

长信量化先锋混合型证券投资基金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：交通银行股份有限公司

送出日期：2016年3月26日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人交通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24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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1月1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	长信量化先锋混合
场内简称	长信量化
基金主代码	519983
交易代码	519983
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月18日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,058,960,844.72份
基金合同存续期	不定期

注：2015年8月7日起本基金更名为长信量化先锋混合型证券投资基金，关于更名的事宜，我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略包括两部分：一是通过自上而下的资产配置策略确定各类标的资产的配置比例，并对组合进行动态管理，进一步优化整个组合的风险收益参数；二是通过自下而上的上市公司研究，借助长信行业多因素选股模型选取具有投资价值的上市公司股票。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+中证综合债券指数收益率*25%
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	交通银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	周永刚	汤嵩彦
	联系电话	021-61009999	95559

长信量化先锋混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

人	电子邮箱	zhouyg@xfund.com.cn	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-700-5566	95559
传真		021-61009800	021-62701216

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.xfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海银城中路68号时代金融中心9楼、上海市仙霞路18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	2014年	2013年
本期已实现收益	319,595,504.31	154,010,526.04	23,775,282.04
本期利润	646,276,800.77	232,378,267.23	18,531,605.84
加权平均基金份额本期利润	0.7300	0.4845	0.1443
本期基金份额净值增长率	84.03%	57.83%	19.92%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.7216	0.1466	-0.1511
期末基金资产净值	2,611,765,777.24	1,799,858,070.10	101,086,141.35
期末基金份额净值	2.466	1.340	0.849

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。

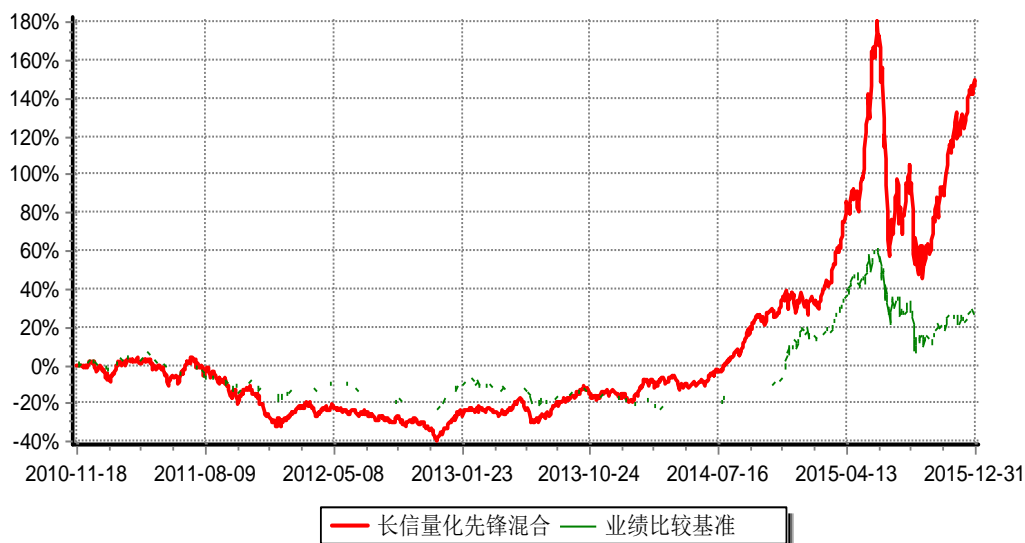
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	54.22%	1.98%	12.98%	1.25%	41.24%	0.73%
过去六个月	11.53%	3.14%	-10.94%	2.01%	22.47%	1.13%
过去一年	84.03%	2.73%	7.71%	1.86%	76.32%	0.87%
过去三年	248.31%	1.84%	42.89%	1.34%	205.42%	0.50%
过去五年	150.10%	1.63%	25.32%	1.20%	124.78%	0.43%
自基金合同生效日起至今（2010年11月18日至2015年12月31日）	146.60%	1.62%	26.18%	1.20%	120.42%	0.42%

