

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

2015年12月31日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016年3月26日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司，根据本基金基金合同的规定，于2016年3月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年7月14日（本基金基金合同生效日）起至2015年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信量化多策略股票
场内简称	量化策略
基金主代码	519965
交易代码	519965
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月14日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	91,232,771.78份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	中证500指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金和债券型基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	95588

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

传真	021-61009800	010-66105798
----	--------------	--------------

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心9楼、北京市西城区复兴门内大街55号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年7月14日（基金合同生效日）-2015年12月31日
本期已实现收益	45,473,837.81
本期利润	58,330,534.91
加权平均基金份额本期利润	0.1616
本期基金份额净值增长率	21.80%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.2182
期末基金资产净值	111,142,362.97
期末基金份额净值	1.218

注：1、本基金基金合同生效日为2015年7月14日，截至本报告期末，本基金运作未满一年。

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

3、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。

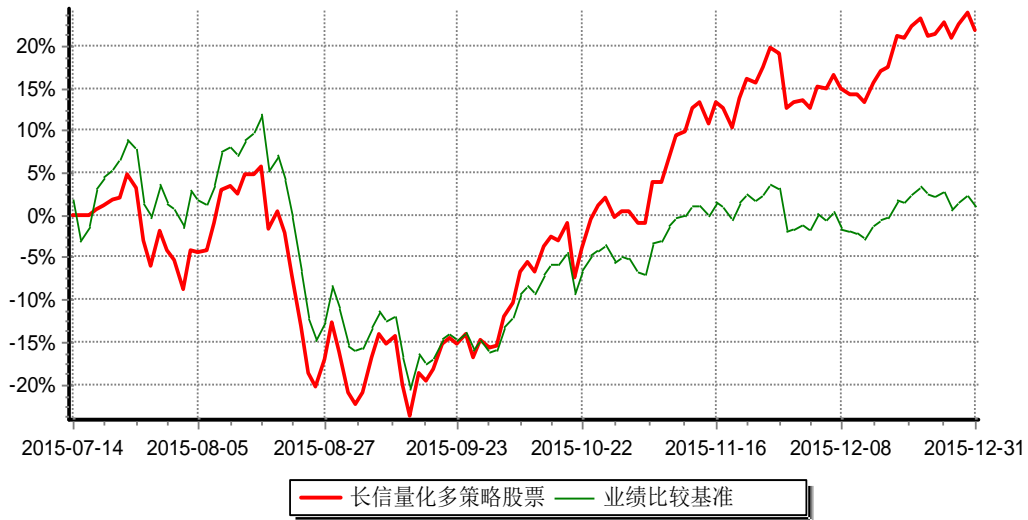
3.2 基金净值表现

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	44.14%	2.09%	19.90%	1.64%	24.24%	0.45%
自基金合同生效日起至 至今（2015年7月14日 -2015年12月31日）	21.80%	2.80%	0.89%	2.41%	20.91%	0.39%

