长盛电子信息主题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26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	长盛电子信息主题混合
基金主代码	000063
交易代码	000063
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月10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	1,283,238,796.30份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	2.投资收益(损失以"-"填列) 7,646,063.97 其中:股票投资收益 93,511,141.81 9,114,765.82 基金投资收益 – -1,496,898.54 债券投资收益 – – 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 308,244.68 28,196.69 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) 146,182,941.08 393,003.07 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) – – 5.其他收入(损失以"-"号填列) 6,179,473.79 382,593.04 减:二、费用 28,967,574.95 2,536,502.53 1. 管理人报酬 16,060,517.55 469,569.86 2. 托管费 2,676,752.83 78,920.94 3. 销售服务费 – – 4. 交易费用 10,046,326.28 1,619,889.50 5. 利息支出 – – 其中:卖出回购金融资产支出 – – 6. 其他费用 183,978.37 368,122.23 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) 223,818,370.31 5,961,027.81 减:所得税费用 – – 四、净利润(净亏损以"-"号填列) 223,818,370.31 5,961,027.81

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:长盛电子信息主题灵活配置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)	60,172,675.44	-530,261.87	59,642,413.57
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	223,818,370.31	223,818,370.31
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)	1,223,066,110.86	1,741,758,548.62	2,964,824,659.48
其中:1.基金申购款	3,743,965,970.76	4,177,215,177.56	7,921,171,148.32
2.基金赎回款	-2,520,889,859.90	-2,435,456,628.94	-4,956,346,488.84
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)	1,283,238,786.30	1,965,046,657.06	3,248,285,443.36

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)	42,590,023.08	-2,907,123.77	39,682,899.31
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	5,961,027.81	5,961,027.81
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)	17,582,652.36	-3,584,165.91	13,998,486.45
其中:1.基金申购款	366,189,185.31	-29,137,600.44	337,052,284.87
2.基金赎回款	-348,607,202.95	25,553,434.53	-323,053,768.42
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)	60,172,675.44	-530,261.87	59,642,413.57

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。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	31.00%	2.23%	17.30%	1.19%	13.70%	1.04%
过去六个月	41.71%	1.99%	0.48%	1.67%	41.23%	0.32%
过去一年	155.40%	1.88%	41.72%	1.53%	113.68%	0.35%
自基金合同生效起至今	153.10%	1.51%	32.12%	1.26%	120.98%	0.25%

注:根据《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,业绩比较基准自2014年7月3日起,由"上证市值百强指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%"变为"50%×中证TMT产业主题指数收益率 +50%×中证综合债指数收益率",基金业绩比较基准收益率在变更前日期同时分别根据相应的指数计算。

本基金业绩比较基准:50%*中证TMT产业主题指数收益率 +50%*中证综合债指数收益率。

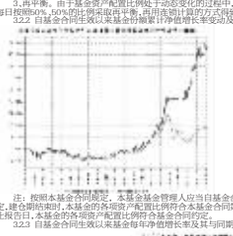
基准指数的构建考虑了三个原则:

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TMT产业主题指数作为股票投资的业绩比较基准,中证TMT产业主题指数由TMT产业中规模和流动性较好的100只公司股票组成,以反映A股上市公司中数字媒体相关产业投资的走势。本基金主要投资于电子信息主题相关产业上市公司股票,从而中证TMT产业主题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0%-95%,其余资产投资于银行存款、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具,其中投资于电子信息主题的股票和债券不低于非现金基金资产的80%。基准指数采用50%、50%的权数,是根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定的,这样使业绩比较基准具有合理性。

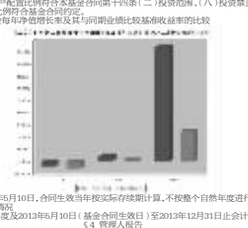
3.再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照50%、50%的比例来取百平衡,再用连续计算的方式得到基准指数的当期序列。

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,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起三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,本基金的投资组合比例应当符合本基金合同第十四条(二)投资组合比例(八)投资禁止行为与限制的有关约定。截止报告日,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份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同生效日为2013年5月10日,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去一年基金投资组合情况

