

# 长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 2014 年年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国建设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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(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 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	41
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
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.....	65
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	65
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.....	65

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.....	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
8.12 投资组合报告附注.....	66
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	69
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>69</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>70</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
11.4 基金投资策略的改变.....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
11.8 其他重大事件.....	73
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>75</b>
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	75
12.3 查阅方式.....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金		
基金简称	长盛同庆中证 800 分级		
场内简称	长盛同庆		
基金主代码	160806		
交易代码	160806		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 5 月 12 日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	851,840,430.56 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	2012-05-31		
下属分级基金的基金简称	长盛同庆 800A	长盛同庆 800B	长盛同庆中证 800 分级
下属分级基金的场内简称	同庆 A	同庆 B	长盛同庆
下属分级基金的交易代码	150098	150099	160806
报告期末下属分级基金份额总额	278,099,590.00 份	417,149,386.00 份	156,591,454.56 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的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控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现中证 800 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4% 的投资目标。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 800 指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金将在基金合同生效 3 个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。
业绩比较基准	95%×中证 800 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益

	的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	长盛同庆 800A：低风险、收益相对稳定。	长盛同庆 800B：获取杠杆收益，风险和预期收益均高于长盛同庆中证 800 分级份额。	长盛同庆中证 800 分级：高风险、高预期收益。

## 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	010-67595096
传真		010-82255988	010-66275853
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100088	100033
法定代表人		高新	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年	2013 年	2012 年 5 月 12 日(基金合同生效日)-2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	306,816,167.34	231,942,788.58	-328,098,108.51

本期利润	502,257,247.90	94,101,096.88	-230,564,485.80
加权平均基金份额本期利润	0.2393	0.0337	-0.0426
本期加权平均净值利润率	27.12%	3.56%	-4.68%
本期基金份额净值增长率	37.77%	-1.19%	-4.26%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	110,534,905.74	-369,610,081.97	-984,331,279.61
期末可供分配基金份额利润	0.1298	-0.1850	-0.2026
期末基金资产净值	1,034,171,205.75	1,833,253,220.43	4,640,886,206.96
期末基金份额净值	1.214	0.917	0.955
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	30.33%	-5.40%	-4.26%

## 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	29.15%	1.42%	31.57%	1.39%	-2.42%	0.03%
过去六个月	46.80%	1.18%	52.22%	1.14%	-5.42%	0.04%
过去一年	37.77%	1.12%	45.71%	1.09%	-7.94%	0.03%
自基金转型起至今	30.33%	1.18%	34.96%	1.19%	-4.63%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准=95%×中证 800 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。

基准指数：中证 800 指数。

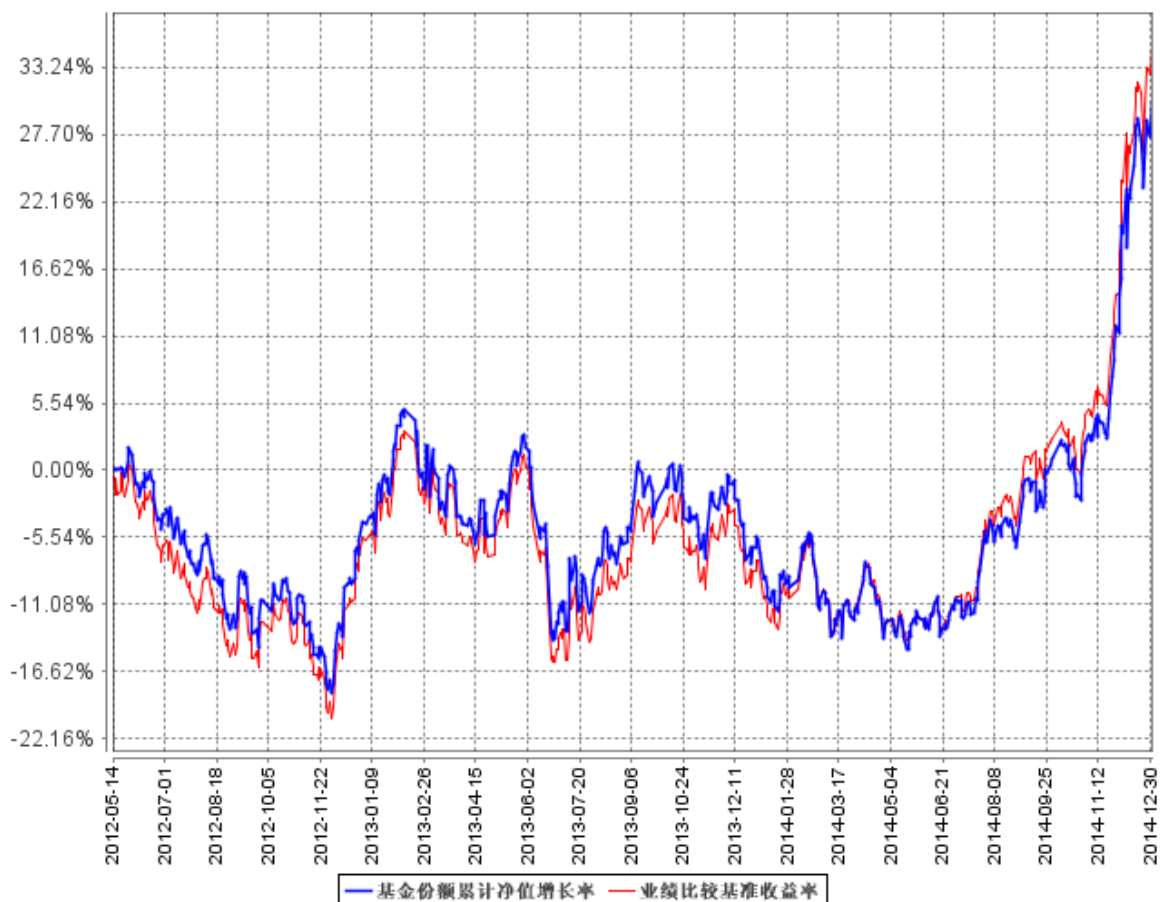
本基金的业绩比较基准中证 800 指数由中证指数有限公司构建和发布。具体的编制规则和再平衡过程请参见中证 800 指数编制细则（网址为：

<http://www.csindex.com.cn/sseportal/csiportal/indexquery.do>）。

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，业绩比较基准中证 800 指数、一年期银行定期存款每日按照 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

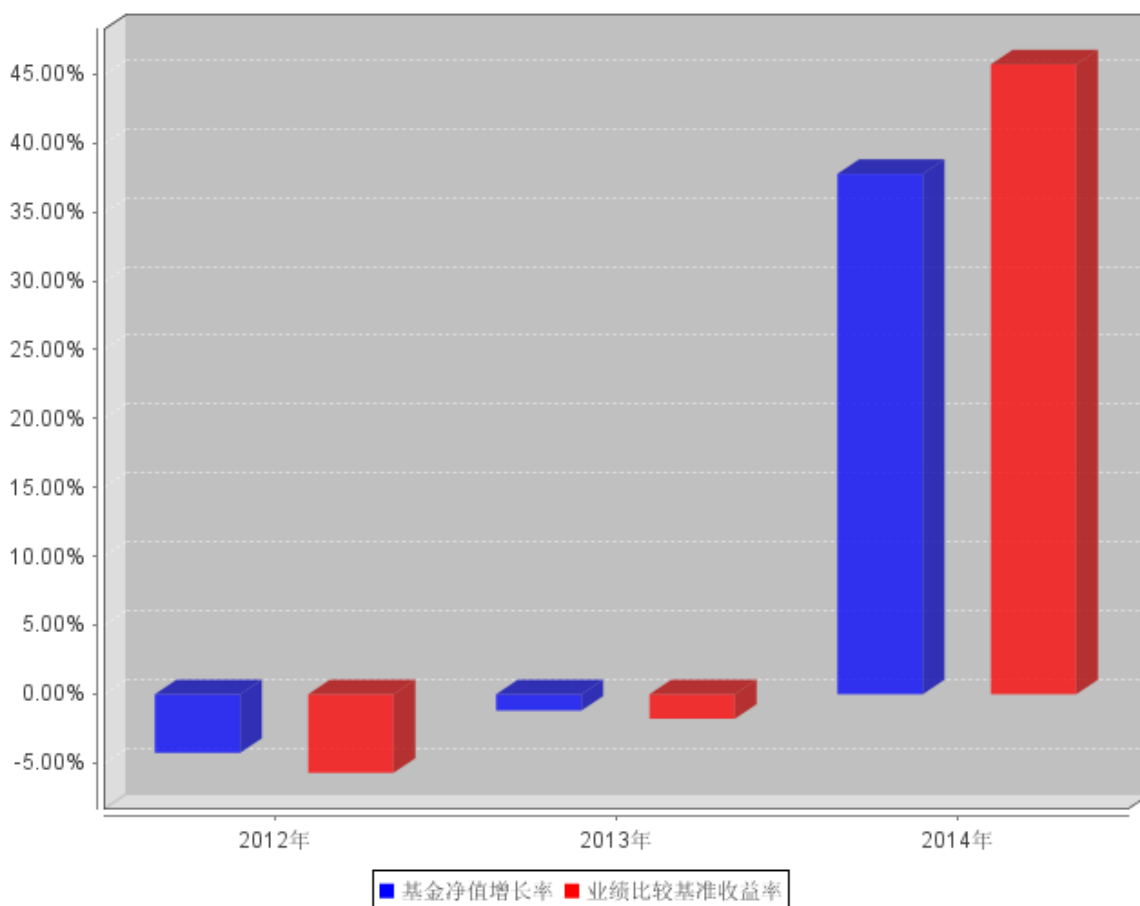


注：1、本基金由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为 2012 年 5 月 12 日。

2、按照本基金合同规定，本基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 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十七条（三）投资范围、（九）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。



### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为 2012 年 5 月 12 日，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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014年度	-	-	-	-	注：2014 年度未分配收益
2013年度	-	-	-	-	注：2013 年度未分配收益
2012年度	-	-	-	-	注：2012 年 5 月 12 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日未分配收益
合计	-	-	-	-	

## § 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		
王超	本基金基金经理，长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理。	2012 年 7 月 20 日	-	7 年	男，1981 年 9 月出生，中国国籍。中央财经大学硕士，CFA（特许金融分析师），FRM（金融风险管理师）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员，从事量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同瑞中证 200 指数分级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（本基金）基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理。
王志远	本基金基金经理助理，研究员。	2013 年 2 月 7 日	2014 年 4 月 30 日	5 年	男，1982 年 7 月出生，中国国籍。毕业于香港科技大学，获硕士学位。2009 年 11 月加入长盛基金管理有限公司，任研究员等职务，自 2014 年 4 月

					30 日起不再担任长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	---------------------------------------

注：1、上表基金经理及基金经理助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

在报告期内，我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略，尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响，将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.214 元，本报告期份额净值增长率为 37.77%，同期业绩比较基准收益率为 45.71%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为 0.15%，控制在 0.35%之内；年化跟踪误差为 3.16%，控制在 4%之内。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年下半年的 A 股市场上证综指暴涨 57.92%，充分体现了“经济新常态”下改革红利释放预期的强度。尽管经济指标持续低迷，国际市场出现剧烈震荡，但是丝毫没有改变国内市场的上涨趋势。改革预期和资金推动是这一波暴涨的主要驱动因素，外在表现为金融改革、一路一带、国企改革等主题性投资机会。

展望 2015 年上半年的市场，预计改革预期和资金效应仍将继续主导市场走势。在四季度表现出明显上涨趋势的高 Beta、大市值、低估值等风格因子仍将继续维持强势。在估值修复行情演绎到比较充分的阶段，大中市值的成长性品种也将获得资金的青睐，GARP 等兼顾成长和价值的策略预计会有良好表现。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作，保障资产委托人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时敦促有关部门改进、完善，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

