基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2015年8月27日

长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月26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2015年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛高端装备混合
基金主代码	000534
交易代码	000534
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月25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	644,722,462.16份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标在于把握中国高端装备制造业发展带来的投资机会,分享高端装备制造相关上市公司的持续投资收益,在严格控制投资风险的基础上,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	在大类资产配置中,本基金将主要考虑:(1)宏观经济指标,包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口数额变化等;(2)微观经济指标,包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期等;(3)市场指标,包括股票市场与债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金的供求关系及其变化等;(4)政策因素,包括财政政策、货币政策、产业政策及其它与证券市场密切相关的各种政策。 本基金的股票投资策略,分为股票池初步构建、细分领域配置和个股精选三个方面。 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。对于股指期货,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。
业绩比较基准	50%×上证高端装备60指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

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	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcsd@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	95566
传真		010-82256988	010-66594942

2.4 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	基金管理人的办公地址及基金托管人的住所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015年1月1日-2015年6月30日)
本期已实现收益	265,134,659.22
本期利润	131,274,496.38
加权平均基金份额本期利润	0.2572
本期基金份额净值增长率	41.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.7902
期末基金资产净值	1,250,084,158.99
期末基金份额净值	1.939

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6月30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
过去一个月	-15.03%	3.50%	-8.04%	1.92%	-6.99%	1.58%
过去三个月	15.07%	2.79%	13.41%	1.52%	1.66%	1.27%
过去六个月	41.33%	2.18%	31.19%	1.22%	10.14%	0.96%
过去一年	86.98%	1.78%	65.92%	1.01%	21.06%	0.77%
自基金合同生效起至今	93.90%	1.61%	68.37%	0.94%	25.53%	0.67%

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%×上证高端装备60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。本基金为主题混合型基金,在综合比较目前市场上各主要行业指数的编制特点后,本基金选择以上证高端装备60指数作为股票投资的业绩比较基准。上证高端装备60指数是中证指数股份有限公司编制,反映沪市通信设备、电气部件与设备、重型电气设备、航天航空与国防等行业股票价格变动趋势的指数。本基金主要投资于投资高端装备等相关上市公司股票,因此上证高端装备60指数适合作为本基金的业绩比较基准。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响,本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%,其中投资于高端装备制造相关上市公司股票和债券的资产不低于非现金基金资产的80%;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。

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:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十二部分“二、投资范围”和“四、投资限制”的有关约定。

§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2015年6月30日,基金管理人共管理三十九只开放式基金,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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
冯雨生	本基金基金经理,长盛中证100指数证券投资基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理。	2015年4月27日	-	8年	男,1983年11月出生,中国国籍。北京大学金融学硕士。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。现任长盛中证100指数证券投资基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)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(本基金)基金经理,长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理。
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,长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。	2014年3月25日	2015年4月27日	10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(本基金)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)基金经理。自2015年4月27日起不再担任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。

4.2 管理人对投资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。

4.3.2 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,未发生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。

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

上半年一季度股票市场整体大幅上涨,互联网金融、智能电视和智慧医疗板块大幅上涨,沪港通、海南旅游岛和自贸区概念板块涨幅较少。行业上,计算机、通信和传媒行业涨幅靠前,银行、券商和煤炭行业跑输市场。二季度股票市场整体大幅震荡,前两个月市场大幅上涨,6月份以来大幅下跌。概念主题上看,安防监控、网络安全和文化传媒等板块涨幅居前,自贸区、经济带和冷链物流等概念板块涨幅较少。行业上,轻工制造、银行和食品饮料涨幅靠前,有色、建筑和商贸大幅跑输市场。在操作中,前期上涨时我们维持高仓位,并在六月份逐步减少了高估值股票的配置。目前组合配置比较均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.939元,本报告期份额净值增长率为41.33%,同期业绩比较基准增长率为31.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,我们延续以前对经济的判断,陆续出台的改革措施也会提升投资者风险偏好,改革相关的板块可能持续受到投资者青睐。短期市场的调整不会影响牛市大方向,在国家划时代的变革背景下,资本市场会更加健康有效。蓝筹股是国家经济转型和产业升级的核心力量,看好蓝筹股未来的市场表现。在投资上,我们将坚持对市场少做预判,多做细心的观察,决策时做到可进可退,并在交易上设置认错机制,保持投资的纪律性。针对下半年,我们将维持组合的弹性,并精选个股为主。

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。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议,由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分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十六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2015年6月30日,期末可供分配利润为509,482,015.98元,其中:未分配利润已实现部分为509,482,015.98元,未分配利润未实现部分为95,879,680.85元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在长盛高端装备灵活配置混合型证券投资基金(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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	579,927,420.27	138,231,398.18
结算备付金	7,134,888.86	3,017,741.68
存出保证金	306,461.25	473,422.02
交易性金融资产	967,235,043.30	572,548,174.99
其中:股票投资	966,402,417.00	572,548,174.99
基金投资	-	-
债券投资	832,626.30	-
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	-	-
应收证券清算款	-	41,629,252.60
应收利息	71,412.62	18,051.11
应收股利	-	-
应收申购款	6,907,828.36	6,559,546.26
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,561,583,054.66	762,477,586.84
负债和所有者权益	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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	188,257,548.79	-
应付赎回款	117,693,376.51	6,681,698.15
应付管理人报酬	1,957,522.94	864,283.80
应付托管费	326,253.80	144,047.29
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,942,705.18	1,402,142.16
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	321,488.45	264,852.23
负债合计	311,498,895.67	9,357,023.63
所有者权益:		
实收基金	644,722,462.16	548,751,968.92
未分配利润	605,361,696.83	204,368,594.29
所有者权益合计	1,250,084,158.99	753,120,563.21
负债和所有者权益总计	1,561,583,054.66	762,477,586.84

