

长盛量化红利策略股票型证券投资基金 2014 年年度报告摘要

2014 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 28 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛量化红利股票
基金主代码	080005
交易代码	080005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 11 月 25 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	537,284,644.27 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标，并追求风险调整后的收益最大化，满足投资人长期稳健的投资收益需求。
投资策略	本基金通过严格的数量化股票选择方法生成红利风格股票池，在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合，从而形成基于核心-卫星投资策略的股票资产组合。其中，大类资产配置策略综合考虑宏观经济、政策导向和市场环境（市场估值水平、资金供求）等因素，股票投资中将以红利股票投资为主导，以价值型企业及分红能力作为选择投资对象的核心标准。
业绩比较基准	中证红利指数×75%+中证综合债指数×25%
风险收益特征	本基金为股票型基金产品，风险高于混合型基金、债券基金和货币市场基金，属于较高风险，较高回报的基金产品。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	赵会军
	联系电话	010-82019988	010-66105799
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666、 010-62350088	95588
传真		010-82255988	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
---------------------	---

基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址
------------	------------------

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	62,616,419.67	22,337,538.55	-30,079,758.79
本期利润	122,903,148.57	16,258,602.82	5,803,066.67
加权平均基金份额本期利润	0.3756	0.0672	0.0211
本期基金份额净值增长率	43.41%	7.44%	2.42%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2079	-0.0896	-0.1535
期末基金资产净值	701,405,928.80	200,678,745.52	220,687,886.81
期末基金份额净值	1.305	0.910	0.847

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 12 月 31 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
过去三个月	4.07%	1.57%	23.08%	1.07%	-19.01%	0.50%
过去六个月	23.00%	1.31%	39.62%	0.88%	-16.62%	0.43%
过去一年	43.41%	1.40%	38.77%	0.85%	4.64%	0.55%
过去三年	57.80%	1.16%	38.64%	0.97%	19.16%	0.19%
过去五年	35.09%	1.17%	4.73%	1.00%	30.36%	0.17%
自基金合同生效起至今	35.90%	1.16%	6.54%	1.02%	29.36%	0.14%

注：本基金业绩比较基准：中证红利指数×75%+中证综合债指数×25%

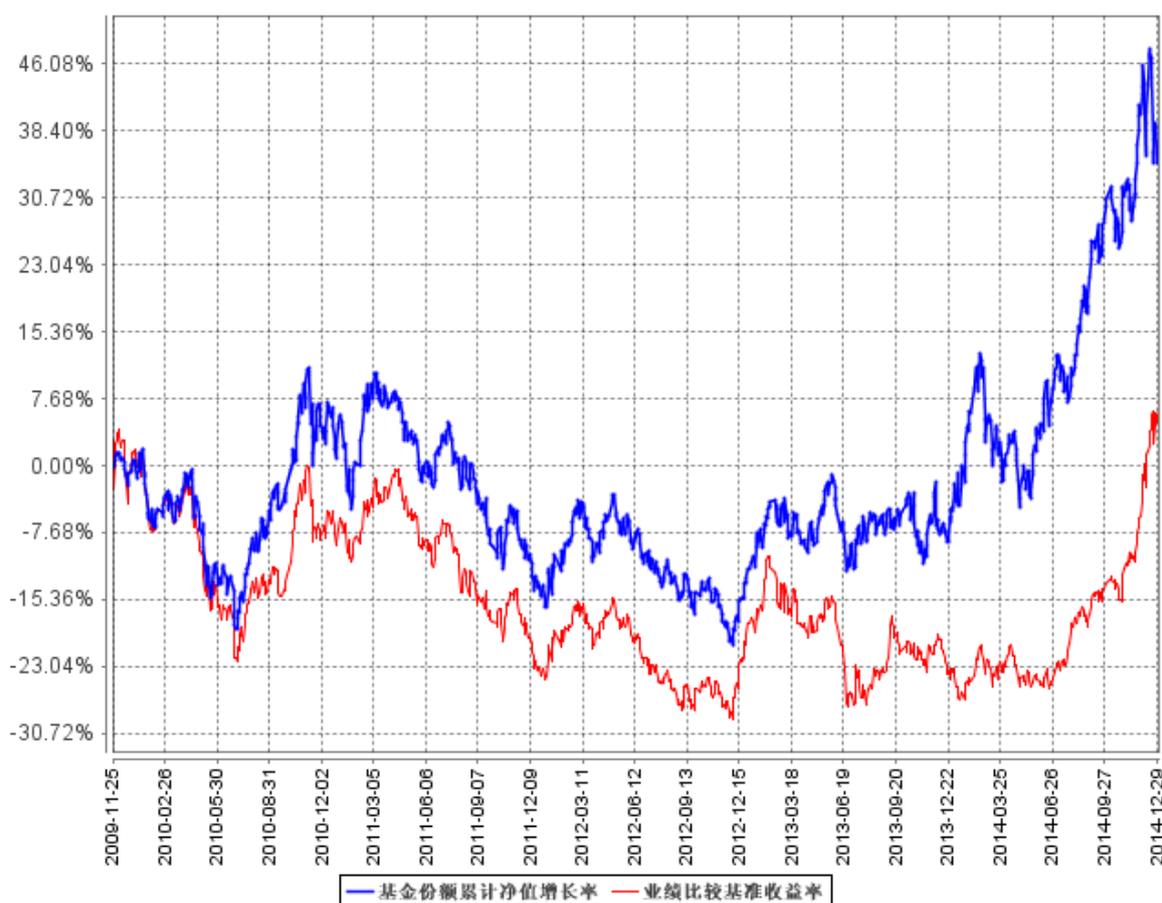
其中，中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的 100 只股票作为样本，以反映 A 股市场高红利股票的整体状况和走

