

长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金
2014 年半年度报告摘要

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。

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。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛上证市值百强 ETF 联接
基金主代码	000063
交易代码	000063
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 5 月 10 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	32,800,987.74 份
基金合同存续期	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510700
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 4 月 24 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 5 月 31 日
基金管理人名称	长盛基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标 ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金为目标 ETF 的联接基金，以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。</p> <p>为实现投资目标，本基金将以不低于基金资产净值 90% 的资产投资于目标 ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其目的是为了本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
业绩比较基准	上证市值百强指数收益率 \times 95% + 银行活期存款利率（税后） \times 5%

风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--------	--

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	本基金跟踪投资标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争实现与标的指数表现相一致的长期收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。
业绩比较基准	上证市值百强指数
风险收益特征	本基金为被动式投资的股票指数型基金，预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合风险收益特征相近，属于高风险、高收益的基金品种。

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
	联系电话	010-82019988
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn
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	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-3,016,324.17
本期利润	-2,230,946.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0560
本期基金份额净值增长率	-6.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1469
期末基金资产净值	28,675,556.60
期末基金份额净值	0.874

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。

表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.92%	0.73%	0.33%	0.73%	0.59%	0.00%
过去三个月	1.63%	0.85%	1.02%	0.87%	0.61%	-0.02%
过去六个月	-6.22%	0.96%	-6.00%	0.98%	-0.22%	-0.02%
过去一年	-3.43%	1.13%	-2.35%	1.15%	-1.08%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-12.60%	1.13%	-14.68%	1.21%	2.08%	-0.08%

注：本基金业绩比较基准=上证市值百强指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

基准指数：上证市值百强指数

本基金的业绩比较基准上证市值百强指数由上海证券交易所和中证指数有限公司构建和发布。具体的编制规则请参见上证市值百强指数编制细则。（网址为：

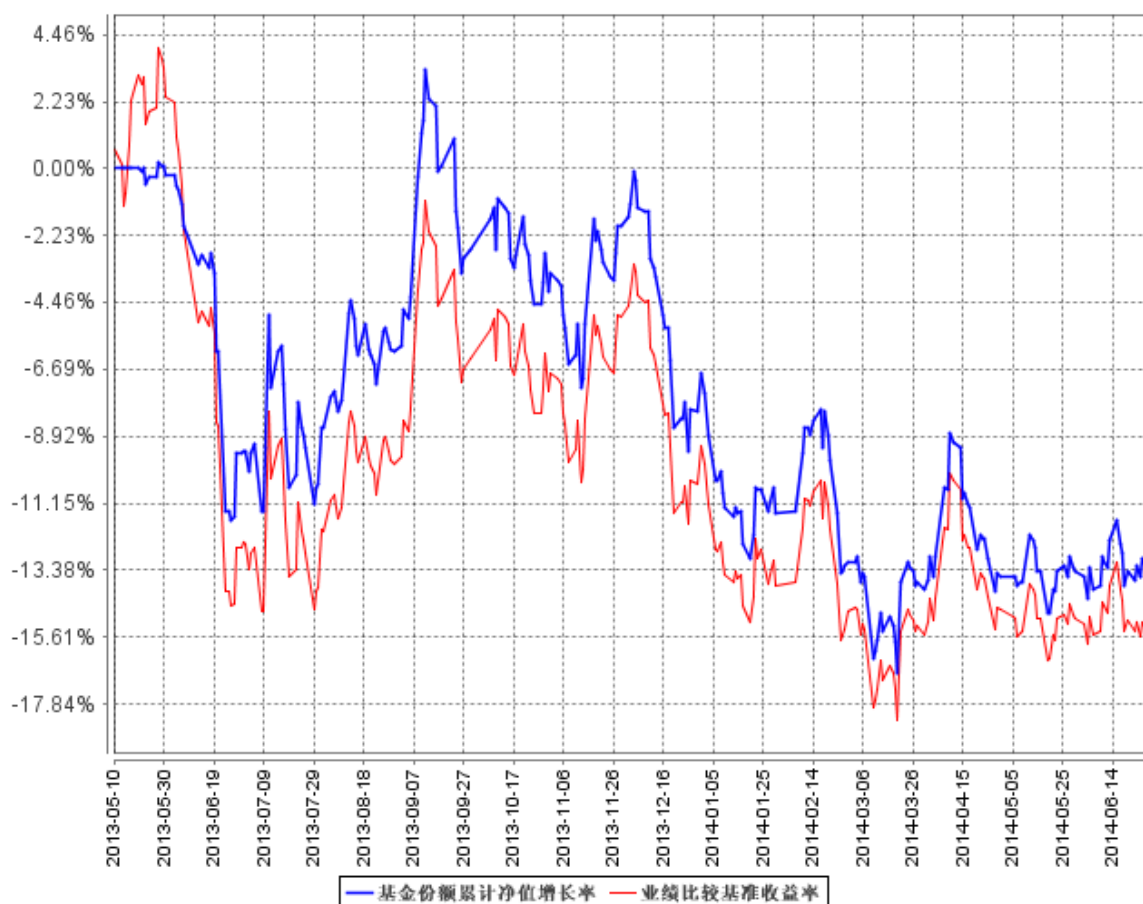
<http://www.csindex.com.cn/sseportal/csiportal/zs/jbxx/report.do?code=000155&&subdir=>

