

# 长信双利优选灵活配置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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
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
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>49</b>
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	49
11.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长信双利优选混合
场内简称	长信双利
基金主代码	519991
前端交易代码	519991
后端交易代码	519990
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月19日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,044,840,494.63份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对股票和债券等金融资产进行积极配置，并精选优质个股和券种，从而在保障基金资产流动性和安全性的前提下，谋求超越比较基准的投资回报，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金为主动式混合型基金，以战略性资产配置(SAA)策略体系为基础决定基金资产在股票类、固定收益类等资产中的配置。将股票价值优选策略模型和修正久期控制策略模型作为个股和债券的选择依据，投资于精选的优质股票和债券，构建动态平衡的投资组合，实现基金资产超越比较基准的稳健增值。
业绩比较基准	中证800指数×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其风险和收益高于债券基金和货币市场基金，属于证券投资基金产品中风险收益程度中等偏高的投资品种。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	林葛
	联系电话	021-61009999	010-66060069
	电子邮箱	zhouyg@xcfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007005566	95599

传真	021-61009800	010-63201816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	上海市浦东新区银城中路68号9楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层
邮政编码	200120	100031
法定代表人	叶焯	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、证券时报
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	上海市浦东新区银城中路68号9楼、北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

## 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	-163,312,429.16
本期利润	-240,482,331.34
加权平均基金份额本期利润	-0.2213
本期加权平均净值利润率	-17.67%
本期基金份额净值增长率	-14.38%
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	268,330,739.67
期末可供分配基金份额利润	0.2568
期末基金资产净值	1,313,171,234.30
期末基金份额净值	1.257
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	114.64%

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、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、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。

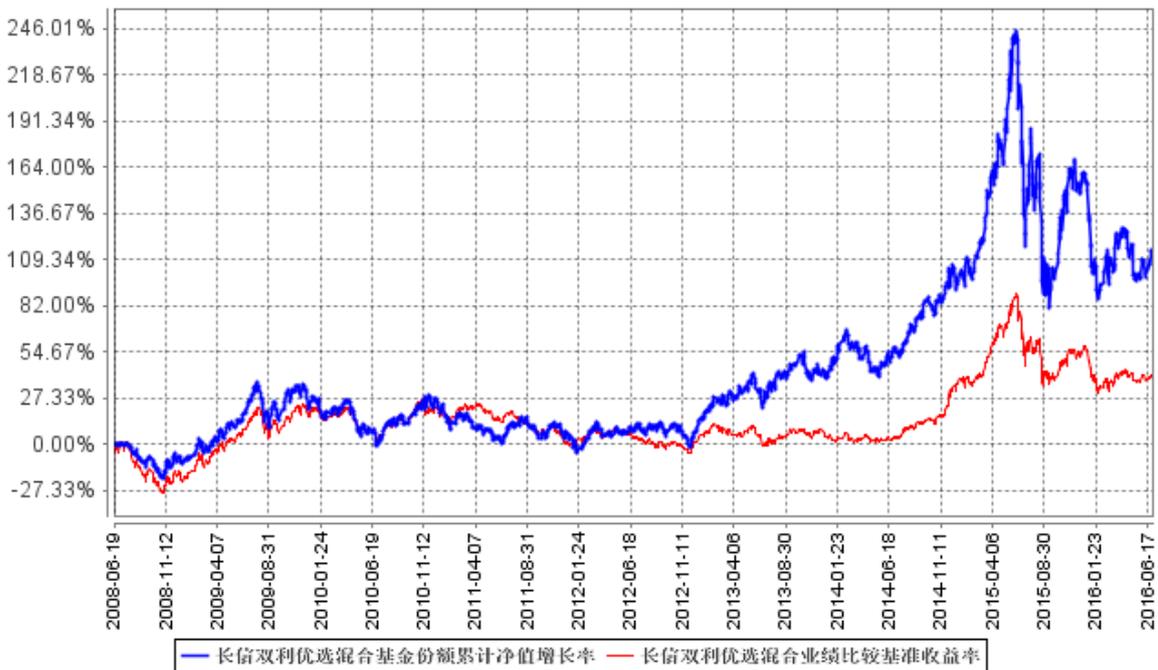
### 3.2 基金净值表现

#### 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	2.86%	1.31%	0.46%	0.68%	2.40%	0.63%
过去三个月	-4.56%	1.54%	-0.57%	0.71%	-3.99%	0.83%
过去六个月	-14.38%	2.28%	-9.12%	1.21%	-5.26%	1.07%
过去一年	-23.22%	2.83%	-16.11%	1.45%	-7.11%	1.38%

