长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金

（原长盛同鑫保本混合型证券投资基金转型）

2014 半年度 报告摘要

2014年6月30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
送出日期:2014年8月28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2014年8月27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。

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定由长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来。长盛同鑫保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2011]519号文核准,每个保本周期为三年,第一个保本周期自2011年5月24日开始至2014年5月24日(含)到期,鉴于2014年5月24日至5月25日为非工作日,因此第一个保本周期届满日顺延至下一工作日,即2014年5月26日。根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,在保本周期届满后,长盛同鑫保本混合型证券投资基金变更为“长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金”,变更后基金的投资及基金费率等按照《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。就前述基金变更事项,本基金管理人已按照相关法律法规及本基金基金合同约定履行相关备案手续。

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2014年1月1日起至6月30日止。(其中转型前长盛同鑫保本混合型证券投资基金报告期自2014年1月1日起至2014年5月26日止,转型后长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金报告期自2014年5月27日起至2014年6月30日止)

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	长盛同鑫保本混合
基金主代码	080007
交易代码	080007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月24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	351,679,073.44份
基金合同存续期	长盛同鑫保本混合型证券投资基金的保本周期期限为三年,自基金合同生效日(即2011年5月24日)起至三个公历年后对应日止,如该对应日为非工作日,保本周期到期日顺延至下一个工作日,即2014年5月26日。

注:上表中“报告期末”为基金转型前最后一日,即2014年5月26日。

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	长盛同鑫行业混合
基金主代码	080007
交易代码	080007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5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	196,779,756.42份
基金合同存续期	不定期

注:上表中“报告期末”为2014年6月30日。

2.2 基金产品说明(转型前)

投资目标	依据本基金的保证合同,本基金通过运用投资组合保险策略,在严格控制风险和保证本金安全的基础上,力争在本基金保本周期结束时,实现基金资产的收益增长。
投资策略	本基金投资策略突出强调配置的科学性与纪律性,通过严格金融工程手段有效控制风险,保证实现投资期中的稳定收益,并通过有效地资产配置和保本投资策略以保障基金资产本金的安全。 本基金将按照恒定比例组合保险机制(CPPI)将资产配置于安全资产与风险资产,用投资于固定收益类证券的现金净流入来冲抵风险资产组合潜在的最大亏损,并通过投资股票等风险资产来获得资本利得。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种。未持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额,不享受保本担保。

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会,在控制风险的前提下,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	(1)本基金在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上,把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化,挖掘预期具有良好增长前景的优势行业,以谋求行业配置的超额收益。 (2)在资产配置层面,本基金管理人对宏观经济的经济周期进行预测,在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断,确定基金资产在各类别资产间的分配比例。具体操作中,采用经济周期资产配置模型,通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析,对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测,然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。(3)在行业配置层面,通过宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响,得出各行业的相对投资价值与投资时机,据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业,把握行业景气轮换带来的投资机会;(4)在股票选择层面,本基金综合运用长盛行业股票研究分析方法和其它投资分析工具,采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合,前述优势行业中股票优先入选。
业绩比较基准	60%*沪深300指数+40%*中证全债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金、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		010-82255988	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	基金管理人和基金托管人的住所

§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	转型前	转型后
	报告期(2014年1月1日至2014年5月26日)	报告期(2014年5月27日(基金合同生效日)起至6月30日)
本期已实现收益	17,574,852.14	1,160,424.41
本期利润	12,415,659.17	1,881,874.44
加权平均基金份额本期利润	0.0196	0.0082
本期基金份额净值增长率	1.84%	0.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年5月26日)	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0522	0.0613
期末基金资产净值	370,035,450.40	208,848,893.50
期末基金份额净值	1.052	1.061

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(注:长盛同鑫保本混合型证券投资基金本报告期最后一日,即5月26日)。

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

转型前						
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	0.29%	0.04%	0.30%	0.01%	-0.01%	0.03%
过去三个月	0.57%	0.05%	0.64%	0.01%	-0.07%	0.04%
过去六个月	1.84%	0.07%	1.69%	0.01%	0.15%	0.06%
过去一年	2.63%	0.09%	3.90%	0.01%	-1.27%	0.08%
过去三年	8.24%	0.11%	13.74%	0.01%	-5.50%	0.10%
自基金合同生效起至今	8.46%	0.11%	14.30%	0.01%	-5.84%	0.10%

注:1、过去一个月:2014年5月1日至2014年5月26日,过去三个月:2014年4月1日至2014年5月26日,过去六个月:2014年1月1日至2014年5月26日,过去一年:2013年7月1日至2014年5月26日,过去三年:2011年7月1日至2014年5月26日,自基金合同生效起至今:2011年5月24日至2014年5月26日。

