长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

【2015】年度报告摘要

基金管理人：长信基金管理有限责任公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2016年3月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其相关事宜而来。基金管理人于2015年7月10日起至2015年7月16日期间召开长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会，审议《关于长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）变更投资范围及其他相关事项的议案》，于2015年7月20日表决通过，决议自该日起生效，原《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》自该日起失效。

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月21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。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	长信中证中央企业100指数（LOF）
场内简称	长信100
基金主代码	163001
交易代码	163001
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年3月26日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	206,772,718.31份
基金合同存续期	不定期

注：上表中“报告期末”为2015年7月19日。

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	长信医疗保健混合（LOF）
场内简称	长信医疗
基金主代码	163001
交易代码	163001
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月20日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	142,352,731.79份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证中央企业100指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变化进行相应的调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	中证中央企业100指数收益率*95%+银行同行业存款收益率*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于证券投资基金中较高预期收益和较高风险特征的证券投资基金产品，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金通过积极灵活的资产配置，并精选医疗保健行业的优质企业进行投资，在有效控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1.资产配置策略； 2.股票投资策略； 3.债券投资策略； 4.其他类型资产投资策略。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，但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		长信基金管理有限责任公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	田曾
	联系电话	021-61009999	010-67596096
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4007005566	010-67595096
传真		021-61009800	010-66275853

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	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海银城中路68号时代金融中心9楼、北京西城区闹市口大街1号院1号楼

§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
	转型前（2015年1月1日至2015年7月19日）	转型后（2015年7月20日至2015年12月31日）		
本期已实现收益	97,881,373.76	-38,236,806.95	-2,120,650.90	-5,886,599.55
本期利润	42,388,073.74	3,384,593.60	40,824,922.87	-8,706,177.92
加权平均基金份额本期利润	0.1206	0.0204	0.5577	-0.1053
本期基金份额净值增长率	30.24%	5.28%	69.62%	-12.72%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末	2013年末
	转型前（2015年7月19日）	转型后（2015年12月31日）		
期末可供分配基金份额利润	0.0229	-0.1392	-0.0883	-0.2663
期末基金资产净值	211,526,195.37	153,362,658.81	181,324,817.61	55,637,721.41
期末基金份额净值	1.023	1.077	1.245	0.734

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。

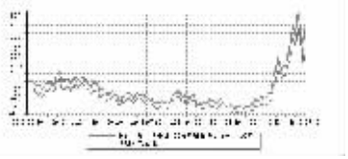
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现(转型前)

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
2015年1月1日至2015年7月19日	30.24%	2.41%	16.38%	2.54%	13.86%	-0.13%
自基金合同生效日起至今（2010年3月26日至2015年7月19日）	62.15%	1.37%	30.34%	1.43%	31.81%	-0.06%

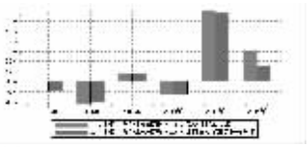
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2010年3月26日至2015年7月19日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效至转型前基金每年净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较



3.2 基金净值表现（转型后）

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	33.29%	1.97%	13.34%	1.14%	19.95%	0.83%
自基金合同生效日起至今（2015年7月20日至2015年12月31日）	5.28%	2.77%	-0.19%	1.61%	5.47%	1.16%

注：1、转型后的本基金基金合同于2015年7月20日起生效；

2、转型后，业绩比较基准变更为：中证医药卫生指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

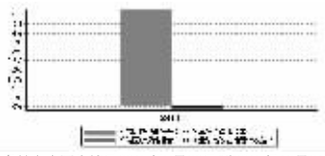
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1、转型后的本基金基金合同生效日为2015年7月20日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2015年7月20日至2015年12月31日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金的各项投资比例将符合基金合同的约定：股票资产占基金资产的比例为0%-95%；投资于医疗保健行业的证券资产不低于非现金基金资产的80%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的3%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

截至本报告期期末，本基金尚未完成建仓。

3.2.3 自基金转型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：2015年计算期间为自基金合同生效日2015年7月20日至2015年12月31日，基金运作时间未满一年，净值增长率按本基金实际存续期计算。

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年	5.400	3,596,419,511.20	15,231,327.73	3,611,650,838.93	
2014年	-	-	-	-	
2013年	-	-	-	-	
合计	5.400	3,596,419,511.20	15,231,327.73	3,611,650,838.93	

注：1、本基金在转型前进行了利润分配；

2、本基金本报告期内进行的利润分配情况，详见4.8。

§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

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本1.5亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49%、上海海欣集团股份有限公司占34.33%、武汉钢铁股份有限公司占16.67%。

