

# 长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 2013 年年度报告摘要

2013 年 12 月 31 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：2014 年 3 月 29 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 2014 年 03 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2013 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	1,998,224,391.67 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	2012-05-31		
下属分级基金的基金简称	长盛同庆 800A(场内简称：同庆 800A)	长盛同庆 800B(场内简称：同庆 800B)	长盛同庆中证 800 分级(场内简称：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	565,266,514.00 份	847,899,772.00 份	585,058,105.67 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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，以实现对中国证 800 指数的有效跟踪。</p>
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</p>

	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。		
下属三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	tianqing1.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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2013 年	2012 年 5 月 12 日(基金合同生效日)-2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	231,942,788.58	-328,098,108.51
本期利润	94,101,096.88	-230,564,485.80
加权平均基金份额本期利润	0.0337	-0.0426
本期基金份额净值增长率	-1.19%	-4.26%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末

期末可供分配基金份额利润	-0.1850	-0.2026
期末基金资产净值	1,833,253,220.43	4,640,886,206.96
期末基金份额净值	0.917	0.955

## 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
过去三个月	-2.86%	1.07%	-2.53%	1.09%	-0.33%	-0.02%
过去六个月	8.26%	1.20%	8.61%	1.21%	-0.35%	-0.01%
过去一年	-1.19%	1.29%	-1.78%	1.30%	0.59%	-0.01%
自基金转型起至今	-5.40%	1.22%	-7.38%	1.25%	1.98%	-0.03%