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

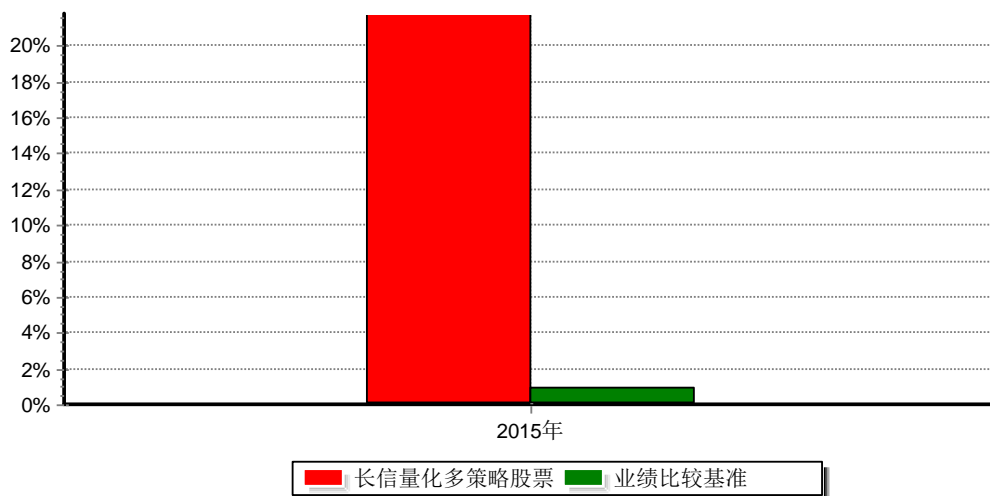


注：1、本基金基金合同生效日为2015年7月14日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2015年7月14日至2015年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例应符合基金合同中的约定：投资于股票的比例不低于基金资产的80%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例为5%-20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注：本基金基金合同生效日为2015年7月14日，2015年净值增长率按当年实际存

续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同生效日为2015年7月14日，本基金基金合同生效日起至本报告期末未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
常松	本基金的基金经理、量化投资部总监	2015年9月25日	—	11年	管理学博士，东南大学管理科学与工程专业博士生毕业，具有基金从业资格。曾任富国基金管理有限公司研究员，北京尊嘉资产管理有限公司投资经理，中原证券股份有限公司投资主办，2015年4月加入长信基金管理有限责任公司，现任量化投资部总监兼本基金的基金经理。

左金保	本基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋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和长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理	2015年7月14日	—	4年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。曾任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员，现任本基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋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和长信中证一带一路主题指数分级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

本基金于2015年三季度（2015年7月14日）成立，恰逢救市高点，上证综指4000点左右。

面对三季度我们认为，市场大幅度调整意味着风险已经大幅度释放，可以逐步建仓，但随后8月18日开始的大幅度下跌说明我们过早乐观。虽然本基金依靠量化选股模型规避了一部分风险，但由于股票仓位较高，最终9月30日净值为0.845元，3季度亏损了15.5%。

面对四季度我们认为，流动性会在实体经济和股票市场寻找洼地，促进股票市场的估值修复。我们预计中小板和创业板将优先于主板开始估值修复。随后市场连续3个月上涨，沪深300指数涨幅为16.49%，中证500指数涨幅为24.40%，创业板指数涨幅为30.32%，中小盘股票涨幅领先整个市场，印证了我们前期对市场的观点和看法。四季度实际运作中，我们始终保持股票仓位相对稳定、行业和个股投资相对分散，风格偏向中小盘成长股票，较好地契合了2015年四季度的结构性行情。四季度基金净值涨幅为44.14%，超越中证500指数接近20%，为投资者创造了较好的相对收益。

从成立到2015年底，作为一个运作尚未满6个月的次新基金，成立以来21.80%的基金涨幅为参与本基金认购的投资者创造了良好的绝对收益。

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1.218元，报告期基金份额净值增长率为21.80%，成立以来的累计净值为1.218元，本期业绩比较基准增长率为0.89%。

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，总体上，我们认为市场将维持区间震荡；结构方面，由于投资者风险偏好的下降，区别于2015年主题投资盛行，预计2016年A股市场投资者将更加关注基本面。我们预计，在整个经济结构转型、经济增长率缓慢爬坡的过程中，中小盘股票的外延扩张将是上市公司中难得的基本面亮点，预计体现在2016年业绩上的成长性会明显优于主板股票，从而能获得更好的投资机会。

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、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

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对长信量化多策略股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，长信量化多策略股票型证券投资基金的管理人——长信基金管理有限责任公司在长信量化多策略股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本托管人依法对长信基金管理有限责任公司编制和披露的长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本报告期（2015年7月14日起至2015年12月31日）本基金财务报告经毕马威华振会计师事务所审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（毕马威华振审字第1600160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：长信量化多策略股票型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日
资 产：	
银行存款	21,858,635.66
结算备付金	212,208.05
存出保证金	337,932.68
交易性金融资产	97,561,795.83
其中：股票投资	97,561,795.83
基金投资	—
债券投资	—
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	—
应收利息	5,367.39
应收股利	—
应收申购款	59,850.29
递延所得税资产	—
其他资产	—
资产总计	120,035,789.90
负债和所有者权益	本期末 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	5,602,154.25
应付赎回款	2,481,688.71
应付管理人报酬	193,085.41

