

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：2014年8月28日

#### 重要提示

#### 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

根据2014年3月17日收到的中国证监会基金监管部《关于同益证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]150号），自2014年4月4日起《同益证券投资基金基金合同》失效且《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。同益证券投资基金转型为契约型开放式，其投资目标、理念、范围和策略调整，同时更名为“长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止（其中转型前同益证券投资基金报告期自2014年1月1日起至2014年4月3日止，转型后长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）报告期自2014年4月4日（基金合同生效日）起至6月30日止）。

#### 基金简介

基金基本情况（转型前）

基金简称

\_长盛同益封闭

\_

\_场内简称

\_基金同益

\_

\_基金主代码

\_184690

\_

\_交易代码

\_184690

\_

\_基金运作方式

\_契约型封闭式

\_

\_基金合同生效日

\_1999年4月8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

\_2,000,000,000.00份

\_基金合同存续期

\_15年（1999年4月8日至2014年4月3日，于2014年4月4日转型为长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF））

\_基金份额上市的证券交易所

\_深圳证券交易所

\_上市日期

\_1999年4月21日

\_注：上表中“报告期末”为基金转型前最后一日，即2014年4月3日。

基金基本情况（转型后）

基金简称

\_长盛同益成长回报混合（LOF）

\_场内简称

\_长盛同益

\_基金主代码

\_160812

\_交易代码

\_160812

\_基金运作方式

\_契约型开放式

\_基金合同生效日

\_2014年4月4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

\_1, 787, 621, 340. 43份

\_基金合同存续期

\_不定期

\_基金份额上市的证券交易所

\_深圳证券交易所

\_上市日期

\_2014年6月4日

\_注：上表中“报告期末”为2014年6月30日。

基金产品说明（转型前）

投资目标

\_本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

\_投资策略

\_根据国家宏观经济环境决定投资的总体策略；根据货币政策、利率走势决定本基金的债券投资比例；根据地区及行业发展的状况决定行业投资战略；根据对上市公司研究选择所要投资的股票；根据对证券市场走势的研究作为投资择时参考。

\_业绩比较基准

\_无

\_风险收益特征

\_较高风险，较高预期收益。

基金产品说明（转型后）

投资目标

\_通过自上而下筛选增长预期良好或景气复苏的行业，结合挖掘目标行业的上市公司基本面，自下而上精选个股，为投资者实现资产长期增值，力争获得绝对回报。

\_投资策略

\_本基金将通过深入分析上述指标与因素，动态调整基金资产在股票、股指期货、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。

股票投资策略上，本基金将充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，采用定性和定量相结合的方式，以深入的基本面研究为基础，结合数据挖掘技术，密切跟踪市场景气变化，挖掘具有快速成长预期、且估值相对较低的个股进行投资，并通过对股票投资机会的精细操作，审慎选择投资时机，力争获取正回报。本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。

本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，在市场向下带动净值走低时，通过股指期货快速降低投资组合的仓位，从而调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特性；并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时，通过股指期货快速提高投资组合的仓位，从而提高基金资产收益。本基金的权证投资是以权证的市场价

值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

—  
\_业绩比较基准

\_50%\*沪深300指数收益率+50%\*中证综合债指数收益率

—  
\_风险收益特征

\_本基金属于混合型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

—  
\_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

—  
\_信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址

\_http://www.csfunds.com.cn

\_基金半年度报告备置地点  
\_基金管理人和基金托管人的住所

-

-  
\_主要财务指标、基金净值表现

\_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

\_转型前

\_转型后

-

-  
\_报告期（2014年1月1日- 2014年4月3日）

\_报告期（2014年4月4日（基金合同生效日）起至6月30日）

-

\_本期已实现收益

\_101,110,057.72

\_6,029,490.00

-

\_本期利润

\_19,056,214.66

\_7,310,768.66

-

\_加权平均基金份额本期利润

\_0.0095

\_0.0041

-

\_本期基金份额净值增长率

\_0.96%

\_0.36%

-

\_3.1.2 期末数据和指标

\_报告期末（2014年4月3日）

\_报告期末（2014年6月30日）

-

\_期末可供分配基金份额利润

\_-0.0084

\_-0.0059

-

\_期末基金资产净值

\_2,000,570,623.25

\_1,793,752,070.39

-

\_期末基金份额净值

\_1.000

\_1.003

-

\_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。

基金净值表现（转型前）

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

—  
\_过去一个月

\_ -2.99%

\_ 0.72%

—  
\_过去三个月

\_ 0.93%

\_ 1.07%

—  
\_过去六个月

\_ 0.32%

\_ 1.29%

—  
\_过去一年

\_ 11.89%

\_ 1.38%

—  
\_过去三年

\_ -10.06%

\_ 1.38%

—  
\_自基金合同生效起至今

\_ 534.06%

\_ 2.59%

—  
\_注：本基金未规定业绩比较基准，无需进行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

注：本基金未规定业绩比较基准，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。同益证券投资基金存续期为1999年4月8日至2014年4月3日。

基金净值表现（转型后）

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

转型后

—  
\_阶段

\_份额净值增长率①

\_份额净值增长率标准差②

\_业绩比较基准收益率③

\_业绩比较基准收益率标准差④

\_①-③

\_②-④

\_过去一个月

\_0.30%

\_0.44%

\_0.59%

\_0.38%

\_-0.29%

\_0.06%

\_自基金转型起至今

\_0.36%

\_0.58%

\_1.45%

\_0.44%

\_-1.09%

\_0.14%

\_注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准：50%\*沪深300指数收益率+50%\*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。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证全债指数。目前沪深300指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准较为合适。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%；根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可使业绩比较更具有合理性。

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

自基金转型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

注：1、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同益证券投资基金转型而来，转型日期为2014年4月4日（即基金合同生效日）。截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的0%-95%；其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；权证投资占基金资产净值的0%-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

管理人报告

基金管理人及基金经理情况

基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于1999年3月26日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币15000万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至2014年6月30日，基金管理人共管理一只封闭式基金、三十四只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外QFII基金和专户理财产品的投资顾问。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名

\_职务

\_任本基金的基金经理（助理）期限

\_证券从

业年限

\_说明

-

-

-

\_任职日期

\_离任日期

-

-

-

\_张锦灿

\_本基金基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

\_2012年11月20日

\_2014年4月3日

\_9年

\_男，1982年1月出生，中国国籍。北京大学光华管理学院金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、研究主管、基金经理助理。2012年9月加入长盛基金管理有限公司，现任同益证券投资基金（本基金）基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛高端装备制造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。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名

\_职务

\_任本基金的基金经理（助理）期限

\_证券从

业年限

\_说明

-

-

— 任职日期

— 离任日期

—

—

— 张锦灿

— 本基金基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

— 2014年4月4日

—

— 9年

— 男，1982年1月出生，中国国籍。北京大学光华管理学院金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、研究主管、基金经理助理。2012年9月加入长盛基金管理有限公司，曾任同益证券投资基金基金经理。现任长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF，本基金）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。

— 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、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》、《同益证券投资基金基金合同》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。

— 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

— 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下：

— 研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

— 投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

— 交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

— 投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

— 公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

— 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，共发生4次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

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

2014年二季度，市场仍处于弱中。4月初，受流动性好于预期及政策影响，市场有波短暂的反弹，但随着新股发行重启，及上市公司业绩公布，市场尤其是创业板相关股票大跌。5月下旬，随着“微刺激”政策连续出台，及新股发行数量的明确，市场开始反弹。

