

上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 27 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3 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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	37
7.7 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.....	37
7.8 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.....	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	38

§8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	40
§9 开放式基金份额变动	40
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	43
§11 备查文件目录	43
11.1 备查文件目录.....	43
11.2 存放地点.....	44
11.3 查阅方式.....	44

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	长盛上证市值百强 ETF
基金主代码	510700
交易代码	510700
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 4 月 24 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	6,213,677.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013-05-31

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	叶金松	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	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,200,910.10
本期利润	3,392,404.23
加权平均基金份额本期利润	0.4786
本期加权平均净值利润率	15.58%
本期基金份额净值增长率	21.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	9,234,860.94
期末可供分配基金份额利润	1.4862
期末基金资产净值	20,410,432.27
期末基金份额净值	3.285
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	82.65%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-7.96%	3.26%	-8.42%	3.46%	0.46%	-0.20%
过去三个月	8.52%	2.49%	6.19%	2.61%	2.33%	-0.12%
过去六个月	21.76%	2.26%	16.56%	2.35%	5.20%	-0.09%
过去一年	107.12%	1.89%	99.81%	1.97%	7.31%	-0.08%
自基金合同生效起至今	82.65%	1.57%	73.91%	1.64%	8.74%	-0.07%

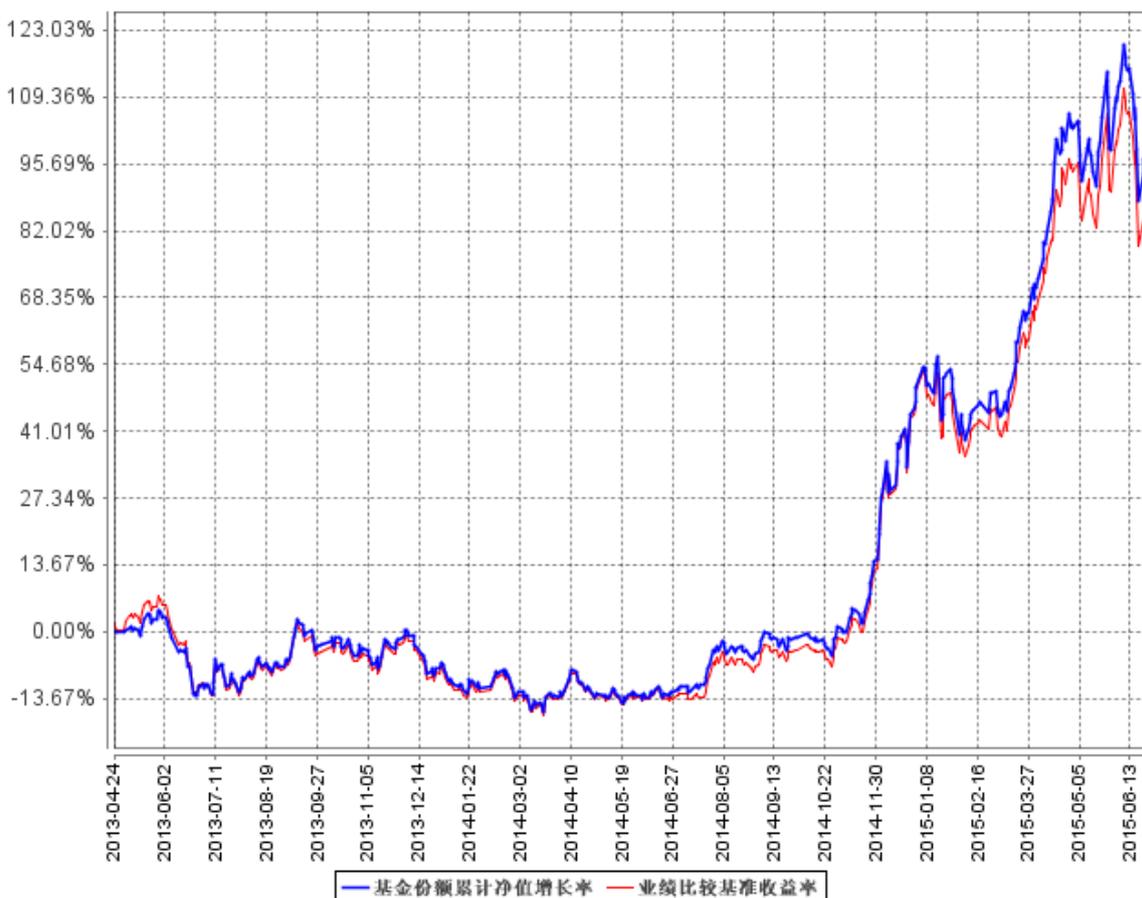
注：本基金业绩比较基准=上证市值百强指数

上证市值百强指数是由上海证券交易所授权、中证指数有限公司编制并发布的中国 A 股市场指数。该指数从市值管理的角度，综合反映上证全指中市值最大、成交最活跃的 100 只股票的整体表现。

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 100%比例采取再平衡，并计算基准指数的时间序列。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十七条（二）投资范围、（八）投资禁止行为与限制的有关约定。截止报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于1999年3月26日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币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 2015 年 6 月 30 日，基金管理人共管理三十九只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵宏宇	本基金基金经理，长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2013 年 4 月 24 日	-	8 年	男，1972 年 6 月出生，中国国籍。四川大学工商管理学院管理学（金融投资研究方向）博士。历任美国晨星公司投资顾问部门数量分析师，招商银行博士后工作站博士后研究员。2007 年 8 月加入长盛基金管理公司，历任金融工程研究员、产品开发经理，首席产品开发师，金融工程与量化投资部副总监、长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理等职务。现任上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金（本基金）基金经理，长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的

