

信息披露 Disclosure

长信量化先锋混合型证券投资基金

2015 年度 报告 摘要

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估值程序等事项的说明

根据相关法律法规和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。

本基金基金收益分配原则如下:

1. 本基金基金分配采用现金方式或红利再投资方式(指将现金红利扣除后除权后的基金份额净值作为计算基金净值的方式)进行再投资,基金份额持有人可自由选择现金方式或红利再投资方式;若基金份额持有人事先未做出选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;若基金份额持有人选择红利再投资,红利再投资的份额免申购费用;

2. 每一基金份额享有同等分配权;

3. 在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年最多分配6次,每次收益分配最低比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的30%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

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基金份额净值减去每单位基金份额应分配的现金红利后不能低于面值;

5. 分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红,分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红;

6. 基金红利发放日距离收益分配基准日(即期末可供分配利润计算截至日)的时间不得超过15个工作日。

4.8 法律法规及监管机构另有规定的,从其规定。

4.9 报告期内管理人对本基金资产净值计价原则及估值程序等情况的说明

5 托管人报告

报告期内本基金托管人遵守情况说明

2015年度,基金托管人在长信量化先锋混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,及时足额地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守法律、净值计算、利润分配等情况的说明

2015年度,长信基金管理有限责任公司在长信量化先锋混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面上,托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等相关信息的真实、准确和完整发表意见

2015年度,由长信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关长信量化先锋混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 审计报告

本基金2015年度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(毕马威华振字第1600164号),投资者可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:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:		
银行存款	482,085,619.91	66,785,613.38
结算备付金	2,980,243.81	683,126.06
应收利息	1,285,421.91	1,576,103.00
买入返售金融资产	2,103,389,139.00	17,967,107.42
应收申购款	2,103,389,139.00	1,686,072,014.20
其他资产	-	-
资产总计	50,055,000.00	-
负债:		
应付赎回款	-	-
应付基金赎回款	20,000,165.00	-
应付证券清算款	-	23,068,513.00
应付利息	123,206.81	1,043,092.69
应付股利	-	-
其他负债	57,684,102.04	13,601,179.64
负债合计	78,684,273.85	24,712,705.33
所有者权益:		
实收基金	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
未分配利润	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
所有者权益合计	2,116,530,158.72	2,116,530,158.72
负债和所有者权益总计	50,055,000.00	2,116,530,158.72

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.466元,基金份额总额1,058,250,079.36份。

7.2 利润表

会计主体:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、收入		
1.利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:存款利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券投资收益	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
二、费用		
1.利息支出	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:应付利息	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他费用	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
三、利润总额	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
四、净利润	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.466元,基金份额总额1,058,250,079.36份。

会计主体:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、收入		
1.利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:存款利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券投资收益	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
二、费用		
1.利息支出	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:应付利息	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他费用	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
三、利润总额	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
四、净利润	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.466元,基金份额总额1,058,250,079.36份。

会计主体:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、收入		
1.利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:存款利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券投资收益	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
二、费用		
1.利息支出	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:应付利息	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他费用	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
三、利润总额	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
四、净利润	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.466元,基金份额总额1,058,250,079.36份。

会计主体:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、收入		
1.利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:存款利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券投资收益	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
二、费用		
1.利息支出	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:应付利息	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他费用	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
三、利润总额	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
四、净利润	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.466元,基金份额总额1,058,250,079.36份。

会计主体:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、收入		
1.利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:存款利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券投资收益	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
二、费用		
1.利息支出	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:应付利息	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他费用	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
三、利润总额	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
四、净利润	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.466元,基金份额总额1,058,250,079.36份。

会计主体:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、收入		
1.利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:存款利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券投资收益	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
二、费用		
1.利息支出	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:应付利息	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他费用	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
三、利润总额	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
四、净利润	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.466元,基金份额总额1,058,250,079.36份。

会计主体:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、收入		
1.利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:存款利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券投资收益	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
二、费用		
1.利息支出	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:应付利息	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他费用	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
三、利润总额	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
四、净利润	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.466元,基金份额总额1,058,250,079.36份。

会计主体:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、收入		
1.利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:存款利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券投资收益	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
二、费用		
1.利息支出	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:应付利息	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他费用	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
三、利润总额	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
四、净利润	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.466元,基金份额总额1,058,250,079.36份。

会计主体:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、收入		
1.利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:存款利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券投资收益	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
二、费用		
1.利息支出	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:应付利息	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他费用	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
三、利润总额	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
四、净利润	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.466元,基金份额总额1,058,250,079.36份。

会计主体:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、收入		
1.利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:存款利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券投资收益	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
二、费用		
1.利息支出	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:应付利息	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他费用	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
三、利润总额	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
四、净利润	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.466元,基金份额总额1,058,250,079.36份。

会计主体:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、收入		
1.利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:存款利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券投资收益	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
二、费用		
1.利息支出	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:应付利息	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他费用	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
三、利润总额	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
四、净利润	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.466元,基金份额总额1,058,250,079.36份。

会计主体:长信量化先锋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

姓名	本报告 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
一、收入		
1.利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其中:存款利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券利息收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
债券投资收益	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36
其他收入	1,058,250,079.36	1,058,250,079.36