

长信利泰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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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 3 月 23 日（基金合同生效日）起至 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46

§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	53
§11 备查文件目录	55
11.1 备查文件目录.....	55
11.2 存放地点.....	55
11.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信利泰灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长信利泰混合
场内简称	长信利泰
基金主代码	519951
交易代码	519951
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 23 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	490,188,576.78 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、税收、货币、汇率政策等)，并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型，动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征，追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 行业配置策略</p> <p>(2) 个股投资策略</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>(1) 久期策略</p> <p>(2) 收益率曲线策略</p> <p>(3) 骑乘策略</p> <p>(4) 息差策略</p> <p>(5) 个券选择策略</p> <p>(6) 信用策略</p> <p>(7) 中小企业私募债投资策略</p> <p>4、其他类型资产投资策略</p> <p>(1) 权证投资策略</p> <p>(2) 资产支持证券投资策略</p>

	(3) 股指期货投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	罗菲菲
	联系电话	021-61009999	010-58560666
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4007005566	95568
传真		021-61009800	010-58560798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 2 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 2 号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		叶焯	洪崎

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 9 楼、北京市西城区复兴门内大街 2 号

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3月23日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	2,210,707.43
本期利润	2,723,715.95
加权平均基金份额本期利润	0.0066
本期加权平均净值利润率	0.65%
本期基金份额净值增长率	0.80%
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	3,630,670.07
期末可供分配基金份额利润	0.0074
期末基金资产净值	494,336,282.81
期末基金份额净值	1.008
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	0.80%

注：1、本基金基金合同生效日为2016年3月23日，截至本报告期末，本基金运作未满半年。

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、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。

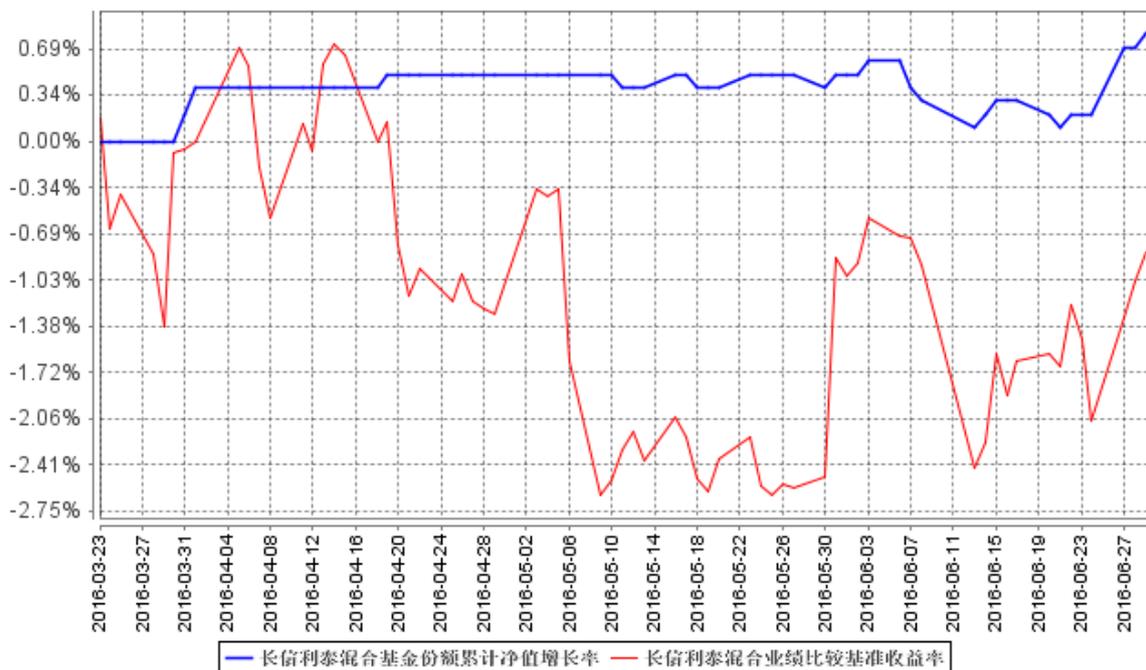
4、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.30%	0.15%	0.09%	0.49%	0.21%	-0.34%
过去三个月	0.60%	0.09%	-0.72%	0.51%	1.32%	-0.42%
自基金合同生效起至今	0.80%	0.09%	-0.78%	0.52%	1.58%	-0.43%

