

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF））  
2015年年度报告

2015年12月31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

送出日期：2016年3月26日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况（转型前）	5
2.1	基金基本情况（转型后）	5
2.2	基金产品说明（转型前）	5
2.2	基金产品说明（转型后）	6
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1	主要会计数据和财务指标	8
3.2	基金净值表现（转型前）	9
3.2	基金净值表现（转型后）	10
3.3	过去三年基金的利润分配情况	12
§4	管理人报告	13
4.1	基金管理人及基金经理情况	13
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	16
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9	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	20
§5	托管人报告	21
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	21
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	21
§6	审计报告（转型前）	22
6.1	审计报告基本信息	22
6.2	审计报告的基本内容	22
§6	审计报告（转型后）	24
6.1	审计报告基本信息	24
6.2	审计报告的基本内容	24
§7	年度财务报表（转型前）	26
7.1	资产负债表（转型前）	26
7.2	利润表（转型前）	27
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	28
7.4	报表附注	30
§7	年度财务报表（转型后）	53
7.1	资产负债表	53
7.2	利润表	54
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	55
7.4	报表附注	56
§8	投资组合报告（转型前）	78
8.1	期末基金资产组合情况	78

8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	78
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	79
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	82
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	85
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	85
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	85
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	85
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	85
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	86
8.12	投资组合报告附注	86
§8	投资组合报告（转型后）	88
8.1	期末基金资产组合情况	88
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	88
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	89
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	91
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	93
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	93
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	93
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	93
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	93
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	93
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	93
8.12	投资组合报告附注	93
§9	基金份额持有人信息（转型前）	95
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	95
9.2	期末上市基金前十名持有人	95
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	95
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	95
§9	基金份额持有人信息（转型后）	97
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	97
9.2	期末上市基金前十名持有人	97
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	97
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	97
§10	开放式基金份额变动（转型前）	99
§10	开放式基金份额变动（转型后）	100
§11	重大事件揭示	101
11.1	基金份额持有人大会决议	101
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	101
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	102
11.4	基金投资策略的改变	102
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	102
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	102
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	102
11.8	其他重大事件	103
§12	备查文件目录	109
12.1	备查文件目录	109
12.2	存放地点	109
12.3	查阅方式	109

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）
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）

基金名称	长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
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

	<p>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。</p> <p>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。</p>
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	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、资产配置策略；</li> <li>2、股票投资策略；</li> <li>3、债券投资策略；</li> <li>4、其他类型资产投资策略。</li> </ol>
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
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@xcfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	010-67595096
传真	021-61009800	010-66275853
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号9楼	北京市西城区金融大街25号

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

办公地址	上海市浦东新区银城中路68号9楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	叶焯	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京东长安街1号东方广场东2座8层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

### § 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
本期加权平均净值利润率	8.96%	2.13%	71.82%	-13.43%
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)		
期末可供分配利润	4,753,477.06	-19,822,447.61	-12,866,432.77	-20,193,420.78
期末可供分配基金份额利润	0.0230	-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
3.1.3 累计期末指标	2015年末		2014年末	2013年末
	转型前 (2015年7月19日)	转型后 (2015年7月20日至2015年12月31日)		
基金份额累计净值增长率	62.15%	5.28%	24.50%	-26.60%

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。

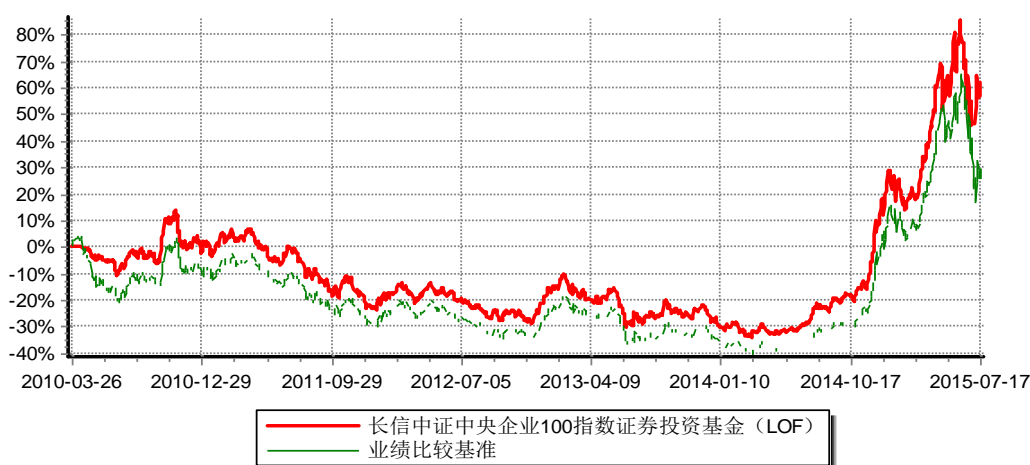
3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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

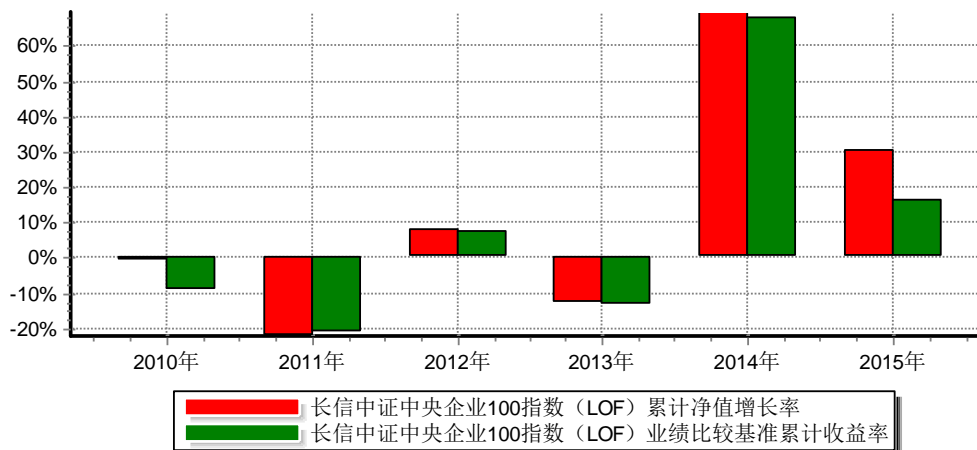


注：1、图示日期为2010年3月26日至2015年7月19日。

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）

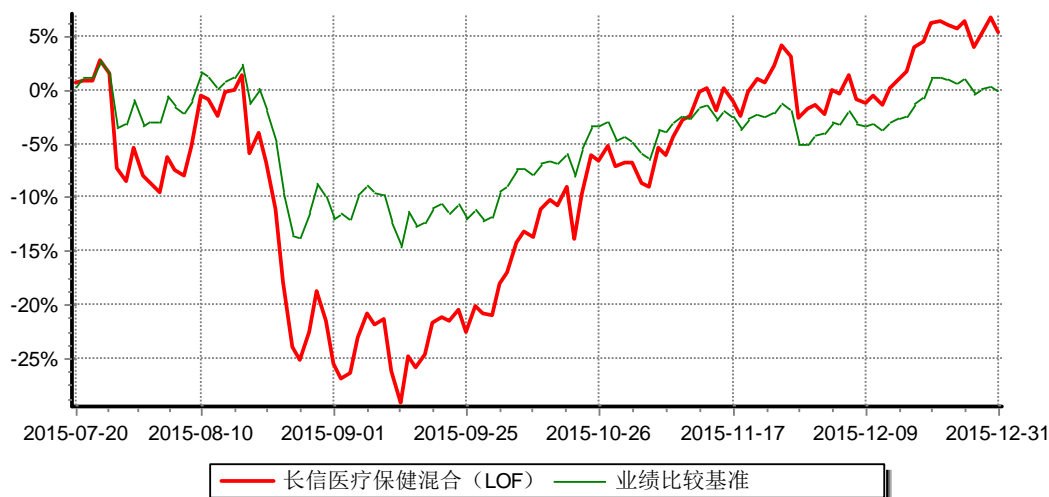
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