1)

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，业绩比较基准中上证市值百强指数、银行活期存款利率（税后）每日按照 95%、5%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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金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约定，建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四条（二）投资范围、（八）投资禁止行为与限制的有关约定。截止报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 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

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵宏宇	本基金基金经理，上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金经理。	2013 年 5 月 10 日	-	7 年	男，1972 年 6 月出生，中国国籍。四川大学工商管理学院管理学（金融投资研究方向）博士。历任美国晨星公司投资顾问部门数量分析师，招商银行博士后工作站博士后研究员。2007 年 8 月加入长盛基金管理公司，历任金融工程研究员、产品开发经理，首席产品开发师，金融工程与量化投资部副总监等职务。现任上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金经理，长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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合规守信情况的说明

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。

本报告期内，本基金执行严格复制上证市值百强指数策略，在调整成分股权重时买入中国银行（指数成份股）股票 24500 股。报告期内，基金管理人召开基金份额持有人大会，通过了本基金转型为混合型基金的事项，新基金合同中未限制买入托管行股票。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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

本基金为 ETF 联接基金，投资跟踪市值百强 ETF，基本反映上证市值百强指数的市场收益和风险特征。

2014 年上半年整体经济增长的不确定性影响了大盘股票的走势，市值较大的股票表现疲弱，而股票结构性机会比较显著。大盘股票的弱势走势对本基金净值增长带来一定负面影响。本基金在基金合同允许的投资范围内，最大程度投资并跟踪分享蓝筹股票市值增长的红利。在报告期内操作中，基金管理人严格遵守基金合同，在成分股权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末（2014 年 6 月 30 日），联接基金份额净值为 0.874 元，本报告期份额净值增长率为 -6.22%，同期业绩比较基准增长率为 -6.00%。本报告期内日均跟踪偏离度绝对值均值为 0.70%，年化跟踪误差为 2.16%。报告期内，本联接基金有较大申购和赎回，基金管理人市场操作比较频繁，份额净值与跟踪误差受到一定影响。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为股票市场受益于经济短期回暖与政策利好预期，以及政策对各项经济改革的具体实施驱动，预期 2014 年下下年的主题政策驱动的市场结构性行情有望获得延续。特别是随着各项经济改革及政策的逐步推进，上证市值百强所代表的大盘蓝筹价值股票预期会有一定上涨空间。

