

长信增利动态策略混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

2015年12月31日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2016年3月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信增利动态混合	
场内简称	长信增利	
基金主代码	519993	
交易代码	前端：519993	后端：519992
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年11月9日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,239,482,156.83份	
基金合同存续期	不定期	

注：2015年8月7日起本基金更名为长信增利动态策略混合型证券投资基金，关于更名的事宜，我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金对上市公司股票按照价值型与成长型进行风格划分，通过对证券市场未来走势的综合研判灵活配置两类风格的股票，从而在风险适度分散并保持组合流动性的基础上超越比较基准，获得长期增值回报。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的策略结构。基金投资策略体系自上而下分为3个层面：战略配置、风格配置和个股选择。本基金为股票型基金，在整个投资体系中，本基金将重点放在风格配置和个股选择层面，这两个层面对基金收益的贡献程度约占80%，战略配置对基金收益的贡献程度约占20%。在风格配置和个股选择层面，本基金将以风格轮换策略为主，辅以多层次个股选择，形成基金最后的投资组合。在投资过程中，本基金的股票风格管理系统和风险控制绩效量化管理平台将提供量化分析方面的决策支持。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+上证国债指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	罗菲菲
	联系电话	021-61009969	010-58560666
	电子邮箱	zhouyig@cxfund.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4007005566	95568
传真		021-61009800	010-58560798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人 互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心9楼、北京市西城区复兴门内大街2号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	1,425,549,515.21	242,336,140.64	211,780,268.07
本期利润	1,408,782,894.71	337,648,554.23	394,459,596.57
加权平均基金份额本期利润	0.9878	0.1293	0.1175
本期基金份额净值增长率	86.30%	19.00%	18.26%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.5579	-0.3898	-0.4894
期末基金资产净值	1,964,973,388.37	1,969,218,597.76	2,038,005,924.39
期末基金份额净值	1.5853	0.8556	0.7190

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	35.03%	1.91%	12.11%	1.17%	22.92%	0.74%
过去六个月	11.89%	3.20%	-10.21%	1.87%	22.10%	1.33%
过去一年	86.30%	2.89%	7.44%	1.74%	78.86%	1.15%
过去三年	162.17%	2.01%	40.14%	1.25%	122.03%	0.76%
过去五年	90.92%	1.75%	24.27%	1.12%	66.65%	0.63%
自基金合同生效日起至今（2006年	282.37%	1.78%	128.89%	1.37%	153.48%	0.41%

11月9日-2015年 12月31日)						
------------------------	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2006年11月9日至2015年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同中的约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	0.100	6,551,943.52	5,826,807.92	12,378,751.44	

长信增利动态策略混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

2014年	—	—	—	—	
2013年	—	—	—	—	
合计	0.100	6,551,943.52	5,826,807.92	12,378,751.44	

注：本基金本报告期内进行的利润分配情况，详见4.8。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本1.5亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49%、上海海欣集团股份有限公司占34.33%、武汉钢铁股份有限公司占16.67%。

截至2015年12月31日，本基金管理人共管理30只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选混合、长信金利趋势混合、长信增利动态策略混合、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势混合、长信量化先锋混合、长信标普100等权重指数（QDII）、长信利鑫分级债、长信内需成长混合、长信可转债债券、长信利众分级债、长信纯债一年定开债券、长信纯债壹号债券、长信改革红利混合、长信量化中小盘股票、长信新利混合、长信利富债券、长信利盈混合、长信利广混合、长信多利混合、长信睿进混合、长信量化多策略股票、长信医疗保健混合（LOF）、长信中证一带一路指数、长信富民纯债一年定开债券、长信富海纯债一年定开债券、长信利保债券、长信富安纯债一年定开债券。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶松	本基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2015年3月14日	—	8年	经济学硕士，中南财经政法大学投资学专业研究生毕业，具有基金从业资格。2007年7月加入长信基金管理有限责任公司，历任行业研究员、长信增利动态策略股票型证券投资基金的基金经理助理。现任本基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金的

