长盛电子信息产业股票型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

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:2015年8月27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。本半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2015年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2015年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛电子信息产业股票
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	631,795,284.82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	80%×中证信息技术指数收益率+20%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金产品,风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金,属于高风险、高预期收益的基金产品。

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	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	95566
传真		010-82265988	010-66594942

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

§3主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	1,598,788,056.27
本期利润	1,485,291,101.17
加权平均基金份额本期利润	0.9754
本期基金份额净值增长率	55.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.2461
期末基金资产净值	1,419,057,565.63
期末基金份额净值	2.246

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6月30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
过去一个月	-13.95%	4.06%	-14.88%	3.37%	0.93%	0.69%
过去三个月	14.71%	3.02%	15.05%	2.62%	-0.34%	0.40%
过去六个月	55.86%	2.41%	64.98%	2.15%	-9.12%	0.26%
过去一年	82.29%	1.8%	91.28%	1.70%	-8.99%	0.15%
过去三年	250.59%	1.60%	150.60%	1.47%	99.99%	0.13%
自基金合同生效起至今	246.74%	1.54%	145.11%	1.45%	101.63%	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。本基金为行业主题股票型基金,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:按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十四条(二)投资范围、(八)投资禁止行为与限制的有关约定。

§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6月30日,基金管理人共管理三十九只开放式基金,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。	2015年5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股票投资经理、资深股票投资经理、权益创新业务负责人、投行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股票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,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,长盛电子信息产业股票型证券投资基金(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,长盛城镇化主题股票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5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,长盛同样泛资源主题股票型证券投资基金基金经理等职务。现任权益投资部副总监,长盛电子信息产业股票型证券投资基金(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,长盛城镇化主题股票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5月14日起不再担任长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经理和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 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。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,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。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发生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%的交易。

本报告期内,未发现本基金有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年上半年股票市场不断创阶段新高,上证指数一度突破5000点,创业板更是屡创历史新高,但在6月中下旬出现了快速、较大幅度的调整。支持股票市场走强的主要原因是股票市场本身的加杠杆,资金主要来自三个方面:第一,券商提供的融资业务,资金来自于证券公司自有或体外信用融资;第二,银行资金池资产配置方向的转变,转向的分水岭大致始于2013年四季度,随着市场利率水平上升导致非标资产风险逐步显现,银行资金池在资产配置方向也相应转向了风险更“可观”的股票市场,主要通过股权质押、定增、股票二级市场配资等方式来实现;第三,民间的P2P等方式。市场上涨,加杠杆,彼此相互加强。市场转折点来自于6月初的监管部门禁止券商场外配资业务,这一举措虽有利于规范市场长期、健康运作,但却推到了多米诺骨牌,资金推动的牛市,基本已经结束。

上半年,在投资运作方面仍沿袭了一贯以来的长期、稳健的投资风格。虽然,在5月中旬更换了基金经理,但在投资风格方面,仍坚持长期、价值、稳健、远见的基本原则,通过策略的判断,利用灵活的仓位来规避市场风险,通过自下而上的精选个股,来获得稳定的长期收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为2.246元,本报告期份额净值增长率为55.86%,同期业绩比较基准增长率为64.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前,中国经济有企稳迹象,预计在2015年下半年经济将逐步、缓慢复苏,但复苏的力度可能并不会很强,复苏的延续性仍需要观察。房地产市场在国家众多刺激政策下,开始缓慢复苏,一线城市房地产市场快速去库存,价格开始企稳上涨,二三线城市房地产价格也出现了止跌企稳的迹象。房地产市场的企稳复苏,以及财政支出投资项目的托底对经济复苏起到积极作用。但我们也看到了近几个月汽车、家电数据的疲软,大宗商品价格的下跌,以及猪肉价格的快速上涨,这些说明了目前经济复苏的基础并不牢靠,同时有可能在今年年底或明年上半年面临通胀的压力。除此之外,我们也非常关注美联储下半年的货币政策走向,加息对全球资本市场的影响需要密切关注。

股票市场在“去杠杆”后,结束了快速单边的上涨走势。展望下半年市场,预计股票市场将是区间震荡走势,向上有资金供给的压力,向下有政策的托底预期,预计上证指数运行区间大约在3400到4200之间,反复震荡。在投资方向方面,低估值蓝筹股虽然有估值优势,但缺乏上涨的驱动力,投资机会主要还是来自于成长股。成长股投资趋势性的机会始于2012年,经过今年6月份的大幅调整之后,支持成长股的驱动因素并没有消失,这样的趋势投资机会仍将延续,股价的下跌反而给我们提供了难得的选股机遇。

经济转型、货币政策相对宽松的大背景,是非常难得的投资时机。从十年周期来看,我们最看好两个行业:一个是以科技、创新为主的TMT行业,另一个是需求稳定,不断创新的医疗保健、医药行业。本基金产品是以TMT为主的行业主题基金,在投资运作思路上面,除了不断挖掘优秀的TMT行业上市公司的同时,在非TMT行业投资方面,我们会加大对医药、医疗行业的配置力度。