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

应付托管费	32,180.89
应付销售服务费	—
应付交易费用	378,224.87
应交税费	—
应付利息	—
应付利润	—
递延所得税负债	—
其他负债	206,092.80
负债合计	8,893,426.93
所有者权益：	
实收基金	91,232,771.78
未分配利润	19,909,591.19
所有者权益合计	111,142,362.97
负债和所有者权益总计	120,035,789.90

注：1、报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.218元，基金份额总额91,232,771.78份。

2、本基金本报告期为2015年7月14日至2015年12月31日，本基金基金合同于2015年7月14日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：长信量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2015年7月14日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年7月14日（基金合同生效日）至2015年12月 31日
一、收入	63,593,474.15
1. 利息收入	409,871.13
其中：存款利息收入	409,871.13
债券利息收入	—
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	—
其他利息收入	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	48,291,937.49
其中：股票投资收益	48,134,482.94
基金投资收益	—

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

债券投资收益	—
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	157,454.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	12,856,697.10
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,034,968.43
减：二、费用	5,262,939.24
1. 管理人报酬	2,432,207.34
2. 托管费	405,367.86
3. 销售服务费	—
4. 交易费用	2,225,151.04
5. 利息支出	—
其中：卖出回购金融资产支出	—
6. 其他费用	200,213.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	58,330,534.91
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	58,330,534.91

注：本基金本报告期为2015年7月14日至2015年12月31日，本基金基金合同于2015年7月14日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2015年7月14日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015年7月14日（基金合同生效日）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）	648,523,672.21		648,523,672.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	58,330,534.91	58,330,534.91
三、本期基金份额交易产生的	-557,290,900.43	-38,420,943.72	-595,711,844.15

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	17,082,387.57	762,696.63	17,845,084.20
2. 基金赎回款	-574,373,288.00	-39,183,640.35	-613,556,928.35
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）	91,232,771.78	19,909,591.19	111,142,362.97

注：本基金本报告期为2015年7月14日至2015年12月31日，本基金基金合同于2015年7月14日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

叶焯

覃波

孙红辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信量化多策略股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2015年4月28日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予长信量化多策略股票型证券投资基金注册的批复》证监许可[2015]742号）准予注册，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《长信量化多策略股票型证券投资基金证券投资基金合同》发售，基金合同于2015年7月14日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金为股票型基金，本基金采用数量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限

公司(以下简称“中国工商银行”)。

本基金于2015年6月23日至2015年7月9日募集,募集资金总额人民币648,252,913.17元,利息转份额人民币270,759.04元,募集规模为648,523,672.21份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了毕马威华振验字第1500947号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同》和《长信量化多策略股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的比例不低于基金资产的80%-95%;除股票外的其他资产占基金资产的比例为5%-20%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准:中证500指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%

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

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况、2015年7月14日至2015年12月31日的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2015年7月14日（基金合同生效日）至2015年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项和其他金融负债。

本基金目前持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债（包括交易性金融资产或金融负债）

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债属于此类。

-应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

-其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-金融所转移金融资产的账面价值

-结转因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等)，并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；
本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

收入是本基金在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本基金、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

股票投资收益/(损失)、债券投资收益/(损失)和衍生工具收益/(损失)按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较

小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

根据《长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提。

根据《长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利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；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以

经营分部为基础确定报告分部。经营分部，是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（以下简称“《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》”），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

