

长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)  
(原同盛证券投资基金转型)  
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。

根据 2014 年 9 月 28 日收到的中国证监会基金监管部《关于准予同盛证券投资基金变更注册的批复》（证监许可 [2014] 998 号），自 2014 年 11 月 5 日起《同盛证券投资基金基金合同》失效且《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。同盛证券投资基金转型为契约型开放式，其投资目标、理念、范围和策略调整，同时更名为“长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。

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，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2014 年 11 月 5 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。（注：同盛证券投资基金报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 2014 年 11 月 4 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>6</b>
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现（转型前）.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	11
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>14</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
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.....	20
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>20</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
<b>§6 审计报告(转型前)</b> .....	<b>21</b>
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
<b>§6 审计报告（转型后）</b> .....	<b>22</b>
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
<b>§7 年度财务报表(转型前)</b> .....	<b>23</b>
7.1 资产负债表(转型前).....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
<b>§7 年度财务报表(转型后)</b> .....	<b>49</b>

7.1 资产负债表（转型后） .....	49
7.2 利润表 .....	50
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	51
7.4 报表附注 .....	52
<b>§8 投资组合报告(转型前) .....</b>	<b>73</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	73
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	73
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 .....	74
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	78
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 .....	78
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 .....	79
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 .....	79
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 .....	79
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	79
8.12 投资组合报告附注 .....	79
<b>§8 投资组合报告(转型后) .....</b>	<b>80</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	80
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	81
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 .....	81
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	83
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	85
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 .....	85
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 .....	85
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 .....	85
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 .....	85
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	85
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	85
8.12 投资组合报告附注 .....	86
<b>§9 基金份额持有人信息(转型前) .....</b>	<b>86</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	86
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	87
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	87
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 .....	87
<b>§9 基金份额持有人信息(转型后) .....</b>	<b>88</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	88
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	88
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	88
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 .....	88
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>89</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>89</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	89
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 .....	89
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	90

11.4 基金投资策略的改变.....	90
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	91
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.....	91
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后).....	91
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前).....	93
11.8 其他重大事件 (转型后) .....	95
11.8 其他重大事件 (转型前) .....	96
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>97</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>97</b>
13.1 备查文件目录.....	97
13.2 存放地点.....	97
13.3 查阅方式.....	97

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	同盛证券投资基金
基金简称	长盛同盛封闭
场内简称	基金同盛
基金主代码	184699
交易代码	184699
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999 年 11 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	3,000,000,000.00 份
基金合同存续期	15 年（1999 年 11 月 5 日至 2014 年 11 月 4 日，于 2014 年 11 月 5 日转型为长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF））
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1999-11-26

注：上表中“报告期末”为基金转型前最后一日，即 2014 年 11 月 4 日。

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	长盛同盛成长优选混合
场内简称	长盛同盛
基金主代码	160813
交易代码	160813
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 11 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	3,791,930,155.16 份
基金合同存续期（若有）	不定期
基金份额上市的证券交易所（若有）	深圳证券交易所
上市日期（若有）	2014-12-26

注：上表中“报告期末”为 2014 年 12 月 31 日。

### 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金属于成长价值复合型基金，主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和市场价值被低估的价值型上市公司，利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好的分散和控制风险，实现基金资产的稳定增长。
------	--

投资策略	本基金将根据市场发展情况，确定在一段时间内市场发展的总体趋势，并在此基础上确定股票和国债的配置比例以及股票投资中成长型投资和价值型投资的配置比例。并分别选取成长型特征最明显的股票和价值型特征最明显的股票进行组合投资。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

## 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	聚焦经济转型、产业升级、模式创新、政策热点等板块，通过“自上而下优选行业”和“自下而上精选个股”相结合，重点布局未来增长预期高、成长确定性大的上市公司，为投资者实现资产长期增值。
投资策略	<p>本基金将首先参考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围，通过深入分析上述指标与因素，动态调整基金资产在股票、股指期货、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>股票投资上，本基金将充分发挥基金管理人研究和投资的团队能力，以深入扎实的研究为基础，聚焦经济转型、产业升级、模式创新、政策热点等板块，将“自上而下优选行业”与“自下而上精选个股”相结合，将定性分析与定量分析相结合，寻找和布局未来增长预期良好、估值合理的上市公司，并审慎选择投资时机和介入时点，为投资者实现资产长期增值。</p> <p>债券投资上，本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>股指期货投资上，本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。</p>
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

注：2014 年 10 月 10 日至 2014 年 10 月 30 日，同盛证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议了《关于同盛证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括同盛证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市，调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。上述议案经基金份额持有人大会表决通过，并形成了基金份额持有人大会决议，

自表决通过之日（即 2014 年 10 月 31 日）生效。依据基金份额持有人大会决议，基金管理人向深圳证券交易所申请基金终止上市，自基金终止上市之日起，原《同盛证券投资基金基金合同》失效，《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为不定期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。

## 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
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100088	100818
法定代表人		高新	田国立

## 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	基金管理人的办公地址及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
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 1 月 1 日-2014 年 12 月 31 日		2013 年	2012 年
	转型前（2014 年 1 月 1 日- 2014 年 11 月 4 日）	转型后（2014 年 11 月 5 日（基金合同生效日）起至		



		12 月 31 日)		
本期已实现收益	129,669,118.96	490,726,501.13	236,078,643.26	-228,617,863.62
本期利润	353,702,186.81	562,561,191.32	244,487,877.51	103,710,545.07
加权平均基金份额 本期利润	0.1179	0.1546	0.0815	0.0346
本期加权平均净值 利润率	10.83%	14.11%	7.51%	3.32%
本期基金份额净值 增长率	11.06%	15.11%	7.87%	3.41%
<b>3.1.2 期末数据和 指标</b>	报告期末(2014 年 11 月 4 日)	报告期末(2014 年 12 月 31 日 )	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	19,596,529.50	478,205,433.68	126,927,410.54	-109,151,232.72
期末可供分配基金 份额利润	0.0065	0.1261	0.0423	-0.0364
期末基金资产净值	3,467,153,706.99	4,042,163,060.04	3,350,451,520.18	3,105,963,642.67
期末基金份额净值	1.1557	1.066	1.1168	1.0353
<b>3.1.3 累计期末指 标</b>	报告期末(2014 年 11 月 4 日)	报告期末(2014 年 12 月 31 日 )	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值 增长率	350.63%	15.11%	305.75%	276.14%

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。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

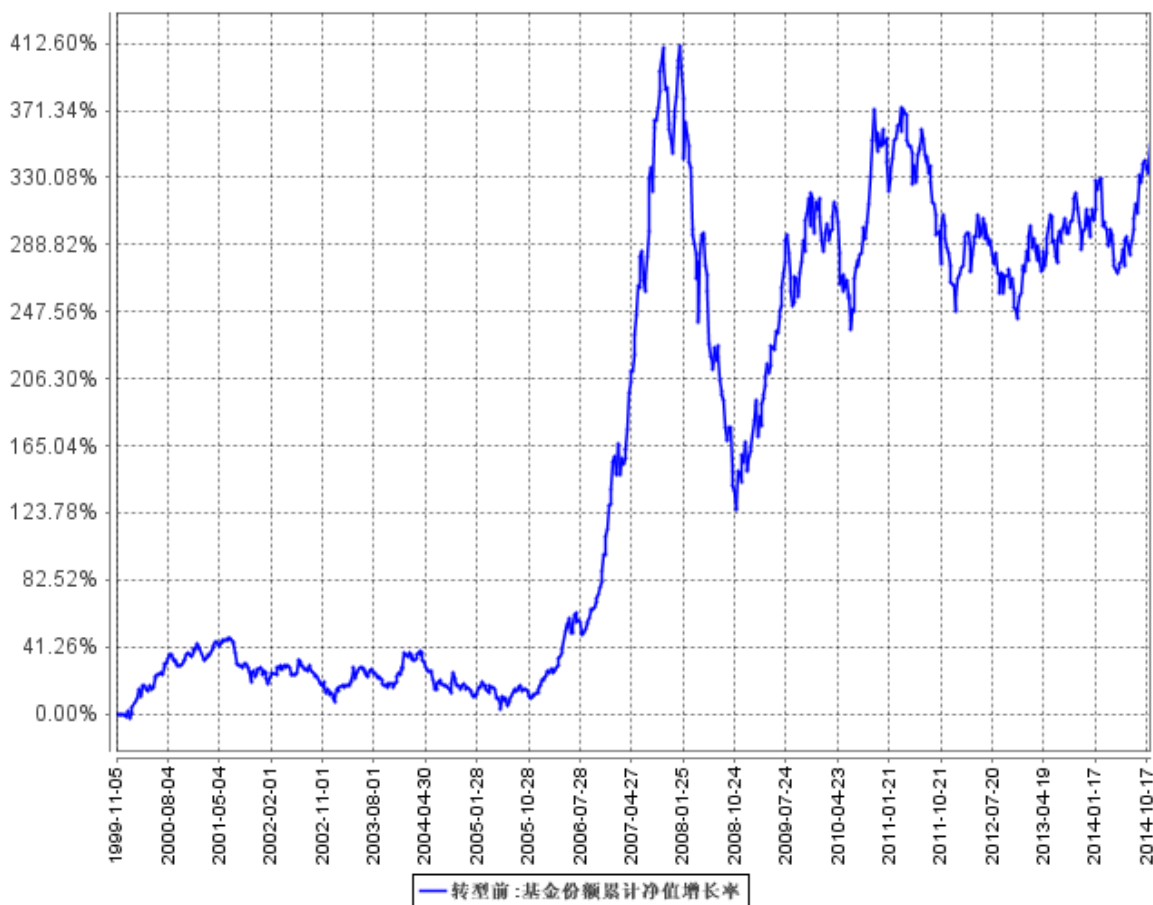
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②
过去三个月	13.37%	0.84%
过去六个月	19.82%	0.83%
过去一年	14.13%	0.92%
过去三年	10.73%	0.98%
过去五年	12.17%	1.07%
自基金合同生效起至今	350.63%	1.39%

