长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12月31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:2015年3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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计,安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2014年3月25日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛高端装备混合
基金主代码	000534
交易代码	000534
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月25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	548,751,968.92份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标在于把握中国高端装备制造业发展带来的投资机会,分享高端装备制造相关上市公司的持续投资收益,在严格控制投资风险的基础上,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	在大类资产配置中,本基金将主要考虑:(1)宏观经济指标,包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口数据变化等;(2)微观经济指标,包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期等;(3)市场指标,包括股票市场与债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金的供求关系及其变化等;(4)政策因素,包括财政政策、货币政策、产业政策及其它与证券市场密切相关的各种政策。 本基金的股票投资策略,分为股票池初步构建、细分领域配置和个股精选三个方面。 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。本基金的权证投资是以权证的市场价值分析为基础,配以权证定价模型寻求其合理估值水平,以主动式的科学投资管理为手段,充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。对于股指期货,本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货的投资。
业绩比较基准	50%×上证高端装备60指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。
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

2.4 信息披露方式

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

§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	2014年3月25日(基金合同生效日)－2014年12月31日
本期已实现收益	69,149,590.00
本期利润	136,661,628.03
加权平均基金份额本期利润	0.3167
本期基金份额净值增长率	37.20%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.2045
期末基金资产净值	753,120,563.21
期末基金份额净值	1.372

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12月31日。

4、本基金基金合同生效日为2014年3月25日,截至本报告期末本基金成立未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.78%	1.55%	8.14%	0.92%	−2.36%	0.63%
过去六个月	32.30%	1.32%	26.48%	0.78%	5.82%	0.54%
自基金合同生效起至今	37.20%	1.13%	28.34%	0.71%	8.86%	0.42%

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:50%×上证高端装备60指数收益率+50%×中证综合债指数收益率

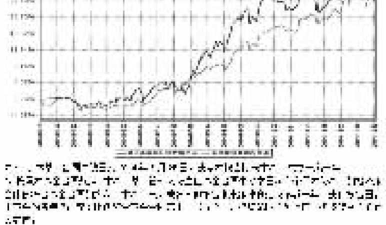
基准指数的构建考虑了三个原则:

1、公允性。本基金为主题混合型基金,在综合比较目前市场上各主要行业指数的编制特点后,本基金选择以上证高端装备60指数作为股票投资的业绩比较基准。上证高端装备60指数是中证指数有限公司编制,反映沪市通信设备、电气部件与设备、重型电气设备、航天航空与国防等行业股票价格变动趋势的指数。本基金主要投资于投资高端装备等相关上市公司股票,因此上证高端装备60指数适合作为本基金的业绩比较基准。

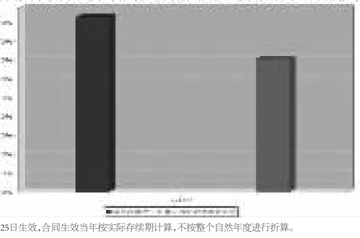
2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响,本基金股票投资占基金资产的比例为0%－95%,其中投资于高端装备制造相关上市公司股票和债券的资产不低于非现金基金资产的80%;根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数,可使业绩比较更具有合理性。

3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照50%、50%的比例采取再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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



[illegible]



注:本基金基金合同于2014年3月25日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金于2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止会计期间未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司(以下简称"公司"),成立于1999年3月26日,是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币18900万元。公司注册地在深圳,总部设在北京,并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司,在香港、北京分别设有子公司。目前,公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司(以下简称"国元证券")占注册资本的41%,新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%,安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%,安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至2014年12月31日,基金管理人共管理三十七只开放式基金,并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外QFII基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张锦灿	本基金基金经理,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。	2014年3月25日	－	9年	男,1982年1月出生,中国国籍。北京大学光华管理学院金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员,银华基金管理有限公司研究员、研究主管、基金经理助理。2012年9月加入长盛基金管理有限公司,曾任同益证券投资基金基金经理。现任长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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 公平交易制度和控制方法

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,确保公平对待不同投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等,切实防范利益输送,保护投资者的合法权益。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发生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