2、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为基金合同成立日所在年度的中国人民银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益率。本基金是保本型基金产品,保本周期为3年。以3年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征,合理衡量比较本基金保本保证的有效性。

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:长盛同鑫保本混合型证券投资基金存续期为2011年5月24日至2014年5月26日。

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

转型后						
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	0.76%	0.17%	0.57%	0.46%	0.19%	-0.29%
自基金转型起至今	0.86%	0.15%	0.68%	0.45%	0.18%	-0.30%

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:60%×沪深300指数+40%×中证全债指数

基准指数的构建考虑了三个原则:

1、公允性。本基金为混合型基金,在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后,选定沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准;债券组合的业绩基准则采用中证全债指数。目前沪深300指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性,用为衡量本基金业绩的基准较为合适。

2、可比性。本基金在运作过程中将维持40%-95%的股票、权证等权益类资产,根据本基金投资策略,业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

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60%、40%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、长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金由长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来,变更日期为2014年5月27日。截至本报告期末本基金转型未满一年。

2、按照本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为:股票、权证等权益类资产占基金资产的40%-95%;其中,持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具(包括一年以内的短期国债、回购协议等)、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证券品种占基金资产的0%-40%,其中基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

§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15000万元。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2014年6月30日,基金管理人共管理一只封闭式基金、三十四只开放式基金,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(转型前)

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		
蔡宾	本基金基金经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理,公司总经理助理,社保组合组合经理,固定收益部总监。	2011年5月24日	2014年5月26日	10年	男,1978年11月出生,中国国籍。毕业于中央财经大学,获硕士学位,CFA(特许金融分析师)。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究员、社保组合助理,投资经理,长盛积极配置债券基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理等职务。现任公司总经理助理,固定收益部总监,社保组合组合经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经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。

基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型后)

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		
蔡宾	本基金基金经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理,公司总经理助理,社保组合组合经理,固定收益部总监。	2014年5月27日	-	10年	男,1978年11月出生,中国国籍。毕业于中央财经大学,获硕士学位,CFA(特许金融分析师)。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究员、社保组合助理,投资经理,长盛积极配置债券基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理等职务。现任公司总经理助理,固定收益部总监,社保组合组合经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理,长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金(本基金)基金经理。

注:1、上表基金经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和利益输送的行为。

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,共发生4次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

上半年,债券市场总体呈现牛市格局,疲弱的经济基本面、定向放松的货币政策以及宽松的资金面共同驱动本轮上涨行情。从不同品种的市场表现看,利率债收益率在经历了去年下半年的大幅攀升后,出现了明显回落。信用债则呈现出明显的分化趋势,其中城投债由于背靠政府信用,受到市场追捧;而低评级信用债的风险溢价显著上升,其主要原因在于高风险企业经营恶化导致违约风险上升、信托产品刚性兑付打破、交易所高风险债券质押回购标准更趋严格以及流动性丧失预期。

报告期内,本基金坚持稳健操作思路,久期匹配策略在保本期内始终得到贯彻,完成了保本基金周期,并为转换进入行业配置型基金做了相应的准备。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,长盛同鑫行业混合份额净值为1.061元,本报告期(2014年5月27日至2014年6月30日)份额净值增长率为0.86%,同期业绩比较基准增长率为0.68%。

截至2014年5月26日,长盛同鑫保本混合份额净值为1.052元,本报告期(2014年1月1日至2014年5月26日)份额净值增长率为1.84%,同期业绩比较基准增长率为1.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年,在经济下行压力下,央行将继续采用定向宽松的货币政策,并有望进一步加大宽松力度,资金面总体上仍将维持中性偏松格局。短期看,前期政府刺激政策令经济出现企稳迹象,加之IPO对资金面的扰动,债市短期或呈震荡调整行情。但从较长一段时间看,企业融资成本高企、房地产投资下滑对实体经济的拖累将继续显现。随着短期刺激政策的减弱或淡出,经济仍然存在回落的可能性。

展望后市,我们对债券市场总体持谨慎乐观态度。权益资产经过数年的低迷,估值水平处在低位,没有反映整体健康的经济形势,存在估值修复的投资机会。

后续投资策略上,我们将继续坚持稳健操作思路,统筹衡量固定收益类和权益类资产的投资价值和投资机会,总体上采取绝对收益的策略。股票资产自下而上选取业绩确定性较高、估值水平合理、反映经济结构转型的品种,逐步建仓,完成组合从保本型向行业配置型的转化。同时密切关注一级市场的投资机会,寻找较好的投资标的适度参与。固定收益资产中,利率债持谨慎乐观态度,择机而动,在仓位和久期上根据经济基本面和市场形势变化灵活应对。信用债在信用分化日益明显的环境中,通过加强信用研究深度积极挖掘信用风险可控、持有回报较高的个券的投资价值。同时,密切关注和规避低评级债券的信用风险,严格控制其仓位和久期,做好个券甄别。