截至2015年12月31日，本基金管理人共管理30只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选混合、长信金利趋势混合、长信增利动态策略混合、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势混合、长信量化先锋混合、长信标普100等权重指数（QDII）、长信利鑫分级债、长信内需成长混合、长信可转债债券、长信利众分级债、长信纯债一年定开债券、长信纯债壹号债券、长信改革红利混合、长信量化中小盘股票、长信新利混合、长信利富债券、长信利盈混合、长信利广混合、长信多利混合、长信睿进混合、长信量化多策略股票、长信医疗保健混合（LOF）、长信中证一带一路指数、长信富民纯债一年定开债券、长信富海纯债一年定开债券、长信利保债券、长信富安纯债一年定开债券。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡倩	基金经理、金融工程部总监	2011年9月21日	2015年3月14日	14年	曾任本基金的基金经理。
左金保	本基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理	2015年3月14日	-	4年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。曾任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员，现任本基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金和长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金的基金经理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准（转型后的本基金基金合同生效日为2015年7月20日）；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。

2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

3、本报告期内，本基金转型前后均由左金保先生担任基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

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

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

（1）严格按照时间顺序发送委托指令；

（2）对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到5:1或以上的，可豁免启动公平交易开关。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现异常交易行为。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年A股市场虽遭遇调整，但仍称得上是波澜壮阔的成长股牛市，全年上证综指上涨9.41%，沪深300上涨5.58%，中证500上涨43.12%，中小板指上涨53.70%，创业板指上涨84.41%。就行业而言，申万一级行业大多数收益不菲，其中计算机、轻工制造、纺织服装行业涨幅最大，分别为100.29%、89.85%、89.17%，而采掘、银行、非银金融三行业全年收阴，分别为-0.43%、-1.36%、-16.89%，行业分化较为明显。2015年上半年趋势性投资机会显著，三季度股市深度调整之后又迎来了以TMT为龙头的新兴成长行业的结构性行情。

报告期间，长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)转型为长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF），并在股市深幅调整前期大比例分红，在医疗保健行业内精选个股构建投资组合，取得了较为理想的绝对和相对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日，本基金单位净值为1.077元，累计单位净值1.617元。本报告期内转型前本基金净值增长率为30.24%，同期业绩比较基准涨幅为16.38%；本报告期内转型后本基金净值增长率为5.28%，同期业绩比较基准涨幅为-0.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年预计反商业贿赂、医保控费、药品降价等对行业估值的压力将会降低，不断推迟的行业新一轮招标也将开始，新药审批效率有望加快，医药板块在2016年整体业绩可期。在供给侧改革背景下，医疗服务、医疗技术等细分领域将是医药行业长期投资热点。综合考虑市场稀缺性、市场竞争力、增长潜力等因素，我们将致力于寻找具有股价安全边际的优质成长股，将利用涵盖宏观、流动性、市场结构、交易特征等多个层面的模型，来监测市场可能存在的运行规律及发生的变动，从而捕捉市场中有效投资机会。借助于不断优化改进的量化投资模型，精选医疗保健类个股构建投资组合，以期获得较为理想的相对收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会2008年9月12日发布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（[2008]38号文）的规定，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、交易管理部总监、金融工程部总监、基金事务部总监以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决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利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金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，根据《长信基金管理有限责任公司关于长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)2015年第一次分红公告》，本基金分红方案为每10份分红5.40元，收益分配基准日为2015年6月30日，权益登记日为2015年7月8日。场外红利发放日为2015年7月10日，场内红利发放日为2015年7月13日，共发放红利人民币3,611,650,838.93元，其中以现金形式发放人民币3,596,419,511.20元，以红利再投资形式发放人民币15,231,327.73元。

1、本基金转型前收益分配原则如下：

（1）本基金的每份基金份额享有同等分配权；

（2）收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除息日除权后的份额净值自动转为基金份额；

（3）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配6次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的30%；

（4）若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

（5）本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日除权后的份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

场内认购、申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深交所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

（6）基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日；

（7）基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（8）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

2、本基金转型后收益分配原则如下：

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

场内申购和上市交易的基金份额的分红方式为现金红利，投资人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

（3）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的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）每一基金份额享有同等分配权；

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

无。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施一次利润分配，共发放红利人民币3,611,650,838.93元。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告（转型前）

本报告期(2015年1月1日至2015年7月19日即基金合同失效前日）本基金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（毕马威华振审字第1600142号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§6 审计报告(转型后)

本报告期（2015年7月20日即转型后的基金合同生效日至2015年12月31日）本基金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（毕马威华振审字第1600143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(转型前)