1、强调合规培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训等多种方式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，强化员工合规理念，深化员工合规意识，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、强调制度/流程建设，扎实公司内控制度建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，保证公司制度/流程的合法合规、全面、适时、有效。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，确保制度/流程严肃性与执行力。报告期内，监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核工作，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、登记注册、产品开发等等；并根据业务发展需要，以及日常监督中发现问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，以保障公司制度/流程的严肃性与执行力。

5、加强员工行为合规的检查监督。报告期内，监察稽核部借助信息技术系统，通过完善员工投资报备系统、建设员工合规档案系统等，提高员工行为合规管理水平，督促员工自觉合规。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证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。

#### **4.8 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》的规定及本基金基金合同第二十一节中对基金利润分配原则的约定，在本基金分级运作期内，本基金（包括长盛同庆 800A、长盛同庆 800B 和长盛同庆中证 800 分级基金份额）不进行收益分配。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投

资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2015)第 20190 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金的财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	<p>编制和公允列报财务报表是长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金的基金管理人长盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的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，公允反映了长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汪棣	沈兆杰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2015 年 3 月 23 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	60,365,980.34	96,653,973.20
结算备付金		694,771.26	3,075,367.98
存出保证金		1,213,680.45	447,075.55
交易性金融资产	7.4.7.2	969,984,095.68	1,728,187,030.87
其中：股票投资		969,984,095.68	1,721,173,750.57
基金投资		-	-
债券投资		-	7,013,280.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		28,577,360.35	-
应收利息	7.4.7.5	18,930.13	25,764.35
应收股利		-	-
应收申购款		-	9,998,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,060,854,818.21	1,838,387,211.95
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2013 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-



卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		22,556,787.67	372,979.57
应付管理人报酬		936,243.33	1,582,174.24
应付托管费		205,973.52	348,078.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,435,204.91	982,898.63
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,549,403.03	1,847,860.74
负债合计		26,683,612.46	5,133,991.52
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	909,795,613.87	2,202,863,302.40
未分配利润	7.4.7.10	124,375,591.88	-369,610,081.97
所有者权益合计		1,034,171,205.75	1,833,253,220.43
负债和所有者权益总计		1,060,854,818.21	1,838,387,211.95

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.214 元，基金份额总额 851,840,430.56 份，其中长盛同庆 800A 基金份额为 278,099,590.00 份，长盛同庆 800B 基金份额为 417,149,386.00 份，长盛同庆中证 800 分级基金份额为 156,591,454.56 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		547,599,463.03	139,075,503.12
1. 利息收入		1,133,677.25	1,415,755.18
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,111,672.90	1,408,363.74
债券利息收入		22,004.35	7,391.44
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）		347,126,854.37	270,614,113.19
其中：股票投资收益	7.4.7.12	300,970,822.50	221,834,719.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	339,093.93	494,224.32

资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	45,816,937.94	48,285,169.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	195,441,080.56	-137,841,691.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,897,850.85	4,887,326.45
<b>减：二、费用</b>		45,342,215.13	44,974,406.24
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	18,373,284.01	26,757,181.47
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,042,122.52	5,886,580.02
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	22,358,960.76	11,718,785.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	567,847.84	611,858.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		502,257,247.90	94,101,096.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		502,257,247.90	94,101,096.88

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,202,863,302.40	-369,610,081.97	1,833,253,220.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	502,257,247.90	502,257,247.90
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）	-1,293,067,688.53	-8,271,574.05	-1,301,339,262.58
其中：1. 基金申购款	2,399,147,193.06	-538,882,325.11	1,860,264,867.95
2. 基金赎回款	-3,692,214,881.59	530,610,751.06	-3,161,604,130.53
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）	909,795,613.87	124,375,591.88	1,034,171,205.75
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	5,508,682,489.79	-867,796,282.83	4,640,886,206.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	94,101,096.88	94,101,096.88
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）	-3,305,819,187.39	404,085,103.98	-2,901,734,083.41
其中：1. 基金申购款	1,255,180,283.95	-187,859,693.06	1,067,320,590.89
2. 基金赎回款	-4,560,999,471.34	591,944,797.04	-3,969,054,674.30
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）	2,202,863,302.40	-369,610,081.97	1,833,253,220.43

注：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

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金是根据长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金（以下简称“长盛同庆封闭基金”）基金份额持有人大会 2012 年 4 月 10 日决议通过的《关于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可字[2012]549 号《关于核准长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，由原基金长盛同庆封闭基金转型而来。原基金长盛同庆封闭基金为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易上市，存续期限至 2012 年 5 月 11 日止。根据深交所《终止上市通知书》（深证上[2012]116 号）的同意，自

2012 年 5 月 14 日起，原基金长盛同庆封闭基金终止上市，并更名为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)，《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》失效的同时《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原长盛同庆封闭基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 12,925,228,407.02 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。此外，根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金封闭期到期同庆 A、同庆 B 停止转托管业务并进行基金份额转换的公告》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金封闭期到期基金份额转换结果的公告》的规定，本基金的基金管理人于 2012 年 5 月 14 日对原长盛同庆封闭之同庆 A 和同庆 B 份额进行了基金份额转换，将原长盛同庆封闭基金之同庆 A 和同庆 B 份额折算为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“长盛同庆中证 800 分级份额”)，并于 2012 年 5 月 14 日进行了变更登记。

根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金进入分级运作期份额折算及分拆的公告》的规定，本基金自 2012 年 5 月 22 日起进入分级运作期，为期三年；分级运作期到期后，本基金将转换为上市开放式基金(LOF)。在分级运作期起始日，即 2012 年 5 月 22 日，本基金的基金管理人对长盛同庆中证 800 分级份额进行了份额折算，折算后长盛同庆中证 800 分级份额的份额净值为人民币 1.000 元。

根据基金合同的有关规定，本基金在分级运作期内的基金份额包括长盛同庆中证 800 分级份额、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“同庆 800A 份额”)以及长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“同庆 800B 份额”)。本基金在分级运作期起始日，场内长盛同庆中证 800 分级份额按 4:6 的比例分离成同庆 800A 份额和同庆 800B 份额，各类基金份额的基金资产合并运作。

长盛同庆中证 800 分级份额只接受场外与场内申购和赎回，同庆 800A 份额和同庆 800B 份额可单独在上市交易但不接受申购和赎回。经深交所深证上[2012]137 号文审核同意，同庆 800A 份额和同庆 800B 份额于 2012 年 5 月 31 日在深交所挂牌交易。截至 2012 年 5 月 30 日，长盛同庆基金份额净值为 1.013 元，同庆 800A 基金份额参考净值为 1.002 元，同庆 800B 基金份额参考净值为 1.020 元。未上市交易的长盛同庆中证 800 分级份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可按照 4:6 的比例与同庆 800A 份额和同庆 800B 份额进行配对转换。

在分级运作期内，在自分级运作期起始日后满一年和满两年的对应日(若该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日)，本基金的基金管理人将根据基金合同的规定对长盛同庆中证 800 分级份额、同庆 800A 份额和同庆 800B 份额的基金份额进行份额折算；此外，若同庆 800B 份额的参考净值跌至 0.250 元以下，本基金的基金管理人还将根据基金合同的规定对长盛同庆中证 800 分级份额、同庆 800A 份额和同庆 800B 份额的基金份额进行不定期份额折算。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同的有关规定，本基金的投资范围为本基金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)、权证、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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率(税后)}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2015 年 3 月 23 日批准报出。

#### 7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 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，包括银行存款和各类其他应收款项等。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各类其他应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 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则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在本基金分级运作期内，本基金(包括长盛同庆 800A、长盛同庆 800B 和长盛同庆中证 800 分级基金份额)不进行收益分配。分级运作期到期后，按照本基金所约定的参考净值计算规则，单独计算出同庆 A 份额与同庆 B 份额各自的份额参考净值并转换为上市开放式基金(LOF)份额，基金份额持有人可通过赎回上市开放式(LOF)基金份额实现应得收益。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

#### 7.4.4.13 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股票投资和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：



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

#### 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

财政部于 2014 年颁布《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》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《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》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局[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。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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2014 年 12 月 31 日	
	上年度末	
	2013 年 12 月 31 日	
活期存款	60,365,980.34	96,653,973.20
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	60,365,980.34	96,653,973.20

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	814,075,958.98	969,984,095.68	155,908,136.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	814,075,958.98	969,984,095.68	155,908,136.70
项目	上年度末		
	2013 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,761,175,974.73	1,721,173,750.57	-40,002,224.16
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,544,000.00	7,013,280.30
	银行间市场	-	-

	合计	6,544,000.00	7,013,280.30	469,280.30
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	1,767,719,974.73	1,728,187,030.87	-39,532,943.86

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
应收活期存款利息	18,070.65	19,417.77
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	313.28	1,384.10
应收债券利息	-	4,561.32
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	199.96
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	546.20	201.20
合计	18,930.13	25,764.35

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,435,204.91	982,898.63
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,435,204.91	982,898.63

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
证管费退还	607,536.79	607,536.79

应付券商交易单元保证金	500,000.00	750,000.00
预提费用	360,000.00	490,000.00
应付赎回费	81,866.24	323.95
合计	1,549,403.03	1,847,860.74

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上期末	1,998,224,391.67	2,202,863,302.40
本期份额折算前申购	726,901,904.79	801,213,580.73
本期份额折算前赎回(以“-”号填列)	-191,383,720.13	-210,982,307.86
2014年5月21日份额折算前	2,533,742,576.33	2,793,094,575.27
份额折算调整	81,772,560.69	-
本期份额折算后申购	1,496,748,961.34	1,597,933,612.33
本期份额折算后赎回(以“-”号填列)	-3,260,423,667.80	-3,481,232,573.73
本期末	851,840,430.56	909,795,613.87

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金份额折算公告》，基金管理人长盛基金管理有限公司以 2014 年 5 月 21 日为份额折算基准日，对长盛同庆份额的场外份额、场内份额以及同庆 800A 份额实施定期份额折算。鉴于同庆 800B 份额在折算基准日 2014 年 5 月 21 日折算前的参考净值为 0.677 元，本基金本次定期折算按照“同庆 800B 份额折算基准日的参考净值处于 1.000 元及以下的情形”进行折算，即对于同庆 800A 份额的约定应得收益，即定期折算基准日同庆 800A 份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内长盛同庆份额分配给同庆 800A 份额持有人；同庆 800B 份额的参考净值和份额数不进行折算；长盛同庆份额持有人持有的每份长盛同庆份额将按持有 0.4 份同庆 800A 份额获得新增长盛同庆份额的分配，场外长盛同庆份额的持有人将按前述折算方式获得新增场外长盛同庆份额的分配，场内长盛同庆份额的持有人将按前述折算方式获得新增场内长盛同庆份额的分配。场内的长盛同庆份额、同庆 800A 份额折算成的新增场内长盛同庆份额的份额数取整计算(最小单位为 1 份)，场外的长盛同庆份额折算成的新增场外长盛同庆份额的份额数保留到小数点后两位，以循环进位方式分配因运算产生的剩余份额。折算后同庆 800A 份额和同庆 800B 份额的比例仍为 4:6，。

3、截至 2014 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 695,248,976.00 份(其中同庆

