(上接B344版)

公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1、股票投资

（1）上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

（2）未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B.首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b.估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2、债券投资

（1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

（2）证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

（3）未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

（4）在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3、权证投资

（1）上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

（2）未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

（3）因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4、分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值；

5、其他

（1）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（2）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.11.10 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时实现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.11.11 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额，每份基金面值为人民币1.00元。

6.4.11.12 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.11.13 收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

3、资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

4、买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

5、股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

6、债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

7、衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

9、公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

10、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.11.14 费用的确认和计量

1、基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

3、卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.11.15 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金收益分配采取现金方式；

3、基金当期收益在弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为4次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

6.4.11.16 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

6.4.12 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.12.5 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.12.6 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.12.7 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。

6.4.13 税项

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。

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。

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。

6.4.14 关联方关系

6.4.14.5 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。

6.4.14.6 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

项目	与本基金的关系
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
中国工商银行	基金托管人

6.4.15 本报告期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.15.5 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.15.5.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年4月4日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国元证券	328,095,680.03	10.39%

6.4.15.5.2 债券交易

注：本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.15.5.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年4月4日至2014年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国元证券	630,000,000.00	7.72%

6.4.15.5.4 权证交易

注：本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.15.5.5 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4月4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
国元证券	298,698.85	10.39%	298,698.85	10.07%

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、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。

6.4.15.6 关联方报酬

6.4.15.6.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年4月4日至2014年6月30日
当期应支付的管理费	7,840,959.04
其中：支付销售机构的客户维护费	62,130.10

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为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，管理费逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款通知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。

6.4.15.6.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年4月4日至2014年6月30日
当期应支付的托管费	1,306,826.52

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为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，基金托管费逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款通知于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.15.7 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.15.8 各关联方投资本基金的情况

6.4.15.8.1 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4月4日至2014年6月30日
基金合同生效日持有的基金份额	28,000,079.00
期间申购/买入总份额	22,999.00
期间因拆分增加的份额	-
期间赎回/卖出总份额	28,023,078.00
期末持有的基金份额	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-

注：1、基金管理人以2014年5月14日作为基金份额折算基准日，对折算基准日登记在册的由原基金同益转型所得的本基金基金份额进行折算与变更登记。折算后，本基金管理人持有的基金份额调增22,999.00份。2、基金管理人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。

6.4.15.8.2 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	
	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	4,003,286.00	0.22%

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。

6.4.15.9 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4月4日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	236,596,520.21	626,898.85

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计算。

6.4.15.10 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.15.11 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.16 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.16.5 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.16.6 期末持有的暂时停牌股票

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
300369	绿盟科技	2014年6月26日	重大事项停牌	61.27	-	-	179,867	10,075,465.69	11,020,451.09	-
300351	永贵电器	2014年6月23日	重大事项停牌	26.29	2014年8月7日	27.61	300,000	6,194,224.60	7,887,000.00	-

注：本基金截至2014年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.16.7 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.16.7.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.16.7.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.17 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告(转型前)

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	979,722,585.71	48.87
	其中：股票	979,722,585.71	48.87
2	固定收益投资	714,288,500.00	35.63
	其中：债券	714,288,500.00	35.63
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	108,838,977.51	5.43
7	其他资产	201,858,145.82	10.07
8	合计	2,004,708,209.04	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6.50	0.00
B	采矿业	4,158,000.00	0.21
C	制造业	786,117,188.20	39.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,489,577.85	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	888.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,574,500.00	0.18
J	金融业	141,064,251.71	7.05
K	房地产业	39,852,000.00	1.99
L	租赁和商务服务业	466,173.45	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	979,722,585.71	48.97