我们将继续秉承谨慎原则,做好组合配置,力求实现基金资产的稳定增值。

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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的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《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》第十六部分中对基金收益分配原则的约定,长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金于报告期内未进行利润分配。

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金截至2014年6月30日,期末可供分配收益为12,069,137.08元,其中:未分配收益已实现部分为14,248,152.80元,未分配收益未实现部分为-2,179,015.72元。

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》第二十条中对基金收益分配原则的约定,长盛同鑫保本混合型证券投资基金于报告期末实施利润分配。

长盛同鑫保本混合型证券投资基金截止2014年5月26日,期末可供分配收益为18,356,376.96元,其中:未分配收益已实现部分为23,889,014.78元,未分配收益未实现部分为-5,532,637.82元。

§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)(转型前)

6.1 资产负债表(转型前)

会计主体:长盛同鑫保本混合型证券投资基金

报告截止日:2014年5月26日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年5月26日	上年度末 2013年12月31日
资产:		
银行存款	350,393,412.46	75,118,560.59
结算备付金	671,626.68	14,131,712.25
存出保证金	154,395.85	162,278.31
交易性金融资产	112,024,966.26	813,808,237.05
其中:股票投资	10,226,242.26	-
基金投资	-	-
债券投资	101,798,724.00	813,808,237.05
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	12,299,493.71
应收利息	2,712,540.06	10,829,502.72
应收股利	-	-
应收申购款	-	13,744.36
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	465,956,941.31	926,363,528.99
负债和所有者权益	本期末 2014年5月26日	上年度末 2013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	-	195,979,897.20
应付证券清算款	-	10,014,099.34
应付赎回款	93,947,750.53	1,858,838.95
应付管理人报酬	502,055.27	748,821.60
应付托管费	83,675.88	124,803.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	58,156.74	42,738.25
应交税费	1,175,703.80	1,175,703.80
应付利息	-	52,325.49
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	154,148.69	394,908.87
负债合计	95,921,490.91	210,392,137.10
所有者权益:		
实收基金	351,679,073.44	693,197,122.82
未分配利润	18,356,376.96	22,774,269.07
所有者权益合计	370,035,450.40	715,971,391.89
负债和所有者权益总计	465,956,941.31	926,363,528.99

注:1、报告截止日2014年5月26日,基金份额净值:1.052元,基金份额总额:351,679,073.44份。

2、本财务报表的实际编制期间为2014年1月1日至2014年5月26日止。

6.2 利润表

会计主体:长盛同鑫保本混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年5月26日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年5月26日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	17,540,875.58	25,776,354.45
1.利息收入	13,068,559.49	25,383,677.03
其中:存款利息收入	6,704,475.72	3,208,889.42
债券利息收入	6,297,452.37	22,174,787.61
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	66,631.40	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	9,463,024.78	6,915,179.46
其中:股票投资收益	-2,310,970.04	59,192.18
基金投资收益	-	-
债券投资收益	11,678,994.82	6,650,627.28
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	95,000.00	205,360.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-5,159,192.97	-7,131,857.75
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	168,484.28	609,355.71
减:二、费用	5,125,216.41	17,437,470.10
1.管理人报酬	3,177,233.66	6,728,158.09
2.托管费	529,538.93	1,121,359.71
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	95,562.86	268,856.94
5.利息支出	1,156,179.66	9,094,697.48
其中:卖出回购金融资产支出	1,156,179.66	9,094,697.48
6.其他费用	166,701.30	224,397.88
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	12,415,659.17	8,338,884.35
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	12,415,659.17	8,338,884.35

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛同鑫保本混合型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年5月26日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年5月26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)	693,197,122.82	22,774,269.07	715,971,391.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,415,659.17	12,415,659.17
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)	-341,518,049.38	-16,833,551.28	-358,351,600.66
其中:1.基金申购款	2,629,004.08	113,481.63	2,742,485.71
2.基金赎回款	-344,147,053.46	-16,947,032.91	-361,094,086.37
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)	351,679,073.44	18,356,376.96	370,035,450.40
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	1,210,328,332.60	25,593,937.69	1,235,922,270.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,338,884.35	8,338,884.35
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)	-270,112,892.64	-9,976,097.16	-280,088,989.80
其中:1.基金申购款	3,283,829.92	124,073.06	3,407,902.98
2.基金赎回款	-273,396,722.56	-10,100,170.22	-283,496,892.78
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)	940,215,439.96	23,956,724.88	964,172,164.84