作为被动型跟踪指数的 ETF 联接基金，我们将继续秉承指数化投资策略，积极应对成分股权重变动、基金申购赎回等因素对指数跟踪带来的影响，控制基金的跟踪误差。以实现投资者获取指数投资收益的投资目标，充分发挥投资市场的指数代表功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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十九条中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2014 年 6 月 30 日，期末可供分配收益为-4,817,984.42 元，未分配收益已实现部分为-4,817,984.42 元，未分配收益未实现部分为 692,553.28 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”）在对长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金（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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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	上年度末 2013年12月31日
资产：		
银行存款	1,317,494.72	2,026,145.69
结算备付金	266,590.37	-
存出保证金	4,738.29	19,630.72
交易性金融资产	27,286,567.00	37,919,394.00
其中：股票投资	324,567.00	783,394.00
基金投资	26,962,000.00	37,136,000.00
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	-	-
应收利息	350.53	1,400.81
应收股利	-	-
应收申购款	39,891.66	99.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	28,915,632.57	39,966,670.62
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	8,677.78	45,364.19
应付管理人报酬	894.87	1,604.61
应付托管费	178.94	320.92
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	71,621.75	36,310.62
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	158,702.63	200,170.97
负债合计	240,075.97	283,771.31
所有者权益：		
实收基金	32,800,987.74	42,590,023.08
未分配利润	-4,125,431.14	-2,907,123.77
所有者权益合计	28,675,556.60	39,682,899.31
负债和所有者权益总计	28,915,632.57	39,966,670.62

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.874元，基金份额总额32,800,987.74份。

6.2 利润表

会计主体：长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至 2014年6月30日	2013年5月10日(基金合同生效 日)至2013年6月30日
一、收入	-1,710,087.03	-24,243,060.25
1.利息收入	28,700.07	481,266.80
其中：存款利息收入	23,238.22	138,606.66
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	5,461.85	342,660.14
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-2,668,290.24	722,892.68
其中：股票投资收益	-500,084.45	-1,187,991.60
基金投资收益	-2,169,970.57	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,764.78	1,910,884.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	785,377.26	-25,549,136.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	144,125.88	101,917.08
减：二、费用	520,859.88	569,457.62
1. 管理人报酬	19,731.56	190,494.23
2. 托管费	3,946.32	38,098.85
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	323,616.92	294,069.50
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	173,565.08	46,795.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-2,230,946.91	-24,812,517.87
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-2,230,946.91	-24,812,517.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	42,590,023.08	-2,907,123.77	39,682,899.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,230,946.91	-2,230,946.91
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）	-9,789,035.34	1,012,639.54	-8,776,395.80
其中：1. 基金申购款	123,903,490.69	-16,165,998.01	107,737,492.68
2. 基金赎回款	-133,692,526.03	17,178,637.55	-116,513,888.48
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)	32,800,987.74	-4,125,431.14	28,675,556.60
项目	上年度可比期间 2013年5月10日(基金合同生效日)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)	308,496,450.30	-	308,496,450.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-24,812,517.87	-24,812,517.87
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)	-85,161,082.56	3,632,605.99	-81,528,476.57
其中: 1. 基金申购款	5,576.42	-635.71	4,940.71
2. 基金赎回款	-85,166,658.98	3,633,241.70	-81,533,417.28
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)	223,335,367.74	-21,179,911.88	202,155,455.86

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

基金管理人负责人

林培富

主管会计工作负责人

龚珉

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第125号《关于核准上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》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《长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集308,394,736.32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(2013)第214号验资报告予以验证。经向中国证

监会备案,《长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2013 年 5 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 308,496,450.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 101,713.98 元份基金份额。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。

本基金是上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是主要采用完全复制法实现对上证市值百强指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为目标 ETF、标的指数即上证市值百强指数成份股和备选成份股。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%;基金保留的现金或者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%。本基金也可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、一级市场股票(包括首次公开发行或增发)、债券资产、回购、银行存款、权证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。本基金业绩比较基准为上证市值百强指数收益率 \times 95%+银行活期存款税后利率 \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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 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 1 月 1 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

本基金在本报告期间无需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

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 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 5 月 10 日(基金合同生效日) 至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	19,731.56	190,494.23
其中：支付销售机构的客户维护费	34,978.82	23,557.63

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.50% 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 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) × 0.50% / 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 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 5 月 10 日(基金合同生效日) 至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,946.32	38,098.85

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.10% 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 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) × 0.10% / 当年

天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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无投资本基金的情况。

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6月30日		上年度可比期间 2013年5月10日(基金合同生效日)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	1,317,494.72	21,130.64	12,150,030.30	135,094.82

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 17,000,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 35.26%（2013 年 12 月 31 日，本基金持有 22,000,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 38.45%）。

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：本基金本报告期无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600637	百视	2014年	重大	32.03	-	-	1,600	51,248.00	51,248.00	-

