

长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金  
(原长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型)

2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》（“本基金合同”）、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》规定，于 2012 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

2012 年 4 月 10 日，本基金管理人就长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金（“长盛同庆封闭”）转型事宜召开了基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，对长盛同庆封闭实施转型，上述决议已获中国证监会核准。

2012 年 5 月 8 日，本基金管理人发布《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金之同庆 A、同庆 B 基金份额终止上市的公告》。自封闭期到期日次日即 2012 年 5 月 12 日起，长盛同庆封闭基金转型为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金，基础份额基金代码不变，仍为“160806”；由《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》生效，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》为准。相关公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（<http://www.szse.cn>）及本公司网站。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 5 月 12 日（基金合同生效日）起至 2012 年 6 月 30 日止（注：

长盛同庆封闭报告期为自 2012 年 1 月 1 日起至 2012 年 5 月 11 日（基金合同失效前日）止）。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	6
2.1	基金基本情况	6
2.2	基金产品说明	7
2.3	基金管理人和基金托管人	8
2.4	信息披露方式	9
2.5	其他相关资料	9
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	10
3.1	主要会计数据和财务指标	10
3.2	基金净值表现（长盛同庆中证 800 分级）	11
3.3	基金净值表现（长盛同庆封闭）	12
§ 4	管理人报告	14
4.1	基金管理人及基金经理情况	14
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
§ 5	托管人报告	19
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	19
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	19
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	20
6.1	资产负债表	20

6.2	利润表 .....	22
6.3	所有者权益(基金净值)变动表 .....	23
6.4	报表附注 .....	23
§ 7	半年度财务会计报告(未经审计) .....	43
7.1	资产负债表 .....	43
7.2	利润表 .....	45
7.3	所有者权益(基金净值)变动表 .....	46
7.4	报表附注 .....	47
§ 8	投资组合报告(长盛同庆中证 800 分级) .....	64
8.1	期末基金资产组合情况 .....	64
8.2	期末按行业分类的股票投资组合 .....	64
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	66
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	77
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	78
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 ..	78
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	78
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 ..	78
8.9	投资组合报告附注 .....	78
§ 9	投资组合报告(长盛同庆封闭) .....	80
9.1	期末基金资产组合情况 .....	80
9.2	期末按行业分类的股票投资组合 .....	80
9.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	81
9.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	81
9.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	82
9.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 ..	82
9.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	83
9.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 ..	83

9.9. 投资组合报告附注 .....	83
§ 10 基金份额持有人信息 .....	84
10.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	84
10.2 期末上市基金前十名持有人 .....	85
10.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	87
§ 11 开放式基金份额变动 .....	88
11.1 开放式基金份额变动（长盛同庆中证 800 分级） .....	88
11.2 开放式基金份额变动（长盛同庆封闭） .....	88
§ 12 重大事件揭示 .....	89
12.1 基金份额持有人大会决议 .....	89
12.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	89
12.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼 .....	89
12.4 基金投资策略的改变 .....	89
12.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	89
12.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	89
12.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	89
12.8 其他重大事件 .....	92
§ 13 影响投资者决策的其他重要信息 .....	95
§ 14 备查文件目录 .....	96
14.1 备查文件目录 .....	96
14.2 存放地点 .....	96
14.3 查阅方式 .....	96

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 基金基本情况（长盛同庆中证 800 分级）

基金名称	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金		
基金简称	长盛同庆中证 800 分级		
基金主代码	160806		
交易代码	160806		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 5 月 12 日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	5,241,812,646.61 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 5 月 31 日		
下属三级基金的基金简称	长盛同庆 800A	长盛同庆 800B	长盛同庆中证 800 分级
下属三级基金的交易代码	150098	150099	160806
报告期末下属三级基金的份额总额	1,337,546,640.00 份	2,006,319,961.00 份	1,897,946,045.61 份

#### 2.1.2 基金基本情况（长盛同庆封闭）

基金名称	长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金
基金简称	长盛同庆封闭
基金主代码	160806
交易代码	160806
基金运作方式	契约型。自 2009 年 5 月 12 日始，进入为期三年的封闭期。2012 年 5 月 11 日，封闭期届满，并于次日转型为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金。
基金合同生效日	2009 年 5 月 12 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

报告期末基金份额总额	14,686,733,239.06 份	
基金合同存续期	2009 年 5 月 12 日至 2012 年 5 月 11 日。于 2012 年 5 月 12 日转型为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金。	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2009 年 5 月 26 日	
下属分级基金的基金简称	长盛同庆封闭 A	长盛同庆封闭 B
下属分级基金的交易代码	150006	150007
报告期末下属分级基金的份额总额	5,874,693,295.62 份	8,812,039,943.44 份

注：长盛同庆封闭之长盛同庆封闭 A 和长盛同庆封闭 B 基金份额于 2012 年 5 月 14 日终止上市。

## 2.2 基金产品说明

### 2.2.1 基金产品说明（长盛同庆中证 800 分级）

投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现中证 800 指数的有效跟踪。
投资策略	<p>本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4% 的投资目标。</p> <p>当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 800 指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金将在基金合同生效 3 个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。</p>
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率（税后）}$
风险收益特征	本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。



下属三级基金的风险收益特征	长盛同庆 800A: 低风险、收益相对稳定。	长盛同庆 800B: 获取杠杆收益, 风险和预期收益均高于长盛同庆中证 800 分级份额。	长盛同庆中证 800 分级: 高风险、高预期收益。
---------------	------------------------	---	---------------------------

### 2.2.2 基金产品说明（长盛同庆封闭）

投资目标	长盛同庆封闭投资于具有稳健成长和业绩优良的上市公司股票, 力求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。		
投资策略	<p>长盛同庆封闭在股票投资上, 通过优选业绩优良、成长性稳定、在行业内具有核心竞争优势的上市公司股票进行投资, 以谋求基金资产的长期稳定增长。在对市场趋势的有效判断的前提下, 进行稳健的战略资产配置和积极的行业配置, 同时根据对上市公司充分的基本面分析, 挖掘行业中的价值个股。</p> <p>长盛同庆封闭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。在实际的投资运作中, 本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略, 获取债券市场的长期稳定收益。</p>		
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%		
风险收益特征	从基金资产整体运作来看, 长盛同庆封闭为股票型基金, 属于高风险、高收益的基金品种, 基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	长盛同庆封闭 A 将表现出低风险、收益相对稳定的特征。	长盛同庆封闭 B 将表现出高风险、收益相对较高的特征。	

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	尹东
	联系电话	010-82019988	010-67595003
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	Yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	010-67595096
传真		010-82255988	010-66275853
注册地址		深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元	北京市西城区金融大街 25 号

办公地址	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100088	100033
法定代表人	凤良志	王洪章

#### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

#### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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	长盛同庆中证 800 分级	长盛同庆封闭
	报告期 (2012 年 5 月 12 日 (基金合同生效日) 至 2012 年 6 月 30 日)	报告期 (2012 年 1 月 1 日至 2012 年 5 月 11 日 (基金合同失效前日))
本期已实现收益	26,533,618.78	227,841,572.69
本期利润	-197,475,616.65	1,064,448,346.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0298	0.0725
本期加权平均净值利润率	-3.13%	8.49%
本期基金份额净值增长率	-3.66%	8.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2012 年 6 月 30 日)	报告期末 (2012 年 5 月 11 日 (基金合同失效前日))
期末可供分配利润	-906,643,377.92	-1,762,279,957.17
期末可供分配基金份额利润	-0.1730	-0.1200
期末基金资产净值	5,035,603,209.33	12,925,228,407.02
期末基金份额净值	0.961	0.880
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2012 年 6 月 30 日)	报告期末 (2012 年 5 月 11 日 (基金合同失效前日))
基金份额累计净值增长率	-3.66%	-12.00%

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，长盛同庆中证 800 分级所列数据期末为 2012 年 6 月 30 日；长盛同庆封闭所列数据期末为 2012 年 5 月 11 日。

4、本基金由长盛同庆可分离交易型证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为 2012 年 5 月 12 日，截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

### 3.2 基金净值表现（长盛同庆中证 800 分级）

#### 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	-4.85%	0.91%	-6.39%	1.07%	1.54%	-0.16%
自基金转型日起至今	-3.66%	0.78%	-6.28%	1.06%	2.62%	-0.28%

注：本基金业绩比较基准=95%×中证 800 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。

基准指数：中证 800 指数。

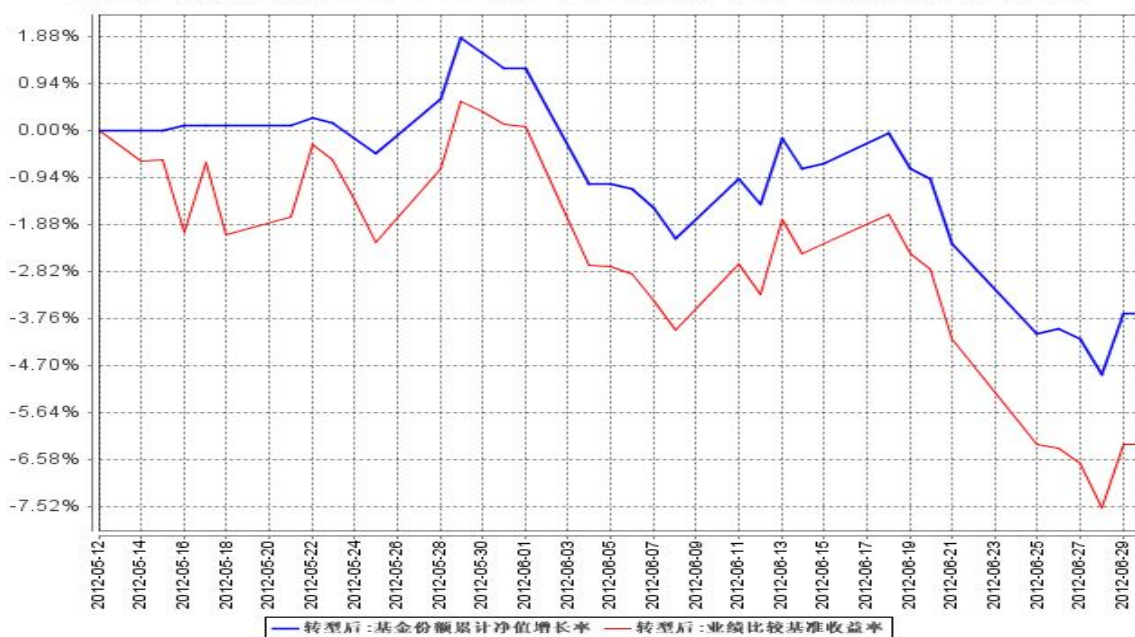
本基金的业绩比较基准中证 800 指数由中证指数有限公司构建和发布。具体的编制规则和再平衡过程请参见中证 800 指数编制细则（网址为：<http://www.csindex.com.cn/sseportal/csiportal/indexquery.do>）。

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，业绩比较基准中中证 800 指数、一年期银行定期存款每日按照 95%、5%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 自基金转型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

（2012 年 5 月 12 日至 2012 年 6 月 30 日）

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为 2012 年 5 月 12 日，截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为：投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0—3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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。

### 3.3 基金净值表现（长盛同庆封闭）

#### 3.3.1 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 (2012-5-1 至 2012-5-11)	1.03%	0.49%	0.43%	0.83%	0.60%	-0.34%
过去三个月 (2012-4-1 至 2012-5-11)	6.02%	0.69%	5.33%	0.77%	0.69%	-0.08%
过去六个月 (2012-1-1 至 2012-5-11)	8.91%	1.06%	9.11%	0.98%	-0.20%	0.08%
过去一年 (2011-7-1 至 2012-5-11)	-13.89%	1.03%	-7.64%	0.97%	-6.25%	0.06%
过去三年 (2009-7-1 至 2012-5-11)	-13.64%	1.26%	-7.72%	1.11%	-5.92%	0.15%
自基金合同生效起至今 (2009-5-12 至 2012-5-11)	-12.00%	1.23%	2.54%	1.10%	-14.54%	0.13%

