长盛同庆中证800指数分级证券投资基金

【2012】半年度报告摘要

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

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。

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

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）。

§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，以实现对中证800指数的有效跟踪。
投资策略	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。 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。
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）
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	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。 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。
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

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 报告期（2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日）	长盛同庆封闭 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

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）。

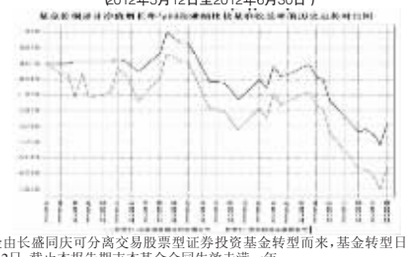
基准指数：中证800指数。

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指数指数编制细则（网址：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）



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%

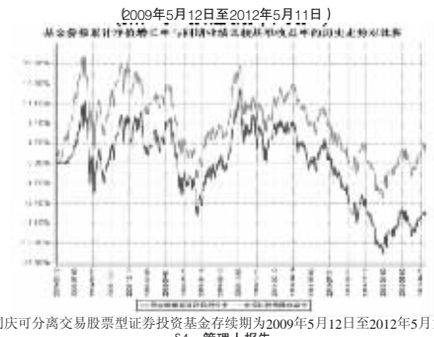
沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。沪深300指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数。

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）



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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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，自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t1、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的真实、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	本期末 2012年6月30日
资产：	
银行存款	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	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	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	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	-
资产总计	5,159,227,009.43
负债和所有者权益	**本期末 2012年6月30日**
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	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	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	2,507,340.99
负债合计	123,623,800.10
所有者权益：	
实收基金	5,942,246,587.25
未分配利润	-906,643,377.92
所有者权益合计	5,035,603,209.33
负债和所有者权益总计	5,159,227,009.43

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	本期 2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年6月30日
一、收入	-175,429,842.74
1.利息收入	8,180,714.81
其中：存款利息收入	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	-11,051,351.13
基金投资收益	-
债券投资收益	492,762.25
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	40,345,411.49
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-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）	10,611,855.27
减：二、费用	22,045,773.91
1.管理人报酬	8,761,764.77
2.托管费	1,927,588.23
3.销售服务费	-
4.交易费用	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	81,526.16
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-197,475,616.65
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-197,475,616.65

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%×中证800指数收益率+5%×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