	通	5月29日	事项							
600832	东方明珠	2014年5月29日	重大事项	10.98	-	-	3,600	39,528.00	39,528.00	-
601669	中国电建	2014年5月13日	重大事项	2.79	-	-	8,400	23,436.00	23,436.00	-

注：本基金截至 2014 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 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。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(a) 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)。

(b) 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 27,172,355.00 元，属于第二层级的余额为 114,212.00 元，无属于第三层级的余额（2013 年 12

月31日：第一层级的余额为37,420,212.00元，属于第二层级的余额为499,182.00元，无属于第三层级的余额）。

(c) 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还是第三层级。

(d) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

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

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	324,567.00	1.12
	其中：股票	324,567.00	1.12
2	基金投资	26,962,000.00	93.24
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,584,085.09	5.48
8	其他各项资产	44,980.48	0.16
9	合计	28,915,632.57	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	99,580.00	0.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	23,436.00	0.08
F	批发和零售业	110,775.00	0.39
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	51,248.00	0.18
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	39,528.00	0.14
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	324,567.00	1.13

7.3 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	600058	五矿发展	10,500	110,775.00	0.39
2	600276	恒瑞医药	1,600	53,056.00	0.19
3	600637	百视通	1,600	51,248.00	0.18
4	600535	天士力	1,200	46,524.00	0.16
5	600832	东方明珠	3,600	39,528.00	0.14
6	601669	中国电建	8,400	23,436.00	0.08

注：本基金本报告期末仅持有上述六只股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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（%）
1	601318	中国平安	6,773,253.70	17.07
2	600016	民生银行	5,627,158.60	14.18
3	600036	招商银行	5,486,801.97	13.83

4	601166	兴业银行	3,628,992.00	9.14
5	600000	浦发银行	3,046,031.00	7.68
6	600837	海通证券	2,617,160.21	6.60
7	600030	中信证券	2,557,141.48	6.44
8	601328	交通银行	2,073,720.00	5.23
9	600887	伊利股份	2,041,248.48	5.14
10	601398	工商银行	1,948,765.00	4.91
11	600519	贵州茅台	1,915,055.36	4.83
12	601601	中国太保	1,894,957.92	4.78
13	600104	上汽集团	1,595,610.31	4.02
14	601088	中国神华	1,571,425.00	3.96
15	601668	中国建筑	1,548,624.00	3.90
16	601006	大秦铁路	1,421,789.00	3.58
17	601818	光大银行	1,389,645.00	3.50
18	601169	北京银行	1,373,080.00	3.46
19	601939	建设银行	1,329,377.00	3.35
20	600015	华夏银行	1,295,555.65	3.26
21	600089	特变电工	1,132,984.00	2.86
22	600048	保利地产	1,117,112.00	2.82
23	600585	海螺水泥	1,109,550.51	2.80
24	600900	长江电力	1,065,463.53	2.68
25	600383	金地集团	1,065,087.00	2.68
26	600690	青岛海尔	1,040,623.98	2.62
27	600111	包钢稀土	1,024,860.76	2.58
28	600028	中国石化	1,024,730.00	2.58
29	601989	中国重工	992,930.12	2.50
30	601288	农业银行	986,435.00	2.49
31	600518	康美药业	948,619.93	2.39
32	600050	中国联通	927,827.00	2.34
33	601857	中国石油	926,843.01	2.34
34	600276	恒瑞医药	920,811.16	2.32
35	600999	招商证券	918,677.20	2.32
36	600637	百视通	899,568.10	2.27
37	600406	国电南瑞	833,600.54	2.10
38	600535	天士力	824,609.06	2.08
39	601688	华泰证券	816,776.00	2.06