注：长盛同庆封闭业绩比较基准 = 沪深 300 指数收益率 × 70% + 中证全债指数收益率 × 30%

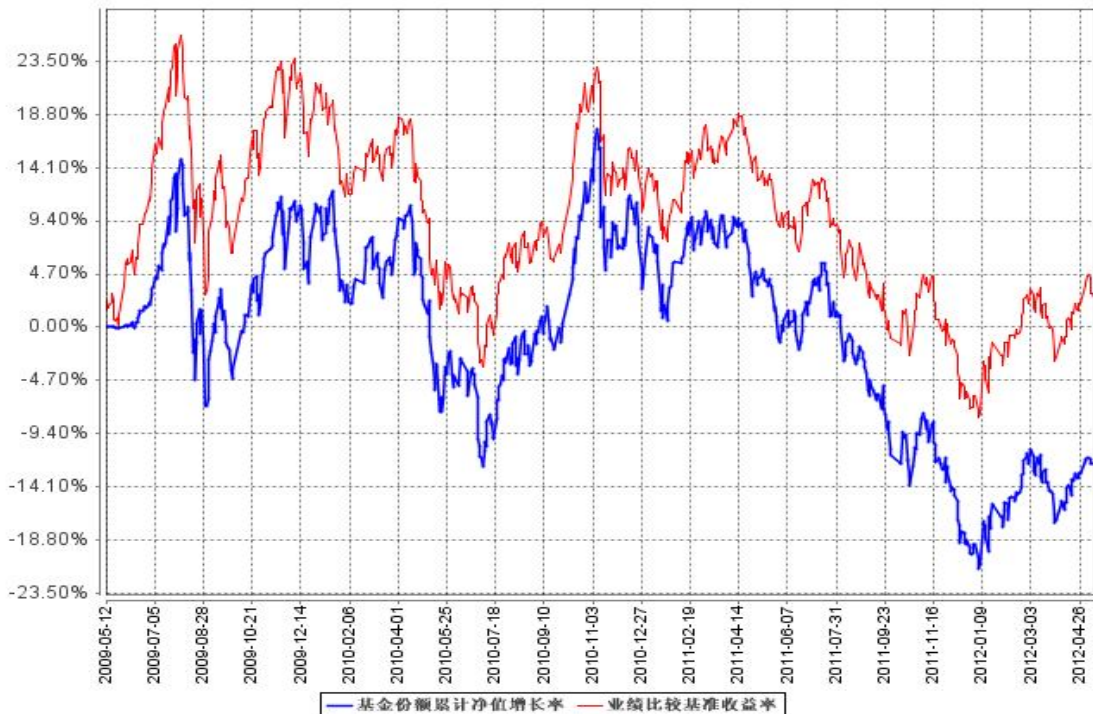
沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

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，基金基准指数每日按照 70%、30%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。

### 3.3.2 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

(2009年5月12日至2012年5月11日)  
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金存续期为 2009 年 5 月 12 日至 2012 年 5 月 11 日。

## § 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

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6号文件批准，于1999年3月成立，注册资本为人民币15000万元。目前，本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%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截止2012年6月30日，基金管理人共管理两支封闭式基金、十八支开放式基金，并于2002年12月，首批取得了全国社保基金管理资格。基金管理人于2007年9月，取得合格境内机构投资者资格，并于2008年2月，取得从事特定客户资产管理业务资格。

#### 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		
王宁	本基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，投资管理部总监。	2012年5月12日	—	14年	男，1971年10月出生，中国国籍。毕业于北京大学光华管理学院，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理等职务。现任投资管理部总监，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛同庆中证800指数分级证券投资基金（本基金）基金经理。
田间	本基金基金经理助理，行业研究员。	2012年5月12日	—	4年	女，1978年11月出生，中国国籍。毕业于中央财经大学，获硕士学位。自2008年7月起加入长盛基金管理有限公司，现任行业研究员，长盛同庆中证800指数分级证券投资基金（本基金）基金经理助理。

注：1、报经中国证券业协会同意，目前王超同志增任长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理，该基金由王宁同志和王超同志共同管理。该事项公司已于

2012年7月24日进行公告。

2、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；

3、“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》的相关规定等。

#### **4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明**

2012年1月1日至2012年5月11日，长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》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。

2012年5月12日长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型为长盛同庆中证800指数分级证券投资基金（“本基金”），即日起至报告期末，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、《长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金合同》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，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% 的交易共有 14 次，其中 1 次为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易，其余 13 次交易为长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金（“长盛同庆封闭”）转型期间和其他组合发生的反向交易。具体原因如下：

长盛同庆封闭于 2012 年 5 月 11 日结束三年封闭期，转型为开放式证券投资基金（以下简称“开放式基金”）。为确保转型后的开放式基金保持充裕流动性，以保障基金份额持有人利益，该基金制定了数量化组合投资交易策略，并报经公司投资决策委员会批准，打开交易所公开竞价同日反向交易控制，因此而产生 13 笔交易所公开竞价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 5% 的交易。

在此期间内，长盛同庆封闭严格执行既定数量化组合投资交易策略，批量下达投资指令。公司交易部对上述指令进行严格审核，在指令分发后，通过恒生交易系统自动委托交易程序执行指令，以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平，杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### **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**

2012 年上半年，国际市场方面，美国股市表现稳定，但是欧洲危机持续升温，希腊等危机严重的国家市场呈现不断下跌状态。

国内市场，虽然市场不断憧憬宏观预期经济政策有所放松和金融市场改革升温，房地产和金融行业股票表现出色，但是实际宏观经济和上市公司业绩不断低于预期，

打击国内市场不断下跌，只有食品饮料和生物医药等行业股票在下跌过程中持续战胜指数。

2012年上半年，长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金召开持有人大会，顺利通过和完成由主动基金向被动指数基金转型，在转型过程中股票仓位比例进行大规模调整，并继续利用市场资金阶段性紧张的机会，积极参与逆回购等交易提高组合资金利用效率。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至2012年6月30日，长盛同庆中证800分级份额净值为0.961元，本报告期（2012年5月12日至2012年6月30日）份额净值增长率为-3.66%，同期业绩比较基准增长率为-6.28%。

截至2012年5月11日，长盛同庆封闭份额净值为0.880元，本报告期（2012年1月1日至2012年5月11日）份额净值增长率为8.91%，同期业绩比较基准增长率为9.11%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

上半年，国内外市场在不断预期放松和救助的过程中，逐渐下跌，完全低于市场的想象。

由于欧洲危机属于格局性全面危机，可以预见短期之内难以出现实质性解决方案和完全好转迹象，市场仍然处在危机和拯救的不断反复过程中。

国内市场由于上市公司业绩整体低于预期，政策放松力度可能低于预期，行业和股票之间的差异会越来越大。

长盛同庆封闭2009年到2012年转型之前属于主动管理型积极投资基金，2012年5月由主动型基金转为指数基金，顺利完成转型，基金未来操作跟踪中证800指数，属于标准型指数基金，本基金将按照基金合同规定为基金持有人提供优良的指数投资工具。

#### **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）、投资管理部、金融工程及量化投资部、研究发展部、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。

本基金未签约与任何估值相关的定价服务。

#### **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》的规定及本基金基金合同第二十一节中对基金利润分配原则的约定，在本基金分级运作期内，本基金（包括长盛同庆800A、长盛同庆800B和长盛同庆中证800分级基金份额）不进行收益分配。

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定及《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》第十九节中对基金利润分配原则的约定，长盛同庆封闭在封闭期内不单独对基金份额所分离的长盛同庆封闭A与长盛同庆封闭B基金份额进行利润分配。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### （长盛同庆中证 800 分级）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛同庆中证800指数分级证券投资基金

报告截止日：2012年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	379,599,145.04
结算备付金		586,101,860.52
存出保证金		3,851,025.44
交易性金融资产	6.4.7.2	4,181,962,362.76
其中：股票投资		4,181,962,362.76
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	302,425.77
应收股利		7,360,665.34
应收申购款		49,524.56
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>5,159,227,009.43</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年6月30日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		97,036,363.48
应付赎回款		522,879.86
应付管理人报酬		4,348,504.88

应付托管费		956,671.06
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	18,252,039.83
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	2,507,340.99
<b>负债合计</b>		<b>123,623,800.10</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	5,942,246,587.25
未分配利润	6.4.7.10	-906,643,377.92
<b>所有者权益合计</b>		<b>5,035,603,209.33</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>5,159,227,009.43</b>

注：1、报告截止日2012年6月30日，基金份额净值：0.961元，基金份额总额：5,241,812,646.61份，其中：长盛同庆800A基金份额总额1,337,546,640.00份，长盛同庆800B基金份额总额2,006,319,961.00份，长盛同庆中证800分级1,897,946,045.61份。

2、本基金合同于2012年5月12日生效，本财务报表的实际编制期间为2012年5月12日(基金合同生效日)至2012年6月30日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证800指数分级证券投资基金

本报告期：2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年5月12日（基金合同 生效日）至2012年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>-175,429,842.74</b>
1. 利息收入		8,180,714.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,428,660.06
债券利息收入		1,270.85
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		5,750,783.90
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		29,786,822.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-11,051,351.13
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	492,762.25
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	40,345,411.49
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-224,009,235.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,611,855.27
<b>减：二、费用</b>		<b>22,045,773.91</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,761,764.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,927,588.23
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	11,274,894.75
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	81,526.16
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-197,475,616.65</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-197,475,616.65</b>

注：本基金合同于2012年5月12日生效，本财务报表的实际编制期间为2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日止期间。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛同庆中证800指数分级证券投资基金

本报告期：2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月12日（基金合同生效日）至2012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）	14,686,733,239.06	-1,761,504,832.04	12,925,228,407.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-197,475,616.65	-197,475,616.65
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）	-8,744,486,651.81	1,052,337,070.77	-7,692,149,581.04
其中：1. 基金申购款	959,924,211.08	-115,308,248.53	844,615,962.55
2. 基金赎回款	-9,704,410,862.89	1,167,645,319.30	-8,536,765,543.59
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）	5,942,246,587.25	-906,643,377.92	5,035,603,209.33

注：1、本基金合同于2012年5月12日生效，本财务报表的实际编制期间为2012年5月12日(基金合同生效日)至2012年6月30日止期间。

2、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

戴君棉

基金管理公司负责人

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

长盛同庆中证800指数分级证券投资基金是根据原长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金（以下简称“长盛同庆封闭”）基金份额持有人大会2012年4月10日决议通过的《关于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可字[2012]549号《关



于核准长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，由原长盛同庆封闭转型而来。原长盛同庆封闭为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易上市，存续期限至 2012 年 5 月 11 日止。根据深交所深证复[2012]116 号《终止上市通知书》，原长盛同庆封闭于 2012 年 5 月 11 日进行终止上市权利登记。自 2012 年 5 月 14 日起，原长盛同庆封闭终止上市，并更名为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》失效的同时《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原长盛同庆封闭于基金合同失效前未经审计的基金资产净值为 12,925,228,407.02 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。此外，根据基金合同、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金封闭期到期同庆 A、同庆 B 停止转托管业务并进行基金份额转换的公告》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金封闭期到期基金份额转换结果的公告》的规定，本基金的基金管理人于 2012 年 5 月 14 日对原长盛同庆封闭之同庆 A 和同庆 B 份额进行了基金份额转换，将原长盛同庆封闭之同庆 A 和同庆 B 份额折算为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“长盛同庆中证 800 分级份额”），并于 2012 年 5 月 14 日进行了变更登记。

根据基金合同和《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金进入分级运作期份额折算及分拆的公告》的规定，本基金自 2012 年 5 月 22 日起进入分级运作期，为期三年；分级运作期到期后，本基金将转换为上市开放式基金（LOF）。在分级运作期起始日，即 2012 年 5 月 22 日，本基金的基金管理人对长盛同庆中证 800 分级份额进行了份额折算，折算后长盛同庆中证 800 分级份额的份额净值为人民币 1.000 元。

根据基金合同的有关规定，本基金在分级运作期内的基金份额包括长盛同庆中证 800 分级份额、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（以下简称“同庆 800A 份额”）以及长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之积极收益类份额（以下简称“同庆 800B 份额”）。本基金在分级运作期起始日，场内长盛同庆中证 800 分级份额按 4:6 的比例分离成同庆 800A 份额和同庆 800B 份额，各类基金份额的

