

长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资 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.....	6
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40

§8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	44
§9 开放式基金份额变动	44
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
其他重大事件.....	46
10.8.....	46
§11 备查文件目录	49
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	49
11.3 查阅方式.....	49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金		
基金简称	长盛同辉深 100 等权重分级		
场内简称	长盛同辉		
基金主代码	160809		
交易代码	160809		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 9 月 13 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	192,248,118.03 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012-09-26		
下属分级基金的基金简称	长盛同辉深 100 等权重 A	长盛同辉深 100 等权重 B	长盛同辉深 100 等权重分级
下属分级基金场内简称:	同辉 100A	同辉 100B	长盛同辉
下属分级基金的交易代码	150108	150109	160809
报告期末下属分级基金份额总额	88,741,185.00 份	88,741,186.00 份	14,765,747.03 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现深证 100 等权重指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用完全复制法，按照成份股在深证 100 等权重指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪深证 100 等权重指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪深证 100 等权重指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	$95\% \times \text{深证 100 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率 (税后)}$
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

	从投资者具体持有的基金份额来看，在分级运作期内，由于基金收益分配的安排，长盛同辉深 100 等权重 A 份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；长盛同辉深 100 等权重 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。		
下属分级基金的风险收益特征	长盛同辉深 100 等权重 A：低风险、收益相对稳定。	长盛同辉深 100 等权重 B：高风险、高预期收益。	长盛同辉深 100 等权重分级：较高风险、较高预期收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》
登载基金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

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	60,988,360.53
本期利润	83,808,716.15
加权平均基金份额本期利润	0.5302
本期加权平均净值利润率	37.70%
本期基金份额净值增长率	39.24%
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	67,344,164.82
期末可供分配基金份额利润	0.3503
期末基金资产净值	173,922,928.22
期末基金份额净值	0.905
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	98.82%

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	-12.56%	3.81%	-9.14%	3.33%	-3.42%	0.48%
过去三个月	9.15%	2.78%	13.87%	2.55%	-4.72%	0.23%
过去六个月	39.24%	2.24%	47.46%	2.10%	-8.22%	0.14%
过去一年	98.51%	1.78%	110.62%	1.69%	-12.11%	0.09%
自基金合同生效起至今	98.82%	1.50%	95.35%	1.48%	3.47%	0.02%