在银行间同业市场交易的债券品种，根据《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

合并财务报表的合并范围以控制为基础予以确定。控制，是指本基金拥有对被投资方的权力，通过参与被投资方的相关活动而享有可变回报，并且有能力运用对被投资方的权力影响其回报金额。在判断本基金是否拥有对被投资方的权力时，本基金仅考虑与被投资方相关的实质性权利(包括本基金自身所享有的及其他方所享有的实质性权利)。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

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

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

7.4.6 税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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，暂减按25%计入应纳税所得额，上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

7.4.7 关联方关系

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

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期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

本基金本报告期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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期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

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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
	2015年7月14日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,432,207.34
其中：支付销售机构的客户维护费	1,786,819.42

注：基金管理费按前一日基金资产净值1.50%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H为每日应计提的基金管理费，E为前一日基金资产净值）。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年7月14日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	405,367.86

注：基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法： $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H为每日应计提的基金托管费，E为前一日基金资产净值）。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

项目	本期
基金合同生效日持有的基金份额	10,001,250.00
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	979,326.42

期间赎回/卖出总份额	
期间由于拆分增加的份额	-
期末持有的基金份额	10,980,576.42
期末持有的基金份额占总份额的比例	12.04%

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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2015年7月14日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	21,858,635.66	398,659.64

注：本基金通过“中国工商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2015年12月31日的相关余额为人民币212,208.05元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
000430	张家界	2015-12-15	重大事项披露	15.56	2016-1-14	14.00	124,802	1,351,360.00	1,941,919.00
000599	青岛双星	2015-12-29	重大事项披露	9.96	2016-1-19	8.96	21,500	183,461.20	214,140.00
000796	凯撒	2015-11	重大事项	29.59	-	-	49,400	1,260,622.00	1,461,746.00

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

	旅游	-9	披露						
000925	众合科技	2015-11-3	重大事项披露	18.48	-	-	45,820	851,707.90	846,753.60
000968	煤气化	2015-12-24	重大事项披露	8.71	-	-	2,050	12,643.86	17,855.50
002020	京新药业	2015-12-29	重大事项披露	33.55	2016-1-20	30.20	15,540	456,753.80	521,367.00
002084	海鸥卫浴	2015-12-18	重大事项披露	13.27	2016-1-15	12.94	184,130	2,058,995.00	2,443,405.00
002228	合兴包装	2015-08-4	重大事项披露	16.88	2016-2-2	15.21	8,000	135,472.00	1,35040.00
002383	合众思壮	2015-12-15	重大事项披露	40.35	-	-	44,365	1,344,196.00	1,790,128.00
002567	唐人神	2015-11-24	重大事项披露	12.84	2016-2-25	11.56	156,935	1,470,965.00	2,015,045.00
300242	明家科技	2015-12-18	重大事项披露	49.96	2016-1-22	44.96	9,495	352,571.80	474,370.20
300247	乐金健康	2015-11-9	重大事项披露	20.75	-	-	2,900	26,244.59	60,175.00
300326	凯利泰	2015-09-24	重大事项披露	27.92	2016-1-22	23.98	116,360	3,364,458.00	3,248,771.00
300336	新文化	2015-12-24	重大事项披露	42.00	-	-	2,911	75,778.52	122,262.00
600122	宏图高科	2015-12-25	重大事项披露	19.42	-	-	2,327	22,744.95	45,190.34
600469	风神股份	2015-12-28	重大事项披露	17.19	-	-	7,600	120,634.10	130,644.00
601137	博威合金	2015-12-21	重大事项披露	24.85	2016-2-29	22.37	26,000	541,476.00	646,100.00
603828	柯利达	2015-11-11	重大事项披露	34.80	2016-3-3	31.32	190	7,065.23	6,612.00
603869	北部湾旅	2015-10-16	重大事项披露	25.76	2016-2-5	28.34	26,050	478,332.70	671,048.00

