

长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资 基金 2015 年半年度报告 摘要

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 27 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛战略新兴产业混合
基金主代码	080008
交易代码	080008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 10 月 26 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,745,961,627.08 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	重点关注国家战略性新兴产业发展过程中带来的投资机会，分享中国经济发展的长期收益，力争为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	（1）本基金采用“自上而下”的战略资产配置体系，通过对宏观基本面及证券市场两个层面的因素定性、定量地分析，动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。（2）本基金将战略性新兴产业相关股票和债券分别纳入战略性新兴产业股票库和债券库，投资于战略性新兴产业的股票及债券比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。（3）战略新兴产业的行业配置上，本基金将深入分析判断各子行业的行业景气状况、产业政策变化、行业生命周期，结合行业可投资的规模和相对估值水平，适时调整各子行业的配置比例。
业绩比较基准	50%×中证新兴产业指数+50%×中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、010-	010-67595096

	62350088	
传真	010-82255988	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§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	14,217,212.46
本期利润	21,173,228.49
加权平均基金份额本期利润	0.0339
本期基金份额净值增长率	43.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.6288
期末基金资产净值	4,934,333,459.93
期末基金份额净值	1.797

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（为期末余额，不是当期发生数）。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	0.17%	0.04%	-6.99%	1.92%	7.16%	-1.88%
过去三个月	8.38%	0.84%	10.09%	1.45%	-1.71%	-0.61%
过去六个月	43.07%	1.08%	28.90%	1.16%	14.17%	-0.08%
过去一年	72.79%	1.02%	50.02%	0.91%	22.77%	0.11%

过去三年	81.42%	1.09%	41.82%	0.89%	39.60%	0.20%
自基金合同生效起至今	88.49%	1.06%	38.24%	0.90%	50.25%	0.16%

注：根据《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 2 月 11 日起，由“沪深 300 指数×70%+中证综合债券指数×30%”变更为“50%×中证新兴产业指数+50%×中证综合债券指数”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

业绩比较基准=50%×中证新兴产业指数+50%×中证综合债券指数

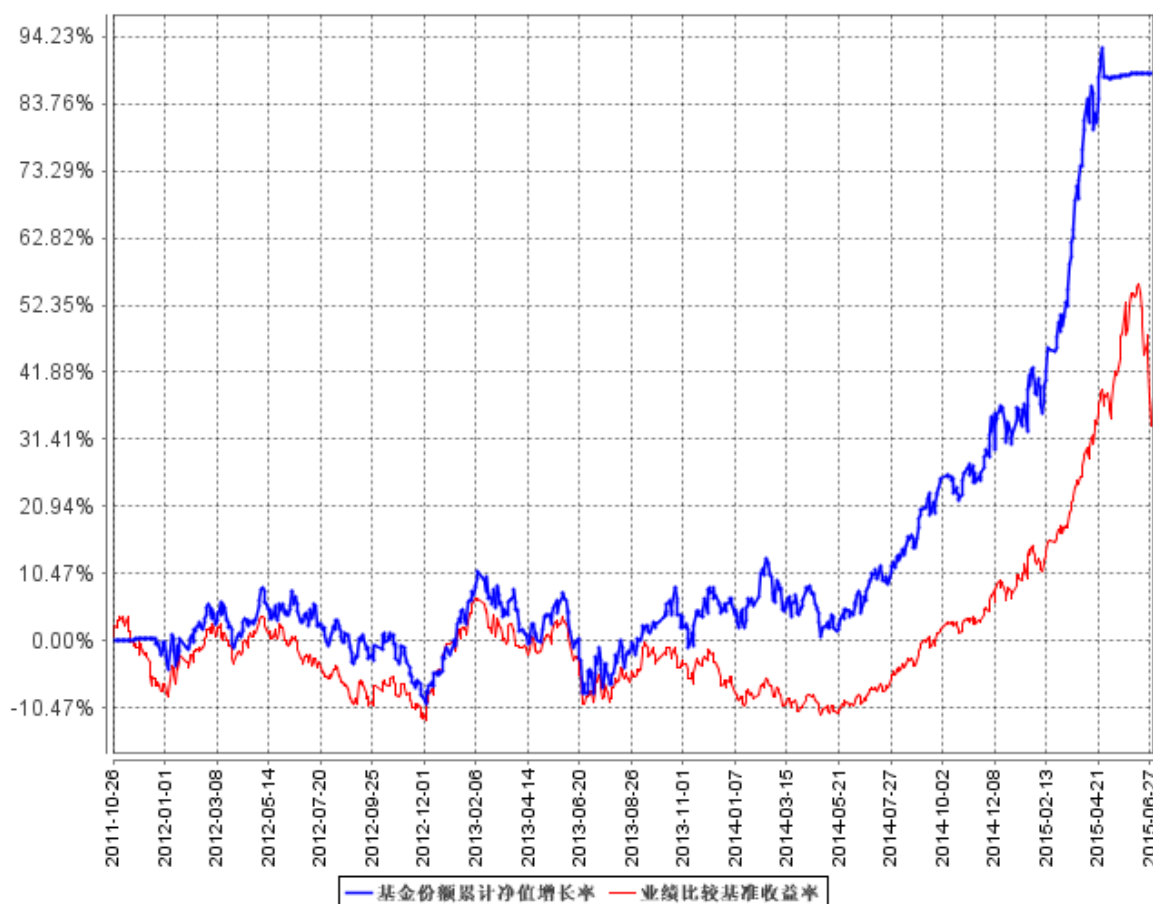
本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定中证新兴产业指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债券指数。

