

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)
(原长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型)
2015 年半年度报告 摘要

2015 年 6 月 30 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

送出日期：2015 年 8 月 27 日

§ 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 2015 年 8 月 26 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。

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于 2012 年 5 月 22 日起进入三年分级运作期。在分级运作期内，长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金分为长盛同庆份额、同庆 800A 份额和同庆 800B 份额三类风险收益特征不同的份额进行运作。上述分级运作期于 2015 年 5 月 21 日到期。根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》的约定，在分级运作期到期后，同庆 800A 份额和同庆 800B 份额转换为长盛同庆 (LOF) 份额，长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金于 2015 年 5 月 22 日变更为非分级的指数型基金，基金名称相应变更为“长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)”。变更后，基金的投资管理程序、投资策略、投资理念、投资范围不变。就前述基金变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及本基金基金合同约定履行相关备案手续。)

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 2015 年 5 月 22 日 (基金合同生效日) 起至 06 月 30 日止。(注：长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 5 月 21 日止)。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况 (转型后)

基金简称	长盛同庆中证 800 指数 (LOF)
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	2015 年 5 月 22 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	439,704,186.13 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	2015 年 8 月 6 日

2.1 基金基本情况 (转型前)

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	542,268,490.78 份		
基金合同存续期	2012 年 5 月 22 日起进入三年分级运作期, 于 2015 年 5 月 21 日结束		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012-05-31		
下属分级基金的基金简称	长盛同庆 800A	长盛同庆 800B	长盛同庆中证 800 分级
下属分级基金场内简称:	同庆 A	同庆 B	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	0.00 份	0.00 份	542,268,490.78 份

注: 转型前报告期末指: 2015 年 5 月 21 日。

2.2 基金产品说明 (转型后)

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。
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。

2.2 基金产品说明 (转型前)

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。		
下属分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	tianqingl.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

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》
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办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标 (转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年5月22日 - 2015年6月30日)	
	转型后	
本期已实现收益	144,115,132.73	
本期利润	-52,695,271.81	
加权平均基金份额本期利润	-0.1111	
本期基金份额净值增长率	-8.42%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.5745	
期末基金资产净值	722,215,236.05	
期末基金份额净值	1.643	

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到 2015 年 6 月 30 日。

3、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。

3.1 主要会计数据和财务指标 (转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年5月21日)	
	转型前	
本期已实现收益	150,196,313.47	
本期利润	379,530,889.92	
加权平均基金份额本期利润	0.5409	

本期基金份额净值增长率	47.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2015 年 5 月 21 日)
期末可供分配基金份额利润	0.3662
期末基金资产净值	972,864,247.08
期末基金份额净值	1.794

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到 2015 年 5 月 21 日。

3、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。

3.2 基金净值表现 (转型后)

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	转型后					
	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	-9.48%	3.53%	-8.02%	3.34%	-1.46%	0.19%
自基金转型起至今	-8.42%	3.47%	-7.05%	3.28%	-1.37%	0.19%

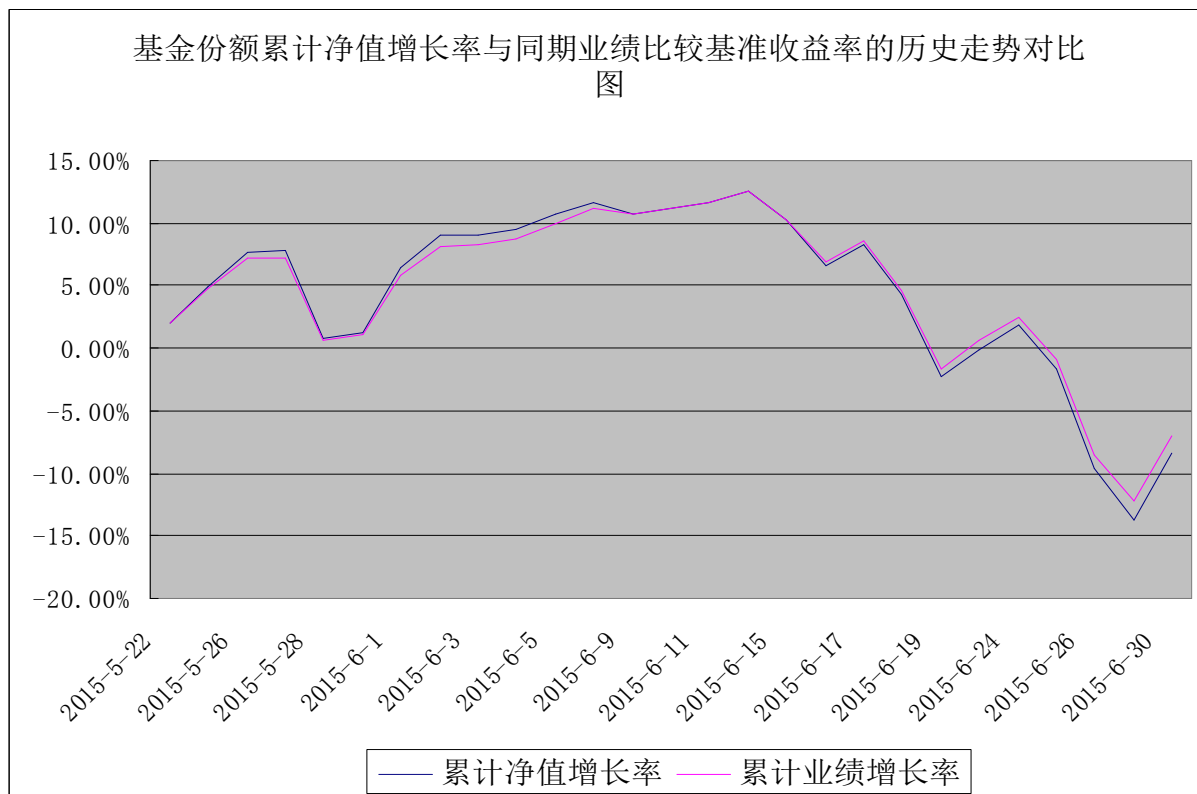
本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率 (税后)}$

本基金为指数型基金，股票资产跟踪的标的指数为中证 800 指数。中证 800 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数。其成份股由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。

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 95%、5% 的比例采取再平衡，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、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为 2015 年 5 月 22 日，截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，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。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十四条（三）投资范围、（九）投资限制的有关约定。截止本报告期末仍处于建仓期。

3、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 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 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的 5%。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.3 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

转型前						
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	5.10%	2.05%	4.94%	1.98%	0.16%	0.07%
过去三个月	20.81%	1.71%	21.96%	1.65%	-1.15%	0.06%

过去六个月	47.78%	1.62%	45.11%	1.59%	2.67%	0.03%
过去一年	116.93%	1.38%	120.89%	1.35%	-3.96%	0.03%
过去三年	99.91%	1.27%	108.97%	1.26%	-9.06%	0.01%
自基金转型起至今	92.59%	1.25%	95.85%	1.25%	-3.26%	0.00%