本基金在报告期处于转型阶段，但仍积极参与了市场机会。在前半期积极参与了新能源汽车、电子等板块机会，后半期及时降低了配置型投资及整体仓位。一季度，本基金表现优于指数。自5月中下旬之后，果断加仓，但本着绝对收益的原则，整体仓位并不很高，虽然也受益于市场反弹，但并不充分。

报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日，长盛同益成长回报混合（LOF）份额净值为1.003元，本报告期（2014年4月4日至2014年6月30日）份额净值增长率为0.36%，同期业绩比较基准增长率为1.45%。

截至2014年4月3日，长盛同益封闭份额净值为1.0003元，本报告期（2014年1月1日至2014年4月3日）份额净值增长率为0.96%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

以创业板为代表的新经济相关行业，股价的主要驱动因素仍不是业绩，而是故事和并购。这是已经持续了14个月的投资模式，被越来越多的投资者，包括机构投资者主动或被迫接受。但是，随着业绩增速和股价表现差距越来越大，其空间越来越有限了。相反，一部分稳定增长的二线蓝筹公司，以汽车、家电、医药、消费品等行业公司为代表，还在实现利润的稳定增长，但受市场风格因素影响，估值不断下降。未来，两种风格的收益差异会大幅缩小。

三季度及下半年，本基金将根据增长和估值因素，参照国内外估值差异，从上述二线蓝筹公司精选个股，在基金规模稳定后，加大配置力度，适度集中。同时，本着绝对收益的决策原则，本基金仓位将参照市场增量资金、及机会状况进行中期调整。

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。

#### 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《同益证券投资基金基金合同》第十七条中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期（2014年1月1日至2014年4月3日）未实施利润分配。本基金截至2014年4月3日，期末可供分配利润为-16,734,154.83元。期末未分配收益为570,623.25元，其中：未分配收益已实现部分为-16,734,154.83元，未分配收益未实现部分为17,304,778.08元。

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》第十六条中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期（2014年4月4日至2014年6月30日）未实施利润分配。本基金截至2014年6月30日，期末可供分配利润为-10,580,775.52元。期末未分配收益为7,630,831.13元，其中：未分配收益已实现部分为-10,580,775.52元，未分配收益未实现部分为18,211,606.65元。

#### 托管人报告

##### 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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。

##### 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，本基金的管理人——长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、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。

##### 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的本基金2014年半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。

##### 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

##### 资产负债表(转型前)

会计主体：同益证券投资基金

报告截止日：2014年4月3日

单位：人民币元

##### 资 产

\_本期末

2014年4月3日

\_上年度末

2013年12月31日

\_ 资 产：

\_

\_

\_

\_ 银行存款

\_98,247,365.34

\_21,604,344.38

-

\_ 结算备付金

\_10,591,612.17

\_5,472,118.25

-

\_ 存出保证金

\_1,721,737.54

\_1,551,116.67

-

\_ 交易性金融资产

\_1,694,011,085.71

\_1,895,858,065.30

-

\_ 其中：股票投资

\_979,722,585.71

\_1,317,891,405.30

-

\_ 基金投资

-

-

-

-

\_ 债券投资

\_714,288,500.00

\_577,966,660.00

-

\_ 资产支持证券投资

-

-

-

-

\_ 贵金属投资

-

-

-

-

\_ 衍生金融资产

-

-

-

-

\_ 买入返售金融资产

-

\_59,500,194.25

-

\_ 应收证券清算款

\_185,345,210.07

\_5,556,375.01

-

\_ 应收利息

\_14,791,198.21  
\_7,500,791.36

\_ 应收股利

-  
-

\_ 应收申购款

-  
-

\_ 递延所得税资产

-  
-

\_ 其他资产

-  
-

\_ 资产总计

\_2,004,708,209.04  
\_1,997,043,005.22

\_ 负债和所有者权益

\_ 本期末

2014年4月3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  
-  
\_7,790,082.45  
-  
\_应付赎回款  
-  
-  
-  
\_应付管理人报酬  
\_246,801.05  
\_2,530,673.19  
-  
\_应付托管费  
\_41,133.51  
\_421,778.86  
-  
\_应付销售服务费  
-  
-  
-  
\_应付交易费用  
\_2,275,455.90  
\_3,050,154.14  
-  
\_应交税费  
\_815,699.68  
\_815,699.68  
-  
\_应付利息  
-  
-  
-  
-  
\_应付利润  
-  
-  
-  
-  
\_递延所得税负债  
-  
-  
-  
-  
\_其他负债  
\_758,495.65  
\_920,208.31  
-  
\_负债合计

\_4, 137, 585. 79  
\_15, 528, 596. 63

\_所有者权益：

-

-

\_实收基金

\_2, 000, 000, 000. 00

\_2, 000, 000, 000. 00

-

\_未分配利润

\_570, 623. 25

\_-18, 485, 591. 41

-

\_所有者权益合计

\_2, 000, 570, 623. 25

\_1, 981, 514, 408. 59

-

\_负债和所有者权益总计

\_2, 004, 708, 209. 04

\_1, 997, 043, 005. 22

-

\_注：1、报告截止日2014年4月3日，基金份额净值1.0003元，基金份额总额2,000,000,000份。

2、本财务报表的实际编制期间为2014年1月1日至2014年4月3日止。

利润表

会计主体：同益证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年4月3日

单位：人民币元

项 目

\_本期

2014年1月1日至2014年4月3日

\_上年度可比期间

2013年1月1日至2013年6月30日

-

\_一、收入

\_33, 204, 247. 13

\_131, 233, 857. 44

-

\_1. 利息收入

\_8, 086, 106. 25

\_8, 510, 769. 27

-

\_其中：存款利息收入

\_218, 509. 05

\_403, 044. 45

-

\_债券利息收入  
\_6,981,288.20  
\_7,437,778.07  
-  
\_资产支持证券利息收入  
-  
-  
-  
\_买入返售金融资产收入  
\_886,309.00  
\_669,946.75  
-  
\_其他利息收入  
-  
-  
-  
\_2. 投资收益（损失以“-”填列）  
\_107,171,983.94  
\_222,793,876.02  
-  
\_其中：股票投资收益  
\_108,964,607.42  
\_216,613,863.18  
-  
\_基金投资收益  
-  
-  
-  
\_债券投资收益  
\_ -1,746,905.41  
\_ -1,049,704.66  
-  
\_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  
\_ -45,718.07  
\_7,229,717.50

—  
\_3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）

\_82,053,843.06

\_100,070,787.85

—  
\_4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）

—

—

—  
\_5. 其他收入（损失以“-”号填列）

—

—

—  
\_减：二、费用

\_14,148,032.47

\_25,521,099.03

—  
\_1. 管理人报酬

\_7,726,322.62

\_13,690,902.01

—  
\_2. 托管费

\_1,287,720.46

\_2,281,816.99

—  
\_3. 销售服务费

—

—

—  
\_4. 交易费用

\_5,018,098.97

\_9,321,385.24

—  
\_5. 利息支出

\_4,415.34

—

—  
\_其中：卖出回购金融资产支出

\_4,415.34

—

—  
\_6. 其他费用

\_111,475.08

\_226,994.79

—  
\_三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）

\_19,056,214.66

\_105,712,758.41

\_减：所得税费用

-

-

-

\_四、净利润（净亏损以“-”号填列）

\_19,056,214.66

\_105,712,758.41

-

\_所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：同益证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年4月3日