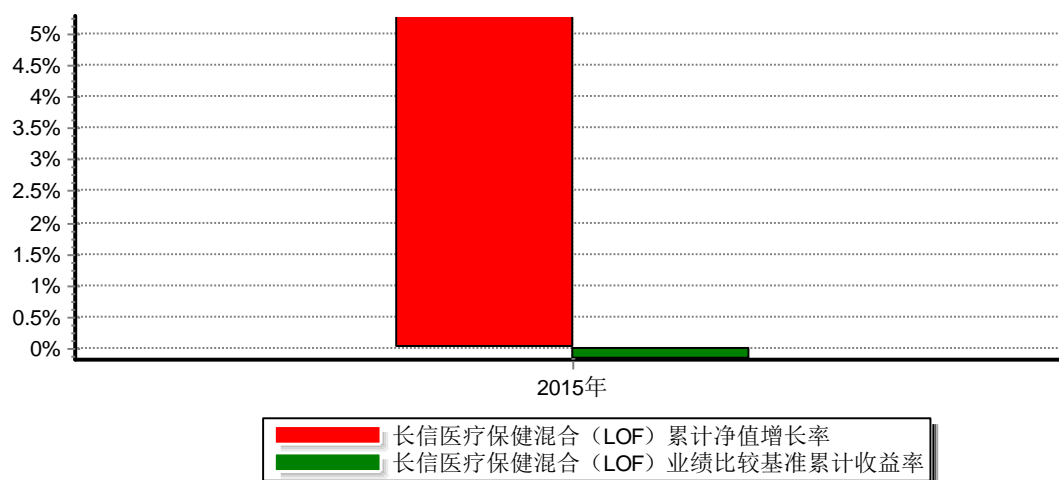


注：1、转型后的本基金基金合同生效日为2015年7月20日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2015年7月20日至2015年12月31日。

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	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，

	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				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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2015年度，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及配套法律法规，时刻以合规运作、防范风险为核心，以维护基金持有人利益为宗旨，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中与事后的监督检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向公司董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

在本报告期，基金管理人的内部监察稽核主要工作如下：

1、公司内部控制总体目标得以实现。一是公司各项业务运作严格遵守有关法律法规、监管机构的规定和行业监管规则，继续践行守法经营、规范管理的经营理念。二是公司未发生重大经营风险，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整。三是公司对外披露、备案、报送的基金信息、专户投资组合信息、公司财务信息及其他信息真实、准确、完整、及时。

2、公司继续贯彻“工作精细化”理念，落实“风险导向型”内控，有重点、有序推进相关内部控制工作。优化监察方式，在保证常规工作质量的前提下，继续深入贯彻监管机关的监管要求，组织多次全公司范围风险梳理工作，并根据公司内部控制要求落实包括年度全公司及子公司自查、销售适用性专项稽核、子公司内部控制专项稽核、专户管理专项稽核、信息安全自查、公司全面业务风险自查等多项自查工作。对于各项梳理及自查工作，公司各部门均以细致、全面的态度进行全面梳理，对于发现的问题及时沟通及通报，并督促整改，有效增强内部控制效果。

3、公司内部控制组织架构在公司章程与《内部控制大纲》规定的框架内顺利运作，董事会风险控制委员会、管理层内部控制委员会工作正常开展，相关内部控制职责得以充分发挥。

4、公司较好把握内控制度建设的整体节奏，并完成内部控制制度建设流程的梳理工作，内部控制制度体系不断完善。一是监察稽核部及时指出公司内部制

度更新不及时、制度规定与实际操作不符等方面的问题，对内控制度建设的及时、有效、审慎性予以定期评估；二是对监管机关新修订的法律法规或新出台的监管要求，监察稽核部及时发起制定或修订公司相关内部制度；三是各业务部门不定期评估实际运作需要，适时发起制度的修订。

5、监察稽核工作改进、内部控制与合规培训、内控逐级责任制等内控保障性措施严格执行，内部控制与风险管理基础进一步夯实。各关键业务流程环节的岗位自控和互控、跨部门业务流程中的部门自控与部门间互控工作效果继续保持，各业务部门根据风险梳理工作要求，审视部门业务流程开展过程中的各项风险，将各项内部控制要求落实到部门流程手册，相关业务流程持续协调更新，具体流程环节实现落实到岗，落实到人，内部控制细节不断深化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则，秉持内控优先、内控从严的理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和实效性、并完善内部控制体系，做好各项内控工作，努力防范和控制各种风险，确保基金资产的规范运作，充分保障基金持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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关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）

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1600142 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）（以下简称“长信中证央企100指数基金（LOF）”）财务报表，包括2015年7月19日的资产负债表，2015年1月1日至2015年7月19日（基金合同失效前日）期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是长信中证央企100指数基金（LOF）管理人长信基金管理有限责任公司管理层的责任，这种责任包括：（1）按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF））2015年年度报告

	<p>效性发表意见。审计工作还包括评价长信基金管理有限责任公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，长信中证央企100指数基金(LOF)财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了长信中证央企100指数基金(LOF)2015年7月19日的财务状况以及2015年转型前的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	黄小熠、虞京京
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	北京东长安街1号东方广场东2座8层
审计报告日期	2016-3-23

## § 6 审计报告(转型后)

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1600143 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“长信医疗保健混合基金（LOF）”）财务报表，包括2015年12月31日的资产负债表，2015年7月20日（转型后的基金合同生效日）至2015年12月31日期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是长信医疗保健混合基金（LOF）管理人长信基金管理有限责任公司管理层的责任，这种责任包括：（1）按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有



长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

	<p>效性发表意见。审计工作还包括评价长信基金管理有限责任公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，长信医疗保健混合基金(LOF)财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了长信医疗保健混合基金(LOF)2015年12月31日的财务状况以及2015年转型后的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	黄小熠、虞京京
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	北京东长安街1号东方广场东2座8层
审计报告日期	2016-3-23

## § 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	附注号	本期末 2015年7月19日	上年度末 2014年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	—	45,774.37
资产总计		227,552,446.61	195,350,824.61
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年7月19日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产		—	—

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF））2015年年度报告

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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	251,767.72	287,011.66
负债合计		16,026,251.24	14,026,007.00
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	206,772,718.31	145,678,728.55
未分配利润	7.4.7.10	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	附注号	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
<b>一、收入</b>		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	7.4.7.11	1,265,170.07	27,372.63
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF））2015年年度报告

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)		92,330,388.05	-1,075,450.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	90,042,084.58	-2,668,245.59
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	—	—
资产支持证券投资		—	—
收益	7.4.7.14	—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—	—
股利收益	7.4.7.16	2,288,303.47	1,592,795.05
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	-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)	7.4.7.18	8,281,484.32	41,034.73
<b>减：二、费用</b>		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	7.4.7.19	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	7.4.7.20	347,268.20	495,689.75
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		42,388,073.74	40,824,922.87
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		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
----	----

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

	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日至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：

叶焯	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 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。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。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债

分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项和其他金融负债。

本基金目前持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债（包括交易性金融资产或金融负债）

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债属于此类。

-应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

-其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

—金融所转移金融资产的账面价值

—结转因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。



金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益/（损失）、债券投资收益/（损失）和衍生工具收益/（损失）按相

关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（适用于企业债和可转债等）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

根据《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率逐日计提。

根据《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率逐日计提。

本基金的交易费用用于进行股票、债券和权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金红利和红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，基金份额持有人事先未做出选择的，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。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。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多不超过6次，但若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配，每次收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的30%。基金红利发放日距离收益分配基准日不得超过15个工作日。法律法规或中国证监会另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（以下简称“《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》”），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上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），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 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，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。
- (5) 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) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年7月19日	上年度末 2014年12月31日
活期存款	22,478,166.47	17,417,688.45
定期存款	—	—
其他存款	—	—
合计	22,478,166.47	17,417,688.45

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年7月19日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	223,454,473.11	198,358,660.70	-25,095,812.41
贵金属投资-金交所黄金	—	—	—

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

合约			
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	223,454,473.11	198,358,660.70	-25,095,812.41
项目	上年度末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	138,344,001.41	168,741,489.02	30,397,487.61
贵金属投资-金交所黄金 合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	138,344,001.41	168,741,489.02	30,397,487.61

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年7月19日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	926,038.73	2,687.74
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	1,776.24	—
应收债券利息	—	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	268,729.45	183.30
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	173.87	0.77