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	97,561,795.83	81.28
	其中：股票	97,561,795.83	81.28
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	22,070,843.71	18.39
7	其他各项资产	403,150.36	0.34
8	合计	120,035,789.90	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	833,832.10	0.75
B	采矿业	4,835,347.18	4.35
C	制造业	70,215,789.11	63.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,810,651.04	2.53
E	建筑业	778,199.00	0.70
F	批发和零售业	3,697,335.44	3.33
G	交通运输、仓储和邮政业	2,345,172.95	2.11
H	住宿和餐饮业	1,461,746.00	1.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,455,774.96	3.11
J	金融业	68,310.00	0.06

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

K	房地产业	2,428,537.53	2.19
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	4,015,077.52	3.61
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	616,023.00	0.55
S	综合	—	—
	合计	97,561,795.83	87.78

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末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	300326	凯利泰	116,360	3,248,771.20	2.92
2	300119	瑞普生物	139,740	2,808,774.00	2.53
3	000758	中色股份	172,186	2,562,127.68	2.31
4	002084	海鸥卫浴	184,130	2,443,405.10	2.20
5	002567	唐人神	156,935	2,015,045.40	1.81
6	002635	安洁科技	72,180	2,006,604.00	1.81
7	300118	东方日升	134,370	1,957,770.90	1.76
8	000430	张家界	124,802	1,941,919.12	1.75
9	300292	吴通控股	45,120	1,908,576.00	1.72
10	002383	合众思壮	44,365	1,790,127.75	1.61

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000758	中色股份	11,877,577.20	10.69
2	000090	天健集团	11,721,737.15	10.55
3	600325	华发股份	11,707,306.20	10.53

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

4	002261	拓维信息	10,879,898.71	9.79
5	300050	世纪鼎利	10,708,093.00	9.63
6	300210	森远股份	10,699,588.45	9.63
7	002618	丹邦科技	10,604,932.27	9.54
8	300307	慈星股份	10,476,408.41	9.43
9	300327	中颖电子	10,154,447.08	9.14
10	002099	海翔药业	10,084,068.18	9.07
11	002187	广百股份	10,067,659.94	9.06
12	002089	新海宜	10,010,618.29	9.01
13	300231	银信科技	9,945,922.84	8.95
14	300379	东方通	9,847,042.60	8.86
15	300270	中威电子	9,826,502.45	8.84
16	600222	太龙药业	9,719,675.11	8.75
17	000639	西王食品	8,780,178.98	7.90
18	600884	杉杉股份	8,765,190.28	7.89
19	600767	运盛医疗	8,610,826.55	7.75
20	600270	外运发展	8,338,497.90	7.50
21	300258	精锻科技	8,066,739.46	7.26
22	002718	友邦吊顶	8,057,965.74	7.25
23	002623	亚玛顿	7,935,551.09	7.14
24	600298	安琪酵母	7,330,763.00	6.60
25	600199	金种子酒	7,310,289.90	6.58
26	002597	金禾实业	7,261,878.90	6.53
27	600064	南京高科	7,189,438.00	6.47
28	000910	大亚科技	7,152,186.80	6.44
29	000042	中洲控股	7,072,255.69	6.36
30	300320	海达股份	6,984,510.40	6.28
31	601233	桐昆股份	6,950,316.88	6.25
32	000401	冀东水泥	6,874,773.22	6.19
33	000916	华北高速	6,850,269.01	6.16
34	000789	万年青	6,757,100.99	6.08
35	002532	新界泵业	6,514,585.96	5.86
36	600723	首商股份	6,506,312.92	5.85
37	002460	赣锋锂业	6,462,527.84	5.81
38	002601	佰利联	6,271,591.78	5.64
39	002126	银轮股份	6,178,872.39	5.56
40	002245	澳洋顺昌	6,136,401.40	5.52
41	002561	徐家汇	6,013,212.95	5.41
42	600129	太极集团	5,999,729.18	5.40
43	000404	华意压缩	5,851,227.96	5.26