本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

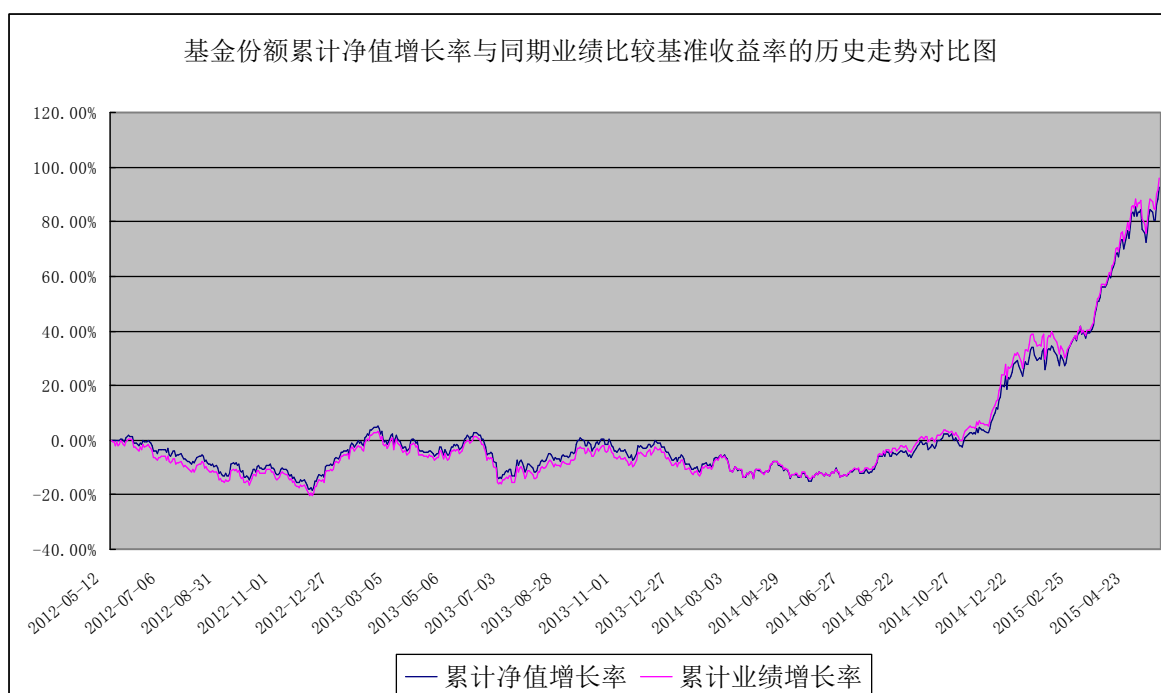
本基金业绩比较基准 = 95% × 中证 800 指数收益率 + 5% × 一年期银行定期存款利率 (税后)。

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。

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, 再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.4 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: 长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金存续期为 2012 年 5 月 12 日至 2015 年 5 月 21 日。

§ 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 18900 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，在香港、北京分别设有子公司。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 2015 年 6 月 30 日，基金管理人共管理三十九只开放式基金，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（转型前）

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，长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理。	2012 年 7 月 20 日	2015 年 5 月 21 日	8 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，从事量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。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（本基金）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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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，长盛同瑞中证 200 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，长盛航天海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，长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。	2015 年 5 月 22 日	-	8 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基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF, 本基金) 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，长盛航天海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，长盛量化红利策略股票型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合规守信情况的说明

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、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (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,未发生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2015年6月30日,长盛同庆中证800指数(LOF)份额净值为1.643元,本报告期(2015年5月22日至2015年6月30日)份额净值增长率为-8.42%,同期业绩比较基准增长率为-7.05%。报告期内,本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.19%,控制在0.35%之内;年化跟踪误差为3.86%,控制在4%之内。

截至2015年5月21日,长盛同庆中证800指数分级份额净值为1.794元,本报告期(2015年1月1日至2015年5月21日)份额净值增长率为47.78%,同期业绩比较基准增长率为45.11%。报告期内,本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.16%,控制在0.35%之内;年化跟踪误差为3.60%,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

A股市场在2015年上半年呈现了冲高之后大幅回落的特征。上证指数在6月12日创下本轮反弹新高5178之后,便在清查场外配资等消息的影响下出现快速大幅下跌。前期出现大幅上涨的创业板和中小板成为主要下跌对象,大盘蓝筹在下跌初期,由于具有较好的流动性,出现了恐慌性的抛售。针对杠杆平仓导致的本轮股市大幅下跌,已经超出了市场正常价值回归的范围,后面不及时监管干预,极有可能酿成系统性风险。对此监管机构也予以充分重视,出台了密集的救市措施予以应对。二季度公布的宏观经济数据虽然还在探底,但是已经出现了结构性回暖迹象,相信在政府保增长政策密集出台的情况下,宏观经济有望于三季度企稳。

展望2015年下半年的行情,高估值类股票仍将处于估值回归的过程,而估值具备明显优势的大盘蓝筹类股,将受益于宏观经济触底反弹和国企改革等因素而预期出现上涨,相对市场整体获得明显的超额收益。

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、风险管理部、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。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议,由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分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》的规定以及长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同第十八条中对基金利润分配原则的约定,本基金本报告期末未实施利润分配。长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 截至 2015 年 6 月 30 日,期末可供分配利润为 252,590,425.61 元,其中,未分配利润已实现部分为 292,245,112.29 元,未分配利润未实现部分为-39,654,686.68 元。

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定及长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同第二十一节中对基金利润分配原则的约定,在本基金分级运作期内,本基金 (包括长盛同庆 800A、长盛同庆 800B 和长盛同庆中证 800 分级基金份额) 不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§ 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表（转型前）

会计主体：长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 5 月 21 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 5 月 21 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	38,034,965.95	60,365,980.34
结算备付金	-	694,771.26
存出保证金	229,267.93	1,213,680.45
交易性金融资产	905,725,908.69	969,984,095.68
其中：股票投资	905,097,866.59	969,984,095.68
基金投资	-	-
债券投资	628,042.10	-
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	46,139,884.30	28,577,360.35
应收利息	80,780.10	18,930.13
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	990,210,806.97	1,060,854,818.21

负债和所有者权益	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 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	15,274,647.79	22,556,787.67
应付管理人报酬	550,108.35	936,243.33
应付托管费	121,023.82	205,973.52
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	87,694.66	1,435,204.91
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,313,085.27	1,549,403.03
负债合计	17,346,559.89	26,683,612.46
所有者权益:		
实收基金	579,170,644.88	909,795,613.87
未分配利润	393,693,602.20	124,375,591.88
所有者权益合计	972,864,247.08	1,034,171,205.75
负债和所有者权益总计	990,210,806.97	1,060,854,818.21

注: 报告截止日 2015 年 5 月 21 日, 基金份额净值 1.794 元, 基金份额总额 542,268,490.78 份, 其中长盛同庆 800A 基金份额为 0.00 份, 长盛同庆 800B 基金份额为 0.00 份, 长盛同庆中证 800 分级基金份额为 542,268,490.78 份。

6.2 利润表

会计主体: 长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金

本报告期: 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入	385,227,836.10	-74,432,668.97
1. 利息收入	198,146.76	534,694.86
其中: 存款利息收入	197,987.74	513,960.42
债券利息收入	159.02	20,734.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-

2. 投资收益 (损失以“-”填列)	155,109,715.73	-36,595,058.21
其中: 股票投资收益	153,674,444.19	-57,599,070.08
基金投资收益	-	-
债券投资收益	42,817.11	31,199.06
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,392,454.43	20,972,812.81
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	229,334,576.45	-39,028,098.30
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	585,397.16	655,792.68
减: 二、费用	5,696,946.18	15,479,686.94
1. 管理人报酬	3,778,505.91	9,002,864.64
2. 托管费	831,271.26	1,980,630.25
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	904,156.09	4,207,707.43
5. 利息支出	-	-
其中: 卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	183,012.92	288,484.62
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	379,530,889.92	-89,912,355.91
减: 所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	379,530,889.92	-89,912,355.91

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金

本报告期: 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 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)	909,795,613.87	124,375,591.88	1,034,171,205.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	379,530,889.92	379,530,889.92
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)	-330,624,968.99	-110,212,879.60	-440,837,848.59
其中: 1. 基金申购款	89,137,038.94	15,149,616.07	104,286,655.01

