

# 长盛电子信息产业股票型证券投资基金 2014 年年度报告

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：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 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 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 11        |
| 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.....             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 13        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 14        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 14        |
| 4.9 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.....       | 15        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 15        |
| 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..... | 15        |
| 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.....      | 15        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>15</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 15        |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 15        |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>16</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 16        |
| 7.2 利润表.....                                 | 18        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 19        |
| 7.4 报表附注.....                                | 20        |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>39</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 39        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 40        |
| 8.3 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.....       | 40        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 43        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 46        |
| 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.....      | 46        |
| 8.7 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.....   | 47        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 47        |
| 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 .....    | 47        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 47        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 47        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 47        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>48</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 48        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 48        |
| 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 .....     | 48        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>49</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>49</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 49        |
| 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 .....      | 49        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 50        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 50        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 50        |
| 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 .....         | 50        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 50        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 52        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>             | <b>54</b> |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                     | <b>54</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 54        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 54        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 54        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金名称       | 长盛电子信息产业股票型证券投资基金 |
| 基金简称       | 长盛电子信息产业股票        |
| 基金主代码      | 080012            |
| 交易代码       | 080012            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2012年3月27日        |
| 基金管理人      | 长盛基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司        |
| 报告期末基金份额总额 | 2,008,654,188.52份 |
| 基金合同存续期    | 不定期               |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金主要投资于电子信息产业上市公司股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 投资策略   | (1) 分析宏观经济运行状况、市场估值水平等因素，动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。(2) 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，判断公司的核心价值与成长能力，选择具有竞争优势且估值具有吸引力的公司作为投资标的，根据市场波动情况精选个股，构建股票投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 中证信息技术指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%  |
| 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、货币市场基金，属于高风险、高预期收益的基金产品。   |

### 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                    | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 叶金松                           | 王永民                  |
|         | 联系电话 | 010-82019988                  | 010-66594896         |
|         | 电子邮箱 | yejs@csfunds.com.cn           | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 400-888-2666、<br>010-62350088 | 95566                |
| 传真      |      | 010-82255988                  | 010-66594942         |
| 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      | 北京市西城区复兴门内大街1号       |
| 办公地址    |      | 北京市海淀区北太平庄路                   | 北京市西城区复兴门内大街1        |

|       |                      |        |
|-------|----------------------|--------|
|       | 18 号城建大厦 A 座 20-22 层 | 号      |
| 邮政编码  | 100088               | 100818 |
| 法定代表人 | 高新                   | 田国立    |

## 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》  |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人的办公地址及基金托管人的住所   |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                             |
|--------|----------------------|----------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼          |
| 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、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 3 月 27 日(基金合同生效日)-2012 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|------------------|---|
| 本期已实现收益       | 625,786,283.84   | 138,008,315.38   | -8,029,702.24                             |
| 本期利润          | 863,454,773.28   | 172,861,765.45   | -10,268,808.34                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.4049           | 0.5443           | -0.0422                                   |
| 本期加权平均净值利润率   | 29.86%           | 43.05%           | -4.35%                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 36.10%           | 74.26%           | -6.20%                                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2014 年末          | 2013 年末          | 2012 年末                                   |
| 期末可供分配利润      | 320,179,578.87   | 7,755,009.83     | -12,364,450.47                            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1594           | 0.0073           | -0.0758                                   |
| 期末基金资产净值      | 2,893,635,110.56 | 1,244,378,963.55 | 150,759,174.20                            |
| 期末基金份额净值      | 1.441            | 1.173            | 0.924                                     |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2014 年末          | 2013 年末          | 2012 年末                                   |
| 基金份额累计净值增长率   | 122.46%          | 63.45%           | -6.20%                                    |

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      | 2.56%    | 1.36%       | 0.40%      | 1.32%         | 2.16%  | 0.04%  |
| 过去六个月      | 16.96%   | 1.09%       | 15.95%     | 1.13%         | 1.01%  | -0.04% |
| 过去一年       | 36.10%   | 1.15%       | 20.14%     | 1.17%         | 15.96% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 122.46%  | 1.33%       | 48.58%     | 1.28%         | 73.88% | 0.05%  |

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： $80\% \times \text{中证信息技术指数收益率} + 20\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

基准指数的构建考虑了三个原则：

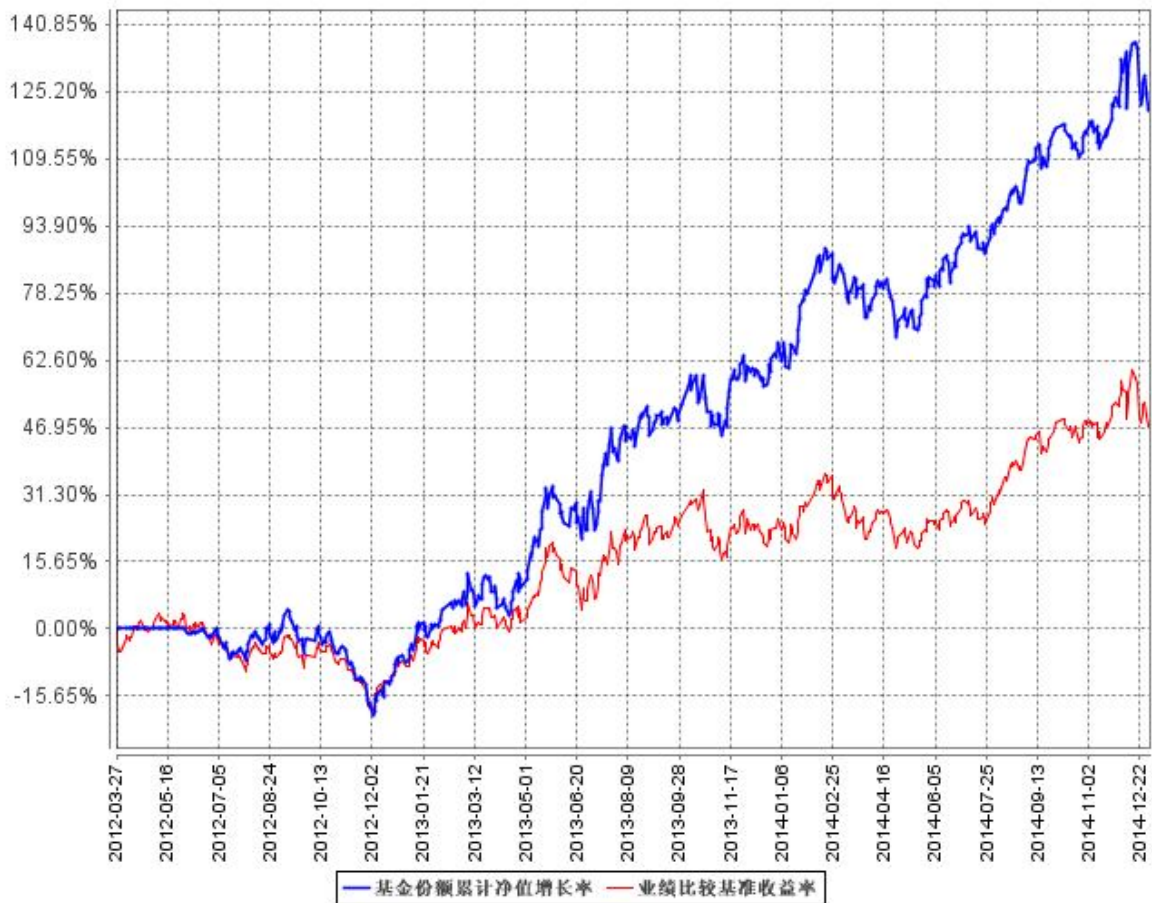
1、公允性。本基金为行业主题股票型基金，在综合比较目前市场上各主要行业指数的编制特点后，本基金选择以中证信息技术指数作为股票投资的业绩比较基准。中证信息技术指数是中证指数公司为反映 A 股中信息技术行业公司股票的整体表现，将中证 800 成分股中信息技术行业中的全部股票作为样本所编制的行业指数。本基金主要投资于电子信息产业上市公司股票，从而中证信息技术指数适合作为本基金的业绩比较基准。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于电子信息产业的上市公司股票不低于股票类资产的 80%；债券投资占基金资产的 0%-40%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数，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 80%、20%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