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

合计	1,196,718.29	2,871.81
----	--------------	----------

注：其他为结算保证金利息

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年7月19日	上年度末 2014年12月31日
其他应收款	—	—
待摊费用	—	45,774.37
合计	—	45,774.37

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年7月19日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	970,154.81	76,618.31
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	970,154.81	76,618.31

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年7月19日	上年度末 2014年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	51,352.98	23,435.97
应付其他-指数使用基费	36,032.74	3,575.69
审计费	32,876.00	60,000.00
信息披露费-上证报	43,836.00	100,000.00
信息披露费-中证报	54,794.00	100,000.00
上市费	32,876.00	—
合计	251,767.72	287,011.66

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年7月19日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	145,678,728.55	145,678,728.55
本期申购	7,049,907,293.19	7,049,907,293.19
本期赎回（以“-”号填列）	-6,988,813,303.43	-6,988,813,303.43
基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份	—	—

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

额		
本期末	206,772,718.31	206,772,718.31

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,866,432.77	48,512,521.83	35,646,089.06
本期利润	97,881,373.76	-55,493,300.02	42,388,073.74
本期基金份额交易产生的变动数	3,540,351,749.58	-1,981,596.39	3,538,370,153.19
其中：基金申购款	3,986,865,308.51	-777,942,327.16	3,208,922,981.35
基金赎回款	-446,513,558.93	775,960,730.77	329,447,171.84
本期已分配利润	-3,611,650,838.93	—	-3,611,650,838.93
本期末	13,715,851.64	-8,962,374.58	4,753,477.06

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	990,463.61	27,074.26
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	5,038.53	90.34
其他	269,667.93	208.03
合计	1,265,170.07	27,372.63

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

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
股票投资收益——买卖股票差价收入	90,042,084.58	-2,668,245.59
股票投资收益——赎回差价收入	—	—
股票投资收益——申购差价收入	—	—



合计	90,042,084.58	-2,668,245.59
----	---------------	---------------

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

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
卖出股票成交总额	503,163,532.16	9,753,939.54
减：卖出股票成本总额	413,121,447.58	12,422,185.13
买卖股票差价收入	90,042,084.58	-2,668,245.59

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期间及上年度可比期间均未持有债券。

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期间及上年度可比期间均未持有资产支持证券

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期间及上年度可比期间均未持有衍生工具。

#### 7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	2,288,303.47	1,592,795.05
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	2,288,303.47	1,592,795.05

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-55,493,300.02	42,945,573.77
——股票投资	-55,493,300.02	42,945,573.77
——债券投资	—	—
——资产支持证券投资	—	—
——基金投资	—	—
——贵金属投资	—	—
——其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
——权证投资	—	—

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

3. 其他	—	—
合计	-55,493,300.02	42,945,573.77

#### 7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	2,589,544.26	41,034.73
转换费收入	5,691,940.06	—
合计	8,281,484.32	41,034.73

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年07 月19日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
交易所市场交易费用	1,500,620.16	108,624.02
银行间市场交易费用	—	—
合计	1,500,620.16	108,624.02

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年07 月19日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
审计费用	32,876.00	60,000.00
信息披露费	98,630.00	200,000.00
指数使用费_固定费用	—	—
上市费	32,876.00	60,000.00
其他费用	—	—
银行费用	4,654.78	2,833.88
回购交易费用	—	—
银行间账户维护费	—	18,000.00
指数使用费_基点费	178,231.42	154,855.87
合计	347,268.20	495,689.75

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》自2015年7月20日起失效，《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》于同日起生效，同时基金更名为长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均没有通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间内均没有应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年7月19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	1,789,816.95	424,411.62
其中：支付销售机构的	350,372.21	140,281.04

客户维护费		
-------	--	--

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年7月19日	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	357,963.37	84,882.33

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期及上年度可比期间内均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本报告期及上年度可比期间内未运用自有资金投资过本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末未投资过本基金。

#### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年7月19日		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
中国建设银行股份有限公司	22,478,166.47	990,463.61	17,417,688.45	27,074.26

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2015年7月19日的相关余额为人民币2,192,777.66元（2014年12月31日的相关余额为人民币0元）

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本年度与上年度均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2015-7-8	2015-7-9	2015-7-8	5.400	3,596,419,511.20	15,231,327.73	3,611,650,838.93	
合计				5.400	3,596,419,511.20	15,231,327.73	3,611,650,838.93	

#### 7.4.12 期末（2015年7月19日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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	复牌单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额
600900	长江电力	2015-6-12	重大资产重组	10.28	2015-11-16	12.92	202,140	2,210,928.31	2,077,999.20
601111	中国国航	2015-6-30	非公开发行股票事项	15.31	2015-7-29	13.78	92,000	1,135,441.00	1,408,520.00
000024	招商地产	2015-4-3	重大资产重组	31.74	2015-9-24	28.48	50,513	1,012,879.26	1,603,282.62
000778	新兴铸管	2015-6-15	非公开发行股票事项	8.58	2015-9-15	11.63	88,989	562,762.88	763,525.62

			项						
000878	云南铜业	2015-6-08	筹划重大事项	14.54	2015-9-8	22.05	28,319	459,231.21	411,758.26
002415	海康威视	2015-7-9	筹划重大事项	32.39	2015-9-9	30.20	20,000	831,415.00	647,800.00

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至2015年7月19日（基金合同失效前日），本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

信用风险

流动性风险

市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以内部控制委员会为核心的、由内部控制委员会、金融工程部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风

险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金在2015年7月19日（基金合同失效前日）及上年末未进行债券投资，因而不存在因债券投资而面临的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可于银行间同业市场交易，因此除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，

约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过专设的金融工程部设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 7.4.13.4 市场风险

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及

经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款和结算备付金等。本基金管理人通过专设的金融工程部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年7 月19日	6个月以内	6 个月 — 1 年	1- 5 年	5年 以 上	不计息	合计
资产						
银行存款	22,478,166.47	—	—	—	—	22,478,166.47
结算备付金	2,192,777.66	—	—	—	—	2,192,777.66
存出保证金	139,442.36	—	—	—	—	139,442.36
交易性金融资产	—	—	—	—	198,358,660.70	198,358,660.70
应收利息	—	—	—	—	1,196,718.29	1,196,718.29
应收申购款	—	—	—	—	3,186,681.13	3,186,681.13
资产总计	24,810,386.49	—	—	—	202,742,060.12	227,552,446.61
负债						
应付赎回款	—	—	—	—	13,702,653.50	13,702,653.50
应付管理人报酬	—	—	—	—	918,062.67	918,062.67
应付托管费	—	—	—	—	183,612.54	183,612.54
应付交易费用	—	—	—	—	970,154.81	970,154.81



长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

其他负债	—	—	—	—	251,767.72	251,767.72
负债总计		—	—	—	16,026,251.24	16,026,251.24
利率敏感度缺口	24,810,386.49	—	—	—	186,715,808.88	211,526,195.37
上年度末 2014年 12月31 日	6个月	6 个月 — 1 年	1- 5 年	5年 以 上	不计息	合计
资产						
银行存款	17,417,688.45	—	—	—	—	17,417,688.45
存出保证金	1,473.20	—	—	—	—	1,473.20
交易性金融资产	—	—	—	—	168,741,489.02	168,741,489.02
应收利息	—	—	—	—	2,871.81	2,871.81
应收申购款	—	—	—	—	9,141,527.76	9,141,527.76
其他资产	—	—	—	—	45,774.37	45,774.37
资产总计	17,419,161.65	—	—	—	177,931,662.96	195,350,824.61
负债						
应付证券清算款	—	—	—	—	6,595,003.83	6,595,003.83
应付赎回款	—	—	—	—	6,990,477.44	6,990,477.44
应付管理人报酬	—	—	—	—	64,079.79	64,079.79
应付托管费	—	—	—	—	12,815.97	12,815.97
应付交	—	—	—	—	76,618.31	76,618.31

易费用						
其他负债	—	—	—	—	287,011.66	287,011.66
负债总计	—	—	—	—	14,026,007.00	14,026,007.00
利率敏感度缺口	17,419,161.65	—	—	—	163,905,655.96	181,324,817.61

