

长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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（以下简称“中国农业银行”）根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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 2014 年 3 月 11 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
§ 8 基金份额持有人信息	43

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	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
10.8 其他重大事件.....	48
§ 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	长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长盛航天海工混合
基金主代码	000535
交易代码	000535
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 3 月 11 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	558,224,898.12 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资航天海工装备等安全相关上市公司股票，把握中国航天海工装备等安全相关行业发展带来的投资机会，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，运用科学严谨、规范化的资产配置方法，灵活配置国内航天海工装备等安全相关上市公司股票和债券，谋求基金资产的长期稳定增长。航天海工装备等安全相关主题包括航天装备、海洋工程装备及涉及未来战略安全的相关装备制造领域，主要包括航空装备、航天装备、领土安全装备、海洋工程装备及信息安全装备 5 个重点方向，本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，选择航天海工装备等安全相关主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
业绩比较基准	50%*巨潮航天军工指数收益率 + 50%*中证综合债指数收益
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松
	联系电话	010-82019988
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666、010-62350088	95599
传真	010-82255988	010-68121816
注册地址	深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市东城区建国门内大街 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	100088	100031
法定代表人	高新	蒋超良

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住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层

§ 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(2014 年 3 月 11 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-5,072,853.28
本期利润	9,192,470.30
加权平均基金份额本期利润	0.0139
本期加权平均净值利润率	1.39%
本期基金份额净值增长率	1.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-4,958,506.50
期末可供分配基金份额利润	-0.0089
期末基金资产净值	567,156,665.09
期末基金份额净值	1.016
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.60%

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。

4、本基金基金合同生效日为 2014 年 3 月 11 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

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	1.91%	0.60%	5.10%	0.73%	-3.19%	-0.13%
过去三个月	1.60%	0.49%	8.01%	0.68%	-6.41%	-0.19%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.44%	5.83%	0.72%	-4.23%	-0.28%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{巨潮航天军工指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

基准指数的构建考虑了三个原则：

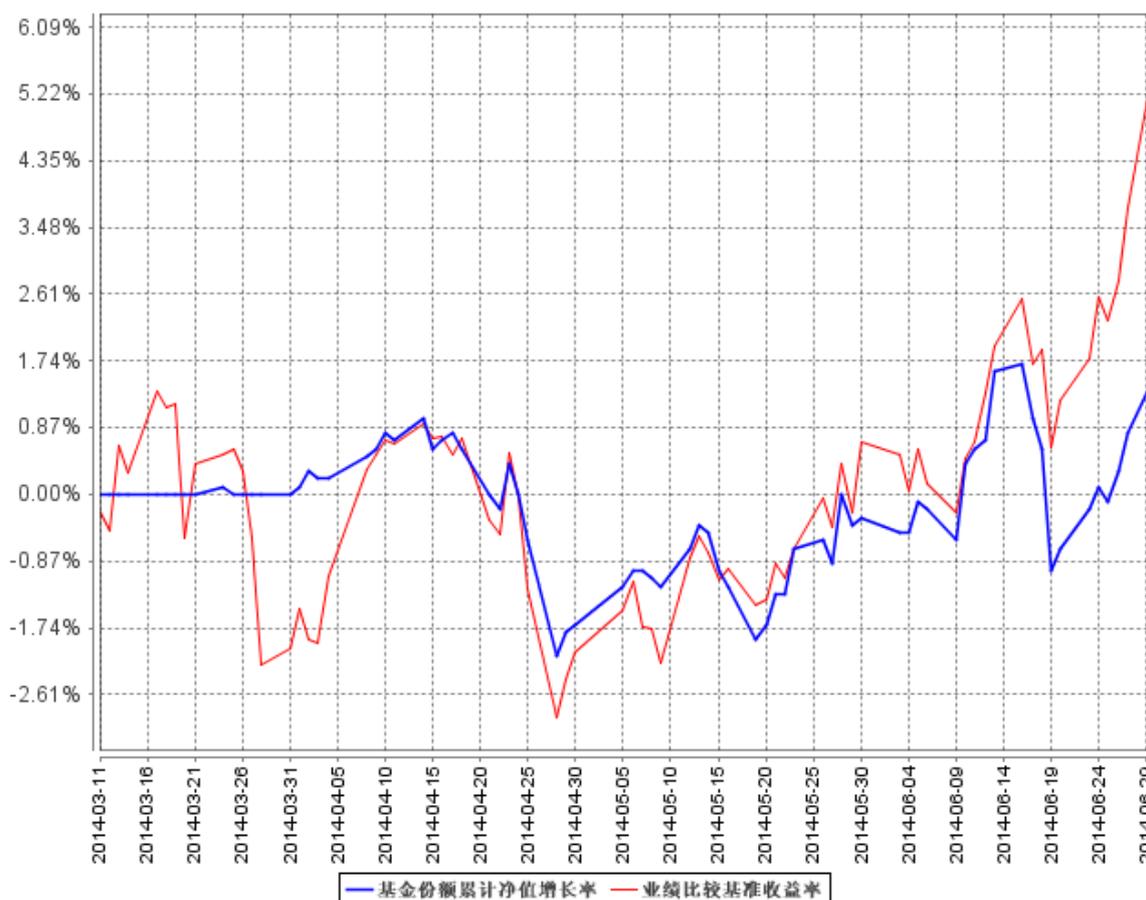
1、公允性。本基金为主题混合型基金，在综合比较目前市场上各主要行业指数的编制特点后，本基金选择以巨潮航天军工指数作为股票投资的业绩比较基准。巨潮航天军工指数是深圳证券信息有限公司编制，反映沪深证券市场上航天军工产品相关行业股票价格变动趋势的指数。本基金主要投资于投资航天海工装备等安全相关上市公司股票，因此巨潮航天军工指数适合作为本基金的业绩比较基准。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金股票投资占基金资产的比例为0%–95%，其中投资于航天海工装备等安全相关上市公司股票和债券的资产不低于非现金基金资产的80%；根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可使业绩比较更具有合理性。