注：本基金未规定业绩比较基准，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

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

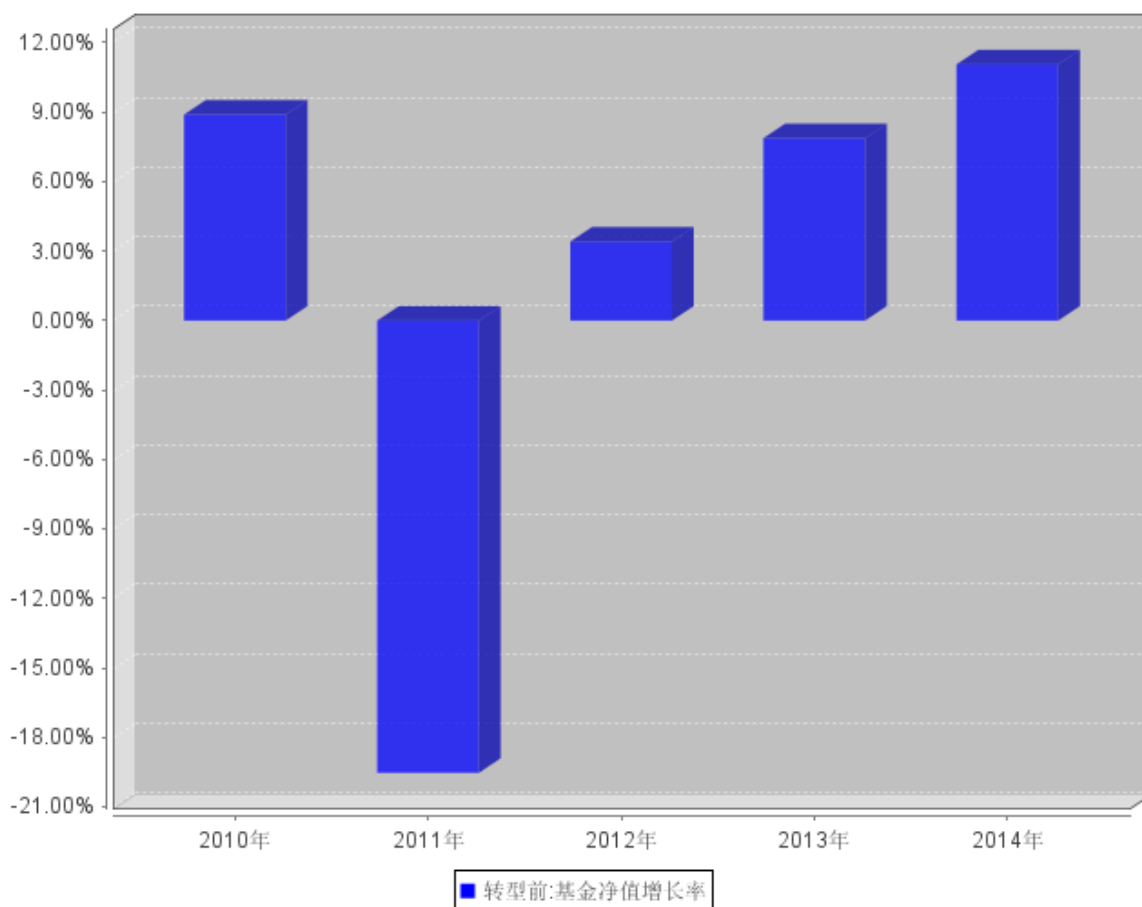
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金未规定业绩比较基准，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。同盛证券投资基金存续期为 1999 年 11 月 5 日至 2014 年 11 月 4 日。

### 3.2.3 过去五年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：本基金未规定业绩比较基准，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。同盛证券投资基金存续期为 1999 年 11 月 5 日至 2014 年 11 月 4 日。

## 3.2 基金净值表现（转型后）

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

转型后						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金转型日起至今	15.11%	1.84%	19.26%	0.93%	-4.15%	0.91%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

基准指数的构建考虑了三个原则：

1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩

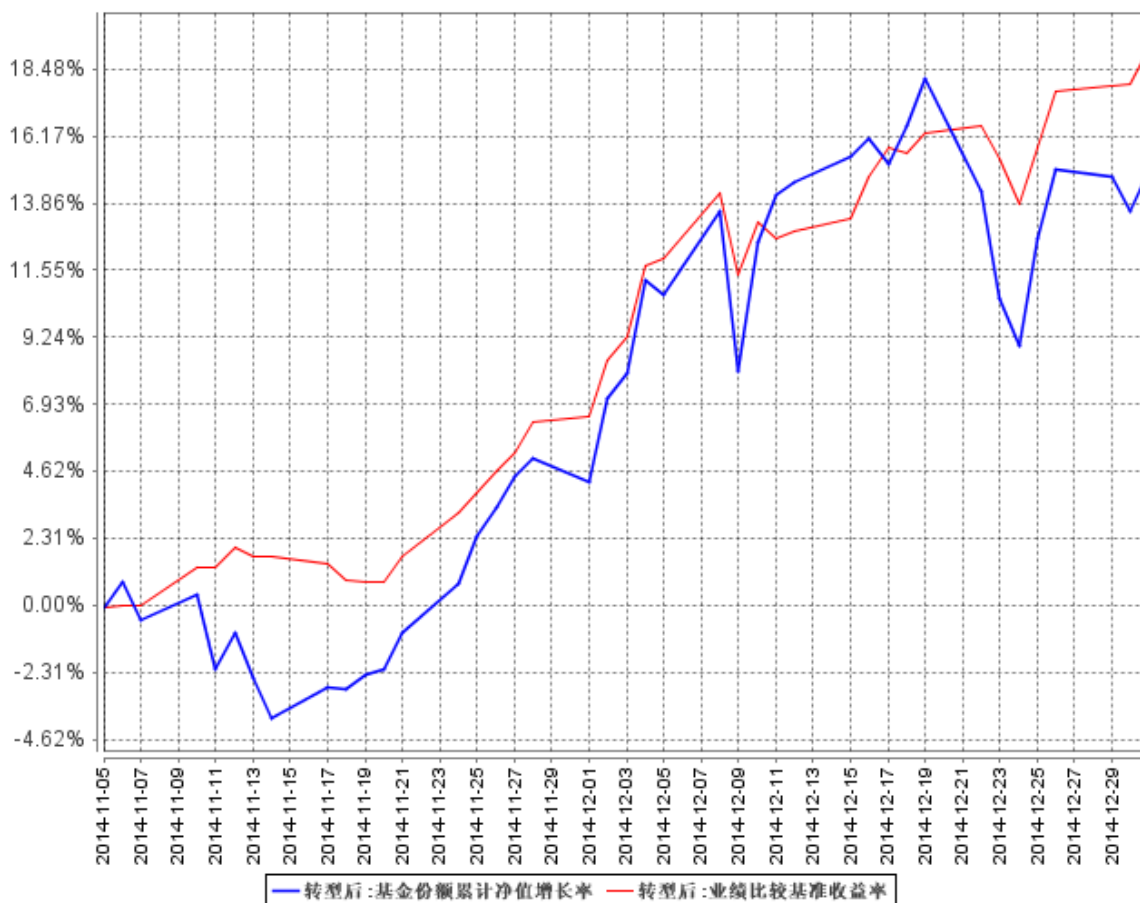
基准则采用中证全债指数。目前沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准较为合适。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可使业绩比较更具有合理性。

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

### 3.2.2 自基金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



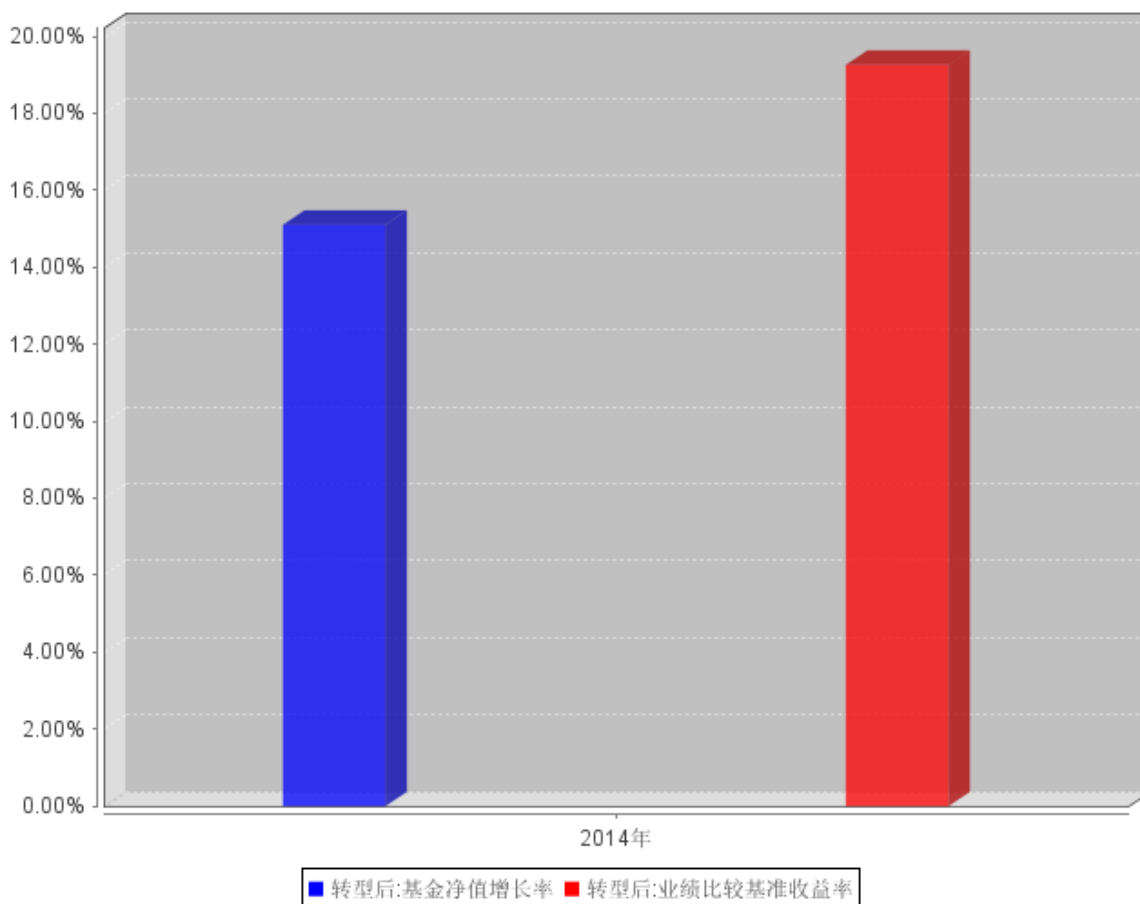
注：1、长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同盛证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 11 月 5 日（即基金合同生效日）。截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

### 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

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：长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）合同于 2014 年 11 月 5 日生效，合同生效当年按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

