

长信双利优选灵活配置混合型证券投资
基金
2016 年年度报告摘要

2016 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2017 年 3 月 23 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 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	483,170,904.26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@cxfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007005566	95599
传真		021-61009800	010-68121816

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 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

§ 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-323,446,827.58	847,714,861.43	120,400,291.69
本期利润	-266,108,761.23	519,313,072.17	277,750,194.28
加权平均基金份额本期利润	-0.2859	0.4486	0.4585
本期基金份额净值增长率	-20.24%	27.12%	36.32%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1708	0.7546	0.2527
期末基金资产净值	565,717,784.75	1,640,109,829.54	1,616,969,049.07
期末基金份额净值	1.171	1.755	1.448

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。

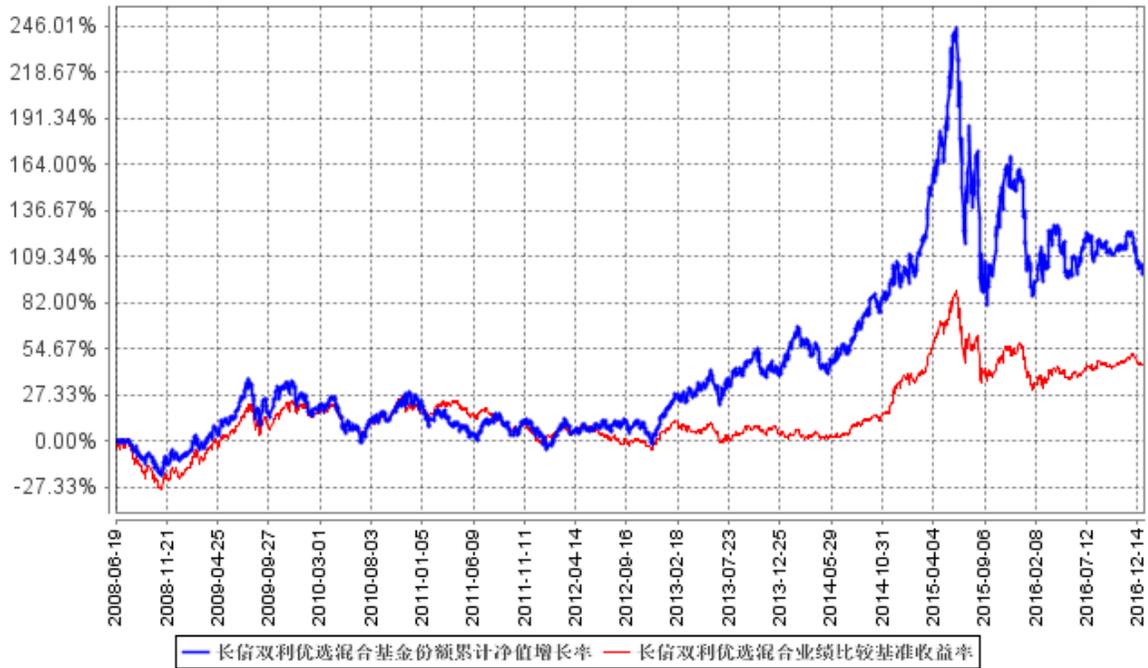
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	-5.34%	0.88%	0.59%	0.43%	-5.93%	0.45%
过去六个月	-6.84%	0.88%	3.10%	0.47%	-9.94%	0.41%
过去一年	-20.24%	1.71%	-6.30%	0.91%	-13.94%	0.80%
过去三年	38.21%	1.99%	37.43%	1.09%	0.78%	0.90%
过去五年	91.18%	1.71%	45.27%	0.99%	45.91%	0.72%
自基金合同生效起至今	99.96%	1.55%	45.34%	1.07%	54.62%	0.48%