注：本基金业绩比较基准=95%×深证100等权重指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。

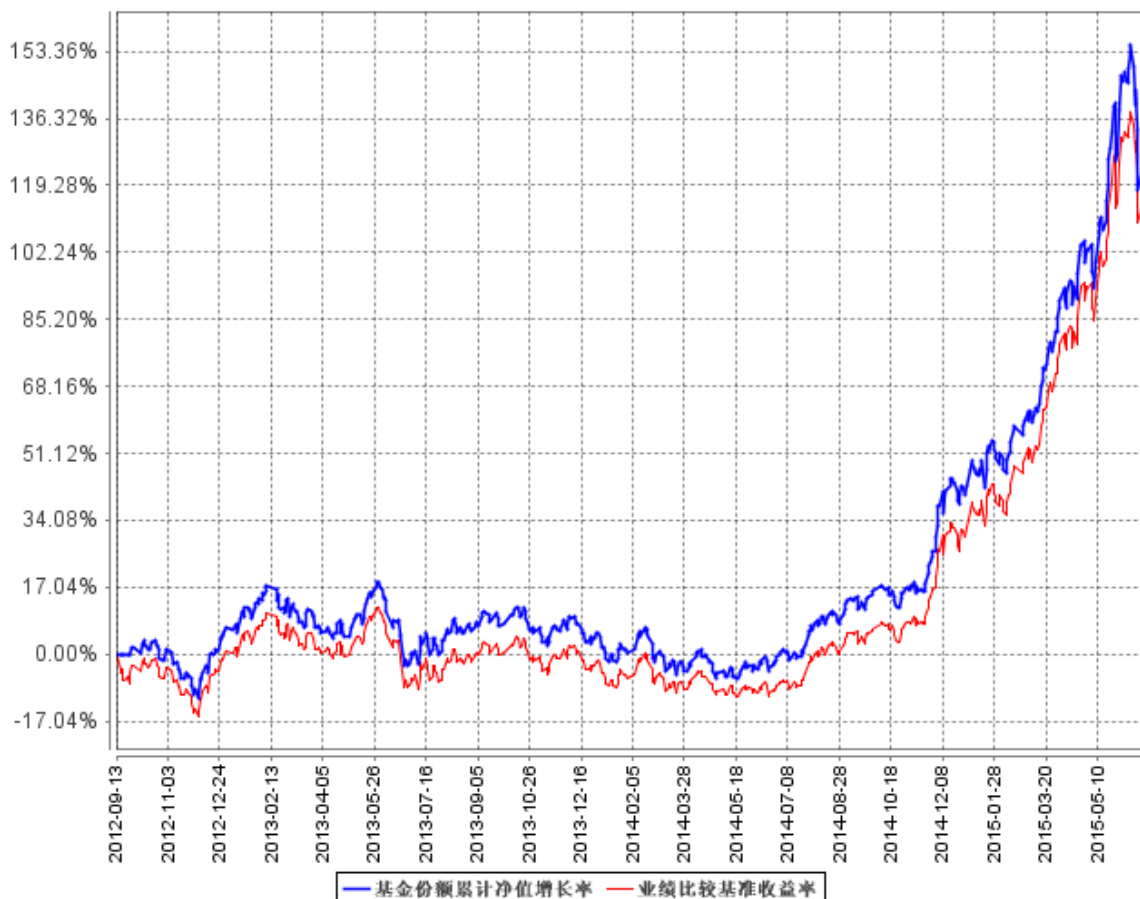
基准指数：深证100等权重指数

本基金的业绩比较基准深证100等权重指数由深圳证券交易所和深圳证券信息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深证100等权重指数编制细则。再平衡：由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，业绩

比较基准中深证 100 等权重指数、一年期银行定期存款每日按照 95%、5% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金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，本基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，报告期末已完成建仓。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十六条（二）投资范围、（八）投资限制的有关约定。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 15000 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		
王超	本基金基金经理，长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）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，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。	2013 年 1 月 5 日	-	8 年	男，1981 年 9 月出生，中国国籍。中央财经大学硕士，金融风险管理师 (FRM)。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员，从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金（本基金）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，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略股票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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.905 元，本报告期份额净值增长率为 39.24%，同期业绩比较基准收益率为 47.46%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为 0.13%，控制在 0.35% 之内；年化跟踪误差为 2.99%，控制在 4% 之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A 股市场在 2015 年上半年呈现了冲高之后大幅回落的特征。上证指数在 6 月 12 日创下本轮反弹新高 5178 之后，便在清查场外配资等消息的影响下出现快速大幅下跌。前期出现大幅上涨的创业板和中小板成为主要下跌对象，大盘蓝筹在下跌初期，由于具有较好的流动性，出现了恐慌性的抛售。针对杠杆平仓导致的本轮股市大幅下跌，已经超出了市场正常价值回归的范围，后面不及时监管干预，极有可能酿成系统性风险。对此监管机构也予以充分重视，出台了密集的救市措施予以应对。二季度公布的宏观经济数据虽然还在探底，但是已经出现了结构性回暖迹象，相信在政府保增长政策密集出台的情况下，宏观经济有望于三季度企稳。

展望 2015 年下半年的行情，高估值类股票仍将处于估值回归的过程，而估值具备明显优势的大盘蓝筹类股，将受益于宏观经济触底反弹和国企改革等因素而预期出现上涨，相对市场整体获得明显的超额收益。

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条中对基金的收益与分配的约定，在分级运作期内，本基金（包括长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额和长盛同辉深 100 等权重份额）不进行收益分配。

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

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：长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金

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	13,317,704.02	16,619,973.69
结算备付金		443,358.73	165,368.50
存出保证金		33,336.09	18,024.88
交易性金融资产	6.4.7.2	160,956,526.05	168,414,666.53
其中：股票投资		160,956,526.05	168,414,666.53
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,368.82	4,362.10
应收股利		-	-
应收申购款		99,049.12	148,217.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		174,852,342.83	185,370,613.52
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		-	7,252,552.91

应付赎回款		292,897.56	136.30
应付管理人报酬		211,913.17	132,683.76
应付托管费		46,620.89	29,190.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	183,523.86	152,103.52
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	194,459.13	270,000.52
负债合计		929,414.61	7,836,667.46
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	88,454,757.01	124,391,603.50
未分配利润	6.4.7.10	85,468,171.21	53,142,342.56
所有者权益合计		173,922,928.22	177,533,946.06
负债和所有者权益总计		174,852,342.83	185,370,613.52

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，长盛同辉深 100 等权重分级份额净值 0.905 元，长盛同辉深 100 等权重 A 份额参考净值 1.008 元，长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值 0.802 元；基金份额总额 192,248,118.03 份，其中长盛同辉深 100 等权重 A 份额 88,741,185.00 份，长盛同辉深 100 等权重 B 份额 88,741,186.00 份，长盛同辉深 100 等权重分级份额 14,765,747.03 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金

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		85,736,832.26	-5,517,811.01
1.利息收入		75,893.27	26,970.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	75,893.27	26,970.81
债券利息收入		-	-
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）		62,574,380.13	-6,198,260.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	61,700,823.88	-7,077,324.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资		-	-

