# 长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

## 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1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 长盛环球行业股票(QDII) |
| 基金主代码 | 080006 |
| 交易代码 | 080006 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年5月26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 | 48,716,536.12份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金主要投资于全球证券市场,把握全球经济趋势,精选景气投资行业,并在此基础上投资于其中的优势公司,实现充分分享全球经济增长收益的目标;同时在投资国家或地区配置上,有效实现全球分散化投资,力争充分分散风险,追求基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法,运用Black-Litterman资产配置模型实现行业层面的风险最优配置,在行业内部,运用全球量化选股模型精选个股,投资管理人将两套进行有机结合,构建最优化的投资组合。 |
| 业绩比较基准 | 摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index) |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金,风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金。同时,本基金为全球股票型证券投资基金,除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。此外,由于投资国家与地区市场的分散,风险低于投资单一市场的股票型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 长盛基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 叶金松 | 唐州徽 |
| | 联系电话 | 010-82019988 | 95566 |
| | 电子邮箱 | yejs@csfunds.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-2666,010-62350088 | 95566 |
| 传真 | | 010-82255988 | 010-66594942 |

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目 | | 境外投资顾问 | 境外资产托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | 英文 | GOLDMAN SACHS ASSET MANAGEMENT,L.P. | BANK OF CHINA (HONG KONG LIMITED) |
| | 中文 | 高盛资产管理有限责任合伙 | 中国银行(香港)有限公司 |
| 注册地址 | | 200 West Street, New York, NY 10282-2198 | 香港花园道1号中银大厦 |
| 办公地址 | | 香港皇后大道中2号长江集团中心68楼 | 香港花园道1号中银大厦 |
| 邮政编码 | | - | - |

2.5 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住所 |

§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 | 607,126.73 | -2,757,360.06 | -5,494,859.86 |
| 本期利润 | 8,337,581.92 | 4,673,780.31 | -12,998,244.05 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1584 | 0.0781 | -0.2035 |
| 本期基金份额净值增长率 | 17.93% | 9.17% | -21.39% |
| 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 | -0.1116 | -0.1227 | -0.1930 |
| 期末基金资产净值 | 50,628,732.49 | 50,562,837.75 | 54,865,177.32 |
| 期末基金份额净值 | 1.039 | 0.881 | 0.807 |

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。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 | 8.23% | 0.49% | 7.99% | 0.58% | 0.24% | -0.09% |
| 过去六个月 | 13.93% | 0.51% | 15.92% | 0.56% | -1.99% | -0.05% |
| 过去一年 | 17.93% | 0.57% | 23.74% | 0.66% | -5.81% | -0.09% |
| 过去三年 | 1.20% | 0.72% | 29.66% | 1.02% | -28.46% | -0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.90% | 0.69% | 56.81% | 1.03% | -47.91% | -0.34% |

注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

业绩比较基准=摩根斯坦利世界大盘股可投资指数(MSCI World Large Cap IMI Index)x 100%(以下简称MSCI世界指数)。

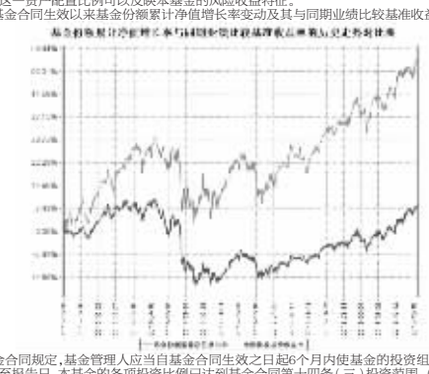
本基金为股票型基金,主要投资范围为全球主要发达地区股票市场大盘类股票,在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后选取上述指数。

摩根斯坦利世界大盘股可投资指数是按照自由流通市值调整方法编制的跟踪全球成熟市场的全球性投资指数,是MSCI标准化指数之一,适合作为全球市场投资业绩比较基准的指数。全球超过80%的基金经理人,是以MSCIBARRA编制的指数作为投资绩效评估的标准。在全球范围内,MSCI世界指数已经成为全球市场投资工具的基准标尺之一,并且由MSCIBARRA每日在市场发布。截至2010年12月,摩根斯坦利世界大盘股可投资指数涵盖23个国家和地区的超过730只股票,代表了全球国家大约75%的总市值,与本基金主要投资方向比较吻合。