					基金经理。
胡志宝	基金经 理、公司 投资总监	2010年8月 26日	2015年3月 14日	17年	曾任本基金的基金经理。

注：1、首任基金经理的任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。

2、证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到5：1或以上的，可豁免启动公平交易开关。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现异常交易行为。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年的市场呈现出A股历史上罕见的大波动。上证综指上涨9.41%，中证500上涨43.12%，沪深300上涨5.58%，中小板指上涨53.7%，创业板指数上涨84.41%。期间本基金净值上涨86.30%。

2015年上、下半年市场呈现冰与火的差别。在大幅波动的市场环境中，本基

金始终围绕行业、公司的前景及其质地来选择标的。并且按照我们自己能够理解的估值体系来决定投资买卖时点，全年获得较好的收益。

在经历了2015年四季度的大分化之后，创业板与沪深300的估值比又到了历史的极限位置。从经验上看，在这种时点发生估值收敛的概率较大。而从市场内在运行轨迹来看，股灾结束以来市场已经经历基本面驱动、政策驱动、到2015年年底的事件驱动以及情绪驱动，风险偏好逐步抬升到较高的位置，市场有内在调整的压力。因此2016年开年以来在汇率、票据检查以及熔断机制等因素的影响下，市场出现了较大的调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.5853元，报告期内基金份额净值增长率为86.30%，成立以来的累计净值为2.8343元，本期业绩比较基准增长率为7.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在目前时点，从2016年全年的角度来看，我们并不悲观。虽然流动性宽松幅度在边际上减弱，但总体上出现2008年和2011年主动收紧的概率很小。从海外来看，我们认为美国这一轮的复苏并不是由新的经济增长引擎带动的新周期的启动，因此其加息的节奏和幅度很大程度要受到全球经济状况的牵制。在全球经济都没有明确增长路径的情况下，其加息的频次和幅度会相当有限。因此，在欧洲没有明显复苏的背景下，我们认为全球的流动性状况仍是宽松的。而中国经济增速虽然整体在下台阶，但其巨大的纵深和内需市场使得我们仍然有不少的高成长行业在不断涌现。政府大力推动改革和鼓励创新也在不断释放着制度红利并为经济增添新的活力。供给侧改革也会对经济结构调整起到巨大的推动作用。在这样一个巨大的转变期，证券市场在整合调整资源配置方面能够起到巨大的作用。因此，如果估值能够回到一个合理的区间，A股市场对我们仍然有较大的吸引力。

未来本基金将更加勤勉地寻找充分受益于大格局变化，具备核心竞争力的优质公司争取为投资人创造最大的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会2008年9月12日发布的【2008】38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，长信基金管理有限责任

公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、交易管理部总监、金融工程部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员1/2以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。报告期内，未签订与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同，结合本报告期基金实际运作情况，基金管理人于2015年5月30日发布《关于长信增利动态策略股票型证券投资基金2015年第一次分红公告》，本次收益分配基准日为2015年5月21日，权益登记日为2015年6月2日，现金红利发放日2015年6月4日，分红总额12,378,751.44元，其中现金分红6,551,943.52元。

本基金收益分配原则如下：

- 1、每一基金份额享有同等分配权；
- 2、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 3、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- 4、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 5、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 6、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年至少分配一次，但若基金合同生效不满3个月不进行收益分配；
- 7、基金每年分红次数最多不超过12次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的80%。若年度分红12次后，基金再次达到分红条件，则可分配收益

滚存到下一年度进行分配。

8、本基金根据基金净值的表现采用程序化的收益分配机制：

(1) 本基金合同生效后进行第一次收益分配的启动条件是基金净值相对于面值累计涨幅超过10%且每份基金份额的可分配收益不低于0.01元。基金管理人将在本基金满足上述条件之日起10个工作日内提出分红方案。

(2) 本基金进行日常收益分配的启动条件是基金净值相对于前次基金分红后净值的累计涨幅超过10%且每份基金份额的可分配收益不低于0.01元，同时距离基金前次分红的时间不少于10个工作日；一旦条件满足，基金管理人将在本基金满足上述条件之日起10个工作日提出分红方案。