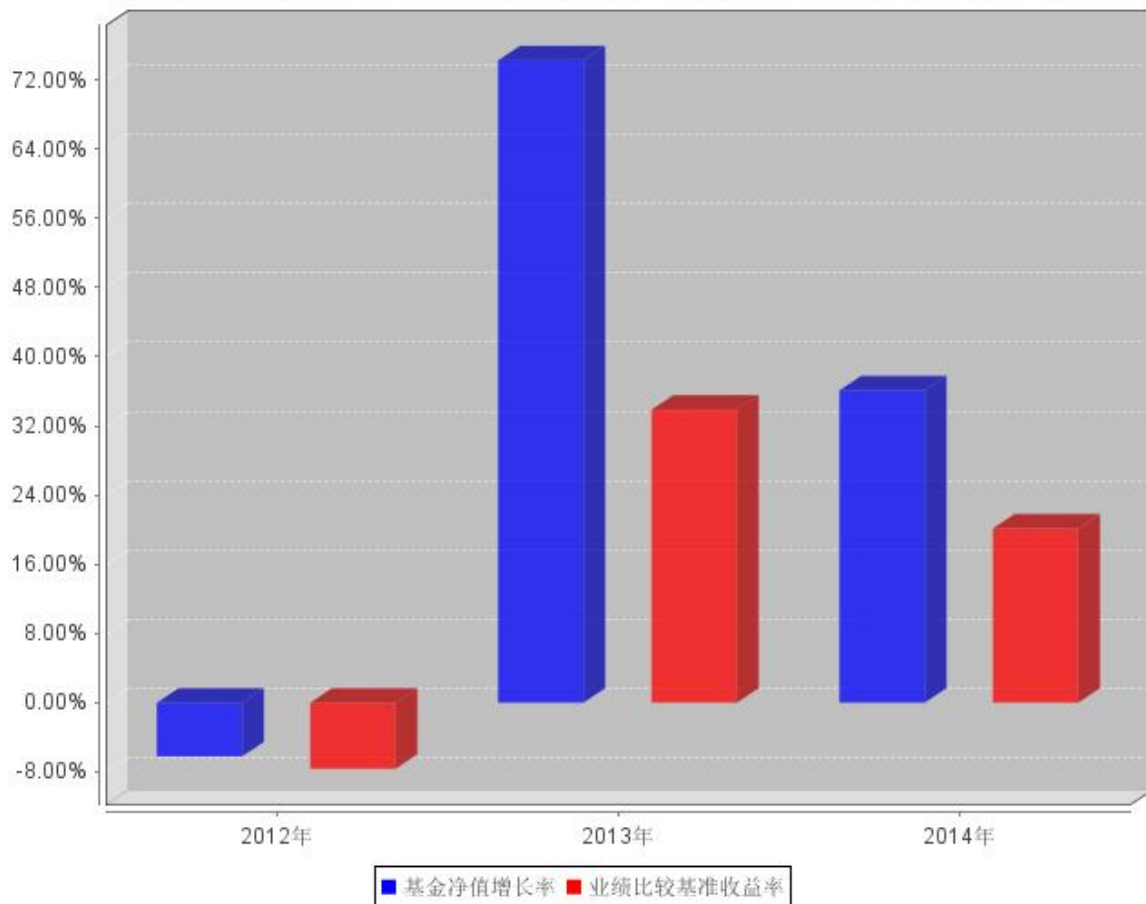


注：按照本基金合同规定，本基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十六条（二）投资范围、（七）投资禁止行为与限制的有关约定。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。



### 3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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



注：长盛电子信息产业股票型证券投资基金合同于 2012 年 3 月 27 日生效，合同生效当年按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年<br>度 | 每 10 份基金份<br>额分红数 | 现金形式发放总<br>额   | 再投资形式发放<br>总额  | 年度利润分配合<br>计   | 备注 |
|--------|-------------------|----------------|----------------|----------------|----|
| 2014   | 1.4500            | 285,231,182.23 | 90,086,301.14  | 375,317,483.37 |    |
| 2013   | 4.1000            | 230,542,867.01 | 51,527,725.74  | 282,070,592.75 |    |
| 2012   | 0.1500            | 2,371,756.32   | 105,729.40     | 2,477,485.72   |    |
| 合<br>计 | 5.7000            | 518,145,805.56 | 141,719,756.28 | 659,865,561.84 |    |

## § 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 |        |   |
| 王克玉 | 本基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，权益投资 | 2012 年 3 月 27 日 | -    | 11 年   | 男，1979 年 12 月出生，中国国籍。上海交通大学硕士。历任元大京华证券上海代表处研究员，天相投资顾问有限公司分析师，国都证券有限公司分析师。2006 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任高级行业研究员，同盛证券投资基金基金经理助理，同益证券投资基金基金经理，长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理等职务。现任权益投资部副总监，长盛电子信息产业股票型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资 |

|  |             |  |  |  |   |
|--|-------------|--|--|--|---|
|  | 部 副 总<br>监。 |  |  |  | 资基金基金经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
|--|-------------|--|--|--|---|

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

2014 年对中国的投资者来说是跌宕起伏而回报丰厚的一年。全年中证流通指数的涨幅达到 45%，A 股市场成为全球表现最好的市场；债券市场上，随着通缩若隐若现，央行不断为市场注入流动性，债券市场收益率水平持续下降，特别是与权益市场联动紧密的可转债呈现大幅度上涨。

然而作为参与其中的管理者而言，这一年也是跌宕起伏的一年。年初市场的主要方向集中在小市值、资产注入、业务转向新经济的资产类别上，相关公司的股价在短时间内出现大幅波动。随着上市公司业绩的披露，市场在三月份经历了一次风险释放，整个二季度基本是微幅震荡的态势。上半年累计看 TMT 领域表现活跃，其中计算机、通信行业领涨市场；其他行业比如国防军工、汽车、电力设备、轻工等也都实现明显的上涨；强周期类行业，例如煤炭、非银行金融等等表现较差。进入第三季度，市场进入普涨的格局，军工行业是第三季度的明星，行业指数涨幅达到 38%；而众多传统行业，包括煤炭、有色金属、电力、钢铁、化工、建筑、机械、电力设备等季度表现大都在 20-30%之间。但在四季度市场格局发生了重大变化，过去一年多时间里持续领先市场的轻资产、中小盘、新兴行业成长类别个股持续震荡，而金融、地产、建筑等重资产、低 PB 估值的行业表现非常惊艳。

受益于市场整体的上涨和主动管理的效果，本基金净值在全年上涨了 36.1%，同期业绩比较基准涨幅为 20%，阶段性的实现了基金的投资目标；其中前三季度表现尚可，第四季度组合风格没有跟上市场的变现，表现较差。在投资过程中，前三季度保持适中的股票仓位，在年末受到规模变动和个股估值吸引力再现的影响，提高了权益资产的占比，增持的行业主要是电子和传媒。同时基于行业估值和公司业绩的考虑，也对采掘、电力设备等传统行业有部分投资。

#### 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 1.441 元，本报告期份额净值增长率为 36.10%，同期业绩比较基准增长率为 20.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济转型一直在持续进行。近年来虽然宏观经济运行整体相对低迷，但在不同阶段都会出现一些表现良好的细分行业和公司；而且中国企业的竞争力，包括很多国企的竞争力在激烈的市场环境中得到了大幅提升。随着全球资源品价格的大幅下降，中国经济运行将进入比较稳定的阶段，企业盈利有机会逐步恢复。而经过多年的制度建设，目前资本市场对经济发展的促进作用越来越明显，市场的赚钱效应也将吸引更多资金进入市场，市场活跃度将显著提高。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作，保障资产委托人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时敦促有关部门改进、完善，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

1、强调合规培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训等多种方式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，强化员工合规理念，深化员工合规意识，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、强调制度/流程建设，扎实公司内控制度建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，保证公司制度/流程的合法合规、全面、适时、有效。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，确保制度/流程严肃性与执行力。报告期内，监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核工作，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、登记注册、产品开发等等；并根据业务发展需要，以及日常监督中发现问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，以保障公司制度/流程的严肃性与执行力。