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

3.2.2 自基金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：1、本基金基金合同生效日为 2014 年 3 月 11 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、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 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截至报告日仍处于建仓期。

3、本基金投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于航天海工装备等安全相关上市公司股票和债券的资产不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

§ 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 2014 年 6 月 30 日，基金管理人共管理一只封闭式基金、三十四只开放式基金，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		
张锦灿	本基金基金经理，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，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。	2014 年 3 月 11 日	-	9 年	男，1982 年 1 月出生，中国国籍。北京大学光华管理学院金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、研究主管、基金经理助理。2012 年 9 月加入长盛基金管理有限公司，曾任同益证券投资基金基金经理。现任长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金（本基金）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，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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，共发生 4 次同日反向

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

2014 年一季度，市场仍处于震荡下跌趋势中。春节前后，市场在次新股、新能源汽车、移动互联网、民营医院等主题带动下，有一波短暂的反弹，基本是一季度唯一的获利时间窗口。两会以后，随着一系列较差的经济数据公布，信用违约事件出现，人民币贬值，国外新经济股票调整，国内股票市场全面调整，成长股调整幅度较大。

2014 年二季度，市场仍处于弱中。4 月初，受流动性好于预期及政策影响，市场有波短暂的反弹，但随着新股发行重启，及上市公司业绩公布，市场尤其是创业板相关股票大跌。5 月下旬，随着“微刺激”政策连续出台，及新股发行数量的明确，市场开始反弹。国防军工相关上市公司，受成飞集成复牌，周边形势，以及科研院所改制预期影响，在 6 月中旬以后有一波非常不错的表现。

本基金在报告期处于建仓期，小仓位参与了季度末的政策性机会，主要仓位利用交易所回购及银行协存等投资工具进行了现金管理。但由于银行间资金较为充裕，现金管理收益一般。自 5 月中下旬之后，果断加仓，但本着绝对收益的原则，整体仓位并不很高，虽然也受益于军工机会，但并不充分。

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 1.016 元，本报告期份额净值增长率为 1.60%，同期业绩比较基准增长率为 5.83%。

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 2014 年，实体经济仍然不景气，不过，政府已经开始“微刺激”，人民币也已经贬值半年，预计经济在下半年会有个小反弹。今年的流动性是好于预期的，尤其是银行间，但利率仍然偏高。上市公司业绩受经济影响，仍然难以超出预期。市场的机会非常大一部分在于估值的变化，主要取决于增量资金及预期。