注:本基金于2015年度,2014年度及2013年5月10日(基金合同生效日)至2013年12月31日止会计期间未进行利润分配。

§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

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15000万元,公司注册地在深圳,总部设在北京,并在北京、上海、深圳、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23%,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%,公司获得资格全国社保基金、合格境内机构投资者(简称"QFII")、企业年金、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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
赵宗宇	本基金基金经理,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。	2014年7月3日	–	8年	男,1972年6月出生,中国籍。四川大学工商管理学院管理学(金融校投资研究方向)博士。历任美国晨星公司投资顾问部门数量分析师,担任银行博士后工作站博士后研究员,2007年8月加入长盛基金管理公司,历任金融工程研究员、产品开发经理、首席产品开发师、金融工程与量化投资部副总监、长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理等职务。现任长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金(本基金)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。
杨衡	本基金基金经理,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,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015年6月18日	–	8年	男,1975年10月出生,中国籍,中国科学院数学与系统科学研究院博士,博士后。2007年7月进入长盛基金管理公司,历任固定收益研究员、社保组合组合经理、长盛组合组合经理助理,社保组合组合经理,长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。现任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,长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
翟宏垒	本基金基金经理,长盛动态精选证券投资基金基金经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2014年09月09日	2015年9月24日	6年	男,1982年3月出生,中国籍。中国人民银行研究生部经济学硕士。2009年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任行业研究员、基金经理助理,长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理等职务。任长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛动态精选证券投资基金基金经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。自2015年9月24日起不再担任长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:1.上表基金经理的任职日期和离任日期均按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《证券从业从业人员资格管理办法》的相关规定;

4.2 管理人对投资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》及其各项实施条例、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 管理人对投资期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 一级市场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报告,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资权与决策: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,所有投资组合的投资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,结内交易,强制并轨性交易系统公平交易程序,给外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理方式的监控与分析评价: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,发现公司管理层投向发现问题,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和利益输送的异常交易行为,从投资权,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 管理人对投资期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 投资期内基金投资策略和运作分析

本基金为电子信息主题基金,投资目标主要是电子、信息、传媒以及改进型信息技术进步驱动业绩增长的相关行业公司,基本反映电子信息的产业市场主题投资收益和风险特征。

回顾2015年度市场呈现暴涨暴跌的剧烈行情,市场波动及政策频繁扰动,特别是电子信息主题板块的波动性表现大幅超越市场平均水平。一方面电子信息板块与中小创板块有着高度的相关性,另一方面电子信息板块中也蕴含着最优质的成长性个股,也代表着新兴产业的投资方向。由于本基金在报告期内通过精选个股开及时调整仓位,在有效控制风险的同时获取了市场较突收益,使得本基金在度取业水平一直处于市场同类基金的前列。

本基金在基金合同允许的主题投资范围内,最大程度投资并跟踪分享电子信息主题及相关股票市值增长的红利。在报告期内操作中,基金管理人严格遵守基金合同,按照主题投资所定义的范围内精选个股,并进行灵活配置主题板块,尽而实现电子信息主题投资的目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末(2015年12月31日),本基金份额净值为2.531元,本报告期份额净值增长率为155.40%,同期业绩比较基准增长率为41.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为股票市场受益于经济环境与政策的好预期,以及各项经济改革的具体实施联动,预期2016年政策驱动的结构性市场行情有望获得延续。特别是随着各项经济改革及政策的逐步推进,作为新兴产业代表的电子、计算机、通讯及传媒主题板块预期会有一定上涨空间,特别是传媒及相关主题标是具有持续性成长投资机会的品种。

本基金作为专注于投资电子、计算机、通讯及传媒行业的主题投资基金,基金管理人将继续采录主题投资策略,积极应对市场及主题行业子板块的结构性业绩基本面变化,行业整体增长的趋势判断等因素对主题目标投资带来的影响,控制基金的结构性和不投资的配置风险,以实现投资组合取得电子信息主题投资收益目标,充分发挥投资市场的灵活性,为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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原则的规定,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分管总经理(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,具备基金估值业作、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。

参与估值程序的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人按照法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当有存有异议时,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。上述各与估值程序方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人公允列示中国银登记结算有限责任公司提供的证券投资基金估值表,由其分别按约定提供在银行间市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内利润分配情况的说明

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

本基金截至2015年12月31日,期末可供分配利润为1,107,129,510.26元,其中未分配利润已实现部分为1,107,129,510.26元,未分配利润未实现部分为857,917,146.80元。

4.8 报告期内投资组合情况

本基金在2015年1月15日至2015年4月9日、自2015年4月13日至2015年6月12日期间出现连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。

§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")在对长盛电子信息主题灵活配置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,完全履职履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、基金合同及其他有关规定的规定,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)正用会计师服务,沈龙杰于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20241号无保留意见的审计报告。报告者联查看审计报告全文,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:长盛电子信息主题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	上年度末 2014年12月31日
资产:		
银行存款	332,339,627.27	4,176,828.49
结算备付金	17,668,093.10	1,152,352.25
存出保证金	1,423,113.90	59,343.30
交易性金融资产	3,014,084,921.25	54,157,373.78
其中:股票投资	3,014,084,921.25	54,157,373.78
基金投资	–	–
债券投资	–	–
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	–	–
应收证券清算款	5,453,503.87	3,187,330.32
应收利息	78,027.15	1,422.86
应收股利	–	–
应收申购款	38,857,627.52	61,850.68
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	3,409,904,914.06	62,796,501.68