单位：人民币元

项目

\_本期

2014年1月1日至2014年4月3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）

\_2,000,000,000.00

-18,485,591.41

\_1,981,514,408.59

-

\_二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）

-

\_19,056,214.66

\_19,056,214.66

-

\_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）

-

-

-

-

\_其中：1. 基金申购款

-

-

-

-

\_2. 基金赎回款

-

-

-

-

-

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）

-

-

-

-

五、期末所有者权益（基金净值）

2,000,000,000.00

570,623.25

2,000,570,623.25

-

项目

上年度可比期间

2013年1月1日至2013年6月30日

-

-

实收基金

未分配利润

所有者权益合计

-

一、期初所有者权益（基金净值）

2,000,000,000.00

-284,377,337.55

1,715,622,662.45

-

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）

-

105,712,758.41

105,712,758.41

-

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）

-

-

-

-

其中：1. 基金申购款

-

-

-

-

2. 基金赎回款

-

-

-

-

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）

-  
-  
-  
-

五、期末所有者权益（基金净值）

2,000,000,000.00

-178,664,579.14

1,821,335,420.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵

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

报表附注

基金基本情况

同益证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[1999]8号文《关于同意同益证券投资基金设立的批复》的核准，由中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、天津北方国际信托投资股份有限公司、国元证券股份有限公司和长盛基金管理有限公司五家发起人共同发起并向社会募集设立，基金合同于1999年4月2日正式生效，首次设立募集规模为20亿份基金份额。本基金为契约型封闭式，存续期为15年。本基金经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[1999]21号文审核同意，于1999年4月21日在深交所挂牌交易。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金只投资于具有良好流动性的金融工具，其中主要投资于国内依法公开发行、上市的股票、债券。本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%。本基金并未就业绩比较基准作出相关规定。

会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2014年4月3日的财务状况以及2014年1月1日至2014年4月3日期间的经营成果和净值变动情况。

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。

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

长盛同益封闭本报告期无会计政策变更。

会计估计变更的说明

长盛同益封闭本报告期无会计估计变更。

差错更正的说明

长盛同益封闭本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

税项

#### 1、印花税

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

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

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

#### 2、营业税、企业所得税

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

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

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

#### 3、个人所得税

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

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

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

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

关联方关系

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称

\_与本基金的关系

\_长盛基金管理有限公司

\_基金发起人、基金管理人

\_国元证券

\_基金发起人、基金管理人股东

\_中国工商银行

\_基金托管人

\_本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称

\_本期

2014年1月1日至2014年4月3日

\_上年度可比期间

2013年1月1日至2013年6月30日

\_成交金额

\_占当期股票

成交总额的比例

\_成交金额

\_占当期股票

成交总额的比例

\_国元证券

-

-

\_1,548,690,773.69

\_25.55%

\_债券交易

注：长盛同益封闭于本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

注：长盛同益封闭于本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

权证交易

注：长盛同益封闭于本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

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4月3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

-

-

-

-

-

\_关联方名称

\_上年度可比期间

2013年1月1日至2013年6月30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

\_1,346,566.79

\_24.69%

\_136,733.70

\_5.01%

-

\_注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、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。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目

\_本期

2014年1月1日至2014年4月3日

\_上年度可比期间

2013年1月1日至2013年6月30日

-

\_当期发生的基金应支付的管理费

\_7,726,322.62

\_13,690,902.01

-

\_其中：支付销售机构的客户维护费\_

-

-

-

\_注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提，基金成立三个月后，如果现

金持有比例超过基金资产净值的20%，超出部分不计提基金管理费。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值（扣除超过规定比例现金后的资产净值）

基金管理人的管理费每日计算，管理费逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款通知于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

基金托管费

单位：人民币元

项目

\_本期

2014年1月1日至2014年4月3日

\_上年度可比期间

2013年1月1日至2013年6月30日

\_当期发生的基金应支付的托管费

\_1,287,720.46

\_2,281,816.99

\_注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，基金托管费逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款通知于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：长盛同益封闭本报告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。

各关联方投资本基金的情况

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4月3日

\_上年度可比期间

2013年1月1日至2013年6月30日

\_基金合同生效日持有的基金份额

\_

\_

\_期初持有的基金份额

\_28,000,079.00

\_28,000,079.00

\_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

\_28,000,079.00

\_28,000,079.00

—

\_期末持有的基金份额

占基金总份额比例

\_1.40%

\_1.40%

—

\_注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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4月3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（%）

—

\_长江证券

\_6,000,000.00

\_0.30%

\_6,000,000.00

\_0.30%

—

\_天津北方国际信托

\_4,000,000.00

\_0.20%

\_4,000,000.00

\_0.20%

\_

\_中信证券

\_6,000,000.00

\_0.30%

\_6,000,000.00

\_0.30%

\_

\_国元证券

\_4,000,000.00

\_0.20%

\_4,000,000.00

\_0.20%

\_

\_注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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4月3日

\_上年度可比期间

2013年1月1日至2013年6月30日

\_

\_

\_期末余额

\_当期利息收入

\_期末余额

\_当期利息收入

\_

\_中国工商银行

\_98,247,365.34

\_188,521.03

\_204,999,032.57

\_349,542.23

\_

\_注：长盛同益封闭的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计算。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：长盛同益封闭于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

其他关联交易事项的说明

注：长盛同益封闭本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

期末（2014年4月3日）本基金持有的流通受限证券

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：长盛同益封闭本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元



\_100,000  
\_2,504,061.00  
\_2,681,000.00

-

-  
\_002111  
\_威海广泰  
\_2014年3月24日  
\_重大事项停牌  
\_12.95  
\_2014年5月8日  
\_12.20  
\_100,000  
\_1,323,024.89  
\_1,295,000.00

-

-  
\_注：长盛同益封闭截至2014年4月3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。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

长盛同益封闭本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

交易所市场债券正回购

长盛同益封闭本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项  
无。

半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

资产负债表（转型后）

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资 产

\_本期末

2014年6月30日

-  
\_资 产：

-

-  
\_银行存款  
\_236,596,520.21

-  
\_结算备付金

\_16,825,734.89

-

\_存出保证金  
\_603,963.99

-

_交易性金融资产	
_824,860,987.12	
-	
_其中：股票投资	
_764,662,987.12	
-	
_    基金投资	
-	
-	
_债券投资	
_60,198,000.00	
-	
_资产支持证券投资	
-	
-	
_贵金属投资	
-	
-	
_衍生金融资产	
-	
-	
_买入返售金融资产	
_830,000,000.00	
-	
_应收证券清算款	
-	
-	
_应收利息	
_2,184,625.69	
-	
_应收股利	
-	
-	
_应收申购款	
_295.57	
-	
_递延所得税资产	
-	
-	
_其他资产	
_30,246.94	
-	
_资产总计	
_1,911,102,374.41	
-	
_负债和所有者权益	
_本期末	