转型前

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	0.7900	237,000,000.00	-	237,000,000.00	
2013	-	-	-	-	
2012	0.1000	30,000,000.00	-	30,000,000.00	
合 计	0.8900	267,000,000.00	-	267,000,000.00	

转型后

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	-	-	-	-	
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（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田间	本基金基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理。	2013年7月9日	2014年11月4日	6年	女，1978年11月出生，中国国籍。中央财经大学经济学硕士。2008年7月加入长盛基金管理有限公司，任行业研究员，基金经理助理，同盛证券投资基金（本基金）基金经理等职务
冯雨生	本基金基金经理助理，长盛中证100指数证	2014年4月3日	2014年11月4日	7年	男，1983年11月出生，中国国籍。北京大学金融学硕士。2007年7月加入长盛基金管理有限公司，

	券投资基金 基金经理， 长盛沪深 300 指数证 券投资基金 (LOF) 基 金经理。				曾任金融工程与量化投资 部金融工程研究员。任同 盛证券投资基金基金经理 助理，长盛中证 100 指数 证券投资基金基金经理， 长盛沪深 300 指数证券投 资基金 (LOF) 基金经理。
侯继雄	本基金基金 经理，社保 组合组合经 理，公司总 经理助理。 长盛创富资 产管理有限 公司执行董 事、总经理。	2008 年 8 月 11 日	2014 年 4 月 21 日	13 年	男，1974 年 5 月出生，中 国国籍。清华大学博士。 历任国泰君安证券研究所 研究员、策略部经理。 2007 年 2 月加入长盛基金 管理有限公司，先后任长 盛同德主题增长股票型证 券投资基金基金经理，研 究部总监等职务。现任公 司总经理助理，社保组合 组合经理，兼任长盛创富 资产管理有限公司执行董 事、总经理。自 2014 年 4 月 21 日起不再担任同盛 证券投资基金基金经理。

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。

### 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田间	本基金基金 经理， 长盛同鑫 行业配置 混合型证 券投资基 金基金经 理，长盛 同智优势 成长混合 型证券投	2014 年 11 月 5 日	-	6 年	女，1978 年 11 月出生，中 国国籍。中央财经大学经济 学硕士。2008 年 7 月加入长 盛基金管理有限公司，曾任 行业研究员，基金经理助理、 同盛证券投资基金基金经理 等职务。现任长盛同鑫行业 配置混合型证券投资基金基 金经理，长盛同智优势成长 混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛同盛成长优

	资基金 (LOF) 基金经理。				选灵活配置混合型证券投资 基金 (LOF, 本基金) 基金经 理。
冯雨生	本基金基 金经理助 理, 长盛 中证 100 指数 证券投资 基金基金 经理, 长 盛沪深 300 指数 证券投资 基金 (LOF) 基金经理。	2014 年 4 月 3 日	-	7 年	男, 1983 年 11 月出生, 中 国国籍。北京大学金融学硕 士。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 研究员等职务。现任长盛同 盛成长优选灵活配置混合型 证券投资基金 (LOF) 助理, 长盛中证 100 指数证券投资 基金基金经理, 长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。

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

2014 年，国内经济压力较大，其中工业和出口增速明显回落，以房地产和固定资产投资为主的一些指标低位徘徊；尽管二季度以来在政府定向宽松稳增长政策的密集出台下，国内经济有一定程度的企稳和回暖迹象，PMI 等多项经济指标有回升趋势，但需求不足的态势仍在延续。全年流动性持续宽松，人民币贷款增速和 M2 增速保持平稳。海外经济中，美国经济持续复苏，日本复苏有反复，欧洲国家温和复苏，新兴经济体加快结构调整。

2014 年的资本市场走势是一个寻求贝塔的过程。一季度是以“小市值+高现金”的转型企业为代表的创业板综指的贝塔行情。二季度是市场重新寻找方向的过程，表现为大盘指数的窄幅箱体震荡和中小盘指数先抑后扬的反弹行情。三季度市场的贝塔主要来自于军工和计算机行业，中小板和创业板指数表现明显好于沪深 300 和上证 50。四季度在流动性泛滥和经济增速下移的市场结构中，估值修复成为行情演绎的主逻辑，与此同时，市场化环境下金融工具充分应用（加杠杆）放大了个股的波动性，资本市场表现为大盘指数一路上涨，其中以非银金融和“一路一带”

相关领域为领涨板块，其它大盘蓝筹板块也随之轮动上涨共同推升指数，而中小板和创业板则出现了明显的向下调整。

回顾基金同盛在 2014 年的操作，前三季度的投资策略是自下而上精选个股，在经济转型叠加宏观经济复苏的预期下，寻找小市值+高现金的转型企业，先后积极参与了新经济成长方向的热点和主题，一定程度上分享了创业板的结构性上涨行情。进入四季度投资策略及时调整为自上而下的宏观配置策略，逐步降低成长股的比例，从行业轮动的角度将组合结构分散化，并根据市场的轮动趋势进行热点切换，阶段性抓住了龙头行业的投资机会，做到稳健地分享市场四季度的蓝筹行情，同时保留长期看好的优势个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2014 年 12 月 31 日，长盛同盛成长优选混合（LOF）份额净值为 1.066 元，本报告期（2014 年 11 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日）份额净值增长率为 15.11%，同期业绩比较基准增长率为 19.26%。

截至 2014 年 11 月 4 日，长盛同盛封闭份额净值为 1.1557 元，本报告期（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 11 月 4 日）份额净值增长率为 11.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2015 年，国内宏观经济依然存在较大压力和不确定性，与此同时政策的博弈程度也在加强。欧美持续复苏，日本复苏稳中有波动。在不出现流动性变局的情况下，我们判断，基于各种预期兑现的临近和经济企稳不确定性的存在，2015 年的资本市场会比此前的极端表现回归理性。我们会重点关注转型方向上政策落实和业绩兑现的高成长公司，以及兼具价值投资和新兴理念的蓝筹公司。未来在投资策略和风格上，会在集中和分散、成长和蓝筹之间寻求均衡。兼顾长期景气与中短期催化，成长与蓝筹的均衡，以避免短期新因素造成风格切换带来的净值波动。

#### 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》的规定以及《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》第十七部分中对基金利润分配原则的约定，长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）于报告期内未进行利润分配。

长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）截至 2014 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 478,205,433.68 元，其中：未分配利润已实现部分为 478,205,433.68 元，未分配利润未实现部分为 525,501,497.40 元。

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及《同盛证券投资基金基金合同》第十七条中对基金利润分配原则的约定，同盛证券投资基金分别于 2014 年 3 月 28 日、2014 年 11 月 4 日进行了利润分配，分配金额为 237,000,000.00 元。。

同盛证券投资基金截至 2014 年 11 月 4 日，期末可供分配利润为 19,596,529.50 元，其中：未分配利润已实现部分为 19,596,529.50 元，未分配利润未实现部分为 447,557,177.49 元。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长盛同盛成长优选灵活配置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以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

## §6 审计报告(转型前)

### 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	安永华明（2015）审字第 60468688_A03 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	同盛证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的同盛证券投资基金财务报表，包括 2014 年 11 月 4 日的资产负债表和 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 11 月 4 日止期间的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	编制和公允列报财务报表是基金管理人长盛基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（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而导致的重大错报。
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基金管理人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</p>

	意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了同盛证券投资基金 2014 年 11 月 4 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 11 月 4 日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤骏	贺耀
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2015 年 3 月 24 日	

## §6 审计报告（转型后）

### 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	安永华明（2015）审字第 60468688_A06 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	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表和 2014 年 11 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间的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	编制和公允列报财务报表是基金管理人长盛基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（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而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	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。 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基金管理人选用会

	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。 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。	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 11 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汤骏	王珊珊
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2015 年 3 月 24 日	

## §7 年度财务报表(转型前)

### 7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：同盛证券投资基金

报告截止日：2014 年 11 月 4 日

单位：人民币元

资产	附注号	2014 年 11 月 4 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	43,665,208.47	51,949,306.83
结算备付金		12,182,769.72	32,699,400.12
存出保证金		2,362,768.59	1,145,805.67
交易性金融资产	7.4.7.2	3,399,528,255.40	2,914,085,432.59
其中：股票投资		2,679,138,801.60	2,219,938,432.59
基金投资		-	-
债券投资		720,389,453.80	694,147,000.00
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	-	361,000,000.00
应收证券清算款		-	12,483,189.04
应收利息	7.4.7.5	13,978,413.02	8,761,321.93
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	9,369.54	-

资产总计		3,471,726,784.74	3,382,124,456.18
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>2014年11月4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		-	19,590,648.31
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		589,937.18	4,225,232.87
应付托管费		98,322.87	704,205.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,469,958.30	4,680,989.94
应交税费		1,823,891.66	1,823,891.66
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	590,967.74	647,967.74
负债合计		4,573,077.75	31,672,936.00
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	467,153,706.99	350,451,520.18
所有者权益合计		3,467,153,706.99	3,350,451,520.18
负债和所有者权益总计		3,471,726,784.74	3,382,124,456.18

注：(1) 自 2014 年 11 月 5 日起，由《同盛证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

(2) 报告截止日 2014 年 11 月 4 日，基金份额净值为人民币 1.1557 元，基金份额总额为 3,000,000,000.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：同盛证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 11 月 4 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年11月4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>		435,177,295.85	331,272,630.85
1. 利息收入		32,545,005.21	33,201,796.63
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,401,536.97	1,682,189.68



债券利息收入		29,206,481.90	27,443,351.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,936,986.34	4,076,255.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		178,599,222.79	289,661,599.97
其中：股票投资收益	7.4.7.12	151,999,570.91	264,004,943.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,138,748.21	-2,502,222.81
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	24,460,903.67	28,158,879.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	224,033,067.85	8,409,234.25
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		81,475,109.04	86,784,753.34
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	41,209,091.39	48,813,028.17
2. 托管费	7.4.10.2.2	6,868,181.91	8,135,504.60
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	32,273,740.00	29,377,112.01
5. 利息支出		14,382.71	-
其中：卖出回购金融资产支出		14,382.71	-
6. 其他费用	7.4.7.19	1,109,713.03	459,108.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		353,702,186.81	244,487,877.51
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		353,702,186.81	244,487,877.51

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：同盛证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年11月4日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年11月4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	3,000,000,000.00	350,451,520.18	3,350,451,520.18

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	353,702,186.81	353,702,186.81
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-237,000,000.00	-237,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	467,153,706.99	3,467,153,706.99
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)	3,000,000,000.00	105,963,642.67	3,105,963,642.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	244,487,877.51	244,487,877.51
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	3,000,000,000.00	350,451,520.18	3,350,451,520.18