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于2015年7月19日（基金合同失效前日）及上年末未进行债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的重大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于2015年7月19日（基金合同失效前日），本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的93.77%，无债券投资。于2015年7月19日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年7月19日	上年度末 2014年12月31日

	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产 -股票投资	198,358,660.70	93.77	168,741,489.02	93.06
交易性金融资产 -基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产 -债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产 -贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产— 权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	198,358,660.70	93.77	168,741,489.02	93.06

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2015年7月19 日）	上年度末 （2014年12月31日）
		VaR值为3.43%	-7,255,732.60
VaR值为2.02%	-	-3,662,761.32	

注：上述风险价值VaR的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2014年的分析同样基于该假设。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

以公允价值计量的金融工具

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于12月31日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价；

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、

除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

单位：人民币元

2015年7月19日（基金合同失效前日）	第一层级	第二层级	第三层级	合计
资产				
交易性金融资产	-	-	-	-
股票投资	191,445,775.00	6,912,885.70	—	198,358,660.70
合计	191,445,775.00	6,912,885.70	—	198,358,660.70
2014年	第一层级	第二层级	第三层级	合计
资产				
交易性金融资产	-	-	-	-
股票投资	167,684,999.52	1,056,489.50	—	168,741,489.02
合计	167,684,999.52	1,056,489.50	—	168,741,489.02

注：2015年，由于会计估计变更，本基金投资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。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

## § 7 年度财务报表(转型后)

### 7.1 资产负债表

会计主体：长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	15,142,910.81
结算备付金		537,708.55
存出保证金		160,428.18
交易性金融资产	7.4.7.2	138,290,066.53
其中：股票投资		138,290,066.53
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	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		885,181.87
应收利息	7.4.7.5	4,354.99
应收股利		—
应收申购款		279,482.29
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		155,300,133.22
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		—
交易性金融负债	7.4.7.3	—
衍生金融负债		—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		875,956.18
应付赎回款		365,441.41
应付管理人报酬		205,665.19

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

应付托管费		34,277.53
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	215,365.14
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	240,768.96
负债合计		1,937,474.41
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	142,352,731.79
未分配利润	7.4.7.10	11,009,927.02
所有者权益合计		153,362,658.81
负债和所有者权益总计		155,300,133.22

注：1、报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.077元，基金份额总额142,352,731.79份。

2、本财务报表的实际编制期间为2015年7月20日至2015年12月31日。转型后的本基金基金合同于2015年7月20日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

## 7.2 利润表

会计主体：长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2015年7月20日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年7月20日(基金合同生效日)至2015年 12月31日
<b>一、收入</b>		5,821,436.30
1. 利息收入		102,485.87
其中：存款利息收入	7.4.7.11	102,485.87
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)		-36,548,774.18

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

其中：股票投资收益	7.4.7.12	-36,739,456.85
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	—
资产支持证券投资收 益	7.4.7.14	—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.15	—
股利收益	7.4.7.16	190,682.67
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.17	41,621,400.55
4. 汇兑收益(损失以“-”号 填列)		—
5. 其他收入(损失以“-”号 填列)	7.4.7.18	646,324.06
<b>减：二、费用</b>		2,436,842.70
1. 管理人报酬		1,035,642.11
2. 托管费		172,606.95
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.19	1,001,606.77
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	7.4.7.20	226,986.87
<b>三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）</b>		3,384,593.60
减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		3,384,593.60

注：本财务报表的实际编制期间为2015年7月20日至2015年12月31日。转型后的本基金基金合同于2015年7月20日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2015年7月20日（基金合同生效日）至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2015年7月20日(基金合同生效日)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）	206,772,718.31	4,753,477.06	211,526,195.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	3,384,593.60	3,384,593.60
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）	-64,419,986.52	2,871,856.36	-61,548,130.16
其中：1. 基金申购款	86,194,355.13	-2,155,486.32	84,038,868.81
2. 基金赎回款	-150,614,341.65	5,027,342.68	-145,586,998.97
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）	142,352,731.79	11,009,927.02	153,362,658.81

注：本财务报表的实际编制期间为2015年7月20日至2015年12月31日。转型后的本基金基金合同于2015年7月20日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告8.1至8.4财务报表由下列负责人签署：

叶焯	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

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)根据原长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)(以下简称“长信中证央企100指数基金(LOF)”)于2015年7月10日起至2015年7月16日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会决议通过的《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》，由原长信中证央企100指数基金(LOF)转型而来。原长信中证央企100指数基金(LOF)存续期限至2015年7月19日止。自2015年7月20日起，原长信中证央企100指数基金(LOF)更名为长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)，《长信中证中央企业100指数证券投资基金(LOF)基金合同》失效同时《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资



基金（LOF）基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。原长信中证央企 100 指数基金（LOF）于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 211,526,195.37 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。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（“中国建设银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》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（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、权证、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。如出现法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资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。本基金的业绩比较基准：中证医药卫生指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

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 12 月 31 日的财务状况、自 2015 年 7 月 20 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2015 年 7 月 20 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项和其他金融负债。

本基金目前持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债（包括交易性金融资产或金融负债）

本基金持有为了近期内出售或回购的金融资产和金融负债属于此类。

-应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

-其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；应收款项和其他金融负债以实际利率法按摊余成本计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

—金融所转移金融资产的账面价值

—结转因转移而收到的对价，与原直接计入所有者权益的公允价值变动累计额之和。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益/（损失）、债券投资收益/（损失）和衍生工具收益/（损失）按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（适用于企业债和可转债等）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

根据《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率逐日计提。

根据《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

本基金的交易费用用于进行股票、债券和权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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,本基金默认为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。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（以下简称“《证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价的通知》”），若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 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

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

#### 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、基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
- 3、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，暂不征收企业所得税。
- 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，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。
- 5、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、对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收

个人所得税和企业所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	15,142,910.81
定期存款	—
其他存款	—
合计	15,142,910.81

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	121,764,478.39	138,290,066.53	16,525,588.14
贵金属投资-金交所 黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	121,764,478.39	138,290,066.53	16,525,588.14

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	4,009.48
应收定期存款利息	—



长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	266.20
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	79.31
合计	4,354.99

注：其他为结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	215,365.14
银行间市场应付交易费用	—
合计	215,365.14

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	768.96
审计费	60,000.00
信息披露费-上证报	80,000.00
信息披露费-中证报	100,000.00
合计	240,768.96

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年7月20日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金转型生效日	206,772,718.31	206,772,718.31
本期申购	86,194,355.13	86,194,355.13
本期赎回（以“-”号填列）	-150,614,341.65	-150,614,341.65
本期末	142,352,731.79	142,352,731.79

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	13,715,851.64	-8,962,374.58	4,753,477.06
本期利润	-38,236,806.95	4,162,140.55	3,384,593.60
本期基金份额交易产生的变动数	4,698,507.70	-1,826,651.34	2,871,856.36
其中：基金申购款	-9,045,146.77	6,889,660.45	-2,155,486.32
基金赎回款	13,743,654.47	-8,716,311.79	5,027,342.68
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-19,822,447.61	30,832,374.63	11,009,927.02

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	95,227.96
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	5,792.83
其他	1,465.08
合计	102,485.87

注：其他为结算保证金利息收入和申购款利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-36,739,456.85
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
合计	-36,739,456.85

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	350,948,626.90

减：卖出股票成本总额	387,688,083.75
买卖股票差价收入	-36,739,456.85

#### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期末持有债券，无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末持有资产支持证券，无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期末持有衍生工具，无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年7月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	190,682.67
基金投资产生的股利收益	—
合计	190,682.67

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年7月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	41,621,400.55
——股票投资	41,621,400.55
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	41,621,400.55

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年7月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	646,324.06
合计	646,324.06

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	1,001,606.77
银行间市场交易费用	—
合计	1,001,606.77

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	27,124.00
信息披露费	81,370.00
指数使用费_固定费用	—
上市费	27,124.00
其他费用	48,000.00
银行费用	4,919.93
回购交易费用	—
银行间账户维护费	—
指数使用费_基点费	38,448.94
合计	226,986.87

注：其他费用为律师公证费

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东

上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
----------------	-----------

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期没有通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期没有通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期没有应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,035,642.11
其中：支付销售机构的客户维护费	195,486.18