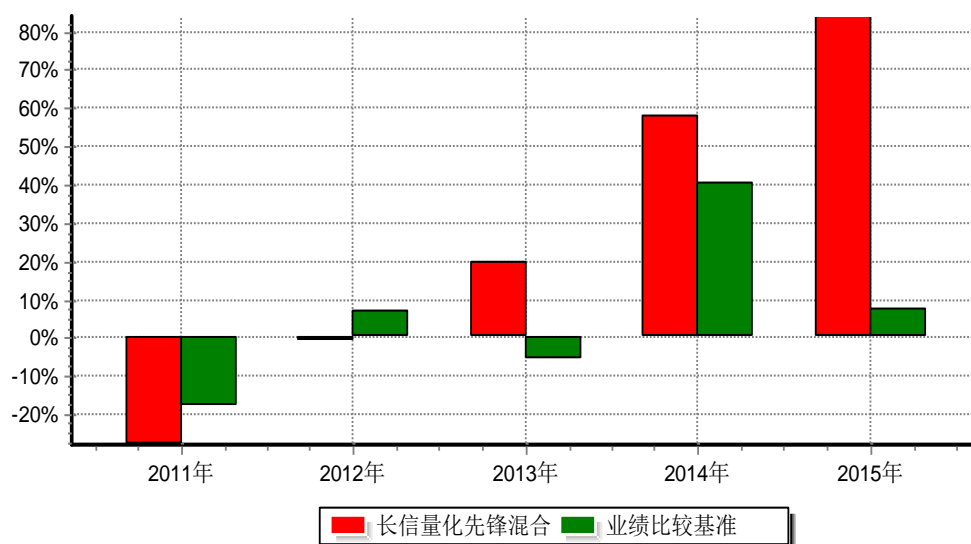
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2010年11月18日（基金合同生效日）至2015年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同中的约定。

### 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

过去三年本基金未进行利润分配。

## § 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		
胡倩	基金经理、公司金融工程部总监	2011年4月14日	2015年3月14日	14年	曾任本基金的基金经理。
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）、长信量化中小盘股票型证	2015年3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、

	券投资基金、长信量化多策略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				长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信量化多策略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遵规守信情况的说明

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

2015年A股市场虽遭遇极端调整，但仍称得上是波澜壮阔的成长股牛市，全年上证综指上涨9.41%，沪深300上涨5.58%，中证500上涨43.12%，中小板指上涨53.70%，创业板指上涨84.41%。就行业而言，申万一级行业大多数收益不菲，其中计算机、轻工制造、纺织服装行业涨幅最大，分别为100.29%、89.85%、89.17%，而采掘、银行、非银金融三行业全年收阴，分别为-0.43%、-1.36%、-16.89%，行业分化较为明显。2015年上半年趋势性投资机会显著，三季度股市深度调整之后又迎来了以TMT为龙头的新兴成长行业的结构性行情。

报告期间，本基金仓位控制基本符合市场运行规律，在行业和风格充分分散的前提下构建稳健投资组合，取得了较为理想的绝对和相对收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日，本基金份额净值为2.466元，本报告期内本基金净值增长率为84.03%，同期业绩比较基准涨幅为7.71%。

#### 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，我们认为经济大概率不会出现硬着陆，持续的改革政策落地和宽松的货币市场环境有助于宏观经济企稳复苏。资金面宽松有望延续，市场流动性不会转向，而汇率也会逐渐趋稳；结构性改革带来热点机会，国企改革总体方案和十三五规划的出台，以及中央经济工作会议的供给侧改革都可能成为带动相关板块上涨的催化剂。我们将利用涵盖宏观、流动性、市场结构、交易特征等多个层面的模型，来监测市场可能存在的运行规律及发生的变动，捕捉市场中有效投资机会。借助于不断优化改进的量化投资模型，构建投资组合，以期获得较为理想的相对收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会2008年9月12日发布的【2008】38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、交易管理部总监、金融工程部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨

干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员1/2以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据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、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式（指将现金红利按除息日除权后的基金份额净值为计算基准自动转为基金份额进行再投资），基金份额持有人可选择现金方式或红利再投资方式；若基金份额持有人事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若基金份额持有人选择红利再投资，红利再投资的份额免收申购费用；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年最多分配6次，每次收益分配最低比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的30%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配（可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数）；

4、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净额后不能低于面值；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过15个工作日。

7、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

2015年度，基金托管人在长信量化先锋混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2015年度，长信基金管理有限责任公司在长信量化先锋混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

### 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

2015年度，由长信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关长信量化先锋混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

本基金2015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(毕马威华振审字第1600164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：长信量化先锋混合型证券投资基金

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	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	482,085,619.81	66,785,813.38
结算备付金	2,980,241.31	12,060,129.69
存出保证金	1,283,421.56	683,135.86
交易性金融资产	2,103,388,139.80	1,736,107,614.20
其中：股票投资	2,103,388,139.80	1,686,072,614.20
基金投资	—	—
债券投资	—	50,035,000.00
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	30,000,165.00	—
应收证券清算款	—	23,068,513.99
应收利息	123,208.81	1,043,692.69
应收股利	—	—
应收申购款	57,984,192.04	13,501,179.54
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	2,677,844,988.33	1,853,250,079.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	54,283,115.04	19,983,131.03
应付赎回款	6,397,023.94	24,298,348.84
应付管理人报酬	2,815,381.13	2,552,023.71