2. 基金赎回款	-419,762,007.93	-125,362,495.67	-545,124,503.60
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)	579,170,644.88	393,693,602.20	972,864,247.08
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	2,202,863,302.40	-369,610,081.97	1,833,253,220.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-89,912,355.91	-89,912,355.91
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)	1,177,195,141.04	-303,997,900.69	873,197,240.35
其中: 1. 基金申购款	1,857,055,812.46	-448,396,586.89	1,408,659,225.57
2. 基金赎回款	-679,860,671.42	144,398,686.20	-535,461,985.22
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)	3,380,058,443.44	-763,520,338.57	2,616,538,104.87

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

长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金是根据长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金(以下简称“长盛同庆封闭基金”)基金份额持有人大会 2012 年 4 月 10 日决议通过的《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》,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可字[2012]549 号《关于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》,由原基金长盛同庆封闭基金转型而来。原基金长盛同庆封闭基金为契约型封闭式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期限至 2012 年 5 月 11 日止。根据深交所《终止上市通知书》(深证上[2012]116 号)的同意,自

2012 年 5 月 14 日起, 原基金长盛同庆封闭基金终止上市, 并更名为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”), 《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》失效的同时《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式, 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, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原长盛同庆封闭基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 12,925,228,407.02 元, 已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。此外, 根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金封闭期到期同庆 A、同庆 B 停止转托管业务并进行基金份额转换的公告》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金封闭期到期基金份额转换结果的公告》的规定, 本基金的基金管理人于 2012 年 5 月 14 日对原长盛同庆封闭之同庆 A 和同庆 B 份额进行了基金份额转换, 将原长盛同庆封闭基金之同庆 A 和同庆 B 份额折算为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“长盛同庆中证 800 分级份额”), 并于 2012 年 5 月 14 日进行了变更登记。

根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金进入分级运作期份额折算及分拆的公告》的规定, 本基金自 2012 年 5 月 22 日起进入分级运作期, 为期三年; 分级运作期到期后, 本基金将转换为上市开放式基金(LOF)。在分级运作期起始日, 即 2012 年 5 月 22 日, 本基金的基金管理人对长盛同庆中证 800 分级份额进行了份额折算, 折算后长盛同庆中证 800 分级份额的份额净值为人民币 1.000 元。

根据基金合同的有关规定, 本基金在分级运作期内的基金份额包括长盛同庆中证 800 分级份额、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“同庆 800A 份额”)以及长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“同庆 800B 份额”)。本基金在分级运作期起始日, 场内长盛同庆中证 800 分级份额按 4:6 的比例分离成同庆 800A 份额和同庆 800B 份额, 各类基金份额的基金资产合并运作。

长盛同庆中证 800 分级份额只接受场外与场内申购和赎回, 同庆 800A 份额和同庆 800B 份额可单独在上市交易但不接受申购和赎回。经深交所深证上[2012]137 号文审核同意, 同庆 800A 份额和同庆 800B 份额于 2012 年 5 月 31 日在深交所挂牌交易。截至 2012 年 5 月 30 日, 长盛同庆基金份额净值为 1.013 元, 同庆 800A 基金份额参考净值为 1.002 元, 同庆 800B 基金份额参考净值为 1.020 元。未上市交易的长盛同庆中证 800 分级份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可按照 4:6 的比例与同庆 800A 份额和同庆 800B 份额进行配对转换。

在分级运作期内, 在自分级运作期起始日后满一年和满两年的对应日(若该对应日为非工作日, 则顺延至下一个工作日), 本基金的基金管理人将根据基金合同的规定对长盛同庆中证 800 分级份额、同庆 800A 份额和同庆 800B 份额的基金份额进行份额折算; 此外, 若同庆 800B 份额的参考净值跌至 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长盛同庆中证 800 分级份额、同庆 800A 份额和同庆 800B 份额的基金份额进行不定期份额折算。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同的有关规定, 本基金的投资范围为本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(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(但须符合中国证监会的相关规定)。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 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%; 其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种, 其中权证资产占基金资产净值的比例为 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的 5%。本基金的业绩比较基准为: $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率(税后)}$ 。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会及中国证券投资基金业协会发布的有关规定及允许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 2015 年 5 月 21 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 5 月 21 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 本基金自 2015 年 3 月 24 日起按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

除上述会计估值变更事项外, 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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金自 2015 年 3 月 24 日起采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 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。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 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（“长盛基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生交易。

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 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 5 月 21 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日 至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,778,505.91	9,002,864.64
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	122,656.54	186,730.54

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 1.00% 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 × 1.00% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	831,271.26	1,980,630.25

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/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自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自有资金投资本基金。

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 2015年1月1日至2015年5月21日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国建设银行	38,034,965.95	186,037.57	181,492,286.97	466,829.55

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管, 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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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(2015年5月21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	复牌日期	复牌	数量(股)	期末	期末	备注
				估值单价		开盘		成本总额	估值总额	
601766	中国中车	20150507	重大事项	33.77	20150608	32.4	361,882	6,241,858.66	12,220,755.14	-
601899	紫金	20150507	重大	5.36	20150507	5.76	547,006	1,378,947.64	2,931,952.16	-

	矿业	422	事项		0527					
600584	长电科技	20150407	重大事项	23.54	20150521	19.68	123,300	1,353,367.44	2,902,482.00	-
000024	招商地产	20150403	重大事项	38.27	-	-	71,507	1,726,893.33	2,736,572.89	-
601888	中国国旅	20150316	重大事项	82.59	20150604	56.5	27,039	1,121,742.05	2,233,151.01	-
300017	网宿科技	20150513	重大事项	59.46	20150615	60.07	29,843	653,265.97	1,774,464.78	-
002081	金螳螂	20150512	重大事项	32.53	20150617	35.67	54,195	890,472.79	1,762,963.35	-
600597	光明乳业	20150309	重大事项	29.08	20150609	21.52	44,702	776,381.48	1,299,934.16	-
000630	铜陵有色	20150309	重大事项	22.98	-	-	56,107	856,838.61	1,289,338.86	-
600645	中源协和	20150427	重大事项	99.26	-	-	12,448	504,909.62	1,235,588.48	-
600516	方大炭素	20150331	重大事项	15.90	20150603	14.34	71,403	758,621.95	1,135,307.70	-
600522	中天科技	20150309	重大事项	30.37	20150525	20.01	29,792	432,315.37	904,783.04	-
600872	中炬高新	20150504	重大事项	23.99	-	-	37,456	387,505.61	898,569.44	-
002292	奥飞动漫	20150518	重大事项	75.78	-	-	11,589	343,024.55	878,214.42	-
600879	航天电子	20150515	重大事项	24.50	-	-	34,524	542,050.03	845,838.00	-
600797	浙大网新	20150211	重大事项	18.75	20150601	10.01	43,372	318,845.39	813,225.00	-
600765	中航重机	20150505	重大事项	37.74	20150609	33.84	20,499	415,348.64	773,632.26	-
002701	奥瑞金	20150514	重大事项	31.08	20150624	31.88	24,460	322,006.86	760,216.80	-
600967	北方创业	20150413	重大事项	24.39	-	-	30,568	420,278.32	745,553.52	-
002001	新和成	20150521	重大事项	20.07	20150522	21.98	33,753	514,365.77	677,422.71	-
002221	东华能源	20150424	重大事项	48.48	20150525	46.04	12,910	213,444.27	625,876.80	-
600151	航天机电	20150508	重大事项	19.96	20150612	16.91	31,281	299,266.63	624,368.76	-
002368	太极股份	20150514	重大事项	107.93	-	-	5,772	247,926.86	622,971.96	-
600572	康恩	20150514	重大	32.16	20150514	30.57	17,893	307,303.91	575,438.88	-