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

同盛证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[1999]30 号文《关于同意同盛证券投资基金设立的批复》批准，由中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、天津北方国际信托投资股份有限公司、国元证券股份有限公司和长盛基金管理有限公司五家发起人共同发起并向社会募集设立。基金合同于 1999 年 11 月 5 日正式生效，本基金为契约型封闭式，存续期为 15 年，发行规模为 30 亿份基金份额。本基金经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[1999]109 号文审核同意，于 1999 年 11 月 26 日在深交所挂牌交易。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。

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其股票投资部分将主要投资于成长型股票和价值型股票。本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%。本基金并未就业绩比较基准做出相关规定。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

采用若干修订后/新会计准则

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

金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

经中国证监会批准，本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司将本基金于 2014 年 11 月 5 日转型为长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）并相应延长存续期至不定期，故本财务报表仍以持续经营假设为编制基础。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 11 月 4 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 11 月 4 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 11 月 4 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

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

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

##### (2) 金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

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

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

#### (2) 债券投资

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

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

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

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

#### (4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

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

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数

据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额，每份基金面值为人民币 1.00 元。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

#### **7.4.4.9 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

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

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

#### **7.4.4.10 基金的收益分配政策**

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益分配采取现金方式；

(3) 基金当期收益在弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，年度收益分配比例不低于基金可分配收益的 90%；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

会计政策变更的说明可参见 7.4.2 会计报表的编制基础。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。



## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 7.4.6.2 营业税、企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 7.4.6.3 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问

题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

## 7.4.7 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 11 月 4 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	43,665,208.47	51,949,306.83
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	43,665,208.47	51,949,306.83

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 11 月 4 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	2,236,302,459.90	2,679,138,801.60	442,836,341.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	136,879,818.01	138,076,453.80
	银行间市场	578,788,800.00	582,313,000.00
	合计	715,668,618.01	720,389,453.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,951,971,077.91	3,399,528,255.40	447,557,177.49
项目	上年度末 2013 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	1,992,882,682.95	2,219,938,432.59	227,055,749.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	697,678,640.00	694,147,000.00

	合计	697,678,640.00	694,147,000.00	-3,531,640.00
	资产支持证券	-	-	-
	基金	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	2,690,561,322.95	2,914,085,432.59	223,524,109.64

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014年11月4日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	-	-
交易所市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2013年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	-	-
交易所市场	361,000,000.00	-
合计	361,000,000.00	-

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年11月4日	上年度末 2013年12月31日
应收活期存款利息	124,616.06	31,364.61
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	37,849.36	14,714.82
应收债券利息	13,812,222.98	8,560,308.82
应收买入返售证券利息	-	154,417.98
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	3,724.62	515.70
合计	13,978,413.02	8,761,321.93

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2014 年 11 月 4 日	2013 年 12 月 31 日
其他应收款	-	-
待摊费用	9,369.54	-
合计	9,369.54	-

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 11 月 4 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,469,958.30	4,679,064.94
银行间市场应付交易费用	-	1,925.00
合计	1,469,958.30	4,680,989.94

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 11 月 4 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
其他	32,967.74	32,967.74
预提审计费用	80,163.16	95,000.00
预提信息披露费用	227,836.84	270,000.00
合计	590,967.74	647,967.74

#### 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 11 月 4 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00

#### 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	126,927,410.54	223,524,109.64	350,451,520.18
本期利润	129,669,118.96	224,033,067.85	353,702,186.81
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-237,000,000.00	-	-237,000,000.00

本期末	19,596,529.50	447,557,177.49	467,153,706.99
-----	---------------	----------------	----------------

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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11月4日	2013年1月1日至2013年12月31日
活期存款利息收入	1,150,930.44	1,444,120.57
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	232,816.74	221,274.58
其他	17,789.79	16,794.53
合计	1,401,536.97	1,682,189.68

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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11月4日	2013年1月1日至2013年12月31日
卖出股票成交总额	10,528,551,973.77	9,816,485,645.10
减：卖出股票成本总额	10,376,552,402.86	9,552,480,701.92
买卖股票差价收入	151,999,570.91	264,004,943.18

#### 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	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年11月4日	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	2,138,748.21	-2,502,222.81
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	2,138,748.21	-2,502,222.81

##### 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	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年	2013年1月1日至2013年12月

	11月4日	31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,571,941,746.61	708,190,191.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,522,145,245.59	692,048,365.70
减：应收利息总额	47,657,752.81	18,644,048.35
买卖债券差价收入	2,138,748.21	-2,502,222.81

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 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 11月4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	24,460,903.67	28,158,879.60
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	24,460,903.67	28,158,879.60

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年 11月4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	224,033,067.85	8,409,234.25
——股票投资	215,780,592.06	10,018,967.45
——债券投资	8,252,475.79	-1,609,733.20
——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	224,033,067.85	8,409,234.25

#### 7.4.7.17 其他收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

#### 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	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年
----	-----------------------	----------------------------

	11月4日	12月31日
交易所市场交易费用	32,266,290.00	29,372,962.01
银行间市场交易费用	7,450.00	4,150.00
合计	32,273,740.00	29,377,112.01

#### 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11月4日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
审计费用	80,163.16	95,000.00
信息披露费	227,836.84	270,000.00
账户维护费用	22,500.00	13,500.00
其他手续费	707,445.00	-
上市年费	50,630.46	60,000.00
银行费用	21,137.57	20,608.56
合计	1,109,713.03	459,108.56

#### 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2014年11月4日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大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
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金发起人
天津北方国际信托投资股份有限公司 （“天津国际信托”）	基金发起人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金发起人
长盛基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金发起人、基金管理人股东
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司
长盛基金（香港）有限公司	基金管理人子公司

注：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11月4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
长江证券	304,156,325.38	1.44%	1,764,434,555.66	9.22%
中信证券	-	-	771,147,349.02	4.03%
国元证券	2,378,670,280.89	11.26%	170,021,583.09	0.89%

**债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年11月4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	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
长江证券	196,747,845.70	14.21%	-	-

**债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年11月4日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
长江证券	897,000,000.00	8.37%	150,000,000.00	0.88%
国元证券	-	-	528,800,000.00	3.09%

**7.4.10.1.2 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。

**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11月4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
长江证券	276,904.80	1.44%	-	-
国元证券	2,165,537.29	11.26%	-	-
	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日			
关联方名称	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
长江证券	1,606,341.07	9.23%	-	-
中信证券	699,637.69	4.02%	615,797.77	13.16%
国元证券	154,787.69	0.89%	60,328.33	1.29%

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的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。

#### 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 11月4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	41,209,091.39	48,813,028.17
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	-	-

注：在通常情况下，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，本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值的20%，超出部分不计提基金管理费。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值（扣除本基金持有现金比例超过20%部分的基金资产净值）

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

**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11月4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	6,868,181.91	8,135,504.60

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 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月最后一个工作日（遇公众假期延至节假日结束后的第一个工作日）由基金托管人从基金资产中一次性支取。

**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：本基金本报告期及上年度可比期间均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11月4日	2013年1月1日至2013年12月31日
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.20%	0.20%

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。

**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**

份额单位：份

关联方名称	本期末	上年度末
	2014年11月4日	2013年12月31日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)
国元证券	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
天津国际信 托	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
长江证券	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
中信证券	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%

注：除基金管理人之外的其他关联方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。

#### 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11月4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
中国银行	43,665,208.47	1,150,930.44	51,949,306.83	1,444,120.57

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序 号	权益 登记日	除息日		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	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2014年 11月3日	2014年 11月4日	2014年 11月4日	0.4000	120,000,000.00	-	120,000,000.00	
2	2014年 3月27日	2014年 3月28日	2014年 3月28日	0.3900	117,000,000.00	-	117,000,000.00	
合计	-	-	-	0.7900	237,000,000.00	-	237,000,000.00	

#### 7.4.12 期末（2014年11月4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：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002207	准油股份	2014年10月10日	重大不确定事项	17.59	2015年1月7日	16.02	3,194,245	46,312,933.00	56,186,769.55	-
300296	利亚德	2014年9月29日	重大资产重组	23.22	2015年1月5日	22.60	6,696,572	103,270,310.09	155,494,401.84	-
300324	旋极信息	2014年10月15日	重大不确定事项	52.73	2015年1月15日	50.00	1,332,841	59,426,581.54	70,280,705.93	-
300003	乐普医疗	2014年10月17日	重大不确定事项	27.27	2014年11月10日	27.00	2,899,772	64,801,718.47	79,076,782.44	-
300010	立思辰	2014年8月5日	重大不确定事项	27.94	2014年11月6日	25.00	5,916,987	131,164,154.95	165,320,616.78	-
300299	富春通信	2014年7月17日	重大不确定事项	13.85	2014年12月3日	12.22	4,041,669	50,687,250.95	55,977,115.65	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会风险控制管理委员会、督察长、公司风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司监察稽核部和风险管理部构成，监察稽核部负责对公司业务的法律合规风险和运作风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险控制委员会构成，公司管理层通过风险控制委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，在公司督察长的指导下，监察稽核部和风险管理部对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门总监、风险控制委员会、公司总经理、风险控制管理委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控

制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会及其下设风险控制管理委员会构成，风险控制管理委员会通过督察长、监察稽核部和风险管理部的工作，掌握整体风险状况并进行决策。风险控制管理委员会负责审查公司风险控制体系及其有效性、公司内控制度的实施情况。

#### **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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 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，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

#### **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**

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因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

金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款等。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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

金额单位：人民币元

本期末 2014年 11月 4日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	43,665,208.47	-	-	-	-	-	43,665,208.47
结算备付金	12,182,769.72	-	-	-	-	-	12,182,769.72
存出保证金	2,362,768.59	-	-	-	-	-	2,362,768.59
交易性金融资产	-	49,990,000.00	532,323,000.00	130,165,052.40	7,911,401.40	2,679,138,801.60	3,399,528,255.40
应收利息	-	-	-	-	-	13,978,413.02	13,978,413.02
其他资产	-	-	-	-	-	9,369.54	9,369.54
资产总计	58,210,746.78	49,990,000.00	532,323,000.00	130,165,052.40	7,911,401.40	2,693,126,584.16	3,471,726,784.74
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	589,937.18	589,937.18
应付托管费	-	-	-	-	-	98,322.87	98,322.87
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,469,958.30	1,469,958.30
应交税费	-	-	-	-	-	1,823,891.66	1,823,891.66
其他负债	-	-	-	-	-	590,967.74	590,967.74
负债总计	-	-	-	-	-	4,573,077.75	4,573,077.75
利率敏感度缺口	58,210,746.78	49,990,000.00	532,323,000.00	130,165,052.40	7,911,401.40	2,688,553,506.41	3,467,153,706.99
上年度末 2013年 12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	51,949,306.83	-	-	-	-	-	51,949,306.83