9、若基金份额净值相对于面值或者前次基金分红后净值的累积涨幅未超过10%，在满足法律法规的前提下，基金也可以根据市场情况进行收益分配。

10、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对长信增利动态策略混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对基金管理人——长信基金管理有限责任公司在长信增利动态策略混合型证券投资基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金进行利润分配的金额为12,378,751.44元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由长信增利动态策略混合型证券投资基金管理人——长信基金管理有限责任公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本基金2015年度财务报告经毕马威华振会计师事务所审计,注册会计师出具了无保留意见的审计报告(毕马威华振审字第1600138号),投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长信增利动态策略混合型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产：		
银行存款	364,049,426.77	92,957,043.26
结算备付金	5,401,120.41	3,701,727.86
存出保证金	1,053,526.90	1,300,495.10
交易性金融资产	1,643,531,227.78	1,892,409,674.04
其中：股票投资	1,643,531,227.78	1,802,374,674.04
基金投资	—	—
债券投资	—	90,035,000.00
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	5,646,739.37
应收利息	74,314.48	1,951,506.89
应收股利	—	—
应收申购款	267,760.42	65,580.34
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	2,014,377,376.76	1,998,032,766.86
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债：		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	38,666,637.24	16,555,144.53
应付赎回款	3,512,752.40	6,468,688.79
应付管理人报酬	2,102,248.90	2,577,887.52

长信增利动态策略混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

应付托管费	350,374.79	429,647.92
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	4,095,033.30	1,757,921.35
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	676,941.76	1,024,878.99
负债合计	49,403,988.39	28,814,169.10
所有者权益：		
实收基金	1,239,482,156.83	2,301,476,216.78
未分配利润	725,491,231.54	-332,257,619.02
所有者权益合计	1,964,973,388.37	1,969,218,597.76
负债和所有者权益总计	2,014,377,376.76	1,998,032,766.86

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.5853元，基金份额总额1,239,482,156.83份。

7.2 利润表

会计主体：长信增利动态策略混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
一、收入	1,456,417,107.35	382,618,346.47
1. 利息收入	3,423,711.26	2,654,646.62
其中：存款利息收入	1,611,670.05	1,552,049.42
债券利息收入	1,808,421.91	958,953.43
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	3,619.30	143,643.77
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,469,326,626.43	284,628,359.26
其中：股票投资收益	1,464,707,120.17	274,183,209.30
基金投资收益	—	—
债券投资收益	101,480.00	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—

长信增利动态策略混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

股利收益	4,518,026.26	10,445,149.96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-16,766,620.50	95,312,413.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	433,390.16	22,927.00
减：二、费用	47,634,212.64	44,969,792.24
1. 管理人报酬	26,814,957.33	28,969,624.11
2. 托管费	4,469,159.63	4,828,270.67
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	16,009,834.76	10,830,129.59
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	340,260.92	341,767.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,408,782,894.71	337,648,554.23
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,408,782,894.71	337,648,554.23

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信增利动态策略混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,301,476,216.78	-332,257,619.02	1,969,218,597.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	1,408,782,894.71	1,408,782,894.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,061,994,059.95	-338,655,292.71	-1,400,649,352.66
其中：1. 基金申购款	726,727,422.02	341,460,887.94	1,068,188,309.96
2. 基金赎回款	-1,788,721,481.97	-680,116,180.65	-2,468,837,662.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	-12,378,751.44	-12,378,751.44

长信增利动态策略混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

五、期末所有者权益（基金净值）	1,239,482,156.83	725,491,231.54	1,964,973,388.37
项 目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,834,608,926.06	-796,603,001.67	2,038,005,924.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	337,648,554.23	337,648,554.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-533,132,709.28	126,696,828.42	-406,435,880.86
其中：1. 基金申购款	58,660,675.28	-9,366,647.44	49,294,027.84
2. 基金赎回款	-591,793,384.56	136,063,475.86	-455,729,908.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	2,301,476,216.78	-332,257,619.02	1,969,218,597.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

叶焯

覃波

孙红辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信增利动态策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于长信增利动态策略股票型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2006]180号)批准,由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信增利动态策略股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2006年11月9日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为580,617,102.63份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国民