相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为上证市值百强指数，由上海证券交易所规模大、流动性好、最具代表性的 100 只股票组成，综合反映上海证券交易所最具市场影响力的市值龙头企业的整体状况。本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

2015 年上半年度上证市场市值较大的蓝筹股票在普涨行情的带动下表现较好，对本基金净值增长带来较好正面贡献。本基金在基金合同允许的投资范围内，最大程度投资并跟踪分享蓝筹股票市值增长的红利。在报告期内操作中，基金管理人严格遵守基金合同，在成分股权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末（2015 年 6 月 30 日），本基金份额净值为 3.285 元，本报告期份额净值增长率为 21.76%，同期业绩比较基准增长率为 16.56%。本报告期内日均跟踪偏离度绝对值均值为 0.17%，年化跟踪误差为 2.30%，控制在投资目标之内。本基金与标的指数产生偏离的主要原因成份股分红、日常运作费用以及替代性策略产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为股票市场受益于经济短期回暖与政策利好预期，以及政策对各项经济改革的具体实施驱动，预期 2015 年下半年的政策驱动的市场行情有望在调整过程继续得以延续。特别是随着新的一年各项经济改革及稳增长政策的逐步推进，上证市值百强所代表的大盘蓝筹价值股票投资价值突显，预期还会有一定上涨空间。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、

估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第二十二条中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2015 年 6 月 30 日，期末可供分配收益为 9,234,860.94 元，未分配收益已实现部分为 13,686,651.39 元，未分配收益未实现部分为-4,451,790.45 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内自 2015 年 2 月 12 日至 2015 年 5 月 12 日及 2015 年 5 月 14 日至 2015 年 7 月 16 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§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”）在上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,175,506.72	799,876.09
结算备付金		42,257.76	22,977.08
存出保证金		290.36	2,482.26
交易性金融资产	6.4.7.2	19,359,490.16	24,375,610.56
其中：股票投资		19,352,224.66	24,375,610.56
基金投资		-	-
债券投资		7,265.50	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	265.00	178.46
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		20,577,810.00	25,201,124.45

负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,294.81	13,899.01
应付托管费		1,858.97	2,779.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	9,028.76	6,845.15
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	147,195.19	320,000.00
负债合计		167,377.73	343,523.97
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	11,175,571.33	16,571,203.26
未分配利润	6.4.7.10	9,234,860.94	8,286,397.22
所有者权益合计		20,410,432.27	24,857,600.48
负债和所有者权益总计		20,577,810.00	25,201,124.45