长信量化先锋混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

应付托管费	469,230.20	425,337.28
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	1,718,312.71	5,568,743.20
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	396,148.07	564,425.19
负债合计	66,079,211.09	53,392,009.25
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,058,960,844.72	1,343,469,056.67
未分配利润	1,552,804,932.52	456,389,013.43
所有者权益合计	2,611,765,777.24	1,799,858,070.10
负债和所有者权益总计	2,677,844,988.33	1,853,250,079.35

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值2.466元，基金份额总额1,058,960,844.72份。

## 7.2 利润表

会计主体：长信量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
<b>一、收入</b>	698,384,058.91	256,565,787.42
1. 利息收入	3,494,655.40	1,160,614.61
其中：存款利息收入	2,200,009.22	604,553.74
债券利息收入	1,095,753.42	536,342.47
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	198,892.76	19,718.40
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	362,672,737.18	175,172,866.45
其中：股票投资收益	358,251,398.96	174,210,162.53
基金投资收益	—	—
债券投资收益	20,650.00	—
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—



长信量化先锋混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

股利收益	4,400,688.22	962,703.92
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	326,681,296.46	78,367,741.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,535,369.87	1,864,565.17
<b>减：二、费用</b>	52,107,258.14	24,187,520.19
1. 管理人报酬	23,760,885.47	8,613,135.68
2. 托管费	3,960,147.62	1,435,522.71
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	24,082,683.20	13,843,303.02
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	303,541.85	295,558.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	646,276,800.77	232,378,267.23
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	646,276,800.77	232,378,267.23

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化先锋混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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)	1,343,469,056.67	456,389,013.43	1,799,858,070.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	646,276,800.77	646,276,800.77
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)	-284,508,211.95	450,139,118.32	165,630,906.37
其中：1. 基金申购款	2,435,022,789.07	2,206,147,337.04	4,641,170,126.11
2. 基金赎回款	-2,719,531,001.02	-1,756,008,218.72	-4,475,539,219.74
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	—	—	—

长信量化先锋混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,058,960,844.72	1,552,804,932.52	2,611,765,777.24
项 目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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）	119,085,071.97	-17,998,930.62	101,086,141.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	232,378,267.23	232,378,267.23
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）	1,224,383,984.70	242,009,676.82	1,466,393,661.52
其中：1. 基金申购款	2,461,642,600.79	592,875,273.49	3,054,517,874.28
2. 基金赎回款	-1,237,258,616.09	-350,865,596.67	-1,588,124,212.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	1,343,469,056.67	456,389,013.43	1,799,858,070.10

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

长信量化先锋股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准长信量化先锋股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可【2010】962号文)批准,由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信量化先锋股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2010年11月18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, 基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

本基金于2010年10月11日至2010年11月12日募集, 募集资金总额人民币324,510,451.15元, 利息转份额人民币161,246.27元, 募集规模为324,671,697.42份。上述募集资金已由上海众华沪银会计师事务所有限公司验证, 并出具了沪众会字(2010)第4128号验资报告。

2015年8月7日起本基金更名为长信量化先锋混合型证券投资基金, 关于更名的事宜, 我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信量化先锋混合型证券投资基金基金合同》和《长信量化先锋混合型证券投资基金招募说明书》(更新)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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金的投资组合比例为: 股票投资比例范围为基金资产的60%-95%, 权证投资比例范围为基金资产净值的0%-3%, 债券、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的比例范围为基金资产的5%-40%, 其中现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金利用数量化模型进行股票投资的比例不低于股票资产的80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 本基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率\*75%+中证综合债券指数收益率\*25%。

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2015年12月31日的财务状况、2015年度的经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注7.4.2所列示的其他有关规定的要求。

#### 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估计发生变更，对本基金本报告期无重大影响，会计政策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

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，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

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

#### 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。

#### 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
中国交通银行	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券	7,463,665,521.64	45.15%	6,682,610,920.08	68.99%

## 7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31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	6,468,273.29	46.62%	1,491,420.59	86.83%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	5,788,356.89	67.92%	4,000,898.35	71.85%

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%-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%-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》，本基金管理人在租用长江证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票和债券交易的同时，还从长江证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