注：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）。

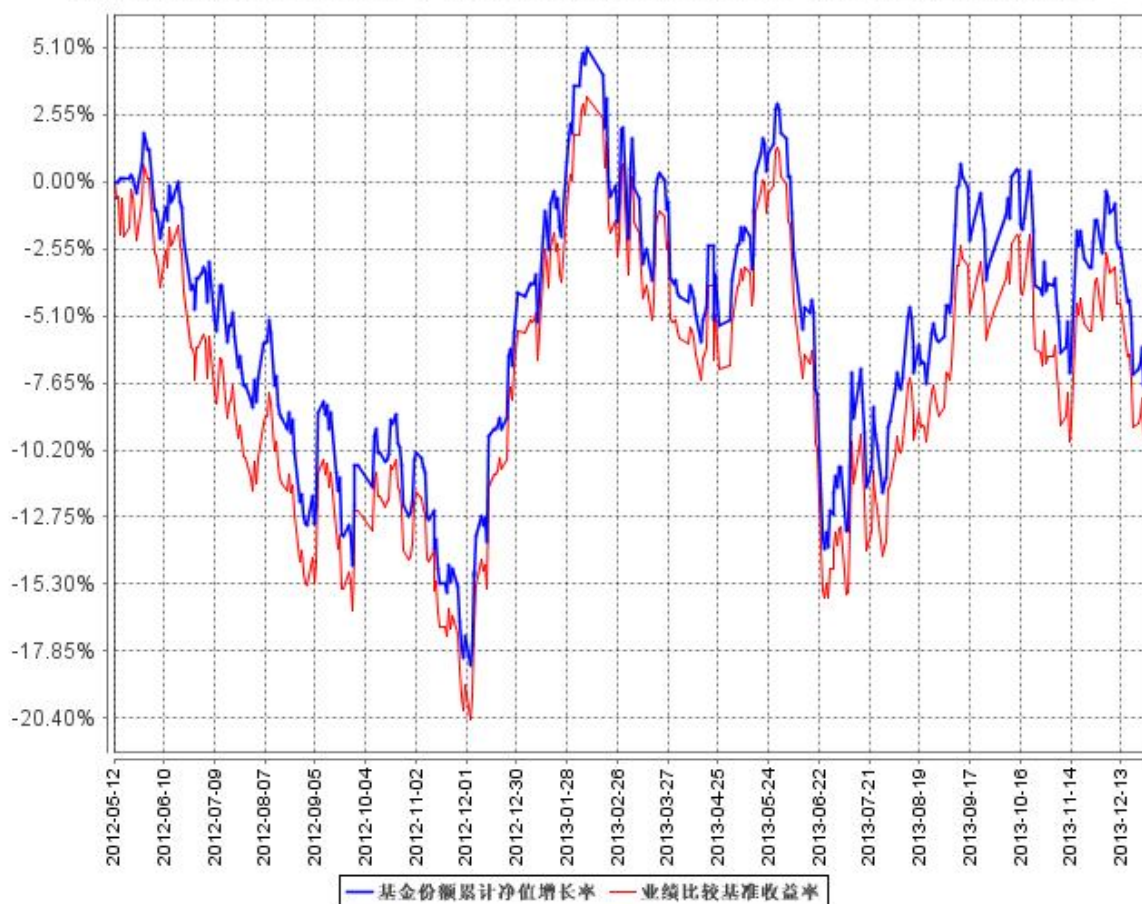
基准指数：中证 800 指数。

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

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 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。

### 3.2.2 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

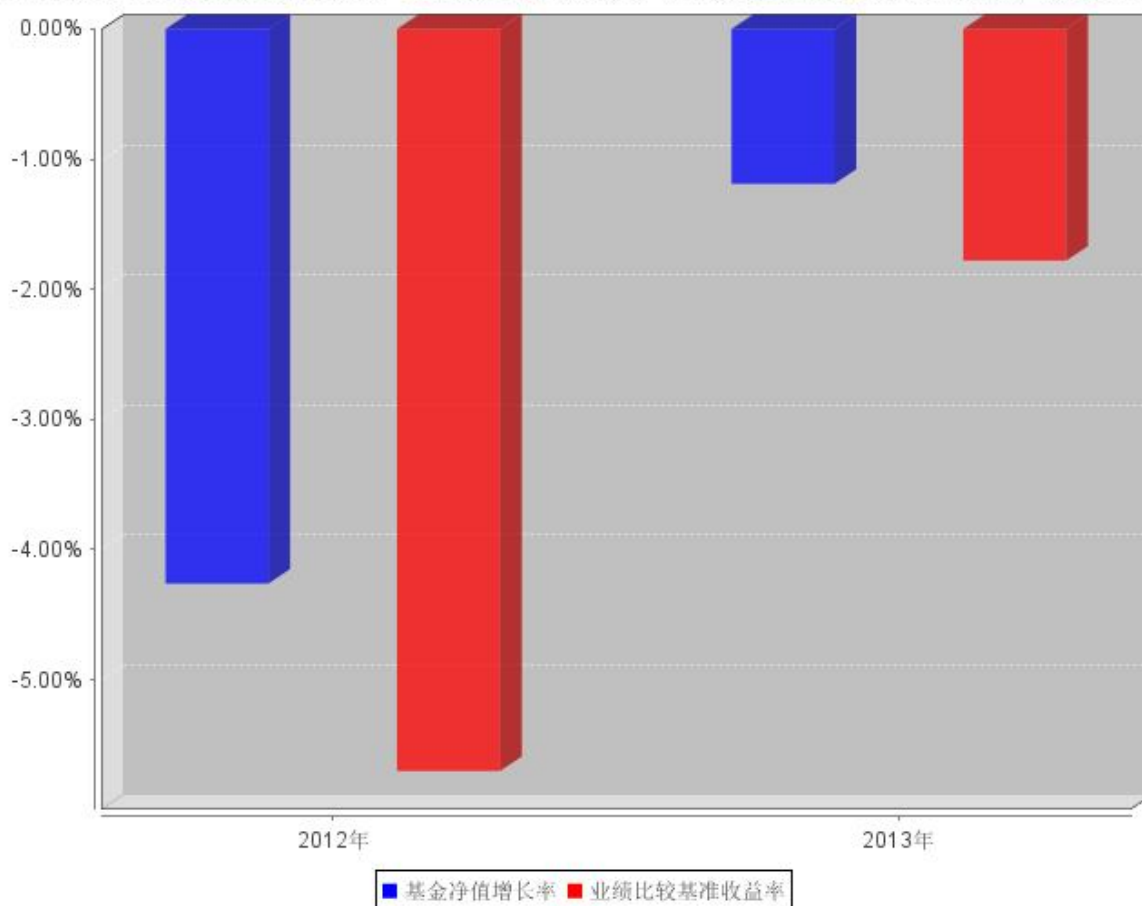
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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。