势。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，作为衡量本基金业绩的基准，较为合适。中证综合债指数是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债和企业债，以更加全面地反映中国债券市场整体价格变动趋势。

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 75%、25% 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

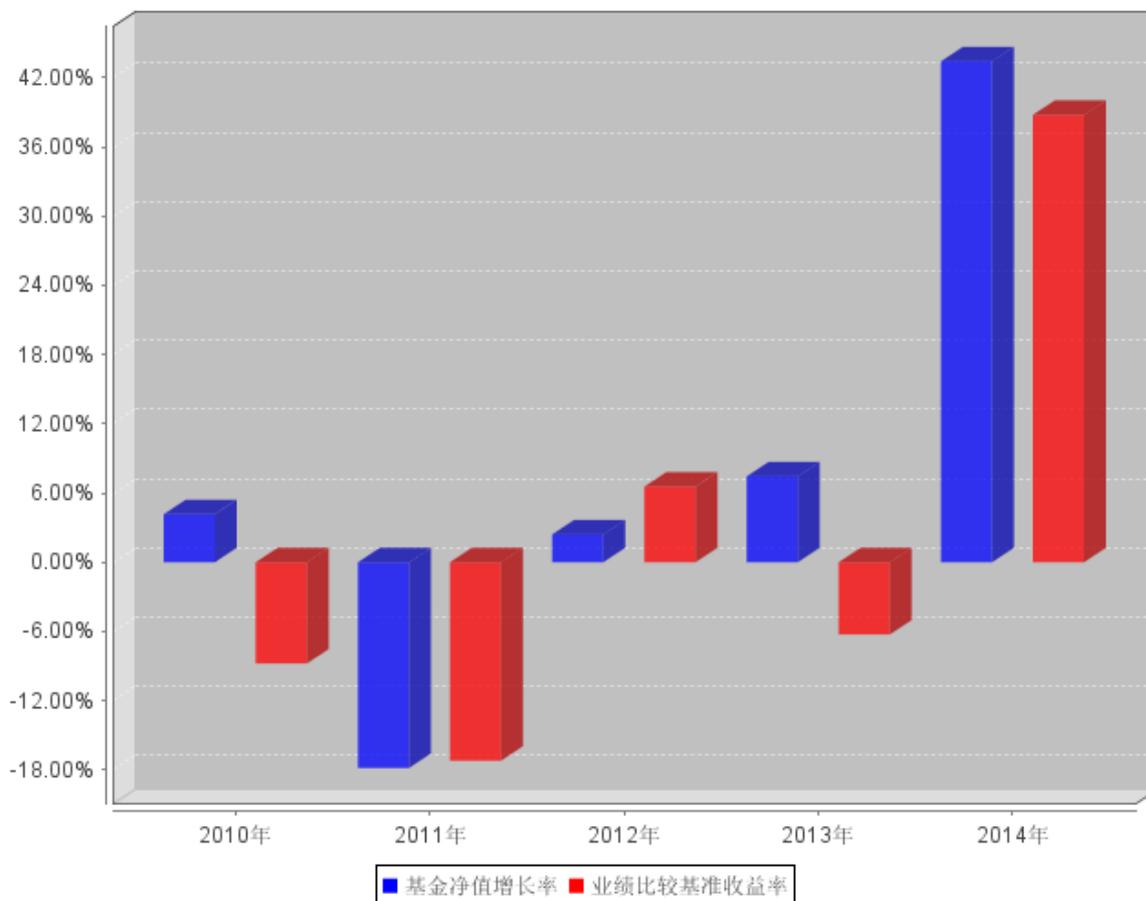
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自本基金成立六个月内，使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十一部分投资范围、投资限制的有关约定。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014	-	-	-	-	注：2014年度未分配收益
2013	-	-	-	-	注：2013年度未分配收益
2012	-	-	-	-	注：2012年度未分配收益
合计	-	-	-	-	

