

# 长盛中证 100 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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.....	12
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.....	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
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
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
7.7 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.....	38
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	38
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	41
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
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.....	44
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>45</b>
11.1 备查文件目录.....	45
11.2 存放地点.....	45
11.3 查阅方式.....	45

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛中证 100 指数证券投资基金
基金简称	长盛中证 100 指数
基金主代码	519100
交易代码	519100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 22 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	478,272,859.46 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在 4% 以下，以实现跟踪指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，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。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率 $\times$ 95% + 一年期银行储蓄存款利率（税后） $\times$ 5%
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，风险中等，将获得证券市场平均收益率。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略，在投资管理上将最大限度的分散非系统性风险。对于跟踪误差的风险，本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	林葛
	联系电话	010-82019988	010-66060069
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95599
传真		010-82255988	010-68121816
注册地址		深圳市福田区福中三	北京市东城区建国门内大街

	路诺德金融中心主楼 10D	69 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	北京复兴门内大街 28 号凯晨世 贸中心东座 9 层世贸中心东座 F9
邮政编码	100088	100031
法定代表人	高新	刘士余

## 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》
登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	225,745,755.62
本期利润	145,068,778.96
加权平均基金份额本期利润	0.2037
本期加权平均净值利润率	17.83%
本期基金份额净值增长率	16.83%
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	102,770,173.39
期末可供分配基金份额利润	0.2149
期末基金资产净值	581,043,032.85
期末基金份额净值	1.2149
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	98.96%

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

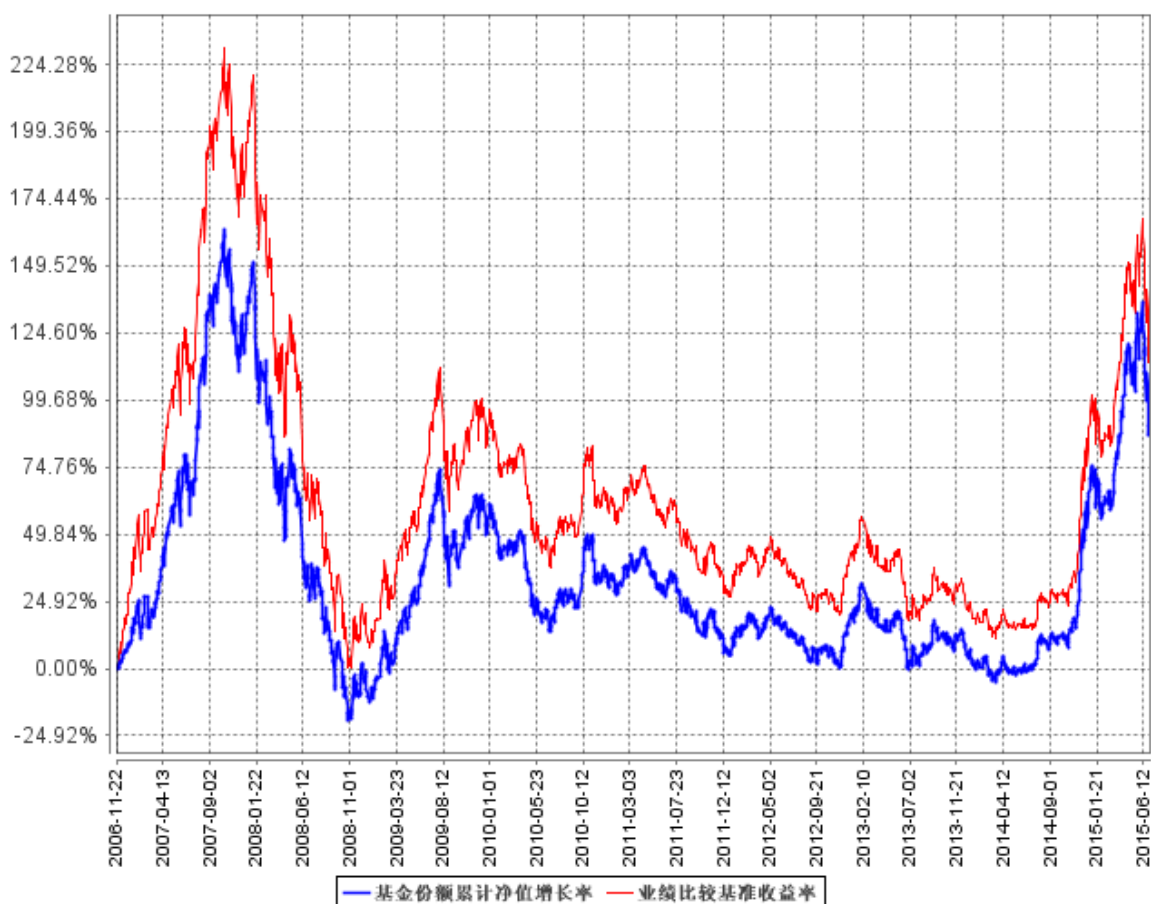
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.35%	3.25%	-6.01%	3.22%	-1.34%	0.03%
过去三个月	8.08%	2.51%	8.06%	2.45%	0.02%	0.06%
过去六个月	16.83%	2.25%	16.64%	2.22%	0.19%	0.03%
过去一年	98.49%	1.89%	96.19%	1.86%	2.30%	0.03%
过去三年	75.40%	1.50%	67.65%	1.48%	7.75%	0.02%
自基金合同生效起至今	98.96%	1.79%	127.74%	1.82%	-28.78%	-0.03%