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	林培富	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

长盛同鑫保本混合型证券投资基金(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”)证监基金字[2011]第519号《关于核准长盛同鑫保本混合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《长盛同鑫保本混合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3,031,349,989.30元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司(事务所的性质已变更为特殊普通合伙)普华永道中天验字(2011)第190号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于2011年5月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,032,111,617.30份基金份额,其中认购资金利息折合761,628.00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。本基金的担保人为安徽省信用担保集团有限公司,为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证担保。

根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的保本期一般每三年为一个周期;在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本期默认选择转入当期保本期的基金份额持有人持有本基金至当期保本期到期的,如可赎回金额加上保本期内的累计分红金额高于或等于其投资净额,本基金的基金管理人将按可赎回金额支付给基金份额持有人;如可赎回金额加上保本期内的累计分红金额低于其投资净额,本基金的担保人将保证向符合上述条件的本基金份额持有人承担上述差额部分的偿付并及时清偿,担保额度为人民币51亿元。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回的,赎回部分不适用保本条款;基金份额持有人在保本期申购的基金份额也不适用保本条款。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同鑫保本混合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)、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。本基金投资组合中本基金投资于股票投资占基金资产的比例不高于30%;投资于债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不得低于70%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:3年期银行定期存款税后收益率。

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、以及其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释和其他相关规定(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》、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》和中国证监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

本基金2014年1月1日至2014年5月26日止期间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2014年5月26日的财务状况以及2014年1月1日至2014年5月26日止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一致的说明

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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局颁布的财税[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(“长盛基金公司”)	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
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东、基金担保人

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:本基金未开立关联方交易单元。

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 2014年1月1日至2014年5月26日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,177,233.66	6,728,158.09
其中:支付销售机构的客户维护费	1,354,022.50	2,892,844.06

注:支付基金管理人长盛基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年5月26日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	529,538.93	1,121,359.71

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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:本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行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

份额单位:份

项目	本期 2014年1月1日至2014年5月26日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
期初持有的基金份额	19,999,000.00	19,999,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	19,999,000.00	19,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.69%	2.13%

注:基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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 2014年1月1日至2014年5月26日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	350,393,412.46	103,448.75	65,094,892.57	68,215.43

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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金由安徽省信用担保集团有限公司作为担保人,为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证担保。保证担保的范围为:在本保本期到期时,基金份额持有人持有到期的基金份额的可赎回金额加上本保本期内本基金的累计分红金额,低于投资净额时的差额部分,担保额度为人民币51亿元。基金份额持有人指在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人。持有到期指在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人在本保本期内一直持有其在本基金的募集期内认购的基金份额。本基金的担保费由本基金的基金管理人按基金资产净值0.20%的年费率从基金管理费收入中列支。

6.4.9 期末(2014年5月26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:本基金本期末无因认购新发/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
000418	小天鹅A	2014年5月12日	重大事项	9.15	2014年6月9日	10.07	100,000	966,259.50	915,000.00	-

注:本基金截至2014年5月26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

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本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

(1) 公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

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相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

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、除第一层级中的市场报价以外的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)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2014年5月26日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为90,989,966.26元,属于第二层级的余额为21,035,000.00元,无属于第三层级的余额(2013年12月31日:第一层级624,380,237.05元,第二层级189,428,000.00元,无属于第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,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)、或属于非公开发行等情况,本基金不会分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2013年12月31日:同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元(2013上半年度:净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元。)

(2)除公允价值外,本基金无需要说明的其他重要事项。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)(转型后)

6.1 资产负债表(转型后)

会计主体:长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年6月30日
资产:	
银行存款	90,566,868.49
结算备付金	140,000.00
存出保证金	151,615.51
交易性金融资产	120,623,475.33
其中:股票投资	38,935,873.00
基金投资	-
债券投资	81,687,602.33
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	2,689,662.65
应收股利	-
应收申购款	2,279.21
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	214,173,901.19
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30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	-
应付赎回款	3,592,151.10
应付管理人报酬	282,208.41
应付托管费	47,034.73
应付销售服务费	-
应付交易费用	41,489.40
应交税费	1,175,703.80
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	186,420.25
负债合计	5,325,007.69
所有者权益:	
实收基金	196,779,756.42
未分配利润	12,069,137.08
所有者权益合计	208,848,893.50
负债和所有者权益总计	214,173,901.19