基金资产合并运作。

长盛同庆中证 800 分级份额只接受场外与场内申购和赎回，同庆 800A 份额和同庆 800B 份额可单独在上市交易但不接受申购和赎回。经深交所深证上[2012]137 号文核准，同庆 800A 份额和同庆 800B 份额于 2012 年 5 月 31 日在深交所挂牌交易。未上市交易的长盛同庆中证 800 分级份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可按照 4:6 的比例与同庆 800A 份额和同庆 800B 份额进行配对转换。

在分级运作期内，在自分级运作期起始日后满一年和满两年的对应日(若该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日)，本基金的基金管理人将根据基金合同的规定对长盛同庆中证 800 分级份额、同庆 800A 份额和同庆 800B 份额的基金份额进行份额折算；此外，若同庆 800B 份额的参考净值跌至 0.250 元以下，本基金的基金管理人还将根据基金合同的规定对长盛同庆中证 800 分级份额、同庆 800A 份额和同庆 800B 份额的基金份额进行不定期份额折算。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同的有关规定，本基金的投资范围为本基金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)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券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)。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率(税后)}$ 。

根据基金合同的规定，本基金的投资组合应在基金成立3个月内达到基金合同规定的比例限制。截至2012年6月30日止，本基金尚处于建仓期。

#### **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”)、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同庆中证800指数分级证券投资基金》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日止期间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2012年6月30日的财务状况以及2012年5月12日（基金合同生效日）至6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日。

##### **6.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **6.4.4.3.1 金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### **6.4.4.3.2 金融负债的分类**

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定及本基金基金合同第二十一节中对基金利润分配原则的约定，在本基金分级运作期内，本基金（包括长盛同庆800A、长盛同庆800B和长盛同庆中证800分级基金份额）不进行收益分配。

#### **6.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

#### **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**

本报告期不存在会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本报告期不存在差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

4、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
活期存款	379,599,145.04
定期存款	-
其他存款	-
合计	379,599,145.04

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,405,196,473.06	4,181,962,362.76	-223,234,110.30
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,405,196,473.06	4,181,962,362.76	-223,234,110.30

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本期末未无买入返售金融资产余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	65,054.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	237,371.31
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
<b>合计</b>	<b>302,425.77</b>

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	18,240,147.93
银行间市场应付交易费用	11,891.90
<b>合计</b>	<b>18,252,039.83</b>

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	2,250,000.00
预提费用	251,799.30
应付赎回费用	600.69
其他	4,941.00
<b>合计</b>	<b>2,507,340.99</b>

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	14,686,733,239.06	14,686,733,239.06
基金份额折算调整	-785,403,105.94	0.00



未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资本本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	954,057,794.13	959,924,211.08
本期赎回（以“-”号填列）	-9,613,575,280.64	-9,704,410,862.89
<b>本期末</b>	<b>5,241,812,646.61</b>	<b>5,942,246,587.25</b>

注：1、本基金合同于 2012 年 5 月 12 日生效，根据本基金基金合同的规定，投资者可申购、赎回长盛同庆中证 800 分级份额，长盛同庆 800A 和长盛同庆 800B 只可在深交所上市交易，因此上表不再单独披露长盛同庆 800A 和长盛同庆 800B 份额的情况。

2、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-1,762,279,957.17	775,125.13	-1,761,504,832.04
本期利润	26,533,618.78	-224,009,235.43	-197,475,616.65
本期基金份额交易产生的变动数	1,044,604,136.83	7,732,933.94	1,052,337,070.77
其中：基金申购款	-114,222,861.98	-1,085,386.55	-115,308,248.53
基金赎回款	1,158,826,998.81	8,818,320.49	1,167,645,319.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-691,142,201.56	-215,501,176.36	-906,643,377.92

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日
活期存款利息收入	1,624,694.62
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	803,965.44
其他	-
<b>合计</b>	<b>2,428,660.06</b>

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日
卖出股票成交总额	2,179,288,986.52

减：卖出股票成本总额	2,190,340,337.65
买卖股票差价收入	-11,051,351.13

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,225,033.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,731,000.00
减：应收利息总额	1,270.85
债券投资收益	492,762.25

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期未取得衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	40,345,411.49
基金投资产生的股利收益	-
合计	40,345,411.49

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	-224,009,235.43
——股票投资	-224,009,235.43
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-224,009,235.43

#### 6.4.7.17 其他收入

项目	本期
	2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日
赎回费收入	10,611,855.27
合计	10,611,855.27

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日
交易所市场交易费用	11,274,894.75
银行间市场交易费用	-
合计	11,274,894.75

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日
信息披露费	45,024.02
审计费用	21,858.00
深交所上市年费	8,197.00
银行划款费用	6,447.14
合计	81,526.16

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构
国元证券	基金管理人的股东、基金代销机构

#### 6.4.10 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。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年5月12日（基金合同生效日）至2012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	961,513,269.79	10.96%

###### 6.4.10.1.2 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	成交金额	占当期回购 成交总额的比例
国元证券	58,400,000,000.00	95.27%

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年5月12日（基金合同生效日）至2012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	818,573.21	11.02%	818,573.21	4.49%

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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年5月12日（基金合同生效日） 至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,761,764.77
其中：支付给销售机构的客户维护费	105,296.06

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值

1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,927,588.23

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.22\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期（2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日）未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金基金管理人于本报告期（2012年5月12日（基金合同生效日）至2011年6月30日）未投资本基金份额。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金其他关联方及其控制的机构于本报告期末（2012年6月30日）未投资本基金份额。

#### 6.4.10.5 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	
	2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	379,599,145.04	1,624,694.62

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内（2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日）未参与关联方承销证券交易。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明：无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
600499	科达机电	12/06/20	重大事项	10.28	12/07/02	10.11	448,135	4,359,731.01	4,606,827.80	
000059	辽通化工	12/06/26	重大事项	7.91	12/07/03	8.15	441,970	3,840,653.16	3,495,982.70	-

注：本基金截至2012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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与金融工程部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与金融工程部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于2012年6月30日，本基金未持有信用类债券，因此不存在重大信用风险。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门

设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及部分应收申购款等，大部分金融资产和金融负债不计息。因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。



#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6月30日	1年内	1至5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	379,599,145.04	-	-	-	379,599,145.04
结算备付金	586,101,860.52	-	-	-	586,101,860.52
存出保证金	-	-	-	3,851,025.44	3,851,025.44
交易性金融资产	-	-	-	4,181,962,362.76	4,181,962,362.76
应收利息	-	-	-	302,425.77	302,425.77
应收股利	-	-	-	7,360,665.34	7,360,665.34
应收申购款	-	-	-	49,524.56	49,524.56
<b>资产总计</b>	<b>965,701,005.56</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4,193,526,003.87</b>	<b>5,159,227,009.43</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	97,036,363.48	97,036,363.48
应付赎回款	-	-	-	522,879.86	522,879.86
应付管理人报酬	-	-	-	4,348,504.88	4,348,504.88
应付托管费	-	-	-	956,671.06	956,671.06
应付交易费用	-	-	-	18,252,039.83	18,252,039.83
其他负债	-	-	-	2,507,340.99	2,507,340.99
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>123,623,800.10</b>	<b>123,623,800.10</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>965,701,005.56</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4,069,902,203.77</b>	<b>5,035,603,209.33</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2012年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金原则上采用复制指数投资策略,股票资产跟踪的标的指数为中证800指数,通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中包括中证800指数成份股、备选成份股、新股(如一级市场初次发行或增发)等,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2012年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值的比例(%)
交易性金融资产—股票投资	4,181,962,362.76	83.05
衍生金融资产—权证投资	—	—
合计	4,181,962,362.76	83.05

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2012年6月30日,本基金运营不满一年,无足够历史数据分析其他价格风险敏感性。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2012年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具为交易性金融资

产和衍生工具金融资产，其中属于第一层级的余额为 4,173,859,552.26 元，属于第二层级的余额为 8,102,810.50 元，无属于第三层级的余额。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 半年度财务会计报告（未经审计）

（长盛同庆封闭）

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

报告截止日：2012年5月11日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012年5月11日 (基金合同失效前日)	上年度末 2011年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	12,815,591,683.55	1,317,365,083.78
结算备付金		109,411,764.71	10,979,311.55
存出保证金		3,851,025.44	8,440,908.16
交易性金融资产	7.4.7.2	5,861,400.96	8,280,594,406.28
其中：股票投资		5,861,400.96	8,280,594,406.28
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	12,800,000,000.00	2,557,755,036.63
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,153,172.17	4,198,253.83
应收股利		587,015.05	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>25,736,456,061.88</b>	<b>12,179,333,000.23</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年5月11日 (基金合同失效前日)</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,791,421,883.57	287,371,260.96
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		5,832,845.46	15,576,296.71
应付托管费		972,140.90	2,596,049.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	10,821,607.65	10,579,332.70
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,179,177.28	2,430,000.00
<b>负债合计</b>		<b>12,811,227,654.86</b>	<b>318,552,939.81</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	14,686,733,239.06	14,686,733,239.06
未分配利润	7.4.7.10	-1,761,504,832.04	-2,825,953,178.64
<b>所有者权益合计</b>		<b>12,925,228,407.02</b>	<b>11,860,780,060.42</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>25,736,456,061.88</b>	<b>12,179,333,000.23</b>

注：报告截止日2012年5月11日（基金合同失效前日），基金份额净值：0.880元，基金份额总额：14,686,733,239.06份，其中A类基金份额总额5,874,693,295.62份，B类基金份额总额8,812,039,943.44份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至 2012年5月11日 (基金合同失效前日)	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>1,177,798,284.31</b>	<b>-442,764,794.36</b>
1. 利息收入		36,602,508.96	38,187,585.71
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,613,809.73	13,420,313.74
债券利息收入		-	10,168.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		33,988,699.23	24,757,102.98
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		304,589,001.44	-257,724,588.02
其中：股票投资收益	7.4.7.12	299,327,595.28	-310,770,045.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	5,323,033.41
资产支持证券投资		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	5,261,406.16	47,722,424.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	836,606,773.91	-223,227,792.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		<b>113,349,937.71</b>	<b>185,104,638.24</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	67,733,436.13	115,033,964.32
2. 托管费	7.4.10.2.2	11,288,906.02	19,172,327.38
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	34,114,096.57	50,629,905.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	213,498.99	268,440.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,064,448,346.60</b>	<b>-627,869,432.60</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,064,448,346.60</b>	<b>-627,869,432.60</b>

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）		
	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）	14,686,733,239.06	-2,825,953,178.64	11,860,780,060.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,064,448,346.60	1,064,448,346.60
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）	14,686,733,239.06	-1,761,504,832.04	12,925,228,407.02
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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）	14,686,733,239.06	944,334,972.93	15,631,068,211.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-627,869,432.60	-627,869,432.60
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）	14,686,733,239.06	316,465,540.33	15,003,198,779.39

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

周 兵	杨思乐	戴君棉
基金管理人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金(以下简称“长盛同庆封闭”)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[2009]第 209 号《关于核准长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。长盛同庆封闭为契约型基金,封闭期为三年(含三年),封闭期届满后转为上市开放式基金(LOF),首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 14,685,567,143.82 元(其中场内募集人民币 4,853,047,143.82 元,场外募集人民币 9,832,520,000.00 元),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 093 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 5 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 14,686,733,239.06 份,其中认购资金利息折合 1,166,095.24 份,按照基金合同约定的 4:6 比例份额分离为同庆 A 基金份额 5,874,693,295.62 份和同庆 B 基金份额 8,812,039,943.44 份。长盛同庆封闭的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,长盛同庆封闭基金合同生效后,在封闭期内,基金份额持有人的总认购份额自动按 4:6 的比例分离成预期收益与风险不同的两个份额类别,即稳健收益类基金份额(基金份额简称“同庆 A 基金份额”)和积极收益类基金份额(基金份额简称“同庆 B 基金份额”),两类基金份额的基金资产合并运作。在封闭期末,长盛同庆封闭净资产优先分配同庆 A 基金份额的本金及约定应得收益;在优先分配同庆 A 基金份额的本金及约定应得收益后本基金的剩余净资产分配予同庆 B 基金份额。