40	600256	广汇能源	803,429.00	2.02
----	--------	------	------------	------

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	601318	中国平安	7,412,636.04	18.68
2	600016	民生银行	6,172,594.75	15.55
3	600036	招商银行	6,070,558.47	15.30
4	601166	兴业银行	3,962,317.27	9.98
5	600000	浦发银行	3,364,097.26	8.48
6	600837	海通证券	2,838,609.12	7.15
7	600030	中信证券	2,774,983.32	6.99
8	601328	交通银行	2,251,128.00	5.67
9	601288	农业银行	2,215,981.00	5.58
10	600887	伊利股份	2,154,338.40	5.43
11	601398	工商银行	2,120,818.68	5.34
12	601601	中国太保	2,072,413.95	5.22
13	600519	贵州茅台	2,034,697.49	5.13
14	600104	上汽集团	1,742,063.87	4.39
15	601088	中国神华	1,724,914.29	4.35
16	601668	中国建筑	1,670,155.22	4.21
17	601006	大秦铁路	1,550,224.16	3.91
18	601818	光大银行	1,518,594.94	3.83
19	601169	北京银行	1,509,459.21	3.80
20	601939	建设银行	1,453,487.00	3.66
21	600015	华夏银行	1,411,805.22	3.56
22	600048	保利地产	1,227,857.60	3.09
23	600585	海螺水泥	1,213,235.67	3.06
24	600383	金地集团	1,174,892.16	2.96
25	600900	长江电力	1,156,887.74	2.92
26	600111	包钢稀土	1,118,058.84	2.82
27	600028	中国石化	1,102,667.78	2.78
28	600690	青岛海尔	1,092,704.72	2.75
29	601989	中国重工	1,063,398.82	2.68
30	601901	方正证券	1,039,106.67	2.62
31	600276	恒瑞医药	1,033,218.87	2.60
32	601857	中国石油	1,014,620.20	2.56
33	600518	康美药业	1,014,368.49	2.56

34	600050	中国联通	986,263.00	2.49
35	600999	招商证券	975,858.45	2.46
36	600089	特变电工	931,428.14	2.35
37	600196	复星医药	915,344.29	2.31
38	600637	百视通	903,332.25	2.28
39	600406	国电南瑞	896,815.31	2.26
40	601688	华泰证券	877,392.37	2.21
41	600256	广汇能源	877,098.11	2.21
42	600535	天士力	837,599.62	2.11
43	600018	上港集团	817,869.36	2.06
44	600739	辽宁成大	805,166.60	2.03
45	600011	华能国际	799,855.94	2.02
46	601766	中国南车	797,569.85	2.01

7.4.3 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	96,853,241.80
卖出股票收入（成交）总额	106,270,572.24

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	上证百强 ETF	股票型	交易型开放式	长盛基金管理有限公司	26,962,000.00	94.02

注：本基金本报告期末仅持有上述一只基金。

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 本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的股票。

7.13.3 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	4,738.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	350.53
5	应收申购款	39,891.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,980.48

7.13.4 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。

7.13.5 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	600637	百视通	51,248.00	0.18	重大事项
2	600832	东方明珠	39,528.00	0.14	重大事项
3	601669	中国电建	23,436.00	0.08	重大事项

7.13.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
325	100,926.12	-	-	32,800,987.74	100.00%

8.2 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	-	-

8.3 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
-----------------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013 年 5 月 10 日）基金份额总额	308,496,450.30
本报告期期初基金份额总额	42,590,023.08
本报告期基金总申购份额	123,903,490.69
减：本报告期基金总赎回份额	133,692,526.03
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	32,800,987.74

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

2014 年 5 月 7 日至 2014 年 6 月 6 日，长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会表决通过了《关于修改长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》，同意长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金变更基金名称、基金类别、投资目标、范围、理念和策略，允许基金管理人按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对基金合同进行修订。基金管理人已就上述基金份额持有人大会决议事项报中国证监会备案，并于 2014 年 7 月 3 日收到中国证监会基金监管部《关于长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]663 号）。自完成备案手续之日（即 2014 年 7 月 3 日）起，该持有人大会决议生效，即《长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》失效且《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金类别变更为混合型，其投资目标、理念、范围和策略调整，同时更名为“长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金”。

10.2 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

10.2.1 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，并报中国证监会审核批准，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。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
东北证券	1	203,123,814.04	100.00%	184,923.90	100.00%	-

10.7.2 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	基金交易
------	------	--------	------	------

	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东北证券	-	-	24,600,000.00	100.00%	-	-	-	-

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、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。

长盛基金管理有限公司

2014 年 8 月 28 日