中证新兴产业指数是由中证指数有限公司编制，选择上海证券交易所和深圳证券交易所两市上市的新兴产业的公司中规模大、流动性好的 100 家公司组成，以综合反映沪深两市中新兴产业公司的整体表现。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准，较为合适。

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：按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条“（二）投资范围”、“（七）投资限制”的有关规定。截至报告期期末，本基金的投资组合比例符合本基金合同的各项规定。

§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，上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金经理，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。	2015 年 5 月 14 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（本基金）基金经理。
杨衡	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，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015 年 6 月 18 日	-	8 年	男，1975 年 10 月出生，中国国籍。中国科学院数学与系统科学研究院博士、博士后。2007 年 7 月进入长盛基金管理公司，历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理、长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。现任长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金（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，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
王克玉	本基金基金经理，长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理，权益投资部副总监。	2014 年 2 月 11 日	2015 年 5 月 14 日	12 年	男，1979 年 12 月出生，中国国籍。上海交通大学硕士。历任元大京华证券上海代表处研究员，天相投资顾问有限公司分析师，国都证券有限公司分析师。2006 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任高级行业研究员，同盛证券投资基金基金经理助理，同益证券投资基金基金经理，长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理等职务。现任权益投资部副总监，长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理。自 2015 年 5 月 14 日起不再担任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

本基金为战略新兴主题基金，投资目标主要是电子、信息、传媒、医药以及收益于信息技术进步或互联网+驱动业绩增长的相关并收益于国家创新政策驱动的战略新兴行业公司，基本反映战略新兴产业市场投资收益和风险特征。

2015 年上半年度战略新兴产业收益于国家出台的大众创新政策的驱动，行业经济发展增速

明显，以新兴产业为代表的成长股票市场呈现急速向上走势，尽管 6 月中旬新兴成长股票市场行情有着较大回调，但是消费类电子、信息服务、医药等中小盘成长板块仍表现较强，对本基金净值增长带来了积极的业绩贡献。本基金在基金合同允许的主题投资范围内，最大程度投资并跟踪分享战略新兴主题投资及相关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，按照主题投资所定义的范围精选个股，并进行灵活配置主题板块，尽而实现新兴成长主题投资的目标。

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 1.797 元，本报告期份额净值增长率为 43.07%，同期业绩比较基准增长率为 28.90%。