2、按照本基金合同规定，本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。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十七条（三）投资范围、（九）投资禁止行为与限制的有关约定。截止报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：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，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	-	-	-	-	注：2013 年度未分配收益
2012年	-	-	-	-	注：2012 年 5 月 12 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日未分配收益
合计	-	-	-	-	

## § 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，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 2013 年 12 月 31 日，基金管理人共管理两只封闭式基金、三十一只开放式基金，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

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。	2012 年 7 月 20 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。
王志远	本基金基金经理助理，研究员。	2013 年 2 月 7 日	-	4 年	男，1982 年 7 月出生，中国国籍。毕业于香港科技大学，获硕士学位。



					2009 年 11 月加入长盛基金管理有限公司, 现任研究员, 长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 (本基金) 基金经理助理。
王宁	本基金基金经理 (已离任), 长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 公司总经理助理。	2012 年 5 月 12 日	2013 年 3 月 14 日	15 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, 先后任基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理, 权益投资部总监等职务。现任公司总经理助理, 长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。曾任本基金基金经理, 目前已离任。

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、本基金的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 公平交易制度和控制方法

依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 为保证公司管理的所有投资组合得到公平对待, 保护投资者合法权益, 公司重新修订了《公司公平交易细则》。报告期内, 公司根据该细则实际执行情况, 对其进行了完善。该细则从研究、投资授权、投资决策、交易执行、投资组合信息隔离、行为监控评估与分析、报告与信息披露等环节对公平交易的管理提出明确要求。

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。投资组合经理在投资决策委员会授权范围内自主进行投资决策，超越授权范围的投资行为，需依照公司相关制度规定履行审批程序。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，对交易所公开竞价交易，公司开启恒生交易系统内的公平交易程序，对符合公平交易条件的投资指令强制执行公平交易，具体如下：

一、限价指令的执行原则：对于不同限价的同向指令，按照“价格优先、时间优先、同时均分”的原则执行；对于相同限价的同向交易指令，强制执行恒生交易系统内的公平交易程序，按照各投资组合委托数量设置委托比例，按比例具体执行。

二、市价指令的执行原则：对于市价同向交易指令，按照“时间优先”的原则执行交易指令，后到达指令后按照先到指令剩余数量和新到指令数量采用公平委托系统执行；对于同时同向交易指令，强制执行恒生交易系统内的公平交易程序，按照各投资组合委托数量设置委托比例，按比例具体执行。

三、部分限价指令与部分市价指令的执行原则：对于不同投资经理下达的不同类型的同向交易指令，按照“价格优先”的原则执行交易指令，在未满足限价执行条件时，先执行市价指令，后执行限价指令。

对债券一级市场申购、非公开发行股票等以公司名义进行的交易，公司依照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

对于银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价的交易，则按照“时间优先、价格优先、同时申报时要求价格差异趋于零且申购量等比分配”的原则进行。

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。风险管理部每日通过系统监控不同组合的反向交易等，监控分析发现异常情况时，要求相关人员作出合理性解释备查，每月度出具上月度公平交易监控分析报告，每季度和每年度分别出具公平交易专项分析报告；公司通过系统记录场内异常交易情况，监察稽核部定期对其进行分析评估，每月度出具异常交易总结报告；针对场外交易，监察稽核部每月度对公司旗下所有投资组合场外交易进行专项检查，检查范围包括但不限于：银行间市场、交易所大宗交易等，每月度出具检查报告；监察稽核部对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案、分配过程进行监督，确保分配结果符合公平交易原

则。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》各项规定，保证公平对待旗下的每一个投资组合。各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；交易环节中，严格执行集中交易制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；事后监控分析环节中，公司定期对投资组合公平交易情况和异常交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；同时，公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

报告期内，公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》中的规定对公司所有投资组合同向交易价差进行分析，取最近 4 个季度交易记录，分别以 1、3、5 日为时间片段分析不同基金间以及公募基金、社保组合、专户组合等大类资产间的同向交易情况。对于同向交易次数足够进行 T 检验的情况，以 95%置信水平对其进行假设检验排查；对于同向交易次数较少的情况考察交易价差对基金净值带来的累计贡献。分析结果显示本投资组合与公司其它组合间同向交易价差未见异常。