800A 份额 278,099,590.00 份，同庆 800B 份额 417,149,386.00 份；本基金于场内未上市交易的基金份额为 39,073,098.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 117,518,356.56 份，均为长盛同庆中证 800 分级份额。场内的基金份额登记在证券登记结算系统，场外的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-264,300,294.05	-105,309,787.92	-369,610,081.97
本期利润	306,816,167.34	195,441,080.56	502,257,247.90
本期基金份额交易产生的变动数	68,019,032.45	-76,290,606.50	-8,271,574.05
其中：基金申购款	-349,465,753.79	-189,416,571.32	-538,882,325.11
基金赎回款	417,484,786.24	113,125,964.82	530,610,751.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	110,534,905.74	13,840,686.14	124,375,591.88

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	981,358.70	1,316,771.40
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	81,942.68	42,807.63
其他	48,371.52	48,784.71
合计	1,111,672.90	1,408,363.74

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	7,725,701,206.46	4,780,193,239.86
减：卖出股票成本总额	7,424,730,383.96	4,558,358,520.12
买卖股票差价收入	300,970,822.50	221,834,719.74

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	339,093.93	494,224.32
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	339,093.93	494,224.32

## 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,406,059.60	8,833,854.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,040,400.00	8,336,800.00
减：应收利息总额	26,565.67	2,830.12
买卖债券差价收入	339,093.93	494,224.32

## 7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本期及上年度可比期间未取得衍生工具收益。

## 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
股票投资产生的股利收益	45,816,937.94	48,285,169.13
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	45,816,937.94	48,285,169.13

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
1. 交易性金融资产	195,441,080.56	-137,841,691.70
——股票投资	195,910,360.86	-138,310,972.00

——债券投资	-469,280.30	469,280.30
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	195,441,080.56	-137,841,691.70

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
基金赎回费收入	3,897,780.73	4,885,418.55
转换费收入	70.12	135.73
其它	-	1,772.17
合计	3,897,850.85	4,887,326.45

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率固定为 0.50%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
交易所市场交易费用	22,358,960.76	11,718,785.94
银行间市场交易费用	-	-
合计	22,358,960.76	11,718,785.94

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年 12月31日
信息披露费	360,000.00	360,000.00
审计费用	110,000.00	150,000.00
深交所上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款费用	19,487.84	23,858.81
帐户维护费	18,000.00	18,000.00
其他费用	360.00	-
合计	567,847.84	611,858.81

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月 31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	-	-	34,125,653.56	0.50%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

#### 7.4.10.1.3 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12月31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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	31,068.47	0.51%	31,068.47	3.16%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。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等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年 12月31日	2013年1月1日至2013年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,373,284.01	26,757,181.47
其中：支付销售机构的客户维护费	362,962.77	561,083.33

注：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 1.00% 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 × 1.00% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年 12月31日	2013年1月1日至2013年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,042,122.52	5,886,580.02

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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 × 0.22% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金基金管理人本期及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国建设银行	60,365,980.34	981,358.70	96,653,973.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

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

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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300315	掌趣科技	2014年7月14日	重大事项	19.58	2015年2月16日	17.41	342,387	5,363,873.38	6,703,937.46	-
601519	大智慧	2014年7月21日	重大事项	7.76	2015年1月23日	6.58	739,900	4,429,461.83	5,741,624.00	-
000897	津滨	2014年	重大	7.55	2015年	7.50	654,945		4,944,834.75	-

	发展	12月26日	事项		1月21日			3,548,676.93		
600761	安徽合力	2014年12月26日	重大事项	15.65	2015年1月6日	16.60	247,762	2,667,891.00	3,877,475.30	-
002050	三花股份	2014年10月27日	重大事项	13.57	2015年1月27日	14.93	243,221	3,461,331.55	3,300,508.97	-
002437	誉衡药业	2014年11月21日	重大事项	23.34	2015年1月26日	26.13	95,419	2,153,843.48	2,227,079.46	-
000627	天茂集团	2014年10月22日	重大事项	4.10	2015年1月16日	4.51	528,100	1,868,529.78	2,165,210.00	-
000413	东旭光电	2014年11月25日	重大事项	7.67	2015年1月28日	8.44	275,097	2,148,469.04	2,109,993.99	-
002152	广电运通	2014年12月17日	重大事项	22.15	2015年3月11日	24.37	94,875	1,652,089.64	2,101,481.25	-
600580	卧龙电气	2014年12月8日	重大事项	10.48	2015年1月14日	11.12	175,672	1,651,624.62	1,841,042.56	-
002396	星网锐捷	2014年10月20日	重大事项	27.31	2015年2月9日	30.04	64,681	1,834,671.92	1,766,438.11	-
000562	宏源证券	2014年12月10日	重大事项	30.50	不适用	不适用	57,791	529,712.46	1,762,625.50	-
000009	中国宝安	2014年12月29日	重大事项	12.95	2015年1月7日	13.88	134,136	1,146,533.41	1,737,061.20	-
601766	中国南车	2014年10月27日	重大事项	6.65	2014年12月31日	6.38	252,253	1,352,620.67	1,677,482.45	-
600584	长电科技	2014年11月3日	重大事项	10.52	2015年1月14日	12.24	159,425	1,749,883.25	1,677,151.00	-
601299	中国北车	2014年10月27日	重大事项	7.33	2014年12月31日	7.10	223,387	1,179,795.00	1,637,426.71	-
600759	洲际油气	2014年12月24日	重大事项	9.90	-	-	156,896	1,898,276.76	1,553,270.40	-
002354	科冕木业	2014年10月31日	重大事项	52.55	-	-	18,586	902,198.79	976,694.30	-
300168	万达信息	2014年12月31日	重大事项	46.20	2015年1月8日	44.50	20,100	882,010.08	928,620.00	-
600664	哈药股份	2014年12月31日	重大事项	8.68	2015年2月17日	9.45	83,800	729,486.00	727,384.00	-
601216	内蒙君正	2014年12月1日	重大事项	10.44	2015年1月7日	11.10	34,180	294,722.01	356,839.20	-
000906	物产中拓	2014年10月13日	重大事项	16.00	2015年1月30日	16.00	6,934	115,744.24	110,944.00	-
600754	锦江股份	2014年11月10日	重大事项	24.99	2015年1月19日	27.00	3,472	72,011.93	86,765.28	-

注：1、根据宏源证券股份有限公司(以下简称“宏源证券”)于2014年12月2日公布的《申银万国证券股份有限公司换股吸收合并宏源证券股份有限公司报告书》和《关于申银万国证券股

份有限公司换股吸收合并本公司事宜的提示性公告》，申银万国证券股份有限公司将向宏源证券全体股东发行 A 股股票，以换股比例 2.049:1 取得宏源证券股东持有的宏源证券全部股票，吸收合并宏源证券；宏源证券自 2014 年 12 月 10 日起连续停牌。合并后的申万宏源于 2015 年 1 月 26 日复牌，当日复牌开盘单价为 17.77 元。宏源证券人民币普通股股票自 2015 年 1 月 26 日起终止上市并摘牌。2、本基金截至 2014 年 12 月 31 日持有的中国北车、中国南车已于本期末复牌，但交易仍不活跃、流通仍受限，因此仍作为流通受限股票。3、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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2013 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.38%），因此不存在重大信用风险（2013 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本

基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均可以合理的价格适时变现。

于 2014 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	60,365,980.34	-	-	-	60,365,980.34
结算备付金	694,771.26	-	-	-	694,771.26
存出保证金	1,213,680.45	-	-	-	1,213,680.45
交易性金融资产	-	-	-	969,984,095.68	969,984,095.68
应收证券清算款	-	-	-	28,577,360.35	28,577,360.35
应收利息	-	-	-	18,930.13	18,930.13
资产总计	62,274,432.05	-	-	998,580,386.16	1,060,854,818.21
负债					

应付赎回款	-	-	-	22,556,787.67	22,556,787.67
应付管理人报酬	-	-	-	936,243.33	936,243.33
应付托管费	-	-	-	205,973.52	205,973.52
应付交易费用	-	-	-	1,435,204.91	1,435,204.91
其他负债	-	-	-	1,549,403.03	1,549,403.03
负债总计	-	-	-	26,683,612.46	26,683,612.46
利率敏感度缺口	62,274,432.05	-	-	971,896,773.70	1,034,171,205.75
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	96,653,973.20	-	-	-	96,653,973.20
结算备付金	3,075,367.98	-	-	-	3,075,367.98
存出保证金	447,075.55	-	-	-	447,075.55
交易性金融资产	-	-	7,013,280.30	1,721,173,750.57	1,728,187,030.87
应收利息	-	-	-	25,764.35	25,764.35
应收申购款	9,998,000.00	-	-	-	9,998,000.00
资产总计	110,174,416.73	-	7,013,280.30	1,721,199,514.92	1,838,387,211.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	372,979.57	372,979.57
应付管理人报酬	-	-	-	1,582,174.24	1,582,174.24
应付托管费	-	-	-	348,078.34	348,078.34
应付交易费用	-	-	-	982,898.63	982,898.63
其他负债	-	-	-	1,847,860.74	1,847,860.74
负债总计	-	-	-	5,133,991.52	5,133,991.52
利率敏感度缺口	110,174,416.73	-	7,013,280.30	1,716,065,523.40	1,833,253,220.43

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2013 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.38%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2013 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪中证 800 指数为原则，进行指数化长期投资，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	969,984,095.68	93.79	1,721,173,750.57	93.89
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	969,984,095.68	93.79	1,721,173,750.57	93.89

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 12 月 31 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	51,919,762.62	90,640,968.62
业绩比较基准下降 5%	-51,919,762.62	-90,640,968.62	



#### 7.4.14 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日，本基金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中属于第一层次的余额为 919,972,205.79 元，属于第二层次的余额为 50,011,889.89 元，无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层次 1,706,170,859.50 元，第二层次 22,016,171.37 元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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次；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次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	969,984,095.68	91.43
	其中：股票	969,984,095.68	91.43
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	61,060,751.60	5.76
7	其他各项资产	29,809,970.93	2.81
8	合计	1,060,854,818.21	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资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	4,993,562.44	0.48
B	采矿业	38,050,066.39	3.68
C	制造业	309,551,262.43	29.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,012,477.19	2.90
E	建筑业	36,670,340.35	3.55
F	批发和零售业	106,853,617.44	10.33
G	交通运输、仓储和邮政业	25,004,597.25	2.42
H	住宿和餐饮业	86,765.28	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,095,287.41	3.59
J	金融业	279,471,691.65	27.02
K	房地产业	48,331,492.76	4.67
L	租赁和商务服务业	9,535,467.97	0.92
M	科学研究和技术服务业	652,048.96	0.06

N	水利、环境和公共设施管理业	8,310,173.61	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	603,703.15	0.06
R	文化、体育和娱乐业	9,616,332.42	0.93
S	综合	3,936,457.15	0.38
	合计	948,775,343.85	91.74

### 8.2.2 期末积极投资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	-	-
C	制造业	5,243,385.55	0.51
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	110,944.00	0.01
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	7,031,818.26	0.68
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,822,604.02	0.85
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	21,208,751.83	2.05

