# 长盛成长价值证券投资基金

## 【2013】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:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2013年8月29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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称:中国农业银行)根据本基金合同规定,于2013年8月28日复核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。

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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013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 | 长盛成长价值混合 |
| 基金主代码 | 080001 |
| 交易代码 | 080001 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2002年9月18日 |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 868,570,141.55份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金为平衡型基金,通过管理人的积极管理,在控制风险的前提下挖掘价值、分享成长,谋求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金投资策略为主动性投资,在战略性资产、战术性资产、股票和债券选择三个层面进行积极配置,力争获得超过投资基准的业绩回报。在资产配置方面,股票资产比例为35%-75%,债券资产比例为20%-60%,现金资产比例不低于5%。 |
| 业绩比较基准 | 中信标普A股综合指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金属平衡型基金,在承担适度风险的前提下,获得长期稳定的收益。 |

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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 叶金松 | 李芳菲 |
| | 联系电话 | 010-82019988 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | yejs@csfunds.com.cn | lifangfei@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-2666<br>010-62350088 | 95599 |
| 传真 | | 010-82255988 | 010-63201816 |

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住所 |

§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 | 报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 40,098,800.49 |
| 本期利润 | 21,697,687.94 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0241 |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.63% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2013年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1785 |
| 期末基金资产净值 | 713,492,746.81 |
| 期末基金份额净值 | 0.821 |

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(为期末余额,不是当期发生数)。表中的"期末"均指本报告期最后一日,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

| 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 | -7.65% | 1.29% | -12.72% | 1.48% | 5.07% | -0.19% |
| 过去三个月 | -1.68% | 1.00% | -7.87% | 1.14% | 6.19% | -0.14% |
| 过去六个月 | 2.63% | 1.02% | -6.11% | 1.15% | 8.74% | -0.13% |
| 过去一年 | 1.73% | 0.86% | -5.85% | 1.08% | 7.58% | -0.22% |
| 过去三年 | 2.28% | 0.93% | -6.41% | 1.11% | 8.69% | -0.18% |
| 自基金合同生效起至今 | 249.21% | 1.22% | 62.29% | 1.45% | 186.92% | -0.23% |

注:本基金业绩比较基准=中信标普A股综合指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%

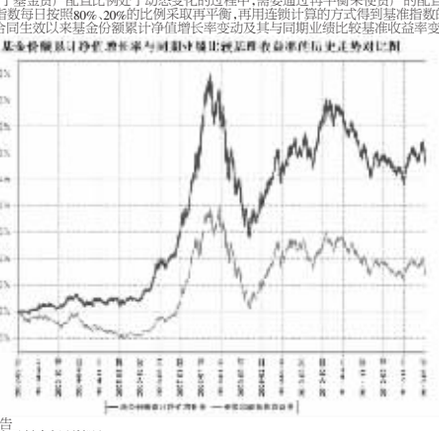
基准指数的构建考虑了三个原则:

1.公允性。选择市场认同度比较高的中信标普A股综合指数和中信标普国债指数作为计算的基础指数。中信标普A股综合指数作为按流通股本加权的综合指数,其指数选股样本覆盖了上交所和深交所上市的所有A股,具有较强的指代作用。

2.可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响,本基金持有的股票资产比例为35%-75%,债券资产比例为20%-60%,现金资产比例不低于5%。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数,使业绩比较更具有合理性。

3.再平衡。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,基准指数每日按照80%、20%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



§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

本基金管理人为长盛基金管理有限公司(以下简称"公司"),成立于1999年3月26日,是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币15000万元。公司注册地在深圳,总部设在北京,并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司。目前,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%,安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至2013年6月30日,基金管理人共管理两只封闭式基金、二十七只开放式基金,并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外QFII基金和专户理财产品的投资顾问。

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 | | |
| 刘斌 | 本基金基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理,金融工程与量化投资部总监 | 2012年7月20日 | - | 7年 | 男,1979年6月出生,中国国籍。清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司,在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理、长盛沪深300指数证券投资基金基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部总监,长盛成长价值证券投资基金(本基金)基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理。 |

注:1.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;

2."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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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、《长盛成长价值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,为基金份额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日的交易比段进行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,未发现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。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2013年上半年,美国市场因经济复苏持续上涨,上半年道琼斯指数涨13.78%,纳斯达克涨12.71%;欧洲经济逐步走出谷底,主要股指先涨后跌,上半年德国法兰克福DAX指数涨4.56%,伦敦富时100指数涨5.39%。因美国经济复苏速象加强及美联储QE政策的退出预期,全球大宗商品出现普跌行情。