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	873,556.25	879,063.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	22,820,355.62	638,924.05
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	266,203.24	14,554.73
减：二、费用		1,928,116.11	1,058,405.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,090,091.25	621,246.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	239,820.01	136,674.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	407,147.85	111,330.13
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	191,057.00	189,154.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		83,808,716.15	-6,576,217.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		83,808,716.15	-6,576,217.00

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金

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）	124,391,603.50	53,142,342.56	177,533,946.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	83,808,716.15	83,808,716.15
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）	-35,936,846.49	-51,482,887.50	-87,419,733.99
其中：1.基金申购款	64,559,346.23	61,213,032.96	125,772,379.19

2. 基金赎回款	-100,496,192.72	-112,695,920.46	-213,192,113.18
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）	88,454,757.01	85,468,171.21	173,922,928.22
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）	132,110,789.53	7,002,303.96	139,113,093.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,576,217.00	-6,576,217.00
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）	-11,437,853.03	-169,093.62	-11,606,946.65
其中：1.基金申购款	324,017.91	12,380.99	336,398.90
2.基金赎回款	-11,761,870.94	-181,474.61	-11,943,345.55
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）	120,672,936.50	256,993.34	120,929,929.84

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

杨思乐

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金(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[2012]827 号《关于核准长盛同辉深证 100 等权重指数分级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《长盛同辉深证 100 等权重指数分级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

844,010,148.73 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司（现已更名为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙））普华永道中天验字(2012)第 356 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 9 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 844,062,743.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 52,594.60 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

根据《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的基金份额包括长盛同辉深证 100 等权重指数证券投资基金之基础份额（以下简称“同辉深证 100 等权重份额”）、长盛同辉深证 100 等权重指数证券投资基金之稳健收益类份额（以下简称“长盛同辉深证 100 等权重 A 份额”）及长盛同辉深证 100 等权重指数证券投资基金之积极收益类份额（以下简称“长盛同辉深证 100 等权重 B 份额”）。本基金一份长盛同辉深证 100 等权重 A 份额与一份长盛同辉深证 100 等权重 B 份额构成一对份额组合，一对长盛同辉深证 100 等权重 A 份额与长盛同辉深证 100 等权重 B 份额的份额组合的净值之和将等于两份同辉深证 100 等权重指数份额的净值。在任一运作周年内，长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额按照本合同规定的参考净值计算规则进行计算；对于长盛同辉深 100 等权重 A 份额的约定应得收益，即定期折算基准日长盛同辉深 100 等权重 A 份额参考净值超出 1.000 元部分，将折算为场内长盛同辉深 100 等权重份额分配给长盛同辉深 100 等权重 A 份额持有人；同辉 B 份额的参考净值和份额数不进行折算；长盛同辉深 100 等权重份额持有人持有的每份长盛同辉深 100 等权重份额将按持有 0.5 份长盛同辉深 100 等权重 A 份额获得新增长盛同辉深 100 等权重份额的分配，场外长盛同辉深 100 等权重份额的持有人将按前述折算方式获得新增场外长盛同辉深 100 等权重份额的分配，场内长盛同辉深 100 等权重份额的持有人将按前述折算方式获得新增场内长盛同辉深 100 等权重份额的分配。当长盛同辉深 100 等权重份额净值达到 2.000 元后（含 2.000 元）和当长盛同辉深 100 等权重 B 份额的基金份额参考净值跌至 0.250 元以下后（不含 0.250 元），本基金将进行不定期份额折算。折算后本基金将确保长盛同辉深 100 等权重 A 份额和长盛同辉深 100 等权重 B 份额的比例为 1:1，份额折算后长盛同辉深 100 等权重份额净值以及长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值均调整为 1.000 元。

长盛同辉深 100 等权重份额接受场外与场内申购和赎回，长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额只上市交易但不接受申购和赎回，并可与长盛同辉深 100 等权重份额

相互间进行配对转换。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]319 号文核准,长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额于 2012 年 9 月 26 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资的标的指数为深证 100 指数,股票投资占基金资产的比例为 90%-95%,原则上投资于深证 100 指数成份股票、备选成份股票的资产占基金资产的比例不低于 90%;其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种,其中权证资产占基金资产净值的比例为 0-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金通过被动的指数化投资管理,实现对深证 100 指数的有效跟踪,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%以内。本基金的业绩比较基准为: $95\% \times \text{深证 100 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率 (税后)}$ 。

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》、《长盛同辉深证 100 等权重指数分级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 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。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	13,317,704.02
定期存款	-
其他存款	-
合计：	13,317,704.02