以创业板为代表的新经济相关行业，股价的主要驱动因素仍不是业绩，而是故事和并购。这是已经持续了 14 个月的投资模式，被越来越多的投资者，包括机构投资者主动或被迫接受。但是，随着业绩增速和股价表现差距越来越大，其空间越来越有限了。相反，一部分稳定增长的二线蓝筹公司，以汽车、家电、医药、消费品等行业公司为代表，还在实现利润的稳定增长，但受市场

风格因素影响，估值不断下降。未来，两种风格的收益差异会大幅缩小。

本基金投资范围相关的国防军工行业，将受益于政府国防投资，及军队、国企等方面改革，景气处于上升期。但由于历史的、政策的和管理的原因，相关公司业绩普遍较差，估值偏高。现阶段投资者，主要关注重组和政策，而非行业的景气度、增长，主题投资的特征较为明显，主要是配置型投资，波动较大，下半年、甚至更长时期内都将是如此。

结合相关行业特征，本基金未来将构建由代表性公司组成的核心股票池，重点根据市场状态、军工相关政策、投资者关注度等方面因素，从中期时间窗口考量，调整仓位，以绝对收益为导向，积极把握军工相关主题的板块性投资机会。

下半年，随着军队“反腐”工作的告一段落，军队、军工改革将拉开帷幕，周边关系仍处于震荡阶段，国际局势也较为复杂，我们倾向于认为相关公司会出现一个预期的高点，投资机会值得积极把握。但是，新经济个股如果发生趋势性调整，也可能会波及军工的投资信心，可能不是单边的趋势性机会，投资风险也值得关注。

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公司总经理（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

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

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间

同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 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十六条中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2014 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-4,958,506.50 元，其中：未分配利润已实现部分为-4,958,506.50 元，未分配利润未实现部分为 13,890,273.47 元。

§ 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 2014 年 3 月 11 日至 2014 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：长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	45,291,723.35
结算备付金		2,706,517.59
存出保证金		229,106.81
交易性金融资产	6.4.7.2	500,712,528.22
其中：股票投资		240,264,528.22
基金投资		-
债券投资		260,448,000.00
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	30,000,000.00
应收证券清算款		7,469,539.82
应收利息	6.4.7.5	1,616,477.13
应收股利		-
应收申购款		57,885.11
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		588,083,778.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30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		15,169,191.59
应付赎回款		3,564,944.41
应付管理人报酬		722,820.20
应付托管费		120,470.03
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	1,244,292.78
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	105,393.93
负债合计		20,927,112.94
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	558,224,898.12

未分配利润	6.4.7.10	8,931,766.97
所有者权益合计		567,156,665.09
负债和所有者权益总计		588,083,778.03

注：1、报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.016 元，基金份额总额 558,224,898.12 份。

2、本基金合同于 2014 年 3 月 11 日生效，本财务报表的实际编制期间为 2014 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 3 月 11 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 3 月 11 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		14,776,332.40
1. 利息收入		4,852,281.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,332,709.51
债券利息收入		1,702,068.45
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		817,503.18
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,011,027.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,899,088.33
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	989,661.31
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	898,399.84
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	14,265,323.58
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	669,754.86
减：二、费用		5,583,862.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,006,940.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	501,156.72
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,976,487.79
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	99, 276. 99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9, 192, 470. 30
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9, 192, 470. 30

注：本基金合同于 2014 年 3 月 11 日生效，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2014 年 3 月 11 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 3 月 11 日(基金合同生效日)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)	741, 260, 519. 36	-	741, 260, 519. 36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9, 192, 470. 30	9, 192, 470. 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)	-183, 035, 621. 24	-260, 703. 33	-183, 296, 324. 57
其中：1. 基金申购款	9, 883, 438. 96	-53. 68	9, 883, 385. 28
2. 基金赎回款	-192, 919, 060. 20	-260, 649. 65	-193, 179, 709. 85
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)	558, 224, 898. 12	8, 931, 766. 97	567, 156, 665. 09