§ 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 2014 年 12 月 31 日，基金管理人共管理三十七只开放式基金，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		
翟彦奎	本基金基金经理，长盛成长价值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，长盛动态精选证券投资基金基金经理。	2013 年 8 月 30 日	-	6 年	男，1982 年 3 月出生，中国国籍。中国人民银行研究生部经济学硕士。2009 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任行业研究员，基金经理助理等职务。现任长盛成长价值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（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，长盛动态精选证券投资基金基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司对该基金过去 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生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

海外市场，美国 2014 年经济复苏确立，美联储开始考虑退出 QE。全年道琼斯指数涨 7.99%，纳斯达克涨 14.01%；欧洲经济不断反复，欧元区货币宽松，德国法兰克福 DAX 指数涨 2.65%，伦敦富时 100 指数跌 2.45%。全球除美国外经济均放缓，叠加 QE 退出导致全球大宗商品普遍收跌，

原油价格暴跌。

国内市场全年主要矛盾是经济下滑的压力与政府“微刺激”背景下宽松的流动性，前三个季度中，成长股、市值管理股和军工持续活跃，轮番表现，但在四季度，尤其 11 月 21 日中国央行宣布降息后，资金开始大力度追捧股票市场，券商两融规模不断创新高，低 PB 大盘蓝筹股大幅上涨，形成一波指数“牛市”行情。上证综指全年上涨 54.21%，代表超大盘股的上证 50 上涨 66.78%。而代表成长股的创业板和中小板在 4 季度开始落后于主板，全年创业板综指上涨 26.26%，创业板指上涨 12.52%。

基于基金契约，我们全年给量化红利基金赋予了投资阶段性高成长红利股的风格，主要原因是量化红利基金契约对上市公司过去和未来的业绩增速极为重视，这也是量化红利风格池的主要入池标准。我们将具有未来阶段性高成长能力的红利股作为主要品种，主要为符合国内经济转型方向的 TMT、高端装备（新能源、军工、智能装备、节能环保）和医药等行业。同时，基于市场风格，我们也动态适度增加了大盘蓝筹股的仓位。

前三个季度我们相对表现良好，但由于四季度对市场偏向大盘蓝筹风格的力度和持续性存在低估，尤其对降息信号的解读存在低估，虽然在四季度增加了大市值蓝筹股来对冲组合的成长风格，但由于大市值股票仓位有限，导致我们的业绩落后于同业，更是落后于主板指数，四季度的业绩表现不能令人满意。

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 1.305 元，本报告期份额净值增长率为 43.41%，业绩比较基准收益率为 38.77%，基金净值增长高于比较基准 4.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年，我们判断国内经济将逐步触底企稳，改革与政策刺激会成为全年的主题。流动性上，美国逐步退出 QE，但其他国家推行各种方式的货币宽松政策，国内流动性可能会由“用好增量、盘活存量”的结构性流动性转变为普惠式的流动性宽松，在实体经济机会不大的情况下，过度宽松的流动性会追逐以证券市场为代表的虚拟经济。财政上继续调结构，结构上“一带一路”、京津冀、自贸区，以及具体的铁路、电力、棚户区改造投资成为托底政策，这些也是受益政策刺激的行业。我们判断目前时点类似于美国的 80 年代，在经济结构转型没有成功前，成长型股票和周期型股票均会受益流动性充裕，A 股可能继续以结构性行情为主，但结构风格转换的频率可能会加快。