注：报告截止日2015年6月30日，基金份额净值3.285元，基金份额总额6,213,677.00份。

6.2 利润表

会计主体：上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
一、收入		3,672,236.92	-4,232,792.88
1.利息收入		3,200.88	4,866.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,200.46	4,858.57
债券利息收入		0.42	7.47
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）		9,473,373.62	-5,287,021.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,317,540.66	-6,160,585.32

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	1,970.33
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	155,832.96	871,593.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,808,505.87	1,043,935.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,168.29	5,427.04
减：二、费用		279,832.69	549,114.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	53,551.87	200,151.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,710.35	40,030.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	17,767.65	19,740.84
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	197,802.82	289,191.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,392,404.23	-4,781,907.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,392,404.23	-4,781,907.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	16,571,203.26	8,286,397.22	24,857,600.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,392,404.23	3,392,404.23
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）	-5,395,631.93	-2,443,940.51	-7,839,572.44

列)			
其中：1. 基金申购款	66,546,127.09	48,818,557.66	115,364,684.75
2. 基金赎回款	-71,941,759.02	-51,262,498.17	-123,204,257.19
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）	11,175,571.33	9,234,860.94	20,410,432.27
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	102,901,314.00	-6,331,668.52	96,569,645.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,781,907.25	-4,781,907.25
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）	-16,186,895.84	880,350.26	-15,306,545.58
其中：1. 基金申购款	122,300,990.18	-15,359,715.14	106,941,275.04
2. 基金赎回款	-138,487,886.02	16,240,065.40	-122,247,820.62
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）	86,714,418.16	-10,233,225.51	76,481,192.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵

基金管理人负责人

杨思乐

主管会计工作负责人

龚珉

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第125号《关于核准上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共

和《证券投资基金法》和《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 622,671,073.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所有限公司（事务所的性质已变更为特殊普通合伙）普华永道中天验字(2013)第 211 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 4 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 622,680,523.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,450.00 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

为了与上证市值百强指数进行对比，根据《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，长盛基金管理有限公司确定 2013 年 5 月 15 日为本基金的基金份额折算日。当日上证市值百强指数收盘值为 1,791.807 点，本基金资产净值为 620,348,678.96 元，折算前基金份额总额为 622,680,523.00 份，折算前基金份额净值为 0.996 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.55600584，折算后基金份额总额为 346,213,677.00 份，折算后基金份额净值为 1.792 元。长盛基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司于 2013 年 5 月 16 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证基字[2013]第 128 号文审核同意，本基金 346,213,677.00 份基金份额于 2013 年 5 月 31 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的主要投资范围为标的指数上证市值百强指数的成份股和备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的 90%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于部分非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、一级市场股票(包括首次公开发行或增发)、债券资产、回购、银行存款、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：上证市值百强指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》

、《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会及中国证券投资基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金自 2015 年 3 月 24 日起按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

除上述事项外，本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金自 2015 年 3 月 24 日起采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局颁布的财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券

的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	1,175,506.72
定期存款	-
其他存款	-
合计：	1,175,506.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	19,992,900.14	19,352,224.66	-640,675.48
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,265.50	2,265.50
	银行间市场	-	-
	合计	7,265.50	2,265.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	19,997,900.14	19,359,490.16	-638,409.98

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	247.21
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	17.28
应收债券利息	0.42
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.09
合计	265.00

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	9,028.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,028.76

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	97,195.19
应付指数使用费	50,000.00
合计	147,195.19

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,213,677.00	16,571,203.26
本期申购	37,000,000.00	66,546,127.09
本期赎回(以“-”号填列)	-40,000,000.00	-71,941,759.02
本期末	6,213,677.00	11,175,571.33

6.4.7.10 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	6,468,366.37	1,818,030.85	8,286,397.22
本期利润	9,200,910.10	-5,808,505.87	3,392,404.23
本期基金份额交易产生的变动数	-1,982,625.08	-461,315.43	-2,443,940.51
其中：基金申购款	55,182,582.92	-6,364,025.26	48,818,557.66
基金赎回款	-57,165,208.00	5,902,709.83	-51,262,498.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,686,651.39	-4,451,790.45	9,234,860.94