注：本基金合同于 2014 年 3 月 11 日生效，无上年度可比期间。

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

林培富

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

长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]107 号文《关于核准长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由长盛基金管理有限公司于 2014 年 2 月 17 日至 2014 年 3 月 7 日向社会公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具安永华明（2014）验字第 60468688_A01 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2014 年 3 月 11 日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金设立时已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 741,039,135.73 元，折合 741,039,135.73 份基金份额；募集资金在募集期间产生的利息为人民币 221,383.63 元，折合 221,383.63 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 741,260,519.36 元，折合 741,260,519.36 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均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。

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、股指期货、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。其中，股票等权益类资产占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于航天海工装备等安全相关上市公司股票和债券的资产不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准是： $50\% \times \text{巨潮航天军工指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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、完整的反映了本基金 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2014 年 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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2014 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2014 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效

套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同

一 证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况

况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率逐日计提；

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 在符合上述第 1 条规定的前提下，在每年度的 12 月 31 日，若本基金的当年度份额净值增长率超过 10%，则将基金可供分配利润的 80% 分配给投资者。在基金合同生效日所在年度，当年的基

金份额净值增长率为基金合同生效日至当年 12 月 31 日期间的基金份额净值增长率；自基金合同生效次年起，当年的基金份额净值增长率为上一年度 12 月 31 日至当年 12 月 31 日期间的份额净值增长率；收益分配基准日为每年 12 月 31 日；

(3) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

(5) 每一基金份额享有同等分配权；

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

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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

1、印花税

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

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

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

暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

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

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

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

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

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

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

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

人所得税。

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 2014年6月30日
活期存款	45,291,723.35
定期存款	-
其他存款	-
合计：	45,291,723.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	226,454,859.97	240,264,528.22	13,809,668.25	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	259,992,344.67	260,448,000.00	455,655.33
	合计	259,992,344.67	260,448,000.00	455,655.33
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	486,447,204.64	500,712,528.22	14,265,323.58	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	30,000,000.00	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	30,000,000.00	-

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 2014年6月30日
应收活期存款利息	39,076.08
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	1,096.20
应收债券利息	1,555,217.53
应收买入返售证券利息	20,982.90
应收申购款利息	11.63
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	92.79
合计	1,616,477.13

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 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,242,142.78
银行间市场应付交易费用	2,150.00
合计	1,244,292.78

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,908.17
预提费用	96,485.76
合计	105,393.93

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年3月11日(基金合同生效日)至2014年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	741,260,519.36	741,260,519.36
本期申购	9,883,438.96	9,883,438.96
本期赎回(以“-”号填列)	-192,919,060.20	-192,919,060.20
本期末	558,224,898.12	558,224,898.12

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金自 2014 年 2 月 17 日至 2014 年 3 月 7 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 741,039,135.73 元。根据《长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 221,383.63 元在本基金成立后，折算为 221,383.63 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据《长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2014 年 3 月 11 日(基金合同生效日)至 2014 年 4 月 17 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购和赎回业务自 2014 年 4 月 18 日起开始办理。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-5,072,853.28	14,265,323.58	9,192,470.30
本期基金份额交易产生的变动数	114,346.78	-375,050.11	-260,703.33
其中：基金申购款	-32,864.27	32,810.59	-53.68
基金赎回款	147,211.05	-407,860.70	-260,649.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,958,506.50	13,890,273.47	8,931,766.97

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 3 月 11 日(基金合同生效日)至 2014 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	671,145.44
定期存款利息收入	1,632,138.89
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	28,910.74
其他	514.44
合计	2,332,709.51

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 2014年3月11日(基金合同生效日)至2014 年6月30日
卖出股票成交总额	565,538,021.28
减：卖出股票成本总额	572,437,109.61
买卖股票差价收入	-6,899,088.33

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月11日(基金合同生效日)至2014年 6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	74,108,566.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	72,796,690.37
减：应收利息总额	322,214.88
债券投资收益	989,661.31

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本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 2014年3月11日(基金合同生效日)至2014年6 月30日
股票投资产生的股利收益	898,399.84
基金投资产生的股利收益	-
合计	898,399.84

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年3月11日(基金合同生效日)至2014 年6月30日
------	--

1. 交易性金融资产	14,265,323.58
——股票投资	13,809,668.25
——债券投资	455,655.33
——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	14,265,323.58