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

44	300179	四方达	5,727,186.98	5.15
45	002042	华孚色纺	5,710,682.88	5.14
46	000811	烟台冰轮	5,697,698.12	5.13
47	300285	国瓷材料	5,529,717.00	4.98
48	002403	爱仕达	5,512,888.00	4.96
49	002580	圣阳股份	5,496,687.00	4.95
50	002282	博深工具	5,398,280.50	4.86
51	002559	亚威股份	5,367,571.90	4.83
52	002380	科远股份	5,238,620.53	4.71
53	002009	天奇股份	5,203,828.04	4.68
54	002394	联发股份	5,202,111.00	4.68
55	002541	鸿路钢构	5,152,840.01	4.64
56	300067	安诺其	5,087,413.19	4.58
57	300225	金力泰	5,069,456.30	4.56
58	300326	凯利泰	4,999,271.00	4.50
59	000685	中山公用	4,944,486.04	4.45
60	002258	利尔化学	4,615,466.70	4.15
61	300261	雅本化学	4,586,227.56	4.13
62	300129	泰胜风能	4,565,791.00	4.11
63	002516	旷达科技	4,366,726.71	3.93
64	300193	佳士科技	4,307,407.40	3.88
65	002098	浔兴股份	4,286,996.06	3.86
66	600313	农发种业	4,216,042.00	3.79
67	300336	新文化	4,213,246.91	3.79
68	300180	华峰超纤	4,174,906.18	3.76
69	300242	明家科技	4,171,376.00	3.75
70	600305	恒顺醋业	4,126,514.20	3.71
71	000703	恒逸石化	4,088,731.60	3.68
72	002279	久其软件	3,981,002.00	3.58
73	002033	丽江旅游	3,974,404.00	3.58
74	002416	爱施德	3,935,170.62	3.54
75	002538	司尔特	3,748,980.00	3.37
76	300227	光韵达	3,725,539.79	3.35
77	002492	恒基达鑫	3,599,935.00	3.24
78	002656	卡奴迪路	3,550,208.20	3.19
79	300119	瑞普生物	3,452,124.24	3.11
80	600706	曲江文旅	3,424,120.00	3.08
81	000903	云内动力	3,408,350.00	3.07
82	300103	达刚路机	3,279,911.47	2.95
83	002332	仙琚制药	3,220,236.26	2.90

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

84	300113	顺网科技	3,111,788.99	2.80
85	002206	海利得	3,090,284.42	2.78
86	300047	天源迪科	2,994,103.00	2.69
87	002128	露天煤业	2,929,481.00	2.64
88	000603	盛达矿业	2,918,485.35	2.63
89	600185	格力地产	2,917,083.80	2.62
90	002182	云海金属	2,825,931.00	2.54
91	600122	宏图高科	2,806,728.72	2.53
92	002449	国星光电	2,805,419.00	2.52
93	600428	中远航运	2,790,978.00	2.51
94	300304	云意电气	2,786,184.60	2.51
95	300415	伊之密	2,756,647.00	2.48
96	002084	海鸥卫浴	2,753,838.00	2.48
97	000700	模塑科技	2,671,357.00	2.40
98	002402	和而泰	2,609,032.00	2.35
99	000524	岭南控股	2,559,162.15	2.30
100	002383	合众思壮	2,551,490.00	2.30
101	000925	众合科技	2,499,366.52	2.25
102	600979	广安爱众	2,429,149.00	2.19
103	002632	道明光学	2,407,299.00	2.17
104	002125	湘潭电化	2,394,218.00	2.15
105	300428	四通新材	2,364,950.00	2.13
106	002322	理工监测	2,240,609.91	2.02
107	600348	阳泉煤业	2,239,548.00	2.02

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300050	世纪鼎利	12,059,258.40	10.85
2	600325	华发股份	12,013,996.79	10.81
3	000090	天健集团	11,551,019.17	10.39
4	300379	东方通	10,335,354.99	9.30
5	000758	中色股份	10,328,155.11	9.29
6	002261	拓维信息	10,111,242.31	9.10
7	002187	广百股份	9,991,303.61	8.99
8	300327	中颖电子	9,961,807.83	8.96
9	300210	森远股份	9,887,751.77	8.90
10	300231	银信科技	9,656,339.21	8.69