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	111,747,598.41	160,956,526.05	49,208,927.64
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	111,747,598.41	160,956,526.05	49,208,927.64

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

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告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	2,174.74
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	179.59
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.99
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	13.50
合计	2,368.82

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	183,523.86
银行间市场应付交易费用	-
合计	183,523.86

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	1,103.88
其他	4,914.34
预提费用	188,440.91
合计	194,459.13

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	132,634,127.60	124,391,603.50
本期申购	52,144,924.34	48,905,827.77
本期赎回(以“-”号填列)	-43,319,751.53	-40,621,490.53
2015 年 5 月 20 日 基金拆分/份额折算前	141,459,300.41	132,675,940.74

基金拆分/份额折算变动份额	146,894,002.21	-
本期申购	34,024,384.18	15,653,518.46
本期赎回(以“-”号填列)	-130,129,568.77	-59,874,702.19
本期末	192,248,118.03	88,454,757.01

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、截至 2015 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 187,240,849.00 份（其中长盛同辉深 100 等权重 A 份额为 88,741,185.00 份，长盛同辉深 100 等权重 B 份额为 88,741,186.00 份）；本基金于场内未上市交易的基金份额为 9,758,478.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 5,007,269.03 份，均为长盛同辉深 100 等权重份额。场内的基金份额登记在证券登记结算系统，场外的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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	25,462,230.43	27,680,112.13	53,142,342.56
本期利润	60,988,360.53	22,820,355.62	83,808,716.15
本期基金份额交易产生的变动数	-19,106,426.14	-32,376,461.36	-51,482,887.50
其中：基金申购款	15,216,191.71	45,996,841.25	61,213,032.96
基金赎回款	-34,322,617.85	-78,373,302.61	-112,695,920.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,344,164.82	18,124,006.39	85,468,171.21

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	74,156.28
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	1,465.71
其他	271.28
合计	75,893.27

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	164,360,956.17
减：卖出股票成本总额	102,660,132.29
买卖股票差价收入	61,700,823.88

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	873,556.25
基金投资产生的股利收益	-
合计	873,556.25

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	22,820,355.62
——股票投资	22,820,355.62
——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	22,820,355.62

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	266,068.89
转换费收入	134.35
合计	266,203.24

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

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	407,147.85
银行间市场交易费用	-
合计	407,147.85

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	24,795.19
信息披露费	133,892.94
深交所上市年费	29,752.78
银行划款费用	2,616.09
合计	191,057.00

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

本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金并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	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、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

注：本基金无关联方交易单元，未发生通过关联方交易单元进行的交易。

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	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管理费	1,090,091.25	621,246.90
其中：支付销售机构的客户维护费	6,422.53	3,936.92

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 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 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	239,820.01	136,674.35

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 当年天数。

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

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
中国建设银行	13,317,704.02	74,156.28	5,772,137.56	26,472.07

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。

6.4.10.6 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**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：本基金本报告期无利润分配情况。

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
002001	新和成	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	17.09	2015 年 7 月 13 日	18.49	64,027	976,725.92	1,094,221.43	-
000963	华东医药	2015 年 6 月 26 日	重大事项停牌	71.48	2015 年 8 月 5 日	69.20	18,991	1,066,023.62	1,357,476.68	-
000709	河北钢铁	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	7.00	2015 年 8 月 24 日	6.30	260,939	835,325.34	1,826,573.00	-

002353	杰瑞股份	2015年5月27日	重大 事项 停牌	35.05	-	-	52,881	1,885,545.56	1,853,479.05	-
000630	铜陵有色	2015年3月9日	重大 事项 停牌	10.32	-	-	202,334	1,731,247.36	2,088,086.88	-
000839	中信国安	2015年6月29日	重大 事项 停牌	23.57	-	-	90,708	950,885.34	2,137,987.56	-
002106	莱宝高科	2015年4月7日	重大 事项 停牌	18.93	-	-	113,554	1,434,768.85	2,149,577.22	-
000778	新兴铸管	2015年6月15日	重大 事项 停牌	10.16	-	-	222,447	1,201,681.53	2,260,061.52	-
000793	华闻传媒	2015年5月26日	重大 事项 停牌	16.89	-	-	142,191	1,561,066.15	2,401,605.99	-
000878	云南铜业	2015年6月8日	重大 事项 停牌	18.54	-	-	132,384	2,113,535.08	2,454,399.36	-
002069	獐子岛	2015年6月1日	重大 事项 停牌	17.94	-	-	144,714	2,704,507.32	2,596,169.16	-
000024	招商地产	2015年4月30日	重大 事项 停牌	36.50	-	-	76,470	1,131,946.19	2,791,155.00	-
002292	奥飞动漫	2015年5月18日	重大 事项 停牌	37.29	-	-	100,152	1,632,467.26	3,734,668.08	-
000917	电广传媒	2015年5月28日	重大 事项 停牌	30.82	-	-	152,100	2,678,115.95	4,687,722.00	-