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月11日(基金合同生效日)至2014 年6月30日
基金赎回费收入	667,390.79
转换费收入	2,364.07
合计	669,754.86

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减。

2、本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、基金转换费用由转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用的补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费差异情况和转出基金的赎回费而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月11日(基金合同生效日)至2014 年6月30日
交易所市场交易费用	1,974,337.79
银行间市场交易费用	2,150.00
合计	1,976,487.79

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年3月11日(基金合同生效日)至2014 年6月30日
审计费用	22,702.40
信息披露费	73,783.36
汇划手续费	2,791.23
合计	99,276.99

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”）	基金管理人、注册登记机构、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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

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 2014年3月11日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,006,940.60
其中：支付销售机构的客户维护费	1,470,166.77

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的1.5%年费率计

提，逐日累计至每月月末，按月支付。

其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2014年3月11日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	501,156.72	

注：支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/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：本基金本报告期未发生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自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自有资金投资本基金。

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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

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	
	2014年3月11日(基金合同生效日)至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	45,291,723.35	671,145.44

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

本基金本期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2014 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002727	一心堂	2014 年 6 月 25 日	2014 年 7 月 2 日	新股流通受限	12.20	12.20	2,152	26,254.40	26,254.40	-

注：基金可使用以基金名义开设股票账户，选择网下或者网上一种方式进行新股申购。从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
300351	永贵电器	2014/6/23	重大事项停牌	26.29	2014/8/7	27.61	607,272	12,656,294.40	15,965,180.88	-

注：本基金截至 2014 年 6 月 30 日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

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

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

本基金的基金管理人建立了以风险控制管理委员会为核心、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。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014年6月30日
A-1	120,162,000.00
A-1 以下	-
未评级	140,286,000.00
合计	260,448,000.00

注：表中所列示的未评级均为截至本期末无信用评级的超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本期末无按长期信用评级列示的债券投资。

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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014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	45,291,723.35	-	-	-	-	-	45,291,723.35
结算备付金	2,706,517.59	-	-	-	-	-	2,706,517.59
存出保证金	229,106.81	-	-	-	-	-	229,106.81
交易性金融资产	40,054,000.00	80,042,000.00	140,352,000.00	-	-	-240,264,528.22	500,712,528.22
买入返售金融资产	30,000,000.00	-	-	-	-	-	30,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,469,539.82	7,469,539.82
应收利息	-	-	-	-	-	1,616,477.13	1,616,477.13
应收申购款	298.21	-	-	-	-	57,586.90	57,885.11
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	118,281,645.96	80,042,000.00	140,352,000.00	-	-	-249,408,132.07	588,083,778.03
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	15,169,191.59	15,169,191.59
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,564,944.41	3,564,944.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	722,820.20	722,820.20
应付托管费	-	-	-	-	-	120,470.03	120,470.03
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,244,292.78	1,244,292.78
其他负债	-	-	-	-	-	105,393.93	105,393.93
负债总计	-	-	-	-	-	20,927,112.94	20,927,112.94
利率敏感度缺口	118,281,645.96	80,042,000.00	140,352,000.00	-	-	-228,481,019.13	567,156,665.09

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2014年6月30日）
	市场利率上升 25 个基点	-216,541.06
	市场利率下降 25 个基点	216,541.06

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

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于航天海工装备等安全相关上市公司股票和债券的资产不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。于 2014 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

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 2014 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	240,264,528.22	42.36
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	240,264,528.22	42.36

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2014 年 6 月 30 日，本基金运营不满一年，无足够历史数据分析其他价格风险敏感性。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金无需作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	240,264,528.22	40.86
	其中：股票	240,264,528.22	40.86
2	固定收益投资	260,448,000.00	44.29
	其中：债券	260,448,000.00	44.29
	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	30,000,000.00	5.10
	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	47,998,240.94	8.16
7	其他各项资产	9,373,008.87	1.59
8	合计	588,083,778.03	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	-	-
C	制造业	218,815,455.12	38.58
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	26,254.40	0.00
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	21,422,818.70	3.78
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	240,264,528.22	42.36

