

长信金利趋势混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本半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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 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.....	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.8 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.....	42
7.9 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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	43

§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 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的情况.....	45
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
10.2 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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§11 备查文件目录	51
11.1 备查文件目录.....	51
11.2 存放地点.....	51
11.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信金利趋势混合型证券投资基金
基金简称	长信金利趋势混合
场内简称	长信金利
基金主代码	519994
前端交易代码	519995
后端交易代码	519994
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月30日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,135,632,651.18份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下精选受益于城市化、工业化和老龄化各个中国趋势点的持续增长的上市公司股票主动投资，谋求基金资产的长期稳定增值。本基金选择投资的上市公司股票包括价值股和成长股，股票选择是基于中国趋势点分析、品质分析和持续增长分析等方面的深入分析论证。
投资策略	本基金采用“自上而下”的主动投资管理策略，在充分研判中国经济增长趋势、中国趋势点和资本市场发展趋势的基础上，深入分析研究受益于中国趋势点的持续增长的上市公司证券，以期在风险可控的前提下实现投资组合的长期增值。
业绩比较基准	上证A股指数×70%+中证综合债指数×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债券基金和货币市场基金，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	上海浦东发展银行股份有限公

		司	司
信息披露负责人	姓名	周永刚	廖原
	联系电话	021-61009999	021-61618888
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	liaoy03@spdb.com.cn
客户服务电话		4007005566	95528
传真		021-61009800	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼	上海市中山东一路12号
办公地址		上海市浦东新区银城中路68号9楼	上海市中山东一路12号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		叶焯	吉晓辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报和上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海银城中路68号时代金融中心9楼、上海市中山东一路12号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	14,949,129.55
本期利润	-298,193,145.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0684
本期加权平均净值利润率	-10.20%
本期基金份额净值增长率	-16.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	374,129,728.28
期末可供分配基金份额利润	0.0905
期末基金资产净值	2,188,090,615.30
期末基金份额净值	0.5291
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	184.32%

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

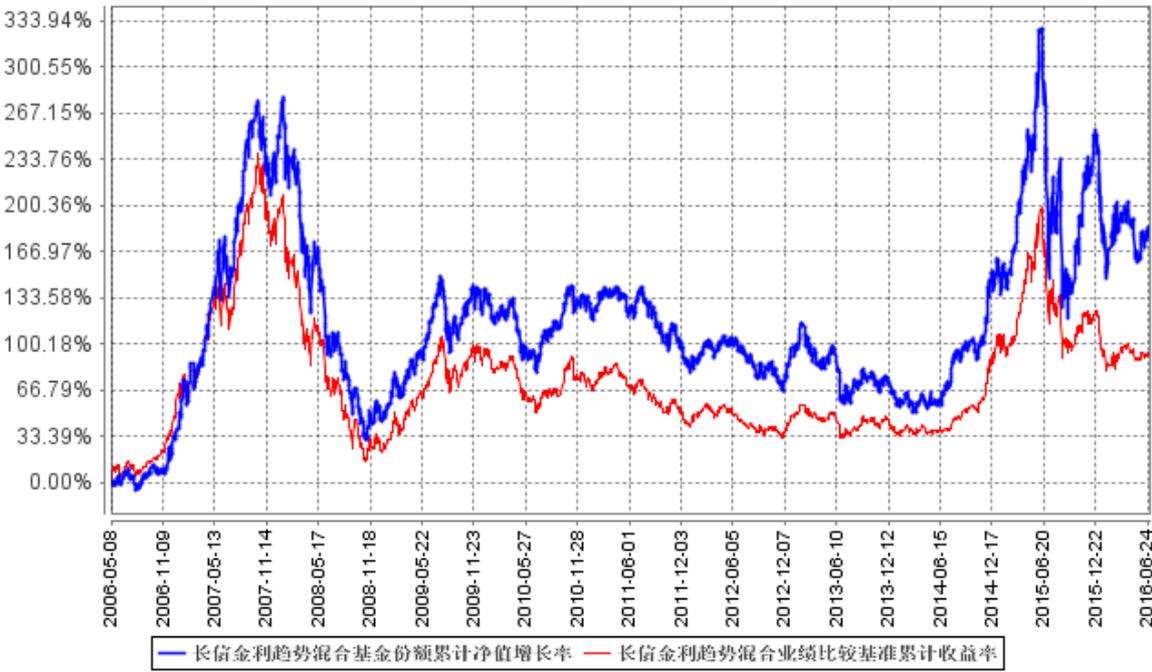
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	4.32%	1.25%	0.53%	0.71%	3.79%	0.54%
过去三个月	-3.69%	1.58%	-1.53%	0.77%	-2.16%	0.81%
过去六个月	-16.10%	2.47%	-11.55%	1.35%	-4.55%	1.12%
过去一年	-17.03%	3.08%	-23.30%	1.70%	6.27%	1.38%
过去三年	75.64%	2.23%	45.25%	1.39%	30.39%	0.84%
自基金合同	184.32%	1.87%	94.63%	1.48%	89.69%	0.39%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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4月30日至2016年6月30日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起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。

