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:2013年8月29日

长盛同庆中证800指数分级证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

§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	长盛同庆中证800分级(场内简称:长盛同庆)		
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	2,882,425,233.10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		
下属分级基金的基金简称	长盛同庆800A(场内简称:同庆800A)	长盛同庆800B(场内简称:同庆800B)	长盛同庆中证800分级(场内简称:长盛同庆)
下属分级基金的交易代码	150098	150099	160806
报告期末下属分级基金份额总额	782,159,830.00份	1,173,239,746.00份	927,025,657.10份

2.2 基金产品说明

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。

2.3 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	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tianqing1.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	234,158,174.42
本期利润	-113,134,441.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0342
本期基金份额净值增长率	-8.73%
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	-0.2548
期末基金资产净值	2,442,818,905.50
期末基金份额净值	0.847

注:1.所选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,即6月30日。
4.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。

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	-14.18%	1.73%	-14.87%	1.76%	0.69%	-0.03%
过去三个月	-9.11%	1.34%	-9.90%	1.37%	0.79%	-0.03%
过去六个月	-8.73%	1.38%	-9.56%	1.39%	0.83%	-0.01%
过去一年	-9.30%	1.28%	-9.00%	1.30%	-0.30%	-0.02%
自基金转型日起至今	-12.63%	1.23%	-14.72%	1.27%	2.09%	-0.04%

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,再用连续计算的方式将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