

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2012年8月25日

§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、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签章。

基金托管人招商银行股份有限公司以下简称:招商银行)根据本基金合同规定,于2012年8月24日对核了报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新并不要求其未来表现。

本半年度报告摘要摘自半年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称:长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)

基金主代码:160807

交易代码:160807

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年4月4日

基金管理人:长盛基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告期基金总资产:223,313,663.92份

基金合同生效日期: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:2010年9月6日

2.2 基金产品说明

本基金采取指数化投资,跟踪沪深300指数,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值在±0.35%以内,且年化跟踪误差小于0.35%,以实现对基准指数的有效跟踪。

本基金采用抽样复制指数化投资策略,综合考察标的指数样本股的自由现金流、股息率、波动性、市盈率、市净率等指标,结合对指数整体的相关性,通过被动方式构造基金股票投资组合,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为与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于0.4%的投资目标。

业绩比较基准:95%×沪深300指数收益率+5%×一年期定期存款利率(税后)

风险收益特征:本基金是股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的证券投资基金。

本基金是股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的证券投资基金。

其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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 招商银行股份有限公司

姓名:叶松 郑燕

信息披露负责人:010-82019988 0755-83199084

联系电子邮箱:yejs@sfunds.com.cn yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话:400-888-2666 95555

传真:010-82255988 0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.csfunds.com.cn

基金半年度报告备置地点:基金管理人和基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 本期期间数据和指标 报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)

本期已实现收益 -1,975,240.31

本期利润 10,358,950.13

加权平均基金份额本期利润 0.0456

基金份额净值增长率为 5.81%

3.1.2 本期数据和指标 报告期末(2012年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.1811

期末基金资产净值 182,871,414.06

基金份额净值 0.819

注:本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+5%×一年期定期存款利率(税后)

2.本期已实现收益指本基金利息收入、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,本期利润即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,采用未分配利润与本期利润扣除已实现部分的孰低数。表中的“期末”指报告期末最后一日,即6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位:人民币元

阶段 份额净值 增长率(1) 份额净值增长 增长率差(2) 业绩比较基准 收益率标准差(3) (1)-(3) (2)-(4)

过去一个月 -5.21% 1.03% -6.14% 1.04% 0.93% -0.01%

过去三个月 1.36% 0.32% 1.07% 1.04% -0.01%

过去六个月 5.81% 1.24% 4.83% 1.26% 0.98% -0.02%

过去一年 -16.77% 1.25% -18.04% 1.28% 1.27% -0.03%

成立以来 -13.98% 1.25% -13.01% 1.30% -0.97% -0.05%

注:本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+5%×一年期定期存款利率(税后)

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,它的样本股占整个股票市场的大部分流通市值,其成份股为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票,能覆盖A股市场总体发展趋势。

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,基准收益率每日按95.5%的比例取平均数,再用连锁计算的方法得到基准收益率的实时数据。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比例

金额单位:人民币元

2010年04月01日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日

一、收入 11,479,738.23 137,499.82

1.利息收入 44,198.87 54,974.09

其中:存款利息收入 44,051.69 54,029.93

债券利息收入 147.18 944.16

2.投资收益(损失以“-”号填列) -915,465.96 8,790,158.93

其中:股票投资收益 -3,007,320.13 7,018,916.02

3.所有者权益合计 182,871,414.06 176,148,947.43

负债和所有者权益总计 186,206,570.58 179,900,532.95

注:报告截止日2012年6月30日,基金份额净值:0.819,基金份额总额:223,313,663.92份。

注:本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将低于所示数字。

2.本期已实现收益指本基金利息收入、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,本期利润即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,采用未分配利润与本期利润扣除已实现部分的孰低数。表中的“期末”指报告期末最后一日,即6月30日。

3.2.3 基金净值表现

3.2.4 本期基金业绩指标

金额单位:人民币元

3.3.1 本期期间数据和指标 报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)

本期已实现收益 -1,975,240.31

本期利润 10,358,950.13

加权平均基金份额本期利润 0.0456

基金份额净值增长率为 5.81%

3.3.2 本期数据和指标 报告期末(2012年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.1811

期末基金资产净值 182,871,414.06

基金份额净值 0.819

注:本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将低于所示数字。

2.本期已实现收益指本基金利息收入、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,本期利润即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,采用未分配利润与本期利润扣除已实现部分的孰低数。表中的“期末”指报告期末最后一日,即6月30日。

3.3.3 本期数据和指标 报告期末(2012年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.1811

期末基金资产净值 182,871,414.06

基金份额净值 0.819

注:本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将低于所示数字。

2.本期已实现收益指本基金利息收入、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,本期利润即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,采用未分配利润与本期利润扣除已实现部分的孰低数。表中的“期末”指报告期末最后一日,即6月30日。

3.3.4 本期数据和指标 报告期末(2012年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.1811

期末基金资产净值 182,871,414.06

基金份额净值 0.819

注:本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将低于所示数字。

2.本期已实现收益指本基金利息收入、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,本期利润即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,采用未分配利润与本期利润扣除已实现部分的孰低数。表中的“期末”指报告期末最后一日,即6月30日。

3.3.5 本期数据和指标 报告期末(2012年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.1811

期末基金资产净值 182,871,414.06

基金份额净值 0.819

注:本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将低于所示数字。

2.本期已实现收益指本基金利息收入、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,本期利润即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,采用未分配利润与本期利润扣除已实现部分的孰低数。表中的“期末”指报告期末最后一日,即6月30日。

3.3.6 本期数据和指标 报告期末(2012年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.1811

期末基金资产净值 182,871,414.06

基金份额净值 0.819

注:本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将低于所示数字。

2.本期已实现收益指本基金利息收入、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,本期利润即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,采用未分配利润与本期利润扣除已实现部分的孰低数。表中的“期末”指报告期末最后一日,即6月30日。

3.3.7 本期数据和指标 报告期末(2012年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.1811

期末基金资产净值 182,871,414.06

基金份额净值 0.819

注:本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将低于所示数字。

2.本期已实现收益指本基金利息收入、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,本期利润即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,采用未分配利润与本期利润扣除已实现部分的孰低数。表中的“期末”指报告期末最后一日,即6月30日。

3.3.8 本期数据和指标