#### 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1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	23,760,885.47	8,613,135.68
其中：支付销售机构的客户维护费	6,859,103.12	2,858,686.32

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,960,147.62	1,435,522.71

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

#### 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

本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

#### 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 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
基金合同生效日（2010年11月18日）持有的基金份额	—	—

长信量化先锋混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

报告期初持有的基金份额	—	20,000,400.00
报告期内申购/买入总份额	—	—
报告期内因拆分变动份额	—	—
减：报告期内赎回/卖出总份额	—	20,000,400.00
报告期末持有的基金份额	—	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	0.00%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

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

除基金管理人之外的其他关联方于本年末及上年末均未持有本基金。

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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年1月1日至2014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
交通银行股份有限公司	482,085,619.81	1,551,184.84	66,785,813.38	302,528.84

注：本基金通过“交通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2,980,241.31元（2014年：人民币12,060,129.69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

本基金在本期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

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	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
------	----	----	----	----	----	----	-------	--------	--------



## 长信量化先锋混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

码	名称	日期	原因	估值 单价	日期	开盘 单价			
000153	丰原 药业	2015- 10-14	重大 事项 停牌	10.44	—	—	120,755	1,427,855.84	1,260,682.20
002201	九鼎 新材	2015- 11-17	重大 事项 停牌	16.01	—	—	952,392	10,585,520.91	15,247,795.92
002231	奥维 通信	2015- 12-03	重大 事项 停牌	16.36	2016- 03-17	16.00	1,005,002	16,352,655.36	16,441,832.72
002435	长江 润发	2015- 07-08	重大 事项 停牌	10.06	2016- 01-27	11.07	779,250	12,127,444.46	7,839,255.00
002582	好想 你	2015- 09-17	重大 事项 停牌	15.62	2016- 02-24	17.18	398,099	8,514,041.79	6,218,306.38
300132	青松 股份	2015- 12-11	重大 事项 停牌	10.04	—	—	1,767,700	16,006,487.07	17,747,708.00
300306	远方 光电	2015- 11-03	重大 事项 停牌	18.67	2016- 02-24	20.54	712,184	8,867,655.80	13,296,475.28
300313	天山 生物	2015- 11-03	重大 事项 停牌	17.70	—	—	81	1,731.48	1,433.70
300323	华灿 光电	2015- 12-29	重大 事项 停牌	10.18	2016- 01-04	10.20	1,796,210	12,022,821.08	18,285,417.80
600603	大洲 兴业	2015- 09-11	重大 事项 停牌	12.32	2016- 01-14	13.55	98	1,806.51	1,207.36
600781	辅仁 药业	2015- 09-22	重大 事项 停牌	19.36	2016- 01-06	21.30	85	2,055.83	1,645.60
600864	哈投 股份	2015- 10-09	重大 事项 停牌	10.88	2016- 01-14	11.97	748,800	10,603,167.58	8,146,944.00
600982	宁波 热电	2015- 10-21	重大 事项 停牌	7.54	2016- 02-25	6.80	10	107.04	75.40
601518	吉林 高速	2015- 12-10	重大 事项 停牌	4.65	2016- 01-25	4.59	3,047,951	14,549,789.04	14,172,972.15

## 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	2,103,388,139.80	78.55
	其中：股票	2,103,388,139.80	78.55
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	30,000,165.00	1.12
	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	485,065,861.12	18.11
7	其他各项资产	59,390,822.41	2.22
8	合计	2,677,844,988.33	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	73,244,793.36	2.80
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,361,517,473.15	52.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	134,986,379.95	5.17
E	建筑业	19,675,379.50	0.75
F	批发和零售业	146,570,431.54	5.61
G	交通运输、仓储和邮政业	51,363,777.74	1.97
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	91,868,568.26	3.52
J	金融业	16,467,509.85	0.63

长信量化先锋混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

K	房地产业	127,794,615.76	4.89
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	19,014,593.95	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	15,354,579.24	0.59
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	45,528,830.14	1.74
S	综合	1,207.36	—
	合计	2,103,388,139.80	80.54

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未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	300275	梅安森	632,100	23,008,440.00	0.88
2	600774	汉商集团	794,051	21,121,756.60	0.81
3	002232	启明信息	982,300	20,903,344.00	0.80
4	000605	渤海股份	632,791	20,875,775.09	0.80
5	300089	文化长城	524,200	20,721,626.00	0.79
6	600117	西宁特钢	2,943,282	20,514,675.54	0.79
7	300100	双林股份	654,196	20,489,418.72	0.78
8	600520	中发科技	718,288	20,025,869.44	0.77
9	300304	云意电气	673,754	19,943,118.40	0.76
10	002134	天津普林	1,074,340	19,875,290.00	0.76