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 2016 年 3 月 23 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 2016 年 3 月 23 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将符合基金合同中的约定：股票资产占基金资产的 0%–95%；债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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占基金资产的 5%–100%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。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。

截至报告期期末，本基金尚未完成建仓。

§ 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		
左金保	本基金、长信医疗保健混合基金 (LOF)、长信量化先锋混合基金、长信量化中小盘股票基金、长信中证一带一路主题指数基金、长信量化多策略股票基	2016 年 4 月 19 日	-	6 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、长信医疗保健混合基金 (LOF)、长信量化先锋混合基金、长信量化中小盘

	金和长信先锐债券基金的基金经理				股票基金、长信中证一带一路主题指数基金、长信量化多策略股票基金和长信先锐债券基金的基金经理。
刘波	本基金、长信利众债券基金（LOF）、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信可转债债券基金、长信富安纯债一年定开债券基金、长信利保债券基金、长信富全纯债一年定开债券基金、长信金葵一年定开债券基金、长信利发债券基金的基金经理。	2016年3月23日	-	9年	经济学硕士，上海财经大学国防经济专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾任太平养老股份有限公司投资管理部投资经理。2011年2月加入长信基金管理有限责任公司，曾任长信利息收益货币基金的基金经理。现任本基金、长信利众债券基金（LOF）、长信利盈混合基金、长信利广混合基金、长信可转债债券基金、长信富安纯债一年定开债券基金、长信利保债券基金、长信富全纯债一年定开债券基金、长信金葵一年定开债券基金和长信利发债券基金的基金经理。

注：1、报告截止日至报告批准送出日期间，自 2016 年 7 月 28 日起，公司增聘姜锡峰先生担任本基金的基金经理。

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

3、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

二季度，英国脱欧事件超出市场预期，对各经济体的影响较为复杂。美国再次加息预期回落，避险情绪升温，美元大幅升值，黄金价格上行，部分大宗商品价格也跟随上涨，主要经济体国债收益率下行，欧元区及新兴经济体汇率普遍贬值。国内方面，受益于一季度信贷刺激，二季度房地产及基建投资增速整体上行，对经济增长起到托底作用，二季度信贷投放规模回归正常，经济刺激意愿减弱，增长预期趋于稳定；二季度通胀冲高回落，通胀预期减弱；央行继续通过公开市场操作及定向工具维持市场资金面稳定。市场方面，4 月份信用违约事件爆发导致债券市场出现一定幅度调整，5-6 月份随着经济增长预期、通胀预期的回落，叠加脱欧因素，债券收益率普遍下行。

报告期内，本基金以建仓为主。债券方面，二季度本基金增持了利率债和城投债，以期获得稳定的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.008 元，份额累计净值为 1.008 元；本基金本期净值增长率为 0.80%；同期业绩比较基准增长率为-0.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券方面：展望未来，英国脱欧事件的影响可能历时较长，后续不确定性因素仍较大，表现

为经济增速的下行压力和各国汇率的再平衡，短期内货币政策可能是相机抉择。国内而言，供给侧改革力度的加大和管理层刺激意愿的减弱可能使经济继续面临下行压力，脱欧因素导致汇率波动加大，短期内通胀有下行趋势，但通胀预期值得关注，货币政策在增长、汇率和通胀之间寻找平衡，短期来看可能继续维持稳定。就市场而言，避险情绪升温及通胀的阶段性回落可能使债市面临较好的环境，利率债和高等级信用债均有一定机会；受益于地方政府债务置换规模的扩大，信用债中城投债仍是相对较好的投资品种，产业债中所处供给侧改革领域的个券信用风险暴露可能进一步加大，信用债标的需要加强个券筛选；下一阶段我们将继续保持审慎严谨的态度，进一步优化投资组合，争取为投资人提供安全、稳健的投资收益。