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

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	600372	中航电子	1,050,021	23,803,976.07	4.20
2	000748	长城信息	1,012,436	22,951,924.12	4.05
3	000801	四川九洲	1,249,879	16,848,368.92	2.97
4	002138	顺络电子	800,000	16,688,000.00	2.94
5	600562	国睿科技	309,799	16,589,736.45	2.93
6	300351	永贵电器	607,272	15,965,180.88	2.81
7	002179	中航光电	899,945	15,794,034.75	2.78
8	002266	浙富股份	2,199,878	15,597,135.02	2.75
9	002118	紫鑫药业	999,879	14,148,287.85	2.49
10	002439	启明星辰	649,980	13,903,072.20	2.45
11	002460	赣锋锂业	350,000	12,600,000.00	2.22
12	300034	钢研高纳	694,649	11,538,119.89	2.03
13	002664	信质电机	199,998	10,269,897.30	1.81
14	600038	哈飞股份	299,932	8,347,107.56	1.47
15	300324	旋极信息	299,950	7,519,746.50	1.33
16	300114	中航电测	350,000	6,954,500.00	1.23
17	300367	天保重装	69,963	5,918,869.80	1.04
18	600416	湘电股份	499,903	4,784,071.71	0.84
19	002727	一心堂	2,152	26,254.40	0.00
20	603006	黎明股份	1,136	16,244.80	0.00

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601766	中国南车	52,777,508.01	9.31
2	601299	中国北车	45,100,057.05	7.95
3	600038	哈飞股份	25,300,749.80	4.46
4	000748	长城信息	24,809,632.17	4.37
5	600416	湘电股份	23,479,131.70	4.14
6	000625	长安汽车	23,398,632.44	4.13
7	600584	长电科技	22,847,181.55	4.03
8	600884	杉杉股份	22,414,761.74	3.95
9	002049	同方国芯	22,171,240.49	3.91
10	600372	中航电子	21,944,942.70	3.87
11	002030	达安基因	20,794,501.87	3.67
12	300351	永贵电器	19,875,455.66	3.50
13	600391	成发科技	19,316,494.79	3.41
14	002138	顺络电子	19,229,999.13	3.39
15	600562	国睿科技	18,621,346.03	3.28
16	300077	国民技术	18,512,963.90	3.26
17	601989	中国重工	18,370,417.75	3.24
18	300002	神州泰岳	17,840,208.37	3.15
19	600150	中国船舶	17,403,126.03	3.07
20	600760	中航黑豹	16,758,139.92	2.95
21	000801	四川九洲	16,743,654.94	2.95
22	600705	中航投资	16,245,287.49	2.86
23	002266	浙富股份	15,893,943.79	2.80
24	002179	中航光电	15,635,184.34	2.76
25	600343	航天动力	15,587,580.40	2.75
26	601099	太平洋	14,778,336.92	2.61
27	002465	海格通信	14,734,949.46	2.60
28	600125	铁龙物流	14,706,811.11	2.59
29	600104	上汽集团	14,471,544.57	2.55
30	002118	紫鑫药业	14,390,168.11	2.54
31	000333	美的集团	14,243,937.53	2.51

32	300114	中航电测	13,982,916.09	2.47
33	002439	启明星辰	12,936,429.00	2.28
34	002460	赣锋锂业	12,142,481.51	2.14
35	600893	航空动力	11,471,896.65	2.02
36	300034	钢研高纳	11,439,472.97	2.02

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601766	中国南车	50,472,044.43	8.90
2	601299	中国北车	42,391,055.22	7.47
3	000625	长安汽车	26,223,415.92	4.62
4	002049	同方国芯	23,434,415.96	4.13
5	600584	长电科技	23,194,228.35	4.09
6	600884	杉杉股份	21,623,668.81	3.81
7	002030	达安基因	20,839,275.70	3.67
8	601989	中国重工	19,181,033.65	3.38
9	600391	成发科技	17,872,106.34	3.15
10	600760	中航黑豹	17,416,805.90	3.07
11	600416	湘电股份	17,343,149.01	3.06
12	300077	国民技术	17,069,876.75	3.01
13	600038	哈飞股份	16,589,511.06	2.93
14	300002	神州泰岳	16,518,915.34	2.91
15	600343	航天动力	16,469,914.00	2.90
16	600150	中国船舶	16,369,314.14	2.89
17	002465	海格通信	15,050,237.51	2.65
18	600705	中航投资	14,911,426.54	2.63
19	601099	太平洋	14,690,611.82	2.59
20	600104	上汽集团	14,670,642.85	2.59
21	600125	铁龙物流	13,782,317.87	2.43
22	000333	美的集团	12,728,014.68	2.24