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	3,019.20
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	174.33
其他	6.93
合计	3,200.46

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,072,130.40
股票投资收益——赎回差价收入	7,245,410.26
合计	9,317,540.66

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	6,388,987.71
减：卖出股票成本总额	4,316,857.31
买卖股票差价收入	2,072,130.40

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
赎回基金份额对价总额	123,204,257.19
减：现金支付赎回款总额	4,549,524.19
减：赎回股票成本总额	111,409,322.74
赎回差价收入	7,245,410.26

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期未取得债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期未取得衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	155,832.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	155,832.96

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,808,505.87
——股票投资	-5,810,771.37
——债券投资	2,265.50
——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	-5,808,505.87

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	4,168.29
合计	4,168.29

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	17,767.65
银行间市场交易费用	-
合计	17,767.65

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	22,811.43
信息披露费	44,630.98
上市费	29,752.78
指数使用费	100,000.00
银行汇划费用	607.63
合计	197,802.82

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金未开立关联方交易单元。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	53,551.87	200,151.34
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,710.35	40,030.31

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.4.10.3 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无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人于本报告期及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年末无投资本基金的情况。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年6月30日		2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,175,506.72	3,019.20	2,499,663.18	4,672.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期无因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量（股）	期末	期末估值	备注
----	----	----	----	----	----	----	-------	----	------	----

代码	名称	日期	原因	估值单价	日期	开盘单价		成本总额	总额	
600886	国投电力	2015年6月24日	重大事项停牌	14.87	-	-	10,200	139,247.04	151,674.00	-
600900	长江电力	2015年6月15日	重大事项停牌	14.35	-	-	16,200	223,407.96	232,470.00	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由法律监察稽核部负责，投资风险分析与绩效评估由独立的投资风险评估人员负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行 中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的债券资产余额占基金资产净值的比例为 0.04%，因此不存在重大信用风险(2014 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 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，其余均能以合理的价格适时变现。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投资的公允价值。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不付息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,175,506.72	-	-	-	1,175,506.72
结算备付金	42,257.76	-	-	-	42,257.76
存出保证金	290.36	-	-	-	290.36
交易性金融资产	-	-	7,265.50	19,352,224.66	19,359,490.16
应收利息	-	-	-	265.00	265.00
资产总计	1,218,054.84	-	7,265.50	19,352,489.66	20,577,810.00
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	9,294.81	9,294.81
应付托管费	-	-	-	1,858.97	1,858.97
应付交易费用	-	-	-	9,028.76	9,028.76
其他负债	-	-	-	147,195.19	147,195.19
负债总计	-	-	-	167,377.73	167,377.73
利率敏感度缺口	1,218,054.84	-	7,265.50	19,185,111.93	20,410,432.27
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	799,876.09	-	-	-	799,876.09
结算备付金	22,977.08	-	-	-	22,977.08
存出保证金	2,482.26	-	-	-	2,482.26

交易性金融资产	-	-	-	24,375,610.56	24,375,610.56
应收利息	-	-	-	178.46	178.46
资产总计	825,335.43	-	-	24,375,789.02	25,201,124.45
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	13,899.01	13,899.01
应付托管费	-	-	-	2,779.81	2,779.81
应付交易费用	-	-	-	6,845.15	6,845.15
其他负债	-	-	-	320,000.00	320,000.00
负债总计	-	-	-	343,523.97	343,523.97
利率敏感度缺口	825,335.43	-	-	24,032,265.05	24,857,600.48

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 6 月 30 日，基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.04%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪上证市值百强指数为原则，进行指数化长期投资，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象，指数化投资比例即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%；也可少量投资于部分非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、一级市场股票（包括首次公开发行或增发）、债券资产、回购、银行存款、权证以及法

律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014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	19,352,224.66	94.82	24,375,610.56	98.06
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	19,352,224.66	94.82	24,375,610.56	98.06

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	业绩比较基准上升5	979,700.75	1,209,553.14
业绩比较基准下降5	-979,700.75	-1,209,553.14	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2015年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属