深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2009]第 2009 号文审核同意,长



盛同庆封闭 13,216,295,898.00 份基金份额于 2009 年 5 月 26 日在深交所挂牌交易 (其中同庆 A 基金份额为 5,285,105,718.00 份,同庆 B 基金份额为 7,931,190,180.00 份)。在封闭期内,同庆 A 与同庆 B 两类基金份额同时在深交所分别上市和交易。初始基金份额持有人或二级市场投资者可以在市场内单独交易同庆 A 或者同庆 B 份额。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,长盛同庆封闭的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。长盛同庆封闭类别资产配置比例为:封闭期内股票投资占基金资产的比例为60%-100%,债券投资占基金资产的0%-40%;封闭期后股票投资占基金资产的比例为60%-95%,债券投资占基金资产的5%-40%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中,权证投资比例占基金资产净值的比例不高于3%。长盛同庆封闭基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

长盛同庆封闭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”)、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作。

根据《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》的规定,长盛同庆封闭存续期至2012年5月11日终止。经中国证监会批准并经深交所同意,长盛同庆封闭的基金管理人长盛基金管理有限公司已于长盛同庆封闭基金合同失效日转型为长盛同庆中证800指数分级证券投资基金并相应延长存续期至不定期,因此长盛同庆封闭财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

#### 7.4.3 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、完整地反映了长盛同庆封闭 2012

年 5 月 11 日（基金合同失效前日）的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 5 月 11 日（基金合同失效前日）期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 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。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本报告期不存在会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本报告期不存在会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本报告期不存在差错更正。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- 3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- 4、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2012年5月11日（基金合同失效前日）
活期存款	12,815,591,683.55
定期存款	-
其他存款	-
合计	12,815,591,683.55

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2012年5月11日（基金合同失效前日）		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,086,275.83	5,861,400.96	775,125.13
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
其他	-	-	-
合计	5,086,275.83	5,861,400.96	775,125.13

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

长盛同庆封闭本期末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末	
	2012年5月11日（基金合同失效前日）	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	12,800,000,000.00	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	12,800,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

长盛同庆封闭本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年5月11日（基金合同失效前日）
应收活期存款利息	1,025,584.62
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	127,587.55
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	1,153,172.17

#### 7.4.7.6 其他资产

长盛同庆封闭本期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年5月11日（基金合同失效前日）
交易所市场应付交易费用	10,809,715.75
银行间市场应付交易费用	11,891.90
合计	10,821,607.65

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年5月11日（基金合同失效前日）
应付券商交易单元保证金	2,000,000.00
预提费用	176,720.28
其他	2,457.00
合计	2,179,177.28

#### 7.4.7.9 实收基金

A类基金

金额单位：人民币元

长盛同庆封闭 A		
项目	本期 2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,874,693,295.62	5,874,693,295.62
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
<b>本期末</b>	<b>5,874,693,295.62</b>	<b>5,874,693,295.62</b>

B类基金

金额单位：人民币元

长盛同庆封闭B		
项目	本期 2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,812,039,943.44	8,812,039,943.44
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
<b>本期末</b>	<b>8,812,039,943.44</b>	<b>8,812,039,943.44</b>

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,990,121,529.86	-835,831,648.78	-2,825,953,178.64
本期利润	227,841,572.69	836,606,773.91	1,064,448,346.60
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
<b>本期末</b>	<b>-1,762,279,957.17</b>	<b>775,125.13</b>	<b>-1,761,504,832.04</b>

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）	
	活期存款利息收入	2,380,201.97
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	233,607.76	
其他	-	
<b>合计</b>	<b>2,613,809.73</b>	

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）	
	卖出股票成交总额	14,216,024,606.96
减：卖出股票成本总额	13,916,697,011.68	
买卖股票差价收入	299,327,595.28	

#### 7.4.7.13 债券投资收益

长盛同庆封闭本期未取得债券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

长盛同庆封闭本期未取得衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年5月11日(基金合同失效前日)
股票投资产生的股利收益	5,261,406.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,261,406.16

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年5月11日(基金合同失效前日)
1. 交易性金融资产	836,606,773.91
——股票投资	836,606,773.91
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	836,606,773.91

#### 7.4.7.17 其他收入

长盛同庆封闭本期未取得其他收入。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年5月11日(基金合同失效前日)
交易所市场交易费用	34,114,096.57
银行间市场交易费用	-
合计	34,114,096.57

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）	
信息披露费	97,376.40	
审计费用	57,705.12	
深交所上市年费	21,638.76	
持有人大会信息、公证费	13,500.00	
银行划款费	14,278.71	
债券托管账户维护费	9,000.00	
合计	213,498.99	

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与长盛同庆封闭的关系
长盛基金	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构
国元证券	基金管理人的股东、基金代销机构

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年5月11日 (基金合同失效前日)		2011年1月1日至2011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
国元证券	415,586,340.92	2.19%	6,650,556,354.52	20.61%

#### 7.4.10.1.2 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年5月11日 (基金合同失效前日)		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	成交金额	占当期回购 成交总额的比例	成交金额	占当期回购 成交总额的比例
国元证券	-	-	16,310,000,000.00	16.78%

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年5月11日 (基金合同失效前日)			
	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	353,247.48	2.21%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	5,652,960.38	20.88%	1,081,250.84	9.53%

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年5月11日 (基金合同失效前日)	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	67,733,436.13	115,033,964.32
其中：支付给销售机构的客户维护费	269,634.32	469,936.87

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。



#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年5月 11日（基金合同失效前日）	上年度可比期间 2011年1月1日 至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,288,906.02	19,172,327.38

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

本期 2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易 金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金 买入	基金 卖出	交易金额	利息收入	交易 金额	利息 支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易 金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金 买入	基金 卖出	交易金额	利息收入	交易 金额	利息 支出
中国建设银行	-	-	3,498,755,000.00	1,229,461.13	-	-

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

长盛同庆封闭基金管理人于本报告期（2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日））及上年度可比期间（2011年1月1日至2011年6月30日）均未投资长盛同庆封闭份额。

##### 7.4.10.4.2 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

长盛同庆封闭其他关联方及其控制的机构于本报告期末（2012年5月11日）（基金合同失效前日）及上年度末（2011年12月31日）均未投资长盛同庆封闭份额。

#### 7.4.10.5 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 2012年1月1日至2012年5月11日 (基金合同失效前日)		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
中国建设银行	12,815,591,683.55	2,380,201.97	1,631,862,938.38	12,707,684.32

注：长盛同庆封闭的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

长盛同庆封闭本报告期内(2012年1月1日至2012年5月11日(基金合同失效前日))及比较期内(2011年1月1日至2011年6月30日)未参与关联方承销证券交易。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明：无。

#### 7.4.11 利润分配情况

长盛同庆封闭本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末(2012年5月11日(基金合同失效前日))长盛同庆封闭持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
600096	云天化	12/02/10	重大事宜	16.04	12/06/06	17.64	365,424	5,086,275.83	5,861,400.96	-

注：长盛同庆封闭截至2012年5月11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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

长盛同庆封闭本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

长盛同庆封闭是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种。

长盛同庆封闭投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。长盛同庆封闭在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。长盛同庆封闭的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使长盛同庆封闭在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

长盛同庆封闭的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与金融工程部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。长盛同庆封闭的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与金融工程部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

长盛同庆封闭的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据长盛同庆封闭的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

长盛同庆封闭的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。长盛同庆封闭的银行存款存放在长盛同庆封闭的托管行中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。长盛同庆封闭在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

长盛同庆封闭的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级

评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于2012年5月11日（基金合同失效前日），长盛同庆封闭未持有信用类债券。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。长盛同庆封闭的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，长盛同庆封闭的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。长盛同庆封闭投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且长盛同庆封闭与由长盛同庆封闭的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。长盛同庆封闭所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据长盛同庆封闭的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，长盛同庆封闭可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

长盛同庆封闭所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此长盛同庆封闭的收入及经

营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。长盛同庆封闭的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年5月11日(基 金合同失效前日)	1年内	1至5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	12,815,591,683.55	-	-	-	12,815,591,683.55
结算备付金	109,411,764.71	-	-	-	109,411,764.71
存出保证金	-	-	-	3,851,025.44	3,851,025.44
交易性金融资产	-	-	-	5,861,400.96	5,861,400.96
买入返售金融资产	12,800,000,000.00	-	-	-	12,800,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,153,172.17	1,153,172.17
应收股利	-	-	-	587,015.05	587,015.05
<b>资产总计</b>	<b>25,725,003,448.26</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>11,452,613.62</b>	<b>25,736,456,061.88</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	12,791,421,883.57	12,791,421,883.57
应付管理人报酬	-	-	-	5,832,845.46	5,832,845.46
应付托管费	-	-	-	972,140.90	972,140.90
应付交易费用	-	-	-	10,821,607.65	10,821,607.65
其他负债	-	-	-	2,179,177.28	2,179,177.28
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>12,811,227,654.86</b>	<b>12,811,227,654.86</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>25,725,003,448.26</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-12,799,775,041.24</b>	<b>12,925,228,407.02</b>
上年度末 2011年12月31日	1年内	1至5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	1,317,365,083.78	-	-	-	1,317,365,083.78
结算备付金	10,979,311.55	-	-	-	10,979,311.55
存出保证金	-	-	-	8,440,908.16	8,440,908.16
交易性金融资产	-	-	-	8,280,594,406.28	8,280,594,406.28
买入返售金融资产	2,557,755,036.63	-	-	-	2,557,755,036.63
应收利息	-	-	-	4,198,253.83	4,198,253.83
<b>资产总计</b>	<b>3,886,099,431.96</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>8,293,233,568.27</b>	<b>12,179,333,000.23</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	287,371,260.96	287,371,260.96
应付管理人报酬	-	-	-	15,576,296.71	15,576,296.71
应付托管费	-	-	-	2,596,049.44	2,596,049.44
应付交易费用	-	-	-	10,579,332.70	10,579,332.70

其他负债	-	-	-	2,430,000.00	2,430,000.00
负债总计	-	-	-	318,552,939.81	318,552,939.81
利率敏感度缺口	3,886,099,431.96	-	-	7,974,680,628.46	11,860,780,060.42

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2012年5月11日（基金合同失效前日），长盛同庆封闭未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于长盛同庆封闭资产净值无重大影响（2011年12月31日：同）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。长盛同庆封闭的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。长盛同庆封闭主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

长盛同庆封闭的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。长盛同庆封闭的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

长盛同庆封闭通过投资组合的分散化降低其他价格风险。长盛同庆封闭封闭期内股票投资占基金资产的比例为60%-100%，债券投资占基金资产的0%-40%。此外，长盛同庆封闭的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012年5月11日 (基金合同失效前日)		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值的比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 的比例(%)
交易性金融资产—股票投资	5,861,400.96	0.05	8,280,594,406.28	69.81
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>5,861,400.96</b>	<b>0.05</b>	<b>8,280,594,406.28</b>	<b>69.81</b>

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对期末基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2012年5月11日 (基金合同失效前日)	上年度末 2011年12月31日
	业绩比较基准上升5%	-	627,602,900.36
	业绩比较基准下降5%	-	-627,602,900.36

于2012年5月11日(基金合同失效前日),长盛同庆封闭持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为0.05%,因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于长盛同庆封闭资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值

(不可观察输入值)。

于2012年5月11日(基金合同失效前日),长盛同庆封闭持有的以公允价值计量的金融工具为交易性金融资产和衍生工具金融资产,其中属于第二层级的余额为5,861,400.96元,无属于第一,第三层级的余额(2011年12月31日:第一层级的余额为8,280,594,406.28元,无属于第二,第三层级的余额)。

对于持有的重大事项停牌股票,长盛同庆封闭将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级,并于复牌后从第二层级转回第一层级(2011年度可比期间:同)。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## § 8 投资组合报告（长盛同庆中证 800 分级）