	贝	427	事项		0608					
000786	北新建材	20150410	重大事项	43.19	-	-	13,162	226,259.49	568,466.78	-
000690	宝新能源	20150513	重大事项	11.02	20150603	12.12	50,656	315,080.32	558,229.12	-
002429	兆驰股份	20150519	重大事项	14.15	20150619	15.53	39,329	303,203.78	556,505.35	-
600376	首开股份	20150513	重大事项	13.76	20150603	15.14	37,609	187,356.27	517,499.84	-
002106	莱宝高科	20150407	重大事项	21.64	-	-	23,046	295,290.54	498,715.44	-
600747	大连控股	20150204	重大事项	9.21	20150623	6.8	54,104	361,462.61	498,297.84	-
600086	东方金钰	20150319	重大事项	46.90	20150615	36.3	9,900	251,378.68	464,310.00	-
000536	华映科技	20150521	重大事项	23.58	20150603	25.94	19,240	287,354.35	453,679.20	-
600289	亿阳信通	20150513	重大事项	23.96	20150527	26.36	18,786	189,198.38	450,112.56	-
000959	首钢股份	20150423	重大事项	6.03	-	-	74,405	297,548.46	448,662.15	-
600970	中材国际	20150504	重大事项	21.39	20150601	19.50	20,962	281,205.23	448,377.18	-
300088	长信科技	20150518	重大事项	32.00	20150610	31.9	13,455	204,794.81	430,560.00	-
000062	深圳华强	20150313	重大事项	44.87	20150521	30.04	9,483	151,086.50	425,502.21	-
002093	国脉科技	20150415	重大事项	20.68	20150520	16.67	19,194	117,217.30	396,931.92	-
000697	炼石有色	20150518	重大事项	33.85	-	-	11,698	237,245.03	395,977.30	-
600259	广晟有色	20150504	重大事项	65.01	20150601	72.81	6,064	357,887.78	394,220.64	-
002414	高德红外	20150513	重大事项	39.38	-	-	9,921	228,099.08	390,688.98	-
600614	鼎立股份	20150330	重大事项	32.13	20150623	26.06	11,726	162,792.89	376,756.38	-
000021	深科技	20150519	重大事项	15.00	20150603	16.5	24,421	187,417.30	366,315.00	-
600628	新世界	20150408	重大事项	17.75	20150617	15.7	20,055	202,904.93	355,976.25	-
000510	*ST 金路	20150119	重大事项	10.00	-	-	34,906	190,743.20	349,060.00	-
002727	一心	20150505	重大	95.05	20150505	70.42	3,645	149,496.51	346,457.25	-

	堂	413	事项		0817					
000669	金鸿能源	20150504	重大事项	39.01	20150723	33.95	8,846	255,472.48	345,082.46	-
002249	大洋电机	20150320	重大事项	14.30	20150616	10.54	23,600	139,894.90	337,480.00	-
000850	华茂股份	20150507	重大事项	13.84	-	-	23,333	179,504.71	322,928.72	-
002416	爱施德	20150505	重大事项	24.18	20150729	18.6	12,922	139,865.62	312,453.96	-
600869	智慧能源	20150511	重大事项	35.22	20150731	26.23	8,267	73,080.99	291,163.74	-
002203	海亮股份	20150427	重大事项	13.23	-	-	21,942	134,524.12	290,292.66	-
603555	贵人鸟	20150519	重大事项	53.89	20150522	59.28	5,183	89,770.98	279,311.87	-
002216	三全食品	20150519	重大事项	20.50	20150529	22.54	13,608	136,284.12	278,964.00	-
600657	信达地产	20150521	重大事项	10.07	20150604	11.08	25,567	189,265.71	257,459.69	-
601777	力帆股份	20150427	重大事项	15.72	20150526	16.12	13,455	121,498.65	211,512.60	-
002662	京威股份	20150515	重大事项	18.14	20150813	16.06	6,389	66,952.13	115,896.46	-

注：1、本基金截至 2015 年 5 月 21 日持有的长电科技、深圳华强、国脉科技已于本期末复牌，但交易仍不活跃、流通仍受限，因此仍作为流通受限股票。2、本基金截至 2015 年 5 月 21 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

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最

低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 5 月 21 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次的余额为 851, 723, 439.02 元, 属于第二层次的余额为 54, 002, 469.67 元, 无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日: 第一层次 919, 972, 205.79 元, 第二层次 50, 011, 889.89 元, 无第三层次)。

(ii) 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, 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的公允价值列入第一层次; 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, 确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 本基金于 2015 年 3 月 24 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6.4.5.2), 并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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。

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计) (转型后)

6.1 资产负债表 (转型后)

会计主体: 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2015 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	本期末 2015 年 6 月 30 日
资产:	
银行存款	53, 171, 532. 33
结算备付金	-
存出保证金	220, 137. 48

交易性金融资产	674,656,487.78
其中：股票投资	674,564,942.48
基金投资	-
债券投资	91,545.30
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	11,107.95
应收股利	-
应收申购款	50,198.23
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	728,109,463.77
负债和所有者权益	本期末 2015年6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	-
应付赎回款	3,215,716.43
应付管理人报酬	705,013.08
应付托管费	155,102.87
应付销售服务费	-
应付交易费用	508,709.10
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	1,309,686.24
负债合计	5,894,227.72
所有者权益：	
实收基金	469,624,810.44
未分配利润	252,590,425.61
所有者权益合计	722,215,236.05
负债和所有者权益总计	728,109,463.77

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.643 元，基金份额总额 439,704,186.13 份。2、本基金合同于 2015 年 5 月 22 日生效，本财务报表的实际编制期间为 2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入	-50,670,755.14
1. 利息收入	45,860.87
其中：存款利息收入	45,824.90
债券利息收入	35.97
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)	145,856,478.91
其中：股票投资收益	142,308,690.73
基金投资收益	-
债券投资收益	433,283.05
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	3,114,505.13
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	-196,810,404.54
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	237,309.62
减：二、费用	2,024,516.67
1. 管理人报酬	969,766.96
2. 托管费	213,348.73
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	791,445.55
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	49,955.43
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	-52,695,271.81
减：所得税费用	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-52,695,271.81

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 22 日至 2015 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)	579,170,644.88	393,693,602.20	972,864,247.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-52,695,271.81	-52,695,271.81
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)	-109,545,834.44	-88,407,904.78	-197,953,739.22
其中: 1. 基金申购款	623,266.14	495,610.40	1,118,876.54
2. 基金赎回款	-110,169,100.58	-88,903,515.18	-199,072,615.76
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)	469,624,810.44	252,590,425.61	722,215,236.05

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:

<u>周兵</u>	<u>杨思乐</u>	<u>龚珉</u>
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

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 (以下简称“长盛同庆 800 分级基金”) 分级运作期到期转型而成; 长盛同庆 800 分级基金是由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金 (以下简称“长盛同庆封闭基金”) 转型而成。本基金为契约型开放式, 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, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金 (以下简称“长盛同庆封闭基金”) 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[2009]第 209 号《关于核准长盛同庆可分离交易股票型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《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案, 《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 5 月 12 日正式生效。

长盛同庆 800 分级基金是根据长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金 (以下简称“长盛同

庆封闭基金”)基金份额持有人大会 2012 年 4 月 10 日决议通过的《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》，经中国证监会证监许可字[2012]549 号《关于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》，由原长盛同庆封闭基金转型而来。长盛同庆封闭基金为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市，存续期限至 2012 年 5 月 11 日止。根据深交所《终止上市通知书》(深证上[2012]116 号)的同意，自 2012 年 5 月 14 日起，原长盛同庆封闭基金终止上市，并转型为长盛同庆 800 分级基金，《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》失效的同时《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》生效。