于第一层次的余额为 18,975,346.16 元，属于第二层次的余额为 384,144.00 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 23,448,091.56 元，第二层次 927,519.00 元，无第三层次)。于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2014 年 12 月 31 日：同)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 24 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 基金申购款

于 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 115,364,684.75 元，其中包括以股票支付的申购款 110,085,679.64 元和以现金支付的申购款 5,279,005.11 元。

(3) 除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	19,352,224.66	94.04
	其中：股票	19,352,224.66	94.04
2	固定收益投资	7,265.50	0.04
	其中：债券	7,265.50	0.04
	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	1,217,764.48	5.92
7	其他各项资产	555.36	0.00
8	合计	20,577,810.00	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	84,936.00	0.42
B	采矿业	1,080,781.26	5.30
C	制造业	4,597,976.60	22.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	593,244.00	2.91
E	建筑业	1,199,436.00	5.88
F	批发和零售业	154,830.00	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	429,438.00	2.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	992,296.00	4.86
J	金融业	9,777,119.80	47.90
K	房地产业	400,956.00	1.96
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	41,211.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	19,352,224.66	94.82

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	16,300	1,335,622.00	6.54
2	600036	招商银行	54,600	1,022,112.00	5.01
3	600016	民生银行	74,520	740,728.80	3.63
4	600030	中信证券	24,000	645,840.00	3.16
5	600000	浦发银行	37,000	627,520.00	3.07
6	601166	兴业银行	34,800	600,300.00	2.94
7	600837	海通证券	24,600	536,280.00	2.63
8	601766	中国中车	27,680	508,204.80	2.49
9	601328	交通银行	51,600	425,184.00	2.08
10	601398	工商银行	73,800	389,664.00	1.91
11	601668	中国建筑	45,600	378,936.00	1.86
12	601989	中国重工	24,000	355,200.00	1.74
13	600887	伊利股份	18,600	351,540.00	1.72
14	601169	北京银行	25,800	343,656.00	1.68
15	601818	光大银行	60,600	324,816.00	1.59
16	600519	贵州茅台	1,200	309,180.00	1.51
17	601288	农业银行	80,500	298,655.00	1.46
18	601601	中国太保	9,600	289,728.00	1.42
19	601390	中国中铁	21,000	287,490.00	1.41
20	601006	大秦铁路	18,000	252,720.00	1.24
21	601688	华泰证券	10,200	235,926.00	1.16
22	600900	长江电力	16,200	232,470.00	1.14
23	600104	上汽集团	10,200	230,520.00	1.13
24	600518	康美药业	12,800	226,944.00	1.11
25	600048	保利地产	19,800	226,116.00	1.11
26	600028	中国石化	31,800	224,508.00	1.10
27	600015	华夏银行	14,400	219,024.00	1.07
28	600637	东方明珠	5,075	213,556.00	1.05
29	600795	国电电力	30,000	209,100.00	1.02
30	601939	建设银行	28,800	205,344.00	1.01

31	600570	恒生电子	1,800	201,690.00	0.99
32	600999	招商证券	7,200	190,512.00	0.93
33	600050	中国联通	25,800	189,114.00	0.93
34	600276	恒瑞医药	4,120	183,504.80	0.90
35	601857	中国石油	15,000	169,950.00	0.83
36	601377	兴业证券	12,000	164,280.00	0.80
37	600109	国金证券	6,600	161,040.00	0.79
38	600705	中航资本	6,600	152,790.00	0.75
39	600886	国投电力	10,200	151,674.00	0.74
40	601628	中国人寿	4,800	150,336.00	0.74
41	601186	中国铁建	9,600	150,048.00	0.74
42	601901	方正证券	12,600	149,814.00	0.73
43	601899	紫金矿业	28,800	147,456.00	0.72
44	601336	新华保险	2,400	146,544.00	0.72
45	600690	青岛海尔	4,800	145,584.00	0.71
46	600010	包钢股份	26,500	137,535.00	0.67
47	601727	上海电气	9,000	134,370.00	0.66
48	601669	中国电建	11,600	131,544.00	0.64
49	600703	三安光电	4,200	131,460.00	0.64
50	600019	宝钢股份	15,000	131,100.00	0.64
51	600585	海螺水泥	6,000	128,700.00	0.63
52	601088	中国神华	6,000	125,100.00	0.61
53	600111	北方稀土	6,600	119,724.00	0.59
54	600271	航天信息	1,800	116,478.00	0.57
55	600089	特变电工	7,800	115,518.00	0.57
56	600221	海南航空	18,000	115,020.00	0.56
57	600100	同方股份	5,400	113,346.00	0.56
58	600839	四川长虹	11,400	112,176.00	0.55
59	600588	用友网络	2,400	110,112.00	0.54
60	601618	中国中冶	15,000	108,450.00	0.53
61	600804	鹏博士	3,600	107,496.00	0.53
62	600196	复星医药	3,600	104,184.00	0.51
63	600118	中国卫星	1,800	102,528.00	0.50
64	600352	浙江龙盛	7,200	102,024.00	0.50
65	600583	海油工程	6,000	99,960.00	0.49
66	600256	广汇能源	9,600	99,840.00	0.49
67	600031	三一重工	10,200	98,838.00	0.48
68	600893	中航动力	1,800	95,670.00	0.47
69	601099	太平洋	7,200	93,024.00	0.46

