

长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金  
(原长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型)

2012 年第 2 季度报告

2012 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

报告送出日期：2012 年 7 月 20 日

## § 1 重要提示

基金管理人长盛基金管理有限公司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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》（“本基金合同”）、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》规定，于 2012 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。

2012 年 4 月 10 日，本基金管理人就长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金（“长盛同庆封闭”）转型事宜召开了基金份额持有人大会，会议审议通过了《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》，对长盛同庆封闭实施转型，上述决议已获中国证监会核准。

2012 年 5 月 8 日，本基金管理人发布《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金之同庆 A、同庆 B 基金份额终止上市的公告》。自封闭期到期日次日即 2012 年 5 月 12 日起，长盛同庆封闭基金转型为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金，基础份额基金代码不变，仍为“160806”；由《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》生效，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》为准。相关公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（<http://www.szse.cn>）及本公司网站。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 5 月 12 日（基金合同生效日）起至 2012 年 6 月 30 日止（注：长盛同庆封闭报告期为自 2012 年 4 月 1 日起至 2012 年 5 月 11 日（基金合同失效前日）止）。

## § 2 基金产品概况（长盛同庆中证 800 分级）

基金简称	长盛同庆中证 800 分级
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
报告期末基金份额总额	5,241,812,646.61 份
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 800 指数的有效跟踪。
投资策略	<p>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。</p> <p>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。</p>
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。		
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		
下属三级基金的基金简称	长盛同庆 800A	长盛同庆 800B	长盛同庆中证 800 分级
下属三级基金的交易代码	150098	150099	160806
报告期末下属三级基金的份额总额	1,337,546,640.00 份	2,006,319,961.00 份	1,897,946,045.61 份
下属三级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	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。	高风险、高预期收益。

### § 3 基金产品概况（长盛同庆封闭）

基金简称	长盛同庆封闭
基金主代码	160806
交易代码	160806
基金运作方式	契约型。自 2009 年 5 月 12 日始，进入为期三年的封闭期。2012 年 5 月 11 日，封闭期届满，并于次日转型为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金。
基金合同生效日	2009 年 5 月 12 日
报告期末基金份额总额	14,686,733,239.06 份
投资目标	长盛同庆封闭投资于具有稳健成长和业绩优良的上市公司股票，力求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	<p>长盛同庆封闭在股票投资上，通过优选业绩优良、成长性稳定、在行业内具有核心竞争优势的上市公司股票进行投资，以谋求基金资产的长期稳定增长。在对市场趋势的有效判断的前提下，进行稳健的战略资产配置和积极的行业配置，同时根据对上市公司充分的基本面分析，挖掘行业中的价值个股。</p> <p>长盛同庆封闭的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益。在实际的投资运作中，本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 × 70% + 中证全债指数收益率 × 30%
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，长盛同庆封闭为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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

下属两级基金的基金简称	长盛同庆封闭 A	长盛同庆封闭 B
下属两级基金的交易代码	150006	150007
报告期末下属两级基金的份额总额	5,874,693,295.62 份	8,812,039,943.44 份
下属两级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、收益相对较高。

## § 4 主要财务指标和基金净值表现

### 4.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	长盛同庆中证 800 分级	长盛同庆封闭
	报告期(2012 年 5 月 12 日 -2012 年 6 月 30 日)	报告期(2012 年 4 月 1 日 -2012 年 5 月 11 日)
1. 本期已实现收益	26,533,618.78	491,635,483.50
2. 本期利润	-197,475,616.65	731,779,887.71
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0298	0.0498
4. 期末基金资产净值	5,035,603,209.33	12,925,228,407.02
5. 期末基金份额净值	0.961	0.880

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、长盛同庆中证 800 分级所列数据截止到 2012 年 6 月 30 日；长盛同庆封闭所列数据截止到 2012 年 5 月 11 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。

### 4.2 基金净值表现（长盛同庆中证 800 分级）

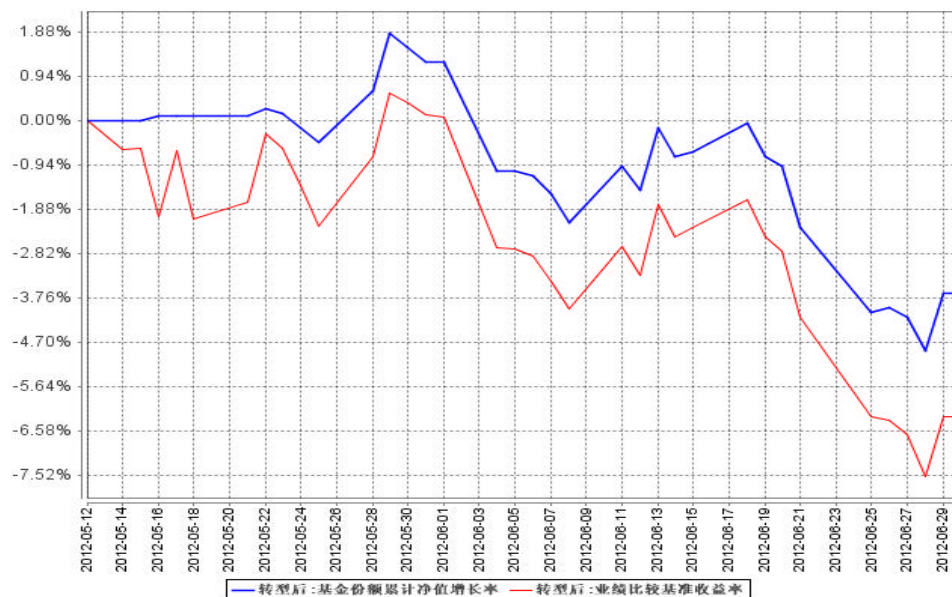
#### 4.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
2012 年 5 月 12 日至 2012 年 6 月 30 日	-3.66%	0.78%	-6.28%	1.06%	2.62%	-0.28%