过去三年	72.22%	2.02%	41.24%	1.12%	30.98%	0.90%
自基金合同生效起至今	114.64%	1.59%	40.97%	1.10%	73.67%	0.49%

### 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2008年6月19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		
谈洁颖	本基金、长信多利混合基金、长信睿进混合基金的基金经理、公司投资管理部总监、	2012 年 7 月 24 日	-	12 年	管理学学士，中国人民大学工商企业管理专业本科毕业生，具有基金从业资格。曾就职于北京大学，从事教育管理工 作；2004 年 8 月加入长信基金管理有限 责任公司，历任研究助理、基金经 理助理、专户理财投资经理，现 任长信基金管理有限 责任公司投资决 策委员会执行委员、投资

	投资决策委员会执行委员				管理部总监，本基金、长信多利混合基金、长信睿进混合基金的基金经理。
--	-------------	--	--	--	-----------------------------------

注：1、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；

2、本基金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遵规守信情况的说明

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。2015年度本基金持有的可转债因未及时转股被发行人赎回，公司以自有资金弥补其价差，公司高管收到上海证监局出具的警示函，并已及时完成整改工作。2015年度本基金在未征得基金托管人同意的情况下发生了网上申购行为（最终未中签），公司及公司高管收到上海证监局出具的责令整改的决定及警示函，并已及时完成整改工作。

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

上半年市场先是经历了为期一个月的大幅调整，之后，随着信贷和房地产新开工数据的转好，投资者对货币宽松和经济复苏的预期升温，市场开始反弹；然而，5 月份权威人士讲话又打破了 2016 年经济迅速复苏的逻辑，导致市场反弹夭折，上半年的剩余时间上证指数一直在 3000 点附近震荡。上半年市场风格也发生了重大变化：周期股在钢铁、煤炭涨价的带动下较为抗跌，食品饮料在高端白酒涨价预期的带动下成为上半年唯一上涨的板块，而去年涨幅较大的 TMT 则跌幅靠前，这表明去库存和涨价已取代互联网新经济成为 2016 年最重要的投资主线。

从宏观层面来看，二季度中国 GDP 同比增长 6.7%，与一季度基本持平，尚在政府可以接受的范围之内；CPI 同比增速 6 月份已回落到 1.9%，而且由于基数效应，三季度 CPI 低于二季度是大概率事件，所以通胀压力不大；美联储 6 月份议息会议鸽派重占上风，加上英国公投意外支持脱欧，人民币贬值压力短期内有所缓解，基本可以排除中国近期收紧货币政策的可能；总体来说，我们对后市的流动性偏乐观，但认为货币政策放松的空间也不会很大。

### 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 1.257 元，报告期基金份额净值增长率为-14.38%，成立以来的累计净值为 1.893 元，本期业绩比较基准增长率为-9.12%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年市场大概率将维持区间震荡，且有较大可能是先涨后跌。在偏宽松货币政策的支持下，我们认为三季度市场将大概率延续 6 月底以来的反弹行情，并在 7、8 月份形成一波上攻；不过目前部分投资者对 9 月份杭州 G20 会议期待过高，而实际上全球经济已经深陷泥潭多年，很难靠一两次会议就振奋起来，并且中国 5 月的基建、制造业、地产投资均全面下滑，保增长压力山大，不排除下半年 GDP 增速会迫近 6.5%，所以 9 月份以后需要警惕经济数据证伪，大盘回落的风险。在行业选择方面，我们认为中期经济难有起色，下半年周期股再有超额收益的概率较小，因此我们将重点关注景气向上行业，如券商、军工、新能源汽车、钢铁等。另外，随着市场风险偏好的提升，下半年市场风格很可能又从周期股切回成长股，我们看好人工智能、现代服务、智能驾驶等领域未来的投资机会；但由于并购借壳监管趋严，主要依赖外延的小盘股明年业绩增速必然放慢，估值中枢也有继续下移的风险，所以下半年需要选择业绩确认性强的真正成长股，规

