

长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款进行。
6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
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

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
长城证券	3,851,081.03	1.70%	17,498,487.05	4.31%

6.4.8.1.2 债券交易
注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。
6.4.8.1.3 债券回购交易
注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。
6.4.8.1.4 权证交易
注：本基金本期及上年度可比期间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
注：上述佣金按市场佣金率计算，并扣除券商承担的税费(包括但不限于)(买)经手费、证券结算风险基金和证券交易所以实(卖)证管费等。
管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.2 基金托管费
注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.3 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.4 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.5 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.6 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.7 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.8 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.9 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.10 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.11 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.12 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.13 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.14 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.15 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.16 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.17 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.18 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.19 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.20 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.21 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.22 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.23 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.24 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.25 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.26 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.27 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.28 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.29 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.30 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.31 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.32 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.33 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.34 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：
 $H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$
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

6.4.8.2.35 销售服务费
注：本基金本期及上年度可比期间均未采用销售服务费。
6.4.8.2.36 报告期末除基金管理费以外的其他关联方支付基金的费用
注：除基金管理费外，本基金其他关联方于本期及上年度均未支付本基金的费用。
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

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
当期发生的基础托管费	1,263,826.28	1,667,804.56
其中：支付销售机构的客户维护	259,497.24	336,207.51

托管人应尽的义务。
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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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
本托管人复核了本报告中的财务数据、净值信息、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。
5.4 基金管理人应履行的义务

6.1 资产负债情况
会计主体：长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2014年6月30日

资产	期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产：		
银行存款	46,361,805.93	36,129,725.03
结算备付金	247,645.83	192,074.18
存出保证金	34,697.38	47,221.12
交易性金融资产	117,594,499.87	146,163,602.61
其中：股票投资	108,243,931.87	127,307,262.41
基金投资	-	-
债券投资	9,350,568.00	18,656,000.00
资产支持证券	-	-
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	1,706,073.18	-
应收利息	73,114.83	85,027.30
应收股利	-	-
应收申购款	1,972.49	11,165.07
其他资产	-	-
资产总计	166,019,809.51	182,628,815.31

负债和所有者权益	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	4,613,984.43	-
应付赎回款	68,290.17	371,651.98
应付管理人报酬	196,272.94	232,845.80
应付托管费	32,712.16	38,807.64
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	122,301.37	126,862.11
应交税费	72,000.00	56,000.00
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	173,109.13	154,562.19
负债合计	5,778,670.20	980,729.72
所有者权益：		
实收基金	150,760,127.80	175,528,624.90
未分配利润	9,881,011.51	6,119,460.69
所有者权益合计	160,641,139.31	181,648,085.59
负债和所有者权益总计	166,019,809.51	182,628,815.31

注：报告截止日2014年06月30日，基金份额净值1.063元，基金份额总额150,760,127.80份。
6.2 利润分配
会计主体：长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2014年1月1日至2014年6月30日

资产	期末 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产：		
一、收入	6,870,676.27	7,080,114.96
1.利息收入	25,889.64	282,497.32
其中：存款利息收入	207,363.97	211,089.11
债券利息收入	48,525.67	71,408.21
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	4,712,288.68	16,877,178.54
其中：股票投资收益	1,099,309.69	15,360,264.21
基金投资收益	-	-
债券投资收益	668,308.41	-
资产支持证券投资损益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	634,670.58	1,516,914.33
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	4,900,778.26	-10,883,540.97
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,719.09	3,080.07
减：-费用	2,017,338.25	2,730,773.66
1.管理人报酬	1,263,826.28	1,667,804.56
2.托管费	210,637.74	277,967.40
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	357,021.42	609,866.68
5.利息支出	7,248.99	-
其中：卖出回购金融资产支出	7,248.99	-
6.其他费用	178,604.22	184,134.96
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	4,853,338.02	4,349,341.30
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	4,853,338.02	4,349,341.30

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体：长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金
本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上期 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)	175,528,624.90	61,19,460.69
本期投资活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	4,853,338.02
二、本期所有者权益(基金净值)变动	-24,768,497.10	-1,491,787.20
其中：1.基金申购款	2,796,253.36	147,603.54
2.基金赎回款	-27,558,750.46	-1,639,391.74
三、期末所有者权益(基金净值)	150,760,127.80	9,881,011.51