2014年6月30日

— 负 债：

—

— 短期借款

—

— 交易性金融负债

—

— 衍生金融负债

—

— 卖出回购金融资产款

—

— 应付证券清算款

— 98,474,063.13

— 应付赎回款

— 11,016,717.31

— 应付管理人报酬

— 2,583,304.33

— 应付托管费

— 430,550.73

— 应付销售服务费

—

— 应付交易费用

— 2,973,437.80

— 应交税费

— 815,699.68

— 应付利息

—

— 应付利润

—

— 递延所得税负债

—

—

\_其他负债  
\_1,056,531.04

\_负债合计  
\_117,350,304.02

\_所有者权益：

\_实收基金  
\_1,786,121,239.26

\_未分配利润  
\_7,630,831.13

\_所有者权益合计  
\_1,793,752,070.39

\_负债和所有者权益总计  
\_1,911,102,374.41

\_注：1、报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.003元，基金份额总额1,787,621,340.43份。2、本基金合同于2014年4月4日生效，本财务报表的实际编制期间为2014年4月4日至2014年6月30日止期间。

#### 利润表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2014年4月4日至2014年6月30日

单位：人民币元

项 目

\_本期

2014年4月4日至2014年6月30日

\_一、收入  
\_21,503,039.22

\_1. 利息收入  
\_7,826,041.44

\_其中：存款利息收入  
\_680,520.04

\_债券利息收入  
\_3,730,397.81

\_资产支持证券利息收入

\_

\_

\_买入返售金融资产收入  
\_3,415,123.59

\_其他利息收入  
\_

\_2. 投资收益（损失以“-”填列）  
\_11,268,596.60

\_其中：股票投资收益  
\_3,997,765.96

\_基金投资收益  
\_

\_债券投资收益  
\_909,343.70

\_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  
\_6,361,486.94

\_3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）  
\_1,281,278.66

\_4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）  
\_

\_5. 其他收入（损失以“-”号填列）  
\_1,127,122.52

\_减：二、费用  
\_14,192,270.56

\_1. 管理人报酬  
\_7,840,959.04

\_2. 托管费  
\_1,306,826.52

—  
\_3. 销售服务费

—

—  
\_4. 交易费用

\_4,941,408.97

—  
\_5. 利息支出

—

—  
\_其中：卖出回购金融资产支出

—

—  
\_6. 其他费用

\_103,076.03

—  
\_三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）

\_7,310,768.66

—  
\_减：所得税费用

—

—  
\_四、净利润（净亏损以“-”号填列）

\_7,310,768.66

—  
\_所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2014年4月4日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目

\_本期

2014年4月4日至2014年6月30日

—

—  
\_实收基金

\_未分配利润

\_所有者权益合计

—  
\_一、期初所有者权益（基金净值）

\_2,000,000,000.00

\_570,623.25

\_2,000,570,623.25

—  
\_二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）

—

\_7,310,768.66

\_7,310,768.66

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)

-213,878,760.74

-250,560.78

-214,129,321.52

其中：1. 基金申购款

686,191,017.38

564,199.68

686,755,217.06

2. 基金赎回款（以“-”号填列）

-900,069,778.12

-814,760.46

-900,884,538.58

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）

1,786,121,239.26

7,630,831.13

1,793,752,070.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵

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

报表附注

基金基本情况

长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同益证券投资基金转型而来。同益证券投资基金（以下简称“基金同益”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[1999]8号文《关于同意同益证券投资基金设立的批复》的核准，由中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、天津北方国际信托投资股份有限公司、国元证券股份有限公司和长盛基金管理有限公司五家发起人共同发起并向社会募集设立，基金合同于1999年4月2日正式生效，首次设立募集规模为20亿份基金份额。基金同益为契约型封闭式，存续期为15年。基金同益经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[1999]21号文审核同意，于1999年4月21日在深交所挂牌交易。

基金同益的基金份额持有人大会自2014年1月30日起至2014年2月26日17:00止以通讯方式投票表决通过了《关于同益证券投资基金转型有关事项的议案》，基金管理人长盛基金管理有限公司于2014年2月28日发布了《关于同益证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》，并于2014年3月19日收到中国证监会基金监管部《关于同益证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]150号），基金份额持有人大会决议报中国证监会备案手续完成，持有人大会决议生效，基金管理人长盛基金管理有限公司于2014年3月20日发布了《同

益证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《同益证券投资基金基金合同》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、中国证监会基金监管部《关于同益证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]150号）和《同益证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》等有关规定，基金管理人长盛基金管理有限公司向深圳证券交易所申请提前终止基金同益上市交易，并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2014]118号）同意，基金同益于2014年4月4日终止上市。自终止上市之日起，基金同益转型为“长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”（以下简称“长盛同益”或“本基金”），由《同益证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。转型完成后，本基金为上市契约型开放式基金，存续期限为不定期。

经深圳证券交易所深证上[2014]186号文核准，长盛同益于2014年6月4日在深圳证券交易所上市交易。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，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》和《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金主要投资于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）、股指期货、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（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%；其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；权证投资占基金资产净值的0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或到期日在一年期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50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。

#### 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2014年6月30日的财务状况以及2014年4月4日至2014年6月30日期间的经营成果和净值变动情况。

#### 重要会计政策和会计估计

##### 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2014年4月4日（基金合同生效日）至2014年6月30日。

##### 记账本位币

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

##### 金融资产和金融负债的分类

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

## 1、金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中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。

本基金将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

## 2、金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。

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

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

### 1、股票投资

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

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

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

### 2、债券投资

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

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，出售债券的成本按移动加权平均法于交易日结转。

### 3、权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资，权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该类权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### 4、分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述相关原则进行计算。

#### 5、回购协议

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

#### 金融资产和金融负债的估值原则

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

#### 1、股票投资

##### （1）上市流通的股票的估值

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

##### （2）未上市的股票的估值

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

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

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

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

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

#### 2、债券投资

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

价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

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

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

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

### 3、权证投资

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

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

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

### 4、分离交易可转债

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

### 5、其他

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

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

### 金融资产和金融负债的抵销

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

### 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额，每份基金面值为人民币1.00元。

### 损益平准金

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

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

### 收入/（损失）的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业

代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 费用的确认和计量

1、基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

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

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

#### 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金收益分配采取现金方式；

3、基金当期收益在弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为4次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

#### 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 税项

##### 1、印花税

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

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

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

##### 2、营业税、企业所得税

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

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

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

### 3、个人所得税

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

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

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

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

### 关联方关系

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

本报告期与基金发生关联交易的各关联方

#### 关联方名称

\_与本基金的关系

-

\_长盛基金管理有限公司

\_基金发起人、基金管理人

-

\_国元证券

\_基金发起人、基金管理人股东

-

\_中国工商银行

\_基金托管人

-

\_本报告期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称

\_本期

2014年4月4日至2014年6月30日

-

-  
\_成交金额  
\_占当期股票  
成交总额的比例

-  
\_国元证券  
\_328,095,680.03  
\_10.39%

-  
\_债券交易

注：本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称

\_本期

2014年4月4日至2014年6月30日

-

-  
\_成交金额  
\_占当期债券  
成交总额的比例

-  
\_国元证券  
\_630,000,000.00  
\_7.72%

-  
\_权证交易

注：本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

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4月4日至2014年6月30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  
\_298,698.85  
\_10.39%  
\_298,698.85  
\_10.07%

-

\_注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、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。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目

\_本期

2014年4月4日至2014年6月30日

\_当期应支付的管理费

\_7,840,959.04

\_其中：支付销售机构的客户维护费

\_62,130.10

\_注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，管理费逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款通知于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

基金托管费

单位：人民币元

项目

\_本期

2014年4月4日至2014年6月30日

\_当期应支付的托管费

\_1,306,826.52

\_注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，基金托管费逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款通知于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

