同盛证券投资基金

[2014] 半年度报告摘要

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8月28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(以下简称"中国银行")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。

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,投资者在做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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛同盛封闭
场内简称	基金同盛
基金主代码	184699
交易代码	184699
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年11月5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	3,000,000,000份
基金合同存续期	15年
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11月26日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属于成长价值复合型基金,主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和市场价值被低估的价值型上市公司,利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好的分散和控制风险,实现基金资产的稳定增长。
投资策略	本基金将根据市场发展情况,确定在一段时间内市场发展的总体趋势,并在此基础上确定股票和国债的配置比例以及股票投资中成长型投资和价值型投资的配置比例。并分别选取成长型特征最明显的股票和价值型特征最明显的股票进行组合投资。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

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	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666 ,010-62350088	95566
传真		010-82255988	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	基金管理人和基金托管人的住所

§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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-49,925,964.49
本期利润	-100,136,251.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0334
本期基金份额净值增长率	-2.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0133
期末基金资产净值	3,133,315,268.52
期末基金份额净值	1.0444

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
过去一个月	4.39%	2.57%
过去三个月	1.14%	2.03%
过去六个月	-2.97%	2.22%
过去一年	4.26%	2.09%
过去三年	-11.98%	2.11%
自基金合同生效起至今	293.69%	2.53%

注:本基金无业绩比较基准收益率,无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

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:本基金无同期业绩比较基准收益率,无需进行同期业绩比较基准收益率的比较

§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。

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		
田间	本基金基金经理。	2013年7月9日	-	6年	女,1978年11月出生,中国国籍。中央财经大学经济学硕士。2008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。现任同盛证券投资基金(本基金)基金经理。
冯雨生	本基金基金经理助理,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。	2014年4月3日	-	7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。现任同盛证券投资基金基金经理助理,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。
侯继雄	本基金基金经理,社保组合组合经理,公司总经理助理,长盛创富资产管理有限公司执行董事、总经理。	2008年8月11日	2014年4月21日	13年	男,1974年5月出生,中国国籍。清华大学博士,历任国泰君安证券研究所研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司,先后任长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理、研究部总监等职务。现任公司总经理助理,社保组合组合经理,兼任长盛创富资产管理有限公司执行董事、总经理。自2014年4月21日起不再担任同盛证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经理和基金经理助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,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。

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

2014年上半年,国内经济在一季度出现了一定程度的下滑,其中工业和出口增速明显回落,投资低位徘徊;二季度以来在政府定向宽松稳增长政策的密集出台下,国内经济有一定企稳迹象和回暖趋势,以PMI为代表的多项经济指标连续回升。上半年流动性持续宽松,人民币贷款增速和M2增速保持平稳。海外经济中,美国经济持续复苏,日本复苏有反复,欧洲国家温和复苏,新兴经济体加快结构调整。

2014年上半年,资本市场表现为大盘指数的窄幅和体震荡和创业板、中小盘指数的宽幅震荡。市场的机会体现为来自创业板和中小板的结构性机会。按细分主题来看,不同主题在各个上涨阶段存在着轮动表现。一季度上涨中,智能家居、教育信息化、信息安全、医疗服务、新能源汽车、LED表现最为突出。而在二季度末的上涨中,金融信息化、去IOE、基因测序、信息安全、新能源汽车、传媒等细分领域表现最为突出。总体来看今年表现较好的是去年滞涨、概念新、市值小的个股。而环保、医药、大众消费等市值较大的白马龙头股持续下跌。与此同时,一季度宏观数据不容乐观的背景下,较强的稳增长举措燃起市场对大盘周期股的预期,在三月底四月初上证指数显著强于创业板指数。

回顾基金同盛在2014年上半年的操作,在两度创业板上涨过程中先后加仓了TMT行业细分主题下的上市公司,此外加仓了以及家用电器、汽车、公用事业等传统低估值行业,在市场下跌中曾一度参与铁路、银行、券商等周期属性行业,一定程度上分享了市场的结构性上涨。但在系统性调整中防御效果不理想,同时医药、食品饮料、大众消费等行业的配置在上半年拖累了基金的业绩表现。

未来在投资策略和风格上,基金同盛会聚焦经济转型、产业升级、模式创新、政策热点等板块,通过"自上而下优选行业"和"自下而上精选个股"相结合,重点布局未来增长预期高、成长确定性大的上市公司。在操作策略上,基金同盛会在坚持"成长性行业优选与成长性个股精选策略"的同时,注重"组合平衡管理策略",即根据经济周期和市场趋势的变化,适时加入对价值股和周期股的投资,以进行投资组合的平衡管理,减少净值波动、回避短风险。

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1.0444元,本报告期份额净值增长率为-2.97%。

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2014年下半年,国内宏观经济进一步企稳的概率增大,但仍然具有不确定性。欧美持续复苏,日本复苏稳中有波动。在不出现流动性变局的情况下,我们判断,2014年下半年的资本市场会好于上半年,但由于上市公司业绩落地业绩风险和经济进一步企稳不确定性的存在,预计走势上会呈现先抑后扬的结构性行情。我们会重点关注转型方向上政策落实和业绩兑现的高成长公司,以及兼具价值投资和新兴理念的蓝筹公司。对于长期看好的领域以及个股,会忽略短期因素的干扰。

4.6 管理人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,本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至2014年6月30日,期末可供分配收益为-39,998,553.95元,其中:未分配收益已实现部分为-39,998,553.95,未分配收益未实现部分为173,313,822.47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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对同盛证券投资基金(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:同盛证券投资基金

