长信利广灵活配置混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:广发证券股份有限公司
送出日期:2016年3月26日

§1 重要提示

基金管理人于2015年11月5日至2015年11月25日以通讯方式召开了长信利广灵活配置混合型证券投资基金的基金份额持有人大会,审议《关于调整长信利广灵活配置混合型证券投资基金赎回费率及修改法律文件的议案》,于2015年11月26日表决通过,本次大会决议自该日起生效,议案通过事项于2015年11月30日起实施。

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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金基金合同的规定,于2016年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和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。

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6月12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	长信利广混合	
场内简称	长信利广	
基金主代码	519961	
基金运作方式	契约型开发式	
基金合同生效日	2015年6月12日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,498,343,900.09份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信利广混合A	长信利广混合C
下属分级基金场内简称	利广A	利广C
下属分级基金的交易代码	519961	519960
报告期末下属分级基金的份额总额	1,000,332,958.78份	498,010,941.31份

注:长信利广灵活配置混合型证券投资基金金份额持有人大会审议通过如下事项:

1.增设基金份额类别,在原基金份额(决议生效并实施后为A类基金份额)基础之上,增加C类基金份额。

2.调整基金赎回费率。

上述审议通过的事项自2015年11月30日起实施。

具体事宜可详见基金管理人于2015年11月30日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信利广灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金,通过积极灵活的资产配置,在有效控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1.资产配置策略 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。 2.股票投资策略 (1)行业配置策略 在行业配置层面,本基金将运用"自上而下"的行业配置方法,通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究,采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。 (2)个股投资策略 本基金将结合定性与定量分析,主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围,基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析,筛选出基本面良好的股票进行投资,在有效控制风险前提下,争取实现基金资产的长期稳健增值。 3.债券投资策略 本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略,灵活地调整组合的券种搭配,精选安全边际较高的个券,力争实现组合的绝对收益。 4.其他类型资产投资策略 在法律法规或监管机构允许的情况下,本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券、股指期货等金融工具的投资。
业绩比较基准	银行一年期定期存款利率(税后)+3%
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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	王玮
	联系电话	021-61009999	020-87555888-6052
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	wwei@gf.com.cn
客户服务电话		4007005566	95575
传真		021-61009800	020-87555129

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、广东省广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

§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6月12日(基金合同生效日)至2015年12月31日	2015年11月30日(基金份额增加日)至2015年12月31日
	长信利广混合A	长信利广混合C
本期已实现收益	7,204,465.49	-574,893.02
本期利润	11,107,036.79	2,260,326.03
加权平均基金份额本期利润	0.0634	0.0283
本期基金份额净值增长率	1.00%	0.30%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0065	0.0046
期末基金资产净值	1,010,776,409.85	503,160,718.21
期末基金份额净值	1.010	1.010

注:1.本基金基金合同生效日为2015年6月12日,长信利广混合A的报告期为2015年6月12日至2015年12月31日;长信利广混合C基金份额增加日为2015年11月30日,报告期为2015年11月30日至2015年12月31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

3.2.1.1 长信利广混合A份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

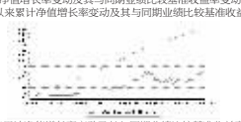
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.50%	0.05%	1.13%	0%	-0.63%	0.05%
自基金合同生效日起至今(2015年6月12日-2015年12月31日)	1.00%	0.05%	2.66%	0%	-1.66%	0.05%

3.2.1.2 长信利广混合C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	0.30%	0.04%	0.40%	0%	-0.10%	0.04%
自基金份额增加日起至今(2015年11月30日-2015年12月31日)	0.30%	0.04%	0.40%	0%	-0.10%	0.04%

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

3.2.2.1 长信利广混合A自基金合同生效以来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.长信利广混合A图示日期为2015年6月12日至2015年12月31日,长信利广混合C图示日期为2015年11月30日(份额增加日)至2015年12月31日。自基金合同生效日(2015年6月12日)至报告期期末,本基金运作时间未满一年。

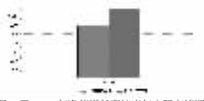
2.按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年;建仓期结束时,本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

3.2.3 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

3.2.3.1 长信利广混合A 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:长信利广混合A合同生效日为2015年6月12日,2015年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.2.3.2 长信利广混合C自基金份额增加日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:长信利广混合C份额增加日为2015年11月30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6月12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(ODII)、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、长信纯债滚动债券、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、长信利丰混合、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		
刘波	本基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众分级债券型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理	2015年6月12日	-	8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3月加入长信基金管理有限公司,任固定收益部基金经理助理,曾任长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理。现任本基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众分级债券型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金和长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

注:1.首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准;新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。

2.本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

3.在本报告期末(2015年12月31日)至报告送出日(2016年3月26日)之间,李小羽先生自2016年1月27日起兼任长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理,自2016年1月29日起兼任长信利广灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

4.在本报告期末(2015年12月31日)至报告送出日(2016年3月26日)之间,刘波先生自2016年1月27日起兼任长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理,自2016年3月9日起兼任长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《长信利广灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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日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±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,公司在获配缴款环节,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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年,美国经济复苏情况确立,就业指标持续向好,失业率下降至5.0%,美联储如期在12月选择加息;欧元区经济缓慢复苏,失业率维持高位,欧央行在年底选择负利率并延长QE来抵制通缩风险;日本工业生产及消费等数据不及预期,也实行了负利率。2015年美元加息因素导致新兴市场汇率波动明显加大,贬值预期上升,经济增速普遍下行。国内方面,2015年上半年经济显示出短暂复苏迹象,二季度之后基建和房地产投资动力减弱,出口持续负增长,经济增速再次面临下行压力。2015年央行选择五次降息和四次降准以应对经济下行的风险,年中汇率出现较大波动。市场方面,受经济下行及货币政策宽松预期影响,债券市场延续了2014年以来的牛市,利率债及信用债收益率均出现了大幅度下行,可转债市场受制于高估值及权益市场的大幅波动,也呈现出较大波动。上半年IPO制度红利使打新存在不错的投资机会,年中权益市场波动导致IPO暂停,直至年底28只新股重启发售。