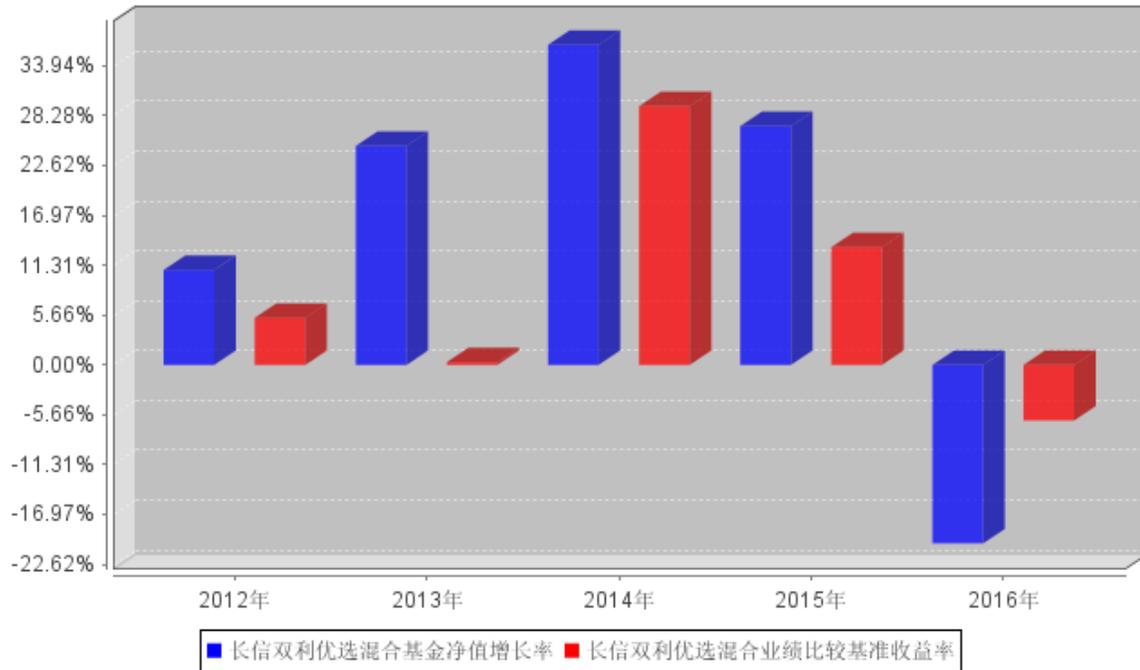
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2008年6月19日至2016年12月31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
2016年	2.300	210,744,804.51	11,394,104.62	222,138,909.13	
2015年	0.760	96,704,110.79	4,746,461.45	101,450,572.24	
2014年	0.300	11,132,366.69	778,909.45	11,911,276.14	
合计	3.360	318,581,281.99	16,919,475.52	335,500,757.51	

注：1、上表所列 2016 年利润分配情况为 2016 年实施的就 2015 年年度利润的分配情况，收益分配基准日为 2015 年 12 月 31 日。

2、上表所列 2015 年利润分配情况为 2015 年实施的就 2014 年年度利润的分配情况，收益分配基准日为 2014 年 12 月 31 日。

3、上表所列 2014 年利润分配情况为 2014 年实施的就 2013 年年度利润的分配情况，收益分配基准日为 2013 年 12 月 31 日。

4、本基金本报告期内进行的利润分配情况，详见 4.7。

§ 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。实收资本1.65亿元人民币，目前股权结构为：长江证券股份有限公司占44.55%、上海海欣集团股份有限公司占31.21%、武汉钢铁股份有限公司占15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）为4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）为4.54%。

截至2016年12月31日，本基金管理人共管理47只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金。

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	长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金和长信睿进灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、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，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、专户理财投资经理和 长信新利灵活配置混合型证券投资 基金的基金经理，现任长信基金 管理有限责任公司投资决策委员 会委员、投资管理部总监，长信 双利优选灵活配置混合型证券投资 基金、长信多利灵活配置混合型 证券投资基金和长信睿进灵活配 置混合型证券投资基金的基金经 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