5、加强员工行为合规的检查监督。报告期内，监察稽核部借助信息技术系统，通过完善员工

投资报备系统、建设员工合规档案系统等，提高员工行为合规管理水平，督促员工自觉合规。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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十九条中对基金利润分配原则的约定，本基金于 2014 年 9 月 4 日进行了利润分配，分配总金额为 375,317,483.37 元。

本基金截至 2014 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 320,179,578.87 元，其中：未分配利润已实现部分为 320,179,578.87 元，未分配利润未实现部分为 564,801,343.17 元。

#### 4.9 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长盛电子信息产业股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2015)第 20189 号 |

#### 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题       | 审计报告  |
|--------------|---|
| 审计报告收件人      | 长盛电子信息产业股票型证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 引言段          | 我们审计了后附的长盛电子信息产业股票型证券投资基金的财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。 |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是长盛电子信息产业股票型证券投资基金的基金管理人 长盛基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括：                               |

|           |   |     |
|-----------|---|-----|
|           | <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表, 并使其实现公允反映;</p> <p>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>  |     |
| 注册会计师的责任段 | <p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> |     |
| 审计意见段     | <p>我们认为, 上述长盛电子信息产业股票型证券投资基金 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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, 公允反映了长盛电子信息产业股票型证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度经营成果和基金净值变动情况。</p>  |     |
| 注册会计师的姓名  | 汪棣  | 沈兆杰 |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  |     |
| 会计师事务所的地址 | 中国·上海市  |     |
| 审计报告日期    | 2015 年 3 月 23 日   |     |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 长盛电子信息产业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   | 附注号     | 本期末<br>2014 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |
|------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产:  |         |                         |                          |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 357,990,439.29          | 72,614,487.69            |



|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 结算备付金           |            | 11,658,024.46              | 11,614,675.16               |
| 存出保证金           |            | 522,956.67                 | 354,526.83                  |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 2,528,782,284.67           | 913,741,599.03              |
| 其中：股票投资         |            | 2,498,077,191.07           | 913,741,599.03              |
| 基金投资            |            | -                          | -                           |
| 债券投资            |            | 30,705,093.60              | -                           |
| 资产支持证券投资        |            | -                          | -                           |
| 贵金属投资           |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 32,900,000.00              | 208,300,000.00              |
| 应收证券清算款         |            | 7,169,150.27               | 35,065,511.75               |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 402,688.24                 | 128,758.53                  |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | 13,272,205.93              | 52,090,297.35               |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 2,952,697,749.53           | 1,293,909,856.34            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2014年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2013年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                            |                             |
| 短期借款            |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                          | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 8,280,624.97               | 17,345,650.47               |
| 应付赎回款           |            | 43,145,698.75              | 29,037,275.41               |
| 应付管理人报酬         |            | 4,212,022.50               | 1,328,991.45                |
| 应付托管费           |            | 702,003.75                 | 221,498.59                  |
| 应付销售服务费         |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 2,289,348.92               | 1,162,475.28                |
| 应交税费            |            | -                          | -                           |
| 应付利息            |            | -                          | -                           |
| 应付利润            |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 432,940.08                 | 435,001.59                  |
| 负债合计            |            | 59,062,638.97              | 49,530,892.79               |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 2,008,654,188.52           | 1,060,660,981.01            |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | 884,980,922.04             | 183,717,982.54              |
| 所有者权益合计         |            | 2,893,635,110.56           | 1,244,378,963.55            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 2,952,697,749.53           | 1,293,909,856.34            |

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.441 元，基金份额总额 2,008,654,188.52 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛电子信息产业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                         | 附注号        | 本期<br>2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2013 年 1 月 1 日至<br>2013 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|------------|---|--|
| <b>一、收入</b>                |            | 924,987,788.43                            | 184,033,162.58                                 |
| 1. 利息收入                    |            | 17,216,087.50                             | 2,915,771.57                                   |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11   | 4,240,641.23                              | 421,710.79                                     |
| 债券利息收入                     |            | 74,396.26                                 | -  |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 12,901,050.01                             | 2,494,060.78                                   |
| 其他利息收入                     |            | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 662,156,443.81                            | 143,965,770.75                                 |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12   | 638,408,758.34                            | 142,838,126.99                                 |
| 基金投资收益                     |            | -   | -  |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13   | 5,894,377.54                              | -  |
| 资产支持证券投资收益                 |            | -   | -  |
| 贵金属投资收益                    |            | -   | -  |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.14   | -   | -  |
| 股利收益                       | 7.4.7.15   | 17,853,307.93                             | 1,127,643.76                                   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.16   | 237,668,489.44                            | 34,853,450.07                                  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.17   | 7,946,767.68                              | 2,298,170.19                                   |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 61,533,015.15                             | 11,171,397.13                                  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 43,139,577.01                             | 5,939,030.97                                   |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 7,189,929.49                              | 989,838.56                                     |
| 3. 销售服务费                   |            | -   | -  |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.18   | 10,751,273.11                             | 3,872,515.88                                   |
| 5. 利息支出                    |            | -   | -  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -   | -  |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.19   | 452,235.54                                | 370,011.72                                     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 863,454,773.28                            | 172,861,765.45                                 |
| 减：所得税费用                    |            | -   | -  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 863,454,773.28                            | 172,861,765.45                                 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛电子信息产业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<br>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）                        | 1,060,660,981.01                            | 183,717,982.54    | 1,244,378,963.55  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 863,454,773.28    | 863,454,773.28    |
| 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）      | 947,993,207.51                              | 213,125,649.59    | 1,161,118,857.10  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 5,689,860,538.53                            | 1,948,708,030.96  | 7,638,568,569.49  |
| 2. 基金赎回款                               | -4,741,867,331.02                           | -1,735,582,381.37 | -6,477,449,712.39 |
| 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） | -   | -375,317,483.37   | -375,317,483.37   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,008,654,188.52                            | 884,980,922.04    | 2,893,635,110.56  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 163,123,624.67                              | -12,364,450.47    | 150,759,174.20    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 172,861,765.45    | 172,861,765.45    |
| 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）      | 897,537,356.34                              | 305,291,260.31    | 1,202,828,616.65  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 2,335,044,642.82                            | 741,444,387.28    | 3,076,489,030.10  |
| 2. 基金赎回款                               | -1,437,507,286.48                           | -436,153,126.97   | -1,873,660,413.45 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净                 | -   | -282,070,592.75   | -282,070,592.75   |

|                  |                  |                |                  |
|------------------|------------------|----------------|------------------|
| 值变动（净值减少以“-”号填列） |                  |                |                  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）  | 1,060,660,981.01 | 183,717,982.54 | 1,244,378,963.55 |

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：

|                |                 |                |
|----------------|-----------------|----------------|
| _____ 周兵 _____ | _____ 林培富 _____ | _____ 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        |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛电子信息产业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[2012]194号《关于核准长盛电子信息产业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《长盛电子信息产业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人民币436,781,526.34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(2012)第071号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同》于2012年3月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为436,879,183.47份基金份额,其中认购资金利息折合97,657.13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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛电子信息产业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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于电子信息产业的上市公司股票不低于股票类资产的80%;债券投资占基金资产的0%-40%;权证投资占基金资产净值的比例不高于3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:80% X 中证信息技术指数收益率+20% X 中证综合债指数收益率。

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》、《长盛电子信息产业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 年度经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类其他应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类其他应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部