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	172,606.95

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

##### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

##### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期末未投资过本基金。

#### 7.4.10.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末均未持有本基金。

#### 7.4.10.5 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7月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	15,142,910.81	95,227.96

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2015年12月31日的相关余额为人民币537,708.55元。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末在承销期内未购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金在本期间未进行过利润分配。

#### 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

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
600271	航天信息	2015-10-12	重大资产重组	55.91	尚未复牌	—	85	7,910.33	4,752.35
600572	康恩贝	2015-12-28	重要事项未公告	13.36	2016-1-4	13.18	177,000	2,281,164.60	2,364,720.00
000028	国药一致	2015-10-21	重大资产重组	66.15	尚未复牌	—	81	5,617.50	5,358.15
000929	兰州黄河	2015-10-9	重大资产重组	12.50	尚未复牌	—	116,000	1,702,724.53	1,450,000.00
002020	京新药业	2015-12-29	拟披露重大事项	33.55	2016-1-20	30.20	96,400	2,622,440.92	3,234,220.00

300238	冠昊生物	2015-11-12	重大资产重组	56.67	尚未复牌	—	28,561	1,195,344.45	1,618,551.87
300326	凯利泰	2015-9-24	重大资产重组	27.92	2016-1-22	23.98	61,200	1,224,228.00	1,708,704.00
300194	福安药业	2015-10-08	重大资产重组	24.55	2016-1-4	20.85	68,500	1,334,253.89	1,681,675.00

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末2015年12月31日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

信用风险

流动性风险

市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上



述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以内部控制委员会为核心的、由内部控制委员会、金融工程部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金在本年末未进行债券投资，因而不存在因债券投资而面临的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可于银行间同业市场交易，因此除在附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸

与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，

约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过专设的金融工程部设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款和结算备付金等。本基金管理人通过专设的金融工程部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末 2015年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,142,910.81	—	—	—	15,142,910.81
结算备付金	537,708.55	—	—	—	537,708.55
存出保证金	160,428.18	—	—	—	160,428.18
交易性金融资 产	—	—	—	138,290,066.53	138,290,066.53
应收证券清算 款	—	—	—	885,181.87	885,181.87
应收利息	—	—	—	4,354.99	4,354.99
应收申购款	—	—	—	279,482.29	279,482.29
资产总计	15,841,047.54	—	—	139,459,085.68	155,300,133.22
负债					
应付证券清算	—	—	—	875,956.18	875,956.18

款					
应付赎回款		—	—	—	365,441.41
应付管理人报酬		—	—	—	205,665.19
应付托管费		—	—	—	34,277.53
应付交易费用		—	—	—	215,365.14
其他负债		—	—	—	240,768.96
负债总计		—	—	—	1,937,474.41
利率敏感度缺口	15,841,047.54	—	—	137,521,611.27	153,362,658.81

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本年末未进行债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于2015年12月31日，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的90.17%，无债券投资。于2015年12月31日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	138,290,066.53	90.17
交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-债券投资	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—
其他	—	—
合计	138,290,066.53	90.17

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)
		本期末 (2015年12月31日)
	VaR值为4.73%	-7,254,053.76

注：上述风险价值VaR的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

公允价值

以公允价值计量的金融工具

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于12月31日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

单位：人民币元

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

资产	本期末 2015年12月31日			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
交易性金融资产	-	-	-	-
股票投资	126,222,085.16	12,067,981.37	—	138,290,066.53
合计	126,222,085.16	12,067,981.37	—	138,290,066.53

自2015年7月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间,本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于限售期间等情况时,本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更,本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关证券公允价值的层级。

对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息,本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设参见附注7.4.4.4和7.4.4.5。

其他金融工具的公允价值(非以公允价值计量账面价值)

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 8 投资组合报告（转型前）

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	198,358,660.70	87.17
	其中：股票	198,358,660.70	87.17
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	24,670,944.13	10.84
7	其他各项资产	4,522,841.78	1.99
8	合计	227,552,446.61	100.00

注：本基金本报告期末未通过沪港通交易机制投资港股。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

##### 8.2.1.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	12,983,303.09	6.14
C	制造业	44,725,118.69	21.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,539,292.41	4.04
E	建筑业	20,426,652.90	9.66
F	批发和零售业	579,990.69	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	4,083,732.46	1.93
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,714,083.74	2.23
J	金融业	78,611,091.94	37.16
K	房地产业	12,643,661.59	5.98

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

L	租赁和商务服务业	852,834.78	0.40
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	1,013,625.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	189,173,387.29	89.43

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

### 8.2.1.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	214,315.20	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	151,152.78	0.07
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	7,197,652.81	3.40
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	1,622,152.62	0.77
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	9,185,273.41	4.34

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
1	600036	招商银行	837,582	15,378,005.52	7.27
2	601988	中国银行	1,879,613	9,717,599.21	4.59
3	600030	中信证券	361,089	9,164,438.82	4.33
4	601766	中国中车	481,997	8,825,365.07	4.17
5	601328	交通银行	1,008,837	8,070,696.00	3.82
6	000002	万科A	497,667	7,499,841.69	3.55
7	601398	工商银行	1,217,472	6,343,029.12	3.00
8	601668	中国建筑	770,691	6,273,424.74	2.97
9	601818	光大银行	1,022,758	5,502,438.04	2.60
10	601288	农业银行	1,358,003	5,106,091.28	2.41
11	601390	中国中铁	352,903	5,060,629.02	2.39
12	601601	中国太保	159,315	4,615,355.55	2.18
13	601989	中国重工	322,797	4,164,081.30	1.97
14	600028	中国石化	538,934	3,815,652.72	1.80
15	600048	保利地产	330,274	3,540,537.28	1.67
16	601857	中国石油	249,454	3,285,309.18	1.55
17	000166	申万宏源	225,081	3,209,655.06	1.52
18	600050	中国联通	434,507	3,132,795.47	1.48
19	600795	国电电力	532,526	2,838,363.58	1.34
20	601628	中国人寿	85,713	2,826,814.74	1.34
21	600999	招商证券	113,540	2,795,354.80	1.32
22	601186	中国铁建	130,299	2,377,956.75	1.12
23	000768	中航飞机	66,601	2,339,027.12	1.11
24	600705	中航资本	111,183	2,214,765.36	1.05
25	601336	新华保险	43,066	2,202,395.24	1.04
26	000625	长安汽车	106,761	2,102,124.09	0.99
27	601088	中国神华	101,461	2,084,008.94	0.99
28	600900	长江电力	202,140	2,077,999.20	0.98
29	601669	中国电建	189,496	1,891,170.08	0.89
30	600011	华能国际	168,986	1,840,257.54	0.87
31	600019	宝钢股份	246,991	1,840,082.95	0.87
32	000898	鞍钢股份	265,719	1,655,429.37	0.78
33	000024	招商地产	50,513	1,603,282.62	0.76
34	601618	中国中冶	236,840	1,544,196.80	0.73



长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

35	601600	中国铝业	231,917	1,505,141.33	0.71
36	600118	中国卫星	30,018	1,475,084.52	0.70
37	601998	中信银行	149,434	1,464,453.20	0.69
38	601106	中国一重	133,773	1,439,397.48	0.68
39	600150	中国船舶	33,478	1,419,132.42	0.67
40	600115	东方航空	139,338	1,411,493.94	0.67
41	601111	中国国航	92,000	1,408,520.00	0.67
42	600068	葛洲坝	141,904	1,304,097.76	0.62
43	600271	航天信息	18,327	1,250,451.21	0.59
44	600406	国电南瑞	71,177	1,237,768.03	0.59
45	000423	东阿阿胶	24,089	1,228,298.11	0.58
46	600029	南方航空	97,717	1,168,695.32	0.55
47	600583	海油工程	89,873	1,056,906.48	0.50
48	600875	东方电气	60,897	1,024,896.51	0.48
49	000069	华侨城 A	112,500	1,013,625.00	0.48
50	601991	大唐发电	143,570	990,633.00	0.47
51	600893	中航动力	19,146	972,616.80	0.46
52	000629	攀钢钒钛	210,507	877,814.19	0.41
53	601718	际华集团	71,516	866,058.76	0.41
54	601117	中国化学	101,126	857,548.48	0.41
55	601888	中国国旅	13,874	852,834.78	0.40
56	600372	中航电子	26,741	790,998.78	0.37
57	601179	中国西电	91,380	775,816.20	0.37
58	000778	新兴铸管	88,989	763,525.62	0.36
59	600500	中化国际	51,320	677,424.00	0.32
60	601898	中煤能源	85,750	675,710.00	0.32
61	600320	振华重工	76,738	667,620.60	0.32
62	000800	一汽轿车	41,031	664,702.20	0.31
63	002415	海康威视	20,000	647,800.00	0.31
64	600316	洪都航空	22,108	623,003.44	0.29
65	601800	中国交建	36,214	614,913.72	0.29
66	600489	中金黄金	59,651	613,212.28	0.29
67	002013	中航机电	23,547	611,515.59	0.29
68	600198	大唐电信	21,865	609,814.85	0.29
69	600038	中直股份	10,426	590,528.64	0.28
70	601808	中海油服	30,215	574,689.30	0.27
71	600765	中航重机	23,830	564,294.40	0.27
72	000400	许继电气	27,319	562,498.21	0.27
73	000039	中集集团	22,276	504,551.40	0.24
74	002051	中工国际	19,645	502,715.55	0.24