我们将密切关注经济数据和市场情绪，及时调整资产、风格和行业配置，并将重点放在个股

层面深度挖掘。1 季度，主体配置仍为“具有阶段性高成长能力的红利股”，目前这些个股集中在 TMT、高端装备（新能源、军工、智能装备、节能环保）和医药行业。同时我们吸取 2014 年 4 季度低估风格转换力度和持续期的教训，对大市值蓝筹股会提高灵活度，并灵活增加相应仓位空间。

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十五条中对基金利润分配原则的约定，2014 年度未实施利润分配。

本基金截至 2014 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 111,703,227.51 元，其中：未分配利润已实现部分为 111,703,227.51 元，未分配利润未实现部分为 52,418,057.02 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对长盛量化红利策略股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，长盛量化红利策略股票型证券投资基金的管理人——长盛基金管理有限公司在长盛量化红利策略股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，长盛量化红利策略股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的长盛量化红利策略股票型证券投资基金 2013 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师汪棣、沈兆杰于 2015 年 3 月 23 日对本基金 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2015)第 20185 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛量化红利策略股票型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	69,522,934.64	12,359,671.63
结算备付金	3,473,878.15	745,386.12
存出保证金	165,807.08	91,035.77
交易性金融资产	637,916,674.91	148,050,170.45
其中：股票投资	637,916,674.91	148,050,170.45
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	40,761,892.56
应收利息	23,443.09	9,003.93
应收股利	-	-
应收申购款	1,695,884.06	7,509.86
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	712,798,621.93	202,024,670.32
负债和所有者权益	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 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	27,383.13	-
应付赎回款	9,210,613.43	418,446.46
应付管理人报酬	1,040,976.00	253,376.86
应付托管费	173,496.00	42,229.44
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	627,019.85	301,393.61
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	313,204.72	330,478.43
负债合计	11,392,693.13	1,345,924.80
所有者权益：		
实收基金	537,284,644.27	220,439,908.87

未分配利润	164,121,284.53	-19,761,163.35
所有者权益合计	701,405,928.80	200,678,745.52
负债和所有者权益总计	712,798,621.93	202,024,670.32

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值：1.305 元，基金份额总额：537,284,644.27 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛量化红利策略股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入	132,133,749.33	22,295,988.87
1. 利息收入	1,010,172.17	594,637.87
其中：存款利息收入	569,266.18	518,223.93
债券利息收入	-	57.81
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	440,905.99	76,356.13
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	69,969,835.48	27,773,766.44
其中：股票投资收益	68,956,928.72	25,435,161.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	52,450.62
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	1,012,906.76	2,286,154.42
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	60,286,728.90	-6,078,935.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	867,012.78	6,520.29
减：二、费用	9,230,600.76	6,037,386.05
1. 管理人报酬	5,616,921.27	3,247,414.64
2. 托管费	936,153.59	541,235.70
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,331,414.41	1,906,319.10
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	346,111.49	342,416.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填	122,903,148.57	16,258,602.82

列)		
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	122,903,148.57	16,258,602.82

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛量化红利策略股票型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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）	220,439,908.87	-19,761,163.35	200,678,745.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	122,903,148.57	122,903,148.57
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）	316,844,735.40	60,979,299.31	377,824,034.71
其中：1. 基金申购款	999,802,685.75	212,341,243.17	1,212,143,928.92
2. 基金赎回款	-682,957,950.35	-151,361,943.86	-834,319,894.21
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）	537,284,644.27	164,121,284.53	701,405,928.80
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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）	260,692,402.98	-40,004,516.17	220,687,886.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,258,602.82	16,258,602.82
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）	-40,252,494.11	3,984,750.00	-36,267,744.11

其中：1. 基金申购款	5,051,517.74	-528,801.63	4,522,716.11
2. 基金赎回款	-45,304,011.85	4,513,551.63	-40,790,460.22
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）	220,439,908.87	-19,761,163.35	200,678,745.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>周兵</u>	<u>林培富</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛量化红利策略股票型证券投资基金(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[2009]927号《关于核准长盛量化红利策略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《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,251,673,981.96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(2009)第248号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》于2009年11月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,251,832,665.50份基金份额,其中认购资金利息折合158,683.54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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《长盛量化红利策略股票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,主要包括国内依法发行、上市的股票、债券、短期金融工具、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。股票投资占基金资产净值的比例为60-95%,其中投资于红利股票的比例不低于股票类资产的80%。债券投资占基金资产净值的比例为0-40%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。本基金的业绩比较基准为:中证红利指数×75%+中证综合债指数×25%。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于2015年3月23日批准报出。

