

## 长信多利灵活配置混合型证券投资基金

[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：交通银行股份有限公司

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高级管理人员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。

基金经理人通过履行职责和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，确认本基金不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经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未来表现。投资人投资前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	股权投资	667,496,500.03	80.31
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
4	其中：债券	—	—
5	货币市场基金	—	—
6	贵金属投资	—	—
7	买入返售金融资产	—	—
8	银行存款和结算备付金合计	162,194,299.24	19.51
9	其他资产	1,460,398.20	0.18
	合计	831,111,198.37	100.00

注：本基金在本报告期末通过的“沪港通交易机制投资港股”。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	—	—	—
B 矿业	—	—	—
C 制造业	352,790,086.66	42.82	—
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,620,240.00	3.47	—
E 建筑业	—	—	—
F 批发和零售业	—	—	—
G 交通运输、仓储和邮政业	—	—	—
H 住宿和餐饮业	17,754,000.00	2.16	—
I 信息传输、软件和信息技术服务业	33,132,810.66	4.02	—
J 金融业	231,366,962.72	28.08	—
K 动物、水产养殖业	—	—	—
L 租赁和商务服务业	—	—	—
M 科学研究、技术服务业	—	—	—
N 水利、环境和公共设施管理业	—	—	—
O 固定资产购建、修理和租赁业	—	—	—
P 教育	—	—	—
Q 卫生和社会工作	3,842,500.00	0.47	—
R 文化、体育和娱乐业	—	—	—
S 酒、饮料和精制茶业	—	—	—
合计	667,496,500.03	81.03	—

注：本基金在本报告期末通过的“沪港通交易机制投资港股”。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资组合

序号	股票代码	股票名称	股份数(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600062	国泰航空	12,186,106	70,360,643.84	85.62
2	600343	航天动力	2,478,000	62,362,460.00	7.69
3	002625	龙生控股	1,263,090	60,962,342.00	7.40
4	002023	海特高新	2,992,317	44,898,363.78	6.66
5	600038	中直股份	899,921	47,462,834.33	7.07
6	002736	围海股份	1,325,642	30,631,425.00	4.62
7	601717	光大证券	1,537,400	20,267,960.00	2.68
8	600839	西南证券	3,528,800	34,035,120.00	4.24
9	601901	万正证券	3,499,464	32,599,946.00	4.08
10	002524	中南建设	799,024	33,132,810.66	4.02
合计				667,496,500.03	81.03

注：本基金在本报告期末通过的“沪港通交易机制投资港股”。

5.3 主要财务指标

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)	年初至报告期末
1.本期已实现收益	90,016,733.67	219,103,311.96
2.本期利润	—	—
3.期初平均基金份额净值	0.4247	0.4247
4.期末基金份额净值	0.4247	0.4247
5.期末可供分配基金份额净值	0.4247	0.4247
6.期末基金资产净值	823,812,362.91	823,812,362.91

注：本基金每份基金份额初始面值为1.00元，本基金运作时间不满一年，因此本报告期未将本期可供分配收益计入收益。

5.4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)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

张洁群 本基金的基金经理及基金经理助理 11年 管理学硕士，中国人民大学工商企业管理专业本科毕业，具有基金从业资格，曾就职于北京人民广播电台，从教并从事管理咨询工作，现就职于本公司，担任基金经理助理、基金经理和基金经理助理。

胡晓东 本基金的基金经理及基金经理助理 11年 管理学硕士，具有基金从业资格，曾就职于本公司，担任基金经理助理。

注：本基金的基金经理及基金经理助理由本公司总经理办公会任命。

5.5 基金销售机构

5.5.1 本基金销售机构包括直销机构和代销机构。

5.5.2 直销机构

5.5.3 代销机构

5.5.4 其他销售渠道

5.5.5 其他销售渠道

5.5.6 其他销售渠道

5.5.7 其他销售渠道

5.5.8 其他销售渠道

5.5.9 其他销售渠道

5.5.10 其他销售渠道

5.5.11 其他销售渠道

5.5.12 其他销售渠道

5.5.13 其他销售渠道

5.5.14 其他销售渠道

5.5.15 其他销售渠道

5.5.16 其他销售渠道

5.5.17 其他销售渠道

5.5.18 其他销售渠道

5.5.19 其他销售渠道

5.5.20 其他销售渠道

5.5.21 其他销售渠道

5.5.22 其他销售渠道

5.5.23 其他销售渠道

5.5.24 其他销售渠道

5.5.25 其他销售渠道

5.5.26 其他销售渠道

5.5.27 其他销售渠道

5.5.28 其他销售渠道

5.5.29 其他销售渠道

5.5.30 其他销售渠道

5.5.31 其他销售渠道

5.5.32 其他销售渠道

5.5.33 其他销售渠道

5.5.34 其他销售渠道

5.5.35 其他销售渠道

5.5.36 其他销售渠道

5.5.37 其他销售渠道

5.5.38 其他销售渠道

5.5.39 其他销售渠道

5.5.40 其他销售渠道

5.5.41 其他销售渠道

5.5.42 其他销售渠道

5.5.43 其他销售渠道

5.5.44 其他销售渠道

5.5.45 其他销售渠道

5.5.46 其他销售渠道

5.5.47 其他销售渠道

5.5.48 其他销售渠道

5.5.49 其他销售渠道

5.5.50 其他销售渠道

5.5.51 其他销售渠道

5.5.52 其他销售渠道

5.5.53 其他销售渠道

5.5.54 其他销售渠道

5.5.55 其他销售渠道

5.5.56 其他销售渠道

5.5.57 其他销售渠道

5.5.58 其他销售渠道

5.5.59 其他销售渠道

5.5.60 其他销售渠道

5.5.61 其他销售渠道

5.5.62 其他销售渠道

5.5.63 其他销售渠道

5.5.64 其他销售渠道

5.5.65 其他销售渠道

5.5.66 其他销售渠道

5.5.67 其他销售渠道

5.5.68 其他销售渠道

5.5.69 其他销售渠道

5.5.70 其他销售渠道

5.5.71 其他销售渠道

5.5.72 其他销售渠道

5.5.73 其他销售渠道

5.5.74 其他销售渠道

5.5.75 其他销售渠道