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，以及各项经济改革的具体实施驱动，尽管行情及个股在 6 月中旬后向下调整幅度较大，但本基金管理仍预期 2015 年下半年的政策驱动的市场行情有望获得延续。特别是随着各项经济改革及政策的逐步推进，新兴成长主题类股票预期将能够恢复回稳并还会有一定上涨空间。

本基金作为专注于投资战略新兴主题投资基金，基金管理人将继续秉承主题投资策略，积极应对市场及行业子板块的结构性业绩基本面变化、行业整体增长的趋势判断等因素对主题目标投资带来的影响，控制基金的结构性和个股的配置风险，以实现投资者获取主题投资收益目标，充分发挥投资市场的灵活配置功能，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十七条中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期末未实施利润分配。

本基金截至 2015 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 1,726,551,029.37，其中，未分配利润已实现部分为 1,726,551,029.37 元，未分配利润未实现部分为 461,820,803.48 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

本基金自 2015 年 1 月 21 日至 2015 年 4 月 16 日出现连续 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	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	225,013,992.41	9,534,180.11
结算备付金	-	115,861.38
存出保证金	11,171.14	15,777.03
交易性金融资产	106,179,763.68	29,410,369.54
其中：股票投资	25,025,965.68	29,383,385.54
基金投资	-	-
债券投资	81,153,798.00	26,984.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	4,602,001,093.20	400,000.00
应收证券清算款	2,718,223.27	-
应收利息	4,716,808.67	3,638.85
应收股利	-	-
应收申购款	1,138,107.18	13,362.23
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,941,779,159.55	39,493,189.14
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	541.96

应付赎回款	1,566,542.25	336,102.39
应付管理人报酬	4,932,764.57	51,025.19
应付托管费	822,127.44	8,504.19
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	46,747.88	31,326.32
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	77,517.48	276,055.00
负债合计	7,445,699.62	703,555.05
所有者权益：		
实收基金	2,745,961,627.08	30,874,184.03
未分配利润	2,188,371,832.85	7,915,450.06
所有者权益合计	4,934,333,459.93	38,789,634.09
负债和所有者权益总计	4,941,779,159.55	39,493,189.14

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.797 元，基金份额总额

2,745,961,627.08 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入	30,872,338.56	2,946,386.35
1.利息收入	6,329,343.53	118,589.80
其中：存款利息收入	2,847,269.91	26,247.58
债券利息收入	9,398.13	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,472,675.49	92,342.22
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	17,456,655.79	2,488,320.34
其中：股票投资收益	17,290,809.73	1,966,536.85
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,346.26	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	169,192.32	521,783.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填	6,956,016.03	312,077.40

列)		
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	130,323.21	27,398.81
减:二、费用	9,699,110.07	918,989.12
1. 管理人报酬	8,146,551.03	454,373.08
2. 托管费	1,357,758.47	75,728.77
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	110,876.97	172,270.98
5. 利息支出	-	-
其中: 卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	83,923.60	216,616.29
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	21,173,228.49	2,027,397.23
减: 所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	21,173,228.49	2,027,397.23

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

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)	30,874,184.03	7,915,450.06	38,789,634.09
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	21,173,228.49	21,173,228.49
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)	2,715,087,443.05	2,159,283,154.30	4,874,370,597.35
其中: 1.基金申购款	2,785,894,498.66	2,202,966,564.70	4,988,861,063.36
2.基金赎回款	-70,807,055.61	-43,683,410.40	-114,490,466.01
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的基 金净值变动(净值减少 以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	2,745,961,627.08	2,188,371,832.85	4,934,333,459.93

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)	63,084,494.99	1,010,849.98	64,095,344.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,027,397.23	2,027,397.23
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)	4,719,049.65	-349,721.61	4,369,328.04
其中：1.基金申购款	31,863,082.23	-60,408.46	31,802,673.77
2.基金赎回款	-27,144,032.58	-289,313.15	-27,433,345.73
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)	67,803,544.64	2,688,525.60	70,492,070.24