注：本基金基准指数：中证 100 指数

本基金的业绩比较基准中证 100 指数由中证指数有限公司构建和发布。具体的编制规则和再平衡过程请参见中证 100 指数指数编制细则。

### 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约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十三条“（二）投资范围”、“（八）投资限制”的有关约定。

## §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		
冯雨生	本基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理。	2011 年 7 月 11 日	-	8 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。现任长盛中证 100 指数证券投资基金（本基金）基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理。

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遵规守信情况的说明

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**

上半年一季度股票市场整体大幅上涨，互联网金融、智能电视和智慧医疗板块大幅上涨，沪港通、海南旅游岛和自贸区概念板块涨幅较少。行业上，计算机、通信和传媒行业涨幅靠前，银行、券商和煤炭行业跑输市场。二季度股票市场整体大幅震荡，前两个月市场大幅上涨，6 月份以来大幅下跌。概念主题上看，安防监控、网络安全和文化传媒等板块涨幅居前，自贸区、经济带和冷链物流等概念板块涨幅较少。行业上，轻工制造、银行和食品饮料涨幅靠前，有色、建筑和商贸大幅跑输市场。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数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，本基金份额净值为 1.2149 元，本报告期份额净值增长率为 16.83%，同期业绩比较基准增长率为 29.15%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0987%，年度化跟踪误差为 1.56%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们延续以前对经济的判断，陆续出台的改革措施也会提升投资者风险偏好，改革相关的板块可能持续受到投资者青睐。短期市场的调整不会影响牛市大方向，在国家划时代的变革背景下，资本市场会更加健康有效。蓝筹股是国家经济转型和产业升级的核心力量，看好蓝筹股未来的市场表现。

作为指数基金，我们将继续秉承指数化投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，控制基金的跟踪误差。

#### 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十八条中对基金利润分配原则的约定，本基金于 2015 年 1 月 15 日对 2014 年度收益进行了分配，分配金额为 37,480,479.12 元。