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600998	九州通	4,433,529	80,113,869.03	7.75
2	601318	中国平安	406,282	30,353,328.22	2.94
3	600016	民生银行	2,300,846	25,033,204.48	2.42
4	600036	招商银行	1,400,844	23,240,001.96	2.25
5	600030	中信证券	667,991	22,644,894.90	2.19
6	600837	海通证券	686,734	16,522,820.04	1.60
7	601166	兴业银行	970,233	16,008,844.50	1.55
8	600000	浦发银行	950,327	14,910,630.63	1.44
9	601398	工商银行	2,598,495	12,654,670.65	1.22
10	000002	万科A	823,572	11,447,650.80	1.11
11	601668	中国建筑	1,273,659	9,272,237.52	0.90
12	601328	交通银行	1,332,493	9,060,952.40	0.88
13	601601	中国太保	266,653	8,612,891.90	0.83
14	601818	光大银行	1,689,615	8,245,321.20	0.80
15	601288	农业银行	2,205,337	8,181,800.27	0.79
16	000001	平安银行	484,576	7,675,683.84	0.74
17	000651	格力电器	204,254	7,581,908.48	0.73
18	600887	伊利股份	260,143	7,447,894.09	0.72
19	600519	贵州茅台	38,707	7,339,621.34	0.71
20	000783	长江证券	431,005	7,249,504.10	0.70
21	000776	广发证券	251,078	6,515,474.10	0.63
22	600104	上汽集团	280,882	6,030,536.54	0.58
23	600048	保利地产	546,755	5,915,889.10	0.57
24	601169	北京银行	537,640	5,876,405.20	0.57
25	601688	华泰证券	237,842	5,819,993.74	0.56
26	601989	中国重工	623,643	5,743,752.03	0.56
27	601519	大智慧	739,900	5,741,624.00	0.56
28	601088	中国神华	280,159	5,684,426.11	0.55
29	600999	招商证券	197,261	5,576,568.47	0.54
30	601390	中国中铁	579,915	5,393,209.50	0.52
31	601006	大秦铁路	504,526	5,378,247.16	0.52
32	600015	华夏银行	377,708	5,083,949.68	0.49
33	000897	津滨发展	654,945	4,944,834.75	0.48

34	000333	美的集团	178,881	4,908,494.64	0.47
35	601377	兴业证券	309,204	4,675,164.48	0.45
36	600900	长江电力	419,738	4,478,604.46	0.43
37	601628	中国人寿	127,405	4,350,880.75	0.42
38	600383	金地集团	381,245	4,350,005.45	0.42
39	601186	中国铁建	261,500	3,990,490.00	0.39
40	600761	安徽合力	247,762	3,877,475.30	0.37
41	600585	海螺水泥	169,860	3,750,508.80	0.36
42	600795	国电电力	799,140	3,700,018.20	0.36
43	601857	中国石油	330,031	3,567,635.11	0.34
44	600050	中国联通	719,342	3,560,742.90	0.34
45	601336	新华保险	70,728	3,505,279.68	0.34
46	000858	五粮液	160,856	3,458,404.00	0.33
47	002024	苏宁云商	376,397	3,387,573.00	0.33
48	002050	三花股份	243,221	3,300,508.97	0.32
49	600886	国投电力	288,319	3,298,369.36	0.32
50	600111	包钢稀土	123,139	3,186,837.32	0.31
51	600011	华能国际	356,899	3,151,418.17	0.30
52	000625	长安汽车	191,294	3,142,960.42	0.30
53	600028	中国石化	471,994	3,063,241.06	0.30
54	000063	中兴通讯	166,924	3,014,647.44	0.29
55	600019	宝钢股份	418,962	2,936,923.62	0.28
56	000725	京东方 A	864,297	2,904,037.92	0.28
57	000538	云南白药	44,162	2,788,830.30	0.27
58	600010	包钢股份	680,131	2,774,934.48	0.27
59	601800	中国交建	199,528	2,771,443.92	0.27
60	600089	特变电工	220,203	2,726,113.14	0.26
61	000157	中联重科	373,585	2,637,510.10	0.26
62	600739	辽宁成大	121,491	2,610,841.59	0.25
63	600109	国金证券	131,828	2,608,876.12	0.25
64	600031	三一重工	258,397	2,578,802.06	0.25
65	601555	东吴证券	114,575	2,568,771.50	0.25
66	000069	华侨城 A	308,428	2,544,531.00	0.25
67	000402	金融街	202,646	2,498,625.18	0.24
68	600018	上港集团	386,517	2,481,439.14	0.24
69	000338	潍柴动力	89,999	2,456,072.71	0.24
70	000100	TCL 集团	641,471	2,437,589.80	0.24
71	600690	青岛海尔	129,275	2,399,344.00	0.23
72	600276	恒瑞医药	63,894	2,394,747.12	0.23

73	601988	中国银行	571,673	2,372,442.95	0.23
74	000024	招商地产	87,555	2,310,576.45	0.22
75	600570	恒生电子	41,926	2,295,867.76	0.22
76	002415	海康威视	102,366	2,289,927.42	0.22
77	600705	中航资本	126,614	2,265,124.46	0.22
78	601899	紫金矿业	669,792	2,263,896.96	0.22
79	002437	誉衡药业	95,419	2,227,079.46	0.22
80	600256	广汇能源	265,659	2,220,909.24	0.21
81	601009	南京银行	151,363	2,217,467.95	0.21
82	002304	洋河股份	27,440	2,169,132.00	0.21
83	600535	天士力	52,626	2,162,928.60	0.21
84	600150	中国船舶	58,324	2,149,822.64	0.21
85	600637	百视通	56,649	2,145,864.12	0.21
86	000768	中航飞机	112,764	2,135,750.16	0.21
87	600369	西南证券	95,582	2,130,522.78	0.21
88	000623	吉林敖东	60,885	2,119,406.85	0.20
89	000413	东旭光电	275,097	2,109,993.99	0.20
90	601618	中国中冶	414,405	2,092,745.25	0.20
91	601669	中国电建	244,132	2,058,032.76	0.20
92	600518	康美药业	130,825	2,056,569.00	0.20
93	600196	复星医药	97,348	2,054,042.80	0.20
94	600352	浙江龙盛	104,117	2,049,022.56	0.20
95	601099	太平洋	141,755	2,015,756.10	0.19
96	600309	万华化学	91,821	1,999,861.38	0.19
97	000686	东北证券	99,798	1,993,964.04	0.19
98	600340	华夏幸福	44,858	1,955,808.80	0.19
99	300027	华谊兄弟	73,593	1,940,647.41	0.19
100	600674	川投能源	93,523	1,938,731.79	0.19
101	000503	海虹控股	61,085	1,910,738.80	0.18
102	600832	东方明珠	135,389	1,873,783.76	0.18
103	002450	康得新	64,131	1,857,875.07	0.18
104	002202	金风科技	130,434	1,843,032.42	0.18
105	600580	卧龙电气	175,672	1,841,042.56	0.18
106	600406	国电南瑞	123,527	1,797,317.85	0.17
107	000895	双汇发展	56,150	1,771,532.50	0.17
108	002396	星网锐捷	64,681	1,766,438.11	0.17
109	000562	宏源证券	57,791	1,762,625.50	0.17
110	300024	机器人	44,311	1,745,410.29	0.17
111	600100	同方股份	149,027	1,740,635.36	0.17

112	000009	中国宝安	134,136	1,737,061.20	0.17
113	600221	海南航空	501,959	1,716,699.78	0.17
114	600804	鹏博士	94,478	1,698,714.44	0.16
115	600066	宇通客车	75,167	1,678,479.11	0.16
116	601766	中国南车	252,253	1,677,482.45	0.16
117	600584	长电科技	159,425	1,677,151.00	0.16
118	000423	东阿阿胶	44,219	1,648,484.32	0.16
119	601299	中国北车	223,387	1,637,426.71	0.16
120	600009	上海机场	81,797	1,604,857.14	0.16
121	000039	中集集团	72,999	1,597,948.11	0.15
122	601117	中国化学	167,904	1,586,692.80	0.15
123	002241	歌尔声学	64,672	1,586,404.16	0.15
124	600583	海油工程	150,416	1,583,880.48	0.15
125	300070	碧水源	45,378	1,579,154.40	0.15
126	600315	上海家化	45,590	1,564,648.80	0.15
127	600759	洲际油气	156,896	1,553,270.40	0.15
128	600029	南方航空	297,278	1,533,954.48	0.15
129	600177	雅戈尔	132,354	1,523,394.54	0.15
130	002673	西部证券	40,615	1,521,031.75	0.15
131	002594	比亚迪	39,774	1,517,378.10	0.15
132	000061	农产品	115,514	1,513,233.40	0.15
133	601018	宁波港	326,813	1,503,339.80	0.15
134	600208	新湖中宝	204,859	1,499,567.88	0.15
135	000831	五矿稀土	49,741	1,491,732.59	0.14
136	601168	西部矿业	161,438	1,491,687.12	0.14
137	600153	建发股份	144,858	1,474,654.44	0.14
138	601888	中国国旅	33,106	1,469,906.40	0.14
139	600415	小商品城	115,479	1,465,428.51	0.14
140	600839	四川长虹	312,792	1,457,610.72	0.14
141	600660	福耀玻璃	119,008	1,444,757.12	0.14
142	601933	永辉超市	165,801	1,444,126.71	0.14
143	600703	三安光电	101,536	1,443,841.92	0.14
144	600893	航空动力	49,573	1,435,634.08	0.14
145	600271	航天信息	46,929	1,431,803.79	0.14
146	600118	中国卫星	50,225	1,430,408.00	0.14
147	601633	长城汽车	34,089	1,416,397.95	0.14
148	000709	河北钢铁	360,980	1,382,553.40	0.13
149	601727	上海电气	166,965	1,377,461.25	0.13
150	002500	山西证券	85,582	1,369,312.00	0.13

151	000750	国海证券	78,187	1,359,671.93	0.13
152	600741	华域汽车	87,652	1,356,852.96	0.13
153	300059	东方财富	48,480	1,355,500.80	0.13
154	000581	威孚高科	50,322	1,350,139.26	0.13
155	601179	中国西电	173,461	1,347,791.97	0.13
156	601607	上海医药	81,349	1,342,258.50	0.13
157	601866	中海集运	268,869	1,328,212.86	0.13
158	600489	中金黄金	124,981	1,327,298.22	0.13
159	000425	徐工机械	87,555	1,310,698.35	0.13
160	002465	海格通信	67,734	1,308,620.88	0.13
161	000629	攀钢钒钛	364,232	1,307,592.88	0.13
162	601333	广深铁路	288,261	1,302,939.72	0.13
163	600362	江西铜业	70,508	1,300,167.52	0.13
164	600663	陆家嘴	34,662	1,299,825.00	0.13
165	002142	宁波银行	82,525	1,298,118.25	0.13
166	600252	中恒集团	78,836	1,289,756.96	0.12
167	600027	华电国际	180,213	1,261,491.00	0.12
168	002081	金螳螂	74,562	1,252,641.60	0.12
169	002353	杰瑞股份	40,820	1,247,867.40	0.12
170	600642	申能股份	193,086	1,247,335.56	0.12
171	600085	同仁堂	55,558	1,246,165.94	0.12
172	600372	中航电子	44,796	1,240,401.24	0.12
173	600600	青岛啤酒	29,544	1,234,348.32	0.12
174	600108	亚盛集团	131,865	1,231,619.10	0.12
175	000568	泸州老窖	59,534	1,214,493.60	0.12
176	600547	山东黄金	60,406	1,199,059.10	0.12
177	000960	锡业股份	68,357	1,189,411.80	0.12
178	000826	桑德环境	42,857	1,172,138.95	0.11
179	600827	百联股份	65,448	1,170,864.72	0.11
180	000792	盐湖股份	53,813	1,167,742.10	0.11
181	600875	东方电气	56,431	1,164,735.84	0.11
182	000060	中金岭南	122,460	1,162,145.40	0.11
183	600588	用友软件	49,459	1,161,791.91	0.11
184	300124	汇川技术	39,754	1,160,419.26	0.11
185	000598	兴蓉投资	151,742	1,159,308.88	0.11
186	600718	东软集团	73,108	1,155,837.48	0.11
187	600079	人福医药	44,893	1,151,505.45	0.11
188	002065	东华软件	64,020	1,146,598.20	0.11
189	002008	大族激光	71,778	1,146,294.66	0.11



