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

长盛同瑞中证200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,投资者在作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	长盛同瑞中证200分级(场内简称:长盛同瑞)		
基金主代码	160808		
交易代码	160808		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年12月6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	57,925,624.80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1月12日		
下属分级基金的基金简称	长盛同瑞A(场内简称:同瑞A)	长盛同瑞B(场内简称:同瑞B)	长盛同瑞中证200分级(场内简称:长盛同瑞)
下属分级基金的交易代码	150064	150065	160808
报告期末下属分级基金份额总额	2,361,196.00份	3,541,794.00份	52,022,634.80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200指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用完全复制法,按照成份股在中证200指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证200指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 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200指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%。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占基金资产比例为5%-10%(其中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5%)。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。
业绩比较基准	95%×中证200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	本基金为完全复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,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	长盛同瑞A:低风险、收益相对稳定 长盛同瑞B:高风险、高预期收益 长盛同瑞中证200分级:较高风险、较高预期收益

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 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	2,558,078.80
本期利润	-1,219,776.37
加权平均基金份额本期利润	-0.0288
本期基金份额净值增长率	-4.11%
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	-0.0346
期末基金资产净值	54,138,951.25
期末基金份额净值	0.935

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。

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	-13.27%	1.68%	-14.52%	1.84%	1.25%	-0.16%
过去三个月	-7.06%	1.35%	-8.43%	1.43%	1.37%	-0.08%
过去六个月	-4.11%	1.33%	-5.84%	1.39%	1.73%	-0.06%
过去一年	-7.25%	1.29%	-7.68%	1.34%	0.43%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-3.56%	1.23%	-13.63%	1.38%	10.07%	-0.15%

注:本基金业绩比较基准=95%×中证200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200指数

本基金的业绩比较基准中证200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200指数指数编制细则。

(网址为:http://www.csindex.com.cn/sseportal/csiportal/indexquery.do)

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,业绩比较基准中中证200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%,新坡量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基金和专严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		
王超	本基金基金经理,长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理。	2011年12月6日	-	6年	男,1981年9月出生,中国国籍。中央财经大学硕士,金融风险管理师(FRM)。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员,从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金(本基金)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,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、《长盛同瑞中证200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日的交易日段进行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

在报告期内,我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略,尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响,将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.935元,本报告期份额净值增长率为-4.11%,同期业绩比较基准收益率为-5.84%。报告期内,本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.10%,控制在0.35%之内;年化跟踪误差为2.39%,控制在4%之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度经济复苏程度弱于预期,海外市场对量化宽松政策退出时点的猜测,以及国内金融体系的去杠杆化行动使得二季度市场出现了大幅度下跌。投资者对于经济转型的期望使得新兴产业表现相对抗跌,低估值的传统周期性行业和金融行业成为主要的下跌动力。新经济与旧经济品种之间的估值差不断创新高。

下半年的宏观经济走势将大概率维持L型走势,但是不排除由于去杠杆引发的短期经济迅速下滑,结构性财政刺激政策预期可能会对权重周期性品种产生脉冲性影响。基于转型预期而形成的成长股泡沫将在中报业绩披露时迎来检验,届时少数业绩能够持续增长的品种将会继续维持强势,而大部分高估值概念性品种将因为缺少业绩支撑而被市场资金抛弃,与之相反,传统行业中能够维持业绩持续增长,盈利能力稳定,现金流良好,财务杠杆较低的医药、消费等品种,将会重新获得资金的青睐。

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)、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。

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收益分配的约定,在存续期内,本基金(包括长盛同瑞中证200分级份额、长盛同瑞A份额、长盛同瑞B份额)不进行收益分配。

§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

在托管长盛同瑞中证200指数分级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《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同》、《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金托管协议》的约定,对长盛同瑞中证200指数分级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同瑞中证200指数分级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,基金费用开支及利润分配等问题上,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同瑞中证200指数分级证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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:长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金

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	3,714,749.87	7,184,997.17
结算备付金	13,096.97	70,893.19
存出保证金	16,287.64	250,000.00
交易性金融资产	30,873,521.31	46,898,064.57
其中:股票投资	30,873,521.31	46,898,064.57
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	3,226.19	1,702.90
应收股利	31,854.11	-
应收申购款	20,000,879.82	3,369.35
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	54,653,615.91	54,409,027.18
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	27,487.16	2,660,242.38
应付管理人报酬	23,483.63	32,032.61
应付托管费	4,696.71	6,406.53
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	15,548.36	37,187.28
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	443,448.80	590,011.22
负债合计	514,664.66	3,325,880.02
所有者权益:		
实收基金	56,141,219.31	50,755,777.19
未分配利润	-2,002,268.06	327,369.97
所有者权益合计	54,138,951.25	51,083,147.16
负债和所有者权益总计	54,653,615.91	54,409,027.18