7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》各项具体会计准则及相关规定(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》、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年度 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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》, 要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外, 其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	占当期股票成交总额的比例	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	占当期股票成交总额的比例
国元证券	9,079,554.20	0.55%	37,117,164.73	3.01%

7.4.8.1.2 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	8,266.04	0.55%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	33,791.77	3.02%	33,791.77	11.21%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,616,921.27	3,247,414.64
其中：支付销售机构的客户维护费	732,346.17	685,303.27

注：支付基金管理人长盛基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	936,153.59	541,235.70

注：支付基金托管人中国工商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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
期初持有的基金份额	30,000,050.00	30,000,050.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	30,000,050.00	30,000,050.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.58%	13.61%

7.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014年12月31日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
安徽省投资集团 控股有限公司	-	-	27,999,980.00	12.70%
国元证券	-	-	9,000,000.00	4.08%

7.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	69,522,934.64	530,510.96	12,359,671.63	508,078.77

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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
600487	亨通光电	2014年10月30日	重大事项	19.80	2015年1月19日	20.60	129,820	2,258,852.71	2,570,436.00	-
600584	长电科技	2014年11月3日	重大资产重组	10.52	2015年1月14日	12.24	570,000	4,033,874.35	5,996,400.00	-
600845	宝信软件	2014年12月29日	重大事项	33.50	2015年1月12日	36.00	199,846	6,456,052.71	6,694,841.00	-
300081	恒信移动	2014年12月5日	重大资产重组	24.90	2015年3月5日	28.00	620,000	8,961,529.95	15,438,000.00	-
002396	星网锐捷	2014年10月20日	重大事项	27.31	2015年2月9日	30.04	129,908	3,639,764.76	3,547,787.48	-

注：本基金截至2014年12月31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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 603,669,210.43 元，属于第二层次的余额为 34,247,464.48 元，无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层次 145,885,123.95 元，第二层次 2,165,046.50 元，无第三层次)。

(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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	637,916,674.91	89.49
	其中：股票	637,916,674.91	89.49
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	72,996,812.79	10.24
7	其他各项资产	1,885,134.23	0.26
8	合计	712,798,621.93	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	314,393,974.64	44.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,400,000.00	5.19
F	批发和零售业	21,916,000.00	3.12
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	165,023,900.27	23.53
J	金融业	100,182,800.00	14.28
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	637,916,674.91	90.95

8.3 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	300351	永贵电器	979,930	39,902,749.60	5.69
2	601668	中国建筑	5,000,000	36,400,000.00	5.19
3	300303	聚飞光电	1,937,587	33,093,985.96	4.72
4	600837	海通证券	1,230,000	29,593,800.00	4.22
5	600015	华夏银行	2,100,000	28,266,000.00	4.03
6	601988	中国银行	5,100,000	21,165,000.00	3.02
7	300155	安居宝	1,049,962	18,689,323.60	2.66
8	300115	长盈精密	999,800	18,126,374.00	2.58
9	002580	圣阳股份	1,039,843	17,968,487.04	2.56
10	300075	数字政通	682,159	17,279,087.47	2.46

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> 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300351	永贵电器	37,466,283.78	18.67
2	300303	聚飞光电	29,108,562.30	14.51
3	601668	中国建筑	24,671,224.00	12.29
4	600015	华夏银行	22,643,218.00	11.28
5	300075	数字政通	20,683,293.93	10.31
6	002580	圣阳股份	20,426,167.10	10.18
7	601988	中国银行	19,675,000.00	9.80
8	002609	捷顺科技	18,678,537.30	9.31
9	002649	博彦科技	18,515,405.58	9.23
10	300036	超图软件	18,334,066.04	9.14
11	000733	振华科技	17,909,561.17	8.92
12	600446	金证股份	17,363,017.92	8.65
13	300115	长盈精密	17,143,322.73	8.54
14	002388	新亚制程	15,922,840.85	7.93
15	600837	海通证券	15,824,139.40	7.89
16	600999	招商证券	15,219,771.96	7.58
17	300227	光韵达	14,852,523.35	7.40