190	000778	新兴铸管	185,387	1,145,691.66	0.11
191	000793	华闻传媒	100,644	1,137,277.20	0.11
192	601111	中国国航	144,664	1,134,165.76	0.11
193	600115	东方航空	216,317	1,120,522.06	0.11
194	600863	内蒙华电	245,701	1,120,396.56	0.11
195	000983	西山煤电	134,289	1,103,855.58	0.11
196	600008	首创股份	93,178	1,099,500.40	0.11
197	002236	大华股份	49,450	1,085,427.50	0.10
198	601898	中煤能源	154,942	1,072,198.64	0.10
199	000970	中科三环	72,235	1,068,355.65	0.10
200	002252	上海莱士	23,283	1,050,296.13	0.10
201	000800	一汽轿车	69,230	1,048,142.20	0.10
202	601808	中海油服	50,336	1,045,478.72	0.10
203	000400	许继电气	51,186	1,039,075.80	0.10
204	300058	蓝色光标	49,159	1,038,238.08	0.10
205	000825	太钢不锈	193,047	1,017,357.69	0.10
206	600316	洪都航空	36,360	1,016,989.20	0.10
207	600655	豫园商城	85,713	1,013,127.66	0.10
208	000917	电广传媒	59,921	1,011,466.48	0.10
209	601098	中南传媒	60,896	1,010,873.60	0.10
210	000630	铜陵有色	64,866	1,004,125.68	0.10
211	002456	欧菲光	52,579	996,897.84	0.10
212	603000	人民网	23,465	984,122.10	0.10
213	600497	驰宏锌锗	84,646	982,740.06	0.10
214	600170	上海建工	115,964	975,257.24	0.09
215	000559	万向钱潮	81,446	966,764.02	0.09
216	000963	华东医药	18,362	966,024.82	0.09
217	000898	*ST 鞍钢	156,805	964,350.75	0.09
218	600867	通化东宝	61,182	954,439.20	0.09
219	600068	葛洲坝	102,062	952,238.46	0.09
220	000729	燕京啤酒	118,675	948,213.25	0.09
221	600873	梅花生物	131,284	939,993.44	0.09
222	600549	厦门钨业	28,284	932,806.32	0.09
223	601992	金隅股份	91,918	932,048.52	0.09
224	300168	万达信息	20,100	928,620.00	0.09
225	002038	双鹭药业	23,254	920,858.40	0.09
226	600633	浙报传媒	50,419	917,121.61	0.09
227	002385	大北农	67,775	909,540.50	0.09
228	600597	光明乳业	51,680	902,332.80	0.09

229	600348	阳泉煤业	101,711	902,176.57	0.09
230	601699	潞安环能	78,150	901,851.00	0.09
231	600143	金发科技	130,508	899,200.12	0.09
232	600166	福田汽车	143,597	898,917.22	0.09
233	300017	网宿科技	18,617	897,339.40	0.09
234	000839	中信国安	79,553	892,584.66	0.09
235	601118	海南橡胶	99,869	870,857.68	0.08
236	601929	吉视传媒	75,034	861,390.32	0.08
237	000878	云南铜业	59,921	855,671.88	0.08
238	600516	方大炭素	87,429	854,181.33	0.08
239	002400	省广股份	39,269	850,959.23	0.08
240	600266	北京城建	35,791	846,815.06	0.08
241	002570	贝因美	52,262	846,121.78	0.08
242	600169	太原重工	96,960	845,491.20	0.08
243	002007	华兰生物	24,723	823,275.90	0.08
244	300251	光线传媒	34,421	813,712.44	0.08
245	600881	亚泰集团	108,401	809,755.47	0.08
246	600694	大商股份	16,760	803,306.80	0.08
247	600688	上海石化	185,484	803,145.72	0.08
248	000998	隆平高科	39,948	786,576.12	0.08
249	600157	永泰能源	179,877	784,263.72	0.08
250	600648	外高桥	23,853	772,121.61	0.07
251	601958	金钼股份	82,222	770,420.14	0.07
252	600398	海澜之家	75,920	766,792.00	0.07
253	002146	荣盛发展	48,147	764,092.89	0.07
254	600060	海信电器	66,224	756,940.32	0.07
255	600755	厦门国贸	66,902	755,992.60	0.07
256	000027	深圳能源	67,321	751,302.36	0.07
257	002344	海宁皮城	47,220	751,270.20	0.07
258	000999	华润三九	32,967	747,032.22	0.07
259	002129	中环股份	35,391	744,980.55	0.07
260	600410	华胜天成	36,554	744,604.98	0.07
261	600578	京能电力	117,373	741,797.36	0.07
262	600820	隧道股份	89,785	741,624.10	0.07
263	600879	航天电子	47,414	739,658.40	0.07
264	000876	新希望	52,737	738,318.00	0.07
265	601158	重庆水务	81,868	728,625.20	0.07
266	600664	哈药股份	83,800	727,384.00	0.07
267	000748	长城信息	18,617	724,201.30	0.07

268	600811	东方集团	76,017	722,161.50	0.07
269	002410	广联达	31,949	715,657.60	0.07
270	002051	中工国际	26,083	712,587.56	0.07
271	002470	金正大	26,482	712,365.80	0.07
272	002001	新和成	46,347	703,083.99	0.07
273	601928	凤凰传媒	65,020	699,615.20	0.07
274	600320	振华重工	95,312	698,636.96	0.07
275	000712	锦龙股份	25,598	696,265.60	0.07
276	600267	海正药业	41,208	695,591.04	0.07
277	002153	石基信息	10,563	692,932.80	0.07
278	600158	中体产业	38,590	683,428.90	0.07
279	601872	招商轮船	108,013	679,401.77	0.07
280	000012	南玻A	75,513	671,310.57	0.06
281	600188	兖州煤业	50,225	661,965.50	0.06
282	601258	庞大集团	110,534	657,677.30	0.06
283	600645	中源协和	16,096	652,048.96	0.06
284	600635	大众公用	75,338	642,633.14	0.06
285	600187	国中水务	83,580	641,058.60	0.06
286	600058	五矿发展	36,554	638,232.84	0.06
287	002310	东方园林	34,324	633,964.28	0.06
288	600277	亿利能源	70,878	632,231.76	0.06
289	600498	烽火通信	40,917	630,940.14	0.06
290	600528	中铁二局	41,596	626,019.80	0.06
291	600643	爱建股份	44,467	610,087.24	0.06
292	300015	爱尔眼科	21,913	603,703.15	0.06
293	000401	冀东水泥	46,099	602,513.93	0.06
294	600880	博瑞传播	55,267	594,120.25	0.06
295	600436	片仔癀	6,744	591,313.92	0.06
296	600499	科达洁能	31,997	590,664.62	0.06
297	600601	方正科技	126,119	590,236.92	0.06
298	600895	张江高科	44,311	590,222.52	0.06
299	002294	信立泰	16,615	589,001.75	0.06
300	600219	南山铝业	66,224	587,406.88	0.06
301	002475	立讯精密	21,138	585,099.84	0.06
302	000997	新大陆	20,750	583,905.00	0.06
303	600312	平高电气	39,248	582,440.32	0.06
304	300146	汤臣倍健	22,398	582,348.00	0.06
305	000937	冀中能源	69,036	575,760.24	0.06
306	600201	金宇集团	16,346	573,417.68	0.06

307	002375	亚厦股份	30,155	571,738.80	0.06
308	000528	柳工	45,106	567,433.48	0.05
309	600038	哈飞股份	15,029	565,390.98	0.05
310	600525	长园集团	49,159	564,836.91	0.05
311	600433	冠豪高新	47,511	560,629.80	0.05
312	601718	际华集团	88,213	560,152.55	0.05
313	002603	以岭药业	19,094	556,781.04	0.05
314	600967	北方创业	37,427	552,422.52	0.05
315	300133	华策影视	21,622	542,279.76	0.05
316	002405	四维图新	27,724	541,449.72	0.05
317	000511	银基发展	65,933	541,309.93	0.05
318	600373	中文传媒	40,336	537,275.52	0.05
319	600783	鲁信创投	19,107	534,804.93	0.05
320	600816	安信信托	18,145	533,100.10	0.05
321	601002	晋亿实业	27,343	530,727.63	0.05
322	600522	中天科技	34,442	530,062.38	0.05
323	600317	营口港	111,116	527,801.00	0.05
324	600037	歌华有线	36,360	526,856.40	0.05
325	002399	海普瑞	20,265	522,837.00	0.05
326	600737	中粮屯河	58,661	522,082.90	0.05
327	000661	长春高新	6,012	521,240.40	0.05
328	600435	北方导航	21,258	520,183.26	0.05
329	600376	首开股份	51,560	519,724.80	0.05
330	002266	浙富股份	60,794	513,709.30	0.05
331	600675	中华企业	74,853	513,491.58	0.05
332	600787	中储股份	53,245	513,281.80	0.05
333	600485	信威集团	11,830	512,830.50	0.05
334	300253	卫宁软件	7,273	508,891.81	0.05
335	600511	国药股份	16,387	507,833.13	0.05
336	600587	新华医疗	16,193	507,326.69	0.05
337	600765	中航重机	26,567	506,101.35	0.05
338	600809	山西汾酒	22,107	506,029.23	0.05
339	600395	盘江股份	42,433	505,801.36	0.05
340	603288	海天味业	12,605	503,569.75	0.05
341	002183	怡亚通	33,742	501,406.12	0.05
342	600611	大众交通	41,790	500,226.30	0.05
343	000758	中色股份	33,839	497,094.91	0.05
344	000656	金科股份	31,415	486,932.50	0.05
345	000939	凯迪电力	43,244	486,495.00	0.05

346	002250	联化科技	32,870	486,476.00	0.05
347	600023	浙能电力	66,806	478,999.02	0.05
348	002022	科华生物	22,560	478,272.00	0.05
349	600138	中青旅	28,976	476,944.96	0.05
350	600872	中炬高新	45,862	476,047.56	0.05
351	002358	森源电气	13,575	475,125.00	0.05
352	002292	奥飞动漫	15,902	469,109.00	0.05
353	600536	中国软件	14,060	462,574.00	0.04
354	600125	铁龙物流	51,971	460,463.06	0.04
355	600325	华发股份	37,233	459,455.22	0.04
356	000540	中天城投	38,978	459,160.84	0.04
357	600557	康缘药业	19,780	456,522.40	0.04
358	300273	和佳股份	19,683	455,661.45	0.04
359	600517	置信电气	42,566	452,902.24	0.04
360	600654	飞乐股份	43,147	450,023.21	0.04
361	600685	广船国际	12,513	445,713.06	0.04
362	000887	中鼎股份	31,997	441,558.60	0.04
363	002005	德豪润达	55,655	441,344.15	0.04
364	600805	悦达投资	38,978	440,451.40	0.04
365	000690	宝新能源	69,617	439,979.44	0.04
366	000031	中粮地产	51,971	439,674.66	0.04
367	002030	达安基因	21,816	437,847.12	0.04
368	000088	盐田港	44,311	437,792.68	0.04
369	002424	贵州百灵	10,571	433,939.55	0.04
370	600175	美都控股	83,773	431,430.95	0.04
371	000777	中核科技	15,223	431,419.82	0.04
372	000652	泰达股份	59,049	431,057.70	0.04
373	002092	中泰化学	55,558	430,574.50	0.04
374	002701	奥瑞金	20,936	428,559.92	0.04
375	600200	江苏吴中	35,682	427,827.18	0.04
376	601000	唐山港	46,444	427,749.24	0.04
377	002063	远光软件	21,235	425,761.75	0.04
378	000988	华工科技	35,619	425,290.86	0.04
379	002573	国电清新	15,320	424,057.60	0.04
380	600110	中科英华	66,224	417,873.44	0.04
381	601001	大同煤业	48,189	417,798.63	0.04
382	000415	渤海租赁	30,543	417,522.81	0.04
383	000536	华映科技	26,373	416,429.67	0.04
384	600426	华鲁恒升	38,043	416,190.42	0.04