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2015年7月19日

单位：人民币元

资产	本期末 2015年7月19日	上年度末 2014年12月31日
资产：		
银行存款	22,478,166.47	17,417,688.45
结算备付金	2,192,777.66	-
存出保证金	139,442.36	1,473.20
交易性金融资产	198,358,660.70	168,741,489.02
其中：股票投资	198,358,660.70	168,741,489.02
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	-	-
应收利息	1,196,718.29	2,871.81
应收股利	-	-
应收申购款	3,186,681.13	9,141,527.76
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	45,774.37
资产总计	227,552,446.61	195,350,824.61
负债和所有者权益	本期末 2015年7月19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	-	6,595,003.83
应付赎回款	13,702,653.50	6,990,477.44
应付管理人报酬	918,062.67	64,079.79
应付托管费	183,612.54	12,815.97
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	970,154.81	76,618.31
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	251,767.72	287,011.66
负债合计	16,026,251.24	14,026,007.00
所有者权益：		
实收基金	206,772,718.31	145,678,728.55
未分配利润	4,753,477.06	35,646,089.06
所有者权益合计	211,526,195.37	181,324,817.61
负债和所有者权益总计	227,552,446.61	195,350,824.61

注：1、报告截止日2015年7月19日（基金合同失效前日），基金份额净值1.023元，基金份额总额206,772,718.31份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2015年1月1日至2015年7月19日（基金合同失效前日）止期间。

7.2 利润表（转型前）

会计主体：长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2015年1月1日至2015年7月19日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年7月19日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	46,383,742.42	41,938,530.59
1.利息收入	1,265,170.07	27,372.63
其中：存款利息收入	1,265,170.07	27,372.63
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	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益损失以“-”填列）	92,330,398.06	-1,075,450.54
其中：股票投资收益	90,042,084.58	-2,668,245.59
基金投资收益	-	-
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	2,288,303.47	1,592,795.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-55,493,300.02	42,945,573.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	8,281,484.32	41,034.73
减：二、费用	3,995,668.68	1,113,607.72
1. 管理人报酬	1,789,816.95	424,411.62
2. 托管费	357,963.37	84,882.33
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,500,620.16	108,624.02
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	347,268.20	495,689.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	42,388,073.74	40,824,922.87
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	42,388,073.74	40,824,922.87

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2015年1月1日至2015年7月19日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年7月19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）	145,678,728.55	35,646,089.06	181,324,817.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	42,388,073.74	42,388,073.74
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）	61,093,989.76	3,538,370.153.19	3,599,464,142.95
其中：1.基金申购款	7,049,907,293.19	3,208,922,981.35	10,258,830,274.54
2.基金赎回款	-6,988,813,303.43	329,447,171.84	-6,659,366,131.59
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）	-	-3,611,650,838.93	-3,611,650,838.93
五、期末所有者权益（基金净值）	206,772,718.31	4,753,477.06	211,526,195.37
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）	75,831,142.19	-20,193,420.78	55,637,721.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	40,824,922.87	40,824,922.87
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）	69,847,586.36	15,014,586.97	84,862,173.33
其中：1.基金申购款	123,458,137.81	14,577,217.02	138,035,354.83
2.基金赎回款	-53,610,551.45	437,369.95	-53,173,181.50
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）	145,678,728.55	35,646,089.06	181,324,817.61

注：本财务报表的实际编制期间为2015年1月1至2015年7月19日(基金合同失效日)。

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：

叶烨	覃波	孙红辉
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

长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)(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”)《关于核准长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可【2009】1361号)批准，由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)基金合同》发售，基金合同于2010年3月26日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为743,255,611.35份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字【2010】第116号文审核同意，本基金155,765,645份基金份额于2010年4月16日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)基金合同》和《长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括中证中央企业100指数的成份股及其备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。本基金投资组合资产类别配置的基本范围为：股票资产的投资比例为基金资产的90%-95%，其中，中证中央企业100指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的90%；现金或者到期日在一年以内的政府债券比例不低于基金资产净值的5%；本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证中央企业100指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。本基金的业绩比较基准为中证中央企业100指数和银行同行业存款的复合收益率：中证中央企业100指数收益率*95%+银行同行业存款收益率*5%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2015年7月19日(基金合同失效前日)的财务状况、自2015年1月1日至2015年7月19日(基金合同失效前日)止期间经营成果和基金净值变动情况。

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估计发生变更，对本基金本报告期无重大影响，会计政策与上年度会计报表一致。

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

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据估值处理标准，本基金自2015年3月27日起，对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格进行估值。于2015年3月27日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税字［1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(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。

(2)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4)对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额