2014年,市场先抑后扬,颇超年初预期。前三季度,市场基本延续上一年风格,投资关注点从成长逐渐转移到成长的故事,主题,次新股,小市值公司,最后到疯狂的并购重组和市值管理。四季度,随着增量资金流入,市场投资风格骤变,迅速转移到低股价、低估值、低涨幅的中大市值公司,市场赚钱效应凸显,与资金形成良性互动,开启了一波波澜壮阔的行情。

本基金在前期,尤其是二季度末、三季度,在建仓期,果断加仓,迅速享受了军工股的上涨行情,取得了较好的收益。四季度,适应了市场风格的变化,下调了军工股仓位,部分参与了大市值、低估值、政策主题股票的机会,获取了较好的投资收益。整体看,今年是本基金的第一年,其间经历了巨额申赎、规模巨幅波动的挑战,我们基本抓住了市场主要的机会,创造性的贯彻了绝对收益的原则,控制住了净值的波动率,为投资人获取了良好的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.372元,本报告期份额净值增长率为37.20%,业绩比较基准收益率为28.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2015年,在各类大宗商品价格处于弱势的背景下,货币政策趋于宽松可能是除了美国以外的全球央行的一致选择。中国更是处于利率下行周期,财政政策已经从2014年二季度开始明确处于较为宽松状态,再结合政府的外交国际战略、区域振兴战略,需要我们对看空了多年的投资品、装备线条进行重新审视,寻找机会。明年,改革进入实质性推进阶段,国企、土地、医疗、财税、政府等改革都有望提升市场对整体经济的信心,并带来制度红利释放,提供一些机会。同时,互联网、信息产业对传统产业的改造继续高歌猛进,传统行业面临新经济革命,带来竞争格局的巨大变化,新的机会。整体看,明年实体经济仍将处于偏弱状态,有些风险尚需释放,但是改革、宽松的政策,以及新经济影响的深化会带来一些亮点。

市场角度,2014年四季度大量增量资金涌入,改变了原有的估值体系和市场风格,未来一段时间有望维持,市场估值体系有个梯队重估的过程。同时,去年过度投机的伪成长股、并购重组和定增也可能会趋于降温,市场将从关注"故事"转移到更加关注业绩增长和估值。增量资金的流入可能是持续性的,但受融资融券、短期涨幅影响,市场的波动性将大大增加。

军工板块在2014年三季度的疯狂以后,主题的关注热度下降,投资特征也将会发生一定调整。可能会从整体性机会逐渐转移到个股性机会,从关注资产注入预期到关注产品、管理层,从关注央企军工企业到央企、地方、民营都有机会,整体投资将更加结构化和精细化。

新的一年,本基金将在初期保持低仓位,精选有安全边际、预期差异的个股进行投资,本着绝对收益的决策原则,更加关注安全边际,谨慎决策。

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》的规定以及本基金基金合同第十六条中对基金利润分配原则的约定,2014年度未实施利润分配。

本基金截至2014年12月31日,期末可供分配利润为112,199,550.83元,其中:未分配利润已实现部分为112,199,550.83元,未分配利润未实现部分为92,169,043.46元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本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 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师汤骏、王珊珊2015年3月24日对本基金2014年12月31日的资产负债表、2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注出具了安永华明(2015)审字第60468688_A08号标准无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日
资 产:	
银行存款	138,231,398.18
结算备付金	3,017,741.68
存出保证金	473,422.02
交易性金融资产	572,548,174.99
其中:股票投资	572,548,174.99
基金投资	－
债券投资	－
资产支持证券投资	－
贵金属投资	－
衍生金融资产	－
买入返售金融资产	－
应收证券清算款	41,629,252.60
应收利息	18,051.11
应收股利	－
应收申购款	6,559,546.26
递延所得税资产	－
其他资产	－
资产总计	762,477,586.84
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日
负 债:	
短期借款	－
交易性金融负债	－
衍生金融负债	－
卖出回购金融资产款	－
应付证券清算款	－
应付赎回款	6,681,698.15
应付管理人报酬	864,283.80
应付托管费	144,047.29
应付销售服务费	－
应付交易费用	1,402,142.16
应交税费	－
应付利息	－
应付利润	－
递延所得税负债	－
其他负债	264,852.23
负债合计	9,357,023.63
所有者权益:	
实收基金	548,751,968.92
未分配利润	204,368,594.29
所有者权益合计	753,120,563.21
负债和所有者权益总计	762,477,586.84