385	600478	科力远	21,525	415,647.75	0.04
386	600259	广晟有色	7,466	414,960.28	0.04
387	002073	软控股份	33,949	411,122.39	0.04
388	002429	兆驰股份	53,910	409,716.00	0.04
389	002340	格林美	31,706	409,641.52	0.04
390	600017	日照港	87,943	408,934.95	0.04
391	600978	宜华木业	67,872	408,589.44	0.04
392	601666	平煤股份	67,581	407,513.43	0.04
393	600098	广州发展	46,512	407,445.12	0.04
394	000786	北新建材	16,114	407,361.92	0.04
395	000671	阳光城	29,254	405,752.98	0.04
396	300134	大富科技	10,957	405,737.71	0.04
397	600216	浙江医药	37,233	404,350.38	0.04
398	600151	航天机电	42,954	403,338.06	0.04
399	000869	张裕A	11,512	401,308.32	0.04
400	002271	东方雨虹	11,927	397,646.18	0.04
401	600062	华润双鹤	19,533	395,738.58	0.04
402	002440	闰土股份	22,054	395,207.68	0.04
403	600521	华海药业	27,149	394,746.46	0.04
404	000685	中山公用	17,720	393,915.60	0.04
405	000933	神火股份	65,642	393,195.58	0.04
406	600432	吉恩镍业	27,595	392,676.85	0.04
407	600747	大连控股	59,146	389,772.14	0.04
408	300202	聚龙股份	12,605	389,368.45	0.04
409	600770	综艺股份	44,893	388,773.38	0.04
410	600183	生益科技	48,613	387,931.74	0.04
411	600720	祁连山	35,343	387,712.71	0.04
412	601012	隆基股份	18,520	385,956.80	0.04
413	600422	昆明制药	15,514	385,057.48	0.04
414	600067	冠城大通	47,414	384,053.40	0.04
415	000543	皖能电力	29,864	383,453.76	0.04
416	000422	湖北宜化	51,098	382,724.02	0.04
417	000006	深振业A	54,201	382,117.05	0.04
418	000735	罗牛山	50,032	381,243.84	0.04
419	000848	承德露露	17,326	380,998.74	0.04
420	600161	天坛生物	14,738	380,387.78	0.04
421	600122	宏图高科	52,843	378,884.31	0.04
422	002428	云南锗业	26,083	378,464.33	0.04
423	000959	首钢股份	91,106	378,089.90	0.04

424	000975	银泰资源	24,725	378,045.25	0.04
425	002223	鱼跃医疗	15,126	377,544.96	0.04
426	600056	中国医药	22,980	377,101.80	0.04
427	002240	威华股份	16,774	375,569.86	0.04
428	000050	深天马 A	19,489	373,409.24	0.04
429	600064	南京高科	20,750	373,292.50	0.04
430	600284	浦东建设	31,492	365,937.04	0.04
431	002505	大康牧业	49,838	362,820.64	0.04
432	601717	郑煤机	47,317	361,028.71	0.03
433	002191	劲嘉股份	26,333	361,025.43	0.03
434	000877	天山股份	35,003	358,780.75	0.03
435	000550	江铃汽车	11,830	358,449.00	0.03
436	002106	莱宝高科	28,216	357,778.88	0.03
437	601216	内蒙君正	34,180	356,839.20	0.03
438	600545	新疆城建	31,221	355,607.19	0.03
439	600639	浦东金桥	14,932	355,232.28	0.03
440	000930	中粮生化	44,493	353,274.42	0.03
441	000563	陕国投 A	27,867	350,288.19	0.03
442	600572	康恩贝	23,131	349,046.79	0.03
443	000926	福星股份	32,385	348,462.60	0.03
444	002048	宁波华翔	24,118	346,575.66	0.03
445	000566	海南海药	22,704	345,554.88	0.03
446	600797	浙大网新	47,414	345,173.92	0.03
447	600651	飞乐音响	42,081	344,222.58	0.03
448	600835	上海机电	18,326	343,795.76	0.03
449	002368	太极股份	7,800	342,420.00	0.03
450	002422	科伦药业	11,704	342,107.92	0.03
451	300147	香雪制药	20,362	339,638.16	0.03
452	600270	外运发展	20,653	337,676.55	0.03
453	002219	独一味	17,647	336,175.35	0.03
454	000669	金鸿能源	11,442	335,822.70	0.03
455	600582	天地科技	27,541	335,724.79	0.03
456	600160	巨化股份	51,472	335,597.44	0.03
457	002004	华邦颖泰	19,295	335,347.10	0.03
458	600366	宁波韵升	20,653	333,545.95	0.03
459	000099	中信海直	24,240	333,300.00	0.03
460	000028	国药一致	6,982	333,250.86	0.03
461	600970	中材国际	24,822	332,863.02	0.03
462	600198	大唐电信	20,265	331,738.05	0.03

463	002299	圣农发展	26,180	331,177.00	0.03
464	601608	中信重工	46,929	329,910.87	0.03
465	600026	中海发展	36,166	329,110.60	0.03
466	600409	三友化工	53,261	328,620.37	0.03
467	000078	海王生物	33,548	327,763.96	0.03
468	002285	世联地产	21,719	326,653.76	0.03
469	600120	浙江东方	17,444	326,551.68	0.03
470	600596	新安股份	31,318	325,080.84	0.03
471	600673	东阳光科	21,894	324,906.96	0.03
472	601369	陕鼓动力	37,233	323,927.10	0.03
473	600171	上海贝岭	30,635	323,811.95	0.03
474	000667	名流置业	101,905	323,038.85	0.03
475	600546	山煤国际	56,625	321,063.75	0.03
476	000830	鲁西化工	59,243	319,912.20	0.03
477	600825	新华传媒	29,864	319,544.80	0.03
478	601311	骆驼股份	24,416	319,361.28	0.03
479	600220	江苏阳光	81,737	318,774.30	0.03
480	600748	上实发展	25,016	317,953.36	0.03
481	000488	晨鸣纸业	51,292	316,471.64	0.03
482	001696	宗申动力	39,404	314,049.88	0.03
483	002653	海思科	18,229	312,445.06	0.03
484	000718	苏宁环球	46,347	311,915.31	0.03
485	002122	天马股份	40,723	310,716.49	0.03
486	600086	东方金钰	12,120	310,150.80	0.03
487	000513	丽珠集团	6,264	309,692.16	0.03
488	600509	天富能源	31,318	309,108.66	0.03
489	603766	隆鑫通用	22,939	308,300.16	0.03
490	002179	中航光电	13,090	307,353.20	0.03
491	000726	鲁泰 A	25,614	307,111.86	0.03
492	600176	中国玻纤	19,838	306,893.86	0.03
493	000541	佛山照明	30,058	306,892.18	0.03
494	002309	中利科技	16,290	306,740.70	0.03
495	002013	中航精机	12,296	304,940.80	0.03
496	000829	天音控股	37,912	304,433.36	0.03
497	000090	深天健	22,010	303,738.00	0.03
498	000979	中弘股份	66,669	303,343.95	0.03
499	002273	水晶光电	17,647	301,763.70	0.03
500	002508	老板电器	9,212	300,311.20	0.03
501	002311	海大集团	24,434	300,049.52	0.03



502	000572	海马汽车	56,916	299,947.32	0.03
503	600392	盛和资源	10,763	298,673.25	0.03
504	002665	首航节能	7,563	295,940.19	0.03
505	000762	西藏矿业	22,024	294,901.36	0.03
506	600823	世茂股份	20,033	294,685.43	0.03
507	600416	湘电股份	24,434	294,185.36	0.03
508	600757	长江传媒	34,518	293,748.18	0.03
509	600851	海欣股份	33,742	293,217.98	0.03
510	600859	王府井	13,187	292,487.66	0.03
511	600812	华北制药	47,123	291,691.37	0.03
512	000816	江淮动力	48,267	290,084.67	0.03
513	600004	白云机场	26,403	288,584.79	0.03
514	000788	北大医药	20,556	287,372.88	0.03
515	000900	现代投资	40,917	287,237.34	0.03
516	600702	沱牌舍得	15,417	287,218.71	0.03
517	002277	友阿股份	22,730	287,079.90	0.03
518	600021	上海电力	36,748	287,001.88	0.03
519	600657	信达地产	35,100	286,416.00	0.03
520	000636	风华高科	32,288	286,071.68	0.03
521	002595	豪迈科技	11,524	285,795.20	0.03
522	600699	均胜电子	14,641	285,645.91	0.03
523	000732	泰禾集团	17,356	285,506.20	0.03
524	000697	炼石有色	16,037	282,732.31	0.03
525	300039	上海凯宝	22,204	281,546.72	0.03
526	600261	阳光照明	33,161	281,205.28	0.03
527	002317	众生药业	14,641	281,107.20	0.03
528	600039	四川路桥	51,292	280,054.32	0.03
529	002431	棕榈园林	13,187	278,377.57	0.03
530	000961	中南建设	20,288	277,945.60	0.03
531	600351	亚宝药业	31,803	277,640.19	0.03
532	002161	远望谷	34,203	277,044.30	0.03
533	600864	哈投股份	18,617	276,462.45	0.03
534	002414	高德红外	13,615	276,384.50	0.03
535	600141	兴发集团	18,117	276,103.08	0.03
536	000973	佛塑科技	44,602	275,640.36	0.03
537	600874	创业环保	24,919	275,354.95	0.03
538	601678	滨化股份	26,373	274,015.47	0.03
539	600884	杉杉股份	16,484	273,469.56	0.03
540	002690	美亚光电	7,660	272,696.00	0.03

541	601231	环旭电子	9,055	271,921.65	0.03
542	600006	东风汽车	45,571	271,147.45	0.03
543	300088	长信科技	17,453	269,997.91	0.03
544	600993	马应龙	13,286	269,440.08	0.03
545	300115	长盈精密	14,835	268,958.55	0.03
546	601225	陕西煤业	40,180	267,197.00	0.03
547	000969	安泰科技	29,282	267,051.84	0.03
548	002028	思源电气	21,281	264,948.45	0.03
549	601880	大连港	57,452	264,853.72	0.03
550	600790	轻纺城	32,191	264,288.11	0.03
551	002672	东江环保	7,563	262,738.62	0.03
552	002204	大连重工	21,913	262,736.87	0.03
553	000417	合肥百货	31,609	262,038.61	0.03
554	000650	仁和药业	33,839	261,237.08	0.03
555	600112	天成控股	23,271	261,100.62	0.03
556	002371	七星电子	9,987	260,660.70	0.03
557	002221	东华能源	15,805	260,624.45	0.03
558	600199	金种子酒	22,221	259,319.07	0.03
559	002064	华峰氨纶	24,194	258,875.80	0.03
560	000931	中关村	31,000	258,230.00	0.02
561	002041	登海种业	8,048	257,938.40	0.02
562	002181	粤传媒	16,774	257,648.64	0.02
563	002056	横店东磁	11,733	257,539.35	0.02
564	002444	巨星科技	22,980	257,376.00	0.02
565	600628	新世界	24,555	256,845.30	0.02
566	002588	史丹利	6,538	254,655.10	0.02
567	600289	亿阳信通	25,695	254,380.50	0.02
568	600073	上海梅林	27,052	253,747.76	0.02
569	600894	广日股份	19,683	252,926.55	0.02
570	600997	开滦股份	35,159	252,793.21	0.02
571	600380	健康元	35,100	252,369.00	0.02
572	002237	恒邦股份	15,417	249,909.57	0.02
573	002325	洪涛股份	22,980	249,333.00	0.02
574	600971	恒源煤电	28,507	248,866.11	0.02
575	002244	滨江集团	30,834	247,905.36	0.02
576	002052	同洲电子	27,149	247,598.88	0.02
577	600059	古越龙山	27,634	247,047.96	0.02
578	600460	士兰微	43,050	245,815.50	0.02
579	000850	华茂股份	31,997	245,416.99	0.02

