

长盛动态精选证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

本基金截至2015年6月30日,期末可供分配收益为254,637,034.81元,其中,未分配收益已实现部分为302,362,515.07元,未分配收益未实现部分为-48,325,480.26元。

48 报告期末管理人对本基金持有人人数或基金份额净值变动情况的说明

本基金报告期内无基金份额持有人人数或基金份额净值变动情况。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守法律法规情况

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—长盛基金管理有限公司2015年1月1日至2015年6月30日的基金的投资运作,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各项义务,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、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本基金的基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,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约定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息和其他信息的真实、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,基金管理人所编制并披露的基金半年度报告中的财务信息、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现现有损害基金份额持有人利益的行为。

5 半年度报告摘要(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:长盛动态精选证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

资产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
货币资产	47,106,068.86	80,061,271.90
结算备付金	304,046.15	302,628.66
存出保证金	463,398.88	651,727.53
交易性金融资产	590,430,828.96	832,382,436.74
其中:股票投资	579,526,828.96	812,904,436.74
债券投资	19,904,000.00	19,478,000.00
资产支持证券投资	-	-
应收款项	-	-
应收利息	2,201,466.13	8,662,249.60
应收股利	179,261.19	179,700.64
其他资产	679,067.20	34,886.73
资产总计	641,290,978.07	922,294,883.20
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
应付短期融资款	-	-
应付利息	2,201,466.13	8,662,249.60
应付股利	179,261.19	179,700.64
其他负债	679,067.20	34,886.73
所有者权益		
实收资本	641,290,978.07	922,294,883.20
未分配收益	254,637,034.81	302,362,515.07
所有者权益合计	641,290,978.07	922,294,883.20

注:本基金本报告期末无股指期货合约持仓情况。

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.6956元,基金份额总额364,043,244.66份。

6.2 利润表

会计主体:长盛动态精选证券投资基金

报告期间:2015年1月1日至2015年6月30日

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	416,032,376.11	46,891,351.31
1.利息收入	62,320,030.11	3,256,146.29
其中:存款利息收入	672,376.00	1,160,732.32
债券利息收入	200,000.00	2,045,503.81
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产利息收入	-	48,779.16
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	351,273,670.63	60,440,706.22
其中:股票投资收益	348,586,576.26	56,561,689.79
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	676,408.71
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	2,676,094.38	3,912,597.72
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	63,985,477.02	-17,265,300.17
4.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	4,312,316.66	9,388.97
二、费用	10,236,688.46	13,511,667.26
1.管理人报酬	7,046,064.16	7,023,443.36
2.托管费	399,341.91	936,450.10
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,669,337.33	5,367,628.23
5.利息支出	-	-
6.其他费用	192,944.02	192,939.76
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	406,367,147.65	32,989,184.06
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	406,367,147.65	32,989,184.06

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛动态精选证券投资基金

报告期间:2015年1月1日至2015年6月30日

应交税费	62,550.40	62,550.40
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	514,536.74	589,694.61
负债合计	22,610,680.80	5,396,053.79
所有者权益:		
实收基金	364,043,244.46	729,320,876.36
未分配利润	254,637,034.81	177,572,063.06
所有者权益合计	618,680,279.27	916,892,939.41
负债和所有者权益总计	641,290,970.07	922,294,993.20

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.6905元,基金份额总额364,043,244.46份。

6.2 利润表