长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）基金份额上市交易公告书

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
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2015年8月6日
公告日期:2015年8月3日

一、重要声明与提示

长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）基金份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、深圳证券交易所（以下简称“深交所”）对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本上市交易公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2015年5月18日刊登在深圳证券交易所网站（www.szse.cn）以及长盛基金管理有限公司网站（www.csfunds.com.cn）的《长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）和2015年5月18日刊登在上述网站和《中国证券报》的《长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

1.基金名称:长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）
2.基金类型:股票型
3.基金运作方式:上市契约型开放式
4.基金场内简称:长盛同庆
5.基金代码:160806
6.本基金的存续期为不定期。
7.基金份额总额:319,351,404.43份（截至2015年7月30日）
8.长盛同庆份额净值为:1.417元（截至2015年7月30日）
9.本次上市交易份额:292,227,017.00份（截至2015年7月30日）
10.上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
11.上市交易日期:2015年8月6日
12.基金管理人:长盛基金管理有限公司
13.基金托管人:中国建设银行股份有限公司
14.本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的历史、转型及份额转换结果、日常申赎和上市交易

（一）本基金的历史

长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）由长盛同庆中证800指数分级证券投资基金分级运作期到期转型而成。长盛同庆中证800指数分级证券投资基金则是由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型而成。

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金经中国证监会证监许可字【2009】209号文批准，于2009年5月6日起向全社会公开募集。

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。基金管理人于2009 年5月12日获得中国证监会书面确认，《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》生效，基金募集规模14,686,733,239.06份。

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金二年封闭期运作于2012年5月11日到期，经持有人大会审议通过了《关于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，该基金转型为长盛同庆中证800指数分级证券投资基金，分级运作周期三年。

2015年5月21日，长盛同庆中证800指数分级证券投资基金三年分级运作周期到期，根据《长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金合同》，该基金分级运作期到期后，满足基金合同约定的存续条件，该基金无需召开基金份额持有人大会，自动转换为契约型上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“长盛同庆中证800 指数型证券投资基金（LOF）”。

（二）本基金的转型及份额转换结果

根据《长盛同庆中证800指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，长盛同庆中证800指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）分级运作期到期后，满足基金合同约定的存续条件，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为契约型上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）”。同庆800A、同庆800B的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金（LOF）份额。

本基金管理人已于2015年4月8日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（www.szse.cn）和本基金管理人网站(www.csfunds.com.cn)上发布了《长盛同庆中证800 指数分级证券投资基金分级运作期届满与基金份额到期转换的公告》。

本基金管理人于2015 年5月21日对长盛同庆中证800 指数分级证券投资基金进行了三年分级运作期届满到期后的基金转型工作。经本基金基金管理人计算并经本基金基金托管人中国建设银行股份有限公司确认，基金份额转换基准日（2015 年5月21日）长盛同庆份额净值为1.7946元，精确到小数点后第8位为1.79406276元;转换前同庆800A份额净值为1.0656元,精确到小数点后第8位为1.06560000元(第9位四舍五入)，转换前同庆A份额数157,659,406.00,本基金管理人按照0.593624387的转换比例进行了折算，折算后原同庆800A份额调整为93,590,468.00份；转换前同庆800B份额净值为2.2280元，精确到小数点后第8位为2.28010626元(第9 位四舍五入)，转换前同庆B份额数236,489,110.00,本基金管理人按照1.27039170971的转换比例进行了折算，折算后原同庆800B份额调整为300,568,047.00份；基金份额总额与持有人持有的基金份额数额转发生调整，份额折算对持有人的权益无实质性影响。

本基金管理人已向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请并于2015 年5月26日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（www.szse.cn）和本基金管理人网站(www.csfunds.com.cn)上发布了《长盛同庆中证800 指数分级证券投资基金分级运作期届满基金份额转换结果的公告》。

（三）本基金日常申购、赎回安排

本基金管理人自2015 年5月25日开始办理本基金的日常申购、赎回业务。具体业务办理规则请见相关公告。

（四）本基金份额上市交易的主要内容

1. 基金上市交易的被准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上（2015）378号
2. 上市交易日期:2015年8月6日
3. 上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4. 本次上市的基金份额简称及代码:长盛同庆，基金代码:160806
5. 本次上市交易份额:292,227,017.00份（截至2015年7月30日）
6. 基金资产净值的披露:每个工作日的次日公布长盛同庆份额净值，并在深交所行情发布系统揭示。
7. 未上市交易份额的流通规定:未上市交易的长盛同庆份额托管在场外，其持有人在符合相关办理条件的前提下，基金份额持有人将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后，方可上市流通。
8. 本基金开通跨系统转托管业务日期:2015年5月25日，具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

