

信息披露 Disclosure

长盛中证100指数证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

分为133,322,142.20元,未分配利润未实现部分为-478,136,791.51元。

§ 5 管理人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守信情况

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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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守信守,净值计算,利润分配等情况的说明
本基金管理人认为,长盛基金管理有限公司信息披露事务符合《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本基金半年度报告中的财务指标、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,未发现有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内容的真实、准确和完整发表意见
本基金管理人认为,长盛基金管理有限公司信息披露事务符合《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中证100指数证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

§ 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:长盛中证100指数证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
货币资金	35,077,470.63	39,351,411.03
结算备付金	300,000.00	509,334.33
应收利息	138,641.96	203,142.80
应收股利	500,989,034.68	497,253,985.53
买入返售金融资产	589,089,014.68	492,381,789.09
其他资产	—	—
资产总计	1,461,528,444.25	1,431,286,442.75
负债和所有者权益		
负债:		
短期借款	—	—
应付利息	—	—
应付股利	—	—
其他负债	—	—
负债合计	—	—
所有者权益:		
实收资本	18,955.56	24,669.83
留存收益	1,461,509,488.69	1,431,261,772.92
所有者权益合计	1,461,528,444.25	1,431,286,442.75
资产总计	1,461,528,444.25	1,431,286,442.75

项目	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
1.权益类	—	—
2.固定收益类	—	—
3.商品及金融衍生品	—	—
4.其他资产	—	—
5.负债类	—	—
6.所有者权益	1,461,528,444.25	1,431,286,442.75
7.其他资产	—	—
8.其他负债	—	—
9.其他所有者权益	—	—
10.其他负债	—	—
11.其他所有者权益	—	—
12.其他负债	—	—
13.其他所有者权益	—	—
14.其他负债	—	—
15.其他所有者权益	—	—
16.其他负债	—	—
17.其他所有者权益	—	—
18.其他负债	—	—
19.其他所有者权益	—	—
20.其他负债	—	—
21.其他所有者权益	—	—
22.其他负债	—	—
23.其他所有者权益	—	—
24.其他负债	—	—
25.其他所有者权益	—	—
26.其他负债	—	—
27.其他所有者权益	—	—
28.其他负债	—	—
29.其他所有者权益	—	—
30.其他负债	—	—
31.其他所有者权益	—	—
32.其他负债	—	—
33.其他所有者权益	—	—
34.其他负债	—	—
35.其他所有者权益	—	—
36.其他负债	—	—
37.其他所有者权益	—	—
38.其他负债	—	—
39.其他所有者权益	—	—
40.其他负债	—	—
41.其他所有者权益	—	—
42.其他负债	—	—
43.其他所有者权益	—	—
44.其他负债	—	—
45.其他所有者权益	—	—
46.其他负债	—	—
47.其他所有者权益	—	—
48.其他负债	—	—
49.其他所有者权益	—	—
50.其他负债	—	—
51.其他所有者权益	—	—
52.其他负债	—	—
53.其他所有者权益	—	—
54.其他负债	—	—
55.其他所有者权益	—	—
56.其他负债	—	—
57.其他所有者权益	—	—
58.其他负债	—	—
59.其他所有者权益	—	—
60.其他负债	—	—
61.其他所有者权益	—	—
62.其他负债	—	—
63.其他所有者权益	—	—
64.其他负债	—	—
65.其他所有者权益	—	—
66.其他负债	—	—
67.其他所有者权益	—	—
68.其他负债	—	—
69.其他所有者权益	—	—
70.其他负债	—	—
71.其他所有者权益	—	—
72.其他负债	—	—
73.其他所有者权益	—	—
74.其他负债	—	—
75.其他所有者权益	—	—
76.其他负债	—	—
77.其他所有者权益	—	—
78.其他负债	—	—
79.其他所有者权益	—	—
80.其他负债	—	—
81.其他所有者权益	—	—
82.其他负债	—	—
83.其他所有者权益	—	—
84.其他负债	—	—
85.其他所有者权益	—	—
86.其他负债	—	—
87.其他所有者权益	—	—
88.其他负债	—	—
89.其他所有者权益	—	—
90.其他负债	—	—
91.其他所有者权益	—	—
92.其他负债	—	—
93.其他所有者权益	—	—
94.其他负债	—	—
95.其他所有者权益	—	—
96.其他负债	—	—
97.其他所有者权益	—	—
98.其他负债	—	—
99.其他所有者权益	—	—
100.其他负债	—	—

注:1.上述权益类资产公允价值计量,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券费和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计入公允价值。