根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金管理人于长盛同庆 800 分级基金分级运作期起始日，即 2012 年 5 月 22 日对长盛同庆中证 800 分级份额进行了份额折算，折算后长盛同庆中证 800 分级份额的份额净值为人民币 1.000 元；长盛同庆 800 分级基金自 2012 年 5 月 22 日起进入分级运作期，为期三年；分级运作期到期后，长盛同庆 800 分级基金将转换为上市开放式基金(LOF)。根据《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》，本基金的基金管理人于 2015 年 5 月 21 日终，对原长盛同庆 800 分级基金 A 类份额和 B 类份额以各自的基金份额净值为基准转换为本基金的基金份额。自 2015 年 5 月 22 日起，《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金基金合同》生效，本基金名称相应变更为“长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)。

经深圳证券交易所深证上[2015]378 号审核同意，本基金 292,227,017.00 份基金份额于 2015 年 8 月 6 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同的有关规定，本基金的投资范围为本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(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(但须符合中国证监会的相关规定)。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 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 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的 5%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率(税后)}$ 。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会及中国证券投资基金业协会发布的有关规定及允许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 2015 年 5 月 22 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日止期间的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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 5 月 22 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款和各类其他应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类其他应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的

参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算, 实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权;
- (2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额, 不足以支付银行转账或其他手续费用时, 基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额;
- (3) 本基金收益每年最多分配 4 次, 每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 20%;
- (4) 场外申购的, 登记在注册登记系统的基金收益分配方式分为两种: 现金分红与红利再投资, 但场外基金份额持有人可以事先选择将所获现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资; 若基金份额持有人事先未做出选择, 本基金默认的收益分配方式是现金分红;
- (5) 场内申购和上市交易的, 登记在证券登记结算系统的基金份额的分红方式只能为现金分红, 基金份额持有人不能选择其他的分红方式, 具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所和中国证券登记结算有限公司的相关规定;
- (6) 基金红利发放日距离收益分配基准日 (即可供分配利润计算截止日) 的时间不得超过 15 个工作日;
- (7) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值, 即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;
- (8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部, 以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分: (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用; (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果, 以决定向其配置资源、评价其业绩; (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征, 并且满足一定条件的, 则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作, 不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作, 本基金确定以下类别股

票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

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（“长盛基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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：本基金本期未通过关联方交易单元发生交易。

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 2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日
当期应支付的管理费	969,766.96
其中：支付销售机构的客户维护费	27,972.18

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 1.00% 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 × 1.00% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日
当期应支付的托管费	213,348.73

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 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：本基金本报告期内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自有资金投资本基金的情况

注：基金管理人本期末未运用自有资金投资本基金。

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	
	2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	53,171,532.33	45,422.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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：本基金本期末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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2015 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：本基金本期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

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	复牌期	复牌	数量 (股)	期末	期末	备注
				估值价		开盘 单价		成本总额	估值总额	
600900	长江电力	20150615	重大事项	12.37	-	-	216,220	2,205,802.63	2,674,641.40	-
000024	招商地产	20150403	重大事项	36.50	-	-	71,507	1,726,893.33	2,610,005.50	-

600886	国投 电力	20150624	重大 事项	14.87	-	-	145,878	965,095.36	2,169,205.86	-
002183	怡亚 通	20150601	重大 事项	65.78	-	-	23,358	340,422.62	1,536,489.24	-
000917	电广 传媒	20150528	重大 事项	30.82	-	-	41,338	697,549.73	1,274,037.16	-
000709	河北 钢铁	20150630	重大 事项	7.00	20150824	6.30	181,098	368,783.44	1,267,686.00	-
600153	建发 股份	20150629	重大 事项	17.51	-	-	72,264	721,291.46	1,265,342.64	-
000793	华闻 传媒	20150526	重大 事项	16.89	-	-	69,395	788,511.73	1,172,081.55	-
000630	铜陵 有色	20150309	重大 事项	10.32	-	-	112,214	856,838.61	1,158,048.48	-
601111	中国 国航	20150630	重大 事项	15.36	20150729	13.78	72,124	559,405.25	1,107,824.64	-
002354	天神 娱乐	20150528	重大 事项	69.62	20150723	87.27	15,786	766,281.61	1,099,021.32	-
600645	中源 协和	20150427	重大 事项	81.32	-	-	12,448	504,909.62	1,012,271.36	-
002353	杰瑞 股份	20150527	重大 事项	35.05	-	-	28,238	856,493.68	989,741.90	-
000778	新兴 铸管	20150615	重大 事项	10.16	-	-	95,482	575,116.76	970,097.12	-
600978	宜华 木业	20150618	重大 事项	18.59	-	-	51,797	406,282.29	962,906.23	-
000839	中信 国安	20150629	重大 事项	23.57	-	-	39,926	424,412.83	941,055.82	-
600410	华胜 天成	20150528	重大 事项	34.36	20150722	43.06	25,254	517,075.99	867,727.44	-
600872	中炬 高新	20150504	重大 事项	23.16	-	-	37,456	387,505.61	867,480.96	-
002292	奥飞 动漫	20150518	重大 事项	37.29	-	-	23,178	343,024.55	864,307.62	-
601718	际华 集团	20150617	重大 事项	12.54	20150702	13.61	67,443	429,268.76	845,735.22	-
600654	中安 消	20150629	重大 事项	30.91	-	-	27,149	287,504.85	839,175.59	-
002223	鱼跃 医疗	20150625	重大 事项	67.20	20150713	60.48	12,361	364,761.77	830,659.20	-
600879	航天 电子	20150515	重大 事项	23.59	-	-	34,524	542,050.03	814,421.16	-
000566	海南 海药	20150618	重大 事项	40.75	-	-	19,144	473,970.96	780,118.00	-

000748	长城信息	20150618	重大事项	27.25	-	-	28,512	636,892.24	776,952.00	-
000592	平潭发展	20150630	重大事项	29.76	20150714	30.00	25,100	983,823.71	746,976.00	-
600643	爱建股份	20150630	重大事项	16.73	-	-	42,561	442,547.98	712,045.53	-
002276	万马股份	20150630	重大事项	34.15	20150720	30.74	20,049	299,180.62	684,673.35	-
002018	华信国际	20150615	重大事项	32.85	-	-	20,800	755,248.00	683,280.00	-
002310	东方园林	20150527	重大事项	28.57	-	-	23,733	430,149.91	678,051.81	-
600110	中科英华	20150626	重大事项	13.73	-	-	48,685	357,413.58	668,445.05	-
600175	美都能源	20150629	重大事项	10.64	20150720	9.58	62,316	377,634.66	663,042.24	-
300144	宋城演艺	20150618	重大事项	56.66	20150720	68.82	11,700	989,018.10	662,922.00	-
000963	华东医药	20150626	重大事项	71.48	20150805	69.20	9,272	501,632.41	662,762.56	-
601021	春秋航空	20150626	重大事项	126.09	20150721	113.48	5,200	631,702.28	655,668.00	-
601633	长城汽车	20150619	重大事项	36.70	20150713	38.50	17,675	720,093.87	648,672.50	-
000878	云南铜业	20150608	重大事项	18.54	-	-	34,498	481,871.59	639,592.92	-
600967	北方创业	20150413	重大事项	20.85	-	-	30,568	420,278.32	637,342.80	-
002191	劲嘉股份	20150618	重大事项	15.77	-	-	40,116	365,958.04	632,629.32	-
601216	内蒙君正	20150629	重大事项	24.07	20150702	24.20	26,116	358,658.84	628,612.12	-
600312	平高电气	20150623	重大事项	20.88	-	-	29,854	501,886.91	623,351.52	-
600277	亿利能源	20150601	重大事项	12.74	-	-	48,886	424,213.44	622,807.64	-
600499	科达洁能	20150610	重大事项	22.85	-	-	26,133	532,823.62	597,139.05	-
000887	中鼎股份	20150630	重大事项	24.75	-	-	23,677	413,539.00	586,005.75	-
600587	新华医疗	20150522	重大事项	50.16	20150703	52.77	11,226	360,142.84	563,096.16	-
002375	亚厦股份	20150617	重大事项	23.96	20150720	26.29	23,493	300,419.79	562,892.28	-