MSCI世界指数样本覆盖了与证监会已经签立合作谅解备忘录的主要国家,并为许多国际著名股票投资基金选用为投资比较基准,具有良好的市场代表性。比较起来,该指数具有较好的权威性、市场代表性,用为衡量本基金业绩的基准比较合适。

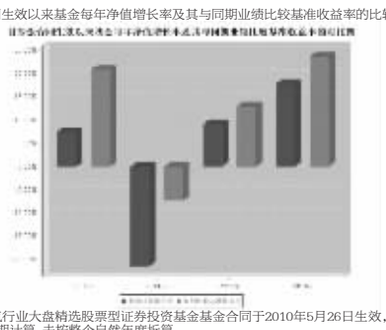
本基金的股票资产占基金资产的60%-95%。在正常的市场情况下,基金的平均股票仓位约为85%,所以,业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

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



注:按基金合同规定,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约定。截至报告日,本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(三)投资范围、(九)投资限制的有关约定。

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



注:长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同于2010年5月26日生效,合同生效当年净值增长率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年 | - | - | - | - | 注:2013年度未分配收益 |
| 2012年 | - | - | - | - | 注:2012年度未分配收益 |
| 2011年 | 0.5000 | 3,423,031.64 | 261,335.34 | 3,684,366.98 | 注:2011年1月12日收益分配 |
| 合计 | 0.5000 | 3,423,031.64 | 261,335.34 | 3,684,366.98 | |

§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 | | |
| 吴达 | 本基金基金经理、国际业务部总监,兼任长盛基金(香港)有限公司副总经理。 | 2010年5月26日 | - | 11年 | 男,1979年8月出生,中国国籍。伦敦政治经济学院金融经济学硕士,CFA(特许金融分析师)。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理、专户投资组合经理;新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员;华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理;2007年8月起加入长盛基金管理有限公司,曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。现任国际业务部总监,长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金(本基金)基金经理,兼任长盛基金(香港)有限公司副总经理。 |

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

| 姓名 | 在境外投资顾问所任职位 | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|
| Len Ioffe | 高盛全球量化股票团队的高级投资组合经理,全球量化股票投资政策委员会成员。 | 20年 | 俄罗斯圣彼得堡理工大学颁发的计算机科学硕士,纽约大学斯特恩商学院工商管理硕士,曾供职于史密斯、巴尼、希尔森公司。1994年加入高盛资产管理,曾负责美国国内及国际投资组合的建立及风险分析,并实施不同的交易策略。 |

注:根据本基金管理人2013年12月31日发布的公告,根据长盛基金管理有限公司管理长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金(QDII)的实际情况,经与高盛资产管理有限责任合伙(GOLDMAN SACHS ASSET MANAGEMENT,L.P.)协商一致,双方决定自2014年1月1日起解除投资顾问协议,自该日起高盛资产管理有限责任合伙(GOLDMAN SACHS ASSET MANAGEMENT,L.P.)不再担任本基金的投资顾问。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度和控制方法

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断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情况,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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年上半年美国零售数据环比继续改善,房地产市场进一步复苏,自2012年以来的企业补库存动作得以持续。美联储的会议纪要显示虽然美行官员对经济的复苏仍然不尽满意,但也承认继续大规模执行量化宽松的风险,逐步退出当前极度宽松的政策开始进入议事日程。二季度美国失业率水平下滑到7.6%的水平,美联储认为经济整体好转,特别是房地产价格提振,促进了消费者信心与家庭开支的改善,抵消了部分财政政策缩减带来的拖累。联储官员在二季度高调讨论了量化宽松政策的退出路径,提升了市场对美国经济的信心。

截至2013年上半年,全球市场的货币调整后回报中表现比较好的是日本和美国的股票市场,对于财政悬崖谈判的担忧并没有引发市场的大幅度调整。日本方面在一季度推出超级量化宽松,目标扩大基础货币供应一倍来刺激经济,日元随即大幅贬值,增强了日本制造业出口的国际竞争力。

