

长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF) 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

长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF) 2014 年半年度报告摘要

§ 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	长盛同智优势混合（LOF）
场内简称	长盛同智
基金主代码	160805
交易代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 1 月 5 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	1,921,750,737.74 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007 年 2 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司，所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	本基金为混合型基金，根据对宏观经济、行业状况、公司成长性及资本市场的判断，综合评价各类资产的风险收益水平，对各类资产采取适度灵活的资产配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益—较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。

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	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	2,107,853.84
本期利润	-69,955,023.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0353
本期基金份额净值增长率	-4.50%
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	-0.2296
期末基金资产净值	1,480,534,305.97
期末基金份额净值	0.7704

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。

4、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为2007年1月5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	2.09%	0.70%	0.39%	0.51%	1.70%	0.19%
过去三个月	-1.50%	0.79%	0.97%	0.57%	-2.47%	0.22%
过去六个月	-4.50%	0.99%	-3.94%	0.68%	-0.56%	0.31%
过去一年	-0.43%	1.05%	0.31%	0.76%	-0.74%	0.29%
过去三年	-16.32%	1.06%	-15.87%	0.84%	-0.45%	0.22%
自基金转型起至今	40.20%	1.47%	21.10%	1.25%	19.10%	0.22%

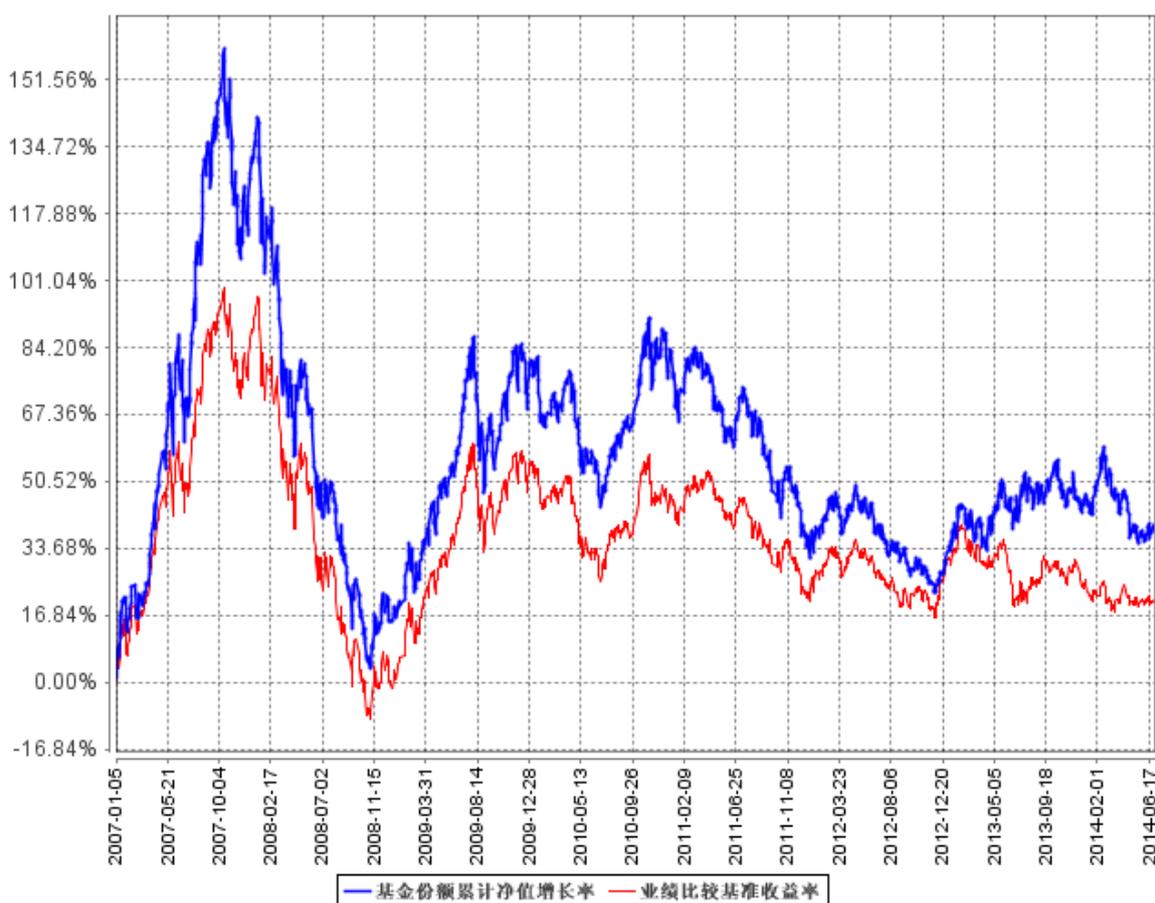
注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