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	798,891,969.58
卖出股票收入（成交）总额	565,538,021.28

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	260,448,000.00	45.92
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	260,448,000.00	45.92

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	011426002	14 中金集 SCP002	200,000	20,074,000.00	3.54
2	041461024	14 兵器 CP001	200,000	20,062,000.00	3.54
3	011410002	14 中电投 SCP002	200,000	20,058,000.00	3.54
4	011409002	14 国电集 SCP002	200,000	20,046,000.00	3.53
5	011411005	14 大唐 SCP005	200,000	20,042,000.00	3.53

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

注：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

吉林紫鑫药业股份有限公司（以下简称“公司”或“紫鑫药业”）于 2011 年 10 月 19 日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（稽查总队调查通字 11223 号）。因公司涉嫌证券违法违规行为，中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）稽查总队决定对公司立案稽查。详细情况请见公司 2011 年 10 月 21 日发布的《关于中国证监会对公司立案稽查的公告》。2014 年 2 月 21 日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》[2014]24 号，现将《行政处罚决定书》的内容公告如下：依据《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）的有关规定，中国证监会对紫鑫药业信息披露违法违规行为进行了立案调查、审理，并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人紫鑫药业、郭春生、曹恩辉、祖春香、殷金龙、李飞、方勇、韩明、徐吉峰未提出陈述、申辩意见，未要求听证。本案现已审理终结。

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	229,106.81
2	应收证券清算款	7,469,539.82
3	应收股利	-
4	应收利息	1,616,477.13
5	应收申购款	57,885.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,373,008.87

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	300351	永贵电器	15,965,180.88	2.81	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
11,716	47,646.37	39,432,089.61	7.06%	518,792,808.51	92.94%

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	49,704.87	0.0089%

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（2014年3月11日）基金份额总额	741,260,519.36
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,883,438.96
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	192,919,060.20
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	558,224,898.12

§ 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**

本基金管理人于2014年4月16日发布公告，经公司第五届董事会第五十七次会议以及第六届董事会第一次会议审议通过，并报中国证监会审核批准，由高新先生担任公司董事长，凤良志先生因年龄原因不再担任公司董事长职务。根据公司章程相关规定，“董事长为公司的法定代表人”。公司已于2014年4月14日完成相关工商登记变更手续。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

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	
国金证券	1	147,813,793.34	10.83%	134,568.60	10.83%	-
国泰君安	2	139,696,534.24	10.24%	127,179.99	10.24%	-
国信证券	1	307,574,831.44	22.54%	280,014.86	22.54%	-
海通证券	1	182,099,324.17	13.35%	165,784.00	13.35%	-
齐鲁证券	1	153,704,905.60	11.27%	139,932.72	11.27%	-
西南证券	1	433,503,067.19	31.77%	394,662.61	31.77%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-

华鑫证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国金证券	28,687,656.10	43.13%	30,000,000.00	0.92%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	17,874,552.30	26.87%	2,255,700,000.00	69.50%	-	-
海通证券	14,929,318.20	22.45%	930,000,000.00	28.65%	-	-
齐鲁证券	5,023,364.70	7.55%	30,000,000.00	0.92%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

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

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	江海证券	上海	1

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	长盛基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》及本公司网站	2014年4月16日
2	长盛基金管理有限公司关于董事长变更的公告	同上	2014年4月16日
3	长盛航天海工装备灵活配置混合型基金开放日常申购 赎回 转换及定期定额投资业务的公告	同上	2014年4月15日
4	关于增加钱景为旗下开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2014年3月24日

5	关于增加恒天明泽为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2014年3月24日
6	长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	同上	2014年3月12日
7	关于增加长盛航天海工灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	同上	2014年2月28日
8	关于增加长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	同上	2014年2月24日
9	关于增加长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	同上	2014年2月21日
10	长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	同上	2014年2月14日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人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
2014年8月28日