

长信金利趋势混合型证券投资基金

2015 年度 报告 摘要

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	3,176,121,406.98	13.51%	643,107,326.81	6.90%

7.4.8.1.2 债券交易
 7.4.8.1.3 债券回购交易
 7.4.8.1.4 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	占当期应付佣金总额的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	2,912,440.06	13.53%	693,522.87	16.04%
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	占当期应付佣金总额的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	585,482.01	6.00%	—	—

注：股票交易佣金计提标准如下：
 深圳证券交易所交易佣金=(成交金额×1‰(0.05%)-清算中买卖经手费-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=(成交金额×1‰(或0.05%)-买卖经手费-买卖证券管理费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取))
 上述交易佣金比例均在合理佣金条款范围内执行,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。
 7.4.8.2 关联方报酬
 7.4.8.2.1 基金管理费

项目	2015年1月1日至2015年12月31日	本期	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的基金管理费	69,607,238.46	70,567,198.72	
其中:支付给托管人的客户管理费	16,691,940.53	19,356,679.23	

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费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：
 基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数
 7.4.8.2.2 基金托管费

项目	2015年1月1日至2015年12月31日	本期	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	11,601,223.04	11,761,189.25	

注：支付基金管理人浦发银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。计算公式：
 基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数
 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
 本基金在本年度与上年度期间均未有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 各关联方报酬
 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

基金合同生效日	2015年1月1日至2015年12月31日	本期	2014年1月1日至2014年12月31日
基金合同生效日(2006年4月30日)持有的	-	-	-
报告期末持有的基金份额	10,261,020.72	10,261,020.72	
报告期末持有基金份额总额	10,261,020.72	10,261,020.72	
报告期末持有基金份额比例	-	-	-
报告期末持有基金份额比例	-	-	-
报告期末持有基金份额比例	-	-	-
报告期末持有基金份额比例	-	-	-

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金合同约定的费率执行。
 7.4.8.4.2 报告期末基金管理人持有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

关联方名称	2015年1月1日至2015年12月31日	本期	2014年1月1日至2014年12月31日
上海浦东发展银行股份有限公司	58,181,348.21	2,573,818.02	113,267,501.56
浦发银行			1,111,396.49

注：本基金通过“浦发银行长信基金托管资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司结算备付金,于2015年12月31日的相关余额为人民币5,654,424.18元(2014年：人民币3,519,957.94元)。
 7.4.8.6 本基金在年度报告中与关联方承销证券的情况
 本基金在本年度与上年度期间未在本报告期内购入过由关联方承销的证券。
 7.4.8.7 其他关联方事项的说明
 上述关联交易均按照正常的商业交易条件进行,并以一般交易价格为定价基础。
 7.4.8.8 附期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券
 7.4.8.9 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。
 7.4.8.2 期末持有的处于停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末未停牌数量	期末未停牌金额	期末未停牌比例
600504	长电科技	2015年11月11日	重大资产重组	22,022	-	-
000002	万科A	2015年12月18日	重大资产重组	24,431	-	-
300064	景嘉微	2015年11月23日	重大资产重组	24,666	-	-
300104	龙源电力	2015年12月7日	重大资产重组	588	-	-
合计					64,506,772.99	2.08
其他各项资产					37,499,479.32	1.21
合计					3,006,865,814.46	100.00

注：本基金本报告期没有通过沪港通交易机制投资港股。
 8.2 报告期末未发行分类的境内股票投资组合
 8.2.1 报告期末未发行分类的境内股票投资组合

B	采矿业	204,763,295.19	6.70
C	制造业	1,987,795,523.49	61.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,978,686.98	1.83
E	建筑业	384,752,771.80	12.50
F	批发和零售业	3,356,766.63	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	31,946,264.02	1.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,001,669.30	0.06
J	金融业	200,781,685.36	6.63
K	房地产业	24,023,421.48	0.79
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	80,106,302.34	2.62
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	1,485,716.67	0.06
S	综合	-	-
	合计	2,984,636,163.15	93.74