国内市场,宏观数据出现触底回升迹象,但则复苏力度不足,A股先在改革预期下先走出上涨的走势,但在弱的宏观经济数据,及楼市调控新"国五条"、银监会8号文、外管局20号文等压力下,中信标普A股指数上半年下跌8.22%。市场风格出现较大的分化,以创业板、电子信息传媒为代表的新兴行业取得了正收益,其中创业板指数实现了41.72%的上涨。

上半年本基金的净值上涨2.63%,上半年战胜了指数和基准。本基金在行业配置上配置较为均衡,没有集中配置在创业板和电子信息传媒等强势行业和个股上,导致总体收益弱于同行业基金。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为0.821元,本报告期份额净值增长率为2.63%,同期业绩比较基准增长率为-6.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断国内经济仍以缓慢复苏为主,并可能出现反复,整体呈"L"形状复苏;通胀水平预计前低后高,总体可控。流动性上,在"稳好增量、盘活存量"的政策信号指引下,我们判断下半年流动性较上半年会略微紧张,会以结构性定向宽松为主。我们认为未来一段时间内,我国实体经济和流动性均会继续出现结构调整的情况,A股也会继续出现结构性机会。

下半年,我们认为最核心的问题是如何理解A股行业间的估值差异,以及如何平衡周期股投资与成长股投资,我们认为A股仍会继续结构性的行情。下半年我们会继续平衡价值与成长的配置比例,加大对新材料、新装备、新能源、新科技等新兴产业方面的研究,积极寻找符合经济转型方向、业绩确定性高的投资品种,并适当提高持股集中度。

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、估值目、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(包括估值小组组长)、公司副总经理和督察长(包括估值小组副组长)、权益投资部、金融工程与量化投资部、研究部、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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

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》的规定以及本基金基金合同第二十条中对基金利润分配原则的约定,本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2013年6月30日,期末可供分配收益为-155,077,394.74元,其中:未分配收益已实现部分为149,363,694.20元,未分配收益未实现部分为-304,441,088.94元。

§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

在托管长盛成长价值证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《长盛成长价值证券投资基金基金合同》、《长盛成长价值证券投资基金托管协议》的约定,对长盛成长价值证券投资基金管理人—长盛基金管理有限公司2013年1月1日至2013年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,长盛基金管理有限公司在长盛成长价值证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的长盛成长价值证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:长盛成长价值证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 108,066,356.88 | 65,885,367.86 |
| 结算备付金 | 1,118,282.45 | 102,625.02 |
| 存出保证金 | 368,912.48 | 1,000,000.00 |
| 交易性金融资产 | 602,181,046.46 | 704,008,475.92 |
| 其中:股票投资 | 422,947,046.46 | 533,813,475.92 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 179,234,000.00 | 170,195,000.00 |
| 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 | - | 4,801,274.73 |
| 应收利息 | 3,643,529.14 | 2,628,031.22 |
| 应收股利 | 922,847.32 | - |
| 应收申购款 | 16,695.71 | 53,439.41 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 716,317,670.44 | 778,479,214.16 |
| **负债和所有者权益** | **本期末 2013年6月30日** | **上年度末 2012年12月31日** |
| 负 债: | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | - | 26,082,458.95 |
| 应付赎回款 | 318,009.28 | 581,168.33 |
| 应付管理人报酬 | 915,067.53 | 915,262.61 |
| 应付托管费 | 152,511.26 | 152,543.78 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 756,720.11 | 255,100.73 |
| 应交税费 | 2,600.00 | 2,600.00 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 680,015.45 | 862,484.69 |
| 负债合计 | 2,824,923.63 | 28,851,619.09 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 868,570,141.55 | 936,712,379.47 |
| 未分配利润 | -155,077,394.74 | -187,084,784.40 |
| 所有者权益合计 | 713,492,746.81 | 749,627,595.07 |
| 负债和所有者权益总计 | 716,317,670.44 | 778,479,214.16 |

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值:0.821元,基金份额总额:868,570,141.55份。