股票方面：展望下半年，我们认为，前期市场已经历过多轮大幅下跌，加之人民币汇率趋稳、美联储加息推迟等风险因素都阶段性形成定论的情况下，市场不确定性大幅降低，很可能会迎来一波估值修复行情，但另一方面，基建、制造业、地产投资均有所下滑，对于下半年实体经济尚不容许过分乐观，所以综上我们认为市场可能继续维持震荡上行走势，呈现慢牛格局。除密切关注处于估值修复且景气向上的行业外，一些存在业绩拐点的成长股也可成为阶段性投资机会，届时我们将借助量化模型的投资优势，通过合理的仓位控制、行业配置以及个股选择，把握未来的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会 2008 年 9 月 12 日发布的[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、股票交易部总监、量化投资部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

- 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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，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。

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利泰灵活配置混合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、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

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

由长信利泰灵活配置混合型证券投资基金的基金管理人——长信基金管理有限责任公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信利泰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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	80,556,873.85
结算备付金		24,307,575.85
存出保证金		14,425.52
交易性金融资产	6.4.7.2	309,065,875.50
其中：股票投资		20,603,913.40
基金投资		-
债券投资		288,461,962.10
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	70,500,000.00
应收证券清算款		3,739,603.74
应收利息	6.4.7.5	6,524,342.94
应收股利		-
应收申购款		2,098.32
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		494,710,795.72
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		13,328.11
应付管理人报酬		242,257.01
应付托管费		40,376.18
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	18,658.14

应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	59,893.47
负债合计		374,512.91
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	490,188,576.78
未分配利润	6.4.7.10	4,147,706.03
所有者权益合计		494,336,282.81
负债和所有者权益总计		494,710,795.72

注：1、报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.008元，基金份额总额490,188,576.78份。

2、本基金本报告期为2016年3月23日至2016年6月30日，本基金基金合同于2016年3月23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。

6.2 利润表

会计主体：长信利泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日
一、收入		3,600,308.14
1.利息收入		2,447,735.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	350,415.63
债券利息收入		1,102,814.59
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		994,505.65
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-258,081.46
其中：股票投资收益	6.4.7.12	60,693.46
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-359,054.76
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	40,279.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	513,008.52
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	897,645.21

减：二、费用		876,592.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	678,097.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	113,016.23
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	25,148.49
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	60,330.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,723,715.95
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,723,715.95

注：本基金本报告期为2016年3月23日至2016年6月30日，本基金基金合同于2016年3月23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。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)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）	278,448,789.92	-	278,448,789.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,723,715.95	2,723,715.95
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）	211,739,786.86	1,423,990.08	213,163,776.94
其中：1.基金申购款	341,663,533.90	1,686,589.20	343,350,123.10
2.基金赎回款	-129,923,747.04	-262,599.12	-130,186,346.16
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）	490,188,576.78	4,147,706.03	494,336,282.81

注：本基金本报告期为2016年3月23日至2016年6月30日，本基金基金合同于2016年3月23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 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>覃波</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信利泰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”)《关于准予长信利泰灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1573 号)文准予注册募集,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《长信利泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2016 年 3 月 23 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司(以下简称“民生银行”)。

本基金于 2016 年 1 月 8 日至 2016 年 3 月 18 日募集,募集资金总额人民币 278,402,890.18 元,利息转份额人民币 45,899.74 元,募集规模为 278,448,789.92 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 1600099 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、《长信利泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长信利泰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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、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、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:股票资产占基金资产的 0%-95%;债券、债券回购、货币市场工具、银行存款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占基金资产的 5%-100%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。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为:沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%