## 4.2.2 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

(2012年5月12日至2012年6月30日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



1、本基金由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为2012年5月12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，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为：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%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 4.3 基金净值表现（长盛同庆封闭）

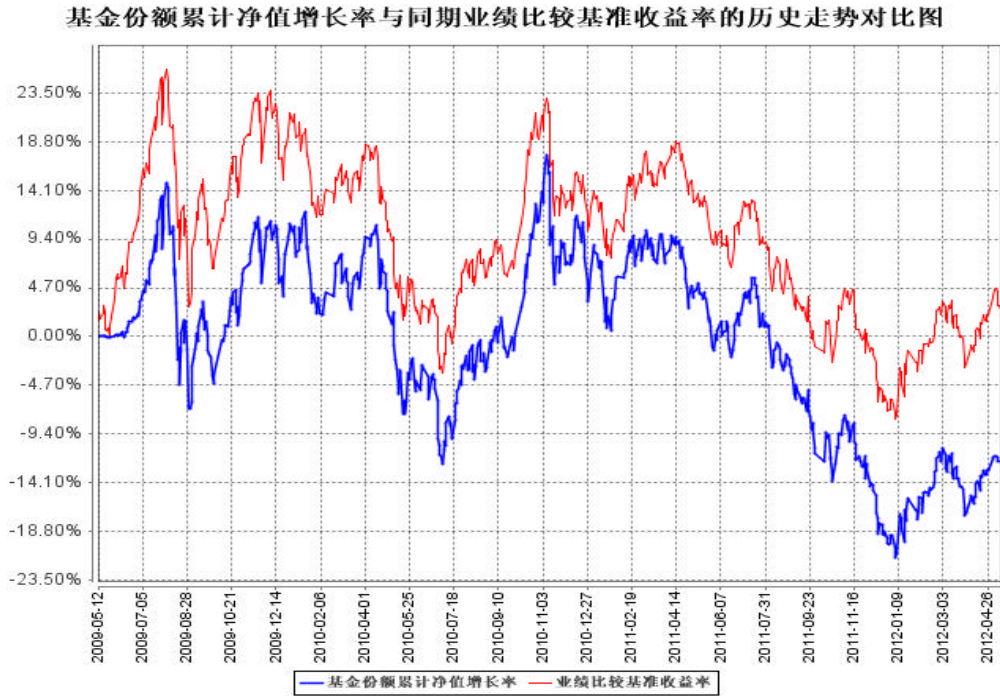
#### 4.3.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
2012年4月1日至2012年5月11日	6.02%	0.69%	5.33%	0.77%	0.69%	-0.08%



#### 4.3.2 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

(2009年5月12日至2012年5月11日)



## § 5 管理人报告

### 5.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王宁	本基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，投资管理部总监。	2012年5月12日	-	14年	男，1971年10月出生，中国国籍。毕业于北京大学光华管理学院，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理等职务。现任投资管理部总监，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛同庆中证800指数分级证券投资基金（本基金）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》的相关规定等。

### 5.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

2012年4月1日至2012年5月11日，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、《长盛同庆可分离交易股票型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。

2012年5月12日长盛同庆封闭基金转型为长盛同庆中证800指数分级证券投资基金，即日起至报告期末，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》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。

### 5.3 公平交易专项说明

#### 5.3.1 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。

#### 5.3.2 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，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%的交易共有 1 次，为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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。

### 5.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 5.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年 2 季度，国际市场方面，欧洲危机持续升温，全球资本市场呈现不断下跌状态。

国内市场，虽然宏观预期经济政策有所放松和金融市场改革升温，但是实际宏观经济和上市公司业绩不断低于预期，打击国内市场不断下跌。

2012年2季度,同庆基金顺利完成由主动基金向被动指数基金转型,在转型过程中本基金股票比例为适应转型方案,进行大规模调整。

在转型过程中,本基金继续利用市场资金阶段性紧张的机会,积极参与逆回购等交易提高组合资金利用效率。

#### 5.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日,长盛同庆中证800分级份额净值为0.961元,本报告期(2012年5月12日至2012年6月30日)份额净值增长率为-3.66%,同期业绩比较基准增长率为-6.28%。