（一）本基金基金份额持有情况

截至2015年7月30日，长盛同庆份额持有人户数为11693户，平均每户持有的基金份额为27,311.33份。

（二）本基金持有人结构

截至2015年7月30日，场内机构投资者持有的本次上市交易的长盛同庆份额159,548,640.00份，占场内总份额的比例为54.60%；场内个人投资者持有的本次上市交易的长盛同庆份额132,678,377.00份，占场内总份额的比例为45.40%。

（三）场内长盛同庆份额前十名持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有长盛同庆份额	占场内总份额比例
1	信诚人寿保险有限公司－分红－个险分红	80,191,944.00	27.44%
2	中信证券股份有限公司	21,752,349.00	7.44%
3	上海盛英投资咨询有限公司	15,886,463.00	5.44%
4	中国工商银行股份有限公司企业年金计划－中国建设银行	8,332,262.00	2.85%
5	信泰人寿保险股份有限公司－分红保险产品	8,096,297.00	2.77%
6	中船重工财务有限责任公司	7,285,002.00	2.49%
7	魏小艳	6,271,508.00	2.15%
8	工银瑞信基金公司－农行－中国农业银行离退休人员福利负债	4,805,376.00	1.64%
9	盛英阳	2,540,685.00	0.87%
10	余栋腾	2,392,881.00	0.82%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

名称:长盛基金管理有限公司
住所:深圳市福田中心区福中三路诺德金融中心主楼10D
办公地址:北京市海淀区北大平庄路18号城建大厦A座21层
法定代表人:高新
电话:（010）82019988
传真:（010）82259988
联系人:叶金松
2.经营概况

本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6号文批准，于1999年3月26日成立，注册资本为人民币18900万元。截至目前，基金管理人股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司占注册资本的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%。截至2015年7月28日，基金管理人共管理三十九只开放式基金和五只社保基金委托资产，同时管理专户理财产品。

公司目前下设二十二个部门,分公司及营销中心和两个全资子公司,分别是:权益投资部、研究部、交易部、国际业务部、社保业务管理部、固定收益部、专户理财部、产品开发部、市场销售总部、电子商务部、北京分公司、郑州分公司、上海分公司、杭州分公司、成都分公司、华南营销中心、业务运营部、信息技术部、财务会计部、人力资源部、总经理办公室、监察稽核部、风险管理部以及长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。

权益投资部主要负责境内公募基金的投资组合管理;研究部主要负责行业与上市公司研究,投资备选库建立、维护与更新;交易部主要负责完成基金经理、组合经理及投资经理下达的交易指令;国际业务部主要负责QDII产品的投资运作管理及QFII投资顾问服务;社保业务管理部主要负责公司社保组合的投资管理工作;固定收益部主要负责公司固定收益产品的投资管理与研究工作;专户理财部主要负责特定资产管理业务的客户营销和服务、产品开发设计和投资管理工作;产品开发部主要负责基金产品的开发报批及产品维护工作;市场销售总部主要负责基金销售策略及基金销售计划制订、客户服务、销售渠道管理等工作;电子商务部主要负责制定及实施公司品牌宣传及市场推广计划;北京分公司、郑州分公司、上海分公司、杭州分公司、成都分公司和华南营销中心主要负责所辖区域的营销策划与基金销售工作;业务运营部主要负责基金核算与估值开放式基金注册与登记,以及资金清算等工作;信息技术部主要负责公司信息系统的日常运行与维护,以及相关系统的规划与开发等;财务会计部主要负责公司财务管理工作;人力资源部主要负责公司战略及人力资源管理;总经理办公室主要负责公司行政事务的管理;监察稽核部主要负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查;风险管理部主要负责对投资风险的管理与控制。长盛基金（香港）有限公司可开展香港证券及期货事务监察委员会颁发的第四类（就证券提供意见）和第九类（提供资产管理）牌照所允许的业务;长盛创富资产管理有限公司的业务范围为特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务。

截至2015年7月28日,公司共有员工156人,其中具有硕士及以上学历的员工占62%,具有本科学历的员工占35%。研究员和基金经理全部拥有硕士及以上学历,公司员工平均年龄为35岁,平均金融从业年限9年。公司主要业务部门人员全部具有基金从业资格。基金管理人无任何受处罚记录。