580	600300	维维股份	48,092	245,269.20	0.02
581	603699	纽威股份	12,605	245,041.20	0.02
582	600251	冠农股份	13,411	244,884.86	0.02
583	000596	古井贡酒	6,619	244,572.05	0.02
584	000860	顺鑫农业	13,090	244,521.20	0.02
585	002269	美邦服饰	23,174	244,485.70	0.02
586	000587	金叶珠宝	22,107	244,061.28	0.02
587	002251	步步高	17,162	240,439.62	0.02
588	000021	长城开发	33,451	240,178.18	0.02
589	000919	金陵药业	17,507	238,095.20	0.02
590	601101	昊华能源	27,634	237,652.40	0.02
591	002203	海亮股份	26,908	237,059.48	0.02
592	600826	兰生股份	12,091	236,862.69	0.02
593	002011	盾安环境	24,046	235,169.88	0.02
594	600481	双良节能	23,174	233,825.66	0.02
595	002029	七匹狼	26,214	233,566.74	0.02
596	002390	信邦制药	11,539	233,318.58	0.02
597	600586	金晶科技	57,304	233,227.28	0.02
598	002477	雏鹰农牧	26,567	232,726.92	0.02
599	600740	山西焦化	34,615	232,612.80	0.02
600	600612	老凤祥	7,175	231,967.75	0.02
601	600482	风帆股份	18,229	231,690.59	0.02
602	002140	东华科技	12,855	231,261.45	0.02
603	002254	泰和新材	20,168	230,721.92	0.02
604	600729	重庆百货	9,212	230,207.88	0.02
605	600387	海越股份	17,919	229,184.01	0.02
606	002463	沪电股份	47,818	229,048.22	0.02
607	600292	中电远达	10,231	227,946.68	0.02
608	600239	云南城投	33,258	227,817.30	0.02
609	600885	宏发股份	12,191	227,727.88	0.02
610	000809	铁岭新城	22,010	225,822.60	0.02
611	600132	重庆啤酒	13,866	224,351.88	0.02
612	002276	万马电缆	27,240	224,185.20	0.02
613	600563	法拉电子	7,757	223,556.74	0.02
614	002332	仙琚制药	20,362	221,945.80	0.02
615	600496	精工钢构	23,271	220,841.79	0.02
616	000886	海南高速	45,087	220,475.43	0.02
617	600438	通威股份	23,509	218,633.70	0.02
618	002646	青青稞酒	10,181	218,382.45	0.02

619	601886	江河创建	26,276	218,090.80	0.02
620	000066	长城电脑	37,729	216,187.17	0.02
621	600425	青松建化	31,277	215,498.53	0.02
622	600337	美克家居	22,301	212,751.54	0.02
623	002025	航天电器	11,233	212,303.70	0.02
624	002551	尚荣医疗	10,375	211,857.50	0.02
625	002480	新筑股份	18,658	210,835.40	0.02
626	002408	齐翔腾达	12,896	210,720.64	0.02
627	000049	德赛电池	6,982	210,297.84	0.02
628	600456	宝钛股份	12,217	209,888.06	0.02
629	600298	安琪酵母	11,345	209,428.70	0.02
630	600636	三爱富	15,417	209,054.52	0.02
631	600736	苏州高新	36,166	208,677.82	0.02
632	002233	塔牌集团	20,460	208,078.20	0.02
633	600750	江中药业	10,181	206,165.25	0.02
634	600260	凯乐科技	23,853	206,089.92	0.02
635	600773	西藏城投	16,924	204,949.64	0.02
636	600831	广电网络	22,301	203,608.13	0.02
637	000951	中国重汽	9,696	200,513.28	0.02
638	002345	潮宏基	23,853	200,365.20	0.02
639	000823	超声电子	18,326	200,119.92	0.02
640	000620	新华联	26,955	198,658.35	0.02
641	002342	巨力索具	32,482	198,140.20	0.02
642	600850	华东电脑	5,527	196,982.28	0.02
643	002242	九阳股份	17,650	195,385.50	0.02
644	600488	天药股份	33,064	195,077.60	0.02
645	002069	獐子岛	16,387	195,005.30	0.02
646	000852	江钻股份	9,309	193,999.56	0.02
647	600640	号百控股	12,411	191,625.84	0.02
648	000510	金路集团	34,906	191,284.88	0.02
649	600335	国机汽车	10,666	191,241.38	0.02
650	000555	神州信息	4,945	190,382.50	0.02
651	002384	东山精密	17,356	189,874.64	0.02
652	600329	中新药业	12,314	187,911.64	0.02
653	600180	瑞茂通	15,223	187,547.36	0.02
654	600537	亿晶光电	13,672	187,443.12	0.02
655	002275	桂林三金	10,181	186,821.35	0.02
656	600401	海润光伏	26,893	185,830.63	0.02
657	600551	时代出版	11,442	185,474.82	0.02

658	000030	富奥股份	21,913	185,164.85	0.02
659	002727	一心堂	4,461	183,391.71	0.02
660	002489	浙江永强	13,478	183,166.02	0.02
661	600830	香溢融通	17,938	183,146.98	0.02
662	002392	北京利尔	13,575	182,448.00	0.02
663	002714	牧原股份	4,137	182,028.00	0.02
664	002416	爱施德	16,678	181,123.08	0.02
665	000927	一汽夏利	27,343	180,737.23	0.02
666	002216	三全食品	9,309	180,687.69	0.02
667	002315	焦点科技	3,297	180,675.60	0.02
668	600614	鼎立股份	13,575	180,547.50	0.02
669	000525	红太阳	11,345	180,045.15	0.02
670	600439	瑞贝卡	37,556	179,517.68	0.02
671	600780	通宝能源	26,470	178,407.80	0.02
672	000962	东方钨业	15,320	178,324.80	0.02
673	600429	三元股份	20,168	178,083.44	0.02
674	002091	江苏国泰	12,307	178,082.29	0.02
675	002083	孚日股份	35,893	176,952.49	0.02
676	000703	恒逸石化	19,489	175,985.67	0.02
677	002503	搜于特	8,921	175,922.12	0.02
678	600776	东方通信	21,622	175,786.86	0.02
679	603993	洛阳钼业	20,063	175,551.25	0.02
680	000062	深圳华强	11,539	175,046.63	0.02
681	601801	皖新传媒	10,472	174,044.64	0.02
682	002128	露天煤业	18,617	173,696.61	0.02
683	601233	桐昆股份	16,290	172,674.00	0.02
684	002281	光迅科技	4,644	172,571.04	0.02
685	000921	海信科龙	20,653	172,452.55	0.02
686	000519	江南红箭	12,702	169,190.64	0.02
687	603077	和邦股份	17,356	168,353.20	0.02
688	600088	中视传媒	9,503	168,108.07	0.02
689	601908	京运通	14,932	167,985.00	0.02
690	002393	力生制药	5,236	167,709.08	0.02
691	002698	博实股份	6,788	166,306.00	0.02
692	002249	大洋电机	14,447	165,562.62	0.02
693	000418	小天鹅 A	12,601	164,821.08	0.02
694	002648	卫星石化	13,575	164,257.50	0.02
695	600616	金枫酒业	17,453	163,709.14	0.02
696	603005	晶方科技	3,879	163,305.90	0.02

697	601126	四方股份	9,417	162,914.10	0.02
698	002293	罗莱家纺	6,303	162,365.28	0.02
699	002078	太阳纸业	39,948	162,188.88	0.02
700	000861	海印股份	20,168	161,949.04	0.02
701	600507	方大特钢	30,486	161,575.80	0.02
702	600467	好当家	25,404	161,569.44	0.02
703	603369	今世缘	5,624	156,740.88	0.02
704	601777	力帆股份	17,453	154,633.58	0.01
705	600195	中牧股份	9,696	153,681.60	0.01
706	600078	澄星股份	22,495	153,640.85	0.01
707	600197	伊力特	12,411	152,407.08	0.01
708	002574	明牌珠宝	14,835	151,910.40	0.01
709	000693	S*ST 聚友	6,268	151,748.28	0.01
710	000156	华数传媒	6,100	151,280.00	0.01
711	603366	日出东方	9,309	151,085.07	0.01
712	002093	国脉科技	24,725	150,328.00	0.01
713	002479	富春环保	16,484	149,674.72	0.01
714	600389	江山股份	5,624	149,485.92	0.01
715	002461	珠江啤酒	11,636	149,057.16	0.01
716	601208	东材科技	17,356	148,393.80	0.01
717	002174	梅花伞	3,011	145,461.41	0.01
718	600162	香江控股	22,362	144,458.52	0.01
719	002678	珠江钢琴	10,860	143,460.60	0.01
720	002557	洽洽食品	7,563	143,016.33	0.01
721	600280	中央商场	9,918	142,819.20	0.01
722	000688	建新矿业	19,683	142,308.09	0.01
723	600743	华远地产	30,640	141,556.80	0.01
724	002226	江南化工	11,248	141,499.84	0.01
725	000780	平庄能源	22,831	139,954.03	0.01
726	601515	东风股份	12,508	139,839.44	0.01
727	600510	黑牡丹	18,132	139,797.72	0.01
728	600468	百利电气	10,472	139,068.16	0.01
729	002194	武汉凡谷	12,862	137,623.40	0.01
730	600803	威远生化	11,248	137,113.12	0.01
731	002267	陕天然气	12,605	136,260.05	0.01
732	601965	中国汽研	11,054	135,300.96	0.01
733	002327	富安娜	9,793	131,226.20	0.01
734	601999	出版传媒	12,508	131,208.92	0.01
735	601010	文峰股份	12,948	130,127.40	0.01

736	603328	依顿电子	5,527	128,723.83	0.01
737	600184	光电股份	3,587	128,558.08	0.01
738	600618	氯碱化工	12,799	127,350.05	0.01
739	601566	九牧王	9,814	126,600.60	0.01
740	002430	杭氧股份	14,254	124,865.04	0.01
741	603001	奥康国际	6,982	124,698.52	0.01
742	002225	濮耐股份	18,035	124,621.85	0.01
743	000552	靖远煤电	12,314	124,371.40	0.01
744	600397	安源煤业	22,980	124,092.00	0.01
745	002419	天虹商场	9,018	122,554.62	0.01
746	603555	贵人鸟	7,079	118,644.04	0.01
747	600333	长春燃气	15,126	116,318.94	0.01
748	600801	华新水泥	10,898	115,409.82	0.01
749	601388	怡球资源	12,314	114,520.20	0.01
750	000631	顺发恒业	18,035	113,440.15	0.01
751	002490	山东墨龙	12,702	109,618.26	0.01
752	002635	安洁科技	3,976	107,232.72	0.01
753	002320	海峡股份	9,585	103,805.55	0.01
754	002662	京威股份	8,554	103,503.40	0.01
755	002498	汉缆股份	12,314	100,605.38	0.01
756	600869	智慧能源	11,345	100,062.90	0.01
757	002238	天威视讯	6,691	93,807.82	0.01
758	601011	宝泰隆	9,018	89,458.56	0.01
759	600754	锦江股份	3,472	86,765.28	0.01
760	002612	朗姿股份	3,319	76,337.00	0.01
761	002705	新宝股份	5,042	74,319.08	0.01
762	000603	盛达矿业	5,624	68,950.24	0.01