6.2 利润表

会计主体:长盛中证100指数证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本期末 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、营业收入	368,012.09	387,159.93
1.利息收入	368,012.09	387,159.93
2.公允价值变动损益	307,481.96	386,142.22
3.其他业务收入	30.13	978.21
4.其他业务收入	—	—
5.其他业务收入	—	—
6.其他业务收入	—	—
7.其他业务收入	—	—
8.其他业务收入	—	—
9.其他业务收入	—	—
10.其他业务收入	—	—
11.其他业务收入	—	—
12.其他业务收入	—	—
13.其他业务收入	—	—
14.其他业务收入	—	—
15.其他业务收入	—	—
16.其他业务收入	—	—
17.其他业务收入	—	—
18.其他业务收入	—	—
19.其他业务收入	—	—
20.其他业务收入	—	—
21.其他业务收入	—	—
22.其他业务收入	—	—
23.其他业务收入	—	—
24.其他业务收入	—	—
25.其他业务收入	—	—
26.其他业务收入	—	—
27.其他业务收入	—	—
28.其他业务收入	—	—
29.其他业务收入	—	—
30.其他业务收入	—	—
31.其他业务收入	—	—
32.其他业务收入	—	—
33.其他业务收入	—	—
34.其他业务收入	—	—
35.其他业务收入	—	—
36.其他业务收入	—	—
37.其他业务收入	—	—
38.其他业务收入	—	—
39.其他业务收入	—	—
40.其他业务收入	—	—
41.其他业务收入	—	—
42.其他业务收入	—	—
43.其他业务收入	—	—
44.其他业务收入	—	—
45.其他业务收入	—	—
46.其他业务收入	—	—
47.其他业务收入	—	—
48.其他业务收入	—	—
49.其他业务收入	—	—
50.其他业务收入	—	—
51.其他业务收入	—	—
52.其他业务收入	—	—
53.其他业务收入	—	—
54.其他业务收入	—	—
55.其他业务收入	—	—
56.其他业务收入	—	—
57.其他业务收入	—	—
58.其他业务收入	—	—
59.其他业务收入	—	—
60.其他业务收入	—	—
61.其他业务收入	—	—
62.其他业务收入	—	—
63.其他业务收入	—	—
64.其他业务收入	—	—
65.其他业务收入	—	—
66.其他业务收入	—	—
67.其他业务收入	—	—
68.其他业务收入	—	—
69.其他业务收入	—	—
70.其他业务收入	—	—
71.其他业务收入	—	—
72.其他业务收入	—	—
73.其他业务收入	—	—
74.其他业务收入	—	—
75.其他业务收入	—	—
76.其他业务收入	—	—
77.其他业务收入	—	—
78.其他业务收入	—	—
79.其他业务收入	—	—
80.其他业务收入	—	—
81.其他业务收入	—	—
82.其他业务收入	—	—
83.其他业务收入	—	—
84.其他业务收入	—	—
85.其他业务收入	—	—
86.其他业务收入	—	—
87.其他业务收入	—	—
88.其他业务收入	—	—
89.其他业务收入	—	—
90.其他业务收入	—	—
91.其他业务收入	—	—
92.其他业务收入	—	—
93.其他业务收入	—	—
94.其他业务收入	—	—
95.其他业务收入	—	—
96.其他业务收入	—	—
97.其他业务收入	—	—
98.其他业务收入	—	—
99.其他业务收入	—	—
100.其他业务收入	—	—

