

长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 2014 年半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

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 2014 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	48

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末上市基金前十名持有人	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	53
§ 11 备查文件目录	54
11.1 备查文件目录	54
11.2 存放地点	54
11.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金		
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	3,165,338,685.99 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 5 月 31 日		
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 800B	长盛同庆中证 800 分级
下属分级基金的场内简称	同庆 800A	同庆 800B	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	483,452,750.00 份	725,179,126.00 份	1,956,706,809.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现对中国证 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	$95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率 (税后)}$
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 (场内简称: 同庆 800A): 低风险、收益相对稳定。	长盛同庆 800B(场内简称: 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(场内简称:长盛同庆): 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
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100088	100033
法定代表人		高新	王洪章

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》《证券日报》
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住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	-50,884,257.61
本期利润	-89,912,355.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0422
本期加权平均净值利润率	-4.94%
本期基金份额净值增长率	-6.15%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	-763,520,338.57
期末可供分配基金份额利润	-0.2412
期末基金资产净值	2,616,538,104.87
期末基金份额净值	0.827
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-11.22%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

4、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.10%	0.86%	0.94%	0.78%	0.16%	0.08%
过去三个月	1.25%	0.91%	1.22%	0.85%	0.03%	0.06%
过去六个月	-6.15%	1.01%	-4.28%	1.00%	-1.87%	0.01%
过去一年	1.61%	1.11%	3.96%	1.11%	-2.35%	0.00%
自基金转型起至今	-11.22%	1.17%	-11.34%	1.20%	0.12%	-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）。