分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

### **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 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2014 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 357,990,439.29          | 72,614,487.69            |
| 定期存款           | -                       | -                        |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | -                       | -                        |
| 其他存款           | -                       | -                        |
| 合计：            | 357,990,439.29          | 72,614,487.69            |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2014 年 12 月 31 日  |                  |                |
|---------------|-------|--------------------------|------------------|----------------|
|               |       | 成本                       | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 2,233,257,927.76         | 2,498,077,191.07 | 264,819,263.31 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场 | 25,241,523.50            | 30,705,093.60    | 5,463,570.10   |
|               | 银行间市场 | -                        | -                | -              |
|               | 合计    | 25,241,523.50            | 30,705,093.60    | 5,463,570.10   |
| 资产支持证券        |       | -                        | -                | -              |
| 基金            |       | -                        | -                | -              |
| 其他            |       | -                        | -                | -              |
| 合计            |       | 2,258,499,451.26         | 2,528,782,284.67 | 270,282,833.41 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |                  |                |
|               |       | 成本                       | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 881,127,255.06           | 913,741,599.03   | 32,614,343.97  |
| 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            |       | 881,127,255.06           | 913,741,599.03   | 32,614,343.97  |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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<br>2014 年 12 月 31 日  |           |
|-----------|--|--------------------------|-----------|
|           |  | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所买入返售证券 |  | 32,900,000.00            | -         |
| 合计        |  | 32,900,000.00            | -         |
| 项目        |  | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |           |
|           |  | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |

|           |                |   |
|-----------|----------------|---|
| 交易所买入返售证券 | 208,300,000.00 | - |
| 合计        | 208,300,000.00 | - |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末及上年度末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2014年12月31日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 72,293.55          | 27,076.45           |
| 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  | 5,226.36           | 5,226.60            |
| 应收债券利息     | 202,315.50         | -                   |
| 应收买入返售证券利息 | 121,973.67         | 94,030.72           |
| 应收申购款利息    | 643.86             | 2,265.16            |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  | -                   |
| 其他         | 235.30             | 159.60              |
| 合计         | 402,688.24         | 128,758.53          |

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2014年12月31日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 2,289,228.92       | 1,162,475.28        |
| 银行间市场应付交易费用 | 120.00             | -                   |
| 合计          | 2,289,348.92       | 1,162,475.28        |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2014年12月31日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 157,372.78         | 109,434.29          |
| 其他          | 5,567.30           | 5,567.30            |
| 预提费用        | 270,000.00         | 320,000.00          |
| 合计          | 432,940.08         | 435,001.59          |

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2014年1月1日至2014年12月31日 |                   |
|---------------|-----------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额              |
| 上年度末          | 1,060,660,981.01            | 1,060,660,981.01  |
| 本期申购          | 5,689,860,538.53            | 5,689,860,538.53  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -4,741,867,331.02           | -4,741,867,331.02 |
| 本期末           | 2,008,654,188.52            | 2,008,654,188.52  |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

### 7.4.7.10 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           | 7,755,009.83    | 175,962,972.71    | 183,717,982.54    |
| 本期利润           | 625,786,283.84  | 237,668,489.44    | 863,454,773.28    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 61,955,768.57   | 151,169,881.02    | 213,125,649.59    |
| 其中：基金申购款       | 419,957,228.14  | 1,528,750,802.82  | 1,948,708,030.96  |
| 基金赎回款          | -358,001,459.57 | -1,377,580,921.80 | -1,735,582,381.37 |
| 本期已分配利润        | -375,317,483.37 | -                 | -375,317,483.37   |
| 本期末            | 320,179,578.87  | 564,801,343.17    | 884,980,922.04    |

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                    | 3,778,937.46                     |
| 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 | 385,100.36                  | 55,603.74                        |
| 其他        | 76,603.41                   | 18,546.41                        |
| 合计        | 4,240,641.23                | 421,710.79                       |

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月31日 |
|----|-----------------------------|----------------------------------|
|    | 卖出股票成交总额                    | 3,271,271,961.05                 |

|            |                  |                |
|------------|------------------|----------------|
| 减：卖出股票成本总额 | 2,632,863,202.71 | 918,520,916.52 |
| 买卖股票差价收入   | 638,408,758.34   | 142,838,126.99 |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2014年1月1日至2014<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年<br>12月31日 |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 5,894,377.54                    | -                                    |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                               | -                                    |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                               | -                                    |
| 合计                           | 5,894,377.54                    | -                                    |

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2014年1月1日至2014<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年<br>12月31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 49,639,799.00                   | -                                    |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 43,522,831.21                   | -                                    |
| 减：应收利息总额               | 222,590.25                      | -                                    |
| 买卖债券差价收入               | 5,894,377.54                    | -                                    |

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本期及上年度可比期间未取得衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2014年1月1日至2014年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年12月<br>31日 |
|-------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 17,853,307.93                   | 1,127,643.76                         |
| 基金投资产生的股利收益 | -                               | -                                    |
| 合计          | 17,853,307.93                   | 1,127,643.76                         |

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年 |
|------|----------------------|----------------------------|
|      |                      |                            |

|            | 年 12 月 31 日    | 12 月 31 日     |
|------------|----------------|---------------|
| 1. 交易性金融资产 | 237,668,489.44 | 34,853,450.07 |
| ——股票投资     | 232,204,919.34 | 34,853,450.07 |
| ——债券投资     | 5,463,570.10   | -             |
| ——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         | 237,668,489.44 | 34,853,450.07 |

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|---------|----------------------------------|----------------------------------|
|         | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |
| 基金赎回费收入 | 7,696,245.34                     | 2,262,377.01                     |
| 基金转换费收入 | 250,522.34                       | 35,793.18                        |
| 合计      | 7,946,767.68                     | 2,298,170.19                     |

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|-----------|----------------------------------|----------------------------------|
|           | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |
| 交易所市场交易费用 | 10,751,273.11                    | 3,872,515.88                     |
| 银行间市场交易费用 | -                                | -                                |
| 合计        | 10,751,273.11                    | 3,872,515.88                     |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|--------|----------------------------------|----------------------------------|
|        | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 | 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日 |
| 审计费用   | 110,000.00                       | 50,000.00                        |
| 信息披露费  | 270,000.00                       | 270,000.00                       |
| 银行划款费用 | 58,735.54                        | 36,511.72                        |
| 帐户维护费  | 13,500.00                        | 13,500.00                        |

|    |            |            |
|----|------------|------------|
| 合计 | 452,235.54 | 370,011.72 |
|----|------------|------------|

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 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 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”）   | 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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金未开立关联方交易单元。

##### 7.4.10.1 关联方报酬

###### 7.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
|                 | 2014年1月1日至2014年12月31日 | 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  | 43,139,577.01         | 5,939,030.97          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 11,130,209.34         | 2,262,694.15          |

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

**7.4.10.1.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
|                | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 | 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 | 7,189,929.49                     | 989,838.56                       |

注：支付基金托管人中国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 X 0.25% / 当年天数。

**7.4.10.2 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。

**7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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

注：除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

**7.4.10.4 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                          |            |
|-------|----------------------------------|--------------|----------------------------------|------------|
|       | 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |              | 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     |
| 中国银行  | 357,990,439.29                   | 3,778,937.46 | 72,614,487.69                    | 347,560.64 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.5 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。

**7.4.10.6 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。

**7.4.11 利润分配情况****7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

金额单位：人民币元



| 序号 | 权益登记日          | 除息日 |                | 每 10 份<br>基金份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额   | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配<br>合计   | 备注 |
|----|----------------|-----|----------------|-----------------------|----------------|---------------|----------------|----|
|    |                | 场内  | 场外             |                       |                |               |                |    |
| 1  | 2014 年 9 月 4 日 | -   | 2014 年 9 月 4 日 | 1.4500                | 285,231,182.23 | 90,086,301.14 | 375,317,483.37 |    |
| 合计 | -              | -   |                | 1.4500                | 285,231,182.23 | 90,086,301.14 | 375,317,483.37 |    |

#### 7.4.12 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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<br>估值单价 | 复牌日期             | 复牌<br>开盘单价 | 数量（股）     | 期末<br>成本总额    | 期末估值总<br>额    | 备注 |
|--------|------|------------------|--------|------------|------------------|------------|-----------|---------------|---------------|----|
| 601299 | 中国北车 | 2014 年 10 月 27 日 | 重大资产重组 | 7.33       | 2014 年 12 月 31 日 | 7.10       | 1,717,743 | 7,778,584.07  | 12,591,056.19 |    |
| 601766 | 中国南车 | 2014 年 10 月 27 日 | 重大资产重组 | 6.65       | 2014 年 12 月 31 日 | 6.38       | 1,000,000 | 4,466,457.02  | 6,650,000.00  |    |
| 600487 | 亨通光电 | 2014 年 10 月 30 日 | 筹划重大事项 | 19.80      | 2015 年 1 月 19 日  | 20.60      | 2,119,947 | 31,165,593.30 | 41,974,950.60 |    |
| 002351 | 漫步者  | 2014 年 12 月 11 日 | 筹划重大事项 | 17.55      | 2015 年 1 月 16 日  | 17.00      | 191,000   | 2,017,940.76  | 3,352,050.00  |    |
| 300170 | 汉得信息 | 2014 年 12 月 10 日 | 重大事项停牌 | 13.22      | 2015 年 1 月 28 日  | 14.54      | 15,051    | 138,158.39    | 198,974.22    |    |
| 002152 | 广电运通 | 2014 年 12 月 17 日 | 重大事项停牌 | 22.15      | 2015 年 3 月 11 日  | 24.37      | 391,017   | 6,290,254.55  | 8,661,026.55  |    |
| 002335 | 科华恒盛 | 2014 年 12 月 8 日  | 重大事项停牌 | 21.41      | 2015 年 1 月 30 日  | 22.00      | 1,932,132 | 32,084,900.80 | 41,366,946.12 |    |