2016 年年初市场有所回调，上证指数 1 月份回调幅度超过 22%；然后，随着经济数据的好转、货币宽松预期的升温，市场逐步震荡反弹，年底上证指数重新站上 3100 点，全年回调幅度收窄到 12.3%。经过 2015 年波澜壮阔的“新经济”行情后，市场重新归于理性，前期涨幅过大的成长股沦为杀估值的重灾区，传媒、计算机板块 2016 年回调幅度都超过 30%，分别是表现最差和第二差的行业，而食品饮料、家电等防御性行业相对表现较好。本基金策略是在精选个股的同时兼顾阶段性周期行业，在行业选择方面，我们重点关注景气向上行业，比如券商、军工、通信、国企改革、传媒、医疗等；成长股方面，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、IPO 加速将导致小股票的外延增长放慢，所以只选择业绩确定性强的真正成长股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.171 元，份额累计净值为 1.807 元。本基金本期净值增长率为-20.24%，同期业绩比较基准增长率为-6.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年年底以来国内外都出现了流动性收紧的征兆。12 月 15 日美联储的议息会议不但加息 25 个 bp，还预计 2017 年将加息 3 次，中国在 12 月召开的中央经济工作会议也更加求稳，财政政策从 2015 年的“加大力度”变为“更加积极有效”，货币政策从 2015 年的“灵活适度”变为“稳健中性”。我们认为货币中性偏紧已成为当前的政策基调，后期是否会更紧，将取决于通胀和汇率，如果通胀超预期或美联储较快多次加息，不排除中国货币政策进一步收紧甚至开始加息。

2017 年经济改善的程度也不会像 2016 年那么明显。一方面，在政策调控下，预计房地产行业景气度将开始下行，2017 年房地产开发投资增速将从 6.9% 回落到 1% 附近，对经济增长形成较大压力；另一方面，2016 年原材料价格反弹是企业盈利回升最重要的推动因素，而其边际

效应在 2017 年也会明显变弱。

我们认为在货币政策偏紧、经济改善不明显的大背景下，权益市场难有整体性机会，但随着改革和转型的加速，叠加十九大之前可能的政策红利，只要市场风险偏好略有提升，便依然会走出不错的阶段性行情。我们认为新股 IPO 提速对小股票估值的杀伤力巨大，但对主板并不悲观；所以基金将继续重点选择业绩优秀、估值合理的投资标的。在看好的行业和个股选择方面，1) 重点关注仍能保持 25%-30%增速的细分行业，如血制品、二胎相关（如儿童药）、智能物流、军工电子等；2) 要重视油价上涨和化工、油气行业利润率的改善带来的投资机会；3) 去年跌幅最大的传媒、计算机行业中业绩较好的个股会有反弹需求；4) 国企改革的高潮我们认为并未到来，这个预期将会在 2017 年一季度后，或者在第一批示范出现溢出效应后加强。

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》，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，小组成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人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《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

在托管本基金的过程中，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基金合同、托管协议的约定，对本基金管理人——长信基金管理有限责任公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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本基金的投资运作、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本基金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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

本报告期末基金2016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（毕马威华振字第1700219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：长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：		
银行存款	66,280,380.30	106,445,240.84
结算备付金	212,152.90	8,797,110.70
存出保证金	533,419.69	3,044,791.60
交易性金融资产	513,616,508.20	1,525,695,319.97
其中：股票投资	407,186,980.00	1,245,770,319.97
基金投资	-	-
债券投资	106,429,528.20	279,925,000.00
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	2,273,050.76	-
应收利息	129,177.05	2,213,172.65
应收股利	-	-
应收申购款	24,923.35	86,266.43
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	583,069,612.25	1,646,281,902.19
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	14,281,258.06	-
应付赎回款	1,116,852.56	463,052.68
应付管理人报酬	766,435.46	2,120,163.59
应付托管费	127,739.24	353,360.64
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	614,690.84	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	400,871.34	396,237.61
负债合计	17,351,827.50	6,172,072.65
所有者权益：		
实收基金	483,170,904.26	934,755,208.85
未分配利润	82,546,880.49	705,354,620.69
所有者权益合计	565,717,784.75	1,640,109,829.54
负债和所有者权益总计	583,069,612.25	1,646,281,902.19