6.2 利润表

会计主体:长盛成长价值证券投资基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 31,259,699.32 | 26,027,132.74 |
| 1.利息收入 | 3,821,985.55 | 4,428,327.49 |
| 其中:存款利息收入 | 891,509.77 | 733,058.74 |
| 债券利息收入 | 2,930,475.78 | 3,448,949.42 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | 246,319.33 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 45,738,153.36 | -72,955,484.51 |
| 其中:股票投资收益 | 40,472,588.78 | -78,176,946.16 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -262,642.22 | 319,304.31 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 5,528,206.80 | 4,902,157.34 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -18,401,112.55 | 94,502,662.59 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 100,672.96 | 51,627.17 |
| 减:二、费用 | 9,562,011.38 | 10,189,537.17 |
| 1.管理人报酬 | 5,650,475.89 | 6,187,978.29 |
| 2.托管费 | 941,746.01 | 1,031,329.73 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 2,789,037.32 | 2,779,866.63 |
| 5.利息支出 | - | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6.其他费用 | 180,752.16 | 190,362.52 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 21,697,687.94 | 15,837,595.57 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 21,697,687.94 | 15,837,595.57 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛成长价值证券投资基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013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) | 936,712,379.47 | -187,084,784.40 | 749,627,595.07 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 21,697,687.94 | 21,697,687.94 |
| 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) | -68,142,237.92 | 10,309,701.72 | -57,832,536.20 |
| 其中:1.基金申购款 | 26,870,160.44 | -4,183,251.76 | 22,686,908.68 |
| 2.基金赎回款 | -95,012,398.36 | 14,492,953.48 | -80,519,444.88 |
| 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) | 868,570,141.55 | -155,077,394.74 | 713,492,746.81 |
| **项目** | **上年度可比期间 2012年1月1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) | 1,025,210,970.19 | -212,926,867.28 | 812,284,102.91 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 15,837,595.57 | 15,837,595.57 |
| 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) | -11,050,485.26 | 1,813,331.05 | -9,237,154.21 |
| 其中:1.基金申购款 | 39,467,191.38 | -7,422,259.54 | 32,044,931.84 |
| 2.基金赎回款 | -50,517,676.64 | 9,235,590.59 | -41,282,086.05 |
| 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) | 1,014,160,484.93 | -195,275,940.66 | 818,884,544.27 |

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:

周民 杨思乐 龚晓

基金管理人负责人 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

长盛成长价值证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2002]第57号《关于同意长盛成长价值证券投资基金设立的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《长盛成长价值证券投资基金基金契约》在更名为《长盛成长价值证券投资基金合同》)发起,并于2002年9月18日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,166,886,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字[2002]第95号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛成长价值证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金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。本基金投资组合中股票资产比例为35%-75%,债券资产比例为20%-60%,现金资产比例不低于5%。本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%,投资于权证的比例不得超过基金资产净值的3%。股票投资在成长和价值类资产中根据市值大小在大盘成长、中盘成长、小盘成长、大盘价值、中盘价值和小盘价值六类资产间进行二次配置,具体配置比例限制如下表所示:

| | 投资下限 | 投资上限 | | 投资下限 | 投资上限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 大盘成长 | 5% | 40% | 大盘价值 | 5% | 40% |
| 中盘成长 | 5% | 50% | 中盘价值 | 5% | 50% |
| 小盘成长 | 5% | 40% | 小盘价值 | 5% | 40% |
| 成长类合计 | 30% | 70% | 价值类合计 | 30% | 70% |

本基金的业绩比较基准为:中信标普A股综合指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%。

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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛成长价值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编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年1月1日至2013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2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

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[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》、财政部、国家税务总局、中国证监会于2012年11月16日联合发布财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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.对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3.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。

4.自2013年1月1日起,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得,按照本通知的规定计征个人所得税。

5.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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国农业银行 | 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 |

6.4.8 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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 | - | - | 460,892,376.89 | 25.59% |

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 国元证券 | - | - | 25,881,817.50 | 57.20% |

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 国元证券 | - | - | 1,790,000,000.00 | 78.85% |

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013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 | - | - | - | - |
| **关联方名称** | **上年度可比期间 2012年1月1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 | 400,804.42 | 26.31% | 400,804.42 | 43.77% |

注: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。

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,650,475.89 | 6,187,978.29 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 874,108.49 | 911,198.99 |

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 941,746.01 | 1,031,329.73 |

注:支付基金托管人中国农业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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

| 本期 2013年1月1日至2013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 |
| 中国农业银行 | 101,194,174.65 | - | - | - | - | - |
| **上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 |
| 中国农业银行 | - | - | - | - | - | - |

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | 14,109,387.26 | 14,109,387.26 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 1.62% | 1.39% |

6.4.8.4.2 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

注:除基金管理人之外的其他关联方本期及上年度末未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012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 |
| 中国农业银行 | 108,066,356.88 | 878,886.34 | 121,072,636.97 | 711,082.42 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 300020 | 银江股份 | 2013/6/3 | 重大事项 | 22.67 | - | - | 197,741 | 3,025,854.96 | 4,482,788.47 | - |
| 000999 | 华润三九 | 2013/6/3 | 重大事项 | 26.55 | 2013/8/19 | 26.51 | 3,042 | 88,334.38 | 80,765.10 | |
| 002322 | 理工监测 | 2013/6/6 | 重大事项 | 14.62 | 2013/8/8 | 13.80 | 297,319 | 3,194,408.65 | 4,346,803.78 | - |

注:本基金截至2013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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 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

(i)金融工具公允价值计量的方法

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)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2013年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为414,036,688.88元,属于第二层级的余额为188,144,357.58元,无属于第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级533,813,475.92元,第二层级170,195,000.00元,无第三层级)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃),或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间