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

75	000999	华润三九	15,685	456,433.50	0.22
76	600517	置信电气	38,225	452,201.75	0.21
77	000028	国药一致	6,181	422,842.21	0.20
78	600498	烽火通信	15,501	417,906.96	0.20
79	000878	云南铜业	28,319	411,758.26	0.19
80	000831	五矿稀土	21,471	405,157.77	0.19
81	600688	上海石化	55,877	401,755.63	0.19
82	600863	内蒙华电	69,969	396,724.23	0.19
83	600027	华电国际	48,327	395,314.86	0.19
84	600161	天坛生物	13,030	387,121.30	0.18
85	600582	天地科技	18,697	345,894.50	0.16
86	603000	人民网	13,874	343,520.24	0.16
87	000738	中航动控	10,717	285,608.05	0.14
88	600058	五矿发展	6,352	157,148.48	0.07
89	601866	中海集运	13,974	95,023.20	0.04

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资  
明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601006	大秦铁路	308,597	3,548,865.50	1.68
2	601919	中国远洋	265,602	2,294,801.28	1.08
3	601788	光大证券	69,234	1,622,152.62	0.77
4	601333	广深铁路	173,352	989,839.92	0.47
5	601872	招商轮船	47,851	364,146.11	0.17
6	000050	深天马A	11,070	214,315.20	0.10
7	601016	节能风电	6,443	151,152.78	0.07

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

1	600036	招商银行	32,468,460.51	17.91
2	600030	中信证券	25,487,067.24	14.06
3	601818	光大银行	17,800,951.07	9.82
4	000166	申万宏源	17,374,571.00	9.58
5	601988	中国银行	16,786,724.00	9.26
6	000002	万科A	15,086,585.53	8.32
7	601328	交通银行	14,746,245.94	8.13
8	601668	中国建筑	14,529,922.00	8.01
9	600048	保利地产	12,953,042.58	7.14
10	601998	中信银行	12,441,212.21	6.86
11	601390	中国中铁	12,085,613.00	6.67
12	601398	工商银行	11,724,338.37	6.47
13	601288	农业银行	11,000,031.00	6.07
14	601601	中国太保	10,880,989.13	6.00
15	601628	中国人寿	10,680,137.18	5.89
16	601766	中国中车	10,571,362.01	5.83
17	601989	中国重工	10,033,409.00	5.53
18	600795	国电电力	7,755,700.00	4.28
19	600050	中国联通	7,165,310.00	3.95
20	600999	招商证券	7,056,584.10	3.89
21	002051	中工国际	6,609,734.46	3.65
22	600029	南方航空	6,225,188.90	3.43
23	601186	中国铁建	5,959,614.15	3.29
24	600027	华电国际	5,574,186.00	3.07
25	601088	中国神华	5,443,997.82	3.00
26	600705	中航资本	5,443,679.00	3.00
27	601299	中国北车	4,952,278.00	2.73
28	601336	新华保险	4,814,602.63	2.66
29	000768	中航飞机	4,783,612.00	2.64
30	600028	中国石化	4,657,852.00	2.57
31	600011	华能国际	4,655,735.77	2.57
32	600115	东方航空	4,413,839.60	2.43
33	601006	大秦铁路	4,365,686.00	2.41
34	600019	宝钢股份	4,206,798.00	2.32
35	601669	中国电建	4,193,315.00	2.31
36	601857	中国石油	4,162,503.00	2.30
37	000625	长安汽车	4,070,811.66	2.25
38	000898	鞍钢股份	4,057,918.00	2.24
39	601800	中国交建	3,978,007.00	2.19
40	601618	中国中冶	3,783,125.00	2.09

41	601600	中国铝业	3,750,756.00	2.07
----	--------	------	--------------	------

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	32,599,025.35	17.98
2	600030	中信证券	26,940,420.48	14.86
3	601818	光大银行	17,725,062.92	9.78
4	000002	万科A	14,895,408.91	8.21
5	601668	中国建筑	14,682,015.41	8.10
6	000166	申万宏源	14,317,870.62	7.90
7	600048	保利地产	12,857,325.06	7.09
8	601390	中国中铁	12,675,471.88	6.99
9	601328	交通银行	12,667,193.21	6.99
10	601998	中信银行	12,652,098.16	6.98
11	601601	中国太保	11,345,955.67	6.26
12	601989	中国重工	11,320,700.99	6.24
13	601766	中国中车	11,159,984.33	6.15
14	601288	农业银行	10,615,885.96	5.85
15	601628	中国人寿	10,529,754.31	5.81
16	601398	工商银行	9,621,164.27	5.31
17	601988	中国银行	8,840,342.03	4.88
18	600999	招商证券	7,572,179.02	4.18
19	600795	国电电力	7,560,233.85	4.17
20	600050	中国联通	7,311,931.27	4.03
21	600029	南方航空	7,168,986.26	3.95
22	002051	中工国际	7,081,598.91	3.91
23	601088	中国神华	6,709,742.57	3.70
24	601186	中国铁建	6,507,049.76	3.59
25	600027	华电国际	6,273,232.15	3.46
26	601800	中国交建	5,415,043.06	2.99
27	601336	新华保险	5,227,580.18	2.88
28	000768	中航飞机	5,192,318.34	2.86
29	600011	华能国际	5,155,139.55	2.84
30	600271	航天信息	5,112,380.94	2.82
31	600705	中航资本	4,901,431.68	2.70
32	002415	海康威视	4,743,647.97	2.62
33	000625	长安汽车	4,685,505.94	2.58

34	000069	华侨城 A	4,554,949.28	2.51
35	600115	东方航空	4,457,589.40	2.46
36	600019	宝钢股份	4,401,303.70	2.43
37	600886	国投电力	4,222,199.95	2.33
38	601618	中国中冶	4,002,281.22	2.21
39	601669	中国电建	3,880,860.14	2.14
40	600150	中国船舶	3,854,694.65	2.13
41	601106	中国一重	3,706,382.70	2.04
42	600900	长江电力	3,661,402.53	2.02
43	600406	国电南瑞	3,627,417.12	2.00

注：本项“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	498,231,919.28
卖出股票收入（成交）总额	503,163,532.16

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券中，中信证券（600030）的发行主体于2015年1月18日发布公告称因存在为到期融资融券合约展期的问题（根据相关规定，融资融券合约期限最长为6个月），公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。对此，公司已采取以下整改措施：1、暂停新开立融资融券客户信用账户3个月。2、自2015年1月16日起，公司将不允许新增任何新的合约逾期，距合约到期前将反复提醒客户及时了结合约，对于到期未了结的合约将强制平仓。3、在监管规定的时间内，清理完成旧的逾期合约。4、将融资融券业务客户开户条件由客户资产满人民币30万元提高到客户资产满人民币50万元。

对该股票投资决策程序的说明：本基金采用完全复制法，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。金融工程部根据上述投资策略将该股票纳入基金投资对象备选库并进行投资。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	139,442.36
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—

4	应收利息	1,196,718.29
5	应收申购款	3,186,681.13
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,522,841.78

