基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2013年8月29日

长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

【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。

本基金托管人中国银行股份有限公司(以下简称:中国银行)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、收益分配情况、财务会计报告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。

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	长盛同智优势混合(LOF)(场内简称:长盛同智)
基金主代码	160805
交易代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1月5日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,228,692,387.12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	2007年2月16日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司,所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下,谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	本基金为混合型基金,根据对宏观经济、行业状况、公司成长性及资本市场的判断,综合评价各类资产的风险收益水平,对各类资产采取适度灵活的资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益—较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于债券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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	唐州徽
	联系电话	010-82019988	95566
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

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	220,139,791.70
本期利润	106,115,764.44
加权平均基金份额本期利润	0.0458
本期基金份额净值增长率	5.96%
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	-0.2263
期末基金资产净值	1,724,364,675.60
期末基金份额净值	0.7737

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,即6月30日。

4.本基金由同智证券投资基金转型而来,转型日为2007年1月5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	-5.46%	1.35%	-10.23%	1.21%	4.77%	0.14%
过去三个月	1.01%	1.31%	-7.44%	0.94%	8.45%	0.37%
过去六个月	5.96%	1.30%	-7.69%	0.97%	13.65%	0.33%
过去一年	1.39%	1.03%	-5.49%	0.89%	6.88%	0.14%
过去三年	-4.59%	1.09%	-4.92%	0.89%	0.33%	0.20%
自基金转型日起至今	40.80%	1.53%	20.72%	1.30%	20.08%	0.23%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

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沪深300指数和上证国债指数作为计算的基础指数。

2.可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响,本基金持有的股票投资占基金资产的比例范围为30%-95%;权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%;债券投资占基金资产的比例范围为0-65%;现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在5%以上。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65%、30%、5%的比例来取再平衡,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

注:1.本基金由同智证券投资基金转型而来,转型日为2007年1月5日。

2.按基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十五条(二)投资范围、(六)投资限制的有关约定。截止报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
王宁	本基金基金经理,公司总经理助理,权益投资部总监。	2012年7月20日	-	15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,曾任基金经理助理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理、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基金经理等职务。现任公司总经理助理,权益投资部总监,长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF,本基金)基金经理。
苏李	本基金基金经理助理,行业研究员。	2012年9月3日	-	6年	男,1982年5月出生,英国雷丁大学硕士。2006年11月加入长盛基金管理有限公司,现任行业研究员,长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF),(本基金)基金经理助理。

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 管理人对投资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、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)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 管理人对投资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,所有投资组合的投指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,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年上半年市场整体运行与2012年同期有诸多相似之处。2012年末市场对经济的复苏仍有期待,组合1季度初在相关板块有较多布局。随着春节后出现的信贷收紧、地产调控和影子银行治理,我们将配置的重点转移到具有中长期成长潜力的优势个股上,同时注意到了成长股系统性高估的风险,降低了组合整体的仓位。

2013年第2季度,沪深300指数反弹1个月后陷入了2个月的下跌,创下新低。与其相反的是,创业板指数上涨9%,创下历史新高。虽然海外流动性在撤出新兴市场,但实质上并没有威胁到二级市场里中小市值板块的估值。原因在于存量资金虽然认知到中小板的整体风险,但在宏观经济复苏偏弱的大背景下,在中小板中挖掘可持续成长的标的似乎是唯一的选择。

本基金在市场的波动中坚持选择有基本面支持的,有中长期成长潜力的个股。在经济弱复苏的背景下,淡化周期,淡化行业,同时注意到了成长股系统性高估的风险,组合整体的仓位保持相对的谨慎,同时对基本面的考量更加严格。

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0.7737元,本报告期份额净值增长率为5.96%,同期业绩比较基准增长率为-7.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

弱复苏大局已定,宏观经济政策依然持续偏紧。6月份银行系统资金面的紧张再次验证了政府的态度。如果目前的政策得以持续,会加速经济的出清速度,理论上有利于政府在当前和下一个执政期的经济发展以及风险防控。但我们也同时认为,政府在必要的时候,需要对经济采取必要的托底,防止可能的风险扩散。

我们同时相信目前经济的增速低于潜在增速,政府何种方式、力度和时点采取托底的政策,取决于对经济增速下限容忍的程度。

从近期政府对外界的表态来看,稳增长和防通胀有明确的目标。因此我们相信,宏观经济无底线的下移,乃至引发全面的经济或金融危机是小概率事件。而前一阶段市场的走势,似乎预示着相反的方向,因而我们判断在未来1-2个季度中,可能会存在一定概率的纠偏。

尽管如此,更大概率上今年会重演2010年成长股的泡沫行情,投资者在这个过程中将面临许多艰难的抉择。在行业和股票上,我们会继续关注符合经济发展方向,具备成长空间、创新潜力和业绩支撑的行业和股票。重点关注的行业包括但不限于环保、医药、必需和可选消费、传媒等。而对市场可能的纠偏行为,我们会结合最新的经济数据和趋势判断,谨慎参与。

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(但任估值小组组长)、公司副总经理和督察长(但任估值小组副组长)、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,当存在异议时,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关于基金利润分配原则的约定,本基金于报告期内未实施利润分配。