§ 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 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 37 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)、长信利鑫债券 (LOF)、长信内需成长混合、长信可转债债券、长信利众债券 (LOF)、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、长信中证能源互联网指数 (LOF)、长信金葵纯债一年定开债券、长信富全纯债一年定开债券、长信利泰混合、长信海外收益一年定开债券 (QDII)、长信先锐债券、长信利发债券。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋小龙	本基金、长信内需成长混合基金和长信银利精选混合基金的基金经理、公司副总	2013 年 2 月 5 日	-	17 年	理学硕士，北京大学计算机软件专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾任北京北大青鸟公司项目经理、富国基金管理公司项目经理、行业研究员、基金经理及权益投资部总经理，2012 年 10 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信基金管理有限责任公司副总经理、投

	经理、投资决策委员会主任委员				资决策委员会主任委员、本基金、长信内需成长混合基金和长信银利精选混合基金的基金经理。
--	----------------	--	--	--	--

注：1、报告截止日至报告批准送出日期间，自 2016 年 7 月 15 日起，公司聘任常松先生担任本基金的基金经理。自 2016 年 7 月 23 日起，宋小龙先生不再担任本基金的基金经理。

2、首任基金经理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。

3、基金经理的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合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规、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。

4.3.2 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且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。

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

2016年上半年，A股市场整体呈下跌趋势，上证综指，深圳成指，中小板指数和创业板指数分别下跌16.64%，16.44%，15.51%和16%。

从具体时间阶段看，市场明显分为两段：

2016年1月份，由于对宏观经济情况的担忧和熔断机制推出，市场出现快速下跌，所有板块下跌均超过20%，创业板指下跌超过30%；

2016年2月至6月，随着政府两会为经济定调，后续经济情况出现好转，市场随之恢复性反弹。前期下跌幅度较大的板块出现了较大幅度的上涨。

从板块上看，食品饮料上半年业绩复苏共上涨5.39%，是唯一获得正收益板块；其余有色金属，银行，煤炭，家电，电子元器件等防御性或供给侧改革受益板块在所有板块中排名中相对收益明显。

从题材看，由于趋势不清晰，投资避险情绪强烈，黄金板块获得明显相对收益。同时确定性最强的新能源汽车产业链获得众投资者追捧，各细分板块均获得较大涨幅，部分个股突破历史高点。

本基金在年初判断全年经济情况好于市场预期，二季度有望出现复苏态势。因此在配置上，以与宏观经济密切相关的大宗周期品为主，主要为基本金属，煤炭，钢铁，建筑建材等。其余配置主要是自下而上选择基本面扎实，高成长性的个股。

总体上市场运行情况符合金利预期，上半年除应对分红赎回，未进行较大的调仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为0.5291元，报告期基金份额净值增长率为-16.10%，成立以来的累计份额净值为2.7326元，本期业绩比较基准增长率为-11.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年下半年，总体上我们认为，在经历过轮番多次大幅度下跌后、在国内经济L型一致预期下、在人民币汇率等风险因素都阶段性形成定论情况下，整个市场的不确定性大幅度降低。

根据估值理论，不确定性降低的重要意义在于意味着投资者风险偏好的上升，从而导致估值上升。因此我们认为，在没有新的、且重要的风险因素出现的情况下，第三季度的市场乃至整个下半年市场，总体上将形成慢牛行情，结构上、局部上形成牛市行情。事实上这种特点已经在2016

年3月以来有所反映，回头来看全市场大概20%的股票已经超越一年前4200点之时的股价，最近3个月更是绝大多数股票上涨，形成赚钱效应。

我们将积极布局，通过合理的仓位控制、行业配置以及个股选择，把握未来的投资机会。

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、股票交易部总监、量化投资部总监、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、《长信金利趋势混合型证券投资基金基金合同》，结合本报告期基金实际运作情况，基金管理人于 2016 年 3 月 19 日发布《长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金 2015 年年度分红公告》，对 2015 年的利润进行了分配，收益分配基准日为 2015 年 12 月 31 日，权益登记日为 2016 年 3 月 22 日，现金红利发放日 2016 年 3 月 24 日。分红总额 7,348,076,114.68 元，其中现金分红 6,969,971,888.02 元。