避有监管层核准风险和偏主题投资的公司。

#### 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、《长信双利优选灵活配置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 1 月 16 日发布《长信基金管理有限责任公司关于长信双利优选灵活配置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 1 月 22 日，现金红利发放日 2016 年 1 月 26 日。分红总额 222,138,909.13 元，其中现金分红 210,744,804.51 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在财务日不能低于面值；
- 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；若投资人不选择，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 1 次，但若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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 30%。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、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

在托管长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》的约定，对长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金管理人——长信基金管理有限责任公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司在长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：长信双利优选灵活配置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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	127,502,388.36	106,445,240.84
结算备付金		353,881.86	8,797,110.70
存出保证金		1,006,929.70	3,044,791.60
交易性金融资产	6.4.6.2	1,187,140,035.99	1,525,695,319.97
其中：股票投资		978,495,967.39	1,245,770,319.97
基金投资		-	-
债券投资		208,644,068.60	279,925,000.00
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		871,090.60	-
应收利息	6.4.6.5	244,248.32	2,213,172.65
应收股利		-	-
应收申购款		37,964.49	86,266.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		1,317,156,539.32	1,646,281,902.19
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		696,992.09	463,052.68
应付管理人报酬		1,624,756.84	2,120,163.59
应付托管费		270,792.79	353,360.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	1,093,532.39	2,795,278.13

应交税费		43,980.00	43,980.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	255,250.91	396,237.61
负债合计		3,985,305.02	6,172,072.65
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.9	1,044,840,494.63	934,755,208.85
未分配利润	6.4.6.10	268,330,739.67	705,354,620.69
所有者权益合计		1,313,171,234.30	1,640,109,829.54
负债和所有者权益总计		1,317,156,539.32	1,646,281,902.19

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.257 元，基金份额总额 1,044,840,494.63 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信双利优选灵活配置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	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-223,960,561.66	818,465,095.79
1.利息收入		895,408.84	3,038,402.11
其中：存款利息收入	6.4.6.11	501,547.39	768,115.36
债券利息收入		393,861.45	2,259,039.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	11,246.85
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-148,104,885.59	968,292,162.53
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-148,689,393.13	942,729,445.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	-7,012,321.43	20,771,128.90
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.14	-	-
股利收益	6.4.6.15	7,596,828.97	4,791,588.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	-77,169,902.18	-156,556,740.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	418,817.27	3,691,271.67

减：二、费用		16,521,769.68	35,392,161.99
1. 管理人报酬		10,092,631.55	17,078,240.96
2. 托管费		1,682,105.26	2,846,373.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.6.18	4,553,739.66	15,300,187.41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.6.19	193,293.21	167,360.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-240,482,331.34	783,072,933.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-240,482,331.34	783,072,933.80

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信双利优选灵活配置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）	934,755,208.85	705,354,620.69	1,640,109,829.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-240,482,331.34	-240,482,331.34
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）	110,085,285.78	25,597,359.45	135,682,645.23
其中：1.基金申购款	494,961,238.53	162,767,136.25	657,728,374.78
2.基金赎回款	-384,875,952.75	-137,169,776.80	-522,045,729.55
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）	-	-222,138,909.13	-222,138,909.13
五、期末所有者权益（基金净值）	1,044,840,494.63	268,330,739.67	1,313,171,234.30
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)	1,116,797,502.71	500,171,546.36	1,616,969,049.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	783,072,933.80	783,072,933.80
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)	-1,776,033.21	-115,048,445.96	-116,824,479.17
其中：1.基金申购款	1,619,207,174.73	1,320,609,691.55	2,939,816,866.28
2.基金赎回款	-1,620,983,207.94	-1,435,658,137.51	-3,056,641,345.45
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)	-	-101,450,572.24	-101,450,572.24
五、期末所有者权益(基金净值)	1,115,021,469.50	1,066,745,461.96	2,181,766,931.46