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 8 投资组合报告（转型后）

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	138,290,066.53	89.05
	其中：股票	138,290,066.53	89.05
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	15,680,619.36	10.10
7	其他各项资产	1,329,447.33	0.86
8	合计	155,300,133.22	100.00

注：本基金本报告期末未通过沪港通交易机制投资港股。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	122,391,038.48	79.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	8,501,302.95	5.54
G	交通运输、仓储和邮政业	2,080,601.00	1.36
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—



长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	5,317,124.10	3.47
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	138,290,066.53	90.17

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600867	通化东宝	141,349	3,840,452.33	2.50%
2	300255	常山药业	214,500	3,755,895.00	2.45%
3	000078	海王生物	151,380	3,627,064.80	2.37%
4	300246	宝莱特	87,600	3,617,880.00	2.36%
5	002287	奇正藏药	86,988	3,616,961.04	2.36%
6	002349	精华制药	90,002	3,483,077.40	2.27%
7	002020	京新药业	96,400	3,234,220.00	2.11%
8	300267	尔康制药	92,690	3,114,384.00	2.03%
9	002399	海普瑞	87,900	3,109,023.00	2.03%
10	002551	尚荣医疗	91,760	3,025,327.20	1.97%
11	002332	仙琚制药	198,778	3,011,486.70	1.96%
12	002644	佛慈制药	177,450	3,009,552.00	1.96%
13	002007	华兰生物	68,100	2,996,400.00	1.95%
14	300026	红日药业	141,800	2,991,980.00	1.95%
15	000963	华东医药	36,500	2,991,540.00	1.95%
16	002317	众生药业	219,500	2,906,180.00	1.90%
17	300206	理邦仪器	103,900	2,863,484.00	1.87%
18	000661	长春高新	23,766	2,862,614.70	1.87%
19	002262	恩华药业	97,150	2,843,580.50	1.85%
20	300122	智飞生物	77,431	2,816,939.78	1.84%
21	300233	金城医药	85,000	2,776,100.00	1.81%
22	300289	利德曼	138,100	2,748,190.00	1.79%

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

23	300015	爱尔眼科	86,895	2,744,144.10	1.79%
24	002294	信立泰	89,499	2,695,709.88	1.76%
25	002393	力生制药	55,600	2,685,480.00	1.75%
26	002223	鱼跃医疗	68,996	2,652,896.20	1.73%
27	002424	贵州百灵	103,100	2,645,546.00	1.73%
28	300244	迪安诊断	37,000	2,572,980.00	1.68%
29	600572	康恩贝	177,000	2,364,720.00	1.54%
30	300301	长方照明	219,800	2,360,652.00	1.54%
31	600727	鲁北化工	213,300	2,312,172.00	1.51%
32	002322	理工监测	87,110	2,201,269.70	1.44%
33	002606	大连电瓷	117,700	2,118,600.00	1.38%
34	000429	粤高速 A	301,100	2,080,601.00	1.36%
35	300193	佳士科技	151,635	2,018,261.85	1.32%
36	000903	云内动力	241,300	2,002,790.00	1.31%
37	002487	大金重工	126,100	1,790,620.00	1.17%
38	300326	凯利泰	61,200	1,708,704.00	1.11%
39	300194	福安药业	68,500	1,681,675.00	1.10%
40	300173	智慧松德	92,800	1,663,904.00	1.08%
41	300238	冠昊生物	28,561	1,618,551.87	1.06%
42	000756	新华制药	112,200	1,504,602.00	0.98%
43	600222	太龙药业	155,000	1,458,550.00	0.95%
44	000929	兰州黄河	116,000	1,450,000.00	0.95%
45	000004	国农科技	31,100	1,427,490.00	0.93%
46	600796	钱江生化	101,600	1,341,120.00	0.87%
47	300048	合康变频	63,100	1,337,089.00	0.87%
48	002511	中顺洁柔	114,200	1,333,856.00	0.87%
49	300239	东宝生物	70,500	1,308,480.00	0.85%
50	600351	亚宝药业	81,400	1,271,468.00	0.83%
51	002252	上海莱士	31,274	1,243,766.98	0.81%
52	600833	第一医药	56,500	1,139,040.00	0.74%
53	300158	振东制药	56,200	1,138,050.00	0.74%
54	002433	太安堂	74,500	1,107,070.00	0.72%
55	300142	沃森生物	83,000	1,093,940.00	0.71%
56	600488	天药股份	143,600	1,058,332.00	0.69%
57	300086	康芝药业	55,100	969,760.00	0.63%
58	002099	海翔药业	40,100	956,385.00	0.62%
59	300261	雅本化学	62,880	949,488.00	0.62%
60	600285	羚锐制药	64,800	858,600.00	0.56%
61	002566	益盛药业	49,000	798,700.00	0.52%
62	600297	广汇汽车	57,500	738,300.00	0.48%
63	002603	以岭药业	35,300	639,989.00	0.42%

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

64	300119	瑞普生物	16,500	331,650.00	0.22%
65	002107	沃华医药	8,200	212,626.00	0.14%
66	000766	通化金马	12,500	209,250.00	0.14%
67	300381	溢多利	3,700	207,348.00	0.14%
68	300199	翰宇药业	8,400	206,892.00	0.13%
69	002437	誉衡药业	6,800	205,700.00	0.13%
70	300003	乐普医疗	5,300	204,580.00	0.13%
71	002693	双成药业	13,700	203,445.00	0.13%
72	600529	山东药玻	10,300	199,099.00	0.13%
73	002786	银宝山新	500	13,680.00	0.01%
74	000028	国药一致	81	5,358.15	0.00%
75	600271	航天信息	85	4,752.35	0.00%

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002223	鱼跃医疗	5,991,296.76	2.83
2	300255	常山药业	5,750,324.06	2.72
3	002007	华兰生物	5,026,758.67	2.38
4	002433	太安堂	4,928,540.00	2.33
5	300267	尔康制药	4,917,556.41	2.32
6	300244	迪安诊断	4,737,366.63	2.24
7	300246	宝莱特	4,660,814.50	2.20
8	002644	佛慈制药	4,658,391.00	2.20
9	300318	博晖创新	4,644,063.00	2.20
10	002317	众生药业	4,603,486.00	2.18
11	300049	福瑞股份	4,589,083.76	2.17
12	002566	益盛药业	4,586,229.00	2.17
13	300026	红日药业	4,533,498.52	2.14
14	002365	永安药业	4,429,350.40	2.09
15	002393	力生制药	4,318,054.00	2.04
16	002287	奇正藏药	4,196,989.28	1.98
17	300015	爱尔眼科	4,168,421.58	1.97
18	002252	上海莱士	4,157,158.03	1.97
19	002424	贵州百灵	4,081,859.00	1.93

20	600727	鲁北化工	4,071,431.00	1.92
----	--------	------	--------------	------

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	14,882,567.20	7.04
2	601988	中国银行	8,527,871.78	4.03
3	600030	中信证券	7,779,191.50	3.68
4	601766	中国中车	7,637,745.06	3.61
5	000002	万科A	7,315,654.53	3.46
6	601328	交通银行	7,013,116.90	3.32
7	601398	工商银行	5,924,789.36	2.80
8	601668	中国建筑	5,674,725.10	2.68
9	300318	博晖创新	5,064,018.75	2.39
10	601390	中国中铁	4,908,087.14	2.32
11	601818	光大银行	4,779,924.56	2.26
12	601288	农业银行	4,715,278.60	2.23
13	601989	中国重工	4,609,286.89	2.18
14	300381	溢多利	4,590,458.50	2.17
15	300049	福瑞股份	4,285,740.00	2.03
16	300214	日科化学	4,090,215.00	1.93
17	601601	中国太保	4,088,978.30	1.93
18	002365	永安药业	3,988,719.00	1.89
19	002433	太安堂	3,610,781.00	1.71
20	600613	神奇制药	3,521,242.20	1.66

注：本项“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	285,998,089.03
卖出股票收入（成交）总额	350,948,626.90

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定的备选股票库的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

序号	名称	金额
1	存出保证金	160,428.18
2	应收证券清算款	885,181.87
3	应收股利	—
4	应收利息	4,354.99
5	应收申购款	279,482.29
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,329,447.33

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值(元)	占基金资产净值 比例(%)	流通受限情况说 明
1	002020	京新药业	3,234,220.00	2.11	停牌