2013年三季度,全球市场的投资交易主线围绕美联储货币政策会议及全球制造业季节性复苏展开,由于美联储没有对量化宽松做出改变,新兴市场包括金砖四国指数有所反弹,表现最好的是日本和亚太市场。美元汇率没有形成向上的趋势,在期间内回落到这几年的均值水平,缓解了资金回流美国的市场压力。反应在行业板块方面,年初以来表现最差的原材料和采矿业强劲反弹。

四季度美国经济指标继续改善,美联储宣布将从2014年1月份开始QE减量,并且只要就业形势继续改善、通胀不进一步下行,美联储将"可能在未来的会议上推出进一步的减量步骤"。但由于照顾到经济和劳动力市场的改善的可持续性,调整资产购买速度的步伐比较小,仅缩减一百亿,强调近期由于市场预期推动的按揭抵押利率上升对房地产市场的复苏有负面影响。

除美国外,欧洲经济继续保持见底回升缓慢复苏的态势,CPI增速小幅回升、PMI连续6个月扩张、制造业和服务业PMI指数双双突破50,回到扩张的景气水位上。国际资本开始对欧洲看好,逐渐开始回流欧洲市场。德国仍是欧元区经济增长的主要动力,反映了欧元区增长分化的情况仍将持续。然而,与发达地区相比,新兴市场国家普遍继续面临资金流出的压力。

由于财政政策的制约和货币政策的相对收缩,中国国内经济在年初经历了短暂的季节性反弹后重新进入缓慢下滑轨道,香港市场主板由于权重行业的拖累全年走低,中小市值的网络信息类、医药类股票全年表现大幅超越市场,进入2014年后这种分化行情有可能持续。

除德国和日本市场没有配置外,本基金全年维持对美国的重点配置,方向选择上偏重业绩表现良好的医疗保健、可选消费和科技信息板块,对于香港市场采取完全自下而上选股的方式,规避了市场的整体风险的同时取得了较好的回报。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.039元,本报告期份额净值增长率为17.93%,同期业绩比较基准增长率为23.74%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入2014年,发达国家经济体仍然将引领全球经济的进一步复苏,其中美国经济可能逐步显示出彻底摆脱量化宽松的实力,进入美联储是否应该加息的话题讨论时间。在美国逐渐缩减量化宽松的背景下,欧洲央行将基本维持宽松的货币政策,等待已经初露见底回升迹象的经济进一步复苏。最有可能加大货币宽松力度是日本央行,主要因为今年2季度消费税上调对日本经济的冲击可能超预期,通货膨胀下滑也会对经济增长带来负面冲击。

虽然2013年发达国家的股市估值水平有显著提升,但并未超过合理范围。从经济复苏的角度看资产回报率的提升,股票市场在今年的表现有望继续超越债市,发达地区市场仍然会优于正在努力通过改革提升劳动生产率的新兴市场国家。行业方面,能够在最大程度享受消费经济复苏的高科技电子信息产业、医疗保健行业、零售可选消费行业可能继续领先市场表现。主要应当防范的风险点在于美国利率上升对消费的负面影响、流动性环节的紧缩超预期、中国的金融杠杆风险释放等方面。

本基金2014年将继续把控制下行波动风险作为首要条件,主要配置经济复苏态势很好的美国市场,同时对估值有相对优势的欧洲和香港市场进行选择性配置,执行稳健增值的投资策略。

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,本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2013年12月31日期末可供分配收益为-5,437,074.40元,其中:未分配收益已实现部分为-5,437,074.40元,未分配收益未实现部分为7,349,270.77。

§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")在对长盛环球景气行业大盘精选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

普华永道中天会计师事务所有限公司注册会计师汪棣、沈兆杰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、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注出具了普华永道中天审字(2014)第20627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:长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

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 | 6,442,348.61 | 14,165,384.44 |
| 结算备付金 | - | - |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 42,378,897.58 | 35,667,205.60 |
| 其中:股票投资 | 42,378,897.58 | 35,667,205.60 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | - |
| 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 | 2,387,591.58 | 1,323,080.34 |
| 应收利息 | 309.72 | 359.78 |
| 应收股利 | 34,416.88 | 7,621.17 |
| 应收申购款 | 25,486.01 | 534,004.38 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 51,269,050.38 | 51,697,655.71 |
| 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 | - | 672,780.08 |
| 应付赎回款 | 231,833.13 | 52,898.45 |
| 应付管理人报酬 | 75,809.48 | 76,289.30 |
| 应付托管费 | 12,634.92 | 12,714.87 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | - | - |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 320,040.36 | 320,135.26 |
| 负债合计 | 640,317.89 | 1,134,817.96 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 48,716,536.12 | 57,417,671.25 |
| 未分配利润 | 1,912,196.37 | -6,854,833.50 |
| 所有者权益合计 | 50,628,732.49 | 50,562,837.75 |
| 负债和所有者权益总计 | 51,269,050.38 | 51,697,655.71 |