注:1.报告截止日2014年12月31日,基金份额净值为人民币1.372元,基金份额总额548,751,968.92份。

2.本财务报表的实际编制期间系2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止。

7.2 利润表

会计主体:长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	149,794,184.24
1.利息收入	3,733,071.72
其中:存款利息收入	2,249,573.70
债券利息收入	634,849.32
资产支持证券利息收入	－
买入返售金融资产收入	848,648.70
其他利息收入	－
2.投资收益(损失以"－"填列)	72,240,430.24
其中:股票投资收益	70,843,357.81
基金投资收益	－
债券投资收益	549,697.49
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	847,374.94
3.公允价值变动收益(损失以"－"号填列)	67,512,038.03
4.汇兑收益(损失以"－"号填列)	－
5.其他收入(损失以"－"号填列)	6,308,644.25
减:二、费用	13,132,556.21
1. 管理人报酬	5,714,563.51
2. 托管费	952,427.26
3. 销售服务费	－
4. 交易费用	6,115,975.36
5. 利息支出	60,006.51
其中:卖出回购金融资产支出	60,006.51
6. 其他费用	289,583.57
三、利润总额(亏损总额以"－"号填列)	136,661,628.03
减:所得税费用	－
四、净利润(净亏损以"－"号填列)	136,661,628.03

注:本基金合同于2014年3月25日生效,无上年度可比期间。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年3月25日(基金合同生效日)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)	510,326,262.72	－	510,326,262.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	－	136,661,628.03	136,661,628.03
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)	38,425,706.20	67,706,966.26	106,132,672.46
其中:1.基金申购款	1,203,133,858.93	328,462,783.37	1,531,596,642.30
2.基金赎回款	−1,164,708,152.73	−260,755,817.11	−1,425,463,969.84
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)	548,751,968.92	204,368,594.29	753,120,563.21

注:本基金合同于2014年3月25日生效,无上年度可比期间。

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:

______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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系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[2014]106号文《关于核准长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的注册,由长盛基金管理有限公司于2014年2月24日至2014年3月21日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具(2014)验字第60468688_A02号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年3月25日正式生效,存续期间不定。本基金设立时,收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币510,154,078.04元,折合510,154,078.04份基金份额;募集资金在募集期间产生的利息为人民币172,184.68元,折合172,184.68份基金份额;以上收到的实收基金共计人民币510,326,262.72元,折合510,326,262.72份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均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、资产支持证券、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的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例0%－95%,其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具,其中投资于高端装备制造的股票和债券不低于非现金基金资产的80%;权证投资占基金资产净值的比例不高于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%的现金或到期日在一年以内的政府债券,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较标准为:50%×上证高端装备60指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》;修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2014年12月31日的财务状况以及2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资等;

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将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的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

本基金已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的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;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的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,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,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5)回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具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,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值;估值日无市价,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,按最近交易市价确定公允价值;如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,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,确定公允价值;

(2)不存在活跃市场的金融工具,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。本基金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,优先使用相关可观察输入值,只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3)如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能适当反映公允价值的方法估值;

(4)如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时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时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金和转出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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,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

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8)股利收益于除息日确认,并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入账;

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、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;

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率逐日计提;

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率逐日计提;

(3)卖出回购证券支出,按卖出回购金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

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4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%,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按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(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)投资者的现金红利保留到小数点后第2位,此误差产生的收益或损失由基金资产承担;

(6)法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

会计政策变更的说明可参见7.4.2会计报表的编制基础。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

7.4.6.2营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资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。

7.4.6.3个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	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
国元证券股份有限公司("国元证券")	基金管理人股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.1 关联方报酬

7.4.8.1.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,714,563.51
其中:支付销售机构的客户维护费	2,286,010.85

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

7.4.8.1.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	952,427.26

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

7.4.8.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金于2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金于2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.3.2 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:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

7.4.8.4 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3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	138,231,398.18	535,199.74

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。

7.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金于2014年3月25日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300159	新研股份	2014年12月1日	重大资产重组	17.06	2015年3月18日	18.16	2,450,070	23,695,733.01	41,798,194.20	－