本报告期内，公司严格执行了公平交易制度的相关规定。

#### 4.3.3 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 5%的交易。

本报告期内，本基金未发生异常交易情况。

### 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 0.917 元，本报告期份额净值增长率为-1.19%，同期业绩比较基准收益率为-1.78%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为 0.08%，控制在 0.35%之内；年化跟踪误差为 1.55%，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

2013 年一季度经济出现弱复苏，市场在经济企稳、热钱大规模流入的背景下出现整体反弹，二季度经济复苏进程在反腐加大力度、影子银行监管趋严等政策影响下中断，基本面低于市场预期，市场在“钱荒”中再度探底。下半年，经济在稳增长政策影响下企稳回升，十八届三中全会的召开成为影响市场预期的关键，在会议召开前市场对于改革的预期高涨，带动估值提升，市场震荡上行。会议召开后，改革路线图的公布进一步提振改革预期，受益改革板块持续走强。回顾 2013 年的行情，可以发现市场运行特征发生了明显的转变，一是宏观经济增长中枢下移，二是资金成本长期维持高位，三是改革政策预扭转了市场悲观情绪，未来这些因素还将对 2014 年的市场产生深刻影响。

展望 2014 年，改革方案和顶层设计的陆续出台将会延续市场对改革的乐观预期，改革受益的新型城镇化相关产业、国企改革、土地改革以及新兴产业的结构化行情有望继续维持；资金成本维持高位的根本原因在于大量集中于 2014 和 2015 年到期的政府债务，这一问题的妥善解决关系到改革的成败和长远的发展，对于现有的存量资产和金融板块都将产生深远的影响；经济增长中枢下移已经逐步被市场所消化，这将为调整结构和促进转型提供更大的政策腾挪空间，受益于产业结构升级和产能收缩的传统行业将会迎来事件性机会。美国 QE 政策的退出力度和国内的通胀水平将成为宏观经济短期的扰动因素，但是并不会造成显著影响。

除了上述基本面和政策面因素之外，IPO 在一季度开始重启，对于市场的影响存在不确定性，一方面申购新股会导致资金分流，引发对流动性好的大盘股的抛售和对涨幅可观的小盘股的获利了结；另一方面，新股如果定价较高，上市表现较好，又有可能对二级市场成长股形成新的催化剂，带动进一步上涨。

#### 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》的规定及本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。

## **§ 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遵规守信、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 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师汪棣、沈兆杰于 2014 年 3 月 21 日对本基金 2013 年 12 月 31 日的资产负债表、2013 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2014)第 20732 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

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:2013 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	96,653,973.20	220,448,885.81
结算备付金	3,075,367.98	6,170,287.74
存出保证金	447,075.55	1,750,000.00
交易性金融资产	1,728,187,030.87	4,403,403,737.07
其中:股票投资	1,721,173,750.57	4,403,403,737.07
基金投资	-	-
债券投资	7,013,280.30	-
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	-	68,167,190.91
应收利息	25,764.35	49,351.96
应收股利	-	-
应收申购款	9,998,000.00	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,838,387,211.95	4,699,989,453.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2013 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2012 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		
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	372,979.57	47,362,478.65
应付管理人报酬	1,582,174.24	3,750,203.47
应付托管费	348,078.34	825,044.78
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	982,898.63	4,267,297.63
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,847,860.74	2,898,222.00
负债合计	5,133,991.52	59,103,246.53
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	2,202,863,302.40	5,508,682,489.79
未分配利润	-369,610,081.97	-867,796,282.83
所有者权益合计	1,833,253,220.43	4,640,886,206.96
负债和所有者权益总计	1,838,387,211.95	4,699,989,453.49

注：1. 报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.917 元，基金份额总额 1,998,224,391.67 份，其中长盛同庆 800A 基金份额为 565,266,514.00 份，长盛同庆 800B 基金份额为 847,899,772.00 份，长盛同庆中证 800 分级基金份额为 585,058,105.67 份。