基准指数的构建考虑了三个原则：

- 1、公允性。选择市场认同度比较高的沪深 300 指数和上证国债指数作为计算的基础指数。
- 2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金持有的股票投资占基金资产的比例范围为 30%—95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。
- 3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 65%、30%、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

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：1、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 日。

2、按基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 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十五条（二）投资范围、（六）投资禁止行为与限制的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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		
王宁	本基金基金经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理，社保组合组合经理，公司总经理助理。	2012年7月20日	-	16年	男，1971年10月出生，中国国籍。毕业于北京大学光华管理学院，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理，权益投资部总监等职务。现任公司总经理助理，社保组合组合经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF，本基金）基金经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理。

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。

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

2014 年一季度，大型成长股票表现明显低于市场预期，几百亿市值的大型成长股票基本处于调整状态，缺乏业绩支持，依靠题材概念的小形股票曾经表现活跃，但是终究难以抵抗没有业绩难以支持炒作的命运。以 BAT 企业为代表的实业资本收购兼并动作活跃，明显感觉高估值企业和小型企业的业绩成长性只能依靠收购兼并才能可能完成市场预期。

2014 年二季度，市场仍处在宽幅震荡的格局，在经济仍处于弱势运行的格局下，市场主要是跟随政策的各种主题进行炒作，而创业板股票在一季度大幅调整的背景下大幅反弹，同智基金在二季度一直采取了防御的策略，组合保持了大中小盘的均衡配置，在操作上仍不断减持小盘股，增加了大盘蓝筹股的配置。

本基金在这半年内一直寻求成长与价值的类对冲组合的架构。在当前经济新常态下，本组合将淡化行业、淡化周期，保持组合的均衡配置，积极关注受益于改革红利和转型的股票。

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 0.7704 元，本报告期份额净值增长率为-4.50%，同期业绩比较基准增长率为-3.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为在目前转型降杠杆和改革的大背景下，资本市场仍具备一定的投资机会。一方面目前市场估值水平处于底部区间，另一方面从政府角度看，降杠杆的另外一种途径就是增加权益，而这就需要资本市场的繁荣。在目前房地产市场低迷的情况下，资本市场的繁荣有助于经济的降杠杆和国企改革中混合所有制的发展。资本市场的繁荣对整个存量的盘活有重大的意义。

我们认为未来资本市场的机会要从下面两个角度去观察，一方面要寻找什么行业是未来中国的利益承载主体行业。98 年启动房改以来，房地产经过近 20 年的市场化运作，已经成为目前中国传统行业的代表；那么未来 10-30 年，中国新的利益承载主体是什么主导性成长行业，这种主导性成长行业应该具备两个特点：一是成长空间巨大，二是长期有行业政策支持，处在这类行业的股票目前估值水平都不低，这也体现了投资对这类股票的成长预期，从 2012 年 12 月以来，市场一直在演绎这种经济转型预期。在这个方面我们相对看好军工、铁路、新能源汽车等领域。另外这类股票里还有很大一部分是与 BAT 相关的，那些依靠 BAT 收购的小公司，长期发展模式类似以往依附于石油石化等央企的成长模式，当 BAT 成长性降低的时候，小公司未来的发展情况又会