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

长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金(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”)《关于核准长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]357号文)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《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2008年6月19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511,032,952.17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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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，包括国内依法发行的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合资产类别配置的基本范围为：股票类资产的投资比例为基金资产的 30%-80%；固定收益类资产的投资比例为基金资产的 15%-65%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；投资于权证、资产支持证券的比例遵从法律法规及中国证监会的规定。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数×60%+上证国债指数×40%。

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**

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)的要求编制，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。

#### **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 1 日至 2016 年 6 月 30 日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**

本基金在本报告期未发生过重大会计差错。

#### **6.4.5 税项**

##### **6.4.5.1 主要税项说明**

根据财税字[1998]55 号文、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[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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，暂不征收企业所得税。根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税【2012】85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减 25% 计入应纳税所得额。

（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。

#### 6.4.5.2 应缴税费

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
应交债券利息收入所得税	43,980.00	43,980.00

注：该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时代扣代缴的利息税部分。

#### 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	127,502,388.36
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计:	127,502,388.36
-----	----------------

#### 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	1,167,698,421.28	978,495,967.39	-189,202,453.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	266,478,986.19	208,644,068.60
	银行间市场	-	-
	合计	266,478,986.19	208,644,068.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,434,177,407.47	1,187,140,035.99	-247,037,371.48

#### 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	17,522.97
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	159.30
应收债券利息	226,112.87
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	453.18
合计	244,248.32

注: 其他为应收结算保证金利息 453.10 元, 应收申购款利息 0.08 元。

#### 6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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	1,093,532.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,093,532.39

#### 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	2,043.21
预提信息披露费-上证报	59,672.34
预提信息披露费-证券时报	149,726.04
预提帐户维护费	9,000.00
预提审计费	34,809.32
合计	255,250.91

#### 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	934,755,208.85	934,755,208.85
本期申购	494,961,238.53	494,961,238.53
本期赎回(以“-”号填列)	-384,875,952.75	-384,875,952.75
本期末	1,044,840,494.63	1,044,840,494.63

注：申购含红利再投、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	789,190,669.71	-83,836,049.02	705,354,620.69
本期利润	-163,312,429.16	-77,169,902.18	-240,482,331.34
本期基金份额交易产生的变动数	68,290,277.23	-42,692,917.78	25,597,359.45
其中：基金申购款	292,008,960.78	-129,241,824.53	162,767,136.25
基金赎回款	-223,718,683.55	86,548,906.75	-137,169,776.80
本期已分配利润	-222,138,909.13	-	-222,138,909.13
本期末	472,029,608.65	-203,698,868.98	268,330,739.67

#### 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	449,746.80
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	23,153.55
其他	28,647.04
合计	501,547.39

注：其他为申购款利息收入 13,208.07 元，结算保证金利息收入 15,438.97 元。

#### 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	-148,689,393.13
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	-148,689,393.13

##### 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	1,592,293,331.06
减：卖出股票成本总额	1,740,982,724.19
买卖股票差价收入	-148,689,393.13

#### 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	-7,012,321.43
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	-7,012,321.43

#### 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	155,700,510.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	160,514,670.63
减：应收利息总额	2,198,161.62
买卖债券差价收入	-7,012,321.43

#### 6.4.6.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.6.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.6.15 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	7,596,828.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,596,828.97

#### 6.4.6.16 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	-77,169,902.18
——股票投资	-46,766,693.78
——债券投资	-30,403,208.40
——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	-77,169,902.18