2. 本财务报表的比较期间为 2012 年 5 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

## 7.2 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 5 月 12 日(基金合同 生效日)至 2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	139,075,503.12	-165,889,441.11
1. 利息收入	1,415,755.18	9,397,425.54
其中：存款利息收入	1,408,363.74	3,642,212.26
债券利息收入	7,391.44	4,429.38
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	5,750,783.90
其他利息收入	-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)	270,614,113.19	-284,426,802.86

其中：股票投资收益	221,834,719.74	-354,013,980.04
基金投资收益	0.00	-
债券投资收益	494,224.32	550,611.62
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	48,285,169.13	69,036,565.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-137,841,691.70	97,533,622.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	4,887,326.45	11,606,313.50
<b>减：二、费用</b>	<b>44,974,406.24</b>	<b>64,675,044.69</b>
1. 管理人报酬	26,757,181.47	31,608,432.12
2. 托管费	5,886,580.02	6,953,855.06
3. 销售服务费	0.00	-
4. 交易费用	11,718,785.94	25,733,329.84
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	611,858.81	379,427.67
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>94,101,096.88</b>	<b>-230,564,485.80</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>94,101,096.88</b>	<b>-230,564,485.80</b>

### 7.3 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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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）	5,508,682,489.79	-867,796,282.83	4,640,886,206.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	94,101,096.88	94,101,096.88
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）	-3,305,819,187.39	404,085,103.98	-2,901,734,083.41



其中：1. 基金申购款	1,255,180,283.95	-187,859,693.06	1,067,320,590.89
2. 基金赎回款	-4,560,999,471.34	591,944,797.04	-3,969,054,674.30
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）	2,202,863,302.40	-369,610,081.97	1,833,253,220.43
项目	上年度可比期间 2012 年 5 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 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）	14,686,733,239.06	-1,761,504,832.04	12,925,228,407.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-230,564,485.80	-230,564,485.80
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）	-9,178,050,749.27	1,124,273,035.01	-8,053,777,714.26
其中：1. 基金申购款	1,532,709,501.82	-239,786,870.59	1,292,922,631.23
2. 基金赎回款	-10,710,760,251.09	1,364,059,905.60	-9,346,700,345.49
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）	5,508,682,489.79	-867,796,282.83	4,640,886,206.96

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____周兵_____	_____林培富_____	_____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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率（税后）}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2014 年 3 月 21 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 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

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。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局[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。自 2013 年 1 月 1 日起，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。

## 7.4.7 关联方关系

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
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东

安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年5月12日(基金合同生效日)至 2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国元证券	34,125,653.56	0.50%	1,339,533,579.58	7.32%

###### 7.4.8.1.2 权证交易

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权证交易。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国元证券	31,068.47	0.51%	31,068.47	3.16%
关联方名称	上年度可比期间 2012年5月12日(基金合同生效日)至2012年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国元证券	1,148,585.47	7.22%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 5 月 12 日(基金合同生效日) 至 2012 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的管理费	26,757,181.47		31,608,432.12
其中:支付销售机构的客户维护费	561,083.33		432,643.46	

注:支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 5 月 12 日(基金合同生效日) 至 2012 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的托管费	5,886,580.02		6,953,855.06

注:支付基金托管人中国建设银行的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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

#### 7.4.8.3 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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金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。

##### 7.4.8.4.2 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可比期间未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2012 年 5 月 12 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 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	96,653,973.20	1,316,771.40	220,448,885.81