本基金收益分配原则如下：

- 1、基金收益分配比例按有关规定制定；
- 2、本基金每年收益分配次数最多为 6 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 80%；

- 3、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；

- 4、基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 5、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；
- 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、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- 8、每一基金份额享有同等分配权；
- 9、法律法规或监管机关另有规定的，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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对长信金利趋势混合型证券投资基金的托管过程中，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、基金合同、托管协议的规定，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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对长信金利趋势混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了一次利润分配，分配金额为7,348,076,114.68元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由长信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信金利趋势混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	126,940,691.68	58,851,348.81
结算备付金		4,129,772.42	5,654,424.18
存出保证金		3,227,531.64	2,348,611.66
交易性金融资产	6.4.6.2	2,061,878,272.96	2,994,860,163.15
其中：股票投资		1,910,717,272.96	2,864,636,163.15
基金投资		-	-
债券投资		151,161,000.00	130,224,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
应收证券清算款		26,934,760.27	31,939,770.62
应收利息	6.4.6.5	1,965,456.64	2,553,247.97
应收股利		-	-
应收申购款		25,317.22	658,248.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		2,225,101,802.83	3,096,865,814.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		25,352,678.75	27,448,909.68
应付赎回款		2,283,655.20	4,730,105.06
应付管理人报酬		5,395,940.84	3,864,811.54
应付托管费		899,323.48	644,135.27

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	2,768,714.88	3,859,293.32
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	310,874.38	485,865.99
负债合计		37,011,187.53	41,033,120.86
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	1,705,434,499.82	1,118,046,182.52
未分配利润	6.4.6.10	482,656,115.48	1,937,786,511.08
所有者权益合计		2,188,090,615.30	3,055,832,693.60
负债和所有者权益总计		2,225,101,802.83	3,096,865,814.46

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5291 元，基金份额总额 4,135,632,651.18 份。

6.2 利润表

会计主体：长信金利趋势混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-259,954,741.35	2,509,511,534.52
1.利息收入		6,561,055.35	7,870,132.58
其中：存款利息收入	6.4.6.11	4,304,162.47	2,082,980.85
债券利息收入		2,256,892.88	5,786,441.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	710.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		36,904,190.01	2,670,976,547.89
其中：股票投资收益	6.4.6.12	30,285,260.51	2,657,963,457.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	-144,060.00	-354,810.00
资产支持证券投资收益	6.4.6.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.6.15	-	-
衍生工具收益	6.4.6.16	-	-
股利收益	6.4.6.17	6,762,989.50	13,367,900.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	-313,142,275.35	-177,010,187.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.19	9,722,288.64	7,675,041.27

减：二、费用		38,238,404.45	81,986,553.27
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	21,928,326.36	48,849,016.56
2. 托管费	6.4.9.2.2	3,654,721.08	8,141,502.74
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.6.20	12,505,550.15	24,802,318.06
5. 利息支出		-	13,837.65
其中：卖出回购金融资产支出		-	13,837.65
6. 其他费用	6.4.6.21	149,806.86	179,878.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-298,193,145.80	2,427,524,981.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-298,193,145.80	2,427,524,981.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信金利趋势混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30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）	1,118,046,182.52	1,937,786,511.08	3,055,832,693.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-298,193,145.80	-298,193,145.80
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）	587,388,317.30	6,191,138,864.88	6,778,527,182.18
其中：1.基金申购款	6,374,158,373.74	8,183,879,902.83	14,558,038,276.57
2.基金赎回款	-5,786,770,056.44	-1,992,741,037.95	-7,779,511,094.39
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）	-	-7,348,076,114.68	-7,348,076,114.68
五、期末所有者权益（基金净值）	1,705,434,499.82	482,656,115.48	2,188,090,615.30
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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)	2,991,534,775.89	3,074,448,817.11	6,065,983,593.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,427,524,981.25	2,427,524,981.25
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)	-1,512,545,659.46	-2,893,205,195.57	-4,405,750,855.03
其中：1.基金申购款	866,681,836.01	1,086,077,889.23	1,952,759,725.24
2.基金赎回款	-2,379,227,495.47	-3,979,283,084.80	-6,358,510,580.27
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)	1,478,989,116.43	2,608,768,602.79	4,087,757,719.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

覃波

基金管理人负责人

覃波

主管会计工作负责人

孙红辉

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信金利趋势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”)《关于同意长信金利趋势股票型证券投资基金募集申请的批复》(证监基金字【2005】168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《长信金利趋势股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2006年4月30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613,254,516.24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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)。