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.939元,基金份额总额644,722,462.16份

6.2 利润表

会计主体:长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

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3月25日(基金合同生效日)至2014年6月30日
一、收入	145,929,100.90	20,676,255.82
1.利息收入	741,427.13	2,741,629.80
其中:存款利息收入	741,379.41	1,827,037.39
债券利息收入	47.72	270,983.02
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	643,609.39
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	266,086,436.20	3,811,881.98
其中:股票投资收益	263,726,700.26	2,885,764.65
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	73,752.46
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	2,359,735.94	852,364.87
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-133,860,162.84	13,735,495.72
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	12,961,400.41	387,248.32
减:二、费用	14,654,604.52	4,188,736.35
1. 管理人报酬	6,710,202.60	1,955,698.57
2. 托管费	1,118,367.08	325,949.75
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	6,624,317.87	1,805,291.67
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	201,716.97	101,796.36
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	131,274,496.38	16,487,519.47
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	131,274,496.38	16,487,519.47

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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)	548,751,968.92	204,368,594.29	753,120,563.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	131,274,496.38	131,274,496.38
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)	95,970,493.24	269,718,606.16	365,689,099.40
其中:1.基金申购款	1,458,630,771.14	1,328,775,064.90	2,787,405,836.04
2.基金赎回款	-1,362,660,277.90	-1,059,056,458.74	-2,421,716,736.64
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)	644,722,462.16	605,361,696.83	1,250,084,158.99
项目	上年度可比期间 2014年3月25日(基金合同生效日)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)	510,326,262.72	-	510,326,262.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,487,519.47	16,487,519.47
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)	-99,834,115.67	-1,487,360.14	-101,321,475.81
其中:1.基金申购款	6,434,811.48	33,225.94	6,468,037.42
2.基金赎回款	-106,268,927.15	-1,520,586.08	-107,789,513.23
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)	410,492,147.05	15,000,159.33	425,492,306.38

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 杨思乐 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金(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”)证监许可[2014]106号文《关于核准长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准,由长盛基金管理有限公司于2014年2月24日至2014年3月21日向社会公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资并出具安永华明(2014)验字第60468688_A02号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年3月25日正式生效,本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金设立时已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币510,154,078.04元,折合510,154,078.04份基金份额;募集资金在募集期间产生的利息为人民币172,184.68元,折合172,184.68份基金份额;以上收到的实收基金共计人民币510,326,262.72元,折合510,326,262.72份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货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的相关规定)。其中,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,其中投资于高端装备制造的股票和债券不低于非现金基金资产的80%;权证投资占基金资产净值的比例不高于3%;本基金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后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。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。本基金的业绩比较基准是:50%×上证高端装备60指数收益率 + 50%×中证综合债指数收益率。

6.4.2 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估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

除上述会计估值变更事项外,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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),本基金自2015年3月24日起按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.6.1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、国家税务总局财政[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。

6.4.6.2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。

6.4.6.3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、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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(“长盛基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构

6.4.8 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

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

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3月25日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,710,202.60	1,955,698.57
其中:支付销售机构的客户维护费	2,858,874.83	811,575.51

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×1.50%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提,按月支付,由基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

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3月25日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,118,367.08	325,949.75

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×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金管理人于本报告期及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金份额。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:除基金管理人之外的其他关联方本期末未投资本基金。

6.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年3月25日(基金合同生效日)至2014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
中国银行	579,927,420.27	712,028.39	47,302,395.58	141,754.61

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注:本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	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
002309	中利科技	2015年6月2日	重大事项停牌	27.95	2015年7月21日	30.05	517,500	15,394,801.90	14,464,125.00	-
000748	长城信息	2015年6月18日	重大事项停牌	27.25	-	-	450,400	8,084,121.15	12,273,400.00	-
600015	宝硕股份	2015年3月10日	重大事项停牌	22.28	-	-	400,000	5,905,131.00	8,912,000.00	-
300025	常山药业	2015年6月17日	重大事项停牌	27.58	2015年7月13日	31.24	305,120	8,418,418.26	8,415,209.60	-
002001	新 和 成	2015年6月30日	重大事项停牌	17.09	2015年7月13日	18.49	457,400	9,535,730.64	7,816,966.00	-
600872	中炬高新	2015年5月19日	重大事项停牌	23.16	-	-	336,600	5,958,896.16	7,795,656.00	-
002367	康力电梯	2015年6月2日	重大事项停牌	20.90	-	-	317,000	7,790,569.40	6,625,300.00	-
300161	华中数控	2015年6月22日	重大事项停牌	30.27	-	-	187,250	5,443,481.60	5,668,057.50	-
002527	新时达	2015年6月15日	重大事项停牌	24.25	-	-	220,815	6,674,654.60	5,354,763.75	-
002649	博彦科技	2015年6月1日	重大事项停牌	61.63	2015年8月18日	75.43	83,600	7,425,057.40	5,152,268.00	-
300353	东土科技	2015年6月17日	重大事项停牌	57.79	-	-	83,500	5,036,887.60	4,825,465.00	-
600879	航天电子	2015年5月15日	重大事项停牌	23.59	-	-	194,900	4,278,787.30	4,597,691.00	-