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。

#### 7.4.8.6 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。

#### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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
600058	五矿发展	2013 年 7 月 24 日	重大资产重组	13.56	2014 年 1 月 6 日	14.92	285,600	4,646,602.62	3,872,736.00	-
600141	兴发集团	2013 年 12 月 20 日	筹划重大事项	12.48	2014 年 1 月 27 日	13.28	98,544	1,667,544.81	1,229,829.12	-
600547	山东黄金	2013 年 12 月 26 日	筹划重大事项	17.25	2014 年 1 月 2 日	17.52	124,468	4,242,022.28	2,147,073.00	-
600572	康恩贝	2013 年 11 月 25 日	重大资产重组	13.51	-	-	124,640	1,398,262.04	1,683,886.40	-
002266	浙富股份	2013 年 12 月 6 日	筹划重大事项	9.25	2014 年 1 月 16 日	10.18	144,140	1,328,669.84	1,333,295.00	-
000562	宏源证券	2013 年 10 月 30 日	重大资产重组	8.22	-	-	278,248	2,550,421.94	2,287,198.56	-
000625	长安汽车	2013 年 12 月 31 日	重大信息披露	11.45	2014 年 1 月 3 日	11.72	402,754	2,744,725.94	4,611,533.30	-
000735	罗牛山	2013 年 12 月 31 日	讨论重要事项	6.53	2014 年 1 月 6 日	6.53	225,237	1,256,044.69	1,470,797.61	-
001696	宗申动力	2013 年 12 月 9 日	筹划重大投资事项	4.70	2014 年 1 月 9 日	4.41	225,473	1,280,476.59	1,059,723.10	-
002022	科华生物	2013 年 12 月 20 日	筹划重大事项	16.82	2014 年 1 月 27 日	18.50	97,771	1,519,248.13	1,644,508.22	-
002190	成飞集成	2013 年 12 月 23 日	筹划重大事项	15.15	-	-	23,341	360,329.55	353,616.15	-

002573	国电 清新	2013年12月 23日	筹划重 大事项	22.17	2014年3 月25日	20.80	14,523	228,689.40	321,974.91	-
--------	----------	-----------------	------------	-------	----------------	-------	--------	------------	------------	---

注：本基金截至 2013 年 12 月 31 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。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 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。

#### 7.4.9.3.2 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。

### 7.4.10 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

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。

以公允价值计量的金融工具

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)。

各层级金融工具公允价值

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 1,706,170,859.50 元，属于第二层级的余额为 22,016,171.37 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 4,240,073,247.63 元，第二层级 163,330,489.44 元，无属于第三层级的余额)。

公允价值所属层级间的重大变动

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。

#### 第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2012年12月31日:同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动零元(2012年度:净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元,涉及内蒙古伊利实业集团股份有限公司(“伊利股份”)发行的股票)。

(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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	1,721,173,750.57	93.62
	其中:股票	1,721,173,750.57	93.62
2	固定收益投资	7,013,280.30	0.38
	其中:债券	7,013,280.30	0.38
	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	99,729,341.18	5.42
6	其他各项资产	10,470,839.90	0.57
7	合计	1,838,387,211.95	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票指数投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	15,339,586.17	0.84
B	采矿业	88,915,587.97	4.85
C	制造业	706,179,993.88	38.52

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	55,246,808.07	3.01
E	建筑业	41,164,390.04	2.24
F	批发和零售业	64,432,217.54	3.52
G	交通运输、仓储和邮政业	51,156,832.99	2.79
H	住宿和餐饮业	711,304.02	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,524,455.86	1.61
J	金融业	503,829,684.19	27.49
K	房地产业	115,747,610.16	6.32
L	租赁和商务服务业	10,588,601.72	0.58
M	科学研究和技术服务业	1,482,764.60	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	11,944,635.95	0.66
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	3,436,337.89	0.19
S	综合	12,002,074.21	0.65
	合计	1,711,702,885.26	93.37

### 8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,925,149.60	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	883,467.75	0.05
F	批发和零售业	-	-
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	206,701.00	0.01
J	金融业	2,734,169.46	0.15
K	房地产业	1,721,377.50	0.09
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	9,470,865.31	0.52

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 8.3.1 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	601166	兴业银行	8,308,592	84,249,122.88	4.60
2	600036	招商银行	5,809,807	63,268,798.23	3.45
3	601398	工商银行	16,481,912	59,005,244.96	3.22
4	601318	中国平安	1,036,925	43,270,880.25	2.36
5	000002	万科A	4,743,147	38,087,470.41	2.08
6	600000	浦发银行	3,609,406	34,036,698.58	1.86
7	600837	海通证券	2,602,952	29,465,416.64	1.61
8	601989	中国重工	5,105,251	28,640,458.11	1.56
9	600030	中信证券	2,207,703	28,148,213.25	1.54
10	600016	民生银行	3,594,841	27,752,172.52	1.51