注:本基金截至2014年12月31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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1公允价值

银行存款、结算备付金、应收证券清算款、应收申购款、应付赎回款等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1)各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币530,749,980.79元,属于第二层次的余额为人民币41,798,194.20元,属于第三层次的余额为人民币零元。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

7.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2015年3月24日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

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	572,548,174.99	75.09
	其中:股票	572,548,174.99	75.09
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	141,249,139.86	18.53
7	其他各项资产	48,680,271.99	6.38
8	合计	762,477,586.84	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	－	－
B	采矿业	5,265,000.00	0.70
C	制造业	474,608,671.71	63.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	－	－
E	建筑业	29,008,000.00	3.85
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	63,666,503.28	8.45
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	572,548,174.99	76.02

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600169	太原重工	5,902,211	51,467,279.92	6.83
2	000748	长城信息	1,150,008	44,735,311.20	5.94
3	300159	新研股份	2,450,070	41,798,194.20	5.55
4	600066	宇通客车	1,499,999	33,494,977.67	4.45
5	600184	光电股份	899,901	32,252,451.84	4.28
6	000997	新 大 陆	1,120,050	31,518,207.00	4.19
7	000065	北方国际	1,600,000	29,008,000.00	3.85
8	000957	中通客车	1,900,000	25,555,000.00	3.39
9	000528	柳 工	2,000,000	25,160,000.00	3.34
10	002501	利源铝业	900,000	25,128,000.00	3.34

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.csfunds.com.cn网站的年度报告正文。

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	601989	中国重工	77,119,009.02	10.24
2	600184	光电股份	65,484,732.44	8.70
3	600990	四创电子	52,831,666.75	7.02
4	000748	长城信息	47,360,473.00	6.29
5	600271	航天信息	45,691,206.74	6.07
6	600038	哈飞股份	43,804,304.55	5.82
7	000768	中航飞机	42,624,486.76	5.66
8	600562	国睿科技	42,519,777.18	5.65
9	600391	成发科技	39,561,025.10	5.25
10	600169	太原重工	36,597,361.53	4.86
11	300007	汉威电子	35,515,114.37	4.72
12	600584	长电科技	35,234,854.26	4.68
13	300101	国腾电子	34,465,224.31	4.58
14	000065	北方国际	33,010,379.69	4.38
15	300034	钢研高纳	32,570,889.57	4.32
16	601766	中国南车	31,604,910.98	4.20
17	601038	一拖股份	29,888,271.91	3.97
18	601299	中国北车	29,793,038.10	3.96
19	600482	风帆股份	29,345,779.73	3.90
20	000957	中通客车	28,923,403.05	3.84
21	600066	宇通客车	28,751,667.54	3.82
22	000997	新 大 陆	28,315,125.89	3.76
23	000923	河北宣工	27,682,925.89	3.68
24	600685	广船国际	26,578,323.53	3.53
25	000528	柳 工	26,055,103.09	3.46
26	002037	久联发展	26,053,266.10	3.46
27	002179	中航光电	25,894,214.02	3.44
28	300022	吉峰农机	25,389,254.26	3.37
29	600775	南京熊猫	25,154,549.50	3.34
30	002501	利源铝业	24,600,031.48	3.27
31	002338	奥普光电	24,483,115.47	3.25
32	600150	中国船舶	23,999,139.70	3.19
33	600149	廊坊发展	23,859,680.23	3.17
34	300159	新研股份	23,695,733.01	3.15
35	600841	上柴股份	23,389,674.07	3.11
36	000861	海印股份	21,865,536.10	2.90
37	600000	浦发银行	21,749,016.68	2.89
38	002544	杰赛科技	21,547,147.35	2.86
39	300369	绿盟科技	21,236,769.14	2.82
40	600690	青岛海尔	20,834,619.33	2.77
41	300351	永贵电器	20,811,894.34	2.76
42	002439	启明星辰	20,612,636.83	2.74
43	002138	顺络电子	19,239,499.54	2.55
44	600125	铁龙物流	19,227,175.29	2.55
45	300114	中航电测	18,817,646.28	2.50
46	600893	航空动力	18,704,720.85	2.48
47	300265	通光线缆	18,411,189.35	2.44
48	600459	贵研铂业	18,148,388.23	2.41
49	300367	东方网力	17,915,296.55	2.38
50	600104	上汽集团	17,327,170.68	2.30
51	600133	东湖高新	17,169,858.02	2.28
52	600815	厦工股份	16,545,236.61	2.20
53	600152	维科精华	16,444,912.58	2.18
54	002665	首航节能	16,254,274.48	2.16
55	000625	长安汽车	16,136,951.22	2.14
56	300379	东 方 通	16,129,920.88	2.14
57	000687	恒天天鹅	15,760,544.95	2.09
58	002049	同方国芯	15,265,055.64	2.03
59	600884	杉杉股份	15,233,271.01	2.02
60	600699	均胜电子	15,188,260.62	2.02

