长盛成长价值证券投资基金

2013 年度报告摘要

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2014年3月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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

本报告期自2013年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛成长价值混合
基金主代码	080001
交易代码	080001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年9月18日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	787,880,691.78份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为平衡型基金,通过管理人的积极管理,在控制风险的前提下挖掘价值、分享成长,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略为主动性投资,在战略性资产、战术性资产、股票和债券选择三个层面进行积极配置,力争获得超过投资基准的业绩回报。在资产配置方面,股票资产比例为35%~75%,债券资产比例为20%~60%,现金资产比例不低于5%。
业绩比较基准	中信标普A股综合指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属平衡型基金,在承担适度风险的前提下,获得长期稳定的收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	李芳菲
	联系电话	010-82019988	010-66060069
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	95599
传真		010-82255988	010-63201816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	61,394,050.51	-89,008,437.38	74,945,254.82
本期利润	104,911,655.02	7,109,332.18	-227,390,391.56
加权平均基金份额本期利润	0.1215	0.0071	-0.2145
本期基金份额净值增长率	14.88%	1.01%	-22.11%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0814	-0.1997	-0.2077
期末基金资产净值	723,760,542.78	749,627,595.07	812,284,102.91
期末基金份额净值	0.919	0.800	0.792

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	-0.43%	0.98%	-1.79%	0.94%	1.36%	0.04%
过去六个月	11.94%	1.06%	9.44%	1.00%	2.50%	0.06%
过去一年	14.88%	1.04%	2.75%	1.07%	12.13%	-0.03%
过去三年	-9.62%	0.91%	-15.90%	1.07%	6.28%	-0.16%
过去五年	59.09%	1.05%	48.88%	1.24%	10.21%	-0.19%
自基金合同生效起至今	290.90%	1.21%	77.61%	1.43%	213.29%	-0.22%

注:本基金业绩比较基准=中信标普A股综合指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%

基准指数的构建考虑了三个原则:

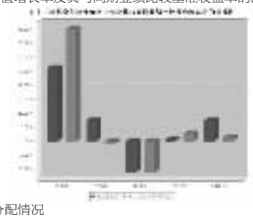
1、公允性。选择市场认同度比较高的中信标普A股综合指数和中信标普国债指数作为计算的基础指数。中信标普A股综合指数作为按流通股本加权的综合指数,其指数选股样本覆盖了上交所和深交所上市的所有A股,具有较强的指代作用。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响,本基金持有的股票资产比例为35%-75%,债券资产比例为20%-60%,现金资产比例不低于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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013	-	-	-	-	注:2013年度未分配收益
2012	-	-	-	-	注:2012年度未分配收益
2011	1.000	74,665,086.03	31,370,321.24	106,035,407.27	注:除息日:2011年1月10日
合计	1.000	74,665,086.03	31,370,321.24	106,035,407.27	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司(以下简称“公司”),成立于1999年3月26日,是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币15000万元。公司注册地在深圳,总部设在北京,并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司,在香港、北京分别设有子公司。目前,公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司(以下简称“国元证券”)占注册资本的41%,新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%,安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%,安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至2013年12月31日,基金管理人共管理两只封闭式基金、三十一只开放式基金,并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外QFII基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
翟彦垒	本基金基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。	2013年7月9日	-	4年	男,1982年3月出生,中国国籍。中国人民银行研究生部经济学硕士,2009年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任行业研究员,基金经理助理等职务。现任长盛成长价值证券投资基金(本基金)基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。
刘斌	本基金基金经理(已离任),长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理,金融工程与量化投资部总监。	2012年7月20日	2013年11月4日	7年	男,1979年6月出生,中国国籍,清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司,在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理、长盛沪深300指数证券投资基金基金经理、金融工程与量化投资部总监。长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理等职务。曾任本基金基金经理,目前已离任。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度及控制方法

依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,为保证公司管理的所有投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,公司重新修订了《公司公平交易细则》。报告期内,公司根据该细则实际执行情况,对其进行了完善。该细则从研究、投资授权、投资决策、交易执行、投资组合信息隔离、行为监控评估与分析、报告与信息披露等环节对公平交易的管理提出明确要求。

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。投资组合经理在投资决策委员会授权范围内自主进行投资决策,超越授权范围的投资行为,需依照公司相关制度规定履行审批程序。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,对交易所公开竞价交易,公司开启恒生交易系统中的公平交易程序,对符合公平交易条件的投资指令强制执行公平交易,具体如下:

一、限价指令的执行原则:对于不同限价的同向指令,按照“价格优先、时间优先、同时均分”的原则执行;对于相同限价的同向交易指令,强制执行恒生交易系统中的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托比例,按比例具体执行。