000786	北新建材	20150410	重大事项	19.13	-	-	26,324	226,259.49	503,578.12	-
001696	宗申动力	20150630	重大事项	17.25	20150824	15.53	29,182	316,880.97	503,389.50	-
000066	长城电脑	20150618	重大事项	16.84	-	-	29,014	252,437.63	488,595.76	-
000539	粤电力A	20150608	重大事项	10.81	20150721	10.75	43,320	462,451.00	468,289.20	-
000959	首钢股份	20150423	重大事项	6.19	-	-	74,405	297,548.46	460,566.95	-
300291	华录百纳	20150630	重大事项	37.76	20150713	34.65	12,100	546,265.90	456,896.00	-
002368	太极股份	20150514	重大事项	52.73	-	-	8,658	247,926.86	456,536.34	-
002269	美邦服饰	20150522	重大事项	11.29	20150702	10.67	40,120	171,712.89	452,954.80	-
600482	风帆股份	20150528	重大事项	35.79	-	-	12,590	163,858.85	450,596.10	-
000732	泰禾集团	20150625	重大事项	34.20	20150702	30.78	12,976	231,002.38	443,779.20	-
000979	中弘股份	20150525	重大事项	5.65	-	-	77,865	203,482.53	439,937.25	-
600366	宁波韵升	20150522	重大事项	30.71	20150812	31.58	14,269	226,848.96	438,200.99	-
002106	莱宝高科	20150407	重大事项	18.93	-	-	23,046	295,290.54	436,260.78	-
000650	仁和药业	20150612	重大事项	13.39	-	-	32,472	257,882.25	434,800.08	-
601311	骆驼股份	20150618	重大事项	23.31	20150715	25.38	18,642	296,491.81	434,545.02	-
002665	首航节能	20150630	重大事项	27.70	20150701	30.00	15,545	323,160.84	430,596.50	-
000543	皖能电力	20150615	重大事项	18.52	20150714	19.22	23,091	315,510.88	427,645.32	-
002325	洪涛股份	20150603	重大事项	23.87	-	-	17,822	191,406.77	425,411.14	-
002308	威创股份	20150612	重大事项	23.15	-	-	18,300	428,302.94	423,645.00	-
000697	炼石有色	20150518	重大事项	34.15	-	-	11,698	237,245.03	399,486.70	-
002001	新和成	20150630	重大事项	17.09	20150713	18.49	23,153	352,831.18	395,684.77	-
002414	高德红外	20150513	重大事项	39.32	-	-	9,921	228,099.08	390,093.72	-

000669	金鸿能源	20150504	重大事项	41.73	20150723	33.95	8,846	255,472.48	369,143.58	-
600790	轻纺城	20150525	重大事项	12.40	20150818	12.04	28,940	179,982.18	358,856.00	-
000510	*ST金路	20150119	重大事项	9.13	20150624	6.09	34,906	190,743.20	318,691.78	-
002309	中利科技	20150602	重大事项	27.95	20150721	30.05	11,305	212,848.92	315,974.75	-
002345	潮宏基	20150522	重大事项	17.94	-	-	17,482	145,519.88	313,627.08	-
600416	湘电股份	20150522	重大事项	17.95	20150720	20.35	16,957	206,154.66	304,378.15	-
600395	盘江股份	20150609	重大事项	13.05	20150819	14.00	23,286	190,743.53	303,882.30	-
002727	一心堂	20150413	重大事项	82.62	20150817	70.42	3,645	149,496.51	301,149.90	-
600702	沱牌舍得	20150629	重大事项	26.11	20150820	28.00	11,492	225,691.65	300,056.12	-
000850	华茂股份	20150507	重大事项	12.38	-	-	23,333	179,504.71	288,862.54	-
600387	海越股份	20150602	重大事项	23.02	20150630	25.52	12,536	196,370.91	288,578.72	-
002416	爱施德	20150505	重大事项	20.99	20150729	18.60	12,922	139,865.62	271,232.78	-
600869	智慧能源	20150511	重大事项	32.06	20150731	26.23	8,267	73,080.99	265,040.02	-
000788	北大医药	20150525	重大事项	18.39	20150721	18.65	14,289	200,421.42	262,774.71	-
002203	海亮股份	20150427	重大事项	11.82	-	-	21,942	134,524.12	259,354.44	-
600335	国机汽车	20150615	重大事项	27.62	20150721	34.14	8,312	176,633.73	229,577.44	-
000688	建新矿业	20150610	重大事项	14.02	-	-	15,976	136,937.08	223,983.52	-
002461	珠江啤酒	20150604	重大事项	25.67	20150724	23.76	8,105	106,053.92	208,055.35	-
002242	九阳股份	20150615	重大事项	15.25	20150707	17.51	13,517	155,900.80	206,134.25	-
002194	武汉凡谷	20150618	重大事项	21.08	20150724	24.28	9,706	141,278.38	204,602.48	-
002069	獐子岛	20150601	重大事项	17.94	-	-	11,385	133,972.46	204,246.90	-
002091	江苏国泰	20150601	重大事项	22.44	-	-	8,653	140,467.06	194,173.32	-

000519	江南红箭	20150615	重大事项	19.81	-	-	9,675	145,963.69	191,661.75	-
002574	明牌珠宝	20150604	重大事项	17.97	-	-	10,417	106,139.02	187,193.49	-
002238	天威视讯	20150629	重大事项	23.76	-	-	6,636	93,197.90	157,671.36	-
002557	洽洽食品	20150629	重大事项	16.38	20150824	14.74	8,767	125,970.62	143,603.46	-
600333	长春燃气	20150529	重大事项	11.47	20150709	10.77	10,555	82,856.75	121,065.85	-
002662	京威股份	20150515	重大事项	17.82	20150813	16.06	6,389	66,952.13	113,851.98	-
002143	印纪传媒	20150630	重大事项	32.01	20150701	33.50	3,300	127,993.63	105,633.00	-
000693	华泽钴镍	20150630	重大事项	20.57	20150818	22.63	3,307	74,690.73	68,024.99	-

注：1、本基金截至 2015 年 6 月 30 日持有的海越股份、*ST 金路已于本期末复牌，但交易仍不活跃、流通仍受限，因此仍作为流通受限股票。2、本基金截至 2015 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

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2015 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次的余额为 614, 556, 874. 52 元, 属于第二层次的余额为 60, 099, 613. 26 元, 无属于第三层次的余额。

(ii)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, 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的公允价值列入第一层次; 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, 确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 本基金于 2015 年 3 月 24 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 6. 4. 5. 2), 并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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 (转型前)