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	601989	中国重工	58,802,956.00	7.81
2	600271	航天信息	50,310,260.25	6.68
3	300101	国腾电子	39,132,228.19	5.20
4	300034	钢研高纳	36,885,647.08	4.90
5	600584	长电科技	36,449,803.59	4.84
6	000768	中航飞机	36,018,955.84	4.78
7	600990	四创电子	34,906,671.62	4.63
8	600184	光电股份	34,831,782.07	4.62
9	601038	一拖股份	33,156,629.02	4.40
10	002179	中航光电	30,523,615.07	4.05
11	601766	中国南车	30,143,683.73	4.00
12	600482	风帆股份	28,504,537.56	3.78
13	300007	汉威电子	28,343,982.50	3.76
14	601299	中国北车	28,272,509.96	3.75
15	300022	吉峰农机	27,729,639.59	3.68
16	300351	永贵电器	26,735,971.14	3.55
17	000923	河北宣工	26,070,027.62	3.46
18	300369	绿盟科技	24,491,346.90	3.25
19	600149	廊坊发展	24,436,674.54	3.24
20	600150	中国船舶	23,889,344.42	3.17
21	600562	国睿科技	23,636,153.65	3.14
22	600775	南京熊猫	23,417,174.99	3.11
23	000861	海印股份	23,329,177.81	3.10
24	002138	顺络电子	22,863,219.41	3.04
25	002338	奥普光电	22,356,195.32	2.97
26	600841	上柴股份	22,207,752.95	2.95
27	002439	启明星辰	21,649,070.04	2.87
28	600000	浦发银行	21,437,450.60	2.85
29	300367	东方网力	20,911,151.94	2.78
30	600690	青岛海尔	20,411,717.54	2.71
31	600391	成发科技	20,018,436.75	2.66
32	300114	中航电测	19,765,350.02	2.62
33	600152	维科精华	19,308,356.59	2.56
34	300265	通光线缆	19,203,854.46	2.55
35	000748	长城信息	18,796,189.22	2.50
36	600459	贵研铂业	18,510,176.53	2.46
37	002665	首航节能	18,477,369.85	2.45
38	600893	航空动力	18,442,907.97	2.45
39	000625	长安汽车	18,117,243.76	2.41
40	600125	铁龙物流	18,028,521.07	2.39
41	600104	上汽集团	17,872,991.40	2.37
42	600169	太原重工	17,483,798.30	2.32
43	600133	东湖高新	17,287,051.54	2.30
44	600685	广船国际	17,101,039.04	2.27
45	600815	厦工股份	17,087,244.73	2.27
46	600038	哈飞股份	17,068,843.29	2.27
47	000687	恒天天鹅	16,830,209.50	2.23
48	300379	东 方 通	16,509,600.39	2.19

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	2,290,748,158.47
卖出股票收入(成交)总额	1,856,555,379.32

注:本项中8.4.1、8.4.2、8.4.3表中的"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")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

注: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

注: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序的前十名资产支持证券投资明细

注: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

注: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

注: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

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2

基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内股票。

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	473,422.02
2	应收证券清算款	41,629,252.60
3	应收股利	－
4	应收利息	18,051.11
5	应收申购款	6,559,546.26
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	48,680,271.99

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

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	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300159	新研股份	41,798,194.20	5.55	重大资产重组

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,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

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
9,183	59,757.37	89,774,958.20	16.36%	458,977,010.72	83.64%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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	80,633.31	0.0147%