8.2.2 报告期末持仓行业分布的沪港通跨境投资股票组合

8.2.2 报告期末未发行分类的沪港通股票投资组合
 本基金本报告期没有通过沪港通交易机制投资港股。
 8.3 报告期末未发行分类的境内股票投资组合
 8.3.1 报告期末未发行分类的境内股票投资组合

代码	股票简称	股票数量	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
000077	华能国际	21,006,102	286,468,054.00	8.46
000060	中金岭南	19,613,497	256,321,469.02	8.27
000007	云南铜业	36,361,313	241,761,940.47	8.32
000000	中金岭南	13,460,972	188,367,437.16	6.18
600497	世纪铝业	17,015,961	167,266,204.4	6.15
600033	振钢科技	4,566,680	156,601,457.20	5.12
700001	华信国际	13,681,061	156,601,457.20	5.12
600301	鲁信矿业	4,539,690	152,323,820.38	4.98
002428	华信国际	7,112,736	144,246,281.08	4.72
600146	峨边铝业	3,975,695	127,277,758.12	4.17
000077	华能国际	21,006,102	286,468,054.00	8.46
000060	中金岭南	19,613,497	256,321,469.02	8.27
000007	云南铜业	36,361,313	241,761,940.47	8.32
000000	中金岭南	13,460,972	188,367,437.16	6.18
600497	世纪铝业	17,015,961	167,266,204.4	6.15
600033	振钢科技	4,566,680	156,601,457.20	5.12
700001	华信国际	13,681,061	156,601,457.20	5.12
600301	鲁信矿业	4,539,690	152,323,820.38	4.98
002428	华信国际	7,112,736	144,246,281.08	4.72
600146	峨边铝业	3,975,695	127,277,758.12	4.17
000077	华能国际	21,006,102	286,468,054.00	8.46
000060	中金岭南	19,613,497	256,321,469.02	8.27
000007	云南铜业	36,361,313	241,761,940.47	8.32
000000	中金岭南	13,460,972	188,367,437.16	6.18
600497	世纪铝业	17,015,961	167,266,204.4	6.15
600033	振钢科技	4,566,680	156,601,457.20	5.12
700001	华信国际	13,681,061	156,601,457.20	5.12
600301	鲁信矿业	4,539,690	152,323,820.38	4.98
002428	华信国际	7,112,736	144,246,281.08	4.72
600146	峨边铝业	3,975,695	127,277,758.12	4.17
000077	华能国际	21,006,102	286,468,054.00	8.46
000060	中金岭南	19,613,497	256,321,469.02	8.27
000007	云南铜业	36,361,313	241,761,940.47	8.32
000000	中金岭南	13,460,972	188,367,437.16	6.18
600497	世纪铝业	17,015,961	167,266,204.4	6.15
600033	振钢科技	4,566,680	156,601,457.20	5.12
700001	华信国际	13,681,061	156,601,457.20	5.12
600301	鲁信矿业	4,539,690	152,323,820.38	4.98
002428	华信国际	7,112,736	144,246,281.08	4.72
600146	峨边铝业	3,975,695	127,277,758.12	4.17
000077	华能国际	21,006,102	286,468,054.00	8.46
000060	中金岭南	19,613,497	256,321,469.02	8.27
000007	云南铜业	36,361,313	241,761,940.47	8.32
000000	中金岭南	13,460,972	188,367,437.16	6.18
600497	世纪铝业	17,015,961	167,266,204.4	6.15
600033	振钢科技	4,566,680	156,601,457.20	5.12
700001	华信国际	13,681,061	156,601,457.20	5.12
600301	鲁信矿业	4,539,690	152,323,820.38	4.98
002428	华信国际	7,112,736	144,246,281.08	4.72
600146	峨边铝业	3,975,695	127,277,758.12	4.17
000077	华能国际	21,006,102	286,468,054.00	8.46
000060	中金岭南	19,613,497	256,321,469.02	8.27
000007	云南铜业	36,361,313	241,761,940.47	8.32
000000	中金岭南	13,460,972	188,367,437.16	6.18
600497	世纪铝业	17,015,961	167,266,204.4	6.15
600033	振钢科技	4,566,680	156,601,457.20	5.12
700001	华信国际	13,681,061	156,601,457.20	5.12