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息（转型前）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
12,303	16,806.69	407,038.76	0.20%	206,365,679.55	99.80%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	韩亚平	540,000.00	8.36%
2	陈志彪	308,157.00	4.77%
3	冯宝东	291,865.00	4.52%
4	陈军	285,315.00	4.42%
5	段久发	240,925.00	3.73%
6	郭国熙	237,762.00	3.68%
7	张伟建	227,500.00	3.52%
8	常桂荣	115,200.00	1.78%
9	曹德华	102,822.00	1.59%
10	易本文	100,022.00	1.55%

注：持有人为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	24,407.04	0.01%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0



## §9 基金份额持有人信息（转型后）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
9,927	14,339.95	541,581.26	0.38%	141,811,150.53	99.62%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	冯宝东	291,865.00	6.17%
2	陈志彪	285,445.00	6.03%
3	张伟建	227,500.00	4.81%
4	郭国熙	200,000.00	4.23%
5	高德荣	140,000.00	2.96%
6	陆贺川	115,700.00	2.45%
7	常桂荣	110,200.00	2.33%
8	郑智军	103,200.00	2.18%
9	曹德华	102,822.00	2.17%
10	林园新	100,000.00	2.11%

注：持有人为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	7,804.21	0.01%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	长信医疗保健混合（LOF）
基金合同生效日(2010年3月26日)基金份额总额	743,255,611.35
本报告期期初基金份额总额	145,678,728.55
本报告期期间基金总申购份额	7,049,907,293.19
减：本报告期期间基金总赎回份额	6,988,813,303.43
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	206,772,718.31

## § 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	
基金转型生效日(2015年7月20日)基金份额总额	206,772,718.31
本基金转型生效日起至报告期期末基金总申购份额	86,194,355.13
减：本基金转型生效日起至报告期期末基金总赎回份额	150,614,341.65
本基金转型生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	142,352,731.79

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

基金管理人自2015年7月10日起至2015年7月16日17:00止，以通讯方式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》。经统计，权益登记日本基金总份额为322,487,460.88份，有效参加基金份额持有人大会表决的基金份额共计205,404,968.84份，占权益登记日该基金总份额的63.69%，达到法定的基金份额持有人大会召开条件。经表决，同意本次会议议案的基金份额占有效参加本次会议表决的基金份额持有人所持基金份额的100%，本次会议议案于2015年7月20日获得通过，基金管理人已于2015年7月22日在指定信息披露媒体及公司网站上就决议生效事项进行了公告。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，原董事长田丹先生离职，覃波先生自2015年4月28日起代为履行董事长（法定代表人）职责。因新任董事长（法定代表人）叶焯先生自2015年7月21日起正式任职，覃波先生自该日起不再代为履行董事长（法定代表人）职责，本基金管理人已按相关规定进行备案，并及时办理法定代表人的工商变更登记等相关手续。

自2015年4月29日起，本基金管理人增聘邵彦明先生、李小羽先生为副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在指定信息披露媒体发布相应的《基金行业高级管理人员变更公告》。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人2015年1月4日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人2015年9月18日发布任免通知，解聘纪伟中

国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

自 2015 年 7 月 20 日起，《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》正式生效，其投资策略变更为：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、其他类型资产投资策略。

本基金详细的投资策略可参见《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）合同》等法律文件。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所；报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 60,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 6 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券有限公司	1	418,667,044.16	65.73%	388,964.12	65.83%	
中信建投有	1	218,274,311.77	34.27%	201,893.89	34.17%	

限责任公司						
-------	--	--	--	--	--	--

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用的交易单元无变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字〔1998〕29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 券商协作表现评价。

（2）选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金2014年12月31日资产净值的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-1-1
2	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）恢复大额申购、定期定额投资业务的公告	上证报、中证报	2015-1-13
3	长信基金管理有限责任公司关于增加西南证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通定期定额投资业务及转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-1-15
4	长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）2014年第4季度报告	中证报、上证报	2015-1-21
5	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放	上证报、中证报、证	2015-3-9

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

	式证券投资基金参加杭州数米基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	券时报	
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加齐鲁证券有限公司网上交易系统申购、定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-3-11
7	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）基金经理变更的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-3-14
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在中山证券有限责任公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-3-23
9	长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）2014 年年报及摘要	中证报、上证报	2015-3-28
10	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-3-30
11	长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）2015 年第 1 季度报告	中证报、上证报	2015-4-20
12	长信基金管理有限责任公司关于增加广州证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-4-29
13	长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）更新的招募说明书（2015 年第【1】号）及摘要	上证报、中证报	2015-5-9
14	长信基金管理有限责任公司关于在平安银行股份有限公司开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-5-12
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金继续参加重庆银行股份有限公司基金网上申购和定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报	2015-5-20
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-5-29
17	长信基金管理有限责任公司关于增加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为旗下部分	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-6-11



长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

	开放式基金代销机构并开通定期定额投资业务、参加申购（含定投申购）费率优惠活动及开通转换业务的公告		
18	长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式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的公告	上证报、中证报	2015-6-16
19	长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式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的第一次提示性公告	上证报、中证报	2015-6-17
20	长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式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的第二次提示性公告	上证报、中证报	2015-6-18
21	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金的分红预告	上证报、中证报、证券时报	2015-6-19
22	长信基金管理有限责任公司关于在第一创业证券股份有限公司开通旗下部分开放式基金的定期定额投资业务并参加基金申购、定期定额投资费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-6-25
23	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-6-29
24	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	上证报、中证报	2015-7-4
25	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）场外份额在直销渠道开通转换业务并实施转换费率优惠的公告	上证报、中证报、证券日报	2015-7-7
26	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加平安银行股份有限公司定期定额投资费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-7-8
27	长信基金管理有限责任公司关于暂停直销渠道长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）与长信利息收益开放式证券投资基金之间转换业务的公告	上证报、中证报、证券日报	2015-7-11
28	长信基金管理有限责任公司关于长信中证	上证报、中证报	2015-7-20

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

	中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 停牌提示性公告		
29	长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF) 2015 年第 1 季度报告	中证报、上证报	2015-7-21
30	长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同及摘要	上证报、中证报	2015-7-22
31	长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 托管协议	上证报、中证报	2015-7-22
32	长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书	上证报、中证报	2015-7-22
33	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) 基金份额持有人大会决议生效公告	上证报、中证报	2015-7-22
34	长信基金管理有限责任公司关于长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) (原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金 (LOF)) 费率等事项的提示性公告	上证报、中证报	2015-7-23
35	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加上海浦东发展银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-7-30
36	长信基金管理有限责任公司关于增加中信期货有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-8-5
37	长信基金管理有限责任公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购 (含定投申购) 费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-8-12
38	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加平安银行股份有限公司申购 (含定投申购) 费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-8-12
39	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加上海天天基金销售有限公司认购、申购 (含定期定额投资申购) 费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-8-22
40	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加国都证券股份有	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-8-27

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

	限公司申购费率优惠的公告		
41	长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）2015 年半年度报告及摘要	中证报、上证报	2015-8-27
42	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加华宝证券有限责任公司申购费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-9-2
43	长信基金管理有限责任公司关于增加上海汇付金融服务有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-9-10
44	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加上海好买基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-9-24
45	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加平安证券有限责任公司申购费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-10-16
46	长信基金管理有限责任公司关于“长金通”网上直销平台申购（含定期定额申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-10-21
47	长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2015 年第 3 季度报告	上证报、中证报、证券时报	2015-10-26
48	长信基金管理有限责任公司关于增加大泰金石投资管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-10-29
49	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加上海长量基金销售投资顾问有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-11-16
50	长信基金管理有限责任公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-11-26
51	长信基金管理有限责任公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-12-1

长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
（原长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF））2015 年年度报告

	务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告		
52	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加平安证券有限责任公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-12-18
53	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司基金组合申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-12-30
54	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-12-30
55	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司定期定额投资申购费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报	2015-12-30
56	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金调整开放时间的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2015-12-31

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《长信中证中央企业100指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 6、《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 7、《长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 9、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在有效的工作时间内免费查阅，在支付工本费后，也可在有效的工作时间内取得上述文件的复制件或复印件。

长信基金管理有限责任公司

二〇一六年三月二十六日