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.171 元，基金份额总额 483,170,904.26 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-238,361,352.42	579,447,078.98
1. 利息收入	1,602,949.31	5,118,840.40
其中：存款利息收入	786,226.15	1,306,226.97
债券利息收入	816,723.16	3,801,366.58
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）	-298,292,372.31	898,118,929.74
其中：股票投资收益	-275,302,195.33	869,706,216.39
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-31,489,253.24	18,216,374.81
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	8,499,076.26	10,196,338.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	57,338,066.35	-328,401,789.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	990,004.23	4,611,098.10
减：二、费用	27,747,408.81	60,134,006.81
1. 管理人报酬	17,540,926.87	30,156,137.02
2. 托管费	2,923,487.78	5,026,022.94
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6,921,947.25	24,610,828.67

5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	361,046.91	341,018.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-266,108,761.23	519,313,072.17
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-266,108,761.23	519,313,072.17

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	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）	-	-266,108,761.23	-266,108,761.23
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）	-451,584,304.59	-134,560,069.84	-586,144,374.43
其中：1. 基金申购款	507,194,139.11	165,965,601.26	673,159,740.37
2. 基金赎回款	-958,778,443.70	-300,525,671.10	-1,259,304,114.80
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）	483,170,904.26	82,546,880.49	565,717,784.75
项目	上年度可比期间 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）	1,116,797,502.71	500,171,546.36	1,616,969,049.07
二、本期经营活动产生的	-	519,313,072.17	519,313,072.17

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-182,042,293.86	-212,679,425.60	-394,721,719.46
其中：1. 基金申购款	1,929,605,040.40	1,543,778,115.96	3,473,383,156.36
2. 基金赎回款	-2,111,647,334.26	-1,756,457,541.56	-3,868,104,875.82
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）	934,755,208.85	705,354,620.69	1,640,109,829.54

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：

<u>成善栋</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</u>
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)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,存续期限不定期,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(以下简称“中国农业银行”)。

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(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,包括国内依法发行并上市股票、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。

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 2016 年 12 月 31 日的财务状况、2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

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政策、会计估计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

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 主要税项说明

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[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》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015]125号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》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：

(a) 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。

(b) 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。

(c) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2017年7月1日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至2016年12月31日，本基金没有计提有关增值税费用。

(d) 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。

(e) 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。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g) 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。

(h) 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。

7.4.6.2 应交税费

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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未代扣代缴的利息税部分。

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
中国农业银行	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
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

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本报告期及上年度可比期间无应付关联方交易单元——长江证券的佣金。

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	17,540,926.87	30,156,137.02
其中：支付销售机构的客户维护费	2,162,690.32	3,814,872.02

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,923,487.78	5,026,022.94

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

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

单位：人民币元

本期 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场交易 的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	50,687,100.82	-	-	-	-

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 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
	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	5,968,220.96	-
期末持有的基金份额	-	5,968,220.96
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.64%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

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

注：除基金管理人之外的其他关联方在本年末及上年度末均未持有本基金。

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 2016年1月1日至2016年12月31 日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国农业银行股份有限公司	66,280,380.30	723,247.80	106,445,240.84	1,135,556.49

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12月31日的相关余额为人民币212,152.90元。（2015年：人民币8,797,110.70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

注：本基金在本年度及上年度可比期间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

注：上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易的价格为定价基础。

7.4.9 期末（2016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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	2,286	52,943.76	52,943.76	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-

603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月6日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

7.4.9.2 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
000750	国海证券	2016年12月15日	临时停牌	5.64	2017年1月20日	6.27	8,225,700	72,020,038.09	46,392,948.00	-

603986	兆易创新	2016年9月19日	临时停牌	177.97	2017年3月13日	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-
--------	------	------------	------	--------	------------	--------	-------	-----------	------------	---