注:报告截止日2013年6月30日,长盛同瑞中证200分级份额净值0.935元,长盛同瑞A份额参考净值1.032元,长盛同瑞B份额参考净值0.870元;基金份额总额57,925,624.80份,其中长盛同瑞中证200分级份额52,022,634.80份,长盛同瑞A份额2,361,196.00份,长盛同瑞B份额3,541,794.00份。

6.2 利润表

会计主体:长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金

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	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	-744,441.88	13,421,728.28
1.利息收入	42,887.79	837,455.01
其中:存款利息收入	42,887.79	258,437.14
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	579,017.87
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	2,876,636.80	11,807,438.73
其中:股票投资收益	2,605,866.74	11,315,913.38
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	270,770.06	491,525.35
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-3,777,855.17	-159,791.78
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	113,888.70	936,626.32
减:二、费用	475,334.49	1,595,222.79
1.管理人报酬	161,103.70	574,409.31
2.托管费	32,220.73	114,881.85
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	98,205.46	695,981.11
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	183,804.60	209,950.52
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-1,219,776.37	11,826,505.49
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-1,219,776.37	11,826,505.49

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金

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)	50,755,777.19	327,369.97	51,083,147.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,219,776.37	-1,219,776.37
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)	5,385,442.12	-1,109,861.66	4,275,580.46
其中:1.基金申购款	93,413,147.59	3,385,581.10	96,798,728.69
2.基金赎回款	-88,027,705.47	-4,495,442.76	-92,523,148.23
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)	56,141,219.31	-2,002,268.06	54,138,951.25
	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
项目	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)	623,196,268.63	1,075,537.59	624,271,806.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,826,505.49	11,826,505.49
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)	-569,814,754.96	-10,716,800.11	-580,531,555.07
其中:1.基金申购款	157,458,651.00	11,304,878.37	168,763,529.37
2.基金赎回款	-727,273,405.96	-22,021,678.48	-749,295,084.44
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)	53,381,513.67	2,185,242.97	55,566,756.64

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

长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金(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")证监许可[2011]1659号《关于核准长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。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622,918,669.86元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第465号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同》于2011年12月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为623,196,268.63份基金份额,其中认购资金利息折合277,598.77份基金份额。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(以下简称"中国农业银行")。

根据《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同》的规定,本基金的基金份额包括长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称"同瑞基金份额")、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称"同瑞A基金份额")以及长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称"同瑞B基金份额")。本基金基金合同生效后,场内同瑞基金份额按4:6的比例离成同瑞A基金份额和同瑞B基金份额,各类基金份额的基金资产合并运作。在每个会计年度(除基金合同生效日所在会计年度外)的第一个工作日,本基金的基金管理人将根据基金合同的规定对同瑞基金份额和同瑞A份额进行基金份额折算;此外,若同瑞基金份额的基金份额净值达到人民币2.000元或同瑞B份额的参考净值跌至人民币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同瑞基金份额、同瑞A份额和同瑞B份额的基金份额进行不定期份额折算。

同瑞基金份额只接受场外与场内申购和赎回,同瑞A基金份额和同瑞B基金份额可单独在上市交易但不接受申购和赎回。经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上字[2012]4号文核准,同瑞A基金份额和同瑞B基金份额于2012年1月12日在深交所挂牌交易。同瑞基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将基金份额转至场内系统并按照4:6的比例分拆成同瑞A基金份额和同瑞B基金份额后,方可上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为股票(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。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200指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%。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占基金资产比例为5%-10%(其中权证资产占基金资产比例为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5%)。本基金的业绩比较基准为:95%×中证200指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)。

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》、《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及元洋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年半年度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2013年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

本基金本期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无会计差错。

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("长盛基金")	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行	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

注:本基金未开立关联方交易单元。

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	161,103.70	574,409.31
其中:支付销售机构的客户维护费	53,027.17	119,316.85

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0.75%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×0.75%/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	32,220.73	114,881.85

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%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:日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/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

注:本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的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

注:基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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末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	3,714,749.87	40,946.74	5,275,261.67	237,205.82

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均未参与关联方承销证券交易。

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须作说明的其他关联交易事项。

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:本基金本期未无因认购新发/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
000999	华润三九	2013年6月3日	重大事项	26.55	2013年8月19日	26.51	7,411	165,277.20	196,762.05	-
600436	片仔癀	2013年6月20日	公司配股	136.82	2013年7月1日	118.73	936	116,094.02	128,063.52	-

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

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

①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。

②以公允价值计量的金融工具

①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)。

②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且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为30,676,759.26元,属于第二层级的余额为196,762.05元,无属于第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级46,541,919.33元,第二层级356,145.24元,无属于第三层级的余额)。

③公允价值所属层次间的重大变动

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、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

④第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2.除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要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	30,873,521.31	56.49
	其中:股票	30,873,521.31	56.49
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	3,727,846.84	6.82
6	其他各项资产	20,052,247.76	36.69
7	合计	54,653,615.91	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	312,219.90	0.58
B	采矿业	1,816,624.17	3.36
C	制造业	15,873,457.32	29.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	795,935.48