18	300155	安居宝	13,985,488.61	6.97
19	300232	洲明科技	13,771,885.75	6.86
20	002253	川大智胜	13,716,030.36	6.83
21	300255	常山药业	13,275,646.47	6.62
22	601231	环旭电子	12,273,079.08	6.12
23	601601	中国太保	11,941,035.78	5.95
24	600549	厦门钨业	11,047,907.85	5.51
25	300275	梅安森	10,939,039.54	5.45
26	300231	银信科技	10,671,717.81	5.32
27	600498	烽火通信	10,407,428.00	5.19
28	300339	润和软件	10,227,662.84	5.10
29	300348	长亮科技	9,873,699.94	4.92
30	002063	远光软件	9,800,156.19	4.88
31	002587	奥拓电子	9,582,872.96	4.78
32	002179	中航光电	9,567,063.96	4.77
33	300081	恒信移动	9,515,707.11	4.74
34	300290	荣科科技	8,827,597.79	4.40
35	002410	广联达	8,675,853.27	4.32
36	002657	中科金财	8,631,214.76	4.30
37	601318	中国平安	8,554,765.00	4.26
38	300383	光环新网	7,845,960.10	3.91
39	300219	鸿利光电	7,788,034.04	3.88
40	002501	利源铝业	7,752,374.36	3.86
41	002606	大连电瓷	7,598,738.99	3.79
42	300302	同有科技	7,536,267.00	3.76
43	600133	东湖高新	7,353,970.16	3.66
44	300209	天泽信息	7,283,081.38	3.63
45	002156	通富微电	7,180,449.05	3.58
46	600016	民生银行	7,175,170.90	3.58
47	300353	东土科技	7,107,636.76	3.54
48	600682	南京新百	7,005,920.28	3.49
49	300328	宜安科技	6,927,872.54	3.45
50	300014	亿纬锂能	6,889,954.38	3.43
51	002371	七星电子	6,736,367.00	3.36
52	600171	上海贝岭	6,682,782.16	3.33
53	300298	三诺生物	6,622,063.11	3.30

54	600845	宝信软件	6,456,052.71	3.22
55	600841	上柴股份	6,410,292.70	3.19
56	300046	台基股份	6,373,621.20	3.18
57	002289	宇顺电子	6,338,647.77	3.16
58	300077	国民技术	6,199,453.06	3.09
59	600775	南京熊猫	6,173,383.19	3.08
60	000948	南天信息	6,045,446.74	3.01
61	300205	天喻信息	5,888,044.54	2.93
62	600571	信雅达	5,853,831.50	2.92
63	600601	方正科技	5,835,509.00	2.91
64	300137	先河环保	5,514,025.97	2.75
65	600460	士兰微	5,427,720.18	2.70
66	300368	汇金股份	5,251,714.50	2.62
67	002196	方正电机	5,136,993.61	2.56
68	600100	同方股份	4,894,100.00	2.44
69	000970	中科三环	4,876,900.00	2.43
70	600363	联创光电	4,765,299.51	2.37
71	601799	星宇股份	4,632,319.30	2.31
72	000636	风华高科	4,573,751.71	2.28
73	002126	银轮股份	4,361,922.00	2.17
74	300064	豫金刚石	4,327,110.04	2.16
75	600050	中国联通	4,274,927.55	2.13
76	300113	顺网科技	4,121,468.11	2.05

8.4.2 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	600999	招商证券	19,384,919.56	9.66
2	002388	新亚制程	16,644,546.62	8.29
3	002657	中科金财	11,419,239.62	5.69
4	600446	金证股份	11,130,098.78	5.55
5	002587	奥拓电子	10,608,950.12	5.29
6	601668	中国建筑	10,208,895.99	5.09
7	300219	鸿利光电	9,973,797.18	4.97
8	002609	捷顺科技	9,900,853.29	4.93
9	300209	天泽信息	9,024,750.16	4.50