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.csfunds.com.cn> 网站的年度报告正文。

#### 8.3.2 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	601788	光大证券	314,634	2,734,169.46	0.15
2	600638	新黄浦	112,194	1,373,254.56	0.07
3	600072	中船股份	94,920	1,160,871.60	0.06
4	600779	水井坊	102,751	1,047,032.69	0.06
5	002006	精功科技	125,495	888,504.60	0.05

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.csfunds.com.cn> 网站的年度报告正文。

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	601166	兴业银行	74,957,124.87	1.62
2	601398	工商银行	55,057,767.47	1.19
3	600036	招商银行	43,203,184.07	0.93
4	600016	民生银行	31,547,471.91	0.68
5	000100	TCL 集团	28,542,763.00	0.62
6	000002	万 科 A	26,529,297.55	0.57
7	601989	中国重工	24,834,288.69	0.54
8	600690	青岛海尔	21,298,797.90	0.46
9	600000	浦发银行	19,710,245.19	0.42
10	601318	中国平安	19,699,873.41	0.42
11	601901	方正证券	19,382,509.08	0.42
12	600642	申能股份	17,665,912.91	0.38
13	601328	交通银行	15,908,707.90	0.34
14	600837	海通证券	15,864,850.98	0.34
15	000333	美的集团	15,859,580.06	0.34
16	600383	金地集团	15,516,219.18	0.33
17	600030	中信证券	13,636,981.38	0.29
18	601168	西部矿业	12,764,272.50	0.28
19	600600	青岛啤酒	12,597,159.34	0.27
20	000060	中金岭南	12,198,913.92	0.26

##### 8.4.2 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	600016	民生银行	137,355,210.17	2.96
2	000002	万 科 A	98,995,606.34	2.13
3	600036	招商银行	93,931,855.67	2.02

4	601328	交通银行	75,177,923.06	1.62
5	601318	中国平安	72,558,823.02	1.56
6	601166	兴业银行	70,840,263.31	1.53
7	601398	工商银行	62,127,861.52	1.34
8	600000	浦发银行	58,950,662.49	1.27
9	600837	海通证券	47,393,743.22	1.02
10	600030	中信证券	46,322,916.12	1.00
11	601288	农业银行	37,016,193.01	0.80
12	601088	中国神华	36,920,376.78	0.80
13	600519	贵州茅台	36,240,667.94	0.78
14	000651	格力电器	34,193,566.43	0.74
15	601601	中国太保	32,574,363.57	0.70
16	601901	方正证券	31,082,183.76	0.67
17	600015	华夏银行	29,921,871.76	0.64
18	601818	光大银行	29,100,303.41	0.63
19	000001	平安银行	27,533,136.32	0.59
20	600887	伊利股份	27,097,713.41	0.58

#### 8.4.3 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	2,014,439,505.62
卖出股票收入（成交）总额	4,780,193,239.86

#### 8.5 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	7,013,280.30	0.38
8	其他	-	-
9	合计	7,013,280.30	0.38

#### 8.6 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

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	113005	平安转债	64,810	6,950,872.50	0.38
2	113006	深燃转债	630	62,407.80	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述 2 只债券。

## 8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金报告期内未进行股指期货投资，报告期末无股指期货持仓。

### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同中未约定本基金投资股指期货的投资政策。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金报告期内未进行国债期货投资，报告期末无国债期货持仓。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未进行国债期货投资。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

根据中国平安股份有限公司 2013 年 5 月 22 日发布的《关于平安证券收到中国证监会处罚事先告知书的公告》显示，中国平安集团的控股子公司平安证券收到证监会的处罚通知书。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科发行上市项目中的业务收入人民币 2,555 万元，并处以人民币 5,110 万元的罚款，暂停其保荐机构资格 3 个月。本基金做出以下说明：

1、中国平安是中国最优秀的综合金融公司，寿险业务最具竞争力，基本面良好。本公司研究员一直保持跟踪，并有相关的跟踪报告。

2、基于相关研究，本基金判断，旗下平安证券受到处罚，对中国平安的影响较小。因为证券业务板块在平安集团内的地位较低，平安证券对中国平安的收入贡献 1%，利润贡献不足 5%。

3、今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其风险控制机制和经营情况。

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记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 8.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	447,075.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,764.35
5	应收申购款	9,998,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,470,839.90

### 8.11.4 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的可转换债券。

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.11.5.1 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。