如何？我们认为互联网公司如果无法实现 O2O 落地，估值水平难以停留在高位！

另外一个角度就是与传统经济相关的价值股，这类股票也是我们设计价值和成长类对冲组合的另外一头。2008 年以来的“四万亿”救市政策和后来的几次救市政策，政策救市资金基本流向房地产行业 and 地方政府平台，房价也随之走高，那么在目前政府的微刺激政策下，如果房价不再上涨，是否意味着巨大的流动性资金利息滚动陷阱？如果未来政府变相打开限购，以及部分相关的地产的微刺激政策下，成交量如果开始放大，那么也就意味着流动性陷阱的消失，也将意味着释放巨大的流动性。由于政府对地产行业的合理融资进行限制，造成 08 年金融危机以来，地产一直在使用高成本的资金经营，在房地产股的估值如此低的情况下，低估值的地产股与使用低成本募集资金的小市值股票，哪个更有吸引力，更有投资价值？另外在未来 QFII、RQFII 规模不断增加，下半年沪港通将实质性推进和国家积极推进的养老金和保险资金入市，这类低风险偏好的资金对于低估值高股息率的价值股也将更加青睐。

因此，我们认为当前市场仍具备较强的吸引力，我们将从以上两个方面设计类对冲组合，为投资者获得稳定持续的回报

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二十条中对基金利润分配原则的约定，本基金于报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2014 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-441,216,431.77 元，其中，未分配利润已实现部分为 233,238,261.00 元，未分配利润未实现部分为-674,454,692.77 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”）在对长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告中的数据真实、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：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

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	182,816,057.49	559,476,103.00
结算备付金	2,607,209.43	5,757,133.90
存出保证金	1,591,200.99	655,396.69
交易性金融资产	1,058,250,758.59	924,669,984.22
其中：股票投资	1,058,250,758.59	904,527,984.22
基金投资	-	-
债券投资	-	20,142,000.00
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	243,400,662.60	175,940,583.92
应收证券清算款	-	-
应收利息	108,631.30	900,001.30
应收股利	-	-
应收申购款	2,268.93	4,143.48
递延所得税资产	-	-
其他资产	30,247.08	-
资产总计	1,488,807,036.41	1,667,403,346.51
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	2,077,102.44	1,889,577.79
应付管理人报酬	1,804,143.34	2,113,612.18
应付托管费	300,690.58	352,268.68
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,521,991.09	2,162,193.46
应交税费	305,932.19	305,932.19
应付利息	-	-
应付利润	428,798.09	428,798.09
递延所得税负债	-	-
其他负债	834,072.71	1,015,781.38
负债合计	8,272,730.44	8,268,163.77
所有者权益：		
实收基金	1,921,750,737.74	2,056,678,664.53

未分配利润	-441,216,431.77	-397,543,481.79
所有者权益合计	1,480,534,305.97	1,659,135,182.74
负债和所有者权益总计	1,488,807,036.41	1,667,403,346.51

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.7704 元，基金份额总额

1,921,750,737.74 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

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	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入	-40,245,077.61	138,959,715.18
1. 利息收入	2,717,480.86	4,040,425.65
其中：存款利息收入	1,621,678.18	1,571,411.38
债券利息收入	243,399.45	329,959.43
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	852,403.23	2,139,054.84
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	29,093,893.39	248,875,045.37
其中：股票投资收益	21,938,522.50	240,379,343.27
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-10,780.82	23,090.10
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	7,166,151.71	8,472,612.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-72,062,877.58	-114,024,027.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6,425.72	68,271.42
减：二、费用	29,709,946.13	32,843,950.74
1. 管理人报酬	11,742,300.65	13,337,748.02
2. 托管费	1,957,050.11	2,222,957.98
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	15,764,824.48	17,042,154.51
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	245,770.89	241,090.23

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-69,955,023.74	106,115,764.44
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-69,955,023.74	106,115,764.44

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

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）	2,056,678,664.53	-397,543,481.79	1,659,135,182.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-69,955,023.74	-69,955,023.74
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）	-134,927,926.79	26,282,073.76	-108,645,853.03
其中：1. 基金申购款	3,455,873.30	-660,239.65	2,795,633.65
2. 基金赎回款	-138,383,800.09	26,942,313.41	-111,441,486.68
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）	1,921,750,737.74	-441,216,431.77	1,480,534,305.97
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）	2,421,471,657.63	-653,388,093.72	1,768,083,563.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	106,115,764.44	106,115,764.44
三、本期基金份额交易	-192,779,270.51	42,944,617.76	-149,834,652.75

产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号 填列）			
其中：1. 基金申购款	4,928,822.73	-1,102,003.17	3,826,819.56
2. 基金赎回款	-197,708,093.24	44,046,620.93	-153,661,472.31
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动（净值减少 以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益 （基金净值）	2,228,692,387.12	-504,327,711.52	1,724,364,675.60