2015年8月7日起本基金更名为长信金利趋势混合型证券投资基金,本基金业绩比较基准变更为:上证A股指数×70%+中证综合债指数×30%,关于更名及变更业绩比较基准的事宜,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、《长信金利趋势混合型证券投资基金基金合同》和《长信金利趋势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、上市的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资组合的比例范围为：股票资产 60%-95%；债券资产 0%-35%；货币市场工具 5%-15%。

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。

6.4.2 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颁布的《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。

6.4.3 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况、2016 年 1 月-6 月的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期末未发生过重大会计差错。

6.4.5 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[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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	126,940,691.68
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	126,940,691.68

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,808,465,726.56	1,910,717,272.96	102,251,546.40

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	151,499,030.00	151,161,000.00
	合计	151,499,030.00	151,161,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,959,964,756.56	2,061,878,272.96	101,913,516.40

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	47,343.44
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,672.56
应收债券利息	1,915,133.47
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,307.16
合计	1,965,456.64

注：其他为应收保证金的利息。

6.4.6.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,765,449.88
银行间市场应付交易费用	3,265.00
合计	2,768,714.88

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,303.66
预提账户维护费	13,500.00
预提审计费	59,672.34
预提费用信息披露费	229,398.38
合计	310,874.38

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,711,233,502.02	1,118,046,182.52
本期申购	15,456,551,427.57	6,374,158,373.74
本期赎回(以“-”号填列)	-14,032,152,278.41	-5,786,770,056.44
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,135,632,651.18	1,705,434,499.82

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,454,489,188.18	483,297,322.90	1,937,786,511.08
本期利润	14,949,129.55	-313,142,275.35	-298,193,145.80
本期基金份额交易产生的变动数	6,252,767,525.23	-61,628,660.35	6,191,138,864.88
其中：基金申购款	7,478,750,603.78	705,129,299.05	8,183,879,902.83
基金赎回款	-1,225,983,078.55	-766,757,959.40	-1,992,741,037.95
本期已分配利润	-7,348,076,114.68	-	-7,348,076,114.68
本期末	374,129,728.28	108,526,387.20	482,656,115.48

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日

活期存款利息收入	3,655,062.67
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	53,736.46
其他	595,363.34
合计	4,304,162.47

注：“其他”项为存出保证金利息和申购款利息之和。

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	30,285,260.51
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	30,285,260.51

6.4.6.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	4,337,954,983.87
减：卖出股票成本总额	4,307,669,723.36
买卖股票差价收入	30,285,260.51

6.4.6.13 债券投资收益

6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-144,060.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-144,060.00

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	326,500,386.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	322,686,410.00
减：应收利息总额	3,958,036.68
买卖债券差价收入	-144,060.00

6.4.6.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.6.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,762,989.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,762,989.50

6.4.6.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-313,142,275.35
——股票投资	-312,531,635.35
——债券投资	-610,640.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-313,142,275.35

6.4.6.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

基金赎回费收入	9,460,226.24
转换费收入	262,062.40
合计	9,722,288.64

注：本基金赎回费（转换费中赎回费部分）的 25% 归入基金资产。

6.4.6.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	12,502,225.15
银行间市场交易费用	3,325.00
合计	12,505,550.15

6.4.6.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,672.34
信息披露费	109,398.38
帐户维护费	9,000.00
其他费用	1,736.14
合计	149,806.86

注：“其他费用”为划款手续费。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	541,262,371.51	6.76%	2,175,240,442.09	14.61%

6.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30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	504,076.09	6.76%	350,363.96	12.67%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	1,980,331.94	14.61%	1,980,331.94	22.02%

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‰(或0.9‰)-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‰(或0.9‰)-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。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	21,928,326.36	48,849,016.56
其中：支付销售机构的客户维护费	4,111,377.92	11,423,345.46

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%的年费率确认，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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,654,721.08	8,141,502.74

注：支付基金托管人浦发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

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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 2016年1月1日至2016年6月30 日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
期初持有的基金份额	10,879,530.33	—

期间申购/买入总份额	—	6,013,496.39
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	10,879,530.33	6,013,496.39
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.26%	0.17%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

6.4.9.4.2 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它关联方在本期间与上年度可比期间均未投资过本基金。

6.4.9.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	126,940,691.68	3,655,062.67	123,903,723.16	1,967,488.68

注：本基金通过“浦发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2016年6月30日的相关余额为人民币4,129,772.42元(2015年6月30日：人民币7,701,744.21元)。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.9.7 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。