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

11	300307	慈星股份	9,600,976.02	8.64
12	600884	杉杉股份	9,341,318.90	8.40
13	600222	太龙药业	9,329,971.25	8.39
14	300270	中威电子	9,213,401.92	8.29
15	002099	海翔药业	9,194,760.57	8.27
16	002460	赣锋锂业	9,156,937.29	8.24
17	000639	西王食品	9,085,077.94	8.17
18	002089	新海宜	9,000,080.39	8.10
19	000401	冀东水泥	8,492,967.72	7.64
20	002623	亚玛顿	8,388,894.74	7.55
21	600270	外运发展	8,348,091.68	7.51
22	600767	运盛医疗	8,337,448.74	7.50
23	002718	友邦吊顶	8,139,339.04	7.32
24	002618	丹邦科技	8,054,960.37	7.25
25	000910	大亚科技	7,479,648.67	6.73
26	300258	精锻科技	7,460,601.04	6.71
27	600199	金种子酒	7,420,427.21	6.68
28	600064	南京高科	7,303,428.49	6.57
29	000789	万年青	7,194,932.13	6.47
30	000042	中洲控股	6,757,896.32	6.08
31	002580	圣阳股份	6,642,261.34	5.98
32	002597	金禾实业	6,512,524.66	5.86
33	600129	太极集团	6,287,667.41	5.66
34	002380	科远股份	6,134,299.09	5.52
35	600723	首商股份	6,104,464.27	5.49
36	600298	安琪酵母	6,100,344.30	5.49
37	002561	徐家汇	6,098,101.99	5.49
38	002279	久其软件	6,071,283.68	5.46
39	002126	银轮股份	6,069,355.70	5.46
40	000811	烟台冰轮	6,052,340.43	5.45
41	002532	新界泵业	6,028,872.53	5.42
42	300285	国瓷材料	5,864,379.44	5.28
43	000404	华意压缩	5,685,401.22	5.12
44	002416	爱施德	5,677,516.82	5.11
45	002245	澳洋顺昌	5,646,410.52	5.08
46	000916	华北高速	5,524,620.95	4.97
47	601233	桐昆股份	5,513,181.12	4.96
48	002282	博深工具	5,492,629.59	4.94
49	000685	中山公用	5,276,523.24	4.75
50	002009	天奇股份	5,189,065.20	4.67

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

51	002403	爱仕达	5,043,533.91	4.54
52	002601	佰利联	4,999,200.01	4.50
53	002541	鸿路钢构	4,996,212.78	4.50
54	300320	海达股份	4,922,674.43	4.43
55	300047	天源迪科	4,822,672.18	4.34
56	002492	恒基达鑫	4,796,370.46	4.32
57	300193	佳士科技	4,721,194.15	4.25
58	002258	利尔化学	4,669,183.31	4.20
59	300179	四方达	4,659,971.92	4.19
60	002516	旷达科技	4,599,760.52	4.14
61	600313	农发种业	4,562,256.94	4.10
62	002559	亚威股份	4,490,047.11	4.04
63	300129	泰胜风能	4,423,575.84	3.98
64	300067	安诺其	4,405,294.15	3.96
65	300261	雅本化学	4,397,074.61	3.96
66	002394	联发股份	4,296,850.78	3.87
67	300227	光韵达	4,276,191.26	3.85
68	002402	和而泰	4,268,313.76	3.84
69	300225	金力泰	4,264,617.00	3.84
70	002042	华孚色纺	4,203,765.90	3.78
71	300113	顺网科技	4,192,931.61	3.77
72	002098	浔兴股份	4,174,646.93	3.76
73	002332	仙琚制药	4,133,497.98	3.72
74	000703	恒逸石化	4,112,968.47	3.70
75	300242	明家科技	4,015,130.11	3.61
76	002487	大金重工	3,960,022.95	3.56
77	300103	达刚路机	3,901,062.85	3.51
78	002656	卡奴迪路	3,891,203.88	3.50
79	002712	思美传媒	3,835,201.21	3.45
80	300180	华峰超纤	3,789,951.06	3.41
81	600706	曲江文旅	3,762,754.67	3.39
82	300336	新文化	3,754,303.25	3.38
83	600122	宏图高科	3,726,761.60	3.35
84	002033	丽江旅游	3,713,083.75	3.34
85	002632	道明光学	3,711,197.05	3.34
86	600185	格力地产	3,554,956.14	3.20
87	000524	岭南控股	3,395,492.97	3.06
88	000903	云内动力	3,395,491.70	3.06
89	002206	海利得	3,388,633.81	3.05
90	000700	模塑科技	3,299,244.60	2.97