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000848	承德露露	5,950,000	127,032,500.00	6.35
2	000748	长城信息	3,800,000	75,620,000.00	3.78
3	601688	华泰证券	8,999,884	69,479,104.48	3.47
4	600552	方兴科技	3,290,000	65,701,300.00	3.28
5	002563	森马服饰	2,016,401	64,323,191.90	3.22
6	600690	青岛海尔	3,899,916	62,398,656.00	3.12
7	601299	中国北车	11,509,890	55,362,570.90	2.77
8	600983	合肥三洋	3,900,000	53,625,000.00	2.68
9	600584	长电科技	6,200,000	49,662,000.00	2.48
10	600837	海通证券	5,214,557	48,964,690.23	2.45

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于http://csfunds.com.cn网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600109	国金证券	82,994,882.50	4.19
2	601688	华泰证券	69,368,354.54	3.50
3	600690	青岛海尔	63,509,856.56	3.21
4	600729	重庆百货	61,827,781.48	3.12
5	600122	宏图高科	60,010,577.32	3.03
6	601299	中国北车	55,531,909.63	2.80
7	000957	中通客车	55,176,693.85	2.78
8	600271	航天信息	53,532,057.41	2.70
9	600759	正和股份	50,238,800.28	2.54
10	600837	海通证券	50,007,849.24	2.52
11	600480	凌云股份	49,789,615.24	2.51
12	600787	中储股份	44,296,768.55	2.24
13	002005	德豪润达	41,449,173.57	2.09
14	000848	承德露露	37,757,795.41	1.91
15	600552	方兴科技	33,718,723.83	1.70
16	600600	青岛啤酒	32,219,105.46	1.63
17	600038	哈飞股份	32,073,254.74	1.62
18	600525	长园集团	27,820,056.40	1.40
19	002050	三花股份	25,465,387.57	1.29
20	300353	东土科技	25,424,554.82	1.28

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300181	佐力药业	162,052,325.63	8.18
2	600584	长电科技	72,664,341.46	3.67
3	600729	重庆百货	65,756,786.34	3.32
4	002470	金正大	60,685,705.13	3.06
5	600109	国金证券	59,478,966.40	3.00
6	002005	德豪润达	57,940,775.20	2.92
7	000957	中通客车	57,824,828.74	2.92
8	600122	宏图高科	56,295,221.91	2.84
9	600303	曙光股份	55,437,003.12	2.80
10	600271	航天信息	55,277,787.16	2.79
11	601601	中国太保	52,979,579.66	2.67
12	600983	合肥三洋	50,519,349.96	2.55
13	600787	中储股份	42,155,725.68	2.13
14	000848	承德露露	40,850,654.77	2.06
15	600643	爱建股份	39,606,717.38	2.00
16	002612	朗姿股份	39,480,939.42	1.99
17	002185	华天科技	33,267,155.65	1.68
18	002108	沧州明珠	30,100,681.10	1.52
19	300202	聚龙股份	28,259,447.44	1.43
20	002460	赣锋锂业	26,998,611.69	1.36

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	1,404,793,038.56
卖出股票收入(成交)总额	1,766,274,645.47

注：本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	59,334,000.00	2.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	448,520,000.00	22.42
	其中：政策性金融债	448,520,000.00	22.42
4	企业债券	105,508,500.00	5.27
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	90,804,000.00	4.54
7	可转债	10,122,000.00	0.51
8	其他	-	-
9	合计	714,288,500.00	35.70

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110224	11国开24	1,000,000	100,010,000.00	5.00
2	098087	09中铝业债1	900,000	90,405,000.00	4.52
3	120246	12国开46	800,000	78,472,000.00	3.92
4	110257	11国开57	700,000	69,797,000.00	3.49
5	0982040	09沪电力MTN2	600,000	60,468,000.00	3.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：长盛同益封闭本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：长盛同益封闭本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：长盛同益封闭本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：长盛同益封闭本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

长盛同益封闭本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

长盛同益封闭本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：长盛同益封闭本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

长盛同益封闭本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2

长盛同益封闭投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,721,737.54
2	应收证券清算款	185,345,210.07
3	应收股利	-
4	应收利息	14,791,198.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	201,858,145.82