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.039元,基金份额总额48,716,536.12份。

7.2 利润表

会计主体:长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

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 | 9,796,196.40 | 6,215,730.10 |
| 1.利息收入 | 11,283.82 | 23,253.00 |
| 其中:存款利息收入 | 11,283.82 | 23,253.00 |
| 债券利息收入 | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | - |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 2,405,823.97 | -1,161,054.45 |
| 其中:股票投资收益 | 2,178,958.17 | -1,150,178.22 |
| 基金投资收益 | -290,335.84 | -622,776.10 |
| 债券投资收益 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 517,201.64 | 611,899.87 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 7,730,455.19 | 7,431,140.37 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | -378,810.64 | -100,564.35 |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 27,444.06 | 22,955.53 |
| 减:二、费用 | 1,458,614.48 | 1,541,949.79 |
| 1.管理人报酬 | 893,973.98 | 924,636.35 |
| 2.托管费 | 148,995.66 | 154,106.12 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 91,985.46 | 148,435.61 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 323,659.38 | 314,771.71 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 8,337,581.92 | 4,673,780.31 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 8,337,581.92 | 4,673,780.31 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

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) | 57,417,671.25 | -6,854,833.50 | 50,562,837.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 8,337,581.92 | 8,337,581.92 |
| 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) | -8,701,135.13 | 429,447.95 | -8,271,687.18 |
| 其中:1.基金申购款 | 22,847,714.55 | -843,999.58 | 22,003,714.97 |
| 2.基金赎回款 | -31,548,849.68 | 1,273,447.53 | -30,275,402.15 |
| 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) | 48,716,536.12 | 1,912,196.37 | 50,628,732.49 |
| | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日 | | |
| 项目 | 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) | 67,990,591.98 | -13,125,414.66 | 54,865,177.32 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | - | 4,673,780.31 | 4,673,780.31 |
| 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) | -10,572,920.73 | 1,596,800.85 | -8,976,119.88 |
| 其中:1.基金申购款 | 14,333,401.39 | -2,064,168.67 | 12,269,232.72 |
| 2.基金赎回款 | -24,906,322.12 | 3,660,969.52 | -21,245,352.60 |
| 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) | 57,417,671.25 | -6,854,833.50 | 50,562,837.75 |

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

长盛环球景气行业大盘精选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")证监基金字[2009]第1501号《关于核准长盛环球景气行业大盘精选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《长盛环球景气行业大盘精选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339,898,507.52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(2010)第122号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》于2010年5月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为340,041,384.63份基金份额,其中认购资金利息折合142,877.11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,境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司,境外投资顾问为高盛资产管理有限责任合伙。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《长盛环球景气行业大盘精选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在全球证券市场公开发行上市的股票、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中对股票及其他权益类证券投资占本基金基金资产的目标比例为60%-95%,其中投资于业绩比较基准内23个全球发达地区市场大盘类上市公司股票的部分不低于本基金股票资产总额的80%;投资现金、货币市场工具及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产净值的5%-40%。本基金的业绩比较基准为:摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index)。

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》、《长盛环球景气行业大盘精选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》及其他相关境内外税务法规和实务操作,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。

(2)目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(3)目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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、基金销售机构、注册登记机构 |
| 中国银行股份有限公司("中国银行") | 基金托管人、基金代销机构 |
| 中国银行(香港)有限公司("中银香港") | 境外资产托管人 |
| 高盛资产管理有限责任合伙 | 境外投资顾问 |
| 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 |
| 国元证券经纪(香港)有限公司(GUOYUAN SECURITIES BROKERAGE (HONG KONG) LIMITED) | 基金管理人股东控制的公司 |
| 中银国际证券有限公司(BOCI SECURITIES L