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

本基金按照财政部颁布的企业会计准则、中国证券业协会 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长信利泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况、2016 年 3 月 23 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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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 2016 年 3 月 23 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。

-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。衍生工具所产生的金融资产和金融负债在资产负债表中以衍生金融资产和衍生金融负债列示。

-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。

-持有至到期投资

本基金将有明确意图和能力持有至到期的且到期日固定、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为持有至到期投资。

-可供出售金融资产

本基金将在初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产以及没有归类到其他类别的金融资产分类为可供出售金融资产。

-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。

6.4.4.4 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；对于支付价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

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。

6.4.4.5 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。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交

易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

存款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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

根据《长信利泰灵活配置混合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 0.60%的年费率逐日计提。

根据《长信利泰灵活配置混合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 0.10%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。

6.4.4.11 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,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%,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。

6.4.4.12 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并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 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；(3) 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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上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)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期末发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期末未发生过重大会计差错。

6.4.6 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、债券的投资收益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按根据持有期限计提个人所得税：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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	80,556,873.85
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	80,556,873.85

6.4.7.2 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	18,981,459.50	20,603,913.40	1,622,453.90
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	210,144,420.86	208,798,962.10
	银行间市场	79,426,986.62	79,663,000.00
	合计	289,571,407.48	288,461,962.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	308,552,866.98	309,065,875.50	513,008.52

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	70,500,000.00	-
合计	70,500,000.00	-

6.4.7.5 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	14,387.33
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	9,844.56
应收债券利息	6,500,105.20
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	5.85
合计	6,524,342.94

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 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	18,658.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	18,658.14

6.4.7.8 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	33.47
预提信息披露费-中证报	17,606.00
审计费用	14,085.00
预提信息披露费-上证报	28,169.00
合计	59,893.47

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	278,448,789.92	278,448,789.92
本期申购	341,663,533.90	341,663,533.90
本期赎回(以“-”号填列)	-129,923,747.04	-129,923,747.04
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	490,188,576.78	490,188,576.78

6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,210,707.43	513,008.52	2,723,715.95
本期基金份额交易产生的变动数	1,419,962.64	4,027.44	1,423,990.08
其中：基金申购款	1,691,012.05	-4,422.85	1,686,589.20
基金赎回款	-271,049.41	8,450.29	-262,599.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,630,670.07	517,035.96	4,147,706.03

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日
活期存款利息收入	281,507.30
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	61,256.06
其他	7,652.27
合计	350,415.63

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	60,693.46
股票投资收益——赎回差价收入	-
合计	60,693.46

6.4.7.12.2 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3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日
卖出股票成交总额	556,472.00

减：卖出股票成本总额	495,778.54
买卖股票差价收入	60,693.46

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2016年3月23日(基金合同生效日)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	-359,054.76
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	-359,054.76

6.4.7.13.2 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3月23日(基金合同生效日)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	81,829,580.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	80,475,037.33
减：应收利息总额	1,713,598.37
买卖债券差价收入	-359,054.76

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	40,279.84

基金投资产生的股利收益	-
合计	40,279.84

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
1. 交易性金融资产	513,008.52
——股票投资	1,622,453.90
——债券投资	-1,109,445.38
——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	513,008.52

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
基金赎回费收入	897,630.23
转换费收入	14.98
合计	897,645.21

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
交易所市场交易费用	21,448.49
银行间市场交易费用	3,700.00
合计	25,148.49

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
审计费用	14,085.00
信息披露费	45,775.00

其他费用	470.00
合计	60,330.00

注：其他费用为银行手续费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国民生银行股份有限公司	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
长信财聚 1 号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长江证券	4,812,146.47	24.02%

注：本基金基金合同于 2016 年 3 月 23 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例

长江证券	446,871,592.46	100.00%
------	----------------	---------

注：本基金基金合同于 2016 年 3 月 23 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
长江证券	12,912,200,000.00	99.23%

注：本基金基金合同于 2016 年 3 月 23 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
长江证券	4,481.94	24.02%	4,481.94	24.02%