600301	鲁信矿业	4,539,690	152,323,820.38	4.98
002428	华信国际	7,112,736	144,246,281.08	4.72
600146	峨边铝业	3,975,695	127,277,758.12	4.17
000077	华能国际	21,006,102	286,468,054.00	8.46
000060	中金岭南	19,613,497	256,321,469.02	8.27
000007	云南铜业	36,361,313	241,761,940.47	8.32
000000	中金岭南	13,460,972	188,367,437.16	6.18
600497	世纪铝业	17,015,961	167,266,204.4	6.15
600033	振钢科技	4,566,680	156,601,457.20	5.12
700001	华信国际	13,681,061	156,601,457.20	5.12
600301	鲁信矿业	4,539,690	152,323,820.38	4.98
002428	华信国际	7,112,736	144,246,281.08	4.72
600146	峨边铝业	3,975,695	127,277,758.12	4.17
000077	华能国际	21,006,102	286,468,054.00	8.46
000060	中金岭南	19,613,497	256,321,469.02	8.27
000007	云南铜业	36,361,313	241,761,940.47	8.32
000000	中金岭南	13,460,972	188,367,437.16	6.18
600497	世纪铝业	17,015,961	167,266,204.4	6.15
600033	振钢科技	4,566,680	156,601,457.20	5.12
700001	华信国际	13,681,061	156,601,457.20	5.12
600301	鲁信矿业	4,539,690	152,323,820.38	4.98
002428	华信国际	7,112,736	144,246,281.08	4.72
600146	峨边铝业	3,975,695	127,277,758.12	4.17
000077	华能国际	21,006,102	286,468,054.00	8.46
000060	中金岭南	19,613,497	256,321,469.02	8.27
000007	云南铜业	36,361,313	241,761,940.47	8.32
000000	中金岭南	13,460,972	188,367,437.16	6.18
600497	世纪铝业	17,015,961	167,266,204.4	6.15
600033	振钢科技	4,566,680	156,601,457.20	5.12
700001	华信国际	13,681,061	156,601,457.20	5.12
600301	鲁信矿业	4,539,690	152,323,820.38	4.98
002428	华信国际	7,112,736	144,246,281.08	4.72
600146	峨边铝业	3,975,695	127,277,758.12	4.17
000077	华能国际	21,006,102	286,468,054.00	8.46
000060	中金岭南	19,613,497	256,321,469.02	8.27
000007	云南铜业	36,361,313	241,761,940.47	8.32
000000	中金岭南	13,460,972	188,367,437.16	6.18
600497	世纪铝业	17,015,961	167,266,204.4	6.15
600033	振钢科技	4,566,680	156,601,457.20	5.12
700001	华信国际	13,681,061	156,601,457.20	5.12
600301	鲁信矿业	4,539,690	152,323,820.38	4.98
002428	华信国际	7,112,736	144,246,281.08	4.72
600146	峨边铝业	3,975,695	127,277,758.12	4.17
000077	华能国际	21,006,102	286,468,054.00	8.46
000060	中金岭南	19,613,497	256,321,469.02	8.27
000007	云南铜业	36,361,313	241,761,940.47	8.32
000000	中金岭南	13,460,972	188,367,437.16	6.18
600497	世纪铝业	17,015,961	167,266,204.4	6.15
600033	振钢科技	4,566,680	156,601,457.20	5.12
700001	华信国际	13,681,061	156,601,457.20	5.12
600301	鲁信矿业	4,539,690	152,323,820.38	4.98
002428	华信国际	7,112,736	144,246,281.08	4.72
600146	峨边铝业	3,975,695	127,277,758.12	4.17
000077	华能国际	21,006,102	286,468,054.00	8.46
000060	中金岭南	19,613,497	256,321,469.02	8.27
000007	云南铜业	36,361,313	241,761,940.47	8.32
000000	中金岭南	13,460,972	188,367,437.16	6.18
600497	世纪铝业	17,015,961	167,266,204.4	6.15
600033	振钢科技	4,566,680	156,601,457.20	5.12
700001	华信国际	13,681,061	156,601,457.20	5.12
600301	鲁信矿业	4,539,690	152,323,820.38	4.98