#### 6.4.6.17 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	222,430.48
转换费收入	196,386.79
合计	418,817.27

注：本基金赎回费（含转换费中赎回费部分）的25%归入基金资产。

#### 6.4.6.18 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	4,553,489.66
银行间市场交易费用	250.00
合计	4,553,739.66

#### 6.4.6.19 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	54,809.32
信息披露费	109,398.38
帐户维护费	22,500.00
其他费用	6,585.51
合计	193,293.21

注：其他费用为银行手续费。

### 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
中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)	基金托管人

## 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

本基金本期间与上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.9.1.2 债券交易

本基金本期间与上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.9.1.3 权证交易

本基金本期间与上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.9.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本期间与上年度可比期间均无应付关联方的佣金。

### 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	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	10,092,631.55	17,078,240.96
其中：支付销售机构的客户维护费	1,136,080.29	2,163,001.49

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。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	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	1,682,105.26	2,846,373.52

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的费率计提，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

本基金本报告期间及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
基金合同生效日（2008年6月19日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	5,968,220.96	-
期间申购/买入总份额	-	5,968,220.96
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	5,968,220.96	5,968,220.96
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.57%	0.54%

注：本基金管理人投资本基金适用费率严格遵循本基金招募说明书中的有关规定。

#### 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他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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日	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
中国农业银行股份有限公司	127,502,388.36	488,339.32	219,024,634.62	685,120.48

注：本基金通过“中国农业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：353,881.86元。（2015年12月31日：人民币8,797,110.70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一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 1 月 22 日	2016 年 1 月 22 日	2.300	210,744,804.51	11,394,104.62	222,138,909.13	
合计	-	-	2.300	210,744,804.51	11,394,104.62	222,138,909.13	

#### 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

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流通受限	12.98	12.98	10,848	140,807.04	140,807.04	-
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 20 日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

##### 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
601611	中国核建	2016 年 6 月 30 日	临时停牌	20.92	-	-	37,059	128,594.73	775,274.28	-

### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

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，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行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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，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	-	65,046,500.00
合计	-	65,046,500.00

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等免评级债券。

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	134,553,800	103,872,000.00
AAA 以下	74,090,269.00	111,006,500.00
未评级	-	-
合计	208,644,069.00	214,878,500.00

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与可能遭受的损失。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，其余亦可用于银行间同业市场交易，因此除在附注 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。

本基金管理人量化投资部每日预测本基金的流动性需求，并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。

### 6.4.12.4 市场风险

#### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和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、存出保证金及债券投资等。本基金管理人金融工程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	127,502,388.36	-	-	-	-	127,502,388.36
结算备付金	353,881.86	-	-	-	-	353,881.86
存出保证金	1,006,929.70	-	-	-	-	1,006,929.70
交易性金融资产	69,210,000.00	134,553,800.00	-	-4,880,268.60	978,495,967.39	1,187,140,035.99
应收证券清算款	-	-	-	-	871,090.60	871,090.60
应收利息	-	-	-	-	244,248.32	244,248.32
应收申购款	-	-	-	-	37,964.49	37,964.49
资产总计	198,073,199.92	134,553,800.00	-	-4,880,268.60	979,649,270.80	1,317,156,539.32
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	696,992.09	696,992.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,624,756.84	1,624,756.84
应付托管费	-	-	-	-	270,792.79	270,792.79
应付交易费用	-	-	-	-	1,093,532.39	1,093,532.39
应交税费	-	-	-	-	43,980.00	43,980.00
其他负债	-	-	-	-	255,250.91	255,250.91
负债总计	-	-	-	-	3,985,305.02	3,985,305.02
利率敏感度缺口	198,073,199.92	134,553,800.00	-	-4,880,268.60	975,663,965.78	1,313,171,234.30
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	106,445,240.84	-	-	-	-	106,445,240.84
结算备付金	8,797,110.70	-	-	-	-	8,797,110.70
存出保证金	3,044,791.60	-	-	-	-	3,044,791.60
交易性金融资产	168,918,500.00	111,006,500.00	-	-	-1,245,770,319.97	1,525,695,319.97
应收利息	-	-	-	-	2,213,172.65	2,213,172.65
应收申购款	-	-	-	-	86,266.43	86,266.43
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	287,205,643.14	111,006,500.00	-	-	-1,248,069,759.05	1,646,281,902.19
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	463,052.68	463,052.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,120,163.59	2,120,163.59
应付托管费	-	-	-	-	353,360.64	353,360.64
应付交易费用	-	-	-	-	2,795,278.13	2,795,278.13
应交税费	-	-	-	-	43,980.00	43,980.00
其他负债	-	-	-	-	396,237.61	396,237.61
负债总计	-	-	-	-	6,172,072.65	6,172,072.65
利率敏感度缺口	287,205,643.14	111,006,500.00	-	-	-1,241,897,686.40	1,640,109,829.54