6.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注
1	2016年3月22日	2016年3月22日	4.300	6,969,971,888.02	378,104,226.66	7,348,076,114.68	
合计	-	-	4.300	6,969,971,888.02	378,104,226.66	7,348,076,114.68	

6.4.11 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截止本报告期末，本基金未因认购新发/增发证券而持有流通受限的证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600497	驰宏锌锗	2016年6月13日	重大事项	9.97	2016年7月11日	10.97	16,097,937	167,786,736.86	160,496,431.89	-
600146	商赢环球	2016年6月15日	重大事项	26.46	-	-	5,184,330	143,120,398.49	137,177,371.80	-
000002	万科A	2015年12月21日	重大事项	24.43	2016年7月5日	19.79	126,956	1,734,943.34	3,101,535.08	-
600019	宝钢股份	2016年6月27日	重大事项	4.90	-	-	28,342	166,891.73	138,875.80	-

6.4.11.3 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。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

信用风险

流动性风险

市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可

靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以内部控制委员会为核心的、由内部控制委员会、量化投资部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人浦发银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	79,904,000.00	130,224,000.00
合计	79,904,000.00	130,224,000.00

注：未评级债券为国债、政策金融债及央行票据等免评级债券。

根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。其中，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

级别设置	含义
A-1	还本付息能力最强，安全性最高。
A-2	还本付息能力较强，安全性较高。
A-3	还本付息能力一般，安全性易受不良环境变化的影响。

B	还本付息能力较低，有一定的违约风险。
C	还本付息能力很低，违约风险较高。
D	不能按期还本付息。

6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	71,257,000.00	-
合计	71,257,000.00	-

注：根据中国人民银行 2006 年 3 月 29 日发布的“银发[2006]95 号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及 2006 年 11 月 21 日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用 AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC 和 C 表示，其中，除 AAA 级、CCC 级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

级别设置	含义
AAA	偿还债务的能力极强，基本不受不利经济环境的影响，违约风险极低。
AA	偿还债务的能力很强，受不利经济环境的影响较小，违约风险很低。
A	偿还债务的能力较强，较易受不利经济环境的影响，违约风险较低。
BBB	偿还债务的能力一般，受不利经济环境影响较大，违约风险一般。
BB	偿还债务的能力较弱，受不利经济环境影响很大，有较高违约风险。
B	偿还债务的能力较大地依赖于良好的经济环境，违约风险很高。
CCC	偿还债务的能力极度依赖于良好的经济环境，违约风险极高。
CC	在破产重组时可获得保护较小，基本不能保证偿还债务。
C	不能偿还债务。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.11 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能

及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过专设的量化投资部设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金的基金管理人通过专设的量化投资部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	126,940,691.68	-	-	-	-	126,940,691.68
结算备付金	4,129,772.42	-	-	-	-	4,129,772.42
存出保证金	3,227,531.64	-	-	-	-	3,227,531.64
交易性金融资产	-	79,904,000.00	71,257,000.00	-	1,910,717,272.96	2,061,878,272.96
应收证券清算款	-	-	-	-	26,934,760.27	26,934,760.27

应收利息	-	-	-	-	1,965,456.64	1,965,456.64
应收申购款	-	-	-	-	25,317.22	25,317.22
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	134,297,995.74	79,904,000.00	71,257,000.00	-	-1,939,642,807.09	2,225,101,802.83
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	25,352,678.75	25,352,678.75
应付赎回款	-	-	-	-	2,283,655.20	2,283,655.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	5,395,940.84	5,395,940.84
应付托管费	-	-	-	-	899,323.48	899,323.48
应付交易费用	-	-	-	-	2,768,714.88	2,768,714.88
其他负债	-	-	-	-	310,874.38	310,874.38
负债总计	-	-	-	-	37,011,187.53	37,011,187.53
利率敏感度缺口	134,297,995.74	79,904,000.00	71,257,000.00	-	-1,902,631,619.56	2,188,090,615.30
上年度末 2015年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	58,851,348.81	-	-	-	-	58,851,348.81
结算备付金	5,654,424.18	-	-	-	-	5,654,424.18
存出保证金	2,348,611.66	-	-	-	-	2,348,611.66
交易性金融资产	50,060,000.00	80,164,000.00	-	-	-2,864,636,163.15	2,994,860,163.15
应收证券清算款	-	-	-	-	31,939,770.62	31,939,770.62
应收利息	-	-	-	-	2,553,247.97	2,553,247.97
应收申购款	-	-	-	-	658,248.07	658,248.07
资产总计	116,914,384.65	80,164,000.00	-	-	-2,899,787,429.81	3,096,865,814.46
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	27,448,909.68	27,448,909.68
应付赎回款	-	-	-	-	4,730,105.06	4,730,105.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,864,811.54	3,864,811.54
应付托管费	-	-	-	-	644,135.27	644,135.27
应付交易费用	-	-	-	-	3,859,293.32	3,859,293.32
其他负债	-	-	-	-	485,865.99	485,865.99
负债总计	-	-	-	-	41,033,120.86	41,033,120.86
利率敏感度缺口	116,914,384.65	80,164,000.00	-	-	-2,858,754,308.95	3,055,832,693.60