结算备付金	32,699,400.12	-	-	-	-	-	32,699,400.12
存出保证金	1,145,805.67	-	-	-	-	-	1,145,805.67
交易性金融资产	208,692,000.00	128,935,000.00	327,150,000.00	29,370,000.00	-2,219,938,432.59	-	2,914,085,432.59
买入返售金融资产	361,000,000.00	-	-	-	-	-	361,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	12,483,189.04	12,483,189.04
应收利息	-	-	-	-	-	8,761,321.93	8,761,321.93
资产总计	655,486,512.62	128,935,000.00	327,150,000.00	29,370,000.00	-2,241,182,943.56	-	3,382,124,456.18
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	19,590,648.31	19,590,648.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,225,232.87	4,225,232.87
应付托管费	-	-	-	-	-	704,205.48	704,205.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,680,989.94	4,680,989.94
应交税费	-	-	-	-	-	1,823,891.66	1,823,891.66
其他负债	-	-	-	-	-	647,967.74	647,967.74
负债总计	-	-	-	-	-	31,672,936.00	31,672,936.00
利率敏感度缺口	655,486,512.62	128,935,000.00	327,150,000.00	29,370,000.00	-2,209,510,007.56	-	3,350,451,520.18

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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11月4日）	上年度末（2013年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-1,859,321.15	-1,640,635.52
市场利率下降25个基点	1,859,321.15	1,640,635.52	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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的股票和债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%。于 2014 年 11 月 4 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 11 月 4 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	2,679,138,801.60	77.27	2,219,938,432.59	66.26
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,679,138,801.60	77.27	2,219,938,432.59	66.26

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

假设	假定上证综合指数变化 5%，其他变量不变； 用期末时点上证综合指数浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险； Beta 系数是根据组合在过去 204 个交易日的净值数据和上证综合指数数据回归得出，反映了基金和上证综合指数的相关性。		
	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）	
分析		本期末（2014 年 11 月 4 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	0.05	133,089,474.00	106,053,126.11
	-0.05	-133,089,474.00	-106,053,126.11

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、应收利息、应付交易费用、应交税费等，因其剩余期限不长，公允



价值与账面价值相若。

#### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,234,878,863.21 元，属于第二层次的余额为人民币 1,164,649,392.19 元，属于第三层次的余额为人民币零元。

#### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，由第一层次转入第二层次的金额为人民币零元，由第二层次转入第一层次的金额为人民币 51,522,503.90 元。

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

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2015年3月24日经本基金的基金管理人批准。

## §7 年度财务报表(转型后)

### 7.1 资产负债表（转型后）

会计主体：长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	2014年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	1,186,611,911.02
结算备付金		25,841,610.58
存出保证金		2,815,573.78
交易性金融资产	7.4.7.2	3,050,432,083.45
其中：股票投资		3,050,432,083.45
基金投资		-

债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		140,817,254.35
应收利息	7.4.7.5	105,021.42
应收股利		-
应收申购款		1,861,201.20
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		4,408,484,655.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>2014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		116,532,119.18
应付赎回款		226,783,934.52
应付管理人报酬		5,683,022.66
应付托管费		947,170.41
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	13,048,777.08
应交税费		1,823,891.66
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	1,502,680.25
负债合计		366,321,595.76
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	3,038,456,128.96
未分配利润	7.4.7.10	1,003,706,931.08
所有者权益合计		4,042,163,060.04
负债和所有者权益总计		4,408,484,655.80

注：(1) 报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.066 元，基金份额总额为 3,791,930,155.16 份。

(2) 本期财务报表的实际编制期间系 2014 年 11 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2014 年 11 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 11 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		593,147,566.10
1. 利息收入		727,703.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	455,184.22
债券利息收入		272,519.63
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）		519,820,596.77
其中：股票投资收益	7.4.7.12	513,579,390.84
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	5,158,705.89
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	1,082,500.04
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	71,834,690.19
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	764,575.29
<b>减：二、费用</b>		30,586,374.78
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,373,695.78
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,562,282.59
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	19,538,278.39
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	112,118.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		562,561,191.32
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		562,561,191.32

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2014 年 11 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014年11月5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）	3,000,000,000.00	467,153,706.99	3,467,153,706.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	562,561,191.32	562,561,191.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	38,456,128.96	-26,007,967.23	12,448,161.73
其中：1. 基金申购款	498,713,341.64	124,483,554.76	623,196,896.40
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-460,257,212.68	-150,491,521.99	-610,748,734.67
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）	3,038,456,128.96	1,003,706,931.08	4,042,163,060.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵

林培富

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同盛证券投资基金（以下简称“基金同盛”）转型而成。根据基金同盛的基金份额持有人大会审议通过的《关于同盛证券投资基金转型有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予同盛证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2014]998号）及深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2014]406号）的同意，基金同盛于2014年11月4日进行终止上市权益登记，2014年11月5日终止上市。自基金同盛终止上市之日起，基金同盛转型为长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），由《同盛证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。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。

根据《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》、《关于同盛证券投资基金转换所得长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额折算的公告》等相关规定，基金管理人确定 2014 年 12 月 3 日作为基金份额折算基准日。经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算基准日基金份额净值为人民币 1.247992463 元，折算基准日本基金份额净值采用四舍五入的方法保留到小数点后第 9 位。本基金管理人按照 1:

1.247992463 的折算比例对基金同盛进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值为人民币 1.000 元，折算后本基金的基金份额数采用截尾的方式保留到整数，所产生的误差归入基金资产。折算前基金同盛份额总额为 30 亿份，折算后基金份额总额为 3,743,977,389.00 份。本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2014 年 12 月 4 日对折算后的份额进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2014 年 11 月 17 日至 2014 年 11 月 28 日期间开放集中申购，集中申购款扣除申购费用后的净申购金额为人民币 609,423,974.44 元，折合 609,423,974.44 份基金份额；申购资金在集中申购期间产生的利息为人民币 88,606.90 元，折合 88,606.90 份基金份额；集中申购期间收到的实收基金共计人民币 609,512,581.34 元，折合 609,512,581.34 份基金份额。业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具（2014）验字第 60468688\_A12 号验资报告予以验证。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、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相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或到期日在一年期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：50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证

券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

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

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 11 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2014 年 11 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

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

金融资产、贷款和应收款项；

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

#### (2) 金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

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

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

##### (2) 债券投资

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

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

### (3) 权证投资

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

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

### (4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

### (5) 回购协议

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

## 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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



本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入

“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率逐日计提；

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，若事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；场内基金份额的收益分配方式为现金分红，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及注册登记机构的相关规定；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

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

(6) 当日申购的基金份额自申购确认日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自赎回确认日起，不享有基金的分配权益；

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

会计政策变更的说明可参见 7.4.2 会计报表的编制基础。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按

证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 营业税、企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.3 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

## 7.4.7 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
活期存款	1,186,611,911.02
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
-	-
其他存款	-
合计：	1,186,611,911.02

### 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	估值增值
股票	2,531,040,215.77	3,050,432,083.45	519,391,867.68
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	2,531,040,215.77	3,050,432,083.45	519,391,867.68

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期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：本基金本报告期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
应收活期存款利息	92,121.87
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	11,627.70
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4.85
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,267.00
合计	105,021.42

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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
交易所市场应付交易费用	13,045,227.08
银行间市场应付交易费用	3,550.00
合计	13,048,777.08

#### 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
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	854,712.51
其他	32,967.74
预提审计费用	95,000.00
预提信息披露费用	270,000.00
合计	1,502,680.25

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年11月5日至2014年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
- 基金份额折算调整	743,977,389.00	-
- 未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
- 集中申购募集资金本金及利息	609,512,581.34	488,394,440.72
- 基金拆分和集中申购完成后	4,353,489,970.34	3,488,394,440.72
本期申购	12,878,730.41	10,318,900.92
本期赎回（以“-”号填列）	-574,438,545.59	-460,257,212.68

本期末	3,791,930,155.16	3,038,456,128.96
-----	------------------	------------------

注：(1) 申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

(2) 本基金合同生效日为 2014 年 11 月 5 日。

(3) 本基金设立时，收到的集中申购款扣除申购费后的净申购金额为人民币 609,423,974.44 元，折合 609,423,974.44 份基金份额；申购资金在集中申购期间产生的利息为人民币 88,606.90 元，折合 88,606.90 基金份额；集中申购期间收到的实收基金共计人民币 609,512,581.34 元，折合 609,512,581.34 份基金份额。

(4) 根据《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》、《关于同盛证券投资基金转换所得长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额折算的公告》等相关规定，基金管理人以 2014 年 12 月 3 日作为基金份额折算基准日，对折算基准日登记在册的由原基金同盛转型所得的本基金基金份额进行折算与变更登记。份额折算结果如下：

折算前由原基金同盛转换得到的本基金份额数 (单位：份)	折算基准日本基金份额净值(单位：元/份)	折算后本基金份额净值 (单位：元/份)	基金份额折算比例	折算后本基金份额数 (单位：份)
3,000,000,000.00	1.247992463	1.000	1: 1.247992463	3,743,977,389.00

#### 7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	19,596,529.50	447,557,177.49	467,153,706.99
本期利润	490,726,501.13	71,834,690.19	562,561,191.32
本期基金份额交易产生的变动数	-32,117,596.95	6,109,629.72	-26,007,967.23
其中：基金申购款	21,768,074.93	102,715,479.83	124,483,554.76
基金赎回款	-53,885,671.88	-96,605,850.11	-150,491,521.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	478,205,433.68	525,501,497.40	1,003,706,931.08

#### 7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期
	2014 年 11 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	399,207.37
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	49,320.64
其他	6,656.21
合计	455,184.22

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2014年11月5日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	6,466,668,721.29
卖出股票成本总额	5,953,089,330.45
买卖股票差价收入	513,579,390.84

**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11月5日至2014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	5,158,705.89
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	5,158,705.89

**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11月5日至2014年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	734,912,066.51
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	715,668,618.01
减：应收利息总额	14,084,742.61
买卖债券差价收入	5,158,705.89

**7.4.7.14 衍生工具收益**

注：本基金于 2014 年 11 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2014年11月5日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,082,500.04
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,082,500.04