（报告期为 2012 年 5 月 12 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日）

### 8.1 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	4,181,962,362.76	81.06
	其中：股票	4,181,962,362.76	81.06
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	965,701,005.56	18.72
6	其他各项资产	11,563,641.11	0.22
7	合计	5,159,227,009.43	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	36,805,925.42	0.73
B	采掘业	376,159,459.29	7.47
C	制造业	1,602,824,519.72	31.83
C0	食品、饮料	315,207,707.91	6.26
C1	纺织、服装、皮毛	36,227,444.59	0.72
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	123,397,722.06	2.45
C5	电子	86,075,867.47	1.71
C6	金属、非金属	331,008,836.57	6.57
C7	机械、设备、仪表	478,416,817.52	9.50
C8	医药、生物制品	220,941,140.57	4.39
C99	其他制造业	11,548,983.03	0.23
D	电力、煤气及水的生产和供应业	102,517,826.76	2.04

E	建筑业	77,030,588.12	1.53
F	交通运输、仓储业	142,841,941.94	2.84
G	信息技术业	150,086,553.30	2.98
H	批发和零售贸易	143,301,977.30	2.85
I	金融、保险业	1,110,674,743.34	22.06
J	房地产业	282,723,944.83	5.61
K	社会服务业	46,730,584.30	0.93
L	传播与文化产业	32,596,967.45	0.65
M	综合类	77,667,330.99	1.54
	<b>合计</b>	<b>4,181,962,362.76</b>	<b>83.05</b>

### 8.2.2 期末积极投资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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	<b>合计</b>	-	-

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 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	601318	中国平安	2,463,148	112,664,389.52	2.24
2	000002	万科 A	11,425,267	101,799,128.97	2.02
3	600016	民生银行	16,604,411	99,460,421.89	1.98
4	600036	招商银行	9,091,647	99,280,785.24	1.97
5	601398	工商银行	19,358,548	76,466,264.60	1.52
6	601328	交通银行	16,834,309	76,427,762.86	1.52
7	600030	中信证券	5,810,258	73,383,558.54	1.46
8	600519	贵州茅台	305,220	72,993,363.00	1.45
9	601166	兴业银行	5,550,735	72,048,540.30	1.43
10	600000	浦发银行	8,226,617	66,882,396.21	1.33
11	600837	海通证券	5,949,446	57,293,164.98	1.14
12	601088	中国神华	2,424,906	54,511,886.88	1.08
13	601601	中国太保	2,310,195	51,240,125.10	1.02
14	000858	五粮液	1,395,197	45,706,653.72	0.91
15	600111	包钢稀土	1,068,112	42,147,699.52	0.84
16	601288	农业银行	14,310,479	37,064,140.61	0.74
17	600048	保利地产	3,148,915	35,708,696.10	0.71
18	000157	中联重科	3,230,026	32,397,160.78	0.64
19	000651	格力电器	1,548,436	32,284,890.60	0.64
20	002304	洋河股份	238,118	32,038,776.90	0.64
21	601169	北京银行	3,236,087	31,616,569.99	0.63
22	600031	三一重工	2,232,371	31,074,604.32	0.62
23	601006	大秦铁路	4,371,251	30,729,894.53	0.61
24	000001	深发展 A	1,883,893	28,559,817.88	0.57
25	002024	苏宁电器	3,085,768	25,889,593.52	0.51
26	601818	光大银行	8,919,655	25,331,820.20	0.50
27	600900	长江电力	3,637,319	24,733,769.20	0.49
28	600887	伊利股份	1,174,614	24,173,556.12	0.48
29	600015	华夏银行	2,517,440	23,840,156.80	0.47
30	601857	中国石油	2,608,423	23,606,228.15	0.47
31	600050	中国联通	6,234,222	23,191,305.84	0.46
32	600104	上汽集团	1,621,928	23,177,351.12	0.46

33	601899	紫金矿业	5,805,884	22,526,829.92	0.45
34	600585	海螺水泥	1,470,804	21,797,315.28	0.43
35	000568	泸州老窖	512,403	21,679,770.93	0.43
36	000776	广发证券	718,423	21,430,558.09	0.43
37	600383	金地集团	3,286,377	21,295,722.96	0.42
38	600256	广汇股份	1,546,236	20,827,798.92	0.41
39	000063	中兴通讯	1,446,470	20,192,721.20	0.40
40	601628	中国人寿	1,102,638	20,178,275.40	0.40
41	600999	招商证券	1,713,113	19,889,241.93	0.39
42	600028	中国石化	3,145,498	19,816,637.40	0.39
43	600795	国电电力	7,025,385	18,968,539.50	0.38
44	000983	西山煤电	1,159,351	18,085,875.60	0.36
45	600547	山东黄金	522,822	17,169,474.48	0.34
46	000069	华侨城A	2,671,246	17,042,549.48	0.34
47	601989	中国重工	3,235,199	16,790,682.81	0.33
48	600019	宝钢股份	3,862,115	16,684,336.80	0.33
49	000527	美的电器	1,493,826	16,506,777.30	0.33
50	000338	潍柴动力	555,946	16,506,036.74	0.33
51	601788	光大证券	1,237,893	16,303,050.81	0.32
52	600518	康美药业	1,033,283	15,933,223.86	0.32
53	000792	盐湖股份	468,273	15,813,579.21	0.31
54	600739	辽宁成大	1,004,370	15,668,172.00	0.31
55	600489	中金黄金	720,936	15,514,542.72	0.31
56	000423	东阿阿胶	384,332	15,377,123.32	0.31
57	600362	江西铜业	609,904	14,582,804.64	0.29
58	600276	恒瑞医药	507,267	14,563,635.57	0.29
59	601988	中国银行	5,123,077	14,447,077.14	0.29
60	601699	潞安环能	676,943	14,039,797.82	0.28
61	600690	青岛海尔	1,184,812	13,885,996.64	0.28
62	000629	攀钢钒钛	2,106,980	13,863,928.40	0.28
63	000895	双汇发展	222,715	13,781,604.20	0.27
64	600348	阳泉煤业	884,395	13,531,243.50	0.27
65	600089	特变电工	1,935,780	13,105,230.60	0.26
66	601600	中国铝业	2,114,576	13,046,933.92	0.26
67	000783	长江证券	1,432,247	13,033,447.70	0.26
68	601009	南京银行	1,526,799	13,008,327.48	0.26
69	600406	国电南瑞	695,523	12,999,324.87	0.26
70	601688	华泰证券	1,235,899	12,976,939.50	0.26
71	000024	招商地产	506,899	12,434,232.47	0.25

72	601299	中国北车	3,033,917	12,166,007.17	0.24
73	000538	云南白药	204,069	12,097,210.32	0.24
74	601168	西部矿业	1,402,240	12,003,174.40	0.24
75	601766	中国南车	2,596,452	11,839,821.12	0.24
76	601991	大唐发电	2,066,478	11,634,271.14	0.23
77	000402	金融街	1,780,515	11,626,762.95	0.23
78	000709	河北钢铁	3,909,479	10,672,877.67	0.21
79	600309	烟台万华	794,047	10,600,527.45	0.21
80	601919	中国远洋	2,265,300	10,510,992.00	0.21
81	601898	中煤能源	1,346,659	10,423,140.66	0.21
82	000100	TCL集团	4,976,582	10,102,461.46	0.20
83	000630	铜陵有色	522,619	10,086,546.70	0.20
84	601186	中国铁建	2,263,946	10,074,559.70	0.20
85	600068	葛洲坝	1,536,629	10,034,187.37	0.20
86	600100	同方股份	1,167,138	9,827,301.96	0.20
87	600600	青岛啤酒	255,482	9,756,857.58	0.19
88	601390	中国中铁	3,769,090	9,686,561.30	0.19
89	600642	申能股份	2,089,012	9,630,345.32	0.19
90	000878	云南铜业	520,170	9,311,043.00	0.18
91	600150	中国船舶	404,948	9,301,655.56	0.18
92	600660	福耀玻璃	1,180,192	9,229,101.44	0.18
93	600010	宝钢股份	1,887,906	9,212,981.28	0.18
94	000060	中金岭南	1,061,488	9,150,026.56	0.18
95	000623	吉林敖东	526,099	9,122,556.66	0.18
96	600123	兰花科创	503,342	9,090,356.52	0.18
97	600009	上海机场	709,111	9,034,074.14	0.18
98	601958	金钼股份	711,429	9,013,805.43	0.18
99	002106	莱宝高科	446,243	8,956,097.01	0.18
100	601618	中国中冶	3,575,281	8,866,696.88	0.18
101	600549	厦门钨业	200,602	8,808,433.82	0.17
102	601666	平煤股份	868,825	8,792,509.00	0.17
103	600875	东方电气	489,712	8,775,639.04	0.17
104	000425	徐工机械	607,031	8,704,824.54	0.17
105	600583	海油工程	1,429,098	8,703,206.82	0.17
106	000012	南玻A	966,496	8,698,464.00	0.17
107	600196	复星医药	839,512	8,655,368.72	0.17
108	000562	宏源证券	521,375	8,623,542.50	0.17
109	600863	内蒙华电	1,091,340	8,621,586.00	0.17
110	000009	中国宝安	850,250	8,502,500.00	0.17

111	002142	宁波银行	847,110	8,454,157.80	0.17
112	000039	中集集团	634,987	8,445,327.10	0.17
113	601117	中国化学	1,451,637	8,375,945.49	0.17
114	600085	同仁堂	478,934	8,357,398.30	0.17
115	600177	雅戈尔	980,973	8,328,460.77	0.17
116	600535	天士力	189,623	8,290,317.56	0.16
117	600188	兖州煤业	435,776	8,271,028.48	0.16
118	002422	科伦药业	176,649	8,242,442.34	0.16
119	600143	金发科技	1,358,222	8,108,585.34	0.16
120	601998	中信银行	2,025,728	8,102,912.00	0.16
121	002415	海康威视	293,955	7,995,576.00	0.16
122	000581	威孚高科	291,204	7,978,989.60	0.16
123	600005	武钢股份	2,962,295	7,968,573.55	0.16
124	000937	冀中能源	510,285	7,792,051.95	0.15
125	600415	小商品城	998,378	7,787,348.40	0.15
126	600066	宇通客车	346,185	7,775,315.10	0.15
127	601866	中海集运	3,071,105	7,769,895.65	0.15
128	600166	福田汽车	1,084,120	7,751,458.00	0.15
129	600369	西南证券	683,764	7,733,370.84	0.15
130	600271	航天信息	406,711	7,690,905.01	0.15
131	600881	亚泰集团	1,390,991	7,650,450.50	0.15
132	002155	辰州矿业	394,484	7,637,210.24	0.15
133	601111	中国国航	1,226,555	7,543,313.25	0.15
134	002202	金风科技	1,173,784	7,523,955.44	0.15
135	600267	海正药业	418,802	7,320,658.96	0.15
136	600376	首开股份	550,443	7,287,865.32	0.14
137	600694	大商股份	215,806	7,218,710.70	0.14
138	601808	中海油服	435,671	7,192,928.21	0.14
139	600809	山西汾酒	190,824	7,192,156.56	0.14
140	600115	东方航空	1,712,372	7,157,714.96	0.14
141	600029	南方航空	1,551,018	7,150,192.98	0.14
142	000768	西飞国际	910,250	7,145,462.50	0.14
143	600153	建发股份	985,207	7,054,082.12	0.14
144	600252	中恒集团	642,177	7,038,259.92	0.14
145	600058	五矿发展	314,846	7,030,511.18	0.14
146	000401	冀东水泥	496,302	6,978,006.12	0.14
147	600741	华域汽车	759,592	6,813,540.24	0.14
148	600497	驰宏锌锗	480,814	6,765,052.98	0.13
149	000729	燕京啤酒	926,589	6,764,099.70	0.13