3.本基金总经理

王超先生,1981年9月出生,中央财经大学硕士,CFA（特许金融分析师）,FRM（金融风险管理师）,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,长盛航天推工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人

1. 基金托管人基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字1998]12号
联系人:田 睿
联系电话:(0100)759 5096

2. 基金托管部门及主要人员情况

赵观甫,投资托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部、长期从事大客户的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力婷,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部,并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3. 基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉承“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护客户持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过全年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年6月末,中国建设银行已托管514只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

4. 托管业务的内部控制制度

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规,行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监管,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。投资托管业务部专门设置了监督稽核处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核工作职权和能力。

投资托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管,存放、使用、账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完善、独立。

5. 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“托管业务综合系统——基金监督子系统”,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,并定期编写基金投资运作监督报告,报送中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

（1）每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

（3）根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性、投资独立性和风格延续性等方面进行评价,报送中国证监会。

（4）通过技术或手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

（三）基金验资机构

名称:普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:杨绍信
电话:（021）23238888
传真:（021）23238800
经办会计师:汪棣、沈兆杰
联系人:沈兆杰
六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附录:基金合同摘要。

七、基金财务状况

自本基金基金合同生效日起至本上市交易公告书公告日,深圳证券交易所在此期间未收取长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）任何费用,且长盛基金管理有限公司和建设银行根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比率收取申购赎回费。

本基金合同生效后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）截至2015年7月30日资产负债表如下:

单位:人民币元

资 产	2015年7月30日
资 产:	
银行存款	45,588,671.45
结算备付金	1,362,151.95
存出保证金	162,330.04
交易性金融资产	409,135,896.29
其中:股票投资	409,067,580.49
基金投资	–
债券投资	68,315.80
资产支持证券投资	–
贵金属投资	–
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	53,471.04
应收股利	–
应收申购款	13,615.92
递延所得税资产	–
其他资产	–
资产总计	456,316,136.69
负债和所有者权益	2015年7月30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	24,403.35
应付赎回款	1,233,253.89
应付管理人报酬	482,756.25
应付托管费	106,206.39
应付销售服务费	–
应付交易费用	666,335.86
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	1,340,676.05
负债合计	3,853,631.79
所有者权益:	
实收基金	341,079,777.34
未分配利润	111,382,727.56
所有者权益合计	452,462,504.90
负债和所有者权益总计	456,316,136.69

八、基金投资组合

截至2015年7月30日,长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）的投资组合如下:

（一）基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	409,067,580.49	89.65
	其中:股票	409,067,580.49	89.65
2	固定收益投资	68,315.80	0.01
	其中:债券	68,315.80	0.01
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	46,950,823.40	10.29
7	其他资产	229,417.00	0.05
8	合计	456,316,136.69	100.00

（二）按行业分类的股票投资组合

1.指数投资按行业分类的股票投资组合

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	2,774,965.68	0.61
B	采矿业	14,174,853.83	3.13
C	制造业	172,469,912.35	38.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,601,392.34	3.45
E	建筑业	15,148,068.38	3.35
F	批发和零售业	15,008,655.75	3.32
G	交通运输、仓储和邮政业	14,221,150.61	3.14
H	住宿和餐饮业	302,919.54	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,517,501.79	5.42
J	金融业	90,443,170.96	19.99
K	房地产业	21,033,155.97	4.65
L	租赁和商务服务业	6,943,249.28	1.53
M	科学研究和技术服务业	1,034,572.18	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	3,171,092.47	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	677,846.80	0.15
R	文化、体育和娱乐业	6,530,504.06	1.44
S	综合	2,402,171.82	0.53
	合计	406,455,183.81	89.83

2.积极投资按行业分类的股票投资组合

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	163,958.56	0.04
B	采矿业	–	–
C	制造业	1,102,822.84	0.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	216,314.28	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,129,301.00	0.25
J	金融业	–	–
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	2,612,396.68	0.58

（三）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

1.指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

代码	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	304,264	10,439,297.84	2.31
2	600036	招商银行	487,440	8,276,731.20	1.83
3	600016	民生银行	797,850	7,220,542.50	1.60
4	600000	浦发银行	353,612	5,268,818.80	1.16
5	601166	兴业银行	323,369	4,947,545.70	1.09
6	600030	中信证券	223,234	4,661,125.92	1.03
7	601398	工商银行	874,033	4,186,618.07	0.93
8	600837	海通证券	229,043	3,957,863.04	0.87
9	000002	万科A	271,094	3,817,003.52	0.84
10	601766	中国中车	212,082	3,261,821.16	0.72