**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年11月5日至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	71,834,690.19
——股票投资	76,555,525.98
——债券投资	-4,720,835.79
——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	71,834,690.19

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2014年11月5日至2014年12月31日
基金赎回费收入	763,437.90
其他	1,137.39
合计	764,575.29

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2014年11月5日至2014年12月31日
交易所市场交易费用	19,534,728.39
银行间市场交易费用	3,550.00
合计	19,538,278.39

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2014年11月5日至2014年12月31日
审计费用	14,836.84
信息披露费	42,163.16
上市年费	9,369.54

银行费用	3,748.48
持有人大会费用	42,000.00
合计	112,118.02

## 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大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	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
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司
长盛基金（香港）有限公司	基金管理人子公司

注：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

注：本基金于 2014 年 11 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间未通过关联方交易单元进行交易。

### 7.4.10.2 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
	2014 年 11 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	9,373,695.78
其中：支付销售机构的客户维护费	52,184.70

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 11 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	1,562,282.59

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

#### 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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2014 年 11 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	30,712,227.95	-	-	-	-

#### 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2014 年 11 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	6,000,000.00
期间申购/买入总份额	1,487,954.00
期间因拆分增加的份额	-
期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	7,487,954.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.20%

注：1、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。

2、基金管理人以 2014 年 12 月 3 日作为基金份额折算基准日，对折算基准日登记在册的由原基金同盛转型所得的本基金基金份额进行折算与变更登记。折算后，本基金管理人持有的基金份额

调增 1,487,954.00 份。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
国元证券	3,743,978.00	0.10%

注：除基金管理人之外的其他关联方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。

#### 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 11 月 5 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,186,611,911.02	399,207.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于 2014 年 11 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金于 2014 年 11 月 5 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间未进行利润分配。

#### 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：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000883	湖北能源	2014 年 11 月 18 日	重大事项未公告	8.31	-	-	8,579,466	28,830,013.93	71,295,362.46	-

002170	芭田股份	2014年12月25日	重大事项未公告	9.00	2015年1月5日	9.38	4,700,522	44,938,156.35	42,304,698.00	
002207	准油股份	2014年10月10日	重大事项未公告	20.36	2015年1月7日	16.02	3,194,245	46,312,933.00	65,034,828.20	
300296	利亚德	2014年9月29日	重大资产重组	21.95	2015年1月5日	22.60	6,696,572	103,270,310.09	146,989,755.40	
300324	旋极信息	2014年10月15日	重大事项未公告	53.82	2015年1月15日	50.00	1,332,841	59,426,581.54	71,733,502.62	
000411	英特集团	2014年11月28日	重大资产重组	21.70	-	-	1,541,915	23,064,869.89	33,459,555.50	

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会合规与审计委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险和运作风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、合规与审计委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会和合规与审计委员会构成，公司合规与审计委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。

合规与审计委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

#### **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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 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，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

#### **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**

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因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。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款等。

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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

金额单位：人民币元

本期末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,186,611,911.02	-	-	-	-	-	1,186,611,911.02
结算备付金	25,841,610.58	-	-	-	-	-	25,841,610.58
存出保证金	2,815,573.78	-	-	-	-	-	2,815,573.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,050,432,083.45	3,050,432,083.45
应收证券清算款	-	-	-	-	-	140,817,254.35	140,817,254.35
应收利息	-	-	-	-	-	105,021.42	105,021.42
应收申购款	-	-	-	-	-	1,861,201.20	1,861,201.20
资产总计	1,215,269,095.38	-	-	-	-	3,193,215,560.42	4,408,484,655.80
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	116,532,119.18	116,532,119.18
应付赎回款	-	-	-	-	-	226,783,934.52	226,783,934.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,683,022.66	5,683,022.66
应付托管费	-	-	-	-	-	947,170.41	947,170.41
应付交易费用	-	-	-	-	-	13,048,777.08	13,048,777.08
应交税费	-	-	-	-	-	1,823,891.66	1,823,891.66
其他负债	-	-	-	-	-	1,502,680.25	1,502,680.25
负债总计	-	-	-	-	-	366,321,595.76	366,321,595.76
利率敏感度缺口	1,215,269,095.38	-	-	-	-	-2,826,893,964.66	4,042,163,060.04

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末未持有交易性金融资产债券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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的股票和债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资组合中股票投资占基金资产的 0%-95%；其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于 2014 年 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	3,050,432,083.45	75.47
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	3,050,432,083.45	75.47

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是根据自基金合同生效日起至 2014 年 12 月 31 日的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
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）
	0.05	247,072,449.19
	-0.05	-247,072,449.19

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

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

##### (1) 各层次金融工具公允价值



本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,619,614,381.27 元，属于第二层次的余额为人民币 430,817,702.18 元，属于第三层次的余额为人民币零元。

#### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，由第一层次转入第二层次的金额为人民币 414,771,448.77 元，由第二层次转入第一层次的金额为人民币 280,347,370.03 元。

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

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2015年3月24日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告(转型前)

### 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	2,679,138,801.60	77.17
	其中：股票	2,679,138,801.60	77.17
2	固定收益投资	720,389,453.80	20.75
	其中：债券	720,389,453.80	20.75
	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	55,847,978.19	1.61
7	其他资产	16,350,551.15	0.47

8	合计	3,471,726,784.74	100.00
---	----	------------------	--------

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	28,399,661.72	0.82
B	采矿业	126,616,624.43	3.65
C	制造业	1,306,754,848.55	37.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	98,364,720.72	2.84
E	建筑业	213,605,179.98	6.16
F	批发和零售业	228,618,402.85	6.59
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	491,931,597.09	14.19
J	金融业	119,513,504.53	3.45
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,111,244.88	0.49
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	48,223,016.85	1.39
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	2,679,138,801.60	77.27

## 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

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	300010	立思辰	5,916,987	165,320,616.78	4.77
2	300296	利亚德	6,696,572	155,494,401.84	4.48
3	601555	东吴证券	7,875,749	98,604,377.48	2.84

4	000883	湖北能源	16,728,694	98,364,720.72	2.84
5	000333	美的集团	4,441,945	91,726,164.25	2.65
6	002713	东易日盛	2,005,917	91,710,525.24	2.65
7	600133	东湖高新	9,516,363	85,837,594.26	2.48
8	300003	乐普医疗	2,899,772	79,076,782.44	2.28
9	001696	宗申动力	8,177,353	78,257,268.21	2.26
10	000100	TCL 集团	22,399,992	73,471,973.76	2.12
11	600397	安源煤业	12,185,096	70,429,854.88	2.03
12	300324	旋极信息	1,332,841	70,280,705.93	2.03
13	600037	歌华有线	4,800,220	70,083,212.00	2.02
14	002383	合众思壮	2,169,933	64,403,611.44	1.86
15	002085	万丰奥威	2,231,329	63,146,610.70	1.82
16	002347	泰尔重工	5,263,651	62,374,264.35	1.80
17	600122	宏图高科	8,959,664	57,162,656.32	1.65
18	002207	准油股份	3,194,245	56,186,769.55	1.62
19	300299	富春通信	4,041,669	55,977,115.65	1.61
20	300290	荣科科技	2,125,067	52,446,653.56	1.51
21	000555	神州信息	1,407,415	51,975,835.95	1.50
22	002179	中航光电	1,734,231	49,599,006.60	1.43
23	000035	*ST 科健	3,612,211	48,223,016.85	1.39
24	002588	史丹利	1,499,975	47,429,209.50	1.37
25	600893	航空动力	1,619,482	47,013,562.46	1.36
26	300081	恒信移动	2,531,927	43,422,548.05	1.25
27	600535	天士力	1,052,757	42,215,555.70	1.22
28	002216	三全食品	2,063,870	41,277,400.00	1.19
29	300351	永贵电器	977,336	41,038,338.64	1.18
30	601002	晋亿实业	2,589,854	40,427,620.94	1.17
31	002470	金正大	1,499,953	39,898,749.80	1.15
32	000625	长安汽车	2,699,953	39,581,310.98	1.14
33	300354	东华测试	1,173,942	39,374,014.68	1.14
34	002262	恩华药业	1,419,479	39,319,568.30	1.13
35	300055	万邦达	994,952	36,057,060.48	1.04
36	002437	誉衡药业	1,399,960	34,369,018.00	0.99
37	300142	沃森生物	763,709	31,426,625.35	0.91
38	600655	豫园商城	3,115,216	31,027,551.36	0.89
39	000411	英特集团	1,551,042	30,260,829.42	0.87
40	002444	巨星科技	2,002,610	27,676,070.20	0.80
41	600998	九州通	1,699,210	27,425,249.40	0.79
42	002508	老板电器	771,278	26,909,889.42	0.78

43	300007	汉威电子	858,885	25,766,550.00	0.74
44	002382	蓝帆股份	973,405	23,517,464.80	0.68
45	600108	亚盛集团	2,237,527	17,765,964.38	0.51
46	002400	省广股份	687,751	17,111,244.88	0.49
47	000561	烽火电子	1,562,986	16,114,385.66	0.46
48	300377	赢时胜	455,566	14,874,229.90	0.43
49	600690	青岛海尔	798,908	13,261,872.80	0.38
50	300002	神州泰岳	701,613	10,973,227.32	0.32
51	601688	华泰证券	1,000,000	10,640,000.00	0.31
52	601118	海南橡胶	1,299,963	10,633,697.34	0.31
53	000686	东北证券	999,915	10,269,127.05	0.30
54	300083	劲胜股份	400,029	9,460,685.85	0.27
55	600590	泰豪科技	184,961	2,104,856.18	0.06
56	002196	方正电机	14,800	341,584.00	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	000333	美的集团	326,652,498.64	9.75
2	601555	东吴证券	218,292,675.32	6.52
3	600886	国投电力	189,377,129.19	5.65
4	300296	利亚德	187,853,630.46	5.61
5	300010	立思辰	186,297,645.17	5.56
6	600584	长电科技	153,388,954.80	4.58
7	600887	伊利股份	148,317,493.89	4.43
8	300291	华录百纳	136,226,293.41	4.07
9	600893	航空动力	128,426,054.85	3.83
10	600837	海通证券	127,610,195.74	3.81
11	601299	中国北车	119,540,588.71	3.57
12	600037	歌华有线	117,121,291.89	3.50
13	002373	联信永益	111,522,143.57	3.33
14	600015	华夏银行	107,767,642.98	3.22
15	300081	恒信移动	106,610,426.45	3.18
16	601688	华泰证券	102,870,817.98	3.07
17	002229	鸿博股份	102,613,777.22	3.06