本基金截至 2015 年 6 月 30 日，期末可供分配收益为 102,770,173.39 元，其中，未分配收益已实现部分为 201,920,470.29 元，未分配收益未实现部分为-99,150,296.90 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长盛基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛中证 100 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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	43,549,259.13	49,716,582.88
结算备付金		300,000.00	328,634.13
存出保证金		441,668.14	469,058.99
交易性金融资产	6.4.7.2	548,445,576.24	875,245,083.88
其中：股票投资		548,445,576.24	875,245,083.88
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		6,518,016.57	4,490,953.39
应收利息	6.4.7.5	12,945.26	21,856.81
应收股利		-	-
应收申购款		952,581.83	2,943,747.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		600,220,047.17	933,215,917.59
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	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		18,059,612.31	10,714,322.94
应付管理人报酬		414,296.37	522,028.39
应付托管费		82,859.27	104,405.67
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	396,911.58	147,228.25
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	223,334.79	290,819.67
负债合计		19,177,014.32	11,778,804.92
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	478,272,859.46	851,968,041.44
未分配利润	6.4.7.10	102,770,173.39	69,469,071.23
所有者权益合计		581,043,032.85	921,437,112.67
负债和所有者权益总计		600,220,047.17	933,215,917.59

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2149 元，基金份额总额 478,272,859.46 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛中证 100 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
<b>一、收入</b>		150,341,804.72	-40,409,620.53
1.利息收入		378,205.07	368,012.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	378,205.07	367,811.96
债券利息收入		-	200.13
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）		230,107,274.02	-26,440,945.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	224,784,165.43	-35,044,101.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	177,776.28
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	5,323,108.59	8,425,379.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-80,676,976.66	-14,410,050.41
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	533,302.29	73,362.86
<b>减：二、费用</b>		5,273,025.76	3,196,318.77

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,030,254.87	2,312,398.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	606,050.92	462,479.70
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,453,912.26	229,605.83
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	182,807.71	191,834.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		145,068,778.96	-43,605,939.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		145,068,778.96	-43,605,939.30

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛中证 100 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）	851,968,041.44	69,469,071.23	921,437,112.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	145,068,778.96	145,068,778.96
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）	-373,695,181.98	-74,287,197.68	-447,982,379.66
其中：1.基金申购款	353,750,260.82	47,109,590.16	400,859,850.98
2.基金赎回款	-727,445,442.80	-121,396,787.84	-848,842,230.64
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）	-	-37,480,479.12	-37,480,479.12
五、期末所有者权益（基金净值）	478,272,859.46	102,770,173.39	581,043,032.85
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)	1,083,286,318.93	-347,217,662.34	736,068,656.59
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-43,605,939.30	-43,605,939.30
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填 列)	-134,407,023.06	46,008,952.33	-88,398,070.73
其中: 1.基金申购款	14,764,682.51	-5,368,533.87	9,396,148.64
2.基金赎回款	-149,171,705.57	51,377,486.20	-97,794,219.37
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)	948,879,295.87	-344,814,649.31	604,064,646.56

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

长盛中证 100 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”)证监基金字[2006]第 172 号《关于同意长盛中证 100 指数证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 4,029,660,276.84 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司(事务所的性质已变更为特殊普通合伙)普华永道中天验字(2006)第 179 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》于 2006 年 11 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,031,424,938.24 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,764,661.40 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》



的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数成份股、备选成份股、新股(如一级市场初次发行或增发)等，以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，并且可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。本基金力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在 4% 以下。本基金的业绩比较基准为：中证 100 指数收益率  $\times 95\% +$  一年期银行储蓄存款利率(税后)  $\times 5\%$ 。本基金标的指数使用费由基金管理人长盛基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛中证 100 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 6 月 30 日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。

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本期未发生会计政策变更。

### 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须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	43, 549, 259. 13

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	43,549,259.13

#### 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	377,284,403.55	548,445,576.24	171,161,172.69
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	377,284,403.55	548,445,576.24	171,161,172.69

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本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

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

#### 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	12,606.31
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	121.50
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	38.62

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	178.83
合计	12,945.26

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本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	396,911.58
银行间市场应付交易费用	-
合计	396,911.58

