

长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

2013 半年度报告摘要

序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情况处理等事项。本基金管理人设立了由公司副总经理担任组长（副组长）督察长担任副组长以及权益投资部、金融工程与量化投资部、研究部、监察稽核部、财务投资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投资、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。

参与估值原则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，托管人有权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 管理人应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》第四十六条以及《本基金基金合同》第十九条中对基金利润分配原则的约定，本基金于2013年2月26日和2013年3月8日进行了两次利润分配，分配金额分别为4,011,312.15元和13,742,166.68元。

本基金截至2013年6月30日期末可供分配金额为2,222,717.10元，其中：未分配收益已实现部分为9,072,087.07元，未分配收益未实现部分为-6,849,370.97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”）在长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“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规定，恪尽职守，认真履行职责。在基金托管过程中不存在任何违法违规行为。

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约定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，未发现基金管理人有违反基金合同约定的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人对基金管理人编制的净值表现、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）、投资组合报告等进行了核对。

§ 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：长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2013年6月30日

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
银行存款	5,067,807.61	9,976,242.53
结算备付金	1,216,744.97	267,476.04
存出保证金	133,924.25	1,000,000.00
交易性金融资产	120,826,554.85	179,522,658.44
其中：股票投资	151,434,438.85	147,490,658.44
基金投资	-	-
债券投资	31,390,120.00	32,032,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	2,000,000.00	-
应收证券清算款	2,501,883.72	-
应收利息	500,973.28	483,507.76
应收股利	-	-
应收申购款	77,792.31	46,854.86
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	163,325,680.99	191,296,739.63
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	-	-
应付赎回款	125,874.29	668,264.98
应付管理人报酬	209,385.54	225,542.94
应付托管费	34,897.60	37,590.42
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	729,217.15	251,880.37
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付股利	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	159,042.28	1,072,477.02
负债合计	1,258,416.86	2,255,752.28
所有者权益：		
实收基金	159,844,547.03	186,707,578.58
未分配利润	2,222,717.10	2,333,405.77
所有者权益合计	162,067,264.13	189,040,984.35
负债和所有者权益总计	163,325,680.99	191,296,739.63

注：报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

会计主体：长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2013年1月1日至2013年6月30日

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	9,162,806.35	6,010,016.87
1.利息收入	609,254.85	518,473.23
其中：存款利息收入	50,537.27	61,550.36
债券利息收入	425,070.53	456,922.92
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	133,647.05	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	23,118,146.24	-2,799,061.40
其中：股票投资收益	21,608,189.75	-3,566,987.27
基金投资收益	-	-
债券投资收益	119,310.95	39,900.00
资产支持证券投资收入	-	-
衍生工具收益	-	-
公允价值变动收益（损失以“-”填列）	1,390,645.54	728,025.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-14,617,302.33	8,267,330.04
4.其他收益（损失以“-”填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”填列）	52,707.59	23,274.95
减：一、费用	2,512,592.38	2,262,097.90
1.管理人报酬	1,234,836.12	1,338,034.84
2.托管费	200,806.12	223,005.82
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	898,869.81	531,036.94
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	173,079.60	170,020.30
列：利息总额（亏损总额以“-”填列）	6,650,213.97	3,747,918.97
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”填列）	6,650,213.97	3,747,918.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表
会计主体：长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金
报告期间：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、期初所有者权益（基金净值）	186,707,578.58	2,333,405.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,650,213.97
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）	-26,863,031.55	992,576.19
其中：1.基金申购款	42,016,567.63	3,484,817.15
2.基金赎回款	-68,579,593.18	-2,492,240.96
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）	-	-7,753,478.83
五、期末所有者权益（基金净值）	159,844,547.03	2,222,717.10
六、其他综合收益	-	-
七、其他	-	-
八、净利润	6,650,213.97	3,747,918.97

6.4 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.5 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.6 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.7 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.8 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.9 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.10 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.11 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.12 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.13 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.14 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.15 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.16 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.17 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.18 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.19 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.20 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.21 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.22 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.23 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.24 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.25 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.26 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.27 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.28 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.29 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.30 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.31 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.32 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.33 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.34 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.35 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.36 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.37 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.38 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.39 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.40 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.41 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.42 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.43 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.44 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.45 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.46 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.47 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.48 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.49 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.50 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.51 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.52 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.53 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.54 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.55 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.56 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.57 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.58 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.59 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.60 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.61 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.62 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.63 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.64 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.65 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.66 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.67 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.68 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.69 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.70 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.71 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.72 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.73 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.74 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.75 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.76 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.77 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.78 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.79 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.80 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.81 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.82 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.83 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.84 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.85 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.86 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.87 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.88 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.89 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.90 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.91 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.92 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.93 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.94 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.95 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.96 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.97 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.98 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.99 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.100 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。

6.101 本报告期末2013年6月30日，基金份额净值1.0139元，基金份额总额159,844,547.03份。