各关联方投资本基金的情况

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4月4日至2014年6月30日

-

\_基金合同生效日持有的基金份额

\_28,000,079.00

\_期间申购/买入总份额

\_22,999.00

\_期间因拆分增加的份额

-

\_期间赎回/卖出总份额

\_28,023,078.00

\_期末持有的基金份额

-

\_期末持有的基金份额

占基金总份额比例

-

\_注：1、基金管理人以2014年5月14日作为基金份额折算基准日，对折算基准日登记在册的由原基金同益转型所得的本基金基金份额进行折算与变更登记。折算后，本基金管理人持有的基金份额调增22,999.00份。2、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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6月30日

-

\_持有的

基金份额

\_持有的基金份额

占基金总份额的比例

\_国元证券

\_4,003,286.00

\_0.22%

\_注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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4月4日至2014年6月30日

-

\_ 期末余额  
\_ 当期利息收入

\_ 中国工商银行  
\_ 236, 596, 520. 21  
\_ 626, 898. 85

\_ 注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计算。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

期末持有的暂时停牌股票

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

\_ 300369

\_ 绿盟科技

\_ 2014年6月26日

\_ 重大事项停牌

\_ 61. 27

\_

\_

\_ 179, 867

\_ 10, 075, 465. 69

\_ 11, 020, 451. 09

\_

\_

\_ 300351

\_永贵电器  
\_2014年6月23日  
\_重大事项停牌  
\_26.29  
\_2014年8月7日  
\_27.61  
\_300,000  
\_6,194,224.60  
\_7,887,000.00

—  
—

\_注：本基金截至2014年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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。

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。

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

投资组合报告(转型前)

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

\_979,722,585.71

\_48.87

—

\_其中：股票

\_979,722,585.71

\_48.87

—

\_2

\_固定收益投资

\_714,288,500.00

\_35.63

—

\_其中：债券

\_714,288,500.00

\_35.63

-	
-	
-	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
-	108,838,977.51
-	5.43
-	
-	7
-	其他资产
-	201,858,145.82
-	10.07
-	
-	8
-	合计
-	2,004,708,209.04
-	100.00
-	
-	期末按行业分类的股票投资组合
-	金额单位：人民币元
-	代码
-	行业类别
-	公允价值（元）
-	占基金资产净值比例（%）

\_A

\_农、林、牧、渔业

\_6.50

\_0.00

\_B

\_采矿业

\_4,158,000.00

\_0.21

\_C

\_制造业

\_786,117,188.20

\_39.29

\_D

\_电力、热力、燃气及水生产和供应业

\_

\_

\_E

\_建筑业

\_

\_

\_F

\_批发和零售业

\_4,489,577.85

\_0.22

\_G

\_交通运输、仓储和邮政业

\_888.00

\_0.00

\_H

\_住宿和餐饮业

\_

\_

\_I

\_信息传输、软件和信息技术服务业

\_3,574,500.00

\_0.18

\_J

\_金融业  
\_141,064,251.71  
\_7.05

\_K  
\_房地产业  
\_39,852,000.00  
\_1.99

\_L  
\_租赁和商务服务业  
\_466,173.45  
\_0.02

\_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

\_979,722,585.71

\_48.97

- 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

\_000848

\_承德露露

\_5,950,000

\_127,032,500.00

\_6.35

-  
\_2

\_000748

\_长城信息

\_3,800,000

\_75,620,000.00

\_3.78

-  
\_3

\_601688

\_华泰证券

\_8,999,884

\_69,479,104.48

\_3.47

-  
\_4

\_600552

\_方兴科技

\_3,290,000

\_65,701,300.00

\_3.28

-  
\_5

\_002563

\_森马服饰

\_2, 016, 401  
\_64, 323, 191. 90  
\_3. 22

\_6  
\_600690  
\_青岛海尔  
\_3, 899, 916  
\_62, 398, 656. 00  
\_3. 12

\_7  
\_601299  
\_中国北车  
\_11, 509, 890  
\_55, 362, 570. 90  
\_2. 77

\_8  
\_600983  
\_合肥三洋  
\_3, 900, 000  
\_53, 625, 000. 00  
\_2. 68

\_9  
\_600584  
\_长电科技  
\_6, 200, 000  
\_49, 662, 000. 00  
\_2. 48

\_10  
\_600837  
\_海通证券  
\_5, 214, 557  
\_48, 964, 690. 23  
\_2. 45

\_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://csfunds.com.cn>网站的半年度报告正文。

报告期内股票投资组合的重大变动

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  
\_600109  
\_国金证券  
\_82,994,882.50  
\_4.19

\_2  
\_601688  
\_华泰证券  
\_69,368,354.54  
\_3.50

\_3  
\_600690  
\_青岛海尔  
\_63,509,856.56  
\_3.21

\_4  
\_600729  
\_重庆百货  
\_61,827,781.48  
\_3.12

\_5  
\_600122  
\_宏图高科  
\_60,010,577.32  
\_3.03

\_6  
\_601299  
\_中国北车  
\_55,531,909.63  
\_2.80

\_7  
\_000957  
\_中通客车  
\_55,176,693.85  
\_2.78

\_8  
\_600271

\_航天信息  
\_53, 532, 057. 41  
\_2. 70

\_9  
\_600759  
\_正和股份  
\_50, 238, 800. 28  
\_2. 54

\_10  
\_600837  
\_海通证券  
\_50, 007, 849. 24  
\_2. 52

\_11  
\_600480  
\_凌云股份  
\_49, 789, 615. 24  
\_2. 51

\_12  
\_600787  
\_中储股份  
\_44, 296, 768. 55  
\_2. 24

\_13  
\_002005  
\_德豪润达  
\_41, 449, 173. 57  
\_2. 09

\_14  
\_000848  
\_承德露露  
\_37, 757, 795. 41  
\_1. 91

\_15  
\_600552  
\_方兴科技  
\_33, 718, 723. 83  
\_1. 70

\_16

\_600600  
\_青岛啤酒  
\_32,219,105.46  
\_1.63

\_17  
\_600038  
\_哈飞股份  
\_32,073,254.74  
\_1.62

\_18  
\_600525  
\_长园集团  
\_27,820,056.40  
\_1.40

\_19  
\_002050  
\_三花股份  
\_25,465,387.57  
\_1.29

\_20  
\_300353  
\_东土科技  
\_25,424,554.82  
\_1.28

\_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  
\_300181  
\_佐力药业  
\_162,052,325.63  
\_8.18

\_2  
\_600584  
\_长电科技  
\_72,664,341.46

\_3.67

-

\_3

\_600729

\_重庆百货

\_65,756,786.34

\_3.32

-

\_4

\_002470

\_金正大

\_60,685,705.13

\_3.06

-

\_5

\_600109

\_国金证券

\_59,478,966.40

\_3.00

-

\_6

\_002005

\_德豪润达

\_57,940,775.20

\_2.92

-

\_7

\_000957

\_中通客车

\_57,824,828.74

\_2.92

-

\_8

\_600122

\_宏图高科

\_56,295,221.91

\_2.84

-

\_9

\_600303

\_曙光股份

\_55,437,003.12

\_2.80

-

\_10

\_600271

\_航天信息

\_55,277,787.16  
\_2.79

\_11  
\_601601  
\_中国太保  
\_52,979,579.66  
\_2.67

\_12  
\_600983  
\_合肥三洋  
\_50,519,349.96  
\_2.55

\_13  
\_600787  
\_中储股份  
\_42,155,725.68  
\_2.13

\_14  
\_000848  
\_承德露露  
\_40,850,654.77  
\_2.06

\_15  
\_600643  
\_爱建股份  
\_39,606,717.38  
\_2.00

\_16  
\_002612  
\_朗姿股份  
\_39,480,939.42  
\_1.99

\_17  
\_002185  
\_华天科技  
\_33,267,155.65  
\_1.68

\_18  
\_002108

\_ 沧州明珠  
\_ 30,100,681.10  
\_ 1.52

\_ 19  
\_ 300202  
\_ 聚龙股份  
\_ 28,259,447.44  
\_ 1.43

\_ 20  
\_ 002460  
\_ 赣锋锂业  
\_ 26,998,611.69  
\_ 1.36

\_ 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  
\_ 1,404,793,038.56

\_ 卖出股票收入（成交）总额  
\_ 1,766,274,645.47

\_ 注：本项中7.4.1, 7.4.2, 7.4.3表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。  
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  
\_ 59,334,000.00  
\_ 2.97