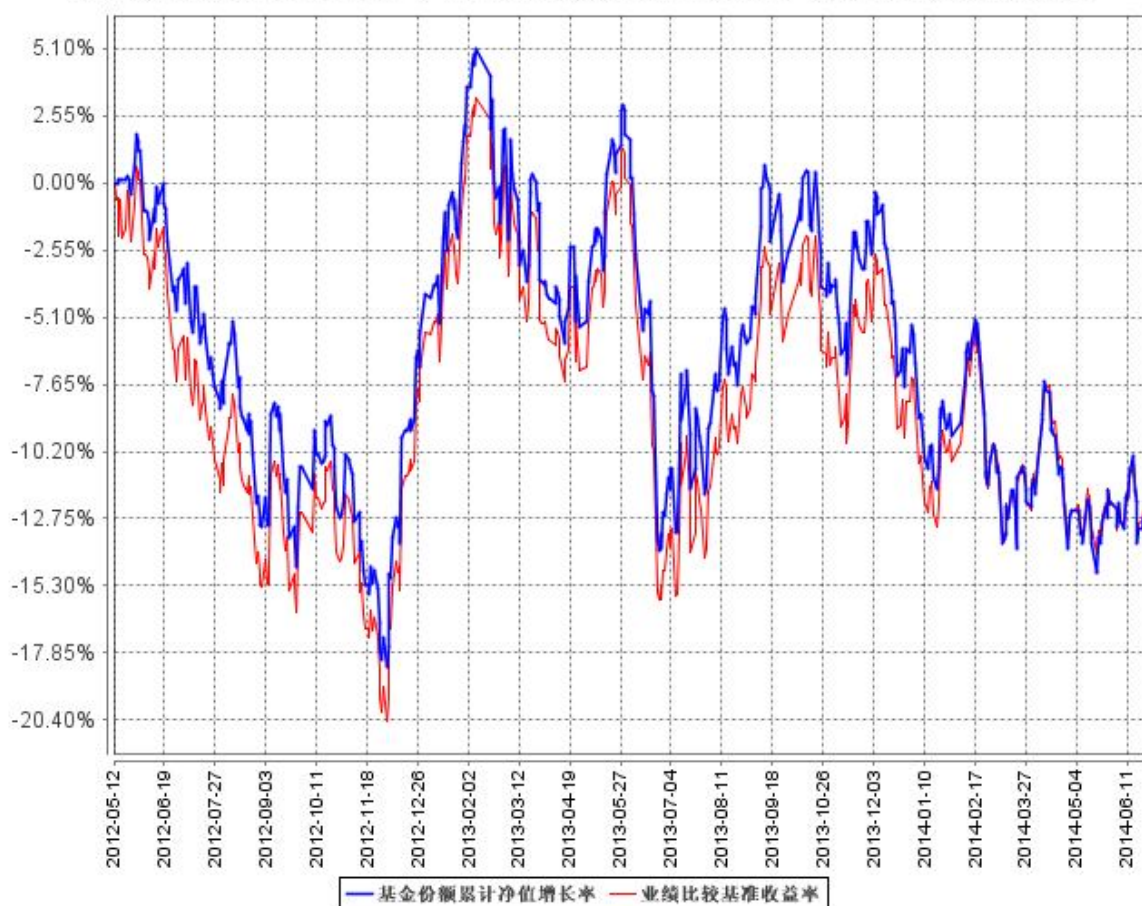
基准指数：中证800指数。

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。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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 2014 年 6 月 30 日，基金管理人共管理一只封闭式基金、三十四只开放式基金，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	-	7 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。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（已离任），研究员。	2013 年 2 月 7 日	2014 年 4 月 30 日	5 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，任研究员等职务。曾担任本基金基金经理助理，目前已离任。

注：1、上表基金经理及基金经理助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，共发生 4 次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.827 元，本报告期份额净值增长率为-6.15%，同期业绩比较基准收益率为-4.28%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为 0.12%，控制在 0.35%之内；年化跟踪误差为 2.34%，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

上半年的 A 股市场在“内忧”经济失速下滑、房地产投资低迷，“外患”美国 QE 退出、打击虚假贸易融资的双重打击下，沪深 300 指数出现了 7%的下跌，这一表现远远弱于其他新兴市场和欧美等成熟市场。但是在整体表现差强人意之下，以新能源汽车、在线教育、信息安全、互联网、京津冀等为代表的新兴成长和主题板块获得了 30%以上的巨大涨幅。存量经济的低迷和新兴经济的火热构成了 A 股市场最鲜明的结构化特征。

正如我们所预期的那样，在二季度，政府出台了一系列微刺激政策以守住经济增长底线，通过定向降准、专向投资等手段使得流动性投放能够有的放矢。展望下半年，政府保证经济增长的决心意味着微刺激政策仍将继续加码，但只是会对经济进行托底，并不会演变为“四万亿式”的全面放松。这种宏观经济调控与经济之间的互动逻辑决定了宏观经济继续维持在底部震荡，通过更长时间的渐进结构性改革来避免出现短期“休克式疗法”，这也意味着上半年的明显分化格局仍将在未来持续。

发端于 2013 年初的新兴成长股炒作已经运行了一年半的时间，大量相关主题的股票估值高高在上，后续存量资金将在这些板块中进行“去伪存真”，那些新涌现的热点和业绩超预期的板块还可以继续向上，而其他的品种将会面临估值水平向均值回归。经济改革相关政策也会对存量经济的板块带来主题性机会，油气改革、国企改革、两路一带、自贸区、国防军工等板块都是值得关注的品种。

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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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）

6.1 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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	181,492,286.97	96,653,973.20
结算备付金		5,284,085.71	3,075,367.98
存出保证金		323,128.08	447,075.55
交易性金融资产	6.4.7.2	2,457,550,976.27	1,728,187,030.87
其中：股票投资		2,450,627,972.07	1,721,173,750.57
基金投资		-	-
债券投资		6,923,004.20	7,013,280.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	96,946.25	25,764.35
应收股利		-	-
应收申购款		-	9,998,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	30,247.07	-
资产总计		2,644,777,670.35	1,838,387,211.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		19,700,582.50	-
应付赎回款		3,211,590.22	372,979.57
应付管理人报酬		1,776,571.42	1,582,174.24
应付托管费		390,845.73	348,078.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,792,986.30	982,898.63
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,366,989.31	1,847,860.74
负债合计		28,239,565.48	5,133,991.52
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,380,058,443.44	2,202,863,302.40
未分配利润	6.4.7.10	-763,520,338.57	-369,610,081.97
所有者权益合计		2,616,538,104.87	1,833,253,220.43
负债和所有者权益总计		2,644,777,670.35	1,838,387,211.95