9.3 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的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年3月25日)基金份额总额	510,326,262.72
本报告期期初基金份额总额	－
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,203,133,858.93
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,164,708,152.73
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"－"填列)	－
本报告期期末基金份额总额	548,751,968.92

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本基金管理人于2014年4月16日发布公告,经公司第五届董事会第五十七次会议以及第六届董事会第一次会议审议通过,并报中国证监会批准,由高新先生担任公司董事长,凤良志先生因年龄原因不再担任公司董事长职务。根据公司章程相关规定,"董事长为公司的法定代表人"。公司已于2014年4月14日完成相关工商登记变更手续。

11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告,自2014年2月13日起,陈四清先生担任本行行长。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。本报告期内本基金未更换会计师事务所,本报告期内应支付该会计师事务所的报酬为60,000.00元。已连续为本基金服务1年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	235,248,266.02	5.67%	214,170.65	5.67%	－
东海证券	2	934,114,830.42	22.52%	850,419.67	22.52%	－
华安证券	1	1,788,509,591.28	43.13%	1,628,254.38	43.12%	－
华福证券	1	145,193,329.45	3.50%	132,184.88	3.50%	－
申银万国	2	165,405,434.48	3.99%	150,585.28	3.99%	－
招商证券	1	107,341,171.41	2.59%	97,723.61	2.59%	－
中信建投	2	35,766,920.21	0.86%	32,562.25	0.86%	－
中信证券	2	735,686,459.64	17.74%	669,770.05	17.74%	－
中金公司	1	－	－	－	－	－
长城证券	1	－	－	－	－	－
国联证券	1	－	－	－	－	－
华泰证券	1	－	－	－	－	－
东兴证券	1	－	－	－	－	－
华融证券	1	－	－	－	－	－
国元证券	1	－	－	－	－	－
东北证券	1	－	－	－	－	－
国泰君安	1	－	－	－	－	－
五矿证券	1	－	－	－	－	－
西南证券	1	－	－	－	－	－
国信证券	1	－	－	－	－	－
上海证券	1	－	－	－	－	－
广发证券	1	－	－	－	－	－
安信证券	1	－	－	－	－	－
高华证券	1	－	－	－	－	－

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	－	－	105,200,000.00	5.60%	－	－
东海证券	－	－	－	－	－	－
华安证券	23,047,819.10	50.60%	965,000,000.00	51.32%	－	－
华福证券	22,499,382.00	49.40%	810,000,000.00	43.08%	－	－
申银万国	－	－	－	－	－	－
招商证券	－	－	－	－	－	－
中信建投	－	－	－	－	－	－
中信证券	－	－	－	－	－	－
中金公司	－	－	－	－	－	－
长城证券	－	－	－	－	－	－
国联证券	－	－	－	－	－	－
华泰证券	－	－	－	－	－	－
东兴证券	－	－	－	－	－	－
华融证券	－	－	－	－	－	－
国元证券	－	－	－	－	－	－
东北证券	－	－	－	－	－	－
国泰君安	－	－	－	－	－	－
五矿证券	－	－	－	－	－	－
西南证券	－	－	－	－	－	－
国信证券	－	－	－	－	－	－
上海证券	－	－	－	－	－	－
广发证券	－	－	－	－	－	－
安信证券	－	－	－	－	－	－
高华证券	－	－	－	－	－	－

注:1、本公司选择证券经营机构的标准

(1)研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时为本公司提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告。

(2)资力雄厚,信誉良好。

(3)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4)经营行为规范,最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

(6)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要,并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1)研究机构提出服务意向,并提供相关研究报告;

(2)研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定;

(3)研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后,按照研究服务评价规定,对研究机构进行综合评价;

(4)试用期满后,评价结果符合条件,双方认为有必要继续合作,经公司领导审批后,我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》,并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用;

(5)本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价,若本公司认为签约机构的服务不能满足要求,或签约机构违规受到国家有关部门的处罚,本公司有权终止签署的协议,并撤销租用的交易单元;

(6)交易单元租用协议期限为一年,到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

(1)本基金报告期内新增租用交易单元情况:无。

(2)本基金报告期内停止租用交易单元情况:无。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

长盛基金管理有限公司
2015年3月28日