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

长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金(以下简称“原基金”)基金份额持有人大会的决议由长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金转型而来。原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[2011]第 1219 号《关于核准长盛同祥泛资源主题股票型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《长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原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 941,564,638.02 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 411 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 10 月 26 日正式生效,基金合同生效

日的基金份额总额为 941,658,939.32 份基金份额，其中认购资金利息折合 94,301.30 份基金份额。

原基金基金份额持有人大会自 2013 年 12 月 23 日起至 2014 年 1 月 22 日止以通讯方式召开，会议审议通过了《关于修改长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，经中国证监会备案后决议生效。根据原基金基金份额持有人大会决议，《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2014 年 2 月 11 日生效，基金投资目标、范围和策略调整，同时“长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金”更名为“长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金”。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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)、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。本基金投资组合中对股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；投资于战略新兴产业的股票及债券不低于本基金非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：50% X 中证新兴产业指数+50% X 中证综合债券指数。

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》、《长盛战略新兴产业灵活配置混合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。

除上述会计估值变更事项外, 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。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 关联方关系

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

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构

6.4.8 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。

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	8,146,551.03	454,373.08
其中：支付销售机构的客户维护费	102,416.52	95,249.53

6.4.8.2.2 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	1,357,758.47	75,728.77

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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×0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间内均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国建设银行	225,013,992.41	2,707,548.90	5,453,539.49

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000024	招商地产	2015年4月	重大事项停牌	36.50	-	-	2,100	35,352.55	76,650.00	-

		3 日								
000917	电广传媒	2015 年 5 月 28 日	重大事项停牌	30.82	-	-	2,100	36,855.00	64,722.00	-
002712	思美传媒	2015 年 3 月 19 日	重大事项停牌	101.15		2015 年 7 月 31 日	66.10	2,147	104,168.92	217,169.05
300048	合康变频	2015 年 6 月 1 日	重大事项停牌	18.77	-		-	4,768	47,987.66	89,495.36
300083	劲胜精密	2015 年 4 月 7 日	重大事项停牌	43.15		2015 年 8 月 17 日	33.79	1,700	35,568.72	73,355.00
300188	美亚柏科	2015 年 5 月 14 日	重大事项停牌	29.92		2015 年 8 月 21 日	33.44	31,786	380,979.26	951,037.12
300353	东土科技	2015 年 6 月 3 日	重大事项停牌	57.79	-		-	1,940	25,015.85	112,112.60

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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(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 24,284,222.55 元，属于第二层次的余额为 81,895,541.13 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 28,484,064.72 元，第二层次 926,304.82 元，无属于第三层次的余额)。

(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。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	25,025,965.68	0.51
	其中：股票	25,025,965.68	0.51
2	固定收益投资	81,153,798.00	1.64
	其中：债券	81,153,798.00	1.64

	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	4,602,001,093.20	93.12
	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	225,013,992.41	4.55
7	其他各项资产	8,584,310.26	0.17
8	合计	4,941,779,159.55	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,635,059.25	0.03
C	制造业	15,115,880.43	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,849,596.64	0.06
E	建筑业	517,786.92	0.01
F	批发和零售业	752,930.00	0.02
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	1,033,441.09	0.02
J	金融业	2,479,500.00	0.05
K	房地产业	76,650.00	0.00
L	租赁和商务服务业	565,121.35	0.01
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	25,025,965.68	0.51

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601368	绿城水务	152,548	2,849,596.64	0.06
2	300473	德尔股份	28,645	1,901,455.10	0.04
3	603979	金诚信	66,063	1,635,059.25	0.03
4	600999	招商证券	50,000	1,323,000.00	0.03
5	603669	灵康药业	39,293	1,309,242.76	0.03
6	300485	赛升药业	17,372	1,164,097.72	0.02
7	601688	华泰证券	50,000	1,156,500.00	0.02
8	603589	口子窖	45,168	1,144,557.12	0.02
9	002376	新北洋	55,615	995,508.50	0.02
10	300188	美亚柏科	31,786	951,037.12	0.02