注：本基金截至 2015 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生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，将交易所批准复牌。

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，使本基金在险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短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外，其余均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约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、债券投资及资产支持证券投资等。

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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	13,317,704.02	-	-	-	-	-	13,317,704.02
结算备付金	443,358.73	-	-	-	-	-	443,358.73
存出保证金	33,336.09	-	-	-	-	-	33,336.09
交易性金融资产	-	-	-	-	-	160,956,526.05	160,956,526.05
应收利息	-	-	-	-	-	2,368.82	2,368.82
应收申购款	-	-	-	-	-	99,049.12	99,049.12
资产总计	13,794,398.84	-	-	-	-	161,057,943.99	174,852,342.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	292,897.56	292,897.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	211,913.17	211,913.17
应付托管费	-	-	-	-	-	46,620.89	46,620.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	183,523.86	183,523.86
其他负债	-	-	-	-	-	194,459.13	194,459.13
负债总计	-	-	-	-	-	929,414.61	929,414.61
利率敏感度缺口	13,794,398.84	-	-	-	-	160,128,529.38	173,922,928.22
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	16,619,973.69	-	-	-	-	-	16,619,973.69
结算备付金	165,368.50	-	-	-	-	-	165,368.50
存出保证金	18,024.88	-	-	-	-	-	18,024.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	168,414,666.53	168,414,666.53

应收利息	-	-	-	-	-	4,362.10	4,362.10
应收申购款	-	-	-	-	-	148,217.82	148,217.82
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	16,803,367.07	-	-	-	-	168,567,246.45	185,370,613.52
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,252,552.91	7,252,552.91
应付赎回款	-	-	-	-	-	136.30	136.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	132,683.76	132,683.76
应付托管费	-	-	-	-	-	29,190.45	29,190.45
应付交易费用	-	-	-	-	-	152,103.52	152,103.52
其他负债	-	-	-	-	-	270,000.52	270,000.52
负债总计	-	-	-	-	-	7,836,667.46	7,836,667.46
利率敏感度缺口	16,803,367.07	-	-	-	-	160,730,578.99	177,533,946.06

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，本基金未持有的交易性债券投资（2014 年 12 月 31 日：同），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。

本基金原则上采用复制指数投资策略，股票资产跟踪的标的指数为深证 100 指数，通过指数

化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于深证 100 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；债券、现金及其它短期金融工具为 5-10%。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	160,956,526.05	92.54	168,414,666.53	94.86
其他	-	-	-	-
合计	160,956,526.05	92.54	168,414,666.53	94.86

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）
	1. 业绩比较基准上升 5%	9,217,915.20	8,905,652.32
2. 业绩比较基准下降 5%	-9,217,915.20	-8,905,652.32	

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

(1) 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) 以公允价值计量的金融工具

①金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

②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级的余额为 127,523,343.12，第二层级的余额为 33,433,182.93，无属于第三层级的余额。(2014 年 12 月 31 日：第一层级 164,376,533.08；，第二层级：4,038,133.45 元，无属于第三层级的余额。)

③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	160,956,526.05	92.05
	其中：股票	160,956,526.05	92.05
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	13,761,062.75	7.87
7	其他各项资产	134,754.03	0.08
8	合计	174,852,342.83	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	2,596,169.16	1.49
B	采矿业	3,520,029.42	2.02
C	制造业	92,327,194.14	53.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,156,869.45	0.67
E	建筑业	2,288,379.63	1.32
F	批发和零售业	2,948,355.38	1.70
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	22,352,761.30	12.85
J	金融业	10,029,885.22	5.77
K	房地产业	8,837,439.27	5.08
L	租赁和商务服务业	4,534,116.98	2.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,502,009.12	2.59
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	3,749,054.05	2.16
S	综合	1,212,534.33	0.70
	合计	160,054,797.45	92.03

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	-	-
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	901,728.60	0.52
S	综合	-	-
	合计	901,728.60	0.52

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	000917	电广传媒	152,100	4,687,722.00	2.70
2	002292	奥飞动漫	100,152	3,734,668.08	2.15
3	002405	四维图新	79,451	3,479,953.80	2.00
4	300104	乐视网	66,327	3,433,085.52	1.97
5	000024	招商地产	76,470	2,791,155.00	1.60
6	002069	獐子岛	144,714	2,596,169.16	1.49
7	002030	达安基因	57,936	2,566,564.80	1.48
8	300017	网宿科技	54,610	2,534,996.20	1.46
9	000878	云南铜业	132,384	2,454,399.36	1.41
10	002008	大族激光	85,216	2,447,403.52	1.41
11	000793	华闻传媒	142,191	2,401,605.99	1.38