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因交易所市场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	407,186,980.00	69.84
	其中：股票	407,186,980.00	69.84
2	固定收益投资	106,429,528.20	18.25
	其中：债券	106,429,528.20	18.25
	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	66,492,533.20	11.40
7	其他各项资产	2,960,570.85	0.51
8	合计	583,069,612.25	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 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	150,949,279.93	26.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.01
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	59,992,164.00	10.60
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	241,692.20	0.04
J	金融业	160,001,205.98	28.28
K	房地产业	35,949,128.00	6.35
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	-	-

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	407,186,980.00	71.98

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末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	600990	四创电子	710,733	51,670,289.10	9.13
2	600309	万华化学	2,183,100	47,002,143.00	8.31
3	000750	国海证券	8,225,700	46,392,948.00	8.20
4	601198	东兴证券	2,190,753	43,946,505.18	7.77
5	601933	永辉超市	8,720,400	42,817,164.00	7.57
6	601377	兴业证券	4,973,152	38,044,612.80	6.73
7	000718	苏宁环球	4,165,600	35,949,128.00	6.35
8	601901	方正证券	4,146,100	31,510,360.00	5.57
9	002024	苏宁云商	1,500,000	17,175,000.00	3.04
10	000683	远兴能源	4,558,800	14,496,984.00	2.56

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	000778	新兴铸管	90,335,293.13	5.51
2	601919	中远海控	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	600231	凌钢股份	62,623,808.66	3.82
6	601668	中国建筑	58,712,910.50	3.58
7	002688	金河生物	57,267,389.17	3.49
8	600076	康欣新材	52,735,324.36	3.22
9	600428	中远航运	51,830,118.90	3.16
10	601939	建设银行	48,965,034.21	2.99
11	600990	四创电子	47,547,435.05	2.90
12	600309	万华化学	44,945,263.03	2.74
13	300098	高新兴	41,089,139.64	2.51
14	601933	永辉超市	40,509,164.69	2.47
15	000718	苏宁环球	37,934,930.10	2.31
16	000425	徐工机械	37,368,110.17	2.28
17	002500	山西证券	35,094,179.70	2.14
18	600061	国投安信	34,314,423.00	2.09
19	000034	神州数码	34,285,227.77	2.09
20	000157	中联重科	34,159,599.36	2.08
21	600188	兖州煤业	33,991,077.00	2.07

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	002625	龙生股份	101,351,013.95	6.18
2	000778	新兴铸管	77,882,400.92	4.75
3	600259	广晟有色	76,974,298.44	4.69
4	000960	锡业股份	76,949,528.26	4.69
5	600990	四创电子	76,688,652.70	4.68
6	601099	太平洋	76,555,203.61	4.67
7	601919	中远海控	76,428,956.54	4.66
8	000758	中色股份	70,413,428.14	4.29
9	600038	中直股份	65,671,800.48	4.00

10	000690	宝新能源	63,981,149.53	3.90
11	002688	金河生物	61,955,869.81	3.78
12	002544	杰赛科技	60,686,565.53	3.70
13	601668	中国建筑	57,861,935.45	3.53
14	002736	国信证券	56,483,787.21	3.44
15	600231	凌钢股份	54,980,719.00	3.35
16	600343	航天动力	52,249,528.70	3.19
17	600076	康欣新材	51,997,263.18	3.17
18	601939	建设银行	50,550,052.10	3.08
19	600109	国金证券	48,342,129.69	2.95
20	600369	西南证券	44,394,013.00	2.71
21	000034	神州数码	44,165,832.88	2.69
22	300098	高新兴	43,690,834.74	2.66
23	002026	山东威达	41,650,598.79	2.54
24	002500	山西证券	40,015,165.64	2.44
25	000425	徐工机械	39,106,391.51	2.38
26	000933	*ST 神	38,386,801.72	2.34
27	600428	中远航运	36,361,237.01	2.22
28	000807	云铝股份	36,288,527.71	2.21
29	002407	多氟多	34,840,725.35	2.12
30	002023	海特高新	34,165,716.50	2.08
31	002526	山东矿机	33,030,565.77	2.01