#### 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	46,029.51
其他	3,742.57
预提费用	173,562.71
合计	223,334.79

#### 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	851,968,041.44	851,968,041.44
本期申购	353,750,260.82	353,750,260.82
本期赎回(以“-”号填列)	-727,445,442.80	-727,445,442.80
本期末	478,272,859.46	478,272,859.46

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 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	89,413,735.21	-19,944,663.98	69,469,071.23
本期利润	225,745,755.62	-80,676,976.66	145,068,778.96
本期基金份额交易	-75,758,541.42	1,471,343.74	-74,287,197.68

产生的变动数			
其中：基金申购款	55,034,834.58	-7,925,244.42	47,109,590.16
基金赎回款	-130,793,376.00	9,396,588.16	-121,396,787.84
本期已分配利润	-37,480,479.12	-	-37,480,479.12
本期末	201,920,470.29	-99,150,296.90	102,770,173.39

#### 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	366,818.78
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	4,672.24
其他	6,714.05
合计	378,205.07

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	655,035,466.59
减：卖出股票成本总额	430,251,301.16
买卖股票差价收入	224,784,165.43

#### 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：本基金本报告期内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	5,323,108.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,323,108.59

**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	-80,676,976.66
——股票投资	-80,676,976.66
——债券投资	-
——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	-80,676,976.66

**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	521,504.94
转换费	11,797.35
合计	533,302.29

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。

**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	1,453,912.26
银行间市场交易费用	-
合计	1,453,912.26

**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	39,671.58
信息披露费	133,891.13
银行汇划费	245.00
银行间账户维护费	9,000.00

合计	182,807.71
----	------------

## 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

本基金无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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”)	基金管理人的股东、基金代销机构

### 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

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国元证券	665,523,579.74	83.14%	45,431,503.14	36.12%

#### 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
-------	----------------------------	--	---------------------------------	--

	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
国元证券	-	-	4,730,033.51	100.00%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国元证券	605,893.13	83.14%	360,163.63	90.74%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国元证券	41,360.90	36.12%	11,390.70	41.82%

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。

#### 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	3,030,254.87	2,312,398.53
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	545,440.35

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.75% 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：日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.75% / 当年天数。



**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的托管费	606,050.92	462,479.70

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 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：本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的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**

份额单位：份

项目	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
基金合同生效日（2006 年 11 月 22 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	10,157,456.32	-
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	10,157,456.32	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.1200%	-

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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

注：除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

**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

中国农业银行	43,549,259.13	366,818.78	35,077,878.03	361,828.50
--------	---------------	------------	---------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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：本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.11.1 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	本期利润配 合计	备注
1	2015 年 1 月 15 日	2015 年 1 月 15 日	0.4100	22,099,770.17	15,380,708.95	37,480,479.12	
合计	-	-	0.4100	22,099,770.17	15,380,708.95	37,480,479.12	

### 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：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 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
002353	杰瑞股份	2015 年 5 月 27 日	重大 事项 停牌	35.05	-	-	38,242	1,780,869.12	1,340,382.10	-
600886	国投电力	2015 年 6 月 24 日	重大 事项 停牌	14.87	-	-	269,000	3,657,324.00	4,000,030.00	-
600900	长江电力	2015 年 6 月 15 日	重大 事项 停牌	12.37	-	-	489,472	4,001,000.42	6,054,768.64	-

601111	中国 国航	2015 年 6 月 30 日	重大 事项 停牌	15.36	2015 年 7 月 29 日	13.78	192,678	1,403,380.67	2,959,534.08	-
601633	长城 汽车	2015 年 6 月 19 日	重大 事项 停牌	36.70	2015 年 7 月 13 日	38.50	32,105	1,362,898.74	1,178,253.50	-

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

本基金是一只进行被动投资的股票型指数基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程

度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持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，均能根据本基金的基金管理人的投资意图，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。