12	000768	中航飞机	54,327	2,367,570.66	1.36
13	002456	欧菲光	68,090	2,297,356.60	1.32
14	002081	金螳螂	81,177	2,288,379.63	1.32
15	000778	新兴铸管	222,447	2,260,061.52	1.30
16	002106	莱宝高科	113,554	2,149,577.22	1.24
17	000839	中信国安	90,708	2,137,987.56	1.23
18	000630	铜陵有色	202,334	2,088,086.88	1.20
19	000559	万向钱潮	92,773	2,028,017.78	1.17
20	002415	海康威视	42,634	1,910,003.20	1.10
21	000060	中金岭南	101,185	1,881,029.15	1.08
22	002146	荣盛发展	149,516	1,868,950.00	1.07
23	000069	华侨城 A	142,832	1,853,959.36	1.07
24	002353	杰瑞股份	52,881	1,853,479.05	1.07
25	000709	河北钢铁	260,939	1,826,573.00	1.05
26	000783	长江证券	129,574	1,807,557.30	1.04
27	002073	软控股份	76,841	1,775,027.10	1.02
28	300024	机器人	22,955	1,773,503.30	1.02
29	002230	科大讯飞	49,656	1,734,980.64	1.00
30	002475	立讯精密	49,913	1,687,558.53	0.97
31	000651	格力电器	26,014	1,662,294.60	0.96
32	000061	农产品	81,012	1,652,644.80	0.95
33	300058	蓝色光标	104,300	1,648,983.00	0.95
34	000046	泛海控股	111,797	1,637,826.05	0.94
35	002024	苏宁云商	103,979	1,590,878.70	0.91
36	300315	掌趣科技	115,050	1,558,927.50	0.90
37	000166	申万宏源	95,300	1,548,625.00	0.89
38	002465	海格通信	47,816	1,539,197.04	0.88
39	000800	一汽轿车	61,739	1,536,066.32	0.88
40	000725	京东方 A	292,381	1,517,457.39	0.87
41	000039	中集集团	46,517	1,502,499.10	0.86
42	000568	泸州老窖	45,824	1,494,320.64	0.86
43	000012	南玻 A	111,667	1,489,637.78	0.86
44	300124	汇川技术	31,033	1,489,584.00	0.86
45	002450	康得新	48,478	1,483,426.80	0.85
46	002202	金风科技	75,985	1,479,427.95	0.85
47	000423	东阿阿胶	26,804	1,460,818.00	0.84
48	002065	东华软件	50,760	1,459,350.00	0.84
49	000538	云南白药	16,558	1,428,458.66	0.82
50	000858	五粮液	44,780	1,419,526.00	0.82

51	000100	TCL 集团	248,465	1,403,827.25	0.81
52	002038	双鹭药业	24,505	1,388,208.25	0.80
53	002142	宁波银行	65,267	1,380,397.05	0.79
54	000977	浪潮信息	46,600	1,377,030.00	0.79
55	002241	歌尔声学	38,347	1,376,657.30	0.79
56	002236	大华股份	42,929	1,370,293.68	0.79
57	000963	华东医药	18,991	1,357,476.68	0.78
58	000825	太钢不锈	190,574	1,354,981.14	0.78
59	300027	华谊兄弟	35,329	1,347,448.06	0.77
60	000999	华润三九	44,158	1,341,961.62	0.77
61	002385	大北农	99,020	1,338,750.40	0.77
62	300002	神州泰岳	86,992	1,325,758.08	0.76
63	300070	碧水源	27,171	1,325,673.09	0.76
64	000826	桑德环境	34,003	1,322,376.67	0.76
65	000402	金融街	92,062	1,300,836.06	0.75
66	000333	美的集团	34,873	1,300,065.44	0.75
67	000729	燕京啤酒	124,366	1,293,406.40	0.74
68	000876	新希望	65,455	1,270,481.55	0.73
69	002007	华兰生物	28,356	1,255,887.24	0.72
70	000792	盐湖股份	44,211	1,254,708.18	0.72
71	000970	中科三环	60,564	1,248,224.04	0.72
72	002304	洋河股份	17,962	1,245,844.32	0.72
73	000063	中兴通讯	52,113	1,240,810.53	0.71
74	000002	万科A	85,308	1,238,672.16	0.71
75	002344	海宁皮城	62,786	1,232,489.18	0.71
76	000937	冀中能源	153,089	1,227,773.78	0.71
77	000625	长安汽车	57,938	1,225,388.70	0.70
78	000425	徐工机械	91,795	1,218,119.65	0.70
79	000009	中国宝安	74,343	1,212,534.33	0.70
80	002570	贝因美	61,069	1,185,349.29	0.68
81	000629	攀钢钒钛	219,395	1,175,957.20	0.68
82	002500	山西证券	64,919	1,174,384.71	0.68
83	002594	比亚迪	21,199	1,170,820.77	0.67
84	000598	兴蓉投资	120,885	1,156,869.45	0.67
85	000960	锡业股份	56,702	1,142,545.30	0.66
86	000400	许继电气	45,315	1,140,125.40	0.66
87	000001	平安银行	78,288	1,138,307.52	0.65
88	000338	潍柴动力	35,596	1,126,969.36	0.65
89	000983	西山煤电	117,753	1,116,298.44	0.64