10	601318	中国平安	8,914,378.62	4.44
11	600133	东湖高新	8,349,953.84	4.16
12	002501	利源铝业	8,303,440.07	4.14
13	002371	七星电子	8,143,693.07	4.06
14	000948	南天信息	7,832,182.16	3.90
15	601231	环旭电子	7,647,826.70	3.81
16	600601	方正科技	7,582,504.00	3.78
17	600016	民生银行	7,493,940.00	3.73
18	300155	安居宝	7,466,555.36	3.72
19	300328	宜安科技	7,428,914.73	3.70
20	300137	先河环保	7,284,700.45	3.63
21	300232	洲明科技	7,280,793.53	3.63
22	600571	信雅达	7,197,286.37	3.59
23	300054	鼎龙股份	7,177,212.87	3.58
24	000970	中科三环	7,160,919.18	3.57
25	300348	长亮科技	6,935,704.41	3.46
26	300207	欣旺达	6,899,143.60	3.44
27	300075	数字政通	6,883,679.24	3.43
28	000733	振华科技	6,822,830.16	3.40
29	002368	太极股份	6,736,477.81	3.36
30	002289	宇顺电子	6,496,515.55	3.24
31	300383	光环新网	6,312,041.76	3.15
32	300368	汇金股份	6,111,257.20	3.05
33	300351	永贵电器	6,018,606.80	3.00
34	300115	长盈精密	5,983,260.07	2.98
35	600570	恒生电子	5,912,409.44	2.95
36	600841	上柴股份	5,904,979.58	2.94
37	300212	易华录	5,765,626.63	2.87
38	600880	博瑞传播	5,754,061.57	2.87
39	002196	方正电机	5,734,532.82	2.86
40	300205	天喻信息	5,619,730.54	2.80
41	601688	华泰证券	5,516,065.20	2.75
42	600100	同方股份	5,506,833.86	2.74
43	002126	银轮股份	5,252,866.68	2.62
44	600050	中国联通	5,195,271.82	2.59
45	600363	联创光电	5,089,056.43	2.54
46	300150	世纪瑞尔	4,994,126.19	2.49
47	300231	银信科技	4,877,703.91	2.43

48	000636	风华高科	4,630,427.80	2.31
49	002518	科士达	4,468,911.18	2.23
50	300227	光韵达	4,291,822.62	2.14
51	000895	双汇发展	4,271,821.07	2.13
52	300096	易联众	4,264,869.70	2.13
53	000333	美的集团	4,180,921.54	2.08
54	600460	士兰微	4,140,011.64	2.06
55	300113	顺网科技	4,049,568.15	2.02
56	300014	亿纬锂能	4,022,344.26	2.00

8.4.3 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	1,002,430,727.41
卖出股票收入（成交）总额	641,807,880.57

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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：本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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：本基金报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

根据中国证监会 2014 年 5 月 29 日发布的《中国证监会对新股发行承销违规机构和个人采取监管措施》显示，海通证券因向禁止配售的配售对象配售股票、向投资者提供超出招股书范围的发行人信息等事项受到中国证监会“出具警示函”、“监管谈话”的监管措施。本基金做出如下说明：

海通证券是国内成立最早、综合实力最强的大型券商之一，基本面良好。基于相关研究，本基金认为：证监会的监管措施对于公司整体经营业绩不构成重大影响。因此，我们审慎地将海通证券在配置上作为组合的阶段性重要投资品种。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。

除上述情况外，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。

8.12.2

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股票。

8.12.3 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	165,807.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,443.09
5	应收申购款	1,695,884.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	1,885,134.23

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
8,264	65,015.08	336,465,234.05	62.62%	200,819,410.22	37.38%

9.2 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	665,295.75	0.1238%

9.3 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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年11月25日）基金份额总额	1,251,832,665.50
本报告期期初基金份额总额	220,439,908.87
本报告期基金总申购份额	999,802,685.75

减:本报告期基金总赎回份额	682,957,950.35
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	537,284,644.27

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

11.2 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

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。

11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

11.5 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,本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元,已连续提供审计服务 5 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
招商证券	1	1,147,941,806.66	69.82%	1,045,087.13	69.82%	-
中信建投	1	487,186,634.45	29.63%	443,535.12	29.63%	-
国元证券	1	9,079,554.20	0.55%	8,266.04	0.55%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 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
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	1,269,000,000.00	100.00%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

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

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

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

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

机构进行综合评价；

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

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

（6）交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

长盛基金管理有限公司

2015年3月28日