

信息披露 disclosure

长信量化先锋股票型证券投资基金

2014 年 度 报 告 摘 要

2014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股票型证券投资基金年度报告全文,经会计师事务所审计,并经会计师事务所出具了无保留意见的审计报告(毕马威华振审字第1500267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

本报告期内本基金2014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(毕马威华振审字第1500267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

2014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股票型证券投资基金年度报告全文,经会计师事务所审计,并经会计师事务所出具了无保留意见的审计报告(毕马威华振审字第1500267号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

7.1 资产负债表

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金
报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产

货币存款 66,785,813.38 13,317,163.62

结算备付金 12,060,129.69 568,585.64

存出保证金 683,136.86 40,390.13

权益类金融资产 1,736,107,614.20 88,128,647.40

基金股票投资 1,086,072,614.20 88,128,647.40

其他权益类投资 - -

债券投资 50,035,000.00 -

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 23,080,513.99 -

应收利息 1,043,652.69 3,048.50

应收股利 - -

应收申购款 13,501,179.54 101,196.67

递延所得税资产 - -

其他资产 - -

资产总计 1,783,260,079.36 102,150,791.96

负债和所有者权益

负债: - -

短期借款 - -

应付短期融资款 - -

应付账款 - -

应付利息 564,426.19 374,521.67

应付股利 - -

其他负债 63,292,009.26 1,004,860.11

所有者权益: - -

实收基金 1,343,469,056.67 119,085,071.97

未分配利润 466,389,413.41 -17,986,930.62

所有者权益合计 1,799,858,070.10 101,098,141.35

负债和所有者权益总计 1,783,260,079.36 102,150,791.96

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额总额1,343,469,056.67份。

会计主体:长信量化先锋股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目

2014年1月1日至2014年12月31日

2013年1月1日至2013年12月31日

一、收入 266,565,787.42 22,736,246.33

1.利息收入 1,160,414.61 110,290.63

其中:存款利息收入 694,563.74 110,290.63

债券利息收入 6,36,342.47 -

买入返售金融资产收入 19,718.40 -

其他利息收入 - -

2.投资收益(损失以“-”填列) 175,127,966.46 27,819,830.77

其中:股票投资收益 174,210,162.53 27,356,356.33

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 - -

衍生工具损益 962,703.92 463,444.44

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) 78,387,241.19 -5,343,676.20

4.汇兑收益(损失以“-”号填列) - -

5.其他收入(损失以“-”号填列) 1,864,655.17 48,791.23

二、费用 24,187,520.19 4,203,639.49

1.管理人报酬 8,613,136.68 1,518,266.78

2.托管费 1,436,522.71 263,069.46

3.销售服务费 - -

4.交易费用 13,843,303.02 2,142,866.84

5.其他支出 - -

其中:卖出回购金融资产支出 - -

6.其他费用 206,568.78 289,366.41

三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) 232,378,267.23 18,531,606.84

减:所得税费用 - -

四、净利润(净亏损以“-”号填列) 232,378,267.23 18,531,606.84

五、期末所有者权益(基金净值) 1,343,469,056.67 1,343,469,056.67

六、本期基金份额持有人应得利息 119,085,071.97 -17,986,930.62

七、本期基金份额持有人应得股息 119,085,071.97 -17,986,930.62

八、本期基金份额持有人应得红利 119,085,071.97 -17,986,930.62

九、本期基金份额持有人应得股息和红利 119,085,071.97 -17,986,930.62

十、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

十一、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

十二、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

十三、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

十四、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

十五、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

十六、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

十七、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

十八、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

十九、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

二十、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

二十一、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

二十二、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

二十三、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

二十四、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

二十五、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

二十六、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

二十七、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

二十八、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

二十九、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

三十、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

三十一、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

三十二、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

三十三、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

三十四、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

三十五、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

三十六、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

三十七、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

三十八、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

三十九、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

四十、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

四十一、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

四十二、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

四十三、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

四十四、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

四十五、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

四十六、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

四十七、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

四十八、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

四十九、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

五十、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

五十一、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

五十二、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

五十三、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

五十四、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

五十五、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

五十六、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

五十七、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

五十八、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

五十九、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

六十、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

六十一、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

六十二、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

六十三、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

六十四、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

六十五、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

六十六、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

六十七、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

六十八、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

六十九、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

七十、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

七十一、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

七十二、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

七十三、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

七十四、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

七十五、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

七十六、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

七十七、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

七十八、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

七十九、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

八十、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

八十一、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

八十二、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

八十三、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

八十四、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

八十五、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

八十六、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

八十七、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

八十八、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

八十九、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

九十、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

九十一、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

九十二、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62

九十三、本期基金份额持有人应得股息和红利及未分配利润及未分配利润及未分配利润 119,085,071.97 -17,986,930.62