生银行股份有限公司(以下简称“中国民生银行”)。

2015年8月7日起本基金更名为长信增利动态策略混合型证券投资基金,关于更名的事宜,我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信增利动态策略混合型证券投资基金基金合同》和《长信增利动态策略混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行并上市的股票(含新股配售与增发)、权证、债券、资产支持证券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中股票包括所有在交易所上市的A股;债券包括国债、金融债、企业债、可转债等;货币市场工具包括各种回购、央行票据、短期融资券、同业存款以及剩余期限在1年以内的短期债券等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资的比例范围为:股票资产60%-95%;债券资产0%-35%;货币市场工具5%-40%(其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%),本基金投资于权证、资产支持证券的比例遵从法律法规及监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为:本基金股票投资部分的业绩比较基准为沪深300指数,债券投资部分为上证国债指数收益率,复合业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 70%+上证国债指数收益率 \times 30%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况、2015年度的经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注7.4.2所列示的其他有关规定的要求。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计发生变更，对本基金本报告期无重大影响，会计政策与上年度会计报表一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据估值处理标准，本基金自2015年3月27日起，对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格进行估值。于2015年3月27日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生过重大会计差错。

7.4.6 税项

根据财税字【1998】55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字【2002】128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券

交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

2) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

4) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。

5) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司	基金管理人
中国民生银行股份有限公司（简称“中国民生银行”）	基金托管人
长江证券股份有限公司（简称“长江证券”）	基金管理人的股东
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券	964,698,566.83	9.65%	2,162,392,764.97	30.98%

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	886,691.86	9.67%	375,589.43	9.17%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	1,968,642.59	30.98%	200,301.72	11.41%

注：股票交易佣金计提标准如下：

深圳证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1%-清算库中买(卖)经手费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上海证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1%-买(卖)经手费-买(卖)证

管费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上述交易佣金比率均在合理商业条款范围内收取,并符合行业标准。

根据《证券交易席位及证券综合服务协议》,本基金的基金管理人在租用长江证券证券交易专用交易单元进行股票和债券交易的同时,还从长江证券获得证券研究综合服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	26,814,957.33	28,969,624.11
其中:支付销售机构的客户维护费	4,750,398.66	5,808,602.58

注:支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,469,159.63	4,828,270.67

注:支付基金托管人中国民生银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本年度与上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12
----	--------------------------	------------------------------

	31日	月31日
期初持有的基金份额	8,004,500.00	8,004,500.00
期间申购/买入总份额	3,453,810.72	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	11,458,310.72	8,004,500.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.92%	0.35%

注：本基金管理人投资本基金适用费率严格遵循本基金基金合同中的有关规定。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本年度末及上年度末均未持有过本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	364,049,426.77	1,513,945.45	92,957,043.26	1,490,862.81

注：本基金通过“中国民生银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2015年12月31日的相关余额为人民币5,401,120.41元(2014年：人民币3,701,727.86元)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与上年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,643,531,227.78	81.59
	其中：股票	1,643,531,227.78	81.59
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	369,450,547.18	18.34
7	其他各项资产	1,395,601.80	0.07
8	合计	2,014,377,376.76	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,019,607,844.35	51.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	157,186,903.35	8.00
E	建筑业	93,479,065.20	4.76
F	批发和零售业	191,679,825.00	9.75
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,257,658.70	3.73
J	金融业	36,099,342.98	1.84

长信增利动态策略混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

K	房地产业	33,009,180.60	1.68
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	8,412,085.20	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	30,799,322.40	1.57
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	1,643,531,227.78	83.64

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过沪港通交易机制投资港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600098	广州发展	8,239,918	104,070,164.34	5.30
2	600477	杭萧钢构	7,599,924	93,479,065.20	4.76
3	600146	商赢环球	2,699,799	88,661,399.16	4.51
4	002640	跨境通	2,500,046	83,251,531.80	4.24
5	000078	海王生物	3,199,895	76,669,484.20	3.90
6	600351	亚宝药业	4,881,866	76,254,746.92	3.88
7	000018	神州长城	1,466,460	72,149,832.00	3.67
8	300285	国瓷材料	1,499,924	68,246,542.00	3.47
9	002773	康弘药业	677,186	55,664,689.20	2.83
10	603001	奥康国际	1,609,989	54,127,830.18	2.75

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600098	广州发展	92,915,528.87	4.72
2	603456	九洲药业	90,003,501.94	4.57
3	600477	杭萧钢构	89,749,940.12	4.56