#### 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	0.00	2,928,159.53
市场利率上升27个基点	0.00	-2,928,159.53	

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

本基金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

其他市场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，所面临的最大其他市场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市场价格风险，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74.51%，债券投资比例为基金资产净值的15.89%。于2016年6月30日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

##### 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	978,495,967.39	74.51	1,245,770,319.97	75.96
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	208,644,068.60	15.89	279,925,000.00	17.07
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	1,187,140,035.99	90.40	1,525,695,319.97	93.03
----	------------------	-------	------------------	-------

#### 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 4.52%	-59,355,339.79	-71,672,799.55

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金融工具及非衍生金融工具。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

以公允价值计量的金融工具

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于 2016 年 6 月 30 日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。

三个层级的定义如下:

第一层级: 相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价;

第二层级: 直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值;

第三层级: 以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

单位: 人民币元

资产	本期末 2015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	977,551,346.99	944,620.40	-	978,495,967.39
债券投资	-	208,644,068.60	-	208,644,068.60
合计	977,551,346.99	209,588,689.00	-	1,187,140,035.99

本报告期, 本基金金融工具的第一层级与第二层级之间没有发生重大转换。

本报告期, 本基金金融工具的公允价值的估值技术并未发生改变。

## § 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	978,495,967.39	74.29
	其中：股票	978,495,967.39	74.29
2	固定收益投资	208,644,068.60	15.84
	其中：债券	208,644,068.60	15.84
	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	127,856,270.22	9.71
7	其他各项资产	2,160,233.11	0.16
8	合计	1,317,156,539.32	100.00

注：本基金本报告期末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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	388,565,319.09	29.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	775,274.28	0.06
F	批发和零售业	34,281,225.00	2.61
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	64,319,562.47	4.90
J	金融业	483,265,560.59	36.80
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,268,899.86	0.55
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	978,495,967.39	74.51

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末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	600990	四创电子	1,502,899	130,286,314.31	9.92
2	002625	龙生股份	2,543,533	111,864,581.34	8.52
3	000750	国海证券	9,026,400	66,705,096.00	5.08
4	002544	杰赛科技	2,003,401	64,249,070.07	4.89
5	601198	东兴证券	2,460,153	60,126,139.32	4.58
6	002736	国信证券	2,738,267	47,235,105.75	3.60
7	600369	西南证券	6,056,900	43,973,094.00	3.35
8	601901	方正证券	5,724,700	43,851,202.00	3.34
9	002500	山西证券	2,587,354	42,846,582.24	3.26
10	601377	兴业证券	5,625,652	41,573,568.28	3.17
11	601099	太平洋	6,736,340	41,293,764.20	3.14
12	600109	国金证券	2,700,000	36,396,000.00	2.77
13	600231	凌钢股份	15,313,600	36,293,232.00	2.76
14	000034	神州数码	1,523,610	34,281,225.00	2.61
15	600061	国投安信	1,722,900	30,702,078.00	2.34
16	601555	东吴证券	2,131,562	28,562,930.80	2.18
17	600618	氯碱化工	2,025,474	26,594,473.62	2.03
18	002428	云南锗业	1,249,096	21,459,469.28	1.63
19	600076	康欣新材	1,000,100	15,151,515.00	1.15
20	300160	秀强股份	1,013,300	13,041,171.00	0.99
21	000910	大亚科技	747,520	11,549,184.00	0.88
22	002688	金河生物	999,967	11,249,628.75	0.86
23	600763	通策医疗	233,127	7,268,899.86	0.55
24	300267	尔康制药	492,200	7,048,304.00	0.54