长信量化多策略股票型证券投资基金2015年年度报告摘要

91	600305	恒顺醋业	3,210,430.14	2.89
92	002611	东方精工	3,103,067.78	2.79
93	002243	通产丽星	3,098,697.87	2.79
94	300415	伊之密	3,090,232.07	2.78
95	300304	云意电气	3,006,584.96	2.71
96	002182	云海金属	3,003,139.27	2.70
97	002322	理工监测	2,966,492.07	2.67
98	002449	国星光电	2,735,275.75	2.46
99	000603	盛达矿业	2,729,169.68	2.46
100	300119	瑞普生物	2,703,792.87	2.43
101	002128	露天煤业	2,696,656.21	2.43
102	300428	四通新材	2,607,391.95	2.35
103	600428	中远航运	2,603,708.12	2.34
104	002538	司尔特	2,550,150.86	2.29
105	002443	金洲管道	2,461,320.40	2.21
106	601799	星宇股份	2,390,805.55	2.15
107	002446	盛路通信	2,382,099.80	2.14
108	600348	阳泉煤业	2,343,421.47	2.11
109	300084	海默科技	2,283,996.19	2.06
110	002125	湘潭电化	2,256,907.36	2.03

注：本项“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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	792,291,737.21
卖出股票的收入（成交）总额	755,721,121.42

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制期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	337,932.68
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	5,367.39
5	应收申购款	59,850.29
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	403,150.36
---	----	------------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300326	凯利泰	3,248,771.20	2.92	停牌
2	002084	海鸥卫浴	2,443,405.10	2.20	停牌
3	002567	唐人神	2,015,045.40	1.81	停牌
4	000430	张家界	1,941,919.12	1.75	停牌
5	002383	合众思壮	1,790,127.75	1.61	停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,680	54,305.22	10,980,576.42	12.04%	80,252,195.36	87.96%

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	1,514,079.29	1.66%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发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	50-100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年7月14日)基金份额总额	648,523,672.21
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	17,082,387.57
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	574,373,288.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	91,232,771.78

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开本基金的基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 报告期内基金管理人的重大人事变动

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

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

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

11.2.2 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。

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

本报告期本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。报告期应支付给毕马威华振会计师事务所审计的报酬为人民币5万元，该审计机构为本基金提供审计服务的连续年限为1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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	926,944,809.51	59.88%	770,571.64	58.45%	
宏源证券	2	428,878,304.25	27.71%	390,451.28	29.62%	
国信证券	2	192,146,414.87	12.41%	157,233.68	11.93%	
华安证券	1	0	0	0	0	
申银万国	1	0	0	0	0	
西南证券	1	0	0	0	0	

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元安信证券2个席位，宏源证券2个席位，国信证券2个席位，华安证券1个席位，申银万国1个席位，西南证券1个席位，共计9个；除西南证券席位外均为共用公司旗下基金长信纯债一年定开债券租用的交易单元。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字〔1998〕29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字〔2007〕48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

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

（2）选择程序：

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

长信基金管理有限责任公司

二〇一六年三月二十六日