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2016年6月30日）	上年度末 （2015年12月31日）
	市场利率下降27个基点	412,442.05	142,065.29
	市场利率上升27个基点	-412,442.05	-142,065.29

6.4.12.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 87.32%，债券投资比例为基金资产净值的 6.91%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,910,717,272.96	87.32	2,864,636,163.15	93.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	151,161,000.00	6.91	130,224,000.00	4.26
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,061,878,272.96	94.23	2,994,860,163.15	98.00

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95% 的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险 (2015 年 12 月 31 日: 4.37%)		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
		VaR 值为 4.25%	-92,993,851.15

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能

发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生工具及非衍生工具金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2015 年的分析同样基于该假设。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.13.1 公允价值计量

(1) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

资产	本期末			
	2016年6月30日			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
交易性金融资产				
股票投资	1,609,803,058.39	300,914,214.57	-	1,910,717,272.96
债券投资	-	151,161,000.00	-	151,161,000.00
合计	1,609,803,058.39	452,075,214.57	-	2,061,878,272.96

2016年上半年，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

2016年上半年，本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生该变更。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.13.2 其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,910,717,272.96	85.87
	其中：股票	1,910,717,272.96	85.87
2	固定收益投资	151,161,000.00	6.79
	其中：债券	151,161,000.00	6.79
	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	131,070,464.10	5.89
7	其他各项资产	32,153,065.77	1.45
8	合计	2,225,101,802.83	100.00

注：本基金本报告期没有通过沪港通交易机制投资港股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	168,304,130.29	7.69
C	制造业	1,167,018,416.34	53.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,074,818.88	1.15
E	建筑业	137,354,065.49	6.28
F	批发和零售业	5,368,877.91	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	27,670,044.64	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	88,001,603.26	4.02

J	金融业	205,409,925.58	9.39
K	房地产业	20,228,270.24	0.92
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	65,044,681.04	2.97
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	1,242,439.29	0.06
S	综合	-	-
	合计	1,910,717,272.96	87.32

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期没有通过沪港通交易机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000960	锡业股份	16,888,496	195,231,013.76	8.92
2	600497	驰宏锌锗	16,097,937	160,496,431.89	7.33
3	300203	聚光科技	5,526,225	145,892,340.00	6.67
4	600146	商赢环球	5,184,330	137,177,371.80	6.27
5	000060	中金岭南	13,060,454	136,220,535.22	6.23
6	000807	云铝股份	20,770,926	136,049,565.30	6.22
7	000001	平安银行	13,015,399	113,233,971.30	5.18
8	300196	长海股份	2,369,874	92,827,964.58	4.24
9	000065	北方国际	2,706,295	87,494,517.35	4.00
10	300182	捷成股份	5,068,631	86,724,276.41	3.96
11	000888	峨眉山A	5,349,226	64,404,681.04	2.94
12	300054	鼎龙股份	2,382,491	59,609,924.82	2.72
13	000878	云南铜业	5,199,920	52,935,185.60	2.42
14	002038	双鹭药业	1,626,915	49,100,294.70	2.24
15	002047	宝鹰股份	4,673,444	46,734,440.00	2.14
16	300342	天银机电	1,343,251	40,915,425.46	1.87
17	002673	西部证券	1,519,650	39,298,149.00	1.80
18	002625	龙生股份	717,007	31,533,967.86	1.44