本基金截至2013年6月30日,期末可供分配利润为-504,327,711.52元,其中,未分配利润已实现部分为279,094,323.29元,未分配利润未实现部分为-783,422,034.81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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告中的数据真实、准确和完整。

§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:长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

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	553,243,701.86	220,283,787.70
结算备付金	7,277,586.46	11,823,514.80
存出保证金	1,697,885.83	2,456,005.93
交易性金融资产	924,219,147.56	1,563,978,101.71
其中:股票投资	904,263,147.56	1,563,978,101.71
基金投资	-	-
债券投资	19,956,000.00	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	235,000,314.00	78,800,000.00
应收证券清算款	10,004,998.49	-
应收利息	528,783.60	199,455.57
应收股利	538,412.50	-
应收申购款	1,973.94	64,015.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,732,512,804.24	1,877,604,881.26
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	-	100,934,655.72
应付赎回款	995,278.72	947,847.06
应付管理人报酬	2,186,646.89	2,150,255.50
应付托管费	364,441.12	358,375.91
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,147,981.54	2,275,181.18
应交税费	305,932.19	305,932.19
应付利息	-	-
应付利润	428,798.09	428,798.09
递延所得税负债	-	-
其他负债	719,050.09	2,120,271.70
负债合计	8,148,128.64	109,521,317.35
所有者权益:		
实收基金	2,228,692,387.12	2,421,471,657.63
未分配利润	-504,327,711.52	-653,388,093.72
所有者权益合计	1,724,364,675.60	1,768,083,563.91
负债和所有者权益总计	1,732,512,804.24	1,877,604,881.26

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值:0.7737元,基金份额总额2,228,692,387.12份。

6.2 利润表

会计主体:长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

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	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	138,959,715.18	51,705,700.78
1.利息收入	4,040,425.65	1,701,348.50
其中:存款利息收入	1,571,411.38	1,591,377.81
债券利息收入	329,959.43	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,139,054.84	109,970.69
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	248,875,045.37	-81,196,940.74
其中:股票投资收益	240,379,343.27	-97,229,360.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	23,090.10	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	8,472,612.00	16,032,419.52
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-114,024,027.26	131,195,894.98
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	68,271.42	5,398.04
减:二、费用	32,843,950.74	21,624,699.49
1.管理人报酬	13,337,748.02	14,736,833.61
2.托管费	2,222,957.98	2,456,138.91
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	17,042,154.51	4,201,568.38
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	241,090.23	230,158.59
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	106,115,764.44	30,081,001.29
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	106,115,764.44	30,081,001.29

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

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)	2,421,471,657.63	-653,388,093.72	1,768,083,563.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	106,115,764.44	106,115,764.44
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)	-192,779,270.51	42,944,617.76	-149,834,652.75
其中:1.基金申购款	4,928,822.73	-1,102,003.17	3,826,819.56
2.基金赎回款	-197,708,093.24	44,046,620.93	-153,661,472.31
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)	2,228,692,387.12	-504,327,711.52	1,724,364,675.60

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)	2,556,640,149.91	-634,093,654.55	1,922,546,495.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,081,001.29	30,081,001.29
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)	-65,617,686.97	13,780,489.73	-51,837,197.24
其中:1.基金申购款	6,875,680.48	-1,507,422.67	5,368,257.81
2.基金赎回款	-72,493,367.45	15,287,912.40	-57,205,455.05
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)	2,491,022,462.94	-590,232,163.53	1,900,790,299.41

注: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 龚珉

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

长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金"),系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[2006]260号"文《关于核准同智证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》的核准,由封闭式基金同智证券投资基金转型而成,自2007年1月5日起,《长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金于2007年1月22日("转换基准日")的基金净值为人民币955,116,003.53元,于2007年1月23日("转换日")折合基金份额955,116,000.00份。本基金为契约型上市开放式,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,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。其中,股票投资占基金资产的比例范围为30%-95%;权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%;债券投资占基金资产的比例范围为0-65%;现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在5%以上。本基金将不低于80%的股票资产投资于具有较大成长潜力的上市公司的股票。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。本基金的业绩比较基准是:沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号《年度报告的内容与格式》》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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》》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 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、完整地反映了本基金于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净值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资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、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会联合发布财税[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》的规定,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。

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("长盛基金")	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易,也没有发生应支付关联方的佣金业务。

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	13,337,748.02	14,736,833.61
其中:支付销售机构的客户维护费	2,195,991.64	2,383,920.41

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提,按月支付,由基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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	2,222,957.98	2,456,138.91

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金托管人复核后于次月首日起10个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

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

注:本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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	62,276,368.00	62,276,368.00
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	62,276,368.00	-
期末持有的基金份额	-	62,276,368.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.50%

注:基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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
中国银行	553,243,701.86	1,469,231.16	174,386,676.11	1,565,147.98

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:本基金于本报告期及上年度可比期间均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

无。

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:本基金本期末未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

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
000997	新大陆	2013/6/3	重大事项停牌	15.11	2013/8/23	14.21	1,840,115	27,086,252.10	27,804,137.65	-

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

截至2013年6月30日,本基金无需作说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	904,263,147.56	52.19
	其中:股票	904,263,147.56	52.19
2	固定收益投资	19,956,000.00	1.15
	其中:债券	19,956,000.00	1.15
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产