二、市价指令的执行原则:对于市价同向交易指令,按照“时间优先”的原则执行交易指令,后到达指令后按照先到指令剩余数量和新到指令数量采用公平委托系统执行;对于同时同向交易指令,强制执行恒生交易系统中的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托比例,按比例具体执行。

三、部分限价指令与部分市价指令的执行原则:对于不同投资经理下达的不同类型的同向交易指令,按照“价格优先”的原则执行交易指令,在未满足限价执行条件时,先执行市价指令,后执行限价指令。

对债券一级市场申购、非公开发行股票等以公司名义进行的交易,公司依照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

对于银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价的交易,则按照“时间优先、价格优先、同时申报时要求价格差异趋于零且申购量等比分配”的原则进行。

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。风险管理部每日通过系统监控不同组合的反向交易等,监控分析发现异常情况时,要求相关人员作出合理性解释备查,每月度出具上月度公平交易监控分析报告,每季度和每年度分别出具公平交易专项分析报告;公司通过系统记录场内异常交易情况,监察稽核部定期对其进行分析评估,每月度出具异常交易总结报告;针对场外交易,监察稽核部每月度对公司旗下所有投资组合场外交易进行专项检查,检查范围包括但不限于:银行间市场、交易所大宗交易等,每月度出具检查报告;监察稽核部对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案、分配过程进行监督,确保分配结果符合公平交易原则。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》各项规定,保证公平对待旗下的每一个投资组合。各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;交易环节中,严格执行集中交易制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;事后监控分析环节中,公司定期对投资组合公平交易情况和异常交易情况进行分析,并出具公平交易执行情况分析报告;同时,公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查,并对发现的问题进行及时报告。

报告期内,公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》中的规定对公司所有投资组合同向交易价差进行分析,取最近4个季度交易记录,分别以1、3、5日为时间片段分析不同基金间以及公募基金、社保组合、专户组合等大类资产间的同向交易情况。对于同向交易次数足够进行T检验的情况,以95%置信水平对其进行假设检验排查;对于同向交易次数较少的情况考察交易价差对基金净值带来的累计贡献。分析结果显示本投资组合与公司其它组合间同向交易价差未见异常。

本报告期内,公司严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现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5%的交易。

本报告期内,本基金未发生异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

海外市场,2014年美国经济处于复苏趋势中,全年道琼斯指数涨28.12%,纳斯达克涨41.09%;欧洲逐步走出衰退,尤其德国经济显出复苏迹象,德国法兰克福DAX指数全年涨25.48%,伦敦富时100指数涨13.90%。流动性上美国OE退出预期加强,以有色金属为代表的大宗商品出现普跌走势。

国内全年经济增速降合阶,特征为经济和货币调结构,热点是以传媒和信息服务为代表的创业板,风险为流动性上经历了两次钱荒。十八届三中全会和中央工作会议后,改革成为决定未来经济走势的关键。A股全年先涨后跌,全年上证综指下跌5.25%,代表经济结构调整方向的创业板上涨84.33%。

在全年投资运作中,成长股和价值股的配置较为均衡,在下半年我们适当提高了成长股的投资比重和个股集中度。

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0.919元,本报告期份额净值增长率为14.88%,同期业绩比较基准增长率为2.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年,我们判断国内经济稳重求进,仍以缓慢复苏为主,改革会成为全年的主题;通胀水平预计前高后低。流动性上,虽然美国缩减OE规模,但海外低利率趋势不改,国内流动性仍会“用好增量、盘活存量”,2014年流动性会继续调结构。政策上需要关注三中全会等改革政策的落地情况。在我国实体经济和流动性继续调结构的影响下,A股预计仍会以结构性行情为主。

未来一个季度,成长股和周期股的估值差异仍是投资的出发点,收益机会主要来自行业个股的估值切换机会。1季度,我们会继续平衡价值与成长的配置比例,在对新材料、新装备、新能源、新科技等新兴产业保持合理仓位,在其中选择符合经济转型方向、业绩确定性高、能够顺利估值切换的品种。传统行业会以医药、食品、汽车等消费行业为主,并关注低估值的周期性板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定,本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值小组,参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据,确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理(担任估值小组组长)、公司副总经理和督察长(担任估值小组副组长)、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组,负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验,具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

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

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第二十条中对基金利润分配原则的约定,本基金2013年度未实施利润分配。