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,本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2015年6月30日,期末可供分配利润为787,262,280.81元,其中:未分配利润已实现部分为1,011,135,204.64元,未分配利润未实现部分为-223,872,923.83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股票型证券投资基金(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 托管人对本半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半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:长盛电子信息产业股票型证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	524,453,662.34	357,990,439.29
结算备付金	6,169,778.11	11,658,024.46
存出保证金	1,982,907.48	522,956.67
交易性金融资产	1,293,613,375.98	2,528,782,284.67
其中:股票投资	1,293,613,375.98	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	-	32,900,000.00
应收证券清算款	-	7,169,150.27
应收利息	111,152.08	402,688.24
应收股利	-	-
应收申购款	3,464,938.38	13,272,205.93
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,829,795,814.37	2,952,697,749.53
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30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	236,197,365.17	8,280,624.97
应付赎回款	167,019,942.74	43,145,698.75
应付管理人报酬	2,453,976.49	4,212,022.50
应付托管费	408,996.07	702,003.75
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,879,878.47	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	778,089.80	432,940.08
负债合计	410,738,248.74	59,062,638.97
所有者权益:		
实收基金	631,795,284.82	2,008,654,188.52
未分配利润	787,262,280.81	884,980,922.04
所有者权益合计	1,419,057,565.63	2,893,635,110.56
负债和所有者权益总计	1,829,795,814.37	2,952,697,749.53

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值2.246元,基金份额总额631,795,284.82份。

6.2 利润表

会计主体:长盛电子信息产业股票型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	1,521,345,574.43	311,348,143.79
1.利息收入	2,501,104.77	6,623,894.49
其中:存款利息收入	1,979,833.78	1,238,670.22
债券利息收入	35,284.14	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	485,986.85	5,385,224.27
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	1,624,799,649.71	179,154,277.87
其中:股票投资收益	1,621,671,024.55	166,549,507.57
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,924,991.44	-
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	6,053,616.60	12,604,770.30
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-113,496,954.10	122,824,539.50
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7,541,774.05	2,745,431.93
减:二、费用	36,054,473.26	24,168,676.90
1. 管理人报酬	21,393,837.81	16,619,604.08
2. 托管费	3,565,639.64	2,769,933.99
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	10,876,814.76	4,560,556.23
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	218,181.05	218,582.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	1,485,291,101.17	287,179,466.89
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	1,485,291,101.17	287,179,466.89

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛电子信息产业股票型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日 至 2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30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)	2,008,654,188.52	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(本期净利润)	-	1,485,291,101.17	1,485,291,101.17
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)	-1,376,858,903.70	-1,583,009,742.40	-2,959,868,646.10
其中:1.基金申购款	1,791,123,414.81	1,685,775,274.89	3,476,898,689.70
2.基金赎回款	-3,167,982,318.51	-3,268,785,017.29	-6,436,767,335.80
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)	631,795,284.82	787,262,280.81	1,419,057,565.63
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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)	1,060,660,981.01	183,717,982.54	1,244,378,963.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	287,179,466.89	287,179,466.89
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)	1,289,524,850.02	386,873,702.96	1,676,398,552.97
其中:1.基金申购款	3,008,026,475.31	868,192,064.37	3,876,218,539.68
2.基金赎回款	-1,718,501,625.29	-481,318,361.42	-2,199,819,976.71
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)	2,350,185,831.03	857,771,152.38	3,207,956,983.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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。

6.4.2 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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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》、《长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会及中国证券投资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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4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

对于在证券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),本基金自2015年3月24日起按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

除上述会计估值变更事项外,本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券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,本基金自2015年3月24日起采用中证指数有限公司根据《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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期不存在差错更正。

6.4.6 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。自2013年1月1日起,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,暂减按25%计入应纳税所得额。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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内,未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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”)	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、基金代销机构

6.4.8 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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:本基金无关联方交易单元。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	21,393,837.81	16,619,604.08
其中:支付销售机构的客户维护费	4,926,876.58	5,112,638.40

注:支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费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:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,565,639.64	2,769,933.99

注:支付基金托管人中国银行的基金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:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金管理人于本报告期及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金份额。

6.4.8.4.2 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本报告期末及上年度末未投资本基金。

6.4.8.5 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6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	524,453,662.34	1,923,977.70	217,705,542.85	988,747.82

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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
300353	东土科技	2015年6月3日	重大事项停牌	57.79	-	-	157,357	2,129,353.09	9,093,661.03	-
300323	华灿光电	2015年4月29日	重大事项停牌	10.65	-	-	2,247	7,955.65	23,930.55	-
300188	美亚柏科	2015年5月14日	重大事项停牌	29.92	-	-	1,444,800	15,715,845.34	43,228,416.00	-
002712	思美传媒	2015年3月19日	重大事项停牌	101.15	2015年7月31日	66.10	415,925	21,297,100.67	42,070,813.75	-
000917	电广传媒	2015年5月28日	重大事项停牌	30.82	-	-	210,875	3,264,087.51	6,499,167.50	-
000024	招商地产	2015年4月3日	重大事项停牌	36.50	-	-	13,184	221,525.92	481,216.00	-
603118	共进股份	2015年6月30日	重大事项停牌	45.39	2015年7月13日	45.39	150,000	11,569,550.00	6,808,500.00	-
600461	洪城水业	2015年2月26日	重大事项停牌	20.69	2015年8月26日	11.66	222,560	2,008,315.25	4,604,766.40	-

注:本基金截至2015年6月30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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(