

## 长信量化多策略股票型证券投资基金

## [2015]第四季度报告

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

报告送出日期:2016年1月20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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	长信量化多策略股票
场内简称	量化策略
基金代码	519906
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年7月14日
报告期末基金的份额总额	91,221,771.78份
报告期利润	
基金份额净值	
基金总资产	
报告期末持有的各类资产占基金资产的比例	
投资目标	本基金通过数量化的方法进行相对的组合管理与风险管理，力求实现超越业已公布的基准的回报率的长期增长。
基金的运作策略	本基金将通过量化模型，将投资组合通过具体指标，参数的动态调整，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格，投资操作透明，投资风格稳定，投资组合风险低下的特点，从而达到投资者的资产配置和长期的资产增值。
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，属较高预期收益和较高预期风险的基金品种。
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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	54,427,606.67
2.本期利润	110,100,460.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.04702
4.期末基金份额净值	111,142,362.97
5.期末基金净值	1,218

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将低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 本基金报告期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

单位:人民币元

主要财务指标	净值增长率为①	业绩比较基准收益率为②	差额为③	差额为④
1.本期已实现收益	54,427,606.67	54,427,606.67	0.00	0.00

注:本基金报告期未通过沪港通交易机制投资港股。

5.3.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.3 报告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

5.3.4 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债券投资明细

5.3.5 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

5.3.6 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贱金属投资明细

5.3.7 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

5.3.8 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贱金属投资明细

5.3.9 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

5.3.10 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

5.3.11 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

5.3.12 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

5.3.13 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

5.3.14 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

5.3.15 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

5.3.16 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

5.3.17 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

5.3.18 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

5.3.19 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

5.3.20 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

5.3.21 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

5.3.22 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

5.3.23 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

5.3.24 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

5.3.25 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

5.3.26 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

5.3.27 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

5.3.28 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

5.3.29 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

5.3.30 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

5.3.31 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

5.3.32 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

5.3.33 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

5.3.34 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

5.3.35 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

5.3.36 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

5.3.37 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

5.3.38 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

5.3.39 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

5.3.40 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

5.3.41 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

5.3.42 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

5.3.43 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

5.3.44 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

5.3.45 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

5.3.46 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

5.3.47 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

5.3.48 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

5.3.49 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

5.3.50 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

5.3.51 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

5.3.52 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

5.3.53 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

5.3.54 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

5.3.55 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

5.3.56 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

5.3.57 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

5.3.58 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

5.3.59 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

5.3.60 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

5.3.61 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

5.3.62 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

5.3.63 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

5.3.64 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

5.3.65 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

5.3.66 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

5.3.67 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

5.3.68 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

5.3.69 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

5.3.70 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

5.3.71 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

5.3.72 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

5.3.73 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

5.3.74 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

5.3.75 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

5.3.76 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

5.3.77 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

5.3.78 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

5.3.79 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

5.3.80 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

5.3.81 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

5.3.82 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

5.3.83 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

5.3.84 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

5.3.85 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

5.3.86 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

5.3.87 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

5.3.88 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

5.3.89 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

5.3.90 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

5.3.91 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

5.3.92 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

5.3.93 报告期末按公允