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

#### 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
<b>资产</b>					
银行存款	43,549,259.13	-	-	-	43,549,259.13
结算备付金	300,000.00	-	-	-	300,000.00
存出保证金	441,668.14	-	-	-	441,668.14
交易性金融资产	-	-	-	548,445,576.24	548,445,576.24
应收证券清算款	-	-	-	6,518,016.57	6,518,016.57
应收利息	-	-	-	12,945.26	12,945.26
应收申购款	29,940.18	-	-	922,641.65	952,581.83
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>44,320,867.45</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>555,899,179.72</b>	<b>600,220,047.17</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	18,059,612.31	18,059,612.31
应付管理人报酬	-	-	-	414,296.37	414,296.37

应付托管费	-	-	-	82,859.27	82,859.27
应付交易费用	-	-	-	396,911.58	396,911.58
其他负债	-	-	-	223,334.79	223,334.79
<b>负债总计</b>	-	-	-	19,177,014.32	19,177,014.32
<b>利率敏感度缺口</b>	44,320,867.45	-	-	536,722,165.40	581,043,032.85
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
<b>资产</b>					
银行存款	49,716,582.88	-	-	-	49,716,582.88
结算备付金	328,634.13	-	-	-	328,634.13
存出保证金	469,058.99	-	-	-	469,058.99
交易性金融资产	-	-	-	875,245,083.88	875,245,083.88
应收证券清算款	-	-	-	4,490,953.39	4,490,953.39
应收利息	-	-	-	21,856.81	21,856.81
应收申购款	21,517.10	-	-	2,922,230.41	2,943,747.51
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	50,535,793.10	-	-	882,680,124.49	933,215,917.59
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	10,714,322.94	10,714,322.94
应付管理人报酬	-	-	-	522,028.39	522,028.39
应付托管费	-	-	-	104,405.67	104,405.67
应付交易费用	-	-	-	147,228.25	147,228.25
其他负债	-	-	-	290,819.67	290,819.67
<b>负债总计</b>	-	-	-	11,778,804.92	11,778,804.92
<b>利率敏感度缺口</b>	50,535,793.10	-	-	870,901,319.57	921,437,112.67

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，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，采用复制指数的投资策略，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。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中包括中证 100 指数成份股、备选成份股、新股(如一级市场初次发行或增发)等，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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	548,445,576.24	94.39	875,245,083.88	94.99
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	548,445,576.24	94.39	875,245,083.88	94.99

#### 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%	29,361,964.01	46,563,166.26
业绩比较基准下降 5%	-29,361,964.01	-46,563,166.26	

#### 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 532,912,607.92 元，属于第二层次的余额为 15,532,968.32 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 858,134,867.96 元，第二层次 17,110,215.92 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。

## §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	548,445,576.24	91.37
	其中：股票	548,445,576.24	91.37
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	43,849,259.13	7.31
7	其他各项资产	7,925,211.80	1.32
8	合计	600,220,047.17	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	-	-
B	采矿业	26,774,755.19	4.61
C	制造业	153,542,747.58	26.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,792,122.10	3.75
E	建筑业	28,449,073.07	4.90
F	批发和零售业	5,443,082.10	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	13,480,978.46	2.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,861,387.72	1.70
J	金融业	265,139,254.03	45.63
K	房地产业	19,072,776.33	3.28
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	3,549,017.56	0.61
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	547,105,194.14	94.16

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采掘业	-	-
C	制造业	1,340,382.10	0.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,340,382.10	0.23

### 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	424,242	34,762,389.48	5.98
2	600036	招商银行	1,324,315	24,791,176.80	4.27
3	600016	民生银行	2,327,292	23,133,282.48	3.98
4	600030	中信证券	671,431	18,068,208.21	3.11
5	601166	兴业银行	977,005	16,853,336.25	2.90
6	600000	浦发银行	972,704	16,497,059.84	2.84
7	600837	海通证券	694,196	15,133,472.80	2.60
8	601766	中国中车	699,863	12,849,484.68	2.21
9	601328	交通银行	1,513,285	12,469,468.40	2.15
10	000651	格力电器	187,471	11,979,396.90	2.06
11	000002	万科A	763,708	11,089,040.16	1.91
12	601398	工商银行	1,861,253	9,827,415.84	1.69