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

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	300315	掌趣科技	342,387	6,703,937.46	0.65
2	000043	中航地产	500,383	4,473,424.02	0.43
3	600533	栖霞建设	869,836	4,349,180.00	0.42
4	000627	天茂集团	528,100	2,165,210.00	0.21
5	002152	广电运通	94,875	2,101,481.25	0.20
6	002354	科冕木业	18,586	976,694.30	0.09
7	300051	三五互联	32,240	327,880.80	0.03

8	000906	物产中拓	6,934	110,944.00	0.01
---	--------	------	-------	------------	------

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	118,074,053.69	6.44
2	600998	九州通	106,010,578.09	5.78
3	600030	中信证券	105,895,559.98	5.78
4	601318	中国平安	86,820,711.13	4.74
5	000001	平安银行	68,655,090.73	3.74
6	601601	中国太保	59,857,596.24	3.27
7	600887	伊利股份	59,106,145.67	3.22
8	601328	交通银行	55,479,694.23	3.03
9	000333	美的集团	55,124,431.37	3.01
10	600196	复星医药	52,473,301.18	2.86
11	000538	云南白药	50,750,685.03	2.77
12	601009	南京银行	46,444,199.17	2.53
13	601299	中国北车	44,776,210.83	2.44
14	000895	双汇发展	44,346,254.64	2.42
15	000625	长安汽车	44,106,833.23	2.41
16	000651	格力电器	43,892,041.95	2.39
17	601800	中国交建	43,223,959.06	2.36
18	600016	民生银行	43,040,613.83	2.35
19	600549	厦门钨业	42,346,663.33	2.31
20	600372	中航电子	41,689,473.45	2.27
21	000848	承德露露	39,028,573.71	2.13
22	000063	中兴通讯	38,467,597.91	2.10
23	600352	浙江龙盛	38,038,339.11	2.07
24	600660	福耀玻璃	37,616,550.12	2.05

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	196,819,953.25	10.74



2	600030	中信证券	144,445,345.07	7.88
3	601318	中国平安	125,484,109.40	6.84
4	000001	平安银行	83,384,978.74	4.55
5	601601	中国太保	78,371,295.08	4.27
6	000333	美的集团	72,322,195.71	3.95
7	600887	伊利股份	68,791,353.60	3.75
8	601398	工商银行	68,523,368.86	3.74
9	601800	中国交建	63,683,822.08	3.47
10	600016	民生银行	63,466,825.12	3.46
11	600036	招商银行	62,216,730.41	3.39
12	000002	万科A	60,283,282.62	3.29
13	000651	格力电器	58,715,991.85	3.20
14	601009	南京银行	56,700,141.65	3.09
15	601328	交通银行	55,195,983.44	3.01
16	000538	云南白药	52,822,699.98	2.88
17	600549	厦门钨业	52,771,353.49	2.88
18	601299	中国北车	51,183,221.00	2.79
19	600372	中航电子	50,213,134.49	2.74
20	600196	复星医药	49,828,161.64	2.72
21	000625	长安汽车	49,787,050.68	2.72
22	000063	中兴通讯	47,427,258.29	2.59
23	000895	双汇发展	46,770,454.91	2.55
24	600104	上汽集团	44,713,056.51	2.44
25	000848	承德露露	43,285,500.69	2.36
26	600660	福耀玻璃	43,088,725.87	2.35
27	600352	浙江龙盛	42,487,382.20	2.32
28	002500	山西证券	41,684,647.11	2.27
29	600000	浦发银行	39,506,102.36	2.15
30	600028	中国石化	36,880,883.70	2.01

#### 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	6,477,630,368.21
卖出股票收入（成交）总额	7,725,701,206.46

#### 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所有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

1、本基金跟踪复制标的指数中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股海通证券。

中国证监会 2014 年 5 月 29 日发布的《中国证监会对新股发行承销违规机构和个人采取监管措施》显示，海通证券因向禁止配售的配售对象配售股票、向投资者提供超出招股书范围的发行人信息等事项受到中国证监会“出具警示函”、“监管谈话”的监管措施。本基金认为：该监管措施对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

2、本基金跟踪复制标的指数中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股中国平安。

根据 2014 年 12 月 8 日中国证券监督管理委员会发布对中国平安控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》，决定对平安证券给予警告，没收保荐业务收入 400 万元，没收承销股票违法所得 2867 万元，并处以 440 万元罚款。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

除上述情况外，本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的股票。

## 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	1,213,680.45
2	应收证券清算款	28,577,360.35
3	应收股利	-
4	应收利息	18,930.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,809,970.93

## 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

### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

### 8.12.5.2 期末积极投资前五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	300315	掌趣科技	6,703,937.46	0.65	重大事项停牌
2	000627	天茂集团	2,165,210.00	0.21	重大事项停牌

3	002152	广电运通	2,101,481.25	0.20	重大事项停牌
---	--------	------	--------------	------	--------

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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

份额级别	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
长盛同庆 800A	5,922	46,960.42	175,834,560.00	63.23%	102,265,030.00	36.77%
长盛同庆 800B	7,998	52,156.71	113,420,382.00	27.19%	303,729,004.00	72.81%
长盛同庆 中证 800 分级	13,010	12,036.24	73,979,880.55	47.24%	82,611,574.01	52.76%
合计	26,930	31,631.65	363,234,822.55	42.64%	488,605,608.01	57.36%

注：1、对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

2、以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

长盛同庆 800A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中油财务有限责任公司	75,242,652.00	27.06%
2	上海真爱梦想公益基金会	42,456,560.00	15.27%
3	中银保险有限公司—传统保险产品	22,905,427.00	8.24%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	14,180,475.00	5.10%
5	魏小艳	10,392,197.00	3.74%
6	工银安盛人寿保险有限公司	8,489,804.00	3.05%
7	中国对外经济贸易信托有限公司—光大稳健 1 号信托计划	3,933,922.00	1.41%

8	信泰人寿保险股份有限公司一分红保险产品	3,050,523.00	1.10%
9	中国对外经济贸易信托有限公司-资产配置固定收益信托	2,809,944.00	1.01%
10	广发证券股份有限公司	2,594,456.00	0.93%

## 长盛同庆 800B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	信诚人寿保险有限公司一分红一个险分红	63,097,700.00	15.13%
2	魏小艳	15,588,296.00	3.74%
3	中信证券股份有限公司	13,441,705.00	3.22%
4	程冰	12,900,000.00	3.09%
5	上海盛筑投资咨询有限公司	12,500,000.00	3.00%
6	中国对外经济贸易信托有限公司-光大稳健 1 号信托计划	5,900,882.00	1.41%
7	北京千石创富-光大银行-千石资本-一道冲套利 2 号资产管理计	5,892,500.00	1.41%
8	中船重工财务有限责任公司	5,732,083.00	1.37%
9	高阿玉	5,353,652.00	1.28%
10	信泰人寿保险股份有限公司一分红保险产品	4,575,785.00	1.10%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长盛同庆 800A	-	-
	长盛同庆 800B	-	-
	长盛同庆中证 800 分级	-	-
	合计	-	-

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	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	长盛同庆 800A	0
	长盛同庆 800B	0
	长盛同庆中证 800 分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛同庆 800A	0

	长盛同庆 800B	0
	长盛同庆中证 800 分级	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛同庆 800A	长盛同庆 800B	长盛同庆中证 800 分级
基金合同生效日（2012 年 5 月 12 日）基金份额总额	-	-	14,686,733,239.06
本报告期期初基金份额总额	565,266,514.00	847,899,772.00	585,058,105.67
本报告期基金总申购份额	-	-	2,223,650,866.13
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	3,451,807,387.93
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-287,166,924.00	-430,750,386.00	799,689,870.69
本报告期期末基金份额总额	278,099,590.00	417,149,386.00	156,591,454.56

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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。

#### 11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。本基金托管人 2014 年 11 月 03 日发布公告，聘任赵观甫为中国建设银行投资托管

业务部总经理。

### 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，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 110,000.00 元，已连续提供审计服务 6 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	
国泰君安	1	4,151,907,947.33	29.23%	3,779,883.96	29.24%	-
东北证券	1	3,421,400,088.54	24.09%	3,114,847.49	24.09%	-
申银万国	1	2,479,578,794.97	17.46%	2,255,824.22	17.45%	-
中信证券	1	1,363,921,499.86	9.60%	1,241,345.99	9.60%	-
国信证券	1	1,036,678,829.12	7.30%	943,795.09	7.30%	-
光大证券	1	581,906,437.45	4.10%	529,768.83	4.10%	-
中航证券	1	557,200,763.58	3.92%	507,276.37	3.92%	-
招商证券	1	434,058,391.10	3.06%	395,167.66	3.06%	-
东兴证券	1	176,678,822.72	1.24%	160,845.75	1.24%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

国元证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	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
国泰君安	6,812,835.10	86.21%	-	-	-	-
东北证券	10,400.00	0.13%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	1,066,380.50	13.49%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	12,844.00	0.16%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

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) 资质雄厚，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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	民生证券	上海	1
2	红塔证券	上海	1

## 11.8 其他重大事件

注：除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事件如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加同花顺为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及本公司网站	2014年1月20日
2	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中信建投证券开通转换业务的公告	同上	2014年2月12日
3	长盛基金管理有限公司关于在兴业银行开通旗下部分基金转换业	同上	2014年2月24日

	务的公告		
4	长盛基金管理有限公司关于增加恒天明泽为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2014 年 3 月 24 日
5	长盛基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	同上	2014 年 4 月 16 日
6	长盛基金管理有限公司关于董事长变更的公告	同上	2014 年 4 月 16 日
7	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告	同上	2014 年 5 月 14 日
8	关于中证 800 指数分级基金办理定期份额折算业务期间暂停申赎及定投业务的公告	同上	2014 年 5 月 16 日
9	关于长盛同庆 800A、同庆 800B 定期份额折算后次日前收盘价调整的提示公告	同上	2014 年 5 月 16 日
10	同庆中证 800 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	同上	2014 年 5 月 16 日
11	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间同庆 800A 份额停复牌的公告	同上	2014 年 5 月 22 日
12	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之同庆 800A 份额约定年收益率变更的公告	同上	2014 年 5 月 22 日
13	关于长盛同庆 800A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	同上	2014 年 5 月 23 日
14	关于长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及同庆 800A 份额恢复交易的公告	同上	2014 年 5 月 23 日
15	关于增加上海证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购费率优惠活动的公告	同上	2014 年 6 月 16 日
16	关于增加万银财富为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2014 年 7 月 9 日
17	增加中山证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购费率优惠及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	同上	2014 年 7 月 31 日
18	关于增加联讯证券为旗下部分开	同上	2014 年 10 月 13 日

	放式基金代销机构的公告		
19	关于增加广州证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购费率优惠活动的公告	同上	2014 年 10 月 13 日
20	长盛基金管理有限公司关于公司从业人员在子公司兼职情况的公告	同上	2014 年 10 月 14 日
21	关于增加长量基金为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2014 年 10 月 16 日
22	长盛基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	同上	2014 年 10 月 29 日
23	关于旗下部分开放式基金在部分代销机构开通转换业务的公告	同上	2014 年 11 月 11 日
24	关于增加旗下部分开放式基金代销机构并推出部分代销机构申购费率优惠活动的公告	同上	2014 年 12 月 17 日
25	关于旗下部分开放式基金参加数米基金申购费率优惠活动的公告	同上	2014 年 12 月 25 日
26	关于增加一路财富为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2014 年 12 月 29 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会关于核准长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复。

2、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》；

3、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金托管协议》；

4、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》；

5、法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所和/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司  
2015年3月28日