\_ 2  
\_ 央行票据

\_

\_ 3  
\_ 金融债券  
\_ 448,520,000.00  
\_ 22.42

-  
-  
\_其中：政策性金融债  
\_448,520,000.00  
\_22.42

-  
\_4  
\_企业债券  
\_105,508,500.00  
\_5.27

-  
\_5  
\_企业短期融资券

-  
-  
-  
\_6  
\_中期票据  
\_90,804,000.00  
\_4.54

-  
\_7  
\_可转债  
\_10,122,000.00  
\_0.51

-  
\_8  
\_其他

-  
\_9  
\_合计  
\_714,288,500.00  
\_35.70

-  
\_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  
\_110224

\_11国开24  
\_1,000,000  
\_100,010,000.00  
\_5.00

\_2  
\_098087  
\_09中铝业债1  
\_900,000  
\_90,405,000.00  
\_4.52

\_3  
\_120246  
\_12国开46  
\_800,000  
\_78,472,000.00  
\_3.92

\_4  
\_110257  
\_11国开57  
\_700,000  
\_69,797,000.00  
\_3.49

\_5  
\_0982040  
\_09沪电力MTN2  
\_600,000  
\_60,468,000.00  
\_3.02

\_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：长盛同益封闭本报告期末未持有资产支持证券。

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：长盛同益封闭本报告期末未持有贵金属投资。

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：长盛同益封闭本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：长盛同益封闭本报告期末无股指期货投资。

本基金投资股指期货的投资政策

长盛同益封闭本报告期内未投资股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

长盛同益封闭本报告期内未投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：长盛同益封闭本报告期末无国债期货投资。

本期国债期货投资评价

长盛同益封闭本报告期内未投资国债期货。

投资组合报告附注

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。

长盛同益封闭投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

其他资产构成

单位：人民币元

序号

\_名称

\_金额

-

\_1

\_存出保证金

\_1,721,737.54

-

\_2

\_应收证券清算款

\_185,345,210.07

-

\_3

\_应收股利

-

-

\_4

\_应收利息

\_14,791,198.21

-

\_5

\_应收申购款

-

-

\_6

\_其他应收款

-

-

\_7

\_待摊费用

-

-

\_8

\_其他

-

-  
\_9

\_合计

\_201,858,145.82

-  
\_期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：长盛同益封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：长盛同益封闭本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

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。

投资组合报告(转型后)

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

\_764,662,987.12

\_40.01

-  
\_其中：股票

\_764,662,987.12

\_40.01

-  
\_2

\_固定收益投资

\_60,198,000.00

\_3.15

-  
\_其中：债券

\_60,198,000.00

\_3.15

-  
\_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

\_830,000,000.00

\_43.43

-

-

\_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

\_253,422,255.10

\_13.26

-

-

\_7  
\_其他资产

\_2,819,132.19

\_0.15

-

-

\_8  
\_合计

\_1,911,102,374.41

\_100.00

-

\_期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码

\_行业类别

\_公允价值（元）

\_占基金资产净值比例（%）

-

-

\_A  
\_农、林、牧、渔业

-

-

-

-

\_B  
\_采矿业

-

-

-

\_C

\_制造业

\_656, 272, 377. 64

\_36. 59

-

\_D

\_电力、热力、燃气及水生产和供应业

-

-

-

\_E

\_建筑业

-

-

-

\_F

\_批发和零售业

\_1, 339, 000. 00

\_0. 07

-

\_G

\_交通运输、仓储和邮政业

\_9, 640, 000. 00

\_0. 54

-

\_H

\_住宿和餐饮业

-

-

-

\_I

\_信息传输、软件和信息技术服务业

\_46, 550, 451. 09

\_2. 60

-

\_J

\_金融业

-

-

-

\_K

\_房地产业

\_31, 681, 570. 76

\_1. 77

\_L

\_租赁和商务服务业

\_19,179,587.63

\_1.07

\_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

\_764,662,987.12

\_42.63

\_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(转型后)

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

\_000848

\_承德露露

\_3,200,000

\_63,584,000.00

\_3.54

-  
\_2

\_600690

\_青岛海尔

\_4,100,000

\_60,516,000.00

\_3.37

-  
\_3

\_000748

\_长城信息

\_2,499,902

\_56,672,778.34

\_3.16

-  
\_4

\_601766

\_中国南车

\_11,500,000

\_51,750,000.00

\_2.89

-  
\_5

\_002563

\_森马服饰

\_1,900,000

\_51,585,000.00

\_2.88

-  
\_6

\_600597

\_光明乳业

\_2,999,759

\_48,116,134.36  
\_2.68

-  
\_7  
\_600104  
\_上汽集团  
\_3,000,000  
\_45,900,000.00  
\_2.56

-  
\_8  
\_000625  
\_长安汽车  
\_3,400,044  
\_41,854,541.64  
\_2.33

-  
\_9  
\_600050  
\_中国联通  
\_11,000,000  
\_35,530,000.00  
\_1.98

-  
\_10  
\_600584  
\_长电科技  
\_4,000,000  
\_35,320,000.00  
\_1.97

-  
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://csfunds.com.cn>网站的半年度报告正文。

报告期内股票投资组合的重大变动

累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号

\_股票代码

\_股票名称

\_本期累计买入金额

\_占期末基金资产净值比例（%）

-  
\_1  
\_601766  
\_中国南车  
\_90,287,046.07  
\_5.03

\_2  
\_601992  
\_金隅股份  
\_70, 570, 428. 35  
\_3. 93

\_3  
\_000625  
\_长安汽车  
\_62, 666, 423. 05  
\_3. 49

\_4  
\_600998  
\_九州通  
\_62, 428, 738. 05  
\_3. 48

\_5  
\_000581  
\_威孚高科  
\_49, 762, 821. 37  
\_2. 77

\_6  
\_600597  
\_光明乳业  
\_49, 500, 624. 00  
\_2. 76

\_7  
\_600104  
\_上汽集团  
\_48, 429, 212. 03  
\_2. 70

\_8  
\_600835  
\_上海机电  
\_47, 036, 143. 43  
\_2. 62

\_9  
\_000401  
\_冀东水泥  
\_44, 998, 646. 26

\_2.51  
-  
\_10  
\_601318  
\_中国平安  
\_39,551,318.06  
\_2.20  
-  
\_11  
\_600050  
\_中国联通  
\_35,480,000.00  
\_1.98  
-  
\_12  
\_600369  
\_西南证券  
\_34,317,129.71  
\_1.91  
-  
\_13  
\_000001  
\_平安银行  
\_33,415,973.66  
\_1.86  
-  
\_14  
\_600837  
\_海通证券  
\_31,457,357.64  
\_1.75  
-  
\_15  
\_002368  
\_太极股份  
\_29,906,233.76  
\_1.67  
-  
\_16  
\_002294  
\_信立泰  
\_29,437,995.14  
\_1.64  
-  
\_17  
\_601808  
\_中海油服