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	905, 097, 866. 59	91. 40
	其中: 股票	905, 097, 866. 59	91. 40
2	固定收益投资	628, 042. 10	0. 06
	其中: 债券	628, 042. 10	0. 06
	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	38, 034, 965. 95	3. 84
7	其他资产	46, 449, 932. 33	4. 69
8	合计	990, 210, 806. 97	100. 00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告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	5,144,984.39	0.53
B	采矿业	33,763,764.49	3.47
C	制造业	364,635,186.54	37.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,584,579.21	2.84
E	建筑业	40,606,101.99	4.17
F	批发和零售业	35,498,847.15	3.65
G	交通运输、仓储和邮政业	26,841,133.74	2.76
H	住宿和餐饮业	96,748.56	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,764,867.81	5.53
J	金融业	211,392,082.35	21.73
K	房地产业	43,285,673.68	4.45
L	租赁和商务服务业	14,460,999.82	1.49
M	科学研究和技术服务业	1,235,588.48	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	7,141,544.88	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	718,514.16	0.07
R	文化、体育和娱乐业	11,687,185.67	1.20
S	综合	5,287,415.45	0.54
	合计	883,145,218.37	90.78

7.2.2 报告期末积极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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	9,385,075.76	0.96
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	157,877.76	0.02
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	2,398,863.70	0.25
J	金融业	1,535,191.70	0.16
K	房地产业	8,475,639.30	0.87
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	21,952,648.22	2.26

7.3 期末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

7.3.1 期末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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	279,502	24,204,873.20	2.49
2	600036	招商银行	963,240	17,492,438.40	1.80
3	600016	民生银行	1,581,950	16,420,641.00	1.69
4	600030	中信证券	459,434	14,844,312.54	1.53
5	600837	海通证券	472,242	12,826,092.72	1.32
6	601166	兴业银行	667,169	12,436,030.16	1.28
7	601766	中国中车	361,882	12,220,755.14	1.26
8	600000	浦发银行	653,612	11,320,559.84	1.16
9	601398	工商银行	1,786,633	9,290,491.60	0.95
10	601668	中国建筑	875,770	8,459,938.20	0.87

7.3.2 期末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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000627	天茂集团	363,290	5,463,881.60	0.56
2	600533	栖霞建设	598,178	4,276,972.70	0.44
3	000043	中航地产	344,153	4,198,666.60	0.43
4	002152	广电运通	75,582	3,921,194.16	0.40
5	002354	天神娱乐	15,786	1,791,711.00	0.18

注：投资者欲了解本报告期末基金的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.csfunds.com.cn> 网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601766	中国中车	5,258,915.95	0.51
2	600637	百视通	2,357,073.60	0.23
3	000166	申万宏源	575,598.96	0.06

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600998	九州通	109,513,728.26	10.59
2	601519	大智慧	20,096,973.63	1.94
3	601318	中国平安	9,890,111.76	0.96
4	300315	掌趣科技	9,828,956.87	0.95
5	600016	民生银行	7,226,636.26	0.70
6	600036	招商银行	7,064,074.22	0.68
7	600030	中信证券	6,445,215.20	0.62
8	600837	海通证券	5,161,353.64	0.50
9	601166	兴业银行	5,052,903.11	0.49
10	600000	浦发银行	4,753,896.09	0.46
11	601398	工商银行	3,953,758.92	0.38
12	000002	万科A	3,425,069.60	0.33
13	601668	中国建筑	3,048,991.91	0.29
14	000651	格力电器	2,932,192.57	0.28
15	601601	中国太保	2,851,541.36	0.28
16	601328	交通银行	2,727,633.95	0.26
17	600887	伊利股份	2,585,384.49	0.25
18	600519	贵州茅台	2,522,699.86	0.24
19	601288	农业银行	2,480,851.29	0.24
20	000001	平安银行	2,473,565.37	0.24

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本 (成交) 总额	8,191,588.51
卖出股票收入 (成交) 总额	455,745,796.14

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	628,042.10	0.06
8	其他	-	-
9	合计	628,042.10	0.06

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序号的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113008	电气转债	2,870	628,042.10	0.06

注：本基金本报告期末仅持有上述 1 只债券。

7.7 期末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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末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：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末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：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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 日中国证券监督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 日中国证券监督管理委员会 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 日中国证券监督管理委员会 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。

7.12.2

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。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	229,267.93
2	应收证券清算款	46,139,884.30
3	应收股利	-
4	应收利息	80,780.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,449,932.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 报告期末指数投资前十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	601766	中国中车	12,220,755.14	1.26	重大事项停牌

7.12.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 7 投资组合报告 (转型后)

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	674,564,942.48	92.65
	其中: 股票	674,564,942.48	92.65
2	固定收益投资	91,545.30	0.01
	其中: 债券	91,545.30	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	53,171,532.33	7.30
7	其他资产	281,443.66	0.04
8	合计	728,109,463.77	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	4,258,586.45	0.59
B	采矿业	26,279,026.35	3.64
C	制造业	274,505,829.65	38.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,261,943.48	3.64
E	建筑业	25,209,869.20	3.49
F	批发和零售业	23,738,368.23	3.29
G	交通运输、仓储和邮政业	25,569,761.56	3.54
H	住宿和餐饮业	248,472.40	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,684,663.64	5.36
J	金融业	161,379,748.32	22.35
K	房地产业	34,442,446.47	4.77
L	租赁和商务服务业	10,319,062.51	1.43
M	科学研究和技术服务业	1,314,078.86	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	4,965,396.79	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,025,335.92	0.14
R	文化、体育和娱乐业	9,074,486.19	1.26

S	综合	4,263,758.36	0.59
	合计	671,540,834.38	92.98

7.2.2 积极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	261,665.32	0.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,392,188.68	0.19
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	271,232.78	0.04
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	1,099,021.32	0.15
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	3,024,108.10	0.42

7.3 期末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(转型后)

7.3.1 期末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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	230,382	18,877,501.08	2.61
2	600036	招商银行	738,140	13,817,980.80	1.91

3	600016	民生银行	1,210,550	12,032,867.00	1.67
4	600000	浦发银行	535,912	9,089,067.52	1.26
5	600030	中信证券	337,134	9,072,275.94	1.26
6	601166	兴业银行	489,869	8,450,240.25	1.17
7	600837	海通证券	346,743	7,558,997.40	1.05
8	601398	工商银行	1,324,033	6,990,894.24	0.97
9	000651	格力电器	102,811	6,569,622.90	0.91
10	000002	万科 A	409,794	5,950,208.88	0.82

7.3.2 期末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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002354	天神娱乐	15,786	1,099,021.32	0.15
2	002429	兆驰股份	38,129	491,864.10	0.07
3	000959	首钢股份	74,405	460,566.95	0.06
4	000510	*ST 金路	34,906	318,691.78	0.04
5	002416	爱施德	12,922	271,232.78	0.04

注：投资者欲了解本报告期末基金的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.csfunds.com.cn> 网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	7,344,281.00	1.02
2	600036	招商银行	4,575,912.00	0.63
3	600016	民生银行	3,919,563.00	0.54
4	300104	乐视网	3,405,607.85	0.47
5	601988	中国银行	3,397,282.00	0.47
6	600030	中信证券	3,289,821.00	0.46
7	601166	兴业银行	2,949,160.00	0.41
8	601901	方正证券	2,860,172.90	0.40
9	600837	海通证券	2,840,612.00	0.39
10	600000	浦发银行	2,723,241.26	0.38

11	000166	申万宏源	2,461,941.24	0.34
12	601106	中国一重	2,293,517.00	0.32
13	002230	科大讯飞	2,210,424.00	0.31
14	601398	工商银行	1,956,597.00	0.27
15	601919	中国远洋	1,897,519.66	0.26
16	600958	东方证券	1,892,180.50	0.26
17	002736	国信证券	1,865,075.00	0.26
18	000651	格力电器	1,716,674.00	0.24
19	600446	金证股份	1,705,067.00	0.24
20	000002	万 科 A	1,670,280.40	0.23