13	601989	中国重工	652,879	9,662,609.20	1.66
14	601668	中国建筑	1,148,728	9,545,929.68	1.64
15	600887	伊利股份	482,120	9,112,068.00	1.57
16	600519	贵州茅台	35,100	9,043,515.00	1.56
17	601988	中国银行	1,775,490	8,682,146.10	1.49
18	601169	北京银行	647,546	8,625,312.72	1.48
19	601818	光大银行	1,548,562	8,300,292.32	1.43
20	601601	中国太保	246,813	7,448,816.34	1.28
21	601390	中国中铁	523,982	7,173,313.58	1.23
22	000001	平安银行	448,930	6,527,442.20	1.12
23	601006	大秦铁路	461,207	6,475,346.28	1.11
24	000333	美的集团	165,664	6,175,953.92	1.06
25	600900	长江电力	489,472	6,054,768.64	1.04
26	600048	保利地产	512,321	5,850,705.82	1.01
27	600104	上汽集团	256,749	5,802,527.40	1.00
28	600028	中国石化	809,253	5,713,326.18	0.98
29	601688	华泰证券	244,883	5,664,143.79	0.97
30	002024	苏宁云商	355,757	5,443,082.10	0.94
31	000166	申万宏源	334,502	5,435,657.50	0.94
32	601939	建设银行	744,889	5,311,058.57	0.91
33	600015	华夏银行	347,363	5,283,391.23	0.91
34	600795	国电电力	745,701	5,197,535.97	0.89
35	000776	广发证券	226,760	5,136,114.00	0.88
36	600050	中国联通	669,975	4,910,916.75	0.85
37	600999	招商证券	181,984	4,815,296.64	0.83
38	600011	华能国际	318,919	4,474,433.57	0.77
39	600518	康美药业	250,644	4,443,918.12	0.76
40	002415	海康威视	98,304	4,404,019.20	0.76
41	601857	中国石油	375,369	4,252,930.77	0.73
42	000858	五粮液	133,343	4,226,973.10	0.73
43	601628	中国人寿	130,044	4,072,978.08	0.70
44	600276	恒瑞医药	91,150	4,059,821.00	0.70
45	601336	新华保险	66,305	4,048,583.30	0.70
46	600886	国投电力	269,000	4,000,030.00	0.69
47	000725	京东方 A	766,855	3,979,977.45	0.68
48	600705	中航资本	169,800	3,930,870.00	0.68
49	600010	包钢股份	750,608	3,895,655.52	0.67
50	000063	中兴通讯	158,146	3,765,456.26	0.65
51	601899	紫金矿业	733,011	3,753,016.32	0.65