#### 8.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

### 8.11.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	9,382	60,250.11	280,040,320.00	49.54%	285,226,194.00	50.46%
长盛同庆 800B	12,109	70,022.28	221,436,096.00	26.12%	626,463,676.00	73.88%
长盛同庆中证 800 分级	15,487	37,777.37	454,954,406.70	77.76%	130,103,698.97	22.24%
合计	36,978	54,038.20	956,430,822.70	47.86%	1,041,793,568.97	52.14%

注：1、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。

2、以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

长盛同庆 800A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中油财务有限责任公司	75,242,652.00	13.31%
2	上海真爱梦想公益基金会	47,672,536.00	8.43%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	43,604,373.00	7.71%
4	信诚人寿保险有限公司—分红—一个险分红	42,065,134.00	7.44%
5	中银保险有限公司—传统保险产品	22,905,427.00	4.05%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	21,415,898.00	3.79%
7	全国社保基金四零二组合	19,340,977.00	3.42%
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	15,219,806.00	2.69%
9	魏小艳	10,392,197.00	1.84%
10	刘健生	9,684,179.00	1.71%

长盛同庆 800B



序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	65,906,554.00	7.77%
2	信诚人寿保险有限公司—分红—一个险分红	63,097,700.00	7.44%
3	中国人寿再保险股份有限公司	26,610,969.00	3.14%
4	西南证券股份有限公司	20,063,620.00	2.37%
5	魏小艳	15,588,296.00	1.84%
6	赵云平	14,736,185.00	1.74%
7	程冰	13,336,132.00	1.57%
8	上海盛筑投资咨询有限公司	12,500,000.00	1.47%
9	张明明	10,630,072.00	1.25%
10	高贤	10,627,185.00	1.25%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 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	0.00	0.0000%
	长盛同庆 800B	0.00	0.0000%
	长盛同庆中证 800 分级	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

注：1、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。

2、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0 份。

3、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0 份。

## § 10 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
本报告期期初基金份额总额	1,329,886,232.00	1,994,829,349.00	1,534,679,879.26
本报告期基金总申购份额	-	-	1,117,946,967.12
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	4,061,899,581.99

本报告期基金拆分变动份额	-764,619,718.00	-1,146,929,577.00	1,994,330,841.28
本报告期期末基金份额总额	565,266,514.00	847,899,772.00	585,058,105.67

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

#### 11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本报告期基金管理人的高级管理人员未曾变动。

#### 11.2.2 基金经理的变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2013 年 3 月 14 日起，王宁同志不再担任长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金经理。

#### 11.2.3 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 2013 年 12 月 5 日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

### 11.5 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，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 130,000.00 元，已连续提供审计服务 5 年。

### 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 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	
海通证券	1	1,217,065,040.13	18.00%	1,108,011.53	18.10%	-
东北证券	1	1,169,241,635.65	17.29%	1,046,612.52	17.10%	-
长江证券	1	1,045,817,129.63	15.46%	950,944.19	15.53%	-
中信证券	1	750,197,855.48	11.09%	682,977.82	11.16%	-
中航证券	1	724,356,983.23	10.71%	655,318.56	10.70%	-
银河证券	1	537,944,706.96	7.95%	482,199.82	7.88%	-
光大证券	1	439,553,845.43	6.50%	397,341.21	6.49%	-
国泰君安	1	431,882,354.61	6.39%	393,185.92	6.42%	-
中金证券	1	217,908,287.47	3.22%	198,384.67	3.24%	-
民生证券	1	136,905,439.46	2.02%	124,638.26	2.04%	-
国元证券	1	34,125,653.56	0.50%	31,068.47	0.51%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	652,634.94	0.01%	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	3,384.92	0.00%	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	56,912,207.01	0.84%	51,187.29	0.84%	2013 年退租

## 11.7.2 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	
	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
海通证券	8,003,000.00	33.75%	-	-
东北证券	-	-	-	-
长江证券	63,000.00	0.27%	-	-
中信证券	6,481,000.00	27.33%	-	-

中航证券	652,345.34	2.75%	-	-
银河证券	8,515,309.10	35.91%	-	-
光大证券	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-

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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	中投证券	深圳	1