注:报告期比2014年6月30日,基金份额净值0.6366元,基金份额总额948,279,528.87份。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛中证100指数证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本期末 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、期初所有者权益(基金净值)	1,083,286,318.93	736,086,650.93
二、本期增减变动金额(减少以“-”号填列)	-347,277,662.34	-418,388,743.13
1.本期新增基金份额	—	—
2.本期赎回基金份额	—	—
3.本期申购基金份额	—	—
4.本期赎回基金份额	—	—
5.本期申购基金份额	—	—
6.本期赎回基金份额	—	—
7.本期申购基金份额	—	—
8.本期赎回基金份额	—	—
9.本期申购基金份额	—	—
10.本期赎回基金份额	—	—
11.本期申购基金份额	—	—
12.本期赎回基金份额	—	—
13.本期申购基金份额	—	—
14.本期赎回基金份额	—	—
15.本期申购基金份额	—	—
16.本期赎回基金份额	—	—
17.本期申购基金份额	—	—
18.本期赎回基金份额	—	—
19.本期申购基金份额	—	—
20.本期赎回基金份额	—	—
21.本期申购基金份额	—	—
22.本期赎回基金份额	—	—
23.本期申购基金份额	—	—
24.本期赎回基金份额	—	—
25.本期申购基金份额	—	—
26.本期赎回基金份额	—	—
27.本期申购基金份额	—	—
28.本期赎回基金份额	—	—
29.本期申购基金份额	—	—
30.本期赎回基金份额	—	—
31.本期申购基金份额	—	—
32.本期赎回基金份额	—	—
33.本期申购基金份额	—	—
34.本期赎回基金份额	—	—
35.本期申购基金份额	—	—
36.本期赎回基金份额	—	—
37.本期申购基金份额	—	—
38.本期赎回基金份额	—	—
39.本期申购基金份额	—	—
40.本期赎回基金份额	—	—
41.本期申购基金份额	—	—
42.本期赎回基金份额	—	—
43.本期申购基金份额	—	—
44.本期赎回基金份额	—	—
45.本期申购基金份额	—	—
46.本期赎回基金份额	—	—
47.本期申购基金份额	—	—
48.本期赎回基金份额	—	—
49.本期申购基金份额	—	—
50.本期赎回基金份额	—	—
51.本期申购基金份额	—	—
52.本期赎回基金份额	—	—
53.本期申购基金份额	—	—
54.本期赎回基金份额	—	—
55.本期申购基金份额	—	—
56.本期赎回基金份额	—	—
57.本期申购基金份额	—	—
58.本期赎回基金份额	—	—
59.本期申购基金份额	—	—
60.本期赎回基金份额	—	—
61.本期申购基金份额	—	—
62.本期赎回基金份额	—	—
63.本期申购基金份额	—	—
64.本期赎回基金份额	—	—
65.本期申购基金份额	—	—
66.本期赎回基金份额	—	—
67.本期申购基金份额	—	—
68.本期赎回基金份额	—	—
69.本期申购基金份额	—	—
70.本期赎回基金份额	—	—
71.本期申购基金份额	—	—
72.本期赎回基金份额	—	—
73.本期申购基金份额	—	—
74.本期赎回基金份额	—	—
75.本期申购基金份额	—	—
76.本期赎回基金份额	—	—
77.本期申购基金份额	—	—
78.本期赎回基金份额	—	—
79.本期申购基金份额	—	—
80.本期赎回基金份额	—	—
81.本期申购基金份额	—	—
82.本期赎回基金份额	—	—
83.本期申购基金份额	—	—
84.本期赎回基金份额	—	—
85.本期申购基金份额	—	—
86.本期赎回基金份额	—	—
87.本期申购基金份额	—	—
88.本期赎回基金份额	—	—
89.本期申购基金份额	—	—
90.本期赎回基金份额	—	—
91.本期申购基金份额	—	—
92.本期赎回基金份额	—	—
93.本期申购基金份额	—	—
94.本期赎回基金份额	—	—
95.本期申购基金份额	—	—
96.本期赎回基金份额	—	—
97.本期申购基金份额	—	—
98.本期赎回基金份额	—	—
99.本期申购基金份额	—	—
100.本期赎回基金份额	—	—

注:1.本基金截至2014年6月30日止持有以上公允价值计量的金融工具属于第一层级的余额为 565,987,489.93元,属于第二层级的余额为4,001,515.75元,无属于第三层级的余额2013年12月31日:第一层级692,357,466.72元,第二层级4,855,628.79元,无属于第三层级的余额。

(ii)公允价值计量所属的重大变动
对于公允价值计量所属的重大变动,若出现重大事项、交易不活跃(包括涨跌停的交易不活跃)、或属于非公允价值等情况,本基金第一层级至第二层级之间交易发生期间,交易不活跃期间及限售期将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值技术中使用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)公允价值公允价值余额和本期变动金额
于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元(2013年上半年度:净转入/(转出)第三层级的金额为元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元)。

(v)公允价值公允价值余额和本期变动金额
于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元(2013年上半年度:净转入/(转出)第三层级的金额为元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元)。

(vi)公允价值公允价值余额和本期变动金额
于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元(2013年上半年度:净转入/(转出)第三层级的金额为元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元)。

(vii)公允价值公允价值余额和本期变动金额
于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元(2013年上半年度:净转入/(转出)第三层级的金额为元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元)。

(viii)公允价值公允价值余额和本期变动金额
于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元(2013年上半年度:净转入/(转出)第三层级的金额为元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元)。

(ix)公允价值公允价值余额和本期变动金额
于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元(2013年上半年度:净转入/(转出)第三层级的金额为元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元)。

(x)公允价值公允价值余额和本期变动金额
于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元(2013年上半年度:净转入/(转出)第三层级的金额为元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元)。

(xi)公允价值公允价值余额和本期变动金额
于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为元(2013年上半年度:净转入/(转出)第三层级的金额为元,计入损益的第三