注：股票交易佣金计提标准如下：

深圳证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1% (0.9%) -清算库中买(卖)经手费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上海证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1% (0.9%) -买(卖)经手费-买(卖)证管费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上述交易佣金比率均在合理商业条款范围内收取，并符合行业标准。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月

	30 日
当期发生的基金应支付的管理费	678,097.47
其中：支付销售机构的客户维护费	16,541.37

注：1、本基金基金合同于 2016 年 3 月 23 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、基金管理费按前一日基金资产净值 0.60% 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）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	113,016.23

注：1、本基金基金合同于 2016 年 3 月 23 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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）。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
长信财聚 1 号资产管理计划	309,949,253.73	63.23%

注：1、长信财聚 1 号资产管理计划为本基金管理人管理的资产管理计划；

2、本基金各关联方投资本基金适用费率严格遵循本基金招募说明书的有关规定。

6.4.10.5 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3月23日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国民生银行	80,556,873.85	281,507.30

注：1、本基金基金合同于 2016 年 3 月 23 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金通过“民生银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2016 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 24,307,575.85 元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内没有进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末，本基金未因认购新发/增发证券而持有流通受限股票。

6.4.12.2 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
603606	东方电缆	2016年6月22日	临时停牌	13.85	2016年7月5日	15.13	14,700	188,846.00	203,595.00	-
000948	南天信息	2016年6月28日	临时停牌	19.31	2016年7月12日	21.00	10,400	182,835.00	200,824.00	-
000551	创元科技	2016年6月7日	临时停牌	9.18	2016年7月7日	10.10	13,400	124,024.00	123,012.00	-
300334	津膜科技	2016年5月20日	临时停牌	18.05	-	-	5,900	98,037.00	106,495.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国民生银行股份有限公司，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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手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。

6.4.13.2.1 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
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	8,960,103.90
合计	8,960,103.90

注：未评级债券为国债、政策金融债及央行票据等免评级债券。

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

级别设置	含义
A-1	还本付息能力最强，安全性最高。
A-2	还本付息能力较强，安全性较高。
A-3	还本付息能力一般，安全性易受不良环境变化的影响。
B	还本付息能力较低，有一定的违约风险。
C	还本付息能力很低，违约风险较高。
D	不能按期还本付息。

6.4.13.2.2 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
AAA	16,434,000
AAA 以下	235,337,308.40
未评级	27,730,549.80
合计	279,501,858.20

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。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 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。本基金管理人量化投资部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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

6.4.13.4.1.1 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	80,556,873.85	-	-	-	-	80,556,873.85
结算备付金	24,307,575.85	-	-	-	-	24,307,575.85
存出保证金	14,425.52	-	-	-	-	14,425.52
交易性金融资产	13,549,644.90	11,978,808.40	217,758,500.00	45,175,008.80	20,603,913.40	309,065,875.50
买入返售金融资产	70,500,000.00	-	-	-	-	70,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	3,739,603.74	3,739,603.74
应收利息	-	-	-	-	6,524,342.94	6,524,342.94
应收申购款	-	-	-	-	2,098.32	2,098.32
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	188,928,520.12	11,978,808.40	217,758,500.00	45,175,008.80	30,869,958.40	494,710,795.72
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	13,328.11	13,328.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	242,257.01	242,257.01
应付托管费	-	-	-	-	40,376.18	40,376.18
应付交易费用	-	-	-	-	18,658.14	18,658.14
其他负债	-	-	-	-	59,893.47	59,893.47
负债总计	-	-	-	-	374,512.91	374,512.91
利率敏感度缺口	188,928,520.12	11,978,808.40	217,758,500.00	45,175,008.80	30,495,445.49	494,336,282.81

6.4.13.4.1.2 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）
	市场利率下降27个基点	1,573,051.66
市场利率上升27个基点	-1,573,051.66	

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 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其他市场价格风险，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) 指标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 4.17%，债券投资比例为基金资产净值的 58.35%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	20,603,913.40	4.17
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	288,461,962.10	58.35
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	309,065,875.50	62.52