\_28,410,548.37  
\_1.58

\_18  
\_600699  
\_均胜电子  
\_27,090,121.72  
\_1.51

\_19  
\_002309  
\_中利科技  
\_26,545,738.67  
\_1.48

\_20  
\_600585  
\_海螺水泥  
\_25,998,422.07  
\_1.45

\_累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细  
金额单位：人民币元

序号

\_股票代码

\_股票名称

\_本期累计卖出金额

\_占期末基金资产净值比例（%）

\_1  
\_601688  
\_华泰证券  
\_94,433,402.82  
\_5.26

\_2  
\_000848  
\_承德露露  
\_86,993,085.13  
\_4.85

\_3  
\_600837  
\_海通证券  
\_82,833,043.12  
\_4.62

\_

\_4  
\_600998  
\_九州通  
\_68,505,514.72  
\_3.82

\_5  
\_601992  
\_金隅股份  
\_65,115,875.53  
\_3.63

\_6  
\_600983  
\_合肥三洋  
\_55,157,544.66  
\_3.07

\_7  
\_600552  
\_方兴科技  
\_54,624,388.09  
\_3.05

\_8  
\_000581  
\_威孚高科  
\_48,715,969.63  
\_2.72

\_9  
\_600480  
\_凌云股份  
\_44,838,465.26  
\_2.50

\_10  
\_000401  
\_冀东水泥  
\_44,329,341.61  
\_2.47

\_11  
\_601299  
\_中国北车  
\_41,516,847.38  
\_2.31

\_12  
\_601318  
\_中国平安  
\_41, 428, 552. 65  
\_2. 31

\_13  
\_000748  
\_长城信息  
\_41, 123, 231. 46  
\_2. 29

\_14  
\_600584  
\_长电科技  
\_35, 546, 393. 91  
\_1. 98

\_15  
\_000001  
\_平安银行  
\_34, 669, 103. 20  
\_1. 93

\_16  
\_601766  
\_中国南车  
\_33, 890, 955. 67  
\_1. 89

\_17  
\_600369  
\_西南证券  
\_32, 223, 194. 30  
\_1. 80

\_18  
\_002368  
\_太极股份  
\_32, 197, 475. 74  
\_1. 79

\_19  
\_600038  
\_哈飞股份  
\_29, 913, 260. 73

\_1.67

\_20

\_600109

\_国金证券

\_29,237,471.51

\_1.63

\_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

\_1,469,018,529.56

\_卖出股票收入（成交）总额

\_1,687,476,303.24

\_注：本项中7.4.1, 7.4.2, 7.4.3表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

\_29,787,000.00

\_1.66

\_

\_其中：政策性金融债

\_29,787,000.00

\_1.66

\_4

\_企业债券

-
-
-
-
-5
_企业短期融资券
-
-
-
-
-6
_中期票据
_30,411,000.00
_1.70
-
-7
_可转债
-
-
-
-8
_其他
-
-
-
-9
_合计
_60,198,000.00
_3.36

\_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  
 \_1182261  
 \_11鲁商MTN1  
 \_300,000  
 \_30,411,000.00  
 \_1.70

-  
 \_2  
 \_120246  
 \_12国开46

\_300,000  
\_29,787,000.00  
\_1.66

注：本基金本报告期末仅持有上述2只债券。  
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细  
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。  
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投资。  
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。  
报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
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。  
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。  
报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
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。  
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。  
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。  
投资组合报告附注

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。

本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。

其他资产构成

单位：人民币元

序号

\_名称

\_金额

\_1

\_存出保证金

\_603,963.99

\_2

\_应收证券清算款

\_

\_3

\_应收股利

\_

\_

\_4  
\_应收利息  
\_2,184,625.69

\_5  
\_应收申购款  
\_295.57

\_6  
\_其他应收款

\_7  
\_待摊费用  
\_30,246.94

\_8  
\_其他

\_9  
\_合计  
\_2,819,132.19

\_期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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未存在流通受限的情况。

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。

基金份额持有人信息(转型前)

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

\_ 18,401  
\_ 108,689.75  
\_ 1,456,857,962.00  
\_ 72.84%  
\_ 543,142,038.00  
\_ 27.16%

\_ 期末上市基金前十名持有人

序号

\_ 持有人名称

\_ 持有份额（份）

\_ 占上市总份额比例

\_ 1  
\_ 中国人寿保险（集团）公司  
\_ 205,568,142.00  
\_ 10.28%

\_ 2  
\_ 中国人寿保险股份有限公司  
\_ 196,455,870.00  
\_ 9.82%

\_ 3  
\_ 泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红-019L-FH002深  
\_ 133,849,819.00  
\_ 6.69%

\_ 4  
\_ 伦敦市投资管理有限公司—客户资金  
\_ 81,666,860.00  
\_ 4.08%

\_ 5  
\_ 阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品  
\_ 75,164,271.00  
\_ 3.76%

\_ 6  
\_ 幸福人寿保险股份有限公司—分红  
\_ 63,049,438.00  
\_ 3.15%

\_ 7  
\_ 中国平安人寿保险股份有限公司—分红—银保分红

\_46,000,000.00

\_2.30%

\_8

\_中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红

\_42,669,693.00

\_2.13%

\_9

\_幸福人寿保险股份有限公司—万能

\_41,912,356.00

\_2.10%

\_10

\_阳光财产保险股份有限公司—自有资金

\_37,775,107.00

\_1.89%

\_注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。  
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

\_

\_基金份额持有人信息(转型后)

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

\_18,635  
\_95,928.16  
\_1,346,790,813.18  
\_75.34%  
\_440,830,527.25  
\_24.66%

\_ 期末上市基金前十名持有人

序号

\_持有人名称

\_持有份额（份）

\_占上市总份额比例

\_1

\_伦敦市投资管理有限公司—客户资金

\_76,914,839.00

\_10.73%

\_2

\_中国平安人寿保险股份有限公司—分红—银保分红

\_46,037,783.00

\_6.42%

\_3

\_宝钢集团有限公司

\_35,003,177.00

\_4.88%

\_4

\_中国财产再保险股份有限公司

\_34,720,703.00

\_4.84%

\_5

\_幸福人寿保险股份有限公司—自有资金

\_33,693,831.00

\_4.70%

\_6

\_中信证券—华夏银行—中信证券贵宾定制2号集合资产管理计划

\_24,698,467.00

\_3.45%

\_7

\_中国平安保险（集团）股份有限公司

\_12,975,259.00

\_1.81%

\_8

\_中银国际—中行—中银国际证券中国红基金宝集合资产管理计划

\_9,549,614.00

\_1.33%

\_9

\_中国农业银行股份有限公司企业年金计划—中国银行股份有限公司

\_8,664,837.00

\_1.21%

\_10

\_吴乐辉

\_8,506,982.00

\_1.19%

\_注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。  
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