90	002001	新 和 成	64,027	1,094,221.43	0.63
91	000686	东北证券	54,842	1,067,773.74	0.61
92	000157	中联重科	130,532	1,058,614.52	0.61
93	000581	威孚高科	34,032	1,054,651.68	0.61
94	000623	吉林敖东	30,685	1,031,016.00	0.59
95	000895	双汇发展	46,955	1,001,550.15	0.58
96	000750	国海证券	59,362	997,281.60	0.57
97	000776	广发证券	40,422	915,558.30	0.53
98	000831	五矿稀土	31,254	799,477.32	0.46
99	002422	科伦药业	10,330	413,613.20	0.24

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	300251	光线传媒	36,214	901,728.60	0.52

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	300104	乐视网	7,104,358.96	4.00
2	000012	南 玻 A	2,519,326.00	1.42
3	000166	申万宏源	2,347,269.11	1.32
4	300315	掌趣科技	2,020,840.00	1.14
5	002069	獐 子 岛	1,983,802.50	1.12
6	000917	电广传媒	1,677,505.60	0.94
7	000977	浪潮信息	1,615,568.00	0.91
8	000425	徐工机械	1,202,776.00	0.68
9	002030	达安基因	1,196,683.68	0.67
10	000783	长江证券	1,119,980.00	0.63
11	002230	科大讯飞	981,951.00	0.55
12	000768	中航飞机	935,253.00	0.53

13	000046	泛海控股	917,376.68	0.52
14	000060	中金岭南	861,968.00	0.49
15	300002	神州泰岳	846,391.00	0.48
16	002065	东华软件	835,536.60	0.47
17	000061	农产品	804,165.00	0.45
18	300024	机器人	794,665.00	0.45
19	000839	中信国安	769,398.00	0.43
20	002024	苏宁云商	765,581.00	0.43

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	000831	五矿稀土	4,537,763.62	2.56
2	300104	乐视网	4,228,809.94	2.38
3	002030	达安基因	3,468,695.35	1.95
4	000060	中金岭南	2,654,737.64	1.50
5	000559	万向钱潮	2,594,998.72	1.46
6	002230	科大讯飞	2,591,292.92	1.46
7	002465	海格通信	2,510,218.09	1.41
8	300024	机器人	2,495,016.94	1.41
9	000768	中航飞机	2,476,960.73	1.40
10	000783	长江证券	2,475,693.48	1.39
11	000839	中信国安	2,424,880.80	1.37
12	000046	泛海控股	2,378,904.30	1.34
13	300002	神州泰岳	2,227,582.70	1.25
14	002024	苏宁云商	2,216,222.92	1.25
15	002065	东华软件	2,148,351.60	1.21
16	000061	农产品	2,134,821.69	1.20
17	300315	掌趣科技	2,109,441.50	1.19
18	300124	汇川技术	2,066,081.64	1.16
19	002415	海康威视	2,064,408.74	1.16
20	002073	软控股份	2,040,068.99	1.15

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	72,381,636.19
卖出股票收入（成交）总额	164,360,956.17

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

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

本基金跟踪的标的指数为深证 100 等权重指数，配置了深证 100 等权重指数成分股獐子岛。根据獐子岛公司公告，公司于 2014 年 12 月 4 日收到中国证券监督管理委员会大连监管局下发的《行政监管措施决定书》（【2014】5 号、【2014】6 号），分别为《关于对獐子岛集团股份有限公司采取责令改正监管措施的决定》（【2014】5 号，以下简称“《责令改正的决定》”）、《关于对獐子岛集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（【2014】6 号，以下简称“《警示函》”）。其中，“《责令改正的决定》”涉及：1、部分事项决策程序不规范；2、内部控制制度执行不规范；“《警示函》”涉及：1、海域收购决策存在瑕疵；2、深海底播缺乏充分论证；3、公司深海底播信息披露及风险揭示问题。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，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	33,336.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,368.82
5	应收申购款	99,049.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	134,754.03