7.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	11,740,684.71	1.63
2	600036	招商银行	8,537,587.52	1.18
3	600016	民生银行	7,780,579.00	1.08
4	600030	中信证券	7,543,401.00	1.04
5	600837	海通证券	6,533,086.35	0.90
6	601166	兴业银行	6,326,483.62	0.88
7	600533	栖霞建设	5,889,410.00	0.82
8	000043	中航地产	5,704,714.93	0.79
9	000627	天茂集团	5,678,925.30	0.79
10	600000	浦发银行	4,814,980.00	0.67
11	601398	工商银行	4,454,486.00	0.62
12	601668	中国建筑	4,271,158.00	0.59
13	000002	万 科 A	4,163,113.18	0.58
14	002152	广电运通	4,122,574.32	0.57
15	000651	格力电器	4,003,192.00	0.55
16	601390	中国中铁	3,810,074.00	0.53
17	601989	中国重工	3,716,819.95	0.51
18	600887	伊利股份	3,543,906.18	0.49
19	000897	津滨发展	3,408,510.09	0.47
20	600761	安徽合力	3,301,019.52	0.46

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本 (成交) 总额	143,078,464.51
卖出股票收入 (成交) 总额	319,422,171.61

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	91,545.30	0.01
8	其他	-	-
9	合计	91,545.30	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110031	航信转债	630	91,545.30	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述 1 只债券。

7.7 期末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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末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：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末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：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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 日中国证券监督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 日中国证券监督管理委员会 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 日中国证券监督管理委员会 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。

7.12.2

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。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	220,137.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,107.95
5	应收申购款	50,198.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	281,443.66

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期可转换债券。

7.12.5 期末资前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	002354	天神娱乐	1,099,021.32	0.15	重大事项停牌
2	000959	首钢股份	460,566.95	0.06	重大事项停牌
3	000510	*ST 金路	318,691.78	0.04	重大事项停牌
4	002416	爱施德	271,232.78	0.04	重大事项停牌

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息 (转型前)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长盛同庆 800A	-	-	-	-	-	-
长盛同庆 800B	-	-	-	-	-	-
长盛同庆 中证 800 分级	13,018	41,655.28	323,713,066.87	59.70%	218,555,423.91	40.30%
合计	13,018	41,655.28	323,713,066.87	59.70%	218,555,423.91	40.30%

注: 1、本基金的基金管理人于 2015 年 5 月 21 日终, 将同庆 800A 份额、同庆 800B 份额以各自的基金份额净值为基准转换为长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF) 份额。

2、对于分级基金, 比例的分母采用各自级别的份额; 对于合计数, 比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.2 期末上市基金前十名持有人

根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》的规定, 同庆 800A 份额、同庆 800B 份额于 2015 年 5 月 21 日终止上市。本基金的基金管理人于 2015 年 5 月 21 日终, 将同庆 800A 份额、同庆 800B 份额以各自的基金份额净值为基准转换为长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF) 份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛同庆 800A	-	-
	长盛同庆 800B	-	-
	长盛同庆中证 800 分级	-	-
	合计	-	-

注: 对于分级基金, 比例的分母采用各自级别的份额; 对于合计数, 比例的分母采用下属分级基

金份额的合计数。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长盛同庆 800A	0
	长盛同庆 800B	0
	长盛同庆中证 800 分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛同庆 800A	0
	长盛同庆 800B	0
	长盛同庆中证 800 分级	0
	合计	0

§ 8 基金份额持有人信息 (转型后)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位: 份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
12,166	36,142.05	255,377,112.87	58.08%	184,327,073.26	41.92%

8.2 期末上市基金前十名持有人

注: 截止报告日 2015 年 6 月 30 日, 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 未上市。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动 (转型前)

单位: 份

项目	长盛同庆 800A	长盛同庆 800B	长盛同庆中证 800 分级
基金合同生效日 (2012 年 5 月 12 日) 基金份额总额	-	-	14,686,733,239.06
本报告期期初基金份额总额	278,099,590.00	417,149,386.00	156,591,454.56
本报告期基金总申购份额	-	-	83,429,559.28
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	393,001,498.06
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-278,099,590.00	-417,149,386.00	695,248,975.00
本报告期期末基金份额总额	0.00	0.00	542,268,490.78

注: 拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§ 9 开放式基金份额变动 (转型后)

单位: 份

项目	长盛同庆中证 800 指数 (LOF)
基金合同生效日 (2015 年 5 月 22 日) 基金份额总额	542,268,490.78
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	583,555.65
减:本报告期基金总赎回份额	103,147,860.30
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	439,704,186.13

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司第六届董事会第七次会议决议, 公司聘任林培富、王宁、蔡宾担任公司副总经理; 聘任孙杰、刁俊东为公司高管人员。以上三名副总经理于 2015 年 4 月 22 日通过中国证券投资基金业协会 (以下简称基金业协会) 组织的高级管理人员证券投资法律知识考试, 公司已及时向基金业协会进行备案。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知, 聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙), 本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	16,158,914.05	3.61	14,711.07	3.61	-
光大证券	1	33,511,914.97	7.49	30,509.30	7.49	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	61,266,989.57	13.69	55,777.60	13.69	-
东兴证券	1	150,180,227.96	33.56	136,722.81	33.56	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	63,799,352.68	14.26	58,083.28	14.26	-
国元证券	1	-	-	-	-	-

兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	122,636,808.40	27.40	111,647.53	27.40	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安			-	-	-	-
东北证券			-	-	-	-
申银万国			-	-	-	-
中信证券			-	-	-	-
国信证券			-	-	-	-
光大证券			-	-	-	-
中航证券			-	-	-	-
招商证券			-	-	-	-
东兴证券	340,000.00	78.01	-	-	-	-
华泰证券			-	-	-	-
海通证券			-	-	-	-
长江证券	63,349.00	14.53	-	-	-	-
国元证券			-	-	-	-
兴业证券			-	-	-	-
中金证券			-	-	-	-
银河证券	32,490.00	7.45	-	-	-	-
东方证券			-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需
要, 并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向, 并提供相关研究报告;

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定;

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后, 按照研究服务评价规定, 对研究机构进行综合评价;

(4) 试用期满后, 评价结果符合条件, 双方认为有必要继续合作, 经公司领导审批后, 我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》, 并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用;

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价, 若本公司认为签约机构的服务不能满足要求, 或签约机构违规受到国家有关部门的处罚, 本公司有权终止签署的协议, 并撤销租用的交易单元;

(6) 交易单元租用协议期限为一年, 到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况: 无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况: 无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	163,151,553.02	35.28%	148,486.02	35.27%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

东兴证券	1	81,024,882.35	17.52%	73,765.86	17.52%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	218,324,200.75	47.21%	198,762.56	47.21%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	783,450.90	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定

要求, 提供专门研究报告。

- (2) 资力雄厚, 信誉良好。
- (3) 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (4) 经营行为规范, 最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。
- (5) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。
- (6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需 要, 并能为本公司基金提供全面的信息服 务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 研究机构提出服务意向, 并提供相关研究报告;
- (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定;
- (3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后, 按照研究服务评价规定, 对研究机构进行综合评价;
- (4) 试用期满后, 评价结果符合条件, 双方认为有必要继续合作, 经公司领导审批后, 我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》, 并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用;
- (5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价, 若本公司认为签约机构的服务不能满足要求, 或签约机构违规受到国家有关部门的处罚, 本公司有权终止签署的协议, 并撤销租用的交易单元;
- (6) 交易单元租用协议期限为一年, 到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况: 无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况: 无。

长盛基金管理有限公司
2015 年 8 月 27 日