截至2012年5月11日,长盛同庆封闭份额净值为0.880元,本报告期(2012年4月1日至2012年5月11日)份额净值增长率为6.02%,同期业绩比较基准增长率为5.33%。

#### 5.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2季度,国内外市场在不断预期放松和救助的过程中,逐渐下跌,完全低于市场的想象。

由于欧洲危机属于格局性全面危机,可以预见短期之内难以出现实质性解决方案和完全好转迹象,市场仍然处在危机和拯救的不断反复过程中。

国内市场由于上市公司业绩整体低于预期,政策放松力度可能低于预期,行业和股票之间的差异会越来越大。

同庆基金由主动型基金转为指数基金,顺利完成转型,基金未来操作跟踪中证800指数,属于标准型指数基金,本基金将按照基金合同规定为基金持有人提供优良的指数投资工具。

## § 6 投资组合报告（长盛同庆中证 800 分级）

（报告期为 2012 年 5 月 12 日至 2012 年 6 月 30 日）

### 6.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4,181,962,362.76	81.06
	其中：股票	4,181,962,362.76	81.06
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	965,701,005.56	18.72
6	其他资产	11,563,641.11	0.22
7	合计	5,159,227,009.43	100.00

### 6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 6.2.1 指数投资部分

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	36,805,925.42	0.73
B	采掘业	376,159,459.29	7.47
C	制造业	1,602,824,519.72	31.83
C0	食品、饮料	315,207,707.91	6.26
C1	纺织、服装、皮毛	36,227,444.59	0.72
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	123,397,722.06	2.45
C5	电子	86,075,867.47	1.71
C6	金属、非金属	331,008,836.57	6.57
C7	机械、设备、仪表	478,416,817.52	9.50
C8	医药、生物制品	220,941,140.57	4.39
C99	其他制造业	11,548,983.03	0.23
D	电力、煤气及水的生产和供应业	102,517,826.76	2.04
E	建筑业	77,030,588.12	1.53
F	交通运输、仓储业	142,841,941.94	2.84
G	信息技术业	150,086,553.30	2.98
H	批发和零售贸易	143,301,977.30	2.85

I	金融、保险业	1,110,674,743.34	22.06
J	房地产业	282,723,944.83	5.61
K	社会服务业	46,730,584.30	0.93
L	传播与文化产业	32,596,967.45	0.65
M	综合类	77,667,330.99	1.54
	合计	4,181,962,362.76	83.05

### 6.2.2 积极投资部分

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	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

### 6.3 报告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

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	601318	中国平安	2,463,148	112,664,389.52	2.24
2	000002	万科 A	11,425,267	101,799,128.97	2.02
3	600016	民生银行	16,604,411	99,460,421.89	1.98
4	600036	招商银行	9,091,647	99,280,785.24	1.97
5	601398	工商银行	19,358,548	76,466,264.60	1.52

6	601328	交通银行	16,834,309	76,427,762.86	1.52
7	600030	中信证券	5,810,258	73,383,558.54	1.46
8	600519	贵州茅台	305,220	72,993,363.00	1.45
9	601166	兴业银行	5,550,735	72,048,540.30	1.43
10	600000	浦发银行	8,226,617	66,882,396.21	1.33

#### 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 6.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 6.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 6.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 6.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 6.8 投资组合报告附注

6.8.1 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

6.8.2 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。

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。

#### 6.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	7,360,665.34
4	应收利息	302,425.77
5	应收申购款	49,524.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,563,641.11

#### 6.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 6.8.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

#### 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 6.8.6 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（长盛同庆封闭）

（报告期为 2012 年 4 月 1 日至 2012 年 5 月 11 日）

### 7.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,861,400.96	0.02
	其中：股票	5,861,400.96	0.02
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	12,800,000,000.00	49.73
	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	12,925,003,448.26	50.22
6	其他资产	5,591,212.66	0.02
7	合计	25,736,456,061.88	100.00

### 7.2 报告期末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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	5,861,400.96	0.05
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,861,400.96	0.05
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-

K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	5,861,400.96	0.05

### 7.3 报告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

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	600096	云天化	365,424	5,861,400.96	0.05

注：长盛同庆封闭报告期末仅持有一只股票。

### 7.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

长盛同庆封闭报告期末未持有债券。

### 7.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

长盛同庆封闭报告期末未持有债券。

### 7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

长盛同庆封闭报告期末未持有资产支持证券。

### 7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

长盛同庆封闭报告期末未持有权证。

### 7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告期内长盛同庆封闭投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.8.2 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。

长盛同庆封闭投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 7.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	587,015.05
4	应收利息	1,153,172.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	5,591,212.66
---	----	--------------

#### 7.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭报告期末未持有可转换债券。

#### 7.8.5 报告期末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(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

#### 7.8.6 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 开放式基金份额变动

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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	954,057,794.13
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	9,613,575,280.64
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	1,337,546,640.00	2,006,319,961.00	-4,129,269,706.94
报告期期末基金份额总额	1,337,546,640.00	2,006,319,961.00	1,897,946,045.61

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 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》；
- 5、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》；
- 6、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金托管协议》；
- 7、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金招募说明书》；
- 8、法律意见书；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 10、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所和/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。