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.csfunds.com.cn>网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600999	招商证券	1,866,491.00	4.81
2	601688	华泰证券	1,543,925.00	3.98
3	603979	金诚信	1,135,622.97	2.93
4	002465	海格通信	1,040,763.82	2.68
5	601368	绿城水务	980,883.64	2.53
6	300473	德尔股份	823,830.20	2.12
7	600348	阳泉煤业	740,016.05	1.91
8	603589	口子窖	722,688.00	1.86
9	601988	中国银行	688,500.00	1.77
10	300485	赛升药业	668,127.12	1.72
11	603616	韩建河山	567,500.00	1.46
12	300133	华策影视	561,800.00	1.45
13	300470	日机密封	549,448.00	1.42
14	601968	宝钢包装	483,991.20	1.25
15	002419	天虹商场	466,320.00	1.20
16	603669	灵康药业	460,898.10	1.19
17	601126	四方股份	433,505.00	1.12

18	300045	华力创通	414,182.00	1.07
19	000568	泸州老窖	391,396.00	1.01
20	000733	振华科技	334,288.52	0.86

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	002465	海格通信	3,082,809.52	7.95
2	600498	烽火通信	2,938,578.00	7.58
3	601968	宝钢包装	1,912,594.00	4.93
4	600875	东方电气	1,584,356.03	4.08
5	000012	南玻A	1,490,605.45	3.84
6	002056	横店东磁	1,423,345.30	3.67
7	000063	中兴通讯	1,339,972.05	3.45
8	300465	高伟达	1,248,800.00	3.22
9	601238	广汽集团	1,138,794.07	2.94
10	002376	新北洋	1,134,149.17	2.92
11	601988	中国银行	1,133,000.00	2.92
12	603616	韩建河山	995,339.00	2.57
13	300470	日机密封	981,200.00	2.53
14	000937	冀中能源	976,019.79	2.52
15	002335	科华恒盛	889,397.75	2.29
16	601699	潞安环能	846,754.93	2.18
17	000568	泸州老窖	806,821.18	2.08
18	601126	四方股份	791,310.23	2.04
19	600750	江中药业	764,271.66	1.97
20	600348	阳泉煤业	755,352.66	1.95

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	20,054,885.97
卖出股票收入（成交）总额	48,409,140.02

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	80,311,000.00	1.63
	其中：政策性金融债	80,311,000.00	1.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	842,798.00	0.02
8	其他	-	-
9	合计	81,153,798.00	1.64

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	140223	14 国开 23	500,000	50,200,000.00	1.02
2	140357	14 进出 57	300,000	30,111,000.00	0.61
3	110031	航信转债	5,800	842,798.00	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持贵金属

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

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，对招商证券股份有限公司采取责令限期改正的行政监管措施。 本基金做出如下说明：招商证券是中国最优秀的证券公司之一，综合实力突出，基本面良好。基于相关研究，本基金判断，这一处罚对招商证券无实质影响。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

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

7.12.2

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	11,171.14
2	应收证券清算款	2,718,223.27
3	应收股利	-
4	应收利息	4,716,808.67
5	应收申购款	1,138,107.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,584,310.26

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

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	300188	美亚柏科	951,037.12	0.02	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
1,320	2,080,273.96	2,707,671,440.63	98.61%	38,290,186.45	1.39%

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	60,383.84	0.0022%

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（2011年10月26日）基金份额总额	941,658,939.32
本报告期期初基金份额总额	30,874,184.03
本报告期基金总申购份额	2,785,894,498.66
减：本报告期基金总赎回份额	70,807,055.61
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	2,745,961,627.08

§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

报经中国证券投资基金业协会同意，自2015年5月14日起，赵宏宇同志兼任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，王克玉同志不再担任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；自2015年6月18日起，杨衡同志兼任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。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人2015年1月4日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

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	
东兴证券	1	33,214,166.36	54.62%	30,231.78	54.79%	-
民生证券	1	27,596,333.04	45.38%	24,943.25	45.21%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	2,761,431.20	100.00%	6,846,000,000.00	100.00%	-	-

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。

长盛基金管理有限公司
2015 年 8 月 27 日