长盛电子信息产业混合型证券投资基金 [2015] 年度报告摘要

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2016年3月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,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、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。

本年度报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2015年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛电子信息产业混合
基金主代码	080012
交易代码	080012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月27日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,048,180,335.58份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于电子信息产业上市公司股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	(1)分析宏观经济运行状况、市场估值水平等因素,动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。(2)发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,判断公司的核心价值与成长能力,选择具有竞争优势且估值具有吸引力的公司作为投资标的,根据市场波动情况精选个股,构建股票投资组合。
业绩比较基准	中证信息技术指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

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		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcsh@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	95566
传真		010-82266881	010-66594942

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	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

§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	2,025,470,375.33	625,786,283.84	138,008,315.38
本期利润	1,888,503,344.48	863,454,773.28	172,861,765.45
加权平均基金份额本期利润	1.6933	0.4049	0.5443
本期基金份额净值增长率	88.27%	36.10%	74.26%
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	1.7134	0.1694	0.0073
期末基金资产净值	2,844,179,884.49	2,893,635,110.56	1,244,378,963.55
期末基金份额净值	2.713	1.441	1.173

注:1.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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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.期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。表中的“期末”均指本报告期最后一日,即12月31日。

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	39.18%	2.03%	26.25%	1.96%	13.60%	0.08%
过去六个月	20.79%	2.96%	-7.74%	2.80%	28.53%	0.15%
过去一年	88.27%	2.69%	52.21%	2.51%	36.06%	0.18%
过去三年	346.54%	1.93%	144.81%	1.81%	201.73%	0.12%
自基金合同生效起至今	318.83%	1.79%	126.14%	1.70%	192.69%	0.09%

注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

本基金业绩比较基准:80%×中证信息技术指数收益率 + 20%×中证综合债指数收益率

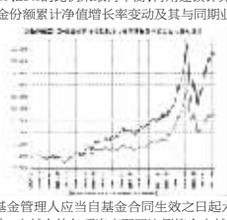
基准指数的构建考虑了三个原则:

1、公允性。本基金为行业主题混合型基金,在综合比较目前市场上各主要行业指数的编制特点后,本基金选择以中证信息技术指数作为股票投资的业绩比较基准。中证信息技术指数是中证指数公司为反映A股中信息技术行业公司股票的整体表现,将中证800成分股中信息技术行业中的全部股票作为样本所编制的行业指数。本基金主要投资于电子信息产业上市公司股票,从而中证信息技术指数适合作为本基金的业绩比较基准。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响,本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于电子信息产业的上市公司股票不低于股票类资产的80%;债券投资占基金资产的0%-40%;权证投资占基金资产净值的比例不高于3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数,使业绩比较更具有合理性。

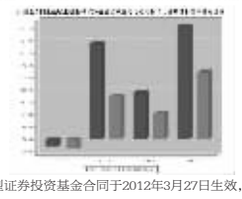
3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照80%、20%的比例采取再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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:按照本基金合同规定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四条(二)投资范围、(八)投资禁止行为与限制的有关约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

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



注:长盛电子信息产业混合型证券投资基金合同于2012年3月27日生效,合同生效当年按照实际存续期计算,未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	-	-	-	-	-
2014	1.4500	285,231,182.23	90,086,301.14	375,317,483.37	-
2013	4.1000	230,542,887.01	51,527,725.74	282,070,612.75	-
合计	5.5500	515,774,049.24	141,614,026.88	657,388,076.12	-

§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

本基金管理人为长盛基金管理有限公司(以下简称“公司”),成立于1999年3月26日,是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币18900万元。公司注册地在深圳,总部设在北京,并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司,在香港、北京分别设有子公司。目前,公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司(以下简称“国元证券”)占注册资本的41%,新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%,安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%,安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至2015年12月31日,基金管理人共管理四十二只开放式基金,并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外QFII基金和专户理财产品的投资顾问。