2.积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002354	天神娱乐	14,386	1,129,301.00	0.25
2	002429	兆驰股份	38,129	454,116.39	0.10
3	000959	首钢股份	74,405	376,489.30	0.08
4	002416	爱施德	12,922	216,314.28	0.05
5	000510	*ST金路	23,306	209,754.00	0.05

（四）按券种分类的债券投资组合:

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	68,315.80	0.02
8	其他	–	–
9	合计	68,315.80	0.02

（五）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细:

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110031	航信转债	490	68,315.80	0.02

注:本基金本报告期未仅持有上述1只债券。

（六）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:截至2015年7月30日,本基金未持有资产支持证券。

（七）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:截至2015年7月30日,本基金未持有贵金属。

（八）按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:截至2015年7月30日,本基金未持有权证。

（九）本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。

（十）本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

（十一）投资组合报告附注

1. 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日（2015年7月30日）前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（1）本基金跟踪复制标的指数中证800指数,配置了中证800指数成分股中国平安。

根据2014年12月8日中国证券监管管理委员会发布对该公司控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》,决定对平安证券给予警告,没收保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2867万元,并处以440万元罚款。本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

（2）本基金跟踪复制标的指数中证800指数,配置了中证800指数成分股中信证券。

根据2015年1月16日中国证券监管管理委员会2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报,对中信证券采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

（3）本基金跟踪复制标的指数中证800指数,配置了中证800指数成分股兴业银行。

根据2015年6月9日兴业银行公告“2015年5月中旬,公司南宁分行下辖二级分行北海分行接到北海市公安局通报,该分行前员工苏瑜涉嫌个人非法集资已被立案,目前案件在调查阶段。公司南宁以及北海两级分行成立专项调查小组,就其涉及业务进行了全面内部排查,未发现银行资金卷入其中。目前,公司北海分行经营、财务状况与对外服务均正常。”本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

（4）本基金跟踪复制标的指数中证800指数,配置了中证800指数成分股海通证券。

根据2015年1月16日中国证券监管管理委员会2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报,对海通证券采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

除上述情况外,本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2. 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

3. 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	162,330.04
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	53,471.04
5	应收申购款	13,615.92
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	229,417.00

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:截至2015年7月30日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

（1）期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:截至2015年7月30日,本基金持有的指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

（2）期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002429	兆驰股份	454,116.39	0.10	重大事项停牌
2	000959	首钢股份	376,489.30	0.08	重大事项停牌

6. 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易公告书公告日期间发生的重大事件如下:

（一）2015年5月26日本基金管理人发布《长盛同庆中证800 指数分级证券投资基金分级运作期届满基金份额转换结果的公告》。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所,投资者可在办公时间免费查阅;也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件,但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会核准长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金募集的文件;

（二）中国证监会核准长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复;

（三）《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议公告》

（四）《长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）基金合同》;

（五）《长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）托管协议》;

（六）《长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）招募说明书》;

（七）法律意见书;

（八）基金管理人业务资格批件、营业执照;

（九）基金托管人业务资格批件、营业执照;

（十）中国证监会要求的其他文件。

以上第（九）项备查文件存放在基金托管人的办公场所,其他文件存放在基金管理人的办公场所。基金投资者在营业时间内可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

长盛基金管理有限公司
2015年8月3日

附录 基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利和义务

（一）基金管理人的权利与义务

本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司。

A、基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的权利为:

1.自本基金合同生效之日起,依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产;

2.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

3.发售基金份额;

4.依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

5.在符合有关法律法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则,在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式;

6.根据本基金合同及有关规定监督基金托管人,对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应及时呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;

7.在基金合同约定的范围内,拒绝或暂停受理申购和赎回申请;

8.在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券;

9.自行担任或选择、更换注册登记机构,获取基金份额持有人名册,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

10.选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

12.在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

13.依法召集基金份额持有人大会;

14.法律法规和基金合同规定的其他权利。

B、基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规,基金管理人的义务为:

1.依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2.办理基金备案手续;

3.自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;

4.配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5.建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

6.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7.依法接受基金托管人的监督;

8.计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回价格;

9.采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;

10.按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

12.编制中期和年度基金报告;

13.严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

14.保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、投资意向等,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;

15.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配收益;

16.依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

17.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

18.以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

19.组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

20.因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益,应当