52	601901	方正证券	315,580	3,752,246.20	0.65
53	000625	长安汽车	175,942	3,721,173.30	0.64
54	601186	中国铁建	233,390	3,647,885.70	0.63
55	600690	青岛海尔	118,615	3,597,592.95	0.62
56	000069	华侨城 A	273,422	3,549,017.56	0.61
57	601088	中国神华	166,612	3,473,860.20	0.60
58	601600	中国铝业	370,788	3,459,452.04	0.60
59	601727	上海电气	230,772	3,445,425.96	0.59
60	600703	三安光电	109,048	3,413,202.40	0.59
61	601669	中国电建	297,380	3,372,289.20	0.58
62	600019	宝钢股份	383,886	3,355,163.64	0.58
63	600585	海螺水泥	149,744	3,212,008.80	0.55
64	600111	北方稀土	169,254	3,070,267.56	0.53
65	601111	中国国航	192,678	2,959,534.08	0.51
66	000538	云南白药	34,284	2,957,680.68	0.51
67	600031	三一重工	300,871	2,915,439.99	0.50
68	600583	海油工程	168,541	2,807,893.06	0.48
69	600150	中国船舶	53,207	2,740,160.50	0.47
70	601618	中国中冶	374,197	2,705,444.31	0.47
71	600637	百视通	63,423	2,668,839.84	0.46
72	600256	广汇能源	245,422	2,552,388.80	0.44
73	600196	复星医药	86,540	2,504,467.60	0.43
74	601018	宁波港	273,642	2,418,995.28	0.42
75	600893	中航动力	44,553	2,367,991.95	0.41
76	600535	天士力	47,361	2,356,683.36	0.41
77	002736	国信证券	93,400	2,343,406.00	0.40
78	002304	洋河股份	33,447	2,319,883.92	0.40
79	600958	东方证券	80,000	2,289,600.00	0.39
80	600406	国电南瑞	110,277	2,281,631.13	0.39
81	002241	歌尔声学	59,851	2,148,650.90	0.37
82	600383	金地集团	168,619	2,133,030.35	0.37
83	600023	浙能电力	208,201	2,065,353.92	0.36
84	600309	万华化学	83,474	2,018,401.32	0.35
85	601800	中国交建	114,135	2,004,210.60	0.34
86	002594	比亚迪	35,914	1,983,530.22	0.34
87	601998	中信银行	251,114	1,936,088.94	0.33
88	600398	海澜之家	102,100	1,851,073.00	0.32
89	601898	中煤能源	145,866	1,665,789.72	0.29
90	600018	上港集团	205,702	1,627,102.82	0.28

91	000895	双汇发展	75,601	1,612,569.33	0.28
92	600372	中航电子	40,059	1,399,260.87	0.24
93	002252	上海莱士	20,700	1,354,608.00	0.23
94	601808	中海油服	46,846	1,308,877.24	0.23
95	601225	陕西煤业	152,405	1,246,672.90	0.21
96	601633	长城汽车	32,105	1,178,253.50	0.20
97	603288	海天味业	21,016	671,251.04	0.12
98	600485	信威集团	11,100	487,179.00	0.08

### 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

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	002353	杰瑞股份	38,242	1,340,382.10	0.23

## 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	601766	中国中车	17,429,835.10	1.89
2	601318	中国平安	8,005,146.00	0.87
3	600383	金地集团	7,946,074.92	0.86
4	601988	中国银行	6,202,879.00	0.67
5	600705	中航资本	6,086,293.30	0.66
6	000725	京东方 A	5,550,566.00	0.60
7	601336	新华保险	4,418,699.00	0.48
8	002304	洋河股份	4,221,573.68	0.46
9	601727	上海电气	4,103,977.50	0.45
10	600196	复星医药	4,084,616.00	0.44
11	600637	东方明珠	4,062,094.47	0.44
12	601989	中国重工	3,852,154.00	0.42
13	000166	申万宏源	3,729,019.90	0.40
14	600690	青岛海尔	3,697,108.61	0.40
15	600886	国投电力	3,657,324.00	0.40
16	600036	招商银行	3,597,027.00	0.39

17	600893	中航动力	3,366,477.36	0.37
18	600958	东方证券	3,285,174.00	0.36
19	002736	国信证券	3,155,086.00	0.34
20	601398	工商银行	3,052,206.00	0.33

#### 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	600036	招商银行	41,422,223.93	4.50
2	601318	中国平安	35,453,404.58	3.85
3	600016	民生银行	25,480,843.50	2.77
4	600030	中信证券	25,245,737.33	2.74
5	601166	兴业银行	21,258,884.28	2.31
6	600837	海通证券	20,093,796.74	2.18
7	600000	浦发银行	19,127,306.56	2.08
8	601328	交通银行	15,895,300.46	1.73
9	600383	金地集团	14,017,047.50	1.52
10	000002	万科A	12,023,422.87	1.30
11	601668	中国建筑	11,607,455.87	1.26
12	601766	中国中车	11,164,407.97	1.21
13	000651	格力电器	10,843,189.15	1.18
14	601601	中国太保	10,782,913.47	1.17
15	601088	中国神华	9,449,297.75	1.03
16	000001	平安银行	9,443,278.54	1.02
17	600519	贵州茅台	9,204,145.07	1.00
18	000776	广发证券	9,011,408.43	0.98
19	600048	保利地产	8,355,219.41	0.91
20	601169	北京银行	7,803,532.95	0.85