本基金截至2013年12月31日,期末可供分配收益为-64,120,149.00元,其中:未分配收益已实现部分为155,943,454.02元,未分配收益未实现部分为-220,063,603.02元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管长盛成长价值证券投资基金的过程中,本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《长盛成长价值证券投资基金基金合同》、《长盛成长价值证券投资基金托管协议》的约定,对长盛成长价值证券投资基金管理人—长盛基金管理有限公司2013年1月1日至2013年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,长盛基金管理有限公司在长盛成长价值证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支情况等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的长盛成长价值证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师汪棣、沈兆杰于2014年3月21日对本基金2013年12月31日的资产负债表、2013年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2014)第20649号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:长盛成长价值证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	43,998,814.41	65,885,367.86
结算备付金	285,664.35	102,625.02
存出保证金	150,293.03	1,000,000.00
交易性金融资产	660,243,645.73	704,008,475.92
其中:股票投资	481,535,645.73	533,813,475.92
基金投资	-	-
债券投资	178,708,000.00	170,195,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	21,610,734.82	4,801,274.73
应收利息	3,252,748.90	2,628,031.22
应收股利	-	-
应收申购款	35,532.11	53,439.41
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	729,577,433.35	778,479,214.16
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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	-	26,082,458.95
应付赎回款	3,619,143.89	581,168.33
应付管理人报酬	920,151.25	915,262.61
应付托管费	153,358.56	152,543.78
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	213,453.80	255,100.73
应交税费	2,600.00	2,600.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	908,183.07	862,484.69
负债合计	5,816,890.57	28,851,619.09
所有者权益:		
实收基金	787,880,691.78	936,712,379.47
未分配利润	-64,120,149.00	-187,084,784.40
所有者权益合计	723,760,542.78	749,627,595.07
负债和所有者权益总计	729,577,433.35	778,479,214.16

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值0.919元,基金份额总额787,880,691.78份。

7.2 利润表

会计主体:长盛成长价值证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	122,504,457.95	25,289,397.13
1.利息收入	7,711,080.63	9,367,532.70
其中:存款利息收入	1,592,312.96	1,741,757.66
债券利息收入	6,063,225.77	7,379,455.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	55,541.90	246,319.33
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	71,062,189.59	-80,357,083.85
其中:股票投资收益	67,017,253.58	-89,036,741.66
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,615,840.66	-538,407.57
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	6,660,776.67	9,218,065.38
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	43,517,604.51	96,117,769.56
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	213,583.22	161,178.72
减:二、费用	17,592,802.93	18,180,064.95
1.管理人报酬	11,268,439.77	11,945,060.82
2.托管费	1,878,073.35	1,990,843.48
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	4,082,149.49	3,860,481.75
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	364,140.32	383,678.90
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	104,911,655.02	7,109,332.18
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	104,911,655.02	7,109,332.18

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛成长价值证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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)	936,712,379.47	-187,084,784.40	749,627,595.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	104,911,655.02	104,911,655.02
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)	-148,831,687.69	18,052,980.38	-130,778,707.31
其中:1.基金申购款	46,172,850.69	-6,121,727.77	40,051,122.92
2.基金赎回款	-195,004,538.38	24,174,708.15	-170,829,830.23
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)	787,880,691.78	-64,120,149.00	723,760,542.78

项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	1,025,210,970.19	-212,926,867.28	812,284,102.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,109,332.18	7,109,332.18
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)	-88,498,590.72	18,732,750.70	-69,765,840.02
其中:1.基金申购款	74,450,855.90	-15,308,819.91	59,142,035.99
2.基金赎回款	-162,949,446.62	34,041,570.61	-128,907,876.01
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)	936,712,379.47	-187,084,784.40	749,627,595.07

注:报表附注为财务报表的组成部分。

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:

周矣 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

长盛成长价值证券投资基金(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”)证监基金字?2002?第57号《关于同意长盛成长价值证券投资基金设立的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《长盛成长价值证券投资基金基金契约》(后更名为《长盛成长价值证券投资基金基金合同》)发起,并于2002年9月18日募集成立。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3,166,886,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第95号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛成长价值证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票资产比例为35%-75%,债券资产比例为20%-60%,现金资产比例不低于5%。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%,投资于权证的比例不得超过基金资产净值的3%。股票投资在成长和价值类资产中根据市值大小在大盘成长、中盘成长、小盘成长、大盘价值、中盘价值和小盘价值六类资产间进行二次配置,具体配置比例限制如下表所示:

投资下限 投资上限投资下限投资上限

大盘成长 5%40%大盘价值 5%40%

中盘成长 5%50%中盘价值 5%50%

小盘成长 5%40%小盘价值 5%40%

成长类合计 30%70%价值类合计30%70%

本基金的业绩比较基准为:中信标普A股综合指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%。

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2014年3月21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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号-年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、长盛成长价值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2013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2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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需说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31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	7,146,669.05	0.27%	644,548,529.52	25.43%

债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国元证券	-	-	26,212,113.40	39.18%

7.4.8.1.2 权证交易

注:本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	6,506.42	0.28%	6,506.42	3.05%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	562,151.36	25.96%	-	-

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和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,268,439.77	11,945,060.82
其中:支付销售机构的客户维护费	1,745,268.37	1,781,887.20

注:支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%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:

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,878,073.35	1,990,843.48

注:支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值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:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013年12月31日					
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	101,194,174.65	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.