报告期内,考虑到IPO制度的变化,本基金在IPO暂停期间以现金管理策略为主,适当增加了长期利率债的配置比例,年底IPO重启后,本基金降低了债券类资产,同时标配权益类资产使组合达到新股申购资格,积极参与新股申购,以期获得相对稳定的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,长信利广混合A份额净值为1.010元,份额累计净值为1.010元,本报告期长信利广混合A净值增长率为1.00%,同期业绩比较基准收益率为2.66%;长信利广混合C份额净值为1.010元,份额累计净值为1.010元,2015年11月30日至2015年12月31日期间长信利广混合C净值增长率为0.30%,同期业绩比较基准收益率为0.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,美联储加息以及后续的加息预期可能导致国际资本继续回流美国,并加大新兴经济体汇率波动,汇率风险加大。供给侧改革短期内使国内经济依然面临较大的下行压力,经济的企稳需要更多政策的托底,未来货币政策及财政政策均有加码的空间,期间汇率波动可能影响政策发力的节奏。就市场而言,经济的下行压力可能使利率继续保持下行,利率风险相对可控;供给侧改革及产能出清会进一步加大信用风险暴露,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,产业债需要进一步加强个券精选;可转债一级市场重启,新增标的有利于化解存量转债的估值压力,等待时机寻找其中交易性机会。新的IPO制度下,新股发行取消预缴款规则,未来本基金将结合债券市场情况适时进行债券资产配置,同时关注注册制改革对IPO的影响,以便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。

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、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.由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

3.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;

4.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;

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广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,长信利广灵活配置混合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利广灵活配置混合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利广灵活配置混合型证券投资基金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6月12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1600157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:长信利广灵活配置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
资 产:	
银行存款	134,278,041.43
结算备付金	34,068,832.06
存出保证金	210,340.75
交易性金融资产	66,916,810.57
其中:股票投资	36,913,810.57
基金投资	-
债券投资	30,003,000.00
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	1,278,001,180.00
应收证券清算款	499,094,403.72
应收利息	2,079,433.13
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	2,014,649,041.66
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	499,000,000.00
应付赎回款	1,004.50
应付管理人报酬	1,003,363.77
应付托管费	313,551.18
应付销售服务费	99,607.82
应付交易费用	84,385.70
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	210,000.63
负债合计	500,711,913.60
所有者权益:	
实收基金	1,498,343,900.09
未分配利润	15,593,227.97
所有者权益合计	1,513,937,128.06
负债和所有者权益总计	2,014,649,041.66

注:1、报告截止日2015年12月31日,长信利广混合A份额净值1.010元,长信利广混合C份额净值1.010元,基金份额总额为1,498,343,900.09份,其中长信利广混合A份额1,000,332,958.78份;长信利广混合C份额498,010,941.31份;

2.本基金本报告期为2015年6月12日至2015年12月31日,本基金基金合同于2015年6月12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:长信利广灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年6月12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6月12日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一.收入	20,503,922.31
1.利息收入	11,402,711.86
其中:存款利息收入	1,411,580.75
债券利息收入	3,377,092.97
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	6,614,038.14
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	630,815.45
其中:股票投资收益	-1,105,372.65
基金投资收益	-
债券投资收益	1,736,188.10
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	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6,737,790.35
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,732,604.65
减:二.费用	7,236,001.14
1. 管理人报酬	4,940,020.36
2. 托管费	1,543,756.31
3. 销售服务费	99,607.82
4. 交易费用	368,873.30
5. 利息支出	12,062.16
其中:卖出回购金融资产支出	12,062.16
6. 其他费用	271,681.19
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	13,267,921.17
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	13,267,921.17

注:本基金本报告期为2015年6月12日至2015年12月31日,本基金基金合同于2015年6月12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:长信利广灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年6月12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6月12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)	261,102,567.29	-	261,102,567.29
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,267,921.17	13,267,921.17
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)	1,237,241,332.80	2,325,306.80	1,239,566,639.60
其中:1.基金申购款	1,698,378,475.23	2,990,188.93	1,701,368,664.16
2.基金赎回款	-461,137,142.43	-664,882.13	-461,802,024.56
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)	1,498,343,900.09	15,593,227.97	1,513,937,128.06

注:本基金本报告期为2015年6月12日至2015年12月31日,本基金基金合同于2015年6月12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:

叶烨	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

长信利广灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")于2015年5月26日经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于准予长信利广灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》证监许可[2015]986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《长信利广灵活配置混合型证券投资基金合同》发售,基金合同于2015年6月12日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金为混合型基金,通过积极灵活的资产配置,在有效控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。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"广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券")。

本基金于2015年6月8日至2015年6月9日募集,募集资金总额人民币261,090,782.24元,利息转份额人民币11,785.05元,募集规模为261,102,567.29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1500366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、《长信利广灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长信利广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、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:银行一年期定期存款利率(税后)+3%

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1》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6月12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6月12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、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券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公允价值进行列示。

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,于资产负债表内确认。

在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。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,金融资产和金融负债的后续计量如下:

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。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

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采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

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:

一所转移金融资产的账面价值

一因转移而收到的对价

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。

存在活跃市场的金融工具按其活跃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。

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:

一本基金具有抵销已确认金额的法定权利,且该种法定权利是当前可执行的;

一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。其中,本期申购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,并于会计期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益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