\_988.48

\_0.00%

\_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

\_开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年4月4日）基金份额总额

\_2,000,000,000.00

\_报告期期初基金份额总额

\_

\_基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额

\_686,754,621.79

—  
\_减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额  
\_900,776,023.36

—  
\_基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  
\_1,642,742.00

—  
\_报告期期末基金份额总额  
\_1,787,621,340.43

—  
\_注:基金管理人以2014年5月14日作为基金份额折算基准日,对折算基准日登记在册的由原基金同益转型所得的本基金基金份额进行折算与变更登记。

#### 重大事件揭示

##### 基金份额持有人大会决议

2014年1月30日至2014年2月26日,同益证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会,大会表决通过了《关于修改同益证券投资基金基金合同有关事项的议案》,同意同益证券投资基金变更基金名称、基金类别、投资目标、范围、理念和策略,允许基金管理人按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对基金合同进行修订。基金管理人已就上述基金份额持有人大会决议事项报中国证监会备案,并于2014年3月19日收到中国证监会基金监管部《关于同益证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]150号)。自完成备案手续之日(即2014年3月19日)起,该持有人大会决议生效,即《同益证券投资基金基金合同》失效且《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。同益证券投资基金的基金类别变更为混合型,其投资目标、理念、范围和策略调整,同时更名为“长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)”。

#### —基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

##### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

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

##### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

##### 10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内,因中国工商银行股份有限公司(以下简称“本行”)工作需要,周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前,由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

#### —涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### —基金投资策略的改变

根据同益证券投资基金基金份额持有人大会决议,自2014年3月19日起,《同益证券投资基金基金合同》失效且《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,同益证券投资基金的投资策略相应调整。

调整后的投资策略要点为:“战略资产配置上,主要考虑宏观经济指标、微观经济指标、市场指

标及政策因素动态调整基金资产在股票、股指期货、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例。股票投资方面，本基金采用“自下而上”的主动选股能力，从上市公司基本状况和股票估值两个方面进行优选，挖掘具有快速成长预期、且估值相对较低的个股进行投资；另外，通过对股票投资机会的精细操作，结合上市公司基本状况以及股票估值分析的结论，审慎选择投资时机，力争获取正回报。债券投资方面，通过对未来市场利率趋势及市场信用环境变化作出预测，并综合考虑利率变化、信用风险、流动性等因素对不同债券品种，构造债券投资组合；并运用久期控制策略、收益率曲线策略、类属选择策略、个券选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。股指期货方面，本基金将本着谨慎原则，利用股指期货流动性好、交易成本低等特点进行投资组合仓位的快速调整。”

调整后的投资策略详见2014年3月20日发布在基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上的《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》。

—  
\_为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

—  
\_管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级人员无受稽查或处罚等情况。

—  
\_基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称

\_交易单元数量

\_股票交易

\_应支付该券商的佣金

\_备注

—

—

—  
\_成交金额

\_占当期股票

成交总额的比例

\_佣金

\_占当期佣金

总量的比例

—

—  
\_国元证券

\_2

\_328,095,680.03

\_10.39%

\_298,698.85

\_10.39%

—

—

\_信达证券

\_1

\_1,032,224,960.91

\_32.70%

\_939,732.66

\_32.70%

\_-

\_-

\_银河证券

\_1

\_958,310,114.12

\_30.36%

\_872,447.63

\_30.36%

\_-

\_-

\_招商证券

\_2

\_837,852,797.26

\_26.54%

\_762,771.88

\_26.54%

\_-

\_-

\_华安证券

\_1

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_ 方正证券

\_ 1

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ 长城证券

\_ 2

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ 红塔证券

\_ 1

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ 申银万国

\_ 2

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ 中信证券

\_ 2

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

\_ 齐鲁证券

\_ 1

\_ -

\_ -

\_ -

\_ -

--

\_国信证券

\_2

--

--

--

--

--

--

\_中信建投

\_1

--

--

--

--

--

--

\_华福证券

\_1

--

--

--

--

--

--

\_南方证券

\_2

--

--

--

--

--

--

\_东方证券

\_1

--

--

--

--

--

--

\_基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称

\_债券交易

\_债券回购交易

\_权证交易

-

-

\_成交金额

\_占当期债券

成交总额的比例

\_成交金额

\_占当期债券回购

成交总额的比例

\_成交金额

\_占当期权证

成交总额的比例

-

\_国元证券

\_0.00

-

\_630,000,000.00

\_7.72%

-

-

-

\_信达证券

\_31,899,332.30

\_43.32%

\_7,528,500,000.00

\_92.28%

-

-

-

\_银河证券

\_0.00

-

-

-

-

-

-

\_招商证券

\_41,730,836.10

\_56.68%

-

-

-

-

-

\_华安证券

-

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

--  
\_平安证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

--  
\_浙商证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

--  
\_方正证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

--  
\_长城证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

--  
\_红塔证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

--  
\_申银万国

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

\_中信证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

\_齐鲁证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

\_国信证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

\_中信建投

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

\_华福证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

\_南方证券

—  
—  
—  
—  
—  
—  
—  
—  
—  
—  
—

\_东方证券

—  
—  
—  
—  
—  
—  
—  
—  
—  
—  
—

\_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，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

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

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

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

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

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

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

-

-

\_方正证券

\_1

\_804,317,698.68

\_25.41%

\_732,252.35

\_25.41%

-

-

\_齐鲁证券

\_1

\_773,100,773.75

\_24.42%

\_703,830.12

\_24.42%

-

-

\_银河证券

\_1

\_485,565,358.27

\_15.34%

\_442,059.69

\_15.34%

-

-

\_招商证券

\_2

\_464,839,231.49

\_14.68%

\_423,185.38

\_14.68%

-

-

\_信达证券

\_1

\_423, 185, 501. 25

\_13. 37%

\_385, 265. 91

\_13. 37%

-

\_申银万国

\_2

\_214, 721, 297. 96

\_6. 78%

\_195, 480. 46

\_6. 78%

-

\_国元证券

\_2

-

-

-

-

-

-

\_华安证券

\_1

-

-

-

-

-

-

\_平安证券

\_2

-

-

-

-

-

-

\_浙商证券

\_1

-

-

-

-

-

-

\_长城证券

\_2

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_红塔证券

\_1

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_大鹏证券

\_2

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_中信证券

\_2

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_国信证券

\_2

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_中信建投

\_1

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_-

\_华福证券

\_1

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

\_南方证券

\_1

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

\_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

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

\_方正证券

-

-

-

-

-

-

-

-

-

-

\_80,000,000.00

\_4.32%

--

--

--

\_齐鲁证券

\_103,250,899.10

\_51.27%

\_220,000,000.00

\_11.89%

--

--

--

\_银河证券

--

--

--

--

--

--

--

\_招商证券

\_9,925,000.00

\_4.93%

\_800,000,000.00

\_43.24%

--

--

--

\_信达证券

\_30,012,794.70

\_14.90%

\_750,000,000.00

\_40.54%

--

--

--

\_申银万国

\_58,178,760.70

\_28.89%

--

--

--

--

--

\_国元证券

--

--

--

--  
--  
--  
--

\_ 华安证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

\_ 平安证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

\_ 浙商证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

\_ 长城证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

\_ 红塔证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

\_ 大鹏证券

--  
--

--  
--  
--  
--  
--

--  
\_ 中信证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

--  
\_ 国信证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

--  
\_ 中信建投

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

--  
\_ 华福证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

--  
\_ 南方证券

--  
--  
--  
--  
--  
--  
--  
--

--  
\_ 东方证券

--  
--

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，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

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

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

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

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

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

长盛基金管理有限公司

2014年8月28日