70	600150	中国船舶	1,800	92,700.00	0.45
71	600340	华夏幸福	3,000	91,350.00	0.45
72	600535	天士力	1,800	89,568.00	0.44
73	600739	辽宁成大	3,600	88,020.00	0.43
74	600406	国电南瑞	4,200	86,898.00	0.43
75	601555	东吴证券	4,200	85,974.00	0.42
76	600958	东方证券	3,000	85,860.00	0.42
77	601800	中国交建	4,800	84,288.00	0.41
78	600383	金地集团	6,600	83,490.00	0.41
79	600369	西南证券	4,200	82,530.00	0.40
80	601998	中信银行	9,600	74,016.00	0.36
81	600309	万华化学	3,000	72,540.00	0.36
82	600688	上海石化	6,600	70,818.00	0.35
83	601607	上海医药	3,000	66,810.00	0.33
84	600372	中航电子	1,800	62,874.00	0.31
85	600332	白云山	1,800	62,028.00	0.30
86	600018	上港集团	7,800	61,698.00	0.30
87	600547	山东黄金	2,400	59,280.00	0.29
88	601117	中国化学	6,000	58,680.00	0.29
89	600489	中金黄金	4,298	55,315.26	0.27
90	600718	东软集团	2,400	52,152.00	0.26
91	600362	江西铜业	2,400	51,624.00	0.25
92	601808	中海油服	1,800	50,292.00	0.25
93	600108	亚盛集团	4,800	49,728.00	0.24
94	601225	陕西煤业	6,000	49,080.00	0.24
95	600316	洪都航空	1,200	41,496.00	0.20
96	601928	凤凰传媒	2,410	41,211.00	0.20
97	601118	海南橡胶	3,600	35,208.00	0.17
98	603000	人民网	600	31,278.00	0.15

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	521,559.00	2.10

2	600999	招商证券	466,764.00	1.88
3	600016	民生银行	403,134.00	1.62
4	601939	建设银行	201,024.00	0.81
5	601727	上海电气	190,800.00	0.77
6	600000	浦发银行	184,022.00	0.74
7	601318	中国平安	162,010.00	0.65
8	601618	中国中冶	142,050.00	0.57
9	600519	贵州茅台	141,766.00	0.57
10	600019	宝钢股份	141,600.00	0.57
11	601398	工商银行	128,099.00	0.52
12	601989	中国重工	126,210.00	0.51
13	600028	中国石化	125,820.00	0.51
14	600588	用友网络	125,104.00	0.50
15	600221	海南航空	117,360.00	0.47
16	600958	东方证券	116,100.00	0.47
17	600369	西南证券	105,210.00	0.42
18	601169	北京银行	103,704.00	0.42
19	600839	四川长虹	96,940.00	0.39
20	601688	华泰证券	96,232.00	0.39