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	101,775,100.48	1,067,431.80
应付赎回款	48,807,200.20	1,185,628.64
应付管理人报酬	3,787,340.02	98,753.68
应付托管费	631,223.32	16,458.96
应付销售服务费	–	–
应交税费	6,284,663.49	511,446.95
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	333,943.19	274,468.08
负债合计	161,619,470.70	3,154,088.11
所有者权益:		
实收基金	1,283,238,786.30	60,172,675.44
未分配利润	1,965,046,657.06	-530,261.87
所有者权益合计	3,248,285,443.36	59,642,413.57
负债和所有者权益总计	3,409,904,914.06	62,796,501.68

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.531元,基金份额总额1,283,238,796.30份。

7.2 利润表

会计主体:长盛电子信息主题灵活配置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	282,785,945.26	8,497,530.34
1.利息收入	6,604,143.90	65,870.28
其中:存款利息收入	4,712,759.10	60,408.41
债券利息收入	–	–
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	1,891,384.80	5,461.87
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	93,819,386.49	7,646,063.97
其中:股票投资收益	93,511,141.81	9,114,765.82
基金投资收益	–	-1,496,898.54
债券投资收益	–	–
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	308,244.68	28,196.69
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	146,182,941.08	393,003.07
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6,179,473.79	382,593.04
减:二、费用	28,967,574.95	2,536,502.53
1. 管理人报酬	16,060,517.55	469,569.86
2. 托管费	2,676,752.83	78,920.94
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	10,046,326.28	1,619,889.50
5. 利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6. 其他费用	183,978.37	368,122.23
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	223,818,370.31	5,961,027.81
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	223,818,370.31	5,961,027.81

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛电子信息主题灵活配置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)	60,172,675.44	-530,261.87	59,642,413.57
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	223,818,370.31	223,818,370.31
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)	1,223,066,110.86	1,741,758,548.62	2,964,824,659.48
其中:1.基金申购款	3,743,965,970.76	4,177,215,177.56	7,921,171,148.32
2.基金赎回款	-2,520,889,859.90	-2,435,456,628.94	-4,956,346,488.84
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)	1,283,238,786.30	1,965,046,657.06	3,248,285,443.36

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)	42,590,023.08	-2,907,123.77	39,682,899.31
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	5,961,027.81	5,961,027.81
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)	17,582,652.36	-3,584,165.91	13,998,486.45
其中:1.基金申购款	366,189,185.31	-29,137,600.44	337,052,284.87
2.基金赎回款	-348,607,202.95	25,553,434.53	-323,053,768.42
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)	60,172,675.44	-530,261.87	59,642,413.57

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:

陈民 柏思荣 龚辰
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

长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")是根据长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金的以下简称"原基金"基金份额持有人大会的决议由长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称"原基金")转型而来。原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[2013]第125号《关于核准上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集398,394,736.32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(2013)第214号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同》于2013年5月10日正式生效,基金合同生效日的募集资金为398,406,300.94基金份额,其中认购资产利息净额10,101.71元,合计398,416,402.65基金份额。

原基金基金份额持有人大会于2014年9月7日起至2014年9月8日止以通讯方式召开,会议审议通过了《关于修改长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金合同有关事项的议案》,经中国证监会备案后决定生效,根据原基金基金份额持有人会决议,《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自2014年7月3日生效,基金投资业绩比较基准由"上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金"更名为"长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金",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《长盛电子信息主题灵活配置混合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),债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或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的相关规定。本基金业绩比较基准为中证TMT产业主题指数收益率X50%+中证综合债指数收益率X50%。

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 会计投资的编制基础

本报告期财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后颁布的《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35号-年度报告和半年度报告-》、中国证券投资基金协会公布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.8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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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》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税范围,不征收营业税。基金企业取得、债券的收益个人不征收营业税。

(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投资收益,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,不计入应纳税所得额。自2015年9月11日起,暂免征收个人所得税。对基金持有上市公司限售股,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。

(4)基金卖出股票按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
长盛创盈资产管理有限公司	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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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	16,060,517.55	469,569.86
其中:支付销售机构的客户维护费	11,073,115.00	121,612.75

注:根据基金合同,管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

自2014年7月3日起,本基金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1.50%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:

日管理费=前一日基金资产净值×1.50%/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	2,676,752.83	78,920.94

注:根据基金合同,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×0.25%/当年天数。

自2014年7月3日起,本基金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×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:本基金基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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:除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年末未投资本基金。

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	332,339,627.27	3,978,668.61	4,176,828.49	53,071.05

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行间定期利率计息。

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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券。

7.4.9.1 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
002049