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。

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

买入股票成本（成交）总额	1,977,399,219.46
卖出股票收入（成交）总额	2,603,610,697.41

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。

8.5 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）	106,429,528.20	18.81
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	106,429,528.20	18.81

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

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	509,610	55,333,453.80	9.78
2	110030	格力转债	448,920	51,096,074.40	9.03

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

注：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

注：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

注：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

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：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，兴业证券（601377）的发行主体及欣泰电气保荐代表人兰翔、伍文祥于 2016 年 7 月 8 日收到中国证监会《行政处罚及市场禁入事先告知书》（处罚字（2016）70 号），主要内容如下：公司涉嫌违反证券法律法规案已由中国证监会调查完毕。公司在推荐欣泰电气申请首次公开发行股票并在创业板上市过程中，未遵守业务规则和行业规范，未勤勉尽责地对欣泰电气 IPO 申请文件进行审慎核查，出具的发行保荐书、《兴业证券股份有限公司关于丹东欣泰电气股份有限公司之 2012 年度财务报告专项检查自查工作报告》等文件存在虚假记载；在欣泰电气公开发行股票过程中，公司作为主承销商，未审慎核查公开发行股票文件的真实性和准确性，未发现《招股意向书》和《招股说明书》中涉及欣泰电气应收账款、流动资产和经营活动产生的现金流量净额等项目的财务数据存在虚假记载。

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	533,419.69

2	应收证券清算款	2,273,050.76
3	应收股利	-
4	应收利息	129,177.05
5	应收申购款	24,923.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,960,570.85

8.12.4 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	55,333,453.80	9.78
2	110030	格力转债	51,096,074.40	9.03

8.12.5 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	000750	国海证券	46,392,948.00	8.20	临时停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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
20,631	23,419.66	226,063,092.05	46.79%	257,107,812.21	53.21%

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	719,330.65	0.15%

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

§ 10 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	507,194,139.11
减：本报告期基金总赎回份额	958,778,443.70
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	483,170,904.26

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开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 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。因新任董事长（法定代表人）成善栋先生自 2016 年 11 月 24 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 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。

自 2016 年 12 月 27 日起，本基金管理人增聘程燕春先生为副总经理。

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 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金托管人的专门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

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

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（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 70,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 7 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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	2	834,207,376.66	18.32%	693,473.78	17.73%	-
国泰君安	1	610,901,455.73	13.41%	507,845.17	12.98%	-
西南证券	1	536,044,210.49	11.77%	445,613.59	11.39%	-
广发证券	2	493,383,855.40	10.83%	410,151.33	10.48%	-
中国国际金融有限公司	1	439,284,553.33	9.65%	409,108.28	10.46%	-
中信证券	1	372,928,434.26	8.19%	347,308.88	8.88%	-
中山证券	1	369,809,919.27	8.12%	344,404.22	8.80%	-
海通证券	1	358,765,185.17	7.88%	298,241.74	7.62%	-
国金证券	1	332,490,395.12	7.30%	276,400.48	7.07%	-
华泰证券	1	125,440,843.57	2.75%	104,279.20	2.67%	-
招商证券	1	80,713,715.82	1.77%	75,168.09	1.92%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
北京高华证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 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

平安证券	33,011,625.10	10.46%	-	-	-	-
国泰君安	25,287,303.51	8.01%	-	-	-	-
西南证券	74,288,905.20	23.54%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	21,476,006.00	6.81%	-	-	-	-
中信证券	13,537,837.02	4.29%	-	-	-	-
中山证券	6,807,655.24	2.16%	-	-	-	-
海通证券	131,325,448.90	41.62%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	3,354,784.80	1.06%	-	-	-	-
招商证券	6,480,000.00	2.05%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
北京高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元变化情况如下：

新增中山证券、西南证券、华信证券交易单元各一个，退租华信证券交易单元一个。

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：

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- d、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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

长信基金管理有限责任公司

2017年3月27日