18	000625	长安汽车	100,150,592.17	2.99
19	600999	招商证券	99,885,352.10	2.98
20	000712	锦龙股份	93,097,576.51	2.78
21	002713	东易日盛	90,296,710.16	2.70
22	601601	中国太保	90,290,850.84	2.69
23	002111	威海广泰	89,191,286.83	2.66
24	601600	中国铝业	87,268,626.11	2.60
25	300104	乐视网	85,117,600.79	2.54
26	601336	新华保险	83,206,242.63	2.48
27	002347	泰尔重工	82,521,050.79	2.46
28	600133	东湖高新	80,871,838.59	2.41
29	600446	金证股份	79,475,880.10	2.37
30	600122	宏图高科	78,609,173.92	2.35
31	300150	世纪瑞尔	77,646,964.01	2.32
32	300002	神州泰岳	75,288,705.14	2.25
33	002383	合众思壮	72,836,414.53	2.17
34	600535	天士力	70,196,839.28	2.10
35	001696	宗申动力	69,987,232.10	2.09
36	000883	湖北能源	69,265,627.77	2.07
37	300219	鸿利光电	68,798,537.97	2.05
38	000739	普洛药业	67,805,545.82	2.02

#### 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	000333	美的集团	315,786,332.77	9.43
2	600886	国投电力	200,483,825.23	5.98
3	600309	万华化学	190,453,583.44	5.68
4	600887	伊利股份	183,415,075.34	5.47
5	002038	双鹭药业	168,420,763.52	5.03
6	601555	东吴证券	165,079,756.80	4.93
7	300291	华录百纳	154,370,637.42	4.61
8	600104	上汽集团	146,339,747.85	4.37
9	600584	长电科技	136,854,530.95	4.08
10	000661	长春高新	121,955,273.44	3.64
11	600837	海通证券	119,229,859.02	3.56

12	000625	长安汽车	119,013,231.43	3.55
13	601299	中国北车	113,840,833.96	3.40
14	600690	青岛海尔	112,731,351.96	3.36
15	002373	联信永益	110,795,171.93	3.31
16	002229	鸿博股份	110,460,827.79	3.30
17	002111	威海广泰	109,716,699.20	3.27
18	000538	云南白药	107,734,873.12	3.22
19	600015	华夏银行	104,066,773.80	3.11
20	300296	利亚德	103,682,664.37	3.09
21	000895	双汇发展	93,221,529.63	2.78
22	601601	中国太保	92,153,953.78	2.75
23	601688	华泰证券	91,954,807.92	2.74
24	600999	招商证券	91,228,776.31	2.72
25	601600	中国铝业	91,179,161.72	2.72
26	000712	锦龙股份	88,610,945.81	2.64
27	600893	航空动力	88,560,100.73	2.64
28	300017	网宿科技	87,679,915.56	2.62
29	601098	中南传媒	86,207,943.86	2.57
30	002508	老板电器	86,206,989.23	2.57
31	601336	新华保险	84,627,589.16	2.53
32	300150	世纪瑞尔	82,179,841.00	2.45
33	300104	乐视网	80,893,944.11	2.41
34	600446	金证股份	79,929,556.21	2.39
35	600519	贵州茅台	78,901,467.40	2.35
36	600037	歌华有线	77,677,881.96	2.32
37	600674	川投能源	77,314,506.88	2.31
38	002410	广联达	75,752,655.17	2.26
39	300113	顺网科技	73,281,783.89	2.19
40	300002	神州泰岳	69,937,751.63	2.09
41	300024	机器人	69,762,458.39	2.08
42	002714	牧原股份	68,534,277.00	2.05
43	300219	鸿利光电	68,074,852.55	2.03

#### 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	10,619,972,179.81
卖出股票收入（成交）总额	10,528,551,973.77

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”

（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	138,076,453.80	3.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	582,313,000.00	16.80
	其中：政策性金融债	582,313,000.00	16.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	720,389,453.80	20.78

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	100209	10 国开 09	1,500,000	150,690,000.00	4.35
2	140218	14 国开 18	1,500,000	150,570,000.00	4.34
3	018002	国开 1302	963,720	103,069,854.00	2.97
4	140212	14 国开 12	700,000	70,308,000.00	2.03
5	100230	10 国开 30	500,000	50,450,000.00	1.46

## 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

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记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金报告期内未进行股票投资。

### 8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,362,768.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,978,413.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	9,369.54
8	其他	-
9	合计	16,350,551.15

### 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处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元



序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300010	立思辰	165,320,616.78	4.77	重大事项停牌
2	300296	利亚德	155,494,401.84	4.48	重大事项停牌
3	300003	乐普医疗	79,076,782.44	2.28	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。

## §8 投资组合报告(转型后)

### 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	3,050,432,083.45	69.19
	其中：股票	3,050,432,083.45	69.19
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	1,212,453,521.60	27.50
7	其他资产	145,599,050.75	3.30
8	合计	4,408,484,655.80	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	20,898,502.18	0.52
B	采矿业	110,272,724.12	2.73
C	制造业	1,036,520,636.66	25.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	86,985,564.06	2.15
E	建筑业	304,725,820.02	7.54
F	批发和零售业	131,212,720.25	3.25

G	交通运输、仓储和邮政业	158,773,827.82	3.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	71,733,502.62	1.77
J	金融业	746,827,065.63	18.48
K	房地产业	238,275,604.34	5.89
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	144,206,115.75	3.57
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	3,050,432,083.45	75.47

### 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

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	300296	利亚德	6,696,572	146,989,755.40	3.64
2	000002	万科A	7,101,557	98,711,642.30	2.44
3	600030	中信证券	2,554,149	86,585,651.10	2.14
4	600048	保利地产	7,877,122	85,230,460.04	2.11
5	000425	徐工机械	5,465,032	81,811,529.04	2.02
6	000786	北新建材	3,100,278	78,375,027.84	1.94
7	000069	华侨城A	9,395,447	77,512,437.75	1.92
8	601336	新华保险	1,507,488	74,711,105.28	1.85
9	601939	建设银行	10,955,640	73,731,457.20	1.82
10	000157	中联重科	10,247,700	72,348,762.00	1.79
11	600176	中国玻纤	4,642,717	71,822,831.99	1.78
12	300324	旋极信息	1,332,841	71,733,502.62	1.77
13	600036	招商银行	4,312,654	71,546,929.86	1.77
14	601318	中国平安	957,168	71,510,021.28	1.77
15	000883	湖北能源	8,579,466	71,295,362.46	1.76
16	601328	交通银行	10,158,318	69,076,562.40	1.71
17	000060	中金岭南	7,185,648	68,191,799.52	1.69

18	300070	碧水源	1,916,485	66,693,678.00	1.65
19	601398	工商银行	13,431,847	65,413,094.89	1.62
20	002207	准油股份	3,194,245	65,034,828.20	1.61
21	000100	TCL 集团	16,828,879	63,949,740.20	1.58
22	601998	中信银行	7,470,624	60,810,879.36	1.50
23	601989	中国重工	6,334,452	58,340,302.92	1.44
24	601555	东吴证券	2,472,853	55,441,364.26	1.37
25	600029	南方航空	10,732,464	55,379,514.24	1.37
26	601800	中国交建	3,954,331	54,925,657.59	1.36
27	600010	包钢股份	13,347,618	54,458,281.44	1.35
28	600115	东方航空	10,212,568	52,901,102.24	1.31
29	001696	宗申动力	6,506,978	51,860,614.66	1.28
30	601006	大秦铁路	4,736,699	50,493,211.34	1.25
31	300055	万邦达	1,086,850	48,484,378.50	1.20
32	600280	中央商场	3,274,545	47,153,448.00	1.17
33	600000	浦发银行	3,000,000	47,070,000.00	1.16
34	601669	中国电建	5,568,615	46,943,424.45	1.16
35	600259	广晟有色	813,924	45,237,895.92	1.12
36	600031	三一重工	4,445,694	44,368,026.12	1.10
37	002317	众生药业	2,227,678	42,771,417.60	1.06
38	601099	太平洋	3,000,000	42,660,000.00	1.06
39	002170	芭田股份	4,700,522	42,304,698.00	1.05
40	601668	中国建筑	5,726,215	41,686,845.20	1.03
41	002146	荣盛发展	2,600,200	41,265,174.00	1.02
42	002465	海格通信	2,095,428	40,483,668.96	1.00
43	601186	中国铁建	2,642,983	40,331,920.58	1.00
44	601369	陕鼓动力	4,387,484	38,171,110.80	0.94
45	002051	中工国际	1,365,235	37,298,220.20	0.92
46	601390	中国中铁	3,769,395	35,055,373.50	0.87
47	000411	英特集团	1,541,915	33,459,555.50	0.83
48	600122	宏图高科	4,102,313	29,413,584.21	0.73
49	000877	天山股份	2,776,379	28,457,884.75	0.70
50	600999	招商证券	1,000,000	28,270,000.00	0.70
51	002508	老板电器	771,278	25,143,662.80	0.62
52	600655	豫园商城	1,792,397	21,186,132.54	0.52
53	600108	亚盛集团	2,237,527	20,898,502.18	0.52
54	601158	重庆水务	1,762,944	15,690,201.60	0.39
55	600104	上汽集团	648,146	13,915,694.62	0.34
56	000024	招商地产	495,200	13,068,328.00	0.32

57	002085	万丰奥威	481,352	12,755,828.00	0.32
----	--------	------	---------	---------------	------

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601939	建设银行	160,044,822.25	3.96
2	600030	中信证券	120,331,836.10	2.98
3	601998	中信银行	120,023,561.04	2.97
4	600048	保利地产	115,201,820.49	2.85
5	600000	浦发银行	114,226,526.00	2.83
6	601989	中国重工	112,188,555.76	2.78
7	000069	华侨城 A	109,780,867.82	2.72
8	600765	中航重机	93,518,629.53	2.31
9	601336	新华保险	92,857,749.73	2.30
10	000002	万科 A	89,852,459.21	2.22
11	601328	交通银行	89,708,928.94	2.22
12	601857	中国石油	85,912,520.30	2.13
13	002051	中工国际	84,687,293.24	2.10
14	600115	东方航空	84,616,742.56	2.09
15	600028	中国石化	83,630,599.40	2.07
16	601318	中国平安	82,551,338.01	2.04
17	600016	民生银行	79,312,662.68	1.96
18	300070	碧水源	78,644,093.44	1.95
19	601668	中国建筑	77,250,001.11	1.91
20	600036	招商银行	76,035,785.76	1.88