6.4.13.4.3.2 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	
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)
	VaR值为0.36%	-1,779,610.62

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生工具及非衍生工具金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、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 2016年6月30日			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
交易性金融资产				
股票投资	19,969,987.4	633,926.00	—	20,603,913.40
债券投资	—	288,461,962.10	—	288,461,962.10
合计	19,969,987.4	289,095,888.10	—	309,065,875.5

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

(b) 第二层次的公允价值计量

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

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

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具

2、其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

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

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	20,603,913.40	4.16
	其中：股票	20,603,913.40	4.16
2	固定收益投资	288,461,962.10	58.31
	其中：债券	288,461,962.10	58.31
	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	70,500,000.00	14.25
	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	104,864,449.70	21.20
7	其他各项资产	10,280,470.52	2.08
8	合计	494,710,795.72	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	211,580.00	0.04
B	采矿业	584,533.32	0.12
C	制造业	14,444,398.20	2.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	589,854.00	0.12
F	批发和零售业	1,366,140.40	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	804,281.48	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,066,566.00	0.22

J	金融业	209,676.00	0.04
K	房地产业	393,218.50	0.08
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	196,633.50	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	185,196.00	0.04
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	201,824.00	0.04
S	综合	350,012.00	0.07
	合计	20,603,913.40	4.17

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	002521	齐峰新材	21,900	250,536.00	0.05
2	300370	安控科技	21,800	247,648.00	0.05
3	002402	和而泰	9,100	246,155.00	0.05
4	300102	乾照光电	26,700	242,436.00	0.05
5	300303	聚飞光电	24,800	235,848.00	0.05
6	600192	长城电工	21,800	233,696.00	0.05
7	300213	佳讯飞鸿	8,100	228,744.00	0.05
8	300320	海达股份	17,300	227,841.00	0.05
9	000532	力合股份	12,500	227,000.00	0.05
10	601137	博威合金	16,700	223,947.00	0.05
11	300194	福安药业	10,300	222,995.00	0.05
12	002669	康达新材	9,100	220,220.00	0.04
13	002320	海峡股份	14,100	219,537.00	0.04
14	002438	江苏神通	10,000	218,900.00	0.04
15	002666	德联集团	23,600	218,064.00	0.04
16	300354	东华测试	8,100	217,485.00	0.04
17	600523	贵航股份	11,700	217,386.00	0.04

18	002255	海陆重工	25,200	216,972.00	0.04
19	300103	达刚路机	11,500	215,050.00	0.04
20	300018	中元股份	16,900	214,799.00	0.04
21	300373	扬杰科技	8,900	214,579.00	0.04
22	603688	石英股份	10,300	214,446.00	0.04
23	002009	天奇股份	13,100	213,923.00	0.04
24	002231	奥维通信	13,800	213,348.00	0.04
25	300177	中海达	14,000	212,240.00	0.04
26	300106	西部牧业	14,200	211,580.00	0.04
27	002115	三维通信	18,400	211,416.00	0.04
28	600353	旭光股份	25,500	210,885.00	0.04
29	002017	东信和平	14,600	210,240.00	0.04
30	002066	瑞泰科技	12,400	210,180.00	0.04
31	300337	银邦股份	26,700	210,129.00	0.04
32	002350	北京科锐	10,400	210,080.00	0.04
33	002125	湘潭电化	10,500	210,000.00	0.04
34	000712	锦龙股份	10,100	209,676.00	0.04
35	300120	经纬电材	14,100	209,103.00	0.04
36	002719	麦趣尔	4,300	208,894.00	0.04
37	002578	闽发铝业	22,100	208,403.00	0.04
38	300387	富邦股份	7,400	208,384.00	0.04
39	300305	裕兴股份	15,000	207,900.00	0.04
40	600148	长春一东	9,400	207,082.00	0.04
41	300235	方直科技	8,300	206,255.00	0.04
42	000663	永安林业	16,000	206,080.00	0.04
43	000922	佳电股份	21,100	204,670.00	0.04
44	300137	先河环保	13,800	204,102.00	0.04
45	603606	东方电缆	14,700	203,595.00	0.04
46	600178	东安动力	23,300	203,176.00	0.04
47	002363	隆基机械	15,600	203,112.00	0.04
48	300050	世纪鼎利	14,100	202,899.00	0.04
49	002397	梦洁股份	24,600	202,458.00	0.04
50	002160	常铝股份	23,100	202,356.00	0.04
51	601999	出版传媒	21,200	201,824.00	0.04
52	002478	常宝股份	17,900	201,196.00	0.04
53	000948	南天信息	10,400	200,824.00	0.04
54	002614	蒙发利	16,700	200,567.00	0.04
55	002064	华峰氨纶	41,600	199,680.00	0.04
56	002644	佛慈制药	17,800	199,538.00	0.04