19	601601	中国太保	1,071,779	28,980,904.16	1.32
20	600219	南山铝业	3,907,820	28,917,868.00	1.32
21	600009	上海机场	1,013,899	26,412,068.95	1.21
22	000690	宝新能源	3,485,896	23,634,374.88	1.08
23	002428	云南锗业	1,007,738	17,312,938.84	0.79
24	600391	成发科技	364,014	13,996,338.30	0.64
25	000625	长安汽车	968,421	13,238,315.07	0.61
26	600048	保利地产	1,482,359	12,792,758.17	0.58
27	000776	广发证券	599,995	10,055,916.20	0.46
28	601318	中国平安	178,120	5,706,964.80	0.26
29	002114	罗平锌电	164,150	4,474,729.00	0.20
30	002251	步步高	334,698	4,341,033.06	0.20
31	601628	中国人寿	186,051	3,873,581.82	0.18
32	600266	北京城建	266,051	3,322,976.99	0.15
33	600477	杭萧钢构	458,227	3,125,108.14	0.14
34	000002	万科A	126,956	3,101,535.08	0.14
35	600686	金龙汽车	175,933	2,591,493.09	0.12
36	601169	北京银行	196,530	2,038,016.10	0.09
37	600348	阳泉煤业	319,303	2,033,960.11	0.09
38	600489	中金黄金	163,189	1,834,244.36	0.08
39	002220	天宝股份	164,950	1,751,769.00	0.08
40	600030	中信证券	100,000	1,623,000.00	0.07
41	000983	西山煤电	181,214	1,476,894.10	0.07
42	600098	广州发展	184,200	1,440,444.00	0.07
43	300156	神雾环保	69,555	1,431,441.90	0.07
44	300133	华策影视	79,797	1,242,439.29	0.06
45	601857	中国石油	158,705	1,147,437.15	0.05
46	600426	华鲁恒升	130,000	1,145,300.00	0.05
47	600809	山西汾酒	48,645	1,078,946.10	0.05
48	600976	健民集团	38,281	1,027,844.85	0.05
49	000046	泛海控股	100,000	1,011,000.00	0.05
50	600352	浙江龙盛	111,169	958,276.78	0.04
51	600096	云天化	100,000	930,000.00	0.04
52	600259	广晟有色	14,618	837,026.68	0.04
53	600050	中国联通	196,385	748,226.85	0.03
54	600428	中远航运	133,329	747,975.69	0.03
55	000069	华侨城A	100,000	640,000.00	0.03
56	601398	工商银行	135,005	599,422.20	0.03
57	300104	乐视网	10,000	529,100.00	0.02

58	000778	新兴铸管	113,859	528,305.76	0.02
59	600018	上港集团	100,000	510,000.00	0.02
60	600028	中国石化	101,300	478,136.00	0.02
61	600563	法拉电子	10,000	455,200.00	0.02
62	000800	一汽轿车	36,415	396,195.20	0.02
63	600584	长电科技	8,800	178,552.00	0.01
64	600019	宝钢股份	28,342	138,875.80	0.01
65	600261	阳光照明	40	282.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000878	云南铜业	663,164,012.92	21.70
2	002114	罗平锌电	264,326,346.42	8.65
3	000960	锡业股份	238,450,389.47	7.80
4	000060	中金岭南	205,082,262.66	6.71
5	601169	北京银行	193,515,679.50	6.33
6	000807	云铝股份	179,500,622.16	5.87
7	601398	工商银行	173,234,443.13	5.67
8	000778	新兴铸管	162,562,964.64	5.32
9	600497	驰宏锌锗	149,694,997.27	4.90
10	300203	聚光科技	138,999,508.49	4.55
11	300009	安科生物	102,637,755.29	3.36
12	600352	浙江龙盛	99,692,202.36	3.26
13	300156	神雾环保	99,262,279.69	3.25
14	601628	中国人寿	88,603,098.77	2.90
15	300182	捷成股份	86,142,986.27	2.82
16	600477	杭萧钢构	85,497,154.27	2.80
17	600219	南山铝业	80,762,020.01	2.64
18	000065	北方国际	72,003,589.49	2.36
19	002673	西部证券	68,833,329.84	2.25
20	300342	天银机电	68,600,512.51	2.24

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。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000878	云南铜业	716,192,750.95	23.44
2	000807	云铝股份	312,352,830.08	10.22
3	600477	杭萧钢构	292,909,017.55	9.59
4	002114	罗平锌电	288,552,190.07	9.44
5	000960	锡业股份	272,353,336.08	8.91
6	000060	中金岭南	226,219,683.14	7.40
7	601169	北京银行	193,645,665.85	6.34
8	601398	工商银行	172,115,000.00	5.63
9	600497	驰宏锌锗	168,137,518.02	5.50
10	000778	新兴铸管	165,161,834.31	5.40
11	002428	云南锗业	160,588,520.31	5.26
12	603001	奥康国际	137,542,770.15	4.50
13	300203	聚光科技	118,153,796.66	3.87
14	600352	浙江龙盛	116,065,731.88	3.80
15	300009	安科生物	113,537,972.61	3.72
16	300156	神雾环保	110,537,612.99	3.62
17	600432	*ST 吉恩	104,318,159.83	3.41
18	601628	中国人寿	87,794,984.49	2.87
19	002047	宝鹰股份	77,174,535.16	2.53
20	000672	上峰水泥	75,344,884.94	2.47