25	600519	贵州茅台	9,979	2,913,069.68	0.22
26	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.06
27	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.02
28	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.02
29	300512	中亚股份	1,873	187,150.16	0.01
30	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
31	601966	玲珑轮胎	10,848	140,807.04	0.01
32	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
33	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
34	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
35	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
36	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
37	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
38	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
39	002805	丰元股份	971	5,631.80	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	000778	新兴铸管	90,335,293.13	5.51
2	601919	中国远洋	79,284,777.50	4.83
3	000960	锡业股份	65,215,921.90	3.98
4	000758	中色股份	63,647,003.62	3.88
5	601668	中国建筑	58,712,910.50	3.58
6	600428	中远航运	51,830,118.90	3.16
7	600231	凌钢股份	47,579,110.66	2.90
8	600990	四创电子	47,547,435.05	2.90
9	300098	高新兴	41,089,139.64	2.51
10	000425	徐工机械	37,368,110.17	2.28
11	002500	山西证券	35,094,179.70	2.14
12	600061	国投安信	34,314,423.00	2.09
13	000157	中联重科	34,159,599.36	2.08
14	600188	兖州煤业	33,991,077.00	2.07
15	000807	云铝股份	32,784,954.42	2.00
16	000933	*ST 神火	30,616,119.36	1.87

17	000034	神州数码	30,581,595.03	1.86
18	601555	东吴证券	28,922,251.22	1.76
19	600618	氯碱化工	28,008,644.80	1.71
20	002407	多氟多	27,302,762.25	1.66

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	000778	新兴铸管	77,882,400.92	4.75
2	600259	广晟有色	76,974,298.44	4.69
3	000960	锡业股份	76,949,528.26	4.69
4	601919	中国远洋	76,428,956.54	4.66
5	000758	中色股份	70,413,428.14	4.29
6	600038	中直股份	65,671,800.48	4.00
7	000690	宝新能源	63,981,149.53	3.90
8	601668	中国建筑	57,861,935.45	3.53
9	600343	航天动力	52,249,528.70	3.19
10	300098	高新兴	43,690,834.74	2.66
11	002026	山东威达	41,650,598.79	2.54
12	000425	徐工机械	39,106,391.51	2.38
13	000933	*ST 神火	38,386,801.72	2.34
14	600428	中远航运	36,361,237.01	2.22
15	000807	云铝股份	36,288,527.71	2.21
16	002407	多氟多	34,840,725.35	2.12
17	002023	海特高新	34,165,716.50	2.08
18	002526	山东矿机	33,030,565.77	2.01
19	600188	兖州煤业	31,000,580.87	1.89
20	000157	中联重科	30,074,352.44	1.83

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，不考虑其它交易费用。

#### 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	1,499,582,560.60
卖出股票收入（成交）总额	1,592,293,331.06

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	208,644,068.60	15.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	208,644,068.60	15.89

## 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	110031	航信转债	1,220,000	134,553,800.00	10.25
2	110030	格力转债	600,000	69,210,000.00	5.27
3	110034	九州转债	39,940	4,880,268.60	0.37

## 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投资股指期货。

## 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，四创电子(600990)的发行主体于 2015 年 12 月 23 日收到上海证券交易所下发的《关于对安徽四创电子股份有限公司及有关责任人予以通报批评的决定》（纪律处分决定书（2015）56 号）。通报批评原因为公司办理股票延期复牌事项不审慎，其停牌期间的信息披露不充分，限制了投资者的正当交易权利，违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称“《股票上市规则》”）第 2.1 条、第 7.5 条、第 12.2 条的规定。公司时任董事会秘书作为公司信息披露事务部门负责人，对公司前述违规行为负有责任，其行为违反了《股票上市规则》第 2.2 条、第 3.1.4 条、第 3.2.2 条的规定及其在《董事（监事、高级管理人员）声明及承诺书》中做出的承诺。