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	601169	北京银行	59,235,846.53	3.29
2	601628	中国人寿	58,587,808.26	3.26
3	601318	中国平安	54,590,233.82	3.03

## 长信量化先锋混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

4	600218	全柴动力	49,297,554.01	2.74
5	601555	东吴证券	45,931,994.15	2.55
6	601336	新华保险	44,411,244.43	2.47
7	601601	中国太保	43,439,962.62	2.41
8	601166	兴业银行	42,632,039.49	2.37
9	601999	出版传媒	41,919,545.42	2.33
10	600030	中信证券	41,891,378.65	2.33
11	300258	精锻科技	41,353,974.71	2.30
12	600345	长江通信	39,951,045.69	2.22
13	300265	通光线缆	34,835,006.85	1.94
14	600248	延长化建	34,643,640.29	1.92
15	000001	平安银行	34,412,387.38	1.91
16	000686	东北证券	33,928,323.52	1.89
17	600036	招商银行	33,706,201.08	1.87
18	002134	天津普林	33,450,298.21	1.86
19	600213	亚星客车	32,932,801.46	1.83
20	600523	贵航股份	32,319,019.37	1.80

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	601169	北京银行	73,391,584.38	4.08
2	601628	中国人寿	69,083,200.71	3.84
3	601336	新华保险	64,842,032.90	3.60
4	600030	中信证券	61,719,610.80	3.43
5	002131	利欧股份	57,621,248.15	3.20
6	601318	中国平安	56,117,966.10	3.12
7	601166	兴业银行	56,032,772.12	3.11
8	002044	美年健康	49,060,308.39	2.73
9	601555	东吴证券	48,685,442.10	2.70
10	000001	平安银行	47,972,869.16	2.67
11	601601	中国太保	47,206,048.57	2.62
12	600036	招商银行	44,115,055.82	2.45
13	601186	中国铁建	42,859,621.08	2.38
14	000686	东北证券	41,812,473.47	2.32
15	603008	喜临门	40,974,784.59	2.28
16	600015	华夏银行	37,183,194.69	2.07
17	002365	永安药业	35,048,794.31	1.95

18	000040	宝安地产	34,050,204.64	1.89
19	603993	洛阳钼业	33,916,708.78	1.88
20	002687	乔治白	33,699,658.44	1.87

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	8,132,494,679.71
卖出股票的收入（成交）总额	8,400,167,499.53

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，不存在投资于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	1,283,421.56
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	123,208.81
5	应收申购款	57,984,192.04
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	59,390,822.41

**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**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**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
28,109	37,673.37	657,332,199.11	62.07%	401,628,645.61	37.93%

## 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	70,472.14	0.01%

## 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 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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年11月18日)基金份额总额	324,671,697.42
本报告期期初基金份额总额	1,343,469,056.67
本报告期基金总申购份额	2,435,022,789.07
减：本报告期基金总赎回份额	2,719,531,001.02
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,058,960,844.72



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未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 报告期内本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 报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，交通银行股份有限公司（以下简称“本行”）因工作需要，刘树军先生不再担任本行资产托管业务中心总裁，任命袁庆伟女士为本行资产托管业务中心总裁。

袁庆伟女士的基金行业高级管理人员任职资格已在中国证券投资基金业协会备案。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

### 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审计的报酬为人民币70,000.00元，该审计机构为本基金提供审计服务的连续年限为6。

### 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

本报告期本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	
长江证券	2	7,463,665,521.64	45.15%	6,468,273.29	46.62%	
华泰证券	2	3,401,960,351.37	20.58%	2,756,950.31	19.87%	
兴业证券	2	1,943,104,607.95	11.75%	1,581,547.37	11.40%	
海通证券	1	1,242,736,571.94	7.52%	1,007,115.42	7.26%	
光大证券	1	814,693,406.36	4.93%	665,912.18	4.80%	
国金证券	1	787,949,505.25	4.77%	647,785.69	4.67%	
申银万国	1	531,690,591.89	3.22%	430,882.80	3.11%	
国泰君安	1	346,185,153.44	2.09%	315,167.70	2.27%	
华创证券	1	0.00	0	0	0	
广发证券	2	0.00	0	0	0	

注：1、本报告期内本基金增加租用光大证券的交易单元1个，国金证券的交易单元1个，兴业证券的交易单元2个，广发证券的交易单元2个，华泰证券的交易单元2个，申银万国交易单元1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