注：1. 本基金截至 2014 年 12 月 31 日持有的中国北车、中国南车已于本期末复牌，但交易仍不活跃、流通仍受限，因此仍作为流通受限股票。

2. 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金产品，风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金，属于高风险、高预期收益的基金产品。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券、权证和货币市场工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

#### 7.4.13.2 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 中国银行，因而与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 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 1.06%(2013 年 12 月 31 日：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券)。

#### **7.4.13.3 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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 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，其余均能以合理价格适时变现。

于 2014 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担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、存出保证金及债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2014 年 12 月 31 日  | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计               |
|--------------------------|----------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 资产                       |                |       |       |                  |                  |
| 银行存款                     | 357,990,439.29 | -     | -     | -                | 357,990,439.29   |
| 结算备付金                    | 11,658,024.46  | -     | -     | -                | 11,658,024.46    |
| 存出保证金                    | 522,956.67     | -     | -     | -                | 522,956.67       |
| 交易性金融资产                  | 30,705,093.60  | -     | -     | 2,498,077,191.07 | 2,528,782,284.67 |
| 买入返售金融资产                 | 32,900,000.00  | -     | -     | -                | 32,900,000.00    |
| 应收证券清算款                  | -              | -     | -     | 7,169,150.27     | 7,169,150.27     |
| 应收利息                     | -              | -     | -     | 402,688.24       | 402,688.24       |
| 应收申购款                    | 10,016,470.18  | -     | -     | 3,255,735.75     | 13,272,205.93    |
| 资产总计                     | 443,792,984.20 | -     | -     | 2,508,904,765.33 | 2,952,697,749.53 |
| 负债                       |                |       |       |                  |                  |
| 应付证券清算款                  | -              | -     | -     | 8,280,624.97     | 8,280,624.97     |
| 应付赎回款                    | -              | -     | -     | 43,145,698.75    | 43,145,698.75    |
| 应付管理人报酬                  | -              | -     | -     | 4,212,022.50     | 4,212,022.50     |
| 应付托管费                    | -              | -     | -     | 702,003.75       | 702,003.75       |
| 应付交易费用                   | -              | -     | -     | 2,289,348.92     | 2,289,348.92     |
| 其他负债                     | -              | -     | -     | 432,940.08       | 432,940.08       |
| 负债总计                     | -              | -     | -     | 59,062,638.97    | 59,062,638.97    |
| 利率敏感度缺口                  | 443,792,984.20 | -     | -     | 2,449,842,126.36 | 2,893,635,110.56 |
| 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计               |
| 资产                       |                |       |       |                  |                  |
| 银行存款                     | 72,614,487.69  | -     | -     | -                | 72,614,487.69    |
| 结算备付金                    | 11,614,675.16  | -     | -     | -                | 11,614,675.16    |
| 存出保证金                    | 354,526.83     | -     | -     | -                | 354,526.83       |
| 交易性金融资产                  | -              | -     | -     | 913,741,599.03   | 913,741,599.03   |
| 买入返售金融资产                 | 208,300,000.00 | -     | -     | -                | 208,300,000.00   |
| 应收证券清算款                  | -              | -     | -     | 35,065,511.75    | 35,065,511.75    |

|         |                |   |   |                |                  |
|---------|----------------|---|---|----------------|------------------|
| 应收利息    | -              | - | - | 128,758.53     | 128,758.53       |
| 应收申购款   | 30,554,750.96  | - | - | 21,535,546.39  | 52,090,297.35    |
| 资产总计    | 323,438,440.64 | - | - | 970,471,415.70 | 1,293,909,856.34 |
| 负债      |                |   |   |                |                  |
| 应付证券清算款 | -              | - | - | 17,345,650.47  | 17,345,650.47    |
| 应付赎回款   | -              | - | - | 29,037,275.41  | 29,037,275.41    |
| 应付管理人报酬 | -              | - | - | 1,328,991.45   | 1,328,991.45     |
| 应付托管费   | -              | - | - | 221,498.59     | 221,498.59       |
| 应付交易费用  | -              | - | - | 1,162,475.28   | 1,162,475.28     |
| 其他负债    | -              | - | - | 435,001.59     | 435,001.59       |
| 负债总计    | -              | - | - | 49,530,892.79  | 49,530,892.79    |
| 利率敏感度缺口 | 323,438,440.64 | - | - | 920,940,522.91 | 1,244,378,963.55 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.06% (2013 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2013 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 60%-95%，其中投资于电子信息产业的上市公司股票不低于股票类资产的 80%；债券投资占

基金资产的 0%—40%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2014 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2013 年 12 月 31 日 |                       |
|--------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|              | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 2,498,077,191.07        | 86.33                    | 913,741,599.03           | 73.43                 |
| 衍生金融资产-权证投资  | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 其他           | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 合计           | 2,498,077,191.07        | 86.33                    | 913,741,599.03           | 73.43                 |

#### 7.4.13.4.3.2 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（2014 年 12 月 31 日）       | 上年度末（2013 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 5           | 133,519,490.79              | 63,817,648.63          |
|    | 业绩比较基准下降 5           | -133,519,490.79             | -63,817,648.63         |

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2014 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,413,987,280.99 元, 属于第二层次的余额为 114,795,003.68 元, 无属于第三层次的余额(2013 年 12 月 31 日: 第一层次的余额为 907,925,921.45 元, 第二层次的余额为 5,815,677.58 元, 无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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               | 2,498,077,191.07 | 84.60         |
|    | 其中: 股票             | 2,498,077,191.07 | 84.60         |
| 2  | 固定收益投资             | 30,705,093.60    | 1.04          |
|    | 其中: 债券             | 30,705,093.60    | 1.04          |
|    | 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           | 32,900,000.00    | 1.11          |
|    | 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       | 369,648,463.75   | 12.52         |
| 7  | 其他各项资产             | 21,367,001.11    | 0.72          |
| 8  | 合计                 | 2,952,697,749.53 | 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              | 172,989,943.61   | 5.98         |
| C  | 制造业              | 1,697,145,092.88 | 58.65        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,595,049.60     | 0.09         |
| E  | 建筑业              | -                | -            |
| F  | 批发和零售业           | 40,612,262.76    | 1.40         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,568,481.66     | 0.05         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 496,317,882.51   | 17.15        |
| J  | 金融业              | 31,508,117.92    | 1.09         |
| K  | 房地产业             | 1,209,428.24     | 0.04         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 46,253,001.89    | 1.60         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 444,314.00       | 0.02         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 3,815,625.00     | 0.13         |
| 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        | 3,617,991.00     | 0.13         |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 2,498,077,191.07 | 86.33        |