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601766	中国中车	852,234.00	3.43
2	601299	中国北车	724,514.00	2.91
3	600016	民生银行	481,526.00	1.94
4	601186	中国铁建	330,868.00	1.33
5	600804	鹏博士	303,393.00	1.22
6	600705	中航资本	287,450.00	1.16
7	600030	中信证券	207,905.00	0.84
8	600519	贵州茅台	160,695.00	0.65
9	600383	金地集团	125,832.00	0.51
10	600023	浙能电力	112,362.30	0.45
11	600332	白云山	109,697.00	0.44
12	600000	浦发银行	107,446.00	0.43
13	600880	博瑞传播	90,680.00	0.36
14	601088	中国神华	90,492.00	0.36

15	600340	华夏幸福	72,204.00	0.29
16	600827	百联股份	71,808.00	0.29
17	601989	中国重工	69,371.96	0.28
18	600111	北方稀土	69,360.00	0.28
19	600048	保利地产	65,604.00	0.26
20	600837	海通证券	62,985.00	0.25

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,427,885.88
卖出股票收入（成交）总额	6,388,987.71

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	7,265.50	0.04
8	其他	-	-
9	合计	7,265.50	0.04

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	110031	航信转债	50	7,265.50	0.04

注：本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

- 1、本基金跟踪的标的指数为上证市值百强指数，配置了上证市值百强指数成分股海通证券。

根据 2015 年 1 月 16 日中国证券监督管理委员会 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，对海通证券采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

- 2、本基金跟踪的标的指数为上证市值百强指数，配置了上证市值百强指数成分股中国平安。

根据 2014 年 12 月 8 日中国证券监督管理委员会发布对该公司控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》，决定对平安证

券给予警告，没收保荐业务收入 400 万元，没收承销股票违法所得 2867 万元，并处以 440 万元罚款。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

3、本基金跟踪的标的指数为上证市值百强指数，配置了上证市值百强指数成分股中信证券。

根据 2015 年 1 月 16 日中国证券监督管理委员会 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，对中信证券采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

4、本基金跟踪的标的指数为上证市值百强指数，配置了上证市值百强指数成分股兴业银行。根据 2015 年 6 月 9 日兴业银行公告“2015 年 5 月中旬，公司南宁分行下辖二级分行北海分行接到北海市公安局通报，该分行前员工苏瑜涉嫌个人非法集资已被立案，目前案件在调查阶段。公司南宁以及北海两级分行成立专项调查小组，就其涉及业务进行了全面内部排查，未发现银行资金卷入其中。目前，公司北海分行经营、财务状况与对外服务均正常。”本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	290.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	265.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	555.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
280	22,191.70	3,090,551.00	49.74%	3,123,126.00	50.26%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中信证券股份有限公司	2,994,383.00	48.19%
2	王美华	162,020.00	2.61%
3	杨京陵	140,113.00	2.25%
4	阮伟红	116,943.00	1.88%
5	孙颖	97,000.00	1.56%
6	朱云菁	75,969.00	1.22%
7	何舟良	72,000.00	1.16%
8	张福顺	69,172.00	1.11%
9	张秀珍	65,490.00	1.05%
10	翁长康	64,042.00	1.03%

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	-	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年4月24日）基金份额总额	622,680,523.00
本报告期期初基金份额总额	9,213,677.00
本报告期基金总申购份额	37,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	40,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	6,213,677.00

§10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况**

根据公司第六届董事会第七次会议决议，公司聘任林培富、王宁、蔡宾担任公司副总经理；聘任孙杰、刁俊东为公司高管人员。以上三名副总经理于2015年4月22日通过中国证券投资基金业协会（以下简称基金业协会）组织的高级管理人员证券投资法律知识考试，公司已及时向基金业协会进行备案。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	11,719,437.83	100.00%	10,669.50	100.00%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	5,000.00	100.00%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

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

10.8 其他重大事件

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

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	《证券时报》及本公司网站	2015年5月28日
2	上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2015年5月28日
3	长盛基金管理有限公司关于子公	同上	2015年5月15日

	司法定代表人、执行董事及高管变更情况的公告		
4	长盛基金管理有限公司关于新任副总经理的公告	同上	2015 年 4 月 24 日
5	关于上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金新增中原证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	同上	2015 年 2 月 3 日

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 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。

11.3 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 8 月 27 日