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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵楠	本基金基金经理,长盛新兴成长主题混合型证券投资基金基金经理,长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015年8月14日	-	9年	男,1980年3月出生,中国国籍。经济学学士,北京大学光华MBA在读。历任安信证券研究中心研究员,光大永明资产管理股份有限公司权益投资部高级投资经理,资源股票投资经理,权益创新业务负责人,现任总部执行董事等职务。2015年2月加入长盛基金管理有限公司,现任长盛电子信息产业混合型证券投资基金(本基金)基金经理。长盛新兴成长主题混合型证券投资基金基金经理,长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
乔培涛	本基金基金经理助理,行业研究员。	2015年6月16日	-	7年	男,1979年12月出生,中国国籍,清华大学硕士,2011年8月加入长盛基金管理有限公司,现任行业研究员,长盛新天商工贸各项活动配置混合型证券投资基金基金经理助理,长盛电子信息产业混合型证券投资基金(本基金)基金经理助理。
王克玉	本基金基金经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理,长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,权益投资部副总监。	2012年3月27日	2015年8月14日	12年	男,1979年12月出生,中国国籍,上海交通大学硕士,历任元大京华证券上海代表处研究员,天相投资顾问有限公司分析师,国都证券有限公司分析师。2006年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任高级行业研究员,同盛证券投资基金基金经理助理,同益证券投资基金基金经理,长盛同祥泛资源主题混合型证券投资基金基金经理等职务。任权益投资部副总监。长盛电子信息产业混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理,长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。自2015年8月14日起不再担任长盛电子信息产业混合型证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经理及基金经理助理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,确保公平对待不同投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等,切实防范利益输送,保护投资者的合法权益。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送,保护投资者的合法权益。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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年市场剧烈波动,但总体来讲投资机会较多,全年上证指数上涨9.41%,沪深300指数上涨5.58%,中小板上涨53.7%,创业板上涨84.41%,电子信息产业品的投资方向主要集中在中小板和创业板,相应的也取得历史上最好的年度投资收益,年度净值上涨88.27%。

全年来看,产品在投资运作方面更加注重了风险控制和回撤,尤其是市场8月份的快速下跌,净值回撤相对较小。在一季度和四季度也相应的把握了市场上涨带来的投资机会。

产品的投资运作,继续坚持长期、稳健风格,以持有人利益、控制风险为首要目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为2.713元,本报告期份额净值增长率为88.27%,同期业绩比较基准增长率为52.21%。

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,我们并不悲观,在市场波动中寻找投资机会,在新兴成长行业中,坚持长期持有有竞争力的优秀公司。

具体来讲,在经济方面,中国经济面临通缩风险,随着中央政府在年内推出结构性的供给侧改革同时需求方面的刺激,中国经济年内有望企稳。人民币汇率风险可控,中长期人民币仍具有较大的升值潜力,汇率年内贬值幅度有限,对汇率风险不应过度解读和恐慌。

在股票市场方面,我们相信以医药、TMT为主的新兴产业,未来仍具有发展潜力。有竞争力优势的公司坚持长期持有,分享行业、公司成长。在经济企稳有明显信号的时候,金融、周期性会有不错的投资机会。在配置方向上,以成长股为主,金融、周期股为辅。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定,本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值小组,参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据,确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理(担任估值小组组长)、公司副总经理和督察长(担任估值小组副组长)、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组,负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验,具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议,由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十九条中对基金利润分配原则的约定,本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至2015年12月31日,期末可供分配利润为1,795,999,548.91元,其中:未分配利润已实现部分为2,177,462,808.42元,未分配利润未实现部分为-381,463,259.51元。

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

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§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,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对长盛电子信息产业混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师陈玲、沈兆杰于2016年3月22日对本基金2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2016)第20231号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:长盛电子信息产业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
资 产:		
银行存款	170,014,702.26	357,990,439.29
结算备付金	15,483,561.66	11,668,024.46
存出保证金	1,897,157.87	522,956.67
交易性金融资产	1,617,590,640.26	2,528,782,284.67
其中:股票投资	1,617,590,640.26	2,498,077,191.07
基金投资	-	-
债券投资	-	30,705,093.60
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	1,060,000,000.00	32,900,000.00
应收证券清算款	-	7,169,150.27
应收利息	58,561.40	402,688.24
应收股利	-	-
应收申购款	33,540,568.51	13,272,206.93
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,898,585,181.96	2,952,697,749.53
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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	29,790,403.06	8,280,624.97
应付赎回款	14,630,581.17	43,145,698.75
应付管理人报酬	3,406,714.99	4,212,022.50
应付托管费	567,785.80	702,003.75
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,660,410.60	2,289,348.92
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	349,401.85	432,940.08
负债合计	54,405,297.47	59,062,638.97
所有者权益:		
实收基金	1,048,180,335.58	2,008,684,188.52
未分配利润	1,796,999,548.91	884,980,922.04
所有者权益合计	2,844,179,884.49	2,893,635,110.56
负债和所有者权益总计	2,898,585,181.96	2,952,697,749.53