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：长盛同益封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：长盛同益封闭本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§7 投资组合报告(转型后)

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	764,662,987.12	40.01
	其中：股票	764,662,987.12	40.01
2	固定收益投资	60,198,000.00	3.15
	其中：债券	60,198,000.00	3.15
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	830,000,000.00	43.43
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	253,422,255.10	13.26
7	其他资产	2,819,132.19	0.15
8	合计	1,911,102,374.41	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	656,272,377.64	36.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,339,000.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	9,640,000.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,550,451.09	2.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	31,681,570.76	1.77
L	租赁和商务服务业	19,179,587.63	1.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	764,662,987.12	42.63

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细(转型后)

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000848	承德露露	3,200,000	63,584,000.00	3.54
2	600690	青岛海尔	4,100,000	60,516,000.00	3.37
3	000748	长城信息	2,499,902	56,672,778.34	3.16
4	601766	中国南车	11,500,000	51,750,000.00	2.89
5	002563	森马服饰	1,900,000	51,585,000.00	2.88
6	600597	光明乳业	2,999,759	48,116,134.36	2.68
7	600104	上汽集团	3,000,000	45,900,000.00	2.56
8	000625	长安汽车	3,400,044	41,854,541.64	2.33
9	600050	中国联通	11,000,000	35,530,000.00	1.98
10	600584	长电科技	4,000,000	35,320,000.00	1.97

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于http://csfunds.com.cn网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.3 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601766	中国南车	90,287,046.07	5.03
2	601992	金隅股份	70,570,428.35	3.93
3	000625	长安汽车	62,666,423.05	3.49
4	600998	九州通	62,428,738.05	3.48
5	000581	威孚高科	49,762,821.37	2.77
6	600597	光明乳业	49,500,624.00	2.76
7	600104	上汽集团	48,429,212.03	2.70
8	600835	上海机电	47,036,143.43	2.62
9	000401	冀东水泥	44,998,646.26	2.51
10	601318	中国平安	39,551,318.06	2.20
11	600050	中国联通	35,480,000.00	1.98
12	600369	西南证券	34,317,129.71	1.91
13	000001	平安银行	33,415,973.66	1.86
14	600837	海通证券	31,457,357.64	1.75
15	002368	太极股份	29,906,233.76	1.67
16	002294	信立泰	29,437,995.14	1.64
17	601808	中海油服	28,410,548.37	1.58
18	600699	均胜电子	27,090,121.72	1.51
19	002309	中利科技	26,545,738.67	1.48
20	600585	海螺水泥	25,998,422.07	1.45

7.4.4 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601688	华泰证券	94,433,402.82	5.26
2	000848	承德露露	86,993,085.13	4.85
3	600837	海通证券	82,833,043.12	4.62
4	600998	九州通	68,505,514.72	3.82
5	601992	金隅股份	65,115,875.53	3.63
6	600983	合肥三洋	55,157,544.66	3.07
7	600552	方兴科技	54,624,388.09	3.05
8	000581	威孚高科	48,715,969.63	2.72
9	600480	凌云股份	44,838,465.26	2.50
10	000401	冀东水泥	44,329,341.61	2.47
11	601299	中国北车	41,516,847.38	2.31
12	601318	中国平安	41,428,552.65	2.31
13	000748	长城信息	41,123,231.46	2.29
14	600584	长电科技	35,546,393.91	1.98
15	000001	平安银行	34,669,103.20	1.93
16	601766	中国南车	33,890,955.67	1.89
17	600369	西南证券	32,223,194.30	1.80
18	002368	太极股份	32,197,475.74	1.79
19	600038	哈飞股份	29,913,260.73	1.67
20	600109	国金证券	29,237,471.51	1.63

7.4.5 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	1,469,018,529.56
卖出股票收入(成交)总额	1,687,476,303.24

注：本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1