57	300214	日科化学	25,900	199,430.00	0.04
58	002693	双成药业	21,000	198,660.00	0.04
59	603123	翠微股份	23,400	198,432.00	0.04
60	000032	深桑达 A	12,960	198,158.40	0.04
61	600888	新疆众和	27,825	198,114.00	0.04
62	600684	珠江实业	26,350	197,888.50	0.04
63	000507	珠海港	36,101	197,833.48	0.04
64	002307	北新路桥	25,200	197,820.00	0.04
65	300132	青松股份	24,600	197,784.00	0.04
66	002674	兴业科技	12,900	197,757.00	0.04
67	600508	上海能源	21,316	197,599.32	0.04
68	002187	广百股份	16,000	197,120.00	0.04
69	000420	吉林化纤	29,500	197,060.00	0.04
70	600397	安源煤业	44,500	196,690.00	0.04
71	300172	中电环保	21,350	196,633.50	0.04
72	600889	南京化纤	18,200	196,196.00	0.04
73	600248	延长化建	32,140	196,054.00	0.04
74	600512	腾达建设	47,800	195,980.00	0.04
75	300255	常山药业	23,600	195,880.00	0.04
76	300357	我武生物	5,200	195,832.00	0.04
77	300139	晓程科技	13,300	195,643.00	0.04
78	601188	龙江交通	48,300	195,615.00	0.04
79	600223	鲁商置业	38,300	195,330.00	0.04
80	000753	漳州发展	43,600	194,892.00	0.04
81	002144	宏达高科	9,900	194,634.00	0.04
82	300272	开能环保	12,600	194,418.00	0.04
83	300344	太空板业	16,400	193,848.00	0.04
84	000554	泰山石油	22,500	193,500.00	0.04
85	600833	第一医药	12,200	193,126.00	0.04
86	002487	大金重工	21,700	192,045.00	0.04
87	600792	云煤能源	37,800	191,646.00	0.04
88	601518	吉林高速	48,800	191,296.00	0.04
89	002561	徐家汇	15,700	190,912.00	0.04
90	300164	通源石油	23,900	190,244.00	0.04
91	002315	焦点科技	2,800	188,888.00	0.04
92	300295	三六五网	5,800	188,500.00	0.04
93	300382	斯莱克	5,000	187,900.00	0.04
94	002420	毅昌股份	21,400	186,180.00	0.04
95	600962	国投中鲁	13,600	185,912.00	0.04

96	600661	新南洋	6,600	185,196.00	0.04
97	600781	辅仁药业	10,600	184,758.00	0.04
98	300250	初灵信息	6,180	182,866.20	0.04
99	002540	亚太科技	17,300	150,856.00	0.03
100	000551	创元科技	13,400	123,012.00	0.02
101	300334	津膜科技	5,900	106,495.00	0.02
102	300312	邦讯技术	4,000	79,200.00	0.02