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。

7.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	3,666,127,634.06
卖出股票收入（成交）总额	4,337,954,983.87

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（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	151,161,000.00	6.91
	其中：政策性金融债	151,161,000.00	6.91
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	151,161,000.00	6.91

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160204	16 国开 04	800,000	79,904,000.00	3.65
2	150201	15 国开 01	500,000	50,805,000.00	2.32
3	150207	15 国开 07	200,000	20,452,000.00	0.93

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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持有股指期货。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

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

7.12.3 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	3,227,531.64
2	应收证券清算款	26,934,760.27
3	应收股利	-
4	应收利息	1,965,456.64
5	应收申购款	25,317.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,153,065.77

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600497	驰宏锌锗	160,496,431.89	7.33	停牌
2	600146	商赢环球	137,177,371.80	6.27	停牌

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
162,942	25,381.01	957,409,119.58	23.15%	3,178,223,531.60	76.85%

8.2 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	2,880,080.13	0.07%

8.3 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的情况

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	≥100
本基金基金经理持有本开放式基金	≥100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年4月30日）基金份额总额	613,254,516.24
本报告期期初基金份额总额	2,711,233,502.02
本报告期基金总申购份额	15,456,551,427.57
减：本报告期基金总赎回份额	14,032,152,278.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	4,135,632,651.18

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

10.2.1 报告期内本基金管理人的重大人事变动

本报告期内，原董事长叶焯先生离职，总经理覃波先生自 2016 年 6 月 3 日起代为履行董事长（法定代表人）职责。

报告截止日至报告批准送出日期间，自 2016 年 7 月 30 日起，宋小龙先生不再担任本基金管理人副总经理。

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》。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2016 年 1 月起，上海浦东发展银行进行组织架构优化调整并变更部门名称，聘任刘长江同志为资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	2	1,342,977,464.72	16.78%	1,250,713.99	16.78%	-
东方证券	2	1,055,513,405.80	13.19%	983,001.93	13.19%	-
国泰君安	1	849,225,042.78	10.61%	790,886.89	10.61%	-
国金证券	1	779,675,887.42	9.74%	726,112.55	9.74%	-
华泰证券	1	696,397,609.68	8.70%	648,555.75	8.70%	-
平安证券	1	684,296,128.08	8.55%	637,286.01	8.55%	-
兴业证券	1	547,658,957.49	6.84%	510,035.04	6.84%	-
长江证券	2	541,262,371.51	6.76%	504,076.09	6.76%	-
国信证券	1	468,548,113.15	5.85%	436,359.22	5.85%	-
中投证券	1	361,145,022.73	4.51%	336,333.03	4.51%	-
东北证券	1	285,326,806.24	3.56%	265,725.89	3.56%	-
申银万国证券	1	224,090,156.36	2.80%	208,695.94	2.80%	-
光大证券	1	167,965,651.97	2.10%	156,426.75	2.10%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中国国际金融	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金减少湘财证券 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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	公司网站	2016年1月4日
2	长信基金管理有限责任公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	公司网站	2016年1月8日
3	长信基金管理有限责任公司关于在直销柜台开展旗下部分基金申购（含定期定额投资申购）、转换费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016年1月13日
4	长信基金管理有限责任公司关于增加平安证券有限责任公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016年1月15日
5	长信金利趋势混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上证报、中证报	2016年1月20日
6	长信基金管理有限责任公司关于增加海银基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016年3月1日
7	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金的分红预告	上证报、中证报、证券时报	2016年3月12日
8	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金 2015 年年度分红公告	上证报、中证报	2016年3月19日
9	长信金利趋势混合型证券投资基金 2015 年年度报告及摘要	上证报、中证报	2016年3月26日
10	长信基金管理有限责任公司关于调整网	上证报、中证报、证券	2016年4月7日

	上直销平台招商银行借记卡费率优惠方案的公告	时报	
11	长信金利趋势混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上证报、中证报	2016 年 4 月 21 日
12	长信基金管理有限责任公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016 年 5 月 11 日
13	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行股份有限公司直销银行申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 5 月 12 日
14	长信金利趋势混合型证券投资基金更新的招募说明书（2016 年【1】号）及摘要	上证报、中证报	2016 年 6 月 13 日
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加定投申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016 年 6 月 16 日
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 6 月 28 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信金利趋势混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信金利趋势混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信金利趋势混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》；
- 7、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程。

11.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

11.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司
2016年8月26日