## 8.3 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  | 000063 | 中兴通讯 | 9,067,867  | 163,765,678.02 | 5.66         |
| 2  | 600498 | 烽火通信 | 10,373,376 | 159,957,457.92 | 5.53         |
| 3  | 002465 | 海格通信 | 7,646,007  | 147,720,855.24 | 5.11         |
| 4  | 600050 | 中国联通 | 23,420,907 | 115,933,489.65 | 4.01         |
| 5  | 002056 | 横店东磁 | 5,094,017  | 111,813,673.15 | 3.86         |



|    |        |      |            |                |      |
|----|--------|------|------------|----------------|------|
| 6  | 002376 | 新北洋  | 10,090,010 | 111,091,010.10 | 3.84 |
| 7  | 600460 | 士兰微  | 17,181,950 | 98,108,934.50  | 3.39 |
| 8  | 000733 | 振华科技 | 6,676,811  | 93,007,977.23  | 3.21 |
| 9  | 300188 | 美亚柏科 | 3,378,526  | 88,416,025.42  | 3.06 |
| 10 | 002063 | 远光软件 | 4,139,479  | 82,996,553.95  | 2.87 |
| 11 | 300077 | 国民技术 | 3,077,925  | 82,119,039.00  | 2.84 |
| 12 | 600718 | 东软集团 | 4,386,695  | 69,353,647.95  | 2.40 |
| 13 | 300102 | 乾照光电 | 4,704,158  | 55,509,064.40  | 1.92 |
| 14 | 600522 | 中天科技 | 3,211,666  | 49,427,539.74  | 1.71 |
| 15 | 000012 | 南玻A  | 5,547,880  | 49,320,653.20  | 1.70 |
| 16 | 601699 | 潞安环能 | 4,207,751  | 48,557,446.54  | 1.68 |
| 17 | 000983 | 西山煤电 | 5,891,398  | 48,427,291.56  | 1.67 |
| 18 | 002315 | 焦点科技 | 874,017    | 47,896,131.60  | 1.66 |
| 19 | 000937 | 冀中能源 | 5,509,304  | 45,947,595.36  | 1.59 |
| 20 | 600487 | 亨通光电 | 2,119,947  | 41,974,950.60  | 1.45 |
| 21 | 002335 | 科华恒盛 | 1,932,132  | 41,366,946.12  | 1.43 |
| 22 | 300303 | 聚飞光电 | 2,411,008  | 41,180,016.64  | 1.42 |
| 23 | 002138 | 顺络电子 | 2,349,721  | 41,002,631.45  | 1.42 |
| 24 | 600875 | 东方电气 | 1,773,334  | 36,601,613.76  | 1.26 |
| 25 | 002419 | 天虹商场 | 2,662,764  | 36,186,962.76  | 1.25 |
| 26 | 300045 | 华力创通 | 2,003,574  | 34,000,650.78  | 1.18 |
| 27 | 002371 | 七星电子 | 1,182,518  | 30,863,719.80  | 1.07 |
| 28 | 002712 | 思美传媒 | 649,093    | 29,864,768.93  | 1.03 |
| 29 | 000917 | 电广传媒 | 1,691,258  | 28,548,435.04  | 0.99 |
| 30 | 002484 | 江海股份 | 1,923,994  | 28,436,631.32  | 0.98 |
| 31 | 002383 | 合众思壮 | 1,014,765  | 24,110,816.40  | 0.83 |
| 32 | 002313 | 日海通讯 | 1,892,010  | 21,001,311.00  | 0.73 |
| 33 | 600166 | 福田汽车 | 3,286,700  | 20,574,742.00  | 0.71 |
| 34 | 300241 | 瑞丰光电 | 1,893,100  | 20,123,653.00  | 0.70 |
| 35 | 601398 | 工商银行 | 4,099,800  | 19,966,026.00  | 0.69 |
| 36 | 601225 | 陕西煤业 | 2,653,676  | 17,646,945.40  | 0.61 |
| 37 | 002449 | 国星光电 | 1,556,801  | 16,470,954.58  | 0.57 |
| 38 | 300058 | 蓝色光标 | 775,958    | 16,388,232.96  | 0.57 |
| 39 | 002017 | 东信和平 | 1,153,296  | 15,188,908.32  | 0.52 |
| 40 | 300017 | 网宿科技 | 309,857    | 14,935,107.40  | 0.52 |
| 41 | 601238 | 广汽集团 | 1,666,475  | 14,465,003.00  | 0.50 |
| 42 | 300365 | 恒华科技 | 413,043    | 12,973,680.63  | 0.45 |
| 43 | 601299 | 中国北车 | 1,717,743  | 12,591,056.19  | 0.44 |
| 44 | 300353 | 东土科技 | 760,000    | 12,441,200.00  | 0.43 |

|    |        |       |           |               |      |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 45 | 600028 | 中国石化  | 1,912,275 | 12,410,664.75 | 0.43 |
| 46 | 300207 | 欣旺达   | 463,618   | 11,919,618.78 | 0.41 |
| 47 | 600563 | 法拉电子  | 396,718   | 11,433,412.76 | 0.40 |
| 48 | 600571 | 信雅达   | 390,369   | 10,512,637.17 | 0.36 |
| 49 | 300219 | 鸿利光电  | 982,154   | 10,332,260.08 | 0.36 |
| 50 | 601939 | 建设银行  | 1,472,500 | 9,909,925.00  | 0.34 |
| 51 | 002073 | 软控股份  | 738,367   | 8,941,624.37  | 0.31 |
| 52 | 002152 | 广电运通  | 391,017   | 8,661,026.55  | 0.30 |
| 53 | 002463 | 沪电股份  | 1,500,000 | 7,185,000.00  | 0.25 |
| 54 | 601208 | 东材科技  | 817,817   | 6,992,335.35  | 0.24 |
| 55 | 601766 | 中国南车  | 1,000,000 | 6,650,000.00  | 0.23 |
| 56 | 300227 | 光韵达   | 359,200   | 6,573,360.00  | 0.23 |
| 57 | 000858 | 五粮液   | 285,200   | 6,131,800.00  | 0.21 |
| 58 | 600271 | 航天信息  | 190,000   | 5,796,900.00  | 0.20 |
| 59 | 300182 | 捷成股份  | 311,696   | 5,579,358.40  | 0.19 |
| 60 | 601126 | 四方股份  | 319,696   | 5,530,740.80  | 0.19 |
| 61 | 300037 | 新宙邦   | 189,100   | 5,508,483.00  | 0.19 |
| 62 | 601607 | 上海医药  | 268,200   | 4,425,300.00  | 0.15 |
| 63 | 300302 | 同有科技  | 205,566   | 4,378,555.80  | 0.15 |
| 64 | 300275 | 梅安森   | 275,686   | 4,154,588.02  | 0.14 |
| 65 | 300115 | 长盈精密  | 218,000   | 3,952,340.00  | 0.14 |
| 66 | 000069 | 华侨城 A | 462,500   | 3,815,625.00  | 0.13 |
| 67 | 002405 | 四维图新  | 190,000   | 3,710,700.00  | 0.13 |
| 68 | 601369 | 陕鼓动力  | 423,562   | 3,684,989.40  | 0.13 |
| 69 | 600633 | 浙报传媒  | 198,900   | 3,617,991.00  | 0.13 |
| 70 | 600151 | 航天机电  | 360,988   | 3,389,677.32  | 0.12 |
| 71 | 002351 | 漫步者   | 191,000   | 3,352,050.00  | 0.12 |
| 72 | 002583 | 海能达   | 300,000   | 3,027,000.00  | 0.10 |
| 73 | 300075 | 数字政通  | 112,600   | 2,852,158.00  | 0.10 |
| 74 | 600461 | 洪城水业  | 222,560   | 2,595,049.60  | 0.09 |
| 75 | 300036 | 超图软件  | 99,798    | 2,226,493.38  | 0.08 |
| 76 | 600009 | 上海机场  | 79,943    | 1,568,481.66  | 0.05 |
| 77 | 300177 | 中海达   | 112,152   | 1,530,874.80  | 0.05 |
| 78 | 300050 | 世纪鼎利  | 94,277    | 1,429,239.32  | 0.05 |
| 79 | 002032 | 苏泊尔   | 67,494    | 1,148,747.88  | 0.04 |
| 80 | 600048 | 保利地产  | 77,914    | 843,029.48    | 0.03 |
| 81 | 300012 | 华测检测  | 29,720    | 444,314.00    | 0.02 |
| 82 | 600015 | 华夏银行  | 30,798    | 414,541.08    | 0.01 |
| 83 | 600000 | 浦发银行  | 26,055    | 408,802.95    | 0.01 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 84 | 601328 | 交通银行 | 60,072 | 408,489.60 | 0.01 |
| 85 | 600036 | 招商银行 | 24,131 | 400,333.29 | 0.01 |
| 86 | 000024 | 招商地产 | 13,884 | 366,398.76 | 0.01 |
| 87 | 300232 | 洲明科技 | 25,333 | 340,728.85 | 0.01 |
| 88 | 002179 | 中航光电 | 14,456 | 339,426.88 | 0.01 |
| 89 | 300003 | 乐普医疗 | 10,400 | 247,520.00 | 0.01 |
| 90 | 600570 | 恒生电子 | 4,056  | 222,106.56 | 0.01 |
| 91 | 300048 | 合康变频 | 16,000 | 209,760.00 | 0.01 |
| 92 | 300170 | 汉得信息 | 15,051 | 198,974.22 | 0.01 |
| 93 | 300224 | 正海磁材 | 618    | 15,066.84  | 0.00 |
| 94 | 300323 | 华灿光电 | 1,498  | 13,661.76  | 0.00 |