报告期内本基金投资的前十名证券中，国信证券（002736）的发行主体于 2015 年 11 月 26 日收到中国证监会下发的《调查通知书》（稽查总队调查通字[153145]号）。因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，决定对公司立案调查。

报告期内本基金投资的前十名证券中，方正证券（601901）的发行主体于 2015 年 7 月 14 日收到中国证监会《调查通知书》（湘证调查字 0335 号）。因公司涉嫌未披露控股股东与其他股东间关联关系等信息披露违法违规，中国证监会根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，决定对公司立案调查。

报告期内本基金投资的前十名证券中，西南证券（600369）的发行主体于 2016 年 6 月 23 日收到中国证监会下发的《中国证券监督管理委员会调查通知书》（编号：深专调查通字 2016975 号）。因公司涉嫌未按规定履行职责，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）决定对公司立案调查。

报告期内本基金投资的前十名证券中，兴业证券（601377）的发行主体于 2016

年6月12日收到中国证券监督管理委员会调查通知书（沈稽查调查通字16005号），因公司涉嫌未按规定履行法定职责，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立案调查。

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五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	1,006,929.70
2	应收证券清算款	871,090.60
3	应收股利	-
4	应收利息	244,248.32
5	应收申购款	37,964.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,160,233.11

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	134,553,800.00	10.25
2	110030	格力转债	69,210,000.00	5.27

**7.12.5 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。

### 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
22,132	47,209.49	763,180,890.56	73.04%	281,659,604.07	26.96%

### 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	728,051.59	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	50-100
本基金基金经理持有本开放式基金	50-100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年6月19日）基金份额总额	511,032,952.17
本报告期期初基金份额总额	934,755,208.85
本报告期基金总申购份额	494,961,238.53
减：本报告期基金总赎回份额	384,875,952.75
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	1,044,840,494.63

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未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 报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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	
国泰君安	1	610,901,455.73	19.76%	507,845.17	18.91%	-
广发证券	2	493,383,855.40	15.96%	410,151.33	15.28%	-
中国国际金融有限公司	1	439,284,553.33	14.21%	409,108.28	15.24%	-
中信证券	1	372,928,434.26	12.06%	347,308.88	12.94%	-
海通证券	1	358,765,185.17	11.60%	298,241.74	11.11%	-
中山证券	1	253,412,670.38	8.20%	236,003.12	8.79%	-
平安证券	2	243,020,259.04	7.86%	202,021.59	7.52%	-
华泰证券	1	125,440,843.57	4.06%	104,279.20	3.88%	-
国金证券	1	114,024,918.96	3.69%	94,789.48	3.53%	-
招商证券	1	80,713,715.82	2.61%	75,168.09	2.80%	-
北京高华证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中邮-退租	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	25,287,303.51	12.14%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

中国国际金融有限公司	21,476,006.00	10.31%	-	-	-	-
中信证券	13,537,837.02	6.50%	-	-	-	-
海通证券	131,325,448.90	63.06%	-	-	-	-
中山证券	6,807,655.24	3.27%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	3,354,784.80	1.61%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	6,480,000.00	3.11%	-	-	-	-
北京高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中邮-退租	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金新增西南证券 1 个交易单元，新增中山证券 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1月11日
4	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
5	长信基金管理有限责任公司关于长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金2015年年度分红公告	上证报、证券时报	2016年1月16日
6	长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金2015年第4季度报告	上证报、证券时报	2016年1月20日
7	长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金更新的招募说明书（2016年第【1】号）及摘要	上证报、证券时报	2016年2月1日
8	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
9	长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告及摘要	上证报、证券时报	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直销平台招商银行借记卡费率优惠方案的公告	上证报、中证报、证券时报	2016年4月7日
11	长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金2016年第1季度报告	上证报、证券时报	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
15	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、《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信双利优选灵活配置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、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

### 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