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600133	东湖高新	157,868,805.54	3.91
2	300010	立思辰	128,305,885.29	3.17
3	601555	东吴证券	107,701,508.19	2.66
4	601939	建设银行	97,907,060.72	2.42
5	000333	美的集团	95,032,855.62	2.35

6	600000	浦发银行	89,605,453.87	2.22
7	601668	中国建筑	89,318,314.23	2.21
8	601688	华泰证券	88,766,302.90	2.20
9	601857	中国石油	87,860,063.90	2.17
10	002713	东易日盛	85,380,890.24	2.11
11	600016	民生银行	84,660,747.88	2.09
12	600028	中国石化	83,128,394.04	2.06
13	002496	辉丰股份	83,107,503.31	2.06
14	601989	中国重工	82,037,897.28	2.03
15	600325	华发股份	77,123,273.90	1.91
16	600153	建发股份	76,834,958.56	1.90
17	600397	安源煤业	73,560,293.42	1.82
18	000768	中航飞机	73,138,279.89	1.81
19	300003	乐普医疗	71,334,611.68	1.76
20	000709	河北钢铁	71,189,376.31	1.76

#### 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	6,247,827,086.32
卖出股票收入（成交）总额	6,466,668,721.29

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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

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记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 8.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金报告期内未进行股票投资。

### 8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,815,573.78
2	应收证券清算款	140,817,254.35
3	应收股利	-
4	应收利息	105,021.42
5	应收申购款	1,861,201.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	145,599,050.75

#### 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处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300296	利亚德	146,989,755.40	3.64	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(转型前)

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
36,125	83,044.98	2,186,329,052.00	72.88%	813,670,948.00	27.12%

#### 9.2 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	中国人寿保险(集团)公司	399,475,771.00	13.32%
2	中国人寿保险股份有限公司	277,741,079.00	9.26%
3	泰康人寿保险股份有限公司-分红-个人分红-019L-FH002 深	200,995,756.00	6.70%
4	伦敦市投资管理有限公司-客户资金	114,837,631.00	3.83%
5	国泰君安证券股份有限公司	113,545,038.00	3.78%
6	幸福人寿保险股份有限公司-分红	91,770,218.00	3.06%
7	中国太保集团股份有限公司-本级-集团自有资金-012G-ZY001 深	91,067,957.00	3.04%

8	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	89,141,309.00	2.97%
9	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品	83,560,523.00	2.79%
10	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	74,817,220.00	2.49%

### 9.3 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	-	-

### 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关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 基金份额持有人信息(转型后)

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
40,181	94,371.22	2,568,493,962.45	67.74%	1,223,435,818.71	32.26%

### 9.2 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	中国人寿保险（集团）公司	498,542,751.00	19.76%
2	中国人寿保险股份有限公司	307,394,088.00	12.19%
3	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	143,316,498.00	5.68%
4	幸福人寿保险股份有限公司—分红	114,528,540.00	4.54%



5	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品	104,282,903.00	4.13%
6	阳光财产保险股份有限公司—自有资金	69,936,433.00	2.77%
7	中国平安保险(集团)股份有限公司	62,715,693.00	2.49%
8	新华人寿保险股份有限公司	23,724,383.00	0.94%
9	阳光人寿保险股份有限公司—万能保险产品	23,188,259.00	0.92%
10	阳光人寿保险股份有限公司—传统保险产品	22,520,326.00	0.89%

### 9.3 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	102,079.10	0.00%

### 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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年11月5日)基金份额总额	3,000,000,000.00
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	622,391,311.75
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	574,438,545.59
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	743,977,389.00
报告期期末基金份额总额	3,791,930,155.16

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

2014 年 10 月 10 日至 2014 年 10 月 30 日，同盛证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议了《关于同盛证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括同盛证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市，调整投资目标、范围和策略以及修订基金合同等。上述议案经基金份额持有人大会表决通过，并形成了基金份额持有人大会决议，自表决通过之日（即 2014 年 10 月 31 日）生效。依据基金份额持有人大会决议，基金管理人向深圳证券交易所申请基金终止上市，自基金终止上市之日起，原《同盛证券投资基金基金合同》失效，《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，基金正式转型为开放式基金，存续期限调整为不定期，基金投资目标、范围和策略调整，同时基金更名为“长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。

### 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

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2014 年 4 月 21 日起，侯继雄同志不再兼任同盛证券投资基金基金经理。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

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

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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

根据同盛证券投资基金基金份额持有人大会基金份额持有人大会决议，自 2014 年 10 月 31 日起，《同盛证券投资基金基金合同》失效且《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，同盛证券投资基金的投资策略相应调整。

调整后的投资策略要点为：“本基金将首先参考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围，通过深入分析上述指标与因素，动态调整基金资产在股票、股指期货、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。股票投资上，本基金将充分发挥基金管理人研究和投资的团队能力，以深入扎实的研究为基础，聚焦经济转型、产业升级、模式创新、政策热点等板块，将“自上而下优选行业”与“自下而上精选个股”相结合，将定性分析与定量分析相结合，寻找和布局未来增长预期良好、估值合理的上市公司，并审慎选择投资时机和介入时点，为投资者实现资产长期增值。债券投资上，本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。股指期货投资上，本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。”

调整后的投资策略详见 2014 年 11 月 3 日发布在基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上的《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和 2014 年 11 月 14 日发布的《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内本基金未更换会计师事务所，报告期内共支付安永华明会计师事务所审计费用 95,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 15 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（转型后）

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

长江证券	2	1,509,438,874.14	11.87%	1,374,194.12	11.87%	-
东北证券	1	3,610,150,146.90	28.39%	3,286,670.95	28.39%	-
国信证券	1	552,661,312.37	4.35%	503,141.05	4.35%	-
银河证券	2	2,335,050,456.74	18.37%	2,125,829.37	18.37%	-
招商证券	1	1,893,950,099.61	14.90%	1,724,254.90	14.90%	-
中信证券	2	2,813,244,917.85	22.13%	2,561,178.39	22.13%	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	138,558,733.90	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

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

务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

- (2) 资力雄厚，信誉良好。
- (3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。
- (5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需 要，并能为本公司基金提供全面的信息服 务。

## 2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；
- (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；
- (3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；
- (4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；
- (5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；
- (6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

## 3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	联讯证券	上海	1

- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

### 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	

银河证券	28,361,615,949.04	39.58%	7,612,418.55	39.58%	-
国泰君安	23,310,197,214.45	15.67%	3,013,605.53	15.67%	-
国元证券	22,378,670,280.89	11.26%	2,165,537.29	11.26%	-
东北证券	12,046,206,301.28	9.69%	1,862,859.26	9.69%	-
齐鲁证券	12,000,570,796.49	9.47%	1,821,321.62	9.47%	-
招商证券	11,801,672,077.82	8.53%	1,640,246.08	8.53%	-
国信证券	1 924,395,717.71	4.38%	841,566.52	4.38%	-
长江证券	2 304,156,325.38	1.44%	276,904.80	1.44%	-
中原证券	1 -	-	-	-	-
东方证券	1 -	-	-	-	-
中航证券	1 -	-	-	-	-
海通证券	1 -	-	-	-	-
中信证券	2 -	-	-	-	-

### 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
银河证券	118,801,868.00	8.58%	167,000,000.00	1.56%	-	-
国泰君安	200,307,718.20	14.47%	1,647,000,000.00	15.36%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	7,544,615.60	0.54%	6,363,500,000.00	59.36%	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	861,163,489.90	62.20%	1,646,000,000.00	15.35%	-	-
长江证券	196,747,845.70	14.21%	897,000,000.00	8.37%	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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务。

## 2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；
- (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；
- (3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；
- (4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；
- (5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；
- (6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

## 3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无。

## 11.8 其他重大事件（转型后）

除上述事项外，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项如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）集中申购期基金份额集中申购公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》及本公司网站	2014年11月14日
2	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）集中申购期基金份额上网发售提	同上	2014年11月17日

	示性公告		
3	关于同盛证券投资基金转换所得长盛同盛成长优选灵活配置混合型基金（LOF）基金份额折算的公告	同上	2014 年 11 月 28 日
4	长盛同盛成长优选灵活配置混合型基金（LOF）集中申购结果暨基金份额折算结果的公告	同上	2014 年 12 月 5 日
5	长盛同盛成长优选灵活配置混合型基金（LOF）基金份额上市交易公告书	同上	2014 年 12 月 23 日
6	长盛同盛成长优选灵活配置混合型基金（LOF）开放日常申购 赎回转换及定期定额投资业务的公告	同上	2014 年 12 月 23 日
7	关于同盛成长优选灵活配置混合型基金发起人基金份额转流通的公告	同上	2014 年 12 月 24 日
8	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
9	长盛同盛成长优选灵活配置混合型基金（LOF）基金份额上市交易提示性公告	同上	2014 年 12 月 26 日
10	关于长盛同盛成长优选灵活配置混合型基金（LOF）开通跨系统转托管业务的公告	同上	2014 年 12 月 26 日
11	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

### 11.8 其他重大事件（转型前）

除上述事项外，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项如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	同盛证券投资基金 2013 年度收益分配公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》及本公司网站	2014 年 3 月 21 日
2	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



3	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
4	关于调整同盛证券投资基金基金经理的公告	同上	2014 年 4 月 23 日
5	关于同盛证券投资基金变更基金份额持有人大会会议召开方式并修改基金合同的公告	同上	2014 年 6 月 6 日
6	同盛证券投资基金关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告	同上	2014 年 9 月 30 日
7	同盛证券投资基金关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告	同上	2014 年 10 月 8 日
8	同盛证券投资基金关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告	同上	2014 年 10 月 9 日
9	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
10	同盛证券投资基金 2014 年度收益分配公告	同上	2014 年 10 月 28 日
11	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
12	关于同盛证券投资基金自持有人大会计票日停牌的提示性公告	同上	2014 年 10 月 31 日
13	同盛证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	同上	2014 年 11 月 3 日
14	同盛证券投资基金终止上市公告	同上	2014 年 11 月 3 日
15	同盛证券投资基金终止上市的提示性公告	同上	2014 年 11 月 4 日

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

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

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《同盛证券投资基金基金合同》；
- 3、《同盛证券投资基金托管协议》；
- 4、《同盛证券投资基金招募说明书》；
- 5、《关于准予同盛证券投资基金变更注册的批复》
- 6、《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 7、《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 8、《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 9、法律意见书；
- 10、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 11、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金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