150	000933	神火股份	740,475	6,753,132.00	0.13
151	000625	长安汽车	1,379,340	6,731,179.20	0.13
152	000869	张裕 A	99,816	6,713,624.16	0.13
153	600655	豫园商城	846,596	6,671,176.48	0.13
154	000960	锡业股份	332,679	6,553,776.30	0.13
155	600395	盘江股份	243,300	6,539,904.00	0.13
156	000800	一汽轿车	599,002	6,505,161.72	0.13
157	000422	湖北宜化	527,496	6,461,826.00	0.13
158	000758	中色股份	337,668	6,405,561.96	0.13
159	600832	东方明珠	1,169,964	6,282,706.68	0.12
160	000999	华润三九	287,013	6,271,234.05	0.12
161	000528	柳工	495,792	6,152,778.72	0.12
162	600779	水井坊	251,326	6,099,682.02	0.12
163	601333	广深铁路	2,073,773	6,096,892.62	0.12
164	600649	城投控股	843,062	6,086,907.64	0.12
165	601106	中国一重	1,919,632	6,066,037.12	0.12
166	601607	上海医药	566,969	6,049,559.23	0.12
167	600259	广晟有色	91,515	6,033,583.95	0.12
168	000825	太钢不锈	1,674,063	5,909,442.39	0.12
169	600804	鹏博士	983,320	5,840,920.80	0.12
170	600183	生益科技	1,130,852	5,823,887.80	0.12
171	000876	新希望	384,214	5,755,525.72	0.11
172	600839	四川长虹	2,715,844	5,730,430.84	0.11
173	600219	南山铝业	853,400	5,717,780.00	0.11
174	002385	大北农	293,958	5,702,785.20	0.11
175	600125	铁龙物流	669,736	5,679,361.28	0.11
176	600208	新湖中宝	1,369,317	5,655,279.21	0.11
177	002001	新和成	267,481	5,651,873.53	0.11
178	600702	沱牌舍得	153,196	5,553,355.00	0.11
179	600588	用友软件	360,671	5,503,839.46	0.11
180	600199	金种子酒	219,376	5,480,012.48	0.11
181	601888	中国国旅	194,038	5,475,752.36	0.11
182	000799	酒鬼酒	104,432	5,472,236.80	0.11
183	002038	双鹭药业	168,446	5,423,961.20	0.11
184	600458	时代新材	429,329	5,388,078.95	0.11
185	601001	大同煤业	491,868	5,385,954.60	0.11
186	600157	永泰能源	591,728	5,372,890.24	0.11
187	600673	东阳光铝	600,096	5,370,859.20	0.11
188	600811	东方集团	978,094	5,359,955.12	0.11

189	600829	三精制药	461,188	5,359,004.56	0.11
190	002482	广田股份	306,940	5,356,103.00	0.11
191	002475	立讯精密	181,205	5,354,607.75	0.11
192	600138	中青旅	297,599	5,350,830.02	0.11
193	002428	云南锗业	255,475	5,347,091.75	0.11
194	000522	白云山A	262,750	5,344,335.00	0.11
195	600983	合肥三洋	667,800	5,342,400.00	0.11
196	002477	雏鹰农牧	283,279	5,339,809.15	0.11
197	600366	宁波韵升	256,914	5,333,534.64	0.11
198	000823	超声电子	381,648	5,323,989.60	0.11
199	000708	大冶特钢	583,638	5,322,778.56	0.11
200	601717	郑煤机	458,300	5,316,280.00	0.11
201	002022	科华生物	489,342	5,309,360.70	0.11
202	600637	百视通	405,066	5,306,364.60	0.11
203	000685	中山公用	363,593	5,304,821.87	0.11
204	601011	宝泰隆	457,227	5,303,833.20	0.11
205	000900	现代投资	372,216	5,300,355.84	0.11
206	002340	格林美	398,173	5,299,682.63	0.11
207	600594	益佰制药	267,553	5,297,549.40	0.11
208	600816	安信信托	318,639	5,295,780.18	0.11
209	000898	鞍钢股份	1,357,517	5,294,316.30	0.11
210	600298	安琪酵母	214,682	5,283,324.02	0.10
211	000988	华工科技	383,637	5,282,681.49	0.10
212	002424	贵州百灵	315,977	5,279,975.67	0.10
213	000861	海印股份	332,068	5,279,881.20	0.10
214	000887	中鼎股份	621,799	5,279,073.51	0.10
215	600059	古越龙山	369,800	5,277,046.00	0.10
216	002308	威创股份	535,671	5,276,359.35	0.10
217	000826	桑德环境	230,265	5,273,068.50	0.10
218	002109	兴化股份	680,990	5,270,862.60	0.10
219	600017	日照港	1,906,900	5,263,044.00	0.10
220	601010	文峰股份	353,720	5,259,816.40	0.10
221	000410	沈阳机床	694,760	5,259,333.20	0.10
222	002250	联化科技	304,888	5,259,318.00	0.10
223	000998	隆平高科	294,850	5,257,175.50	0.10
224	601678	滨化股份	493,125	5,256,712.50	0.10
225	601801	皖新传媒	484,707	5,254,223.88	0.10
226	600651	飞乐音响	744,034	5,252,880.04	0.10
227	000612	焦作万方	452,369	5,252,004.09	0.10



228	000848	承德露露	299,250	5,251,837.50	0.10
229	600139	西部资源	571,400	5,251,166.00	0.10
230	600815	厦工股份	567,595	5,250,253.75	0.10
231	600704	物产中大	589,056	5,248,488.96	0.10
232	600880	博瑞传播	526,400	5,248,208.00	0.10
233	002534	杭锅股份	291,874	5,247,894.52	0.10
234	600835	上海机电	600,701	5,244,119.73	0.10
235	600761	安徽合力	607,779	5,239,054.98	0.10
236	002465	海格通信	231,812	5,238,951.20	0.10
237	002277	友阿股份	335,578	5,238,372.58	0.10
238	601311	骆驼股份	563,864	5,238,296.56	0.10
239	600884	杉杉股份	440,408	5,236,451.12	0.10
240	002223	鱼跃医疗	352,575	5,235,738.75	0.10
241	600079	人福医药	225,748	5,235,096.12	0.10
242	000930	中粮生化	1,077,077	5,234,594.22	0.10
243	600289	亿阳信通	855,200	5,233,824.00	0.10
244	000028	国药一致	175,719	5,232,911.82	0.10
245	002154	报喜鸟	383,902	5,232,584.26	0.10
246	600525	长园集团	740,821	5,230,196.26	0.10
247	600522	中天科技	612,920	5,228,207.60	0.10
248	600372	中航电子	290,562	5,227,210.38	0.10
249	600572	康恩贝	491,700	5,226,771.00	0.10
250	600439	瑞贝卡	964,120	5,225,530.40	0.10
251	600801	华新水泥	417,200	5,223,344.00	0.10
252	000877	天山股份	535,700	5,223,075.00	0.10
253	600575	芜湖港	674,775	5,222,758.50	0.10
254	000541	佛山照明	605,023	5,221,348.49	0.10
255	600563	法拉电子	342,101	5,220,461.26	0.10
256	601208	东材科技	715,028	5,219,704.40	0.10
257	000417	合肥百货	415,867	5,219,130.85	0.10
258	000987	广州友谊	394,756	5,218,674.32	0.10
259	600491	龙元建设	861,000	5,217,660.00	0.10
260	600748	上实发展	868,157	5,217,623.57	0.10
261	600388	龙净环保	210,785	5,214,820.90	0.10
262	600360	华微电子	1,323,528	5,214,700.32	0.10
263	600475	华光股份	417,164	5,214,550.00	0.10
264	000786	北新建材	402,865	5,213,073.10	0.10
265	000598	兴蓉投资	639,563	5,212,438.45	0.10
266	600581	八一钢铁	790,900	5,212,031.00	0.10

267	600893	航空动力	400,572	5,211,441.72	0.10
268	600723	首商股份	620,236	5,209,982.40	0.10
269	601107	四川成渝	1,505,359	5,208,542.14	0.10
270	600086	东方金钰	395,745	5,208,004.20	0.10
271	600469	风神股份	589,100	5,207,644.00	0.10
272	002470	金正大	393,255	5,206,696.20	0.10
273	600717	天津港	823,741	5,206,043.12	0.10
274	000830	鲁西化工	1,146,700	5,206,018.00	0.10
275	000973	佛塑科技	1,119,239	5,204,461.35	0.10
276	600487	亨通光电	270,751	5,203,834.22	0.10
277	600261	阳光照明	437,291	5,203,762.90	0.10
278	600386	北巴传媒	686,500	5,203,670.00	0.10
279	002007	华兰生物	211,687	5,203,266.46	0.10
280	600325	华发股份	610,712	5,203,266.24	0.10
281	000006	深振业A	911,215	5,203,037.65	0.10
282	000301	东方市场	1,745,376	5,201,220.48	0.10
283	600995	文山电力	751,552	5,200,739.84	0.10
284	600195	中牧股份	304,711	5,198,369.66	0.10
285	002237	恒邦股份	133,312	5,196,501.76	0.10
286	600787	中储股份	585,040	5,195,155.20	0.10
287	600240	华业地产	578,500	5,194,930.00	0.10
288	002092	中泰化学	679,051	5,194,740.15	0.10
289	600675	中华企业	1,109,605	5,192,951.40	0.10
290	002345	潮宏基	223,851	5,191,104.69	0.10
291	600004	白云机场	761,629	5,186,693.49	0.10
292	000089	深圳机场	1,268,100	5,186,529.00	0.10
293	000738	中航动控	518,501	5,185,010.00	0.10
294	600425	青松建化	438,200	5,183,906.00	0.10
295	600820	隧道股份	582,378	5,183,164.20	0.10
296	002479	富春环保	343,703	5,183,041.24	0.10
297	002123	荣信股份	455,600	5,180,172.00	0.10
298	600322	天房发展	1,450,333	5,177,688.81	0.10
299	002029	七匹狼	186,158	5,175,192.40	0.10
300	600496	精工钢构	667,720	5,174,830.00	0.10
301	600409	三友化工	792,073	5,172,236.69	0.10
302	601566	九牧王	185,686	5,171,355.10	0.10
303	000926	福星股份	553,599	5,170,614.66	0.10
304	601588	北辰实业	1,812,850	5,166,622.50	0.10
305	600467	好当家	727,180	5,162,978.00	0.10

306	000501	鄂武商 A	346,902	5,161,901.76	0.10
307	600521	华海药业	341,600	5,161,576.00	0.10
308	600428	中远航运	1,266,988	5,156,641.16	0.10
309	002410	广联达	210,021	5,153,915.34	0.10
310	000631	顺发恒业	999,718	5,148,547.70	0.10
311	600570	恒生电子	375,242	5,148,320.24	0.10
312	000822	山东海化	1,074,869	5,137,873.82	0.10
313	002179	中航光电	374,372	5,136,383.84	0.10
314	600597	光明乳业	550,600	5,131,592.00	0.10
315	600067	冠城大通	919,373	5,120,907.61	0.10
316	000616	亿城股份	1,395,310	5,106,834.60	0.10
317	601179	中国西电	1,282,916	5,106,005.68	0.10
318	000550	江铃汽车	238,548	5,092,999.80	0.10
319	600805	悦达投资	543,607	5,071,853.31	0.10
320	600337	美克股份	843,990	5,063,940.00	0.10
321	601101	昊华能源	294,967	5,049,835.04	0.10
322	600216	浙江医药	198,803	4,999,895.45	0.10
323	601918	国投新集	408,603	4,989,042.63	0.10
324	600827	友谊股份	440,007	4,976,479.17	0.10
325	600266	北京城建	326,740	4,963,180.60	0.10
326	600108	亚盛集团	1,001,939	4,939,559.27	0.10
327	600331	宏达股份	608,912	4,895,652.48	0.10
328	600895	张江高科	567,856	4,866,525.92	0.10
329	002230	科大讯飞	246,709	4,860,167.30	0.10
330	000718	苏宁环球	598,641	4,848,992.10	0.10
331	600320	振华重工	1,145,235	4,832,891.70	0.10
332	600062	双鹤药业	253,011	4,827,449.88	0.10
333	600997	开滦股份	454,810	4,761,860.70	0.09
334	000778	新兴铸管	703,802	4,708,435.38	0.09
335	600251	冠农股份	251,199	4,704,957.27	0.09
336	600718	东软集团	543,510	4,679,621.10	0.09
337	000969	安泰科技	381,536	4,666,185.28	0.09
338	000839	中信国安	692,063	4,650,663.36	0.09
339	600664	哈药股份	705,197	4,647,248.23	0.09
340	601126	四方股份	317,161	4,640,065.43	0.09
341	600499	科达机电	448,135	4,606,827.80	0.09
342	600132	重庆啤酒	213,181	4,602,577.79	0.09
343	600288	大恒科技	726,041	4,559,537.48	0.09
344	600635	大众公用	969,536	4,518,037.76	0.09