#### 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	184,128,770.18
卖出股票收入（成交）总额	655,035,466.59

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

(1) 本基金跟踪的标的指数为中证 100 指数，配置了中证 100 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。

(2) 本基金跟踪的标的指数为中证 100 指数，配置了中证 100 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通报的 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况，对中信证券股份有限公司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。

(3) 本基金跟踪复制标的指数中证 100 指数，配置了中证 100 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通报的 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况，对海通证券股份有限公司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中证 100 指数，配置了中证 100 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	441,668.14
2	应收证券清算款	6,518,016.57
3	应收股利	-
4	应收利息	12,945.26
5	应收申购款	952,581.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-



9	合计	7,925,211.80
---	----	--------------

#### 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中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

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	002353	杰瑞股份	1,340,382.10	0.23	重大事项停牌

#### 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
28,281	16,911.46	11,415,805.40	2.39%	466,857,054.06	97.61%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	524,284.88	0.1096%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有本开放式基金	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（2006 年 11 月 22 日）基金份额总额	4,031,424,938.24
本报告期期初基金份额总额	851,968,041.44
本报告期基金总申购份额	353,750,260.82
减:本报告期基金总赎回份额	727,445,442.80
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	478,272,859.46

## §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

本报告期本基金托管人的基金托管部门重大人事未曾变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期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	
国元证券	2	665,523,579.74	83.14%	605,893.13	83.14%	-
国联证券	1	94,641,509.53	11.82%	86,161.82	11.82%	-
中信证券	1	40,364,291.50	5.04%	36,747.95	5.04%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

（2）资力雄厚，信誉良好。

（3）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

（4）经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

（5）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

（6）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：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	关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》及本公司网站	2015 年 6 月 30 日
2	关于旗下部分基金参加一路财富和同花顺费率优惠活动的公告	同上	2015 年 6 月 26 日
3	关于增加汇付金融和增财基金为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠活动的公告	同上	2015 年 6 月 19 日
4	长盛基金管理有限公司关于增加联泰资产和钱景为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠活动的公告	同上	2015 年 6 月 19 日
5	关于我公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2015 年 6 月 1 日
6	关于旗下部分基金参加一路财富（北京）信息科技有限公司网上费率优惠活动的公告	同上	2015 年 5 月 28 日

7	关于在直销柜台开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告	同上	2015 年 5 月 27 日
8	长盛基金管理有限公司关于子公司法定代表人、执行董事及高管变更情况的公告	同上	2015 年 5 月 15 日
9	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
10	关于旗下部分基金参加众禄基金费率优惠活动的公告	同上	2015 年 4 月 20 日
11	关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2015 年 4 月 1 日
12	关于旗下部分基金参加大连银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2015 年 4 月 1 日
13	关于在直销柜台开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告	同上	2015 年 3 月 16 日
14	关于在工商银行开通旗下部分基金转换业务的公告	同上	2015 年 3 月 6 日
15	长盛中证 100 指数证券投资基金收益分配公告	同上	2015 年 1 月 14 日

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一) 关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛中证 100 指数证券投资基金的批复；
- (二) 《长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》；
- (三) 《长盛中证 100 指数证券投资基金托管协议》；
- (四) 《长盛中证 100 指数证券投资基金招募说明书》；
- (五) 法律意见书；
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (七) 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和/或基金托管人的办公地址。

### 11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司  
2015 年 8 月 27 日