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	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	21,311,528.08	51,949,306.83
结算备付金	12,990,615.67	32,699,400.12
存出保证金	1,234,916.48	1,145,805.67
交易性金融资产	3,091,859,527.91	2,914,085,432.59
其中:股票投资	2,458,557,711.91	2,219,938,432.59
基金投资	-	-
债券投资	633,301,816.00	694,147,000.00
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	-	361,000,000.00
应收证券清算款	45,912,182.07	12,483,189.04
应收利息	14,296,934.02	8,761,321.93
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	30,247.07	-
资产总计	3,187,635,951.30	3,382,124,456.18
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30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	39,709,129.95	19,590,648.31
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,743,372.42	4,225,232.87
应付托管费	623,895.41	704,205.48
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,956,425.60	4,680,989.94
应交税费	1,823,891.66	1,823,891.66
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	463,967.74	647,967.74
负债合计	54,320,682.78	31,672,936.00
所有者权益:		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	133,315,268.52	350,451,520.18
所有者权益合计	3,133,315,268.52	3,350,451,520.18
负债和所有者权益总计	3,187,635,951.30	3,382,124,456.18

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0444元,基金份额总额3,000,000,000份。

6.2 利润表

会计主体:同盛证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	-54,275,100.41	52,758,536.47
1.利息收入	19,085,163.18	14,737,908.59
其中:存款利息收入	918,710.66	854,586.84
债券利息收入	16,998,309.15	12,790,956.46
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,168,143.37	1,092,365.29
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-23,149,976.42	175,559,471.71
其中:股票投资收益	-41,531,853.47	150,410,750.79
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,783,574.10	-488,188.38
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	16,598,302.95	25,636,909.30
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-50,210,287.17	-137,538,843.83
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	45,861,151.25	40,777,133.94
1.管理人报酬	23,946,197.34	23,729,663.74
2.托管费	3,991,032.94	3,954,943.92
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	17,329,645.64	12,863,588.62
5.利息支出	8,659.14	-
其中:卖出回购金融资产支出	8,659.14	-
6.其他费用	585,616.19	228,937.66
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-100,136,251.66	11,981,402.53
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-100,136,251.66	11,981,402.53

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:同盛证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1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)	3,000,000,000.00	350,451,520.18	3,350,451,520.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-100,136,251.66	-100,136,251.66
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)	-	-117,000,000.00	-117,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	133,315,268.52	3,133,315,268.52
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)	3,000,000,000.00	105,963,642.67	3,105,963,642.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,981,402.53	11,981,402.53
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)	3,000,000,000.00	117,945,045.20	3,117,945,045.20

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

同盛证券投资基金(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]30号文《关于同意同盛证券投资基金设立的批复》批准,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11月5日正式生效,本基金为契约型封闭式,存续期为15年,发行规模为30亿份基金份额。本基金经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上字[1999]109号文审核同意,于1999年11月26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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其股票投资部分将主要投资于成长型股票和价值型股票。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做出相关规定。

6.4.2 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。

6.4.3 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1月1日至2014年6月30日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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

本基金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一致。

6.4.5 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

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。

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未发生变化的情况。

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
长江证券	基金发起人
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
中信证券	基金发起人
中国银行	基金托管人

6.4.8 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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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6月30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
长江证券	43,816,048.21	0.38%	498,531,197.01	5.97%
中信证券	-	-	94,744,903.23	1.13%
国元证券	2,378,670,280.89	20.79%	103,756,501.54	1.24%
合计	2,422,486,329.10	21.17%	697,032,601.78	8.34%

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30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
长江证券	57,125,851.50	53.85%	-	-

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	45,900,000.00	0.72%	150,000,000.00	9.80%

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金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。

6.4.8.1.5 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
长江证券	39,890.47	0.38%	39,890.47	0.50%
国元证券	2,165,537.29	20.79%	2,148,768.72	27.02%
中信证券	-	-	83,839.92	1.11%
合计	2,205,427.76	21.17%	2,188,659.19	27.52%
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
长江证券	453,861.62	6.00%	453,861.62	10.24%
中信证券	83,839.92	1.11%	-	-
国元证券	94,459.36	1.25%	-	-
合计	632,160.90	8.36%	453,861.62	10.24%

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。

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 2014年1月1日至2014年6月30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	23,946,197.34	23,729,663.74
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:在通常情况下,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,本基金成立三个月后,若持有现金的比例超过本基金资产净值的20%,超出部分不计提基金管理费。计算方法如下:

H=E×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(扣除本基金持有现金比例超过20%部分的基金资产净值)

基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人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,若遇节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30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	3,991,032.94	3,954,943.92

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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

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:本基金于本报告期及上年度可比期间均未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

份额单位:份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30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(1999年11月5日)持有的基金份额	6,000,000	6,000,000
期初持有的基金份额	6,000,000	6,000,000
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	6,000,000	6,000,000
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.20%	0.20%

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年6月30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
国元证券	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%
天津国际信托	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%
长江证券	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%
中信证券	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%

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。

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 2014年1月1日至2014年6月30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
中国银行	21,311,528.08	769,850.89	243,051,228.79	787,912.99

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计算。

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:本基金于本报告期间及上年度可比期间均未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

本基金本期无其他需作说明的关联交易事项利润分配情况

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.5 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别:股票 | | | | | | | | | |
|---|---