注：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：

<u>周兵</u>	<u>林培富</u>	<u>龚珉</u>
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

长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)（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”）证监基金字[2006]260号文《关于核准同智证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》的核准，由封闭式基金同智证券投资基金转型而成，自2007年1月5日起，《长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金于2007年1月22日（“转换基准日”）的基金净值为人民币955,116,003.53元，于2007年1月23日（“转换日”）折合基金份额955,116,000.00份。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券，权证以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资占基金资产的比例范围为30%-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%；债券投资占基金资产的比例范围为0-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在5%以上。本基金将不低于80%的股票资产投资于具有较大成长潜力的上市公司的股票。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。本基金的业绩比较基准是：沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

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。

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。

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、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

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。

6.4.7 关联方关系

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

本报告期内未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金”）	基金管理人、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

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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：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1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
国元证券	30,025,121.95	0.29%	-	-

6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国元证券	27,335.19	0.29%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国元证券	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	11,742,300.65	13,337,748.02
其中：支付销售机构的客户维护费	1,954,805.84	2,195,991.64

注：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：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付	1,957,050.11	2,222,957.98

的托管费		
------	--	--

注：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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

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

份额单位：份

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 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	-	62,276,368.00
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	-	62,276,368.00
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于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		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	182,816,057.49	1,539,723.66	553,243,701.86	1,469,231.16

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：本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002727	一心堂	2014年6月25日	2014年7月2日	新股流通受限	12.20	12.20	6,456	78,763.20	78,763.20	-

注：基金可使用以基金名义开设股票账户，选择网下或者网上一种方式进行新股申购。从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
300271	华宇软件	2014/6/27	重大事项停牌	40.30	-	-	233,649	8,164,756.72	9,416,054.70	-
600850	华东电脑	2014/4/4	重大事项停牌	21.20	2014/7/11	21.52	383,355	7,718,642.31	8,127,126.00	-
300137	先河环保	2014/6/16	重大事项停牌	20.86	2014/8/15	14.31	303,645	6,579,505.89	6,334,034.70	-
300295	三六五网	2014/4/11	重大事项停牌	100.10	2014/7/8	105.00	15,400	1,488,127.00	1,541,540.00	-

注：本基金截至2014年6月30日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

本基金本期末未持有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

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金无需作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	1,058,250,758.59	71.08
	其中：股票	1,058,250,758.59	71.08
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	243,400,662.60	16.35
	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	185,423,266.92	12.45
7	其他各项资产	1,732,348.30	0.12
8	合计	1,488,807,036.41	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	7,035,182.28	0.48
B	采矿业	17,566,884.90	1.19
C	制造业	391,052,569.65	26.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	30,050,000.00	2.03

F	批发和零售业	49,690,442.14	3.36
G	交通运输、仓储和邮政业	6,774,605.48	0.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,787,358.27	6.13
J	金融业	406,848,863.25	27.48
K	房地产业	14,879,821.44	1.01
L	租赁和商务服务业	43,565,031.18	2.94
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	1,058,250,758.59	71.48

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	600050	中国联通	22,198,959	71,702,637.57	4.84
2	601166	兴业银行	4,466,528	44,799,275.84	3.03
3	600138	中青旅	2,000,231	43,565,031.18	2.94
4	601299	中国北车	8,651,426	39,277,474.04	2.65
5	000001	平安银行	3,950,221	39,146,690.11	2.64
6	002154	报喜鸟	6,633,682	38,409,018.78	2.59
7	601766	中国南车	8,480,141	38,160,634.50	2.58
8	600016	民生银行	5,923,014	36,781,916.94	2.48
9	600036	招商银行	3,292,454	33,714,728.96	2.28
10	000768	中航飞机	3,163,576	33,312,455.28	2.25