345	002146	荣盛发展	412,309	4,494,168.10	0.09
346	600859	王府井	163,636	4,477,080.96	0.09
347	600436	片仔癀	50,403	4,429,919.67	0.09
348	600550	天威保变	505,917	4,416,655.41	0.09
349	002069	獐子岛	209,676	4,371,744.60	0.09
350	600352	浙江龙盛	756,423	4,334,303.79	0.09
351	600498	烽火通信	163,054	4,322,561.54	0.09
352	000917	电广传媒	172,900	4,275,817.00	0.08
353	600221	海南航空	869,641	4,243,848.08	0.08
354	600118	中国卫星	335,514	4,224,121.26	0.08
355	600432	吉恩镍业	314,712	4,179,375.36	0.08
356	601158	重庆水务	708,396	4,172,452.44	0.08
357	600316	洪都航空	317,433	4,136,151.99	0.08
358	601558	华锐风电	589,718	4,133,923.18	0.08
359	600516	方大炭素	469,525	4,009,743.50	0.08
360	000807	云铝股份	676,387	3,983,919.43	0.08
361	600008	首创股份	810,277	3,962,254.53	0.08
362	600170	上海建工	548,394	3,959,404.68	0.08
363	601118	海南橡胶	575,682	3,954,935.34	0.08
364	000680	山推股份	671,820	3,930,147.00	0.08
365	600598	北大荒	522,792	3,894,800.40	0.08
366	002299	圣农发展	269,039	3,884,923.16	0.08
367	600812	华北制药	604,499	3,844,613.64	0.08
368	600508	上海能源	211,914	3,842,000.82	0.08
369	002128	露天煤业	291,902	3,818,078.16	0.08
370	601098	中南传媒	394,314	3,777,528.12	0.08
371	600169	太原重工	1,069,378	3,753,516.78	0.07
372	600770	综艺股份	325,256	3,733,938.88	0.07
373	600970	中材国际	322,546	3,722,180.84	0.07
374	002073	软控股份	436,380	3,656,864.40	0.07
375	600528	中铁二局	536,953	3,629,802.28	0.07
376	600418	江淮汽车	660,920	3,575,577.20	0.07
377	600500	中化国际	526,050	3,556,098.00	0.07
378	600037	歌华有线	468,945	3,531,155.85	0.07
379	000059	辽通化工	441,970	3,495,982.70	0.07
380	601377	兴业证券	323,581	3,391,128.88	0.07
381	601369	陕鼓动力	362,127	3,353,296.02	0.07
382	002344	海宁皮城	123,941	3,232,381.28	0.06
383	000961	中南建设	258,159	3,216,661.14	0.06

384	600109	国金证券	220,407	3,171,656.73	0.06
385	000780	平庄能源	299,483	3,138,581.84	0.06
386	600595	中孚实业	559,690	3,123,070.20	0.06
387	600971	恒源煤电	221,376	3,083,767.68	0.06
388	000686	东北证券	179,426	3,075,361.64	0.06
389	600546	山煤国际	146,464	3,064,026.88	0.06
390	601992	金隅股份	459,869	3,058,128.85	0.06
391	601933	永辉超市	112,819	3,057,394.90	0.06
392	600456	宝钛股份	158,456	2,974,219.12	0.06
393	000559	万向钱潮	587,534	2,955,296.02	0.06
394	002431	棕榈园林	112,787	2,908,776.73	0.06
395	000968	煤气化	189,076	2,883,409.00	0.06
396	002122	天马股份	438,166	2,830,552.36	0.06
397	600161	天坛生物	190,260	2,715,010.20	0.05
398	600096	云天化	204,443	2,710,914.18	0.05
399	601718	际华集团	853,959	2,698,510.44	0.05
400	600873	梅花集团	395,582	2,670,178.50	0.05
401	000021	长城开发	486,833	2,619,161.54	0.05
402	002493	荣盛石化	162,822	2,496,061.26	0.05
403	601258	庞大集团	383,147	2,337,196.70	0.05
404	600151	航天机电	349,947	2,264,157.09	0.04
405	002603	以岭药业	81,853	2,255,050.15	0.04
406	600380	健康元	452,316	2,211,825.24	0.04
407	600737	中粮屯河	367,037	2,187,540.52	0.04
408	600307	酒钢宏兴	598,898	2,078,176.06	0.04
409	002405	四维图新	170,130	2,031,352.20	0.04
410	002378	章源钨业	63,121	1,998,410.86	0.04
411	601233	桐昆股份	212,571	1,857,870.54	0.04
412	600481	双良节能	240,251	1,720,197.16	0.03
413	601268	二重重装	249,910	1,531,948.30	0.03
414	601216	内蒙君正	190,158	1,325,401.26	0.03
415	002594	比亚迪	57,899	1,149,874.14	0.02
416	601519	大智慧	205,087	1,060,299.79	0.02
417	002498	汉缆股份	58,299	619,718.37	0.01

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	600016	民生银行	158,682,735.77	3.15
2	601318	中国平安	158,374,666.49	3.15
3	000002	万科 A	154,597,403.39	3.07
4	600036	招商银行	153,675,565.95	3.05
5	601398	工商银行	119,695,657.02	2.38
6	601328	交通银行	116,221,905.93	2.31
7	600030	中信证券	114,970,768.81	2.28
8	601166	兴业银行	111,904,650.44	2.22
9	600000	浦发银行	109,593,341.99	2.18
10	600519	贵州茅台	100,987,868.56	2.01
11	601088	中国神华	94,805,637.41	1.88
12	600837	海通证券	94,435,458.01	1.88
13	000858	五粮液	83,547,035.30	1.66
14	600111	包钢稀土	83,196,875.79	1.65
15	601601	中国太保	72,457,244.99	1.44
16	000157	中联重科	61,405,082.50	1.22
17	601288	农业银行	57,827,990.35	1.15
18	600048	保利地产	57,606,080.92	1.14
19	600031	三一重工	50,422,125.39	1.00
20	000651	格力电器	50,375,983.99	1.00

### 8.4.2 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	601318	中国平安	56,555,839.57	1.12
2	000002	万科 A	52,494,522.46	1.04
3	600016	民生银行	50,746,774.01	1.01
4	600036	招商银行	46,309,983.84	0.92
5	601398	工商银行	38,349,533.55	0.76
6	600030	中信证券	37,777,552.17	0.75
7	000858	五粮液	37,481,490.64	0.74
8	600111	包钢稀土	36,990,905.02	0.73
9	601166	兴业银行	36,536,826.35	0.73
10	600000	浦发银行	35,614,120.49	0.71
11	601328	交通银行	35,222,903.91	0.70
12	600837	海通证券	34,806,701.07	0.69

13	600519	贵州茅台	33,478,979.05	0.66
14	601088	中国神华	29,764,583.98	0.59
15	000157	中联重科	28,092,277.72	0.56
16	601601	中国太保	24,039,098.11	0.48
17	600048	保利地产	22,469,992.20	0.45
18	601288	农业银行	19,426,685.58	0.39
19	600256	广汇股份	18,290,317.28	0.36
20	002024	苏宁电器	17,300,276.35	0.34

#### 8.4.3 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	6,590,450,534.88
卖出股票收入（成交）总额	2,179,288,986.52

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

#### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本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。

#### 8.9.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	7,360,665.34
4	应收利息	302,425.77
5	应收申购款	49,524.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,563,641.11

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 8.9.6 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。



## § 9 投资组合报告（长盛同庆封闭）

（报告期为 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 5 月 11 日（基金合同失效前日））

### 9.1 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	5,861,400.96	0.02
	其中：股票	5,861,400.96	0.02
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	12,800,000,000.00	49.73
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	12,925,003,448.26	50.22
6	其他各项资产	5,591,212.66	0.02
7	合计	25,736,456,061.88	100.00

### 9.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	5,861,400.96	0.05
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,861,400.96	0.05
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-

G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	5,861,400.96	0.05

### 9.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600096	云天化	365,424	5,861,400.96	0.05

注：长盛同庆封闭报告期末仅持有一只股票。

### 9.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 9.4.1 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	601318	中国平安	160,792,525.74	1.36
2	601166	兴业银行	116,510,005.36	0.98
3	601088	中国神华	93,354,244.73	0.79
4	600519	贵州茅台	91,135,857.16	0.77
5	601601	中国太保	75,993,637.96	0.64
6	601398	工商银行	74,303,851.75	0.63
7	601006	大秦铁路	64,848,374.80	0.55
8	601288	农业银行	57,135,611.06	0.48
9	002024	苏宁电器	51,744,464.97	0.44
10	000651	格力电器	50,632,798.11	0.43
11	000157	中联重科	50,352,230.73	0.42
12	600048	保利地产	49,736,346.14	0.42
13	000001	深发展 A	49,037,572.87	0.41
14	600031	三一重工	48,763,611.21	0.41
15	600111	包钢稀土	48,229,504.61	0.41
16	000858	五粮液	48,095,291.14	0.41
17	600015	华夏银行	47,428,661.37	0.40
18	601169	北京银行	45,990,793.06	0.39
19	600104	上汽集团	44,994,844.53	0.38
20	601818	光大银行	42,695,747.30	0.36

#### 9.4.2 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	600016	民生银行	664,323,277.39	5.60
2	600036	招商银行	605,451,681.55	5.10
3	601628	中国人寿	548,911,793.63	4.63
4	600050	中国联通	462,769,864.51	3.90
5	600000	浦发银行	459,988,653.91	3.88
6	000002	万科A	434,785,509.32	3.67
7	600030	中信证券	377,073,139.54	3.18
8	601989	中国重工	339,571,230.83	2.86
9	600085	同仁堂	290,866,142.83	2.45
10	600837	海通证券	285,160,252.99	2.40
11	601328	交通银行	267,076,388.67	2.25
12	600839	四川长虹	231,814,652.14	1.95
13	600010	包钢股份	215,087,145.37	1.81
14	601186	中国铁建	214,163,906.48	1.81
15	601918	国投新集	204,835,467.18	1.73
16	600028	中国石化	197,447,334.22	1.66
17	601299	中国北车	191,460,299.09	1.61
18	600309	烟台万华	179,116,490.72	1.51
19	600582	天地科技	176,178,123.12	1.49
20	600060	海信电器	175,564,743.64	1.48

#### 9.4.3 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	4,805,357,232.45
卖出股票收入（成交）总额	14,216,024,606.96

注：本项中 9.4.1、9.4.2、9.4.3 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。

#### 9.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

长盛同庆封闭本报告期末未持有债券。

#### 9.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有债券。

## 9.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有资产支持证券。

## 9.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有权证。

## 9.9. 投资组合报告附注

### 9.9.1 声明长盛同庆封闭投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告期内长盛同庆封闭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。

### 9.9.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

长盛同庆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。

### 9.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	587,015.05
4	应收利息	1,153,172.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

### 9.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 9.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

### 9.9.6 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。

## § 10 基金份额持有人信息

### 10.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 10.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构（长盛同庆中证 800 分级）

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长盛同庆800A	16,173	82,702.44	864,987,966.00	64.67%	472,558,674.00	35.33%
长盛同庆800B	18,272	109,802.98	853,613,168.00	42.55%	1,152,706,793.00	57.45%
长盛同庆中证800分级	7,172	264,632.74	1,682,840,785.68	88.67%	215,105,259.93	11.33%
<b>合计</b>	<b>41,617</b>	<b>125,953.64</b>	<b>3,401,441,919.68</b>	<b>64.89%</b>	<b>1,840,370,726.93</b>	<b>35.11%</b>

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

#### 10.1.2 期末（2012年5月11日（基金合同失效前日））基金份额持有人户数及持有人结构（长盛同庆封闭）

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长盛同庆封闭A	12,331	476,416.62	4,261,505,680.72	72.54%	1,613,187,614.90	27.46%
长盛同庆封闭B	27,342	322,289.52	4,923,387,691.67	55.87%	3,888,652,251.77	44.13%
<b>合计</b>	<b>39,673</b>	<b>370,194.67</b>	<b>9,184,893,372.39</b>	<b>62.54%</b>	<b>5,501,839,866.67</b>	<b>37.46%</b>