#### 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  | 600050 | 中国联通 | 176,202,192.57 | 14.16           |
| 2  | 000063 | 中兴通讯 | 167,977,418.36 | 13.50           |
| 3  | 002056 | 横店东磁 | 157,187,398.43 | 12.63           |
| 4  | 600498 | 烽火通信 | 140,533,997.11 | 11.29           |
| 5  | 002465 | 海格通信 | 132,027,729.72 | 10.61           |
| 6  | 002376 | 新北洋  | 130,574,924.06 | 10.49           |
| 7  | 000733 | 振华科技 | 129,043,110.98 | 10.37           |
| 8  | 300077 | 国民技术 | 108,115,325.51 | 8.69            |
| 9  | 600718 | 东软集团 | 103,045,318.21 | 8.28            |
| 10 | 300188 | 美亚柏科 | 101,524,263.12 | 8.16            |
| 11 | 600460 | 士兰微  | 99,257,597.62  | 7.98            |
| 12 | 002315 | 焦点科技 | 84,859,081.82  | 6.82            |
| 13 | 000012 | 南玻A  | 80,682,018.60  | 6.48            |
| 14 | 002063 | 远光软件 | 79,936,099.82  | 6.42            |
| 15 | 600522 | 中天科技 | 73,074,453.54  | 5.87            |
| 16 | 002484 | 江海股份 | 72,781,270.31  | 5.85            |
| 17 | 600875 | 东方电气 | 65,143,627.80  | 5.24            |
| 18 | 002419 | 天虹商场 | 60,919,227.87  | 4.90            |
| 19 | 300207 | 欣旺达  | 60,896,744.05  | 4.89            |
| 20 | 002383 | 合众思壮 | 59,467,677.63  | 4.78            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 21 | 002073 | 软控股份 | 55,965,111.14 | 4.50 |
| 22 | 300102 | 乾照光电 | 55,806,171.77 | 4.48 |
| 23 | 300045 | 华力创通 | 53,615,276.84 | 4.31 |
| 24 | 600009 | 上海机场 | 53,064,184.04 | 4.26 |
| 25 | 002335 | 科华恒盛 | 52,583,188.51 | 4.23 |
| 26 | 601299 | 中国北车 | 49,812,697.02 | 4.00 |
| 27 | 601208 | 东材科技 | 49,279,198.21 | 3.96 |
| 28 | 601699 | 潞安环能 | 49,178,221.91 | 3.95 |
| 29 | 300241 | 瑞丰光电 | 48,383,605.41 | 3.89 |
| 30 | 300303 | 聚飞光电 | 44,189,587.26 | 3.55 |
| 31 | 002371 | 七星电子 | 42,937,403.36 | 3.45 |
| 32 | 002138 | 顺络电子 | 42,544,514.60 | 3.42 |
| 33 | 000983 | 西山煤电 | 42,417,490.88 | 3.41 |
| 34 | 300353 | 东土科技 | 42,415,759.65 | 3.41 |
| 35 | 601766 | 中国南车 | 41,303,686.35 | 3.32 |
| 36 | 000937 | 冀中能源 | 40,651,723.09 | 3.27 |
| 37 | 002313 | 日海通讯 | 39,995,535.10 | 3.21 |
| 38 | 000917 | 电广传媒 | 39,056,476.70 | 3.14 |
| 39 | 600537 | 亿晶光电 | 38,573,615.97 | 3.10 |
| 40 | 600151 | 航天机电 | 37,697,382.12 | 3.03 |
| 41 | 002179 | 中航光电 | 37,615,004.24 | 3.02 |
| 42 | 600487 | 亨通光电 | 37,183,231.78 | 2.99 |
| 43 | 002712 | 思美传媒 | 36,264,221.17 | 2.91 |
| 44 | 300036 | 超图软件 | 30,804,163.33 | 2.48 |
| 45 | 300275 | 梅安森  | 30,682,924.23 | 2.47 |
| 46 | 300302 | 同有科技 | 29,649,903.01 | 2.38 |
| 47 | 300219 | 鸿利光电 | 27,287,965.78 | 2.19 |
| 48 | 600036 | 招商银行 | 26,907,788.15 | 2.16 |
| 49 | 601186 | 中国铁建 | 26,670,136.01 | 2.14 |
| 50 | 600401 | 海润光伏 | 26,424,940.80 | 2.12 |
| 51 | 600461 | 洪城水业 | 26,261,907.80 | 2.11 |
| 52 | 601328 | 交通银行 | 25,220,792.42 | 2.03 |

#### 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  | 600050 | 中国联通 | 246,484,897.85 | 19.81  |
| 2  | 300207 | 欣旺达  | 98,168,974.50  | 7.89   |
| 3  | 002484 | 江海股份 | 91,044,746.42  | 7.32   |
| 4  | 300241 | 瑞丰光电 | 83,525,174.30  | 6.71   |
| 5  | 300188 | 美亚柏科 | 82,617,626.67  | 6.64   |
| 6  | 000733 | 振华科技 | 77,384,000.61  | 6.22   |
| 7  | 600522 | 中天科技 | 73,747,744.34  | 5.93   |
| 8  | 600009 | 上海机场 | 69,966,646.27  | 5.62   |
| 9  | 002056 | 横店东磁 | 66,045,505.55  | 5.31   |
| 10 | 002465 | 海格通信 | 63,965,162.26  | 5.14   |
| 11 | 300036 | 超图软件 | 63,609,086.28  | 5.11   |
| 12 | 600151 | 航天机电 | 63,283,830.64  | 5.09   |
| 13 | 600537 | 亿晶光电 | 62,568,056.15  | 5.03   |
| 14 | 002405 | 四维图新 | 60,399,517.27  | 4.85   |
| 15 | 000012 | 南玻A  | 58,651,161.87  | 4.71   |
| 16 | 600875 | 东方电气 | 58,228,346.11  | 4.68   |
| 17 | 002073 | 软控股份 | 57,680,118.82  | 4.64   |
| 18 | 601299 | 中国北车 | 57,484,853.50  | 4.62   |
| 19 | 300077 | 国民技术 | 57,039,578.63  | 4.58   |
| 20 | 002138 | 顺络电子 | 56,377,829.82  | 4.53   |
| 21 | 601208 | 东材科技 | 55,807,877.75  | 4.48   |
| 22 | 600718 | 东软集团 | 55,224,160.12  | 4.44   |
| 23 | 000063 | 中兴通讯 | 53,966,195.11  | 4.34   |
| 24 | 002315 | 焦点科技 | 52,479,781.63  | 4.22   |
| 25 | 601186 | 中国铁建 | 52,106,245.94  | 4.19   |
| 26 | 300353 | 东土科技 | 50,196,502.27  | 4.03   |
| 27 | 601766 | 中国南车 | 49,913,947.80  | 4.01   |
| 28 | 002179 | 中航光电 | 48,288,870.51  | 3.88   |
| 29 | 002383 | 合众思壮 | 46,971,952.95  | 3.77   |
| 30 | 300302 | 同有科技 | 45,575,642.90  | 3.66   |
| 31 | 300219 | 鸿利光电 | 44,076,637.09  | 3.54   |
| 32 | 300017 | 网宿科技 | 41,507,423.79  | 3.34   |
| 33 | 300275 | 梅安森  | 39,587,128.74  | 3.18   |
| 34 | 600401 | 海润光伏 | 37,818,028.37  | 3.04   |
| 35 | 002583 | 海能达  | 37,586,604.17  | 3.02   |
| 36 | 002419 | 天虹商场 | 36,804,605.84  | 2.96   |
| 37 | 300232 | 洲明科技 | 36,358,312.62  | 2.92   |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 38 | 300170 | 汉得信息 | 35,559,139.93 | 2.86 |
| 39 | 002335 | 科华恒盛 | 35,385,065.93 | 2.84 |
| 40 | 600461 | 洪城水业 | 34,758,911.19 | 2.79 |
| 41 | 300182 | 捷成股份 | 34,177,734.74 | 2.75 |
| 42 | 300339 | 润和软件 | 33,442,574.90 | 2.69 |
| 43 | 002063 | 远光软件 | 32,339,460.18 | 2.60 |
| 44 | 600271 | 航天信息 | 30,433,460.81 | 2.45 |
| 45 | 600571 | 信雅达  | 30,332,525.66 | 2.44 |
| 46 | 600036 | 招商银行 | 29,654,354.44 | 2.38 |
| 47 | 600410 | 华胜天成 | 29,132,135.94 | 2.34 |
| 48 | 600563 | 法拉电子 | 29,070,304.32 | 2.34 |
| 49 | 601328 | 交通银行 | 27,766,602.80 | 2.23 |
| 50 | 600588 | 用友软件 | 26,790,092.60 | 2.15 |