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.713元,基金份额总额1,048,180,335.58份。

7.2 利润表

会计主体:长盛电子信息产业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

资 产	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
一、收入	1,953,716,756.91	924,987,788.43
1.利息收入	5,365,220.75	17,216,087.56
其中:存款利息收入	3,586,002.09	4,240,641.23
债券利息收入	35,284.14	74,396.26
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,743,934.52	12,901,050.01
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	2,075,308,909.48	662,156,443.81
其中:股票投资收益	2,072,174,922.90	638,408,758.34
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,924,991.44	5,894,377.54
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	6,068,978.02	17,853,307.93
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-136,967,030.85	237,668,489.44
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	10,009,658.53	7,946,767.68
减:二、费用	65,213,406.43	61,533,015.15
1. 管理人报酬	33,858,110.54	43,139,577.01
2. 托管费	5,643,018.39	7,189,929.49
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	25,274,910.18	10,751,273.11
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	437,367.32	452,235.54
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	1,888,503,344.48	863,454,773.28
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	1,888,503,344.48	863,454,773.28

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛电子信息产业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)	2,008,684,188.52	884,980,922.04	2,893,635,110.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,888,503,344.48	1,888,503,344.48
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)	-960,473,852.94	-977,484,717.61	-1,937,958,570.55
其中:1.基金申购款	3,110,622,524.88	3,440,726,533.83	6,551,349,058.71
2.基金赎回款	-4,071,096,377.82	-4,418,211,251.44	-8,489,307,629.26
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)	1,048,180,335.58	1,796,999,548.91	2,844,179,884.49

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)	1,060,600,981.01	183,777,982.54	1,244,378,963.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	863,454,773.28	863,454,773.28
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)	947,993,207.51	213,125,649.59	1,161,118,857.10
其中:1.基金申购款	5,689,890,538.53	1,948,708,030.96	7,638,598,569.49
2.基金赎回款	-4,741,897,331.02	-1,735,582,381.37	-6,477,479,712.39
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)	-	-375,317,483.37	-375,317,483.37
五、期末所有者权益(基金净值)	2,008,684,188.52	884,980,922.04	2,893,635,110.56

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:

_____周兵_____ _____杨思乐_____ _____龚珉____

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

长盛电子信息产业混合型证券投资基金(原名为长盛电子信息产业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”)证监许可[2012]194号《关于核准长盛电子信息产业股票型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币436,781,526.34元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第071号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同》于2012年3月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为436,879,183.47份基金份额,其中认购资金利息折合97,657.13份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同》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)、权证、债券、货币市场工具、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。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于电子信息产业的上市公司股票不低于股票类资产的80%;债券投资占基金资产的0%-40%;权证投资占基金资产净值的比例不高于3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:80%×中证信息技术指数收益率+20%×中证综合债指数收益率。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,长盛电子信息产业股票型证券投资基金于2015年7月16日公告后更名为长盛电子信息产业混合型证券投资基金。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于2016年3月22日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛电子信息产业混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度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日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于正在交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限责任公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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[2015]101号《关于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》及其他相关财税法规和实务操作,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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4) 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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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	33,858,110.54	43,139,577.01
其中:支付销售机构的客户维护费	10,086,990.31	11,130,209.34

注:支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 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	5,643,018.39	7,189,929.49

注:支付基金托管人中国银行 的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。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 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

注:本基金本期及上年度可比期间未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

注:本基金本期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资。

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

注:本基金本期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	170,014,702.26	3,437,713.75	357,990,439.29	3,778,937.46

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

注:本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300104	乐视网	2015年12月7日	重大事项停牌	60.17	-	-	800,000	48,648,750.60	48,136,000.00	-
300036	超图软件	2015年10月30日	重大事项停牌	43.18	2016年1月15日	35.11	799,944	19,128,186.80	34,541,581.92	-

注:本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值