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	600397	安源煤业	202,684.00	0.04
2	600512	腾达建设	199,758.00	0.04
3	002521	齐峰新材	199,127.00	0.04
4	000420	吉林化纤	198,714.00	0.04
5	000554	泰山石油	198,308.00	0.04
6	600178	东安动力	198,303.00	0.04
7	600223	鲁商置业	198,112.00	0.04
8	002644	佛慈制药	197,834.00	0.04
9	600889	南京化纤	197,722.00	0.04
10	000507	珠海港	197,550.21	0.04
11	600792	云煤能源	197,398.00	0.04
12	002693	双成药业	197,104.00	0.04
13	600248	延长化建	197,095.00	0.04
14	600888	新疆众和	197,069.25	0.04
15	601188	龙江交通	196,835.00	0.04
16	002578	闽发铝业	196,736.00	0.04
17	600353	旭光股份	196,716.00	0.04
18	002187	广百股份	196,630.00	0.04
19	002160	常铝股份	196,581.00	0.04
20	300132	青松股份	196,430.00	0.04

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	002054	德美化工	133,214.00	0.03
2	002297	博云新材	129,929.00	0.03
3	300193	佳士科技	118,130.00	0.02
4	300218	安利股份	112,537.00	0.02
5	300312	邦讯技术	62,662.00	0.01

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，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	19,477,238.04
卖出股票收入（成交）总额	556,472.00

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	48,669,462.10	9.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	239,792,500.00	48.51
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	288,461,962.10	58.35

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	010107	21 国债(7)	214,110	23,141,008.80	4.68
2	1480444	14 新开元债	200,000	22,034,000.00	4.46
3	124606	14 菏泽债	200,000	21,820,000.00	4.41
4	122684	12 合高新	200,000	21,708,000.00	4.39
5	124645	14 临经开	200,000	21,700,000.00	4.39

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

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的备选股票库的情形。

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	14,425.52
2	应收证券清算款	3,739,603.74
3	应收股利	-
4	应收利息	6,524,342.94
5	应收申购款	2,098.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,280,470.52

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
481	1,019,103.07	463,653,149.57	94.59%	26,535,427.21	5.41%

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	22,614.19	0.00%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年3月23日）基金份额总额	278,448,789.92
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	341,663,533.90
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	129,923,747.04
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	490,188,576.78

注：本基金基金合同于2016年3月23日正式生效，本报告期为2016年3月23日至2016年6月30日。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开本基金的基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 报告期内本基金管理人的重大人事变动

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

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

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

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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

本报告期本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

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	
兴业证券	1	15,221,563.57	75.98%	14,176.20	75.98%	-
长江证券	2	4,812,146.47	24.02%	4,481.94	24.02%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	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
兴业证券	-	-	100,000,000.00	0.77%	-	-
长江证券	446,871,592.46	100.00%	12,912,200,000.00	99.23%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本基金共用民生银行旗下基金席位。

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	长信利泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	上证报、中证报	2016年1月5日
2	长信利泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同	上证报、中证报	2016年1月5日
3	长信利泰灵活配置混合型证券投资基金托管协议	公司网站	2016年1月5日
4	长信利泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	上证报、中证报	2016年1月5日
5	长信基金管理有限责任公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下长信利泰灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	上证报、中证报	2016年1月14日
6	长信基金管理有限责任公司关于长信利泰灵活配置混合型证券投资基金延长募集期的公告	上证报、中证报	2016年2月5日
7	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
8	长信基金管理有限责任公司关于长信利泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	上证报、中证报	2016年3月24日
9	长信基金管理有限责任公司长信基金管理有限责任公司关于长信利泰灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资等业务的公告	上证报、中证报	2016年3月28日
10	长信基金管理有限责任公司关于长信利泰灵活配置混合型证券投资基金在中国民生	上证报、中证报	2016年3月28日

	银行股份有限公司等基金销售机构开通转换、定期定额投资业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告		
11	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
12	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信利泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	上证报、中证报	2016 年 4 月 19 日
13	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
14	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
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加定投申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券日 报	2016 年 6 月 16 日
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 6 月 28 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信利泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信利泰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