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**

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	000917	电广传媒	4,687,722.00	2.70	重大事项停牌
2	002292	奥飞动漫	3,734,668.08	2.15	重大事项停牌
3	000024	招商地产	2,791,155.00	1.60	重大事项停牌
4	002069	獐子岛	2,596,169.16	1.49	重大事项停牌
5	000878	云南铜业	2,454,399.36	1.41	重大事项停牌

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：本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

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

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例
长盛同辉深 100 等权重 A	335	264,899.06	79,446,687.00	89.53%	9,294,498.00	10.47%

长盛同辉深 100 等权重 B	2477	35,826.07	2,832,668.00	3.19%	85,908,518.00	96.81%
长盛同辉深 100 等权重 分级	562	26,273.57	8,283,234.00	56.10%	6,482,513.03	43.90%
合计	3374	56,979.29	90,562,589.00	47.11%	101,685,529.03	52.89%

注：1、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。

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

长盛同辉深 100 等权重 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市 总份额 比例
1	工银安盛人寿保险有限公司	33,276,502.00	37.50%
2	人保投资控股有限公司-委托证券投资户	12,597,100.00	14.20%
3	嘉实基金-建设银行-中国人寿-中国人寿委托嘉实基金公司混合	7,344,401.00	8.28%
4	天平汽车保险股份有限公司	4,999,950.00	5.63%
5	嘉实基金-农业银行-中国农业银行股份有限公司企业年金理事会	4,054,669.00	4.57%
6	国泰君安证券股份有限公司	3,706,584.00	4.18%
7	海康人寿保险有限公司	3,118,842.00	3.51%
8	上投摩根基金-兴业银行-兴业银行股份有限公司上海分行	2,397,261.00	2.70%
9	徐州矿务集团有限公司企业年金计划-中国建设银行	2,203,423.00	2.48%
10	神华集团有限责任公司企业年金计划-中国建设银行股份有限公司	2,196,424.00	2.48%

长盛同辉深 100 等权重 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市 总份额
----	-------	---------	------------

			比例
1	陈善宽	7,781,515.68	8.77%
2	韩婧	2,842,166.90	3.20%
3	罗艳华	2,245,118.80	2.53%
4	北京千石创富—光大银行—千石资本—道冲套利 5 号资产管理计	1,903,680.93	2.15%
5	卢晋	1,549,945.20	1.75%
6	倪宪忠	1,209,656.60	1.36%
7	张春明	927,112.00	1.04%
8	朱丹非	793,338.40	0.89%
9	彭燕萍	612,888.40	0.69%
10	依淑娟	593,480.00	0.67%

注：1、以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供；

2、对于长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额前十名持有人持有份额比例的分母采用各自级别的份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛同辉深 100 等权重 A	-	-
	长盛同辉深 100 等权重 B	-	-
	长盛同辉深 100 等权重分级	-	-
	合计	-	-

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

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	持有份额总数（万份）
高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金	0
基金经理持有本基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛同辉深 100 等权重 A	长盛同辉深 100 等权重 B	长盛同辉深 100 等权重分级
基金合同生效日（2012 年 9 月 13 日）	295,025,570.00	295,025,571.00	254,011,602.33
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	63,793,566.00	63,793,567.00	5,046,994.60
本报告期基金总申购份额	-	-	86,169,308.52
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	173,449,320.30
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	24,947,619.00	24,947,619.00	96,998,764.21
本报告期期末基金份额总额	88,741,185.00	88,741,186.00	14,765,747.03

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§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

11.2.1 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。

11.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘张力争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	
浙商证券	1	236,742,592.36	100.00%	215,530.45	100.00%	-
国海证券	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) 资历雄厚，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所需，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

- (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；
- (3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；
- (4) 试用期期满后，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

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

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	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告	同上	2015 年 5 月 22 日
9	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金不定期份额折算前收盘价调整的公告	同上	2015 年 5 月 22 日
10	长盛同辉深证 100 等权重指数分级基金 办理不定期份额折算业务期间同辉 100A 份额、同辉 100B 份额停复牌公告	同上	2015 年 5 月 21 日
11	关于长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告	同上	2015 年 5 月 20 日
12	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	同上	2015 年 5 月 19 日
13	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
14	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	同上	2015 年 5 月 15 日
15	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	同上	2015 年 5 月 14 日
16	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	同上	2015 年 5 月 13 日
17	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的提示公告	同上	2015 年 5 月 12 日
18	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
19	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
20	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2015 年 4 月 16 日
21	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2015 年 4 月 16 日
22	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的第一次提示公告	同上	2015 年 4 月 9 日

23	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
----	-----------------------------	----	-----------------

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (二) 《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金合同》；
- (三) 《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金托管协议》；
- (四) 《长盛同辉深证 100 等权重指数分级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及/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