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>网站的半年度报告正文。

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	600050	中国联通	70,802,152.34	4.27
2	600015	华夏银行	61,869,238.19	3.73
3	300267	尔康制药	48,822,393.85	2.94
4	601009	南京银行	48,245,051.66	2.91
5	002142	宁波银行	46,964,974.77	2.83
6	601166	兴业银行	45,597,454.44	2.75
7	002154	报喜鸟	43,469,550.11	2.62
8	601299	中国北车	43,207,147.38	2.60
9	601766	中国南车	42,160,607.66	2.54
10	002065	东华软件	41,747,155.55	2.52
11	600765	中航重机	41,643,283.16	2.51
12	600138	中青旅	40,278,665.18	2.43
13	600016	民生银行	39,486,137.91	2.38
14	000768	中航飞机	38,703,635.70	2.33
15	000001	平安银行	37,605,432.03	2.27
16	601901	方正证券	37,502,972.37	2.26
17	300017	网宿科技	37,502,439.16	2.26
18	601377	兴业证券	37,360,864.43	2.25
19	002396	星网锐捷	37,285,323.56	2.25
20	002584	西陇化工	35,682,651.82	2.15
21	600240	华业地产	35,561,093.34	2.14
22	600340	华夏幸福	35,013,848.86	2.11
23	600036	招商银行	33,514,191.75	2.02
24	300137	先河环保	33,283,754.74	2.01
25	300037	新宙邦	33,194,309.96	2.00

7.4.2 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	002065	东华软件	68,079,509.92	4.10

2	002551	尚荣医疗	66,920,087.91	4.03
3	300017	网宿科技	58,022,189.76	3.50
4	002484	江海股份	49,764,208.80	3.00
5	300267	尔康制药	49,575,862.94	2.99
6	002410	广联达	49,316,757.78	2.97
7	601009	南京银行	47,557,650.52	2.87
8	002142	宁波银行	46,453,771.01	2.80
9	600893	航空动力	45,235,397.51	2.73
10	002683	宏大爆破	43,482,010.99	2.62
11	002440	闰土股份	42,807,638.86	2.58
12	601668	中国建筑	39,027,077.03	2.35
13	002396	星网锐捷	38,793,958.18	2.34
14	600340	华夏幸福	37,540,920.86	2.26
15	600765	中航重机	36,641,283.89	2.21
16	002584	西陇化工	36,059,792.82	2.17
17	300037	新宙邦	35,866,623.81	2.16
18	000559	万向钱潮	34,601,618.01	2.09
19	600240	华业地产	34,229,959.38	2.06
20	600015	华夏银行	33,504,167.78	2.02

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	5,291,850,600.37
卖出股票收入（成交）总额	5,088,134,690.10

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有资产支持证券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1**

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	1,591,200.99
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	108,631.30
5	应收申购款	2,268.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.08
8	其他	-
9	合计	1,732,348.30

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 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
91,597	20,980.50	11,214,609.53	0.58%	1,910,536,128.21	99.42%

8.2 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	天津开创投资有限责任公司	1,986,564.00	0.10%
2	黄晓峰	709,737.00	0.04%
3	高兆明	577,298.00	0.03%
4	黄带顺	540,000.00	0.03%
5	王明瑞	486,832.00	0.03%
6	陈克明	387,000.00	0.02%
7	沙勤	310,635.00	0.02%
8	李萍	252,969.00	0.01%
9	王远芳	251,326.00	0.01%
10	荆南飞	248,712.00	0.01%

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	-	-

8.4 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（2007年1月5日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,056,678,664.53
本报告期基金总申购份额	3,455,873.30
减：本报告期基金总赎回份额	138,383,800.09
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,921,750,737.74

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略不曾改变。

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。

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	
东海证券	2	4,098,450,573.87	39.48%	3,731,239.07	39.48%	-
东兴证券	1	1,530,565,982.68	14.75%	1,393,431.67	14.75%	-
长江证券	1	1,403,699,776.32	13.52%	1,277,928.15	13.52%	-
中信证券	2	1,382,876,995.05	13.32%	1,258,974.70	13.32%	-
东北证券	1	1,056,839,012.63	10.18%	962,145.64	10.18%	-
西南证券	1	717,515,854.76	6.91%	653,228.16	6.91%	-
招商证券	1	147,463,041.96	1.42%	134,250.77	1.42%	-
国元证券	1	30,025,121.95	0.29%	27,335.19	0.29%	-
上海证券	1	12,470,168.05	0.12%	11,352.86	0.12%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-

中金公司	1	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-

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	
	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
东海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

五矿证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
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，并能为本公司基金提供全面的信息服。

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