长信增利动态策略混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

4	600146	商赢环球	80,057,897.95	4.07
5	300224	正海磁材	75,396,229.74	3.83
6	600422	昆药集团	75,391,171.16	3.83
7	601688	华泰证券	72,260,609.00	3.67
8	002773	康弘药业	71,350,138.80	3.62
9	300203	聚光科技	65,052,391.03	3.30
10	600351	亚宝药业	63,686,372.10	3.23
11	000078	海王生物	63,474,517.06	3.22
12	600036	招商银行	62,825,801.00	3.19
13	600566	济川药业	60,775,775.55	3.09
14	600114	东睦股份	58,349,963.75	2.96
15	002398	建研集团	57,845,523.98	2.94
16	300228	富瑞特装	56,276,431.84	2.86
17	600557	康缘药业	55,931,495.66	2.84
18	300285	国瓷材料	55,568,238.62	2.82
19	002101	广东鸿图	54,909,709.19	2.79
20	601998	中信银行	52,696,372.54	2.68
21	600483	福能股份	52,036,392.72	2.64
22	002008	大族激光	51,217,051.30	2.60
23	600315	上海家化	50,036,244.27	2.54
24	300183	东软载波	49,585,272.30	2.52
25	300196	长海股份	48,920,359.18	2.48
26	300050	世纪鼎利	47,435,423.49	2.41
27	002236	大华股份	47,402,892.32	2.41
28	601222	林洋能源	46,411,755.54	2.36
29	600552	方兴科技	46,151,684.86	2.34
30	300159	新研股份	45,825,935.54	2.33
31	600310	桂东电力	45,193,396.47	2.29
32	000538	云南白药	43,699,768.98	2.22
33	002250	联化科技	43,594,112.19	2.21
34	300036	超图软件	43,370,158.36	2.20
35	000018	神州长城	43,134,823.06	2.19
36	000758	中色股份	42,732,217.03	2.17
37	603001	奥康国际	41,968,245.32	2.13
38	300161	华中数控	41,930,866.50	2.13
39	603000	人民网	40,582,899.10	2.06
40	600172	黄河旋风	39,918,898.64	2.03

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002640	跨境通	237,630,395.06	12.07
2	002450	康得新	207,338,134.99	10.53
3	300274	阳光电源	190,922,823.39	9.70
4	300115	长盈精密	177,712,614.72	9.02
5	601688	华泰证券	141,768,514.70	7.20
6	300224	正海磁材	129,559,238.94	6.58
7	601318	中国平安	115,818,215.08	5.88
8	300166	东方国信	99,864,023.97	5.07
9	603456	九洲药业	93,644,713.93	4.76
10	300009	安科生物	91,534,661.58	4.65
11	002470	金正大	90,935,666.17	4.62
12	002664	信质电机	89,762,662.51	4.56
13	002665	首航节能	86,144,056.07	4.37
14	600036	招商银行	84,309,647.18	4.28
15	300271	华宇软件	81,982,676.55	4.16
16	002007	华兰生物	78,363,587.50	3.98
17	002496	辉丰股份	78,262,058.35	3.97
18	300017	网宿科技	75,534,648.87	3.84
19	300182	捷成股份	75,256,483.24	3.82
20	002185	华天科技	72,168,113.28	3.66
21	300036	超图软件	72,043,139.29	3.66
22	002227	奥特迅	69,631,902.59	3.54
23	300203	聚光科技	67,217,876.43	3.41
24	600048	保利地产	67,215,189.44	3.41
25	000407	胜利股份	66,674,732.44	3.39
26	600783	鲁信创投	65,764,873.64	3.34
27	600566	济川药业	64,490,240.83	3.27
28	002658	雪迪龙	62,800,247.15	3.19
29	300228	富瑞特装	60,281,944.46	3.06
30	000728	国元证券	59,985,290.94	3.05
31	600114	东睦股份	59,687,647.46	3.03
32	601988	中国银行	56,775,707.74	2.88
33	600422	昆药集团	55,464,127.81	2.82
34	300378	鼎捷软件	54,842,788.54	2.79
35	000970	中科三环	52,684,805.38	2.68
36	601258	庞大集团	52,308,631.86	2.66