#### 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 | 3,984,993,875.41 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,271,271,961.05 |

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

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   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债       | 30,705,093.60 | 1.06         |
| 8  | 其他        | -             | -            |
| 9  | 合计        | 30,705,093.60 | 1.06         |

#### 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

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 | 110015 | 石化转债 | 227,580 | 30,705,093.60 | 1.06 |
|---|--------|------|---------|---------------|------|

### 8.7 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。

### 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：本基金本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

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。

#### 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的股票。

#### 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   | 522,956.67    |
| 2 | 应收证券清算款 | 7,169,150.27  |
| 3 | 应收股利    | -             |
| 4 | 应收利息    | 402,688.24    |
| 5 | 应收申购款   | 13,272,205.93 |
| 6 | 其他应收款   | -             |
| 7 | 待摊费用    | -             |
| 8 | 其他      | -             |
| 9 | 合计      | 21,367,001.11 |

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 110015 | 石化转债 | 30,705,093.60 | 1.06         |

#### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 44,361       | 45,279.73     | 1,195,450,674.04 | 59.52%     | 813,203,514.48 | 40.48%     |

### 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 | 209,675.00 | 0.0104%  |

### 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（2012年3月27日）基金份额总额 | 436,879,183.47   |
| 本报告期期初基金份额总额              | 1,060,660,981.01 |
| 本报告期基金总申购份额               | 5,689,860,538.53 |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 4,741,867,331.02 |
| 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              | 2,008,654,188.52 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未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

2014年2月14日中国银行股份有限公司公告，自2014年2月13日起，陈四清先生担任本行行长。

报告期内基金托管人的专门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 110,000.00 元，已连续提供审计服务 3 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 |    |
| 太平洋证券 | 1      | 4,039,019,452.94 | 55.67%       | 3,677,130.78 | 55.67%     | -  |
| 方正证券  | 1      | 2,604,805,991.90 | 35.91%       | 2,371,409.44 | 35.91%     | -  |
| 信达证券  | 1      | 486,848,859.27   | 6.71%        | 443,228.34   | 6.71%      | -  |
| 国金证券  | 1      | 115,485,162.34   | 1.59%        | 105,139.65   | 1.59%      | -  |
| 平安证券  | 1      | 8,525,921.44     | 0.12%        | 7,762.00     | 0.12%      | -  |
| 东莞证券  | 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 |
| 太平洋证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

|      |                |         |                   |        |   |   |
|------|----------------|---------|-------------------|--------|---|---|
| 方正证券 | 111,351,663.20 | 100.00% | 39,091,300,000.00 | 90.00% | - | - |
| 信达证券 | -              | -       | -                 | -      | - | - |
| 国金证券 | -              | -       | 4,342,500,000.00  | 10.00% | - | - |
| 平安证券 | -              | -       | -                 | -      | - | - |
| 东莞证券 | -              | -       | -                 | -      | - | - |

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) 资质雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

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

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

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

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

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

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

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：

| 序号 | 证券公司名称 | 交易单元所属市场 | 数量 |
|----|--------|----------|----|
| 1  | 方正证券   | 上海       | 1  |
| 2  | 信达证券   | 深圳       | 1  |

|   |      |    |   |
|---|------|----|---|
| 3 | 东莞证券 | 上海 | 1 |
|---|------|----|---|

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

## 11.8 其他重大事件

除上述事项外，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旗下部分基金调整股票行业界定的公告                 | 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》及本公司网站 | 2014年1月2日  |
| 2  | 关于旗下部分开放式基金在中信建投证券开通转换业务的公告                   | 同上                         | 2014年2月12日 |
| 3  | 长盛基金管理有限公司关于在兴业银行开通旗下部分基金转换业务的公告              | 同上                         | 2014年2月24日 |
| 4  | 关于增加徽商银行为旗下部分基金代销机构以及开通基金定投业务的公告              | 同上                         | 2014年3月17日 |
| 5  | 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 |
| 6  | 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...   | 同上                         | 2014年3月24日 |
| 7  | 关于增加中信银行为旗下部分基金代销机构以及开通基金定投业务的公告              | 同上                         | 2014年4月4日  |
| 8  | 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 |
| 9  | 长盛基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告                      | 同上                         | 2014年4月16日 |
| 10 | 关于参加天天基金申购费率优惠活动的公告                           | 同上                         | 2014年4月21日 |
| 11 | 关于增加东方证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购费率优惠活动及定期定额投资业务的公告 | 同上                         | 2014年6月16日 |
| 12 | 关于增加上海证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购费率优惠活动的公告          | 同上                         | 2014年6月16日 |
| 13 | 关于增加万银财富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7月9日  |

|    |   |    |                  |
|----|---|----|------------------|
| 14 | 关于旗下部分基金参加包商银行基金代销业务申购费率优惠活动的公告                 | 同上 | 2014 年 7 月 14 日  |
| 15 | 增加中山证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购费率优惠及定期定额投资申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2014 年 7 月 31 日  |
| 16 | 关于增加星展银行为长盛电子信息产业股票型基金代销机构及开通基金定投业务的公告          | 同上 | 2014 年 8 月 26 日  |
| 17 | 长盛电子信息产业股票型证券投资基金收益分配公告                         | 同上 | 2014 年 9 月 3 日   |
| 18 | 关于增加联讯证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告                       | 同上 | 2014 年 10 月 13 日 |
| 19 | 关于增加广州证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购费率优惠活动的公告            | 同上 | 2014 年 10 月 13 日 |
| 20 | 长盛基金管理有限公司关于公司从业人员在子公司兼职情况的公告                   | 同上 | 2014 年 10 月 14 日 |
| 21 | 关于增加长量基金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 10 月 16 日 |
| 22 | 长盛基金管理有限公司关于增加注册资本的公告                           | 同上 | 2014 年 10 月 29 日 |
| 23 | 关于旗下部分开放式基金在部分代销机构开通转换业务的公告                     | 同上 | 2014 年 11 月 10 日 |
| 24 | 关于在星展银行开通旗下部分基金转换业务的公告                          | 同上 | 2014 年 11 月 19 日 |
| 25 | 关于旗下部分开放式基金参加星展银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告              | 同上 | 2014 年 12 月 1 日  |
| 26 | 关于长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金在交通银行开通基金转换业务的公告         | 同上 | 2014 年 12 月 10 日 |
| 27 | 关于增加旗下部分开放式基金代销机构并推出部分代销机构申购费率优惠活动的公告           | 同上 | 2014 年 12 月 17 日 |
| 28 | 关于增加联泰资产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 12 月 22 日 |
| 29 | 关于旗下部分开放式基金参加数                                  | 同上 | 2014 年 12 月 25 日 |

|    |   |    |                  |
|----|---|----|------------------|
|    | 米基金申购费率优惠活动的公告                              |    |                  |
| 30 | 关于增加一路财富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 12 月 29 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (二) 《长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《长盛电子信息产业股票型证券投资基金托管协议》；
- (四) 《长盛电子信息产业股票型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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金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 3 月 28 日