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

## 10.2 期末上市基金前十名持有人

### 10.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构（长盛同庆中证 800 分级）

#### 长盛同庆 800A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	106,310,303.00	7.95%
2	幸福人寿保险股份有限公司—分红	83,020,775.00	6.21%
3	中国银河证券股份有限公司	50,000,000.00	3.74%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	47,415,898.00	3.54%
5	华西证券有限责任公司	45,000,000.00	3.36%
6	信诚人寿保险有限公司—分红—一个险分红	42,065,134.00	3.14%
7	中国民生银行股份有限公司企业年金计划—中国民生银行	34,926,701.00	2.61%
8	东证资管—工行—东方红—新睿 2 号集合资产管理计划	31,767,981.00	2.38%
9	中国人寿再保险股份有限公司	25,373,980.00	1.90%
10	信诚人寿保险有限公司	24,300,392.00	1.82%

#### 长盛同庆 800B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	159,465,454.00	7.95%
2	幸福人寿保险股份有限公司—分红	124,531,162.00	6.21%
3	中国银河证券股份有限公司	72,000,000.00	3.59%
4	信诚人寿保险有限公司—分红—一个险分红	63,097,700.00	3.14%
5	上海平高世贸中心商业投资管理有限公司	60,147,346.00	3.00%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	53,123,975.00	2.65%
7	西南证券股份有限公司	48,063,620.00	2.40%
8	中国太平洋财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品—013C-CT001 深	33,568,848.00	1.67%
9	幸福人寿保险股份有限公司—自有资金	30,365,997.00	1.51%
10	光大证券—光大—光大阳光基中宝（阳光 2 号二期）集合资产	29,797,541.00	1.49%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

10.2.2 期末（2012年5月11日（基金合同失效前日））基金份额持有人户数及持有人结构（长盛同庆封闭）

长盛同庆封闭 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	国泰君安证券股份有限公司	230,034,844.00	4.67%
2	长江证券股份有限公司	219,185,709.00	4.45%
3	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC	206,132,576.00	4.19%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	205,792,982.00	4.18%
5	红塔证券股份有限公司	173,835,504.00	3.53%
6	厦门国际信托有限公司	172,874,159.00	3.51%
7	中海信托股份有限公司—浦江之星75号	171,626,696.00	3.49%
8	中国人民人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	144,514,118.00	2.93%
9	财通证券有限责任公司	120,000,000.00	2.44%
10	华润深国投信托有限公司—礼一避险一号结构化证券投资集合信托	108,470,000.00	2.20%

长盛同庆封闭 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	幸福人寿保险股份有限公司—分红	300,905,484.00	5.66%
2	红塔证券股份有限公司	213,280,178.00	4.02%
3	王荣	176,468,658.00	3.32%
4	杨蓉娣	176,128,170.00	3.32%
5	信诚人寿保险有限公司—分红—一个险分红	152,463,398.00	2.87%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	128,363,818.00	2.42%
7	中英人寿保险有限公司	119,333,214.00	2.25%
8	东航集团财务有限责任公司	104,001,270.00	1.96%
9	中国人民财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	88,524,941.00	1.67%
10	信诚人寿保险有限公司	88,075,802.00	1.66%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 10.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

#### 10.3.1 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况(长盛同庆中证 800 分级)

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	长盛同庆 800A	-	-
	长盛同庆 800B	-	-
	长盛同庆中证 800 分级	-	-
	合计	-	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0万份。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0万份。

#### 10.3.2 期末(2012年5月11日(基金合同失效前日))基金管理人的从业人员持有本基金的情况(长盛同庆封闭)

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	长盛同庆封闭 A	-	-
	长盛同庆封闭 B	-	-
	合计	-	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0万份。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0万份。



## § 11 开放式基金份额变动

### 11.1 开放式基金份额变动（长盛同庆中证 800 分级）

单位：份

项目	长盛同庆 800A	长盛同庆 800B	长盛同庆中证 800 分级
基金合同生效日（2012 年 5 月 12 日）基金份额总额	-	-	14,686,733,239.06
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	954,057,794.13
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	9,613,575,280.64
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	1,337,546,640.00	2,006,319,961.00	-4,129,269,706.94
报告期期末基金份额总额	1,337,546,640.00	2,006,319,961.00	1,897,946,045.61

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

### 11.2 开放式基金份额变动（长盛同庆封闭）

单位：份

项目	长盛同庆封闭 A	长盛同庆封闭 B
基金合同生效日（2009 年 5 月 12 日）基金份额总额	5,874,693,295.62	8,812,039,943.44
本报告期期初基金份额总额	5,874,693,295.62	8,812,039,943.44
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末（2012 年 5 月 11 日（基金合同失效前日））基金份额总额	5,874,693,295.62	8,812,039,943.44

注：本基金封闭期为三年，自 2009 年 5 月 12 日起，至 2012 年 5 月 11 日（基金合同失效前日）止。封闭期内不接受投资者的申购与赎回。

## § 12 重大事件揭示

### 12.1 基金份额持有人大会决议

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金于 2012 年 4 月 10 日召开了基金份额持有人大会，通过了《关于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型有关事项的议案》的决议。

### 12.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 12.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本报告期本基金管理人的高级管理人员未曾变动。

#### 12.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 12.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

### 12.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 12.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

### 12.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 12.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 12.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

下表数据为长盛同庆中证 800 分级与长盛同庆封闭 2012 年 1 月 1 日至 6 月 30 日租用证券公司交易单元发生交易量和应付券商佣金的合计数。

### 12.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
海通证券	1	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-
申银万国	1	3,168,971,684.00	11.41%	2,709,082.44	11.57%
国泰君安	1	3,298,101,269.35	11.88%	2,803,380.24	11.98%
银河证券	1	8,247,079,628.76	29.71%	7,035,726.76	30.06%
国元证券	1	1,377,099,610.71	4.96%	1,171,820.69	5.01%
招商证券	1	-	-	-	-
中投证券	1	378,895,756.66	1.36%	322,060.10	1.38%
中金公司	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-
长江证券	1	432,929,500.15	1.56%	367,989.50	1.57%
东兴证券	1	970,489,557.24	3.50%	824,917.43	3.52%
中航证券	1	954,147,646.01	3.44%	776,686.40	3.32%
东方证券	1	-	-	-	-
东北证券	1	4,262,903,157.26	15.35%	3,483,388.95	14.88%
光大证券	1	1,908,910,921.99	6.88%	1,563,127.26	6.68%
红塔证券	1	2,008,741,814.01	7.24%	1,707,421.96	7.29%
民生证券	1	754,969,399.76	2.72%	641,723.50	2.74%

### 12.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		回购交易	
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
海通证券	1	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	15,500,000,000.00	10.32%
国泰君安	1	-	-	31,000,000,000.00	20.64%
银河证券	1	8,225,033.10	100.00%	20,600,000,000.00	13.72%

国元证券	1	-	-	58,400,000,000.00	38.88%
招商证券	1	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	8,100,000,000.00	5.39%
中航证券	1	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	9,900,000,000.00	6.59%
民生证券	1	-	-	6,700,000,000.00	4.46%

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导

审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

### 3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	光大证券	深圳	1
2	红塔证券	上海	1
3	民生证券	上海	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

### 12.8 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事件如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加华龙证券为旗下开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2012-06-29
2	关于增加国金证券为旗下开放式基金代销机构的公告	同上	2012-06-29
3	长盛基金管理有限公司关于旗下基金持有“伊利股份”估值方法调整的公告	同上	2012-06-16
4	关于增加中国民生银行为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	同上	2012-06-01
5	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金开通份额配对转换的公告	同上	2012-05-31
6	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之同庆 800A 与同庆 800B 基金份额上市交易提示性公告	同上	2012-05-31
7	关于长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金开通部分银行定投业务及参与部分银行网上交易申购费率优惠活动的公告	同上	2012-05-31
8	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金开放日常转换业务的公告	同上	2012-05-31
9	长盛基金管理有限公司关于增加长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金代销机构的公告	同上	2012-05-31
10	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之同庆 800A 与同庆 800B 基金份额上市交易公告书	同上	2012-05-28

11	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金恢复申购、赎回、定期定额投资、跨系统转托管业务的公告	同上	2012-05-28
12	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金分级运作期起始长盛同庆份额折算及分拆结果的公告	同上	2012-05-24
13	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之同庆 800A 份额约定年收益率的公告	同上	2012-05-23
14	长盛同庆中证 800 指数分级基金进入分级运作期份额折算及分拆的公告	同上	2012-05-18
15	长盛同庆中证 800 指数分级基金赎回限定期结束暂停申购、赎回、定期定额投资及跨系统转托管业务的公告	同上	2012-05-18
16	关于长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金申购费率优惠及定期定额投资业务的公告	同上	2012-05-15
17	长盛基金管理有限公司关于增加长盛同庆中证 800 指数分级基金代销机构的公告	同上	2012-05-15
18	长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金封闭期到期基金份额转换结果的公告	同上	2012-05-15
19	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金赎回限定期开放申购、赎回和跨系统转托管业务的提示性公告	同上	2012-05-15
20	关于长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金开通跨系统转托管业务的公告	同上	2012-05-11
21	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金进入赎回限定期，开放申购、赎回和定期定额投资业务的公告	同上	2012-05-11
22	长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金之同庆 A、同庆 B 基金份额终止上市提示性公告	同上	2012-05-11
23	长盛同庆可分离交易基金基金名称变更的公告	同上	2012-05-09
24	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书及基金合同摘要	同上	2012-05-08
25	长盛同庆可分离交易基金之同庆 A、同庆 B 基金份额终止上市的公告	同上	2012-05-08
26	长盛同庆可分离交易基金封闭期到期同庆 A、同庆 B 停止转托管业务并进行基金份额转换的公告	同上	2012-05-08
27	长盛同庆可分离交易基金份额持有人大会决议公告	同上	2012-04-26
28	长盛基金管理有限公司上海分公司注册地址及负责人变更的公告	同上	2012-04-17
29	关于长盛同庆基金份额持有人大会表决结果的公告	同上	2012-04-11
30	长盛同庆基金召开基金份额持有人大会第七次提示性公告	同上	2012-04-05
31	关于长盛同庆基金召开基金份额持有人大会的通知	同上	2012-03-30
32	长盛同庆基金之同庆 A、同庆 B 停牌的第三次提示性公告	同上	2012-03-30
33	长盛同庆基金召开基金份额持有人大会第六次提示性公告	同上	2012-03-30
34	关于长盛同庆基金召开基金份额持有人大会的通知	同上	2012-03-29
35	长盛同庆基金召开基金份额持有人大会第五次提示性公告	同上	2012-03-29

36	长盛同庆基金之同庆 A、同庆 B 停牌的第二次提示性公告	同上	2012-03-28
37	关于长盛同庆基金召开基金份额持有人大会的通知	同上	2012-03-28
38	关于长盛同庆可基金召开基金份额持有人大会的通知	同上	2012-03-27
39	长盛同庆基金召开基金份额持有人大会第四次提示性公告	同上	2012-03-26
40	长盛同庆基金之同庆 A、同庆 B 停牌的第一次提示性公告	同上	2012-03-26
41	关于长盛同庆基金召开基金份额持有人大会的通知	同上	2012-03-21
42	关于长盛同庆基金转型有关事项的议案持有人大会第三次提示性公告	同上	2012-03-19
43	关于长盛同庆基金召开基金份额持有人大会的通知	同上	2012-03-19
44	长盛同庆基金召开基金份额持有人大会的补充公告	同上	2012-03-16
45	关于长盛同庆基金召开基金份额持有人大会的通知	同上	2012-03-16
46	关于长盛同庆基金份额持有人大会的通知	同上	2012-03-14
47	长盛同庆基金份额持有人大会第二次提示性公告	同上	2012-03-14
48	长盛同庆基金召开基金份额持有人大会第一次提示性公告	同上	2012-03-12
49	长盛同庆可分离交易基金召开基金份额持有人大会公告	同上	2012-03-09

注：上述 2012 年 6 月 1 日以后的公告增加《证券日报》为法定披露方式。

### § 13 影响投资者决策的其他重要信息

2012年1月16日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自2012年1月16日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。



## § 14 备查文件目录

### 14.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》；
- 5、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》；
- 6、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金托管协议》；
- 7、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金招募说明书》；
- 8、法律意见书；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 10、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 14.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所

### 14.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所和/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。