长信增利动态策略混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

37	300196	长海股份	50,440,980.01	2.56
38	002108	沧州明珠	48,190,957.01	2.45
39	603000	人民网	45,274,158.61	2.30
40	601222	林洋能源	44,035,096.44	2.24
41	002773	康弘药业	44,033,926.75	2.24
42	000758	中色股份	43,675,538.00	2.22
43	300207	欣旺达	43,647,494.40	2.22
44	002250	联化科技	43,186,962.83	2.19
45	601166	兴业银行	41,160,369.84	2.09
46	600335	国机汽车	40,152,985.58	2.04
47	600315	上海家化	40,033,152.98	2.03
48	600366	宁波韵升	39,749,044.87	2.02
49	300006	莱美药业	39,735,532.24	2.02
50	600172	黄河旋风	39,633,286.38	2.01
51	600596	新安股份	39,473,883.79	2.00

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,196,684,087.92
卖出股票的收入（成交）总额	5,803,604,513.85

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成本单价乘以成交数量）填制，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券中，商赢环球（600146）的发行主体于2015年7月17日收到中国证监会下发的《行政处罚决定书》（编号：[2015]14号），处罚原因为该公司关联交易未在2012年年报中如实披露，违反了《证券法》第六十三条、第六十六条和第六十八条关于信息披露的规定，构成《证券法》第一百九十三条所述的信息披露违法行为。

对如上股票投资决策程序的说明：研究发展部按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该股票的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该股票投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该股票的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,053,526.90
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	74,314.48
5	应收申购款	267,760.42
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,395,601.80

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有 份额	占总份额 比例
43,306	28,621.49	470,203,117.09	37.94%	769,279,039.74	62.06%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	345,917.91	0.03%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10-50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年11月9日)基金份额总额	580,617,102.63
本报告期期初基金份额总额	2,301,476,216.78
本报告期基金总申购份额	726,727,422.02
减：本报告期基金总赎回份额	1,788,721,481.97
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,239,482,156.83

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开本基金的基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 报告期内本基金管理人的重大人事变动

本报告期内，原董事长田丹先生离职，覃波先生自2015年4月28日起代为履行董事长（法定代表人）职责。因新任董事长（法定代表人）叶焯先生自2015年7月21日起正式任职，覃波先生自该日起不再代为履行董事长（法定代表人）职责，本基金管理人已按相关规定进行备案，并及时办理法定代表人的工商变更登记等相关手续。

自2015年4月29日起，本基金管理人增聘邵彦明先生、李小羽先生为副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在指定信息披露媒体发布相应的《基金行业高级管理人员变更公告》。

11.2.2 报告期内基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所，报告期应支付给毕马威华振会计师事务所审计的报酬为人民币100,000.00元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为9年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	4,205,399,263.47	42.08%	3,855,212.50	42.03%	
国金证券	1	1,101,575,308.77	11.02%	1,002,874.65	10.93%	
长江证券	2	964,698,566.83	9.65%	886,691.86	9.67%	
浙商证券	1	881,377,580.34	8.82%	815,151.35	8.89%	
兴业证券	1	613,685,095.99	6.14%	558,699.44	6.09%	
齐鲁证券	1	567,327,336.52	5.68%	528,349.26	5.76%	
中银国际	1	506,350,943.65	5.07%	466,576.89	5.09%	
国信证券	1	401,146,246.76	4.01%	365,202.85	3.98%	
光大证券	1	317,865,705.26	3.18%	289,384.57	3.15%	
民生证券	1	313,065,972.78	3.13%	291,558.62	3.18%	
国元证券	1	121,759,222.69	1.22%	113,393.79	1.24%	
海通证券	2	—	—	—	—	
中航证券	1	—	—	—	—	
民族证券	1	—	—	—	—	
广发证券	1	—	—	—	—	
国联证券	1	—	—	—	—	
中金公司	2	—	—	—	—	
中山证券	1	—	—	—	—	
长城证券	1	—	—	—	—	
华泰证券	2	—	—	—	—	

注：1、截至2015年本基金新增加华泰证券2个交易单元；退租国泰君安1个交易单元。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字

〈1998〉29号)和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

(1) 选择标准:

- 1) 券商基本面评价(财务状况、经营状况);
- 2) 券商研究机构评价(报告质量、及时性和数量);
- 3) 券商每日信息评价(及时性和有效性);
- 4) 券商协作表现评价。

(2) 选择程序:

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》,然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

长信基金管理有限责任公司

二〇一六年三月二十六日