注:1、报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.061元,基金份额总额196,779,756.42份。 2、本基金合同于2014年5月27日生效,本财务报表的实际编制期间为2014年5月27日至2014年6月30日止期间。

6.2 利润表

会计主体:长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金

本报告期:2014年5月27日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年5月27日至2014年6月30日
一、收入	2,347,861.03
1.利息收入	470,732.67
其中:存款利息收入	101,902.47
债券利息收入	368,830.20
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)	1,154,995.56
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	1,126,495.56
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	28,500.00
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	721,450.03
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	682.77
减:二、费用	465,986.59
1.管理人报酬	344,364.07
2.托管费	57,394.01
3.销售服务费	-
4.交易费用	28,995.58
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	35,232.93
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	1,881,874.44
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	1,881,874.44

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金

本报告期:2014年5月27日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年5月27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)	351,679,073.44	18,356,376.96	370,035,450.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,881,874.44	1,881,874.44
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)	-154,899,317.02	-8,169,114.32	-163,068,431.34
其中:1.基金申购款	88,881.66	4,759.98	93,641.64
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-154,988,198.68	-8,173,874.30	-163,162,072.98
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)	196,779,756.42	12,069,137.08	208,848,893.50

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	林培富	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

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定由长盛同鑫保本混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)第一个保本周期届满后变更而来。原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[2011]第519号《关于核准长盛同鑫保本混合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《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原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3,031,349,989.30元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司(事务所的性质已变更为特殊普通合伙)普华永道中天验字(2011)第190号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于2011年5月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,032,111,617.30份基金份额,其中认购资金利息折合761,628.00份基金份额。

根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,原基金的保本期一般每三年为一个周期;如保本周期到期后,原基金未能符合保本基金存续条件,则原基金将按基金合同的约定变更为非保本的混合型基金。在原基金募集期内认购原基金的基金份额持有人,在继续持有转型后的本基金基金份额,而可赎回金额(可赎回金额以原保本周期届满日的原基金基金份额净值为基准进行计算)加上原保本周期间的累计分红金额低于其投资净额,基金管理人或担保人应补足该金额差额。原基金的担保人将保证向符合上述条件的原基金份额持有人承担上述差额部分的偿付并及时清偿,担保额度为人民币51亿元。根据《关于长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后变更为长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金及相关业务安排的公告》,原基金在第一个保本周期届满日次日,即2014年5月27日起变更为本基金,变更后基金的投资及基金费率等按照《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。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《长盛同鑫行业配置混合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)、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。如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。本基金投资组合中股票、权证等权益类资产占基金资产的40%-95%,其中,持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具(包括一年以内的短期国债、回购协议等)、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证券品种占基金资产的0%-40%,其中基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:60%×沪深300指数+40%×中证全债指数。

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、以及其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释和其他相关规定(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》、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监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

本基金2014年5月27日至2014年6月30日止期间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2014年6月30日的财务状况以及2014年5月27日至2014年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为2014年5月27日至2014年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。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。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)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;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 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。由于申购和赎回引起的实收基金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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计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认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)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《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的市盈率法、指数收益法等估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种,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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局颁布的财税[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(“长盛基金公司”)	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

注: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 本报告期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:本基金未开立关联方交易单元。

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 2014年5月27日至2014年6月30日
当期应支付的管理费	344,364.07
其中:支付销售机构的客户维护费	159,008.95

注:支付基金管理人长盛基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年5月27日至2014年6月30日
当期应支付的托管费	57,394.01

注:支付基金托管人中国银行的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:本基金本期未与关联方进行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

份额单位:份

项目	本期 2014年5月27日至2014年6月30日
基金合同生效日(2014年5月27日)持有的基金份额	19,999,000.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分增加的份额	-
期间赎回/卖出总份额	19,999,000.00
期末持有的基金份额	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-

注:基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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期末未投资本基金。

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 2014年5月27日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	90,566,868.49	101,226.89

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:本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2014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:本基金本期末无因认购新发/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股票

注:本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

(1) 公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

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相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

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、除第一层级中的市场报价以外的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)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2014年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为100,501,475.33元,属于第二层级的余额为20,122,000.00元,无属于第三层级的余额。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,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)、或属于非公开发行等情况,本基金不会分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元。

(2)除公允价值外,本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告(转型前)

7.1 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	10,226,242.26	2.19
	其中:股票	10,226,242.26	2.19
2	固定收益投资	101,798,724.00	21.85
	其中:债券	101,798,724.00	21.85
	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	351,065,039.14	75.34
7	其他资产	2,866,935.91	0.62
8	合计	465,956,941.31	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	10,226,242.26	2.76
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	-	-
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	10,226,242.26	2.76

(下转B268版)