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.827 元，基金份额总额 3,165,338,685.99 份，其中长盛同庆 800A 基金份额为 483,452,750.00 份，长盛同庆 800B 基金份额为 725,179,126.00 份，长盛同庆中证 800 分级基金份额为 1,956,706,809.99 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		-74,432,668.97	-85,304,252.86
1. 利息收入		534,694.86	884,731.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	513,960.42	882,100.02
债券利息收入		20,734.44	2,631.12
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）		-36,595,058.21	257,652,644.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-57,599,070.08	227,663,186.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	31,199.06	509,677.98
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-

股利收益	6.4.7.16	20,972,812.81	29,479,780.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-39,028,098.30	-347,292,615.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	655,792.68	3,450,986.63
减：二、费用		15,479,686.94	27,830,188.16
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	9,002,864.64	16,176,527.82
2.托管费	6.4.10.2.2	1,980,630.25	3,558,836.14
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	4,207,707.43	7,760,380.41
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.20	288,484.62	334,443.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-89,912,355.91	-113,134,441.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-89,912,355.91	-113,134,441.02

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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	3,380,058,443.44	-763,520,338.57	2,616,538,104.87

项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	净值)		
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）	-	-113,134,441.02	-113,134,441.02
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）	-2,331,281,501.70	246,348,641.26	-2,084,932,860.44
其中：1. 基金申购款	825,972,248.18	-120,747,979.39	705,224,268.79
2. 基金赎回款	-3,157,253,749.88	367,096,620.65	-2,790,157,129.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,177,400,988.09	-734,582,082.59	2,442,818,905.50

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：

_____ 周兵 _____

基金管理人负责人

_____ 林培富 _____

主管会计工作负责人

_____ 龚珉 _____

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将对长盛同庆中证 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%×中证 800 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、以及其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释和其他相关规定(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。

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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	181,492,286.97
定期存款	-
其他存款	-
合计：	181,492,286.97

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,529,631,018.43	2,450,627,972.07	-79,003,046.36
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	6,481,000.00	6,923,004.20	442,004.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	6,481,000.00	6,923,004.20	442,004.20
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,536,112,018.43	2,457,550,976.27	-78,561,042.16

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	41,160.81
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,140.42
应收债券利息	25,114.32
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	28,399.84
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	130.86
合计	96,946.25

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	30,247.07
合计	30,247.07

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,792,986.30

银行间市场应付交易费用	-
合计	1,792,986.30

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	11,549.42
其他	612,451.01
预提费用	242,988.88
合计	1,366,989.31

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,998,224,391.67	2,202,863,302.40
本期申购	726,901,904.79	801,213,580.73
本期赎回(以“-”号填列)	-191,383,720.13	-210,982,307.86
2014年5月21日基金拆分/份额折算前	2,533,742,576.33	2,793,094,575.27
基金拆分/份额折算变动份额	81,772,560.69	-
本期申购	988,878,350.58	1,055,842,231.73
本期赎回(以“-”号填列)	-439,054,801.61	-468,878,363.56
本期末	3,165,338,685.99	3,380,058,443.44

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》和《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金份额折算公告》的有关规定，本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司确定 2014 年 5 月 21 日为份额折算基准日，对长盛同庆中证 800 分级的场外份额、场内份额以及长盛同庆 A 份额实施定期份额折算。折算结果请阅读登载于 <http://www.csfunds.com.cn> 网站的《关于长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及同庆 800A 份额恢复交易的公告》

3、截至 2014 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 1,208,631,876.00 份(其中长盛同庆 A 份额 483,452,750.00 份，长盛同庆 B 基金份额 725,179,126.00 份)；本基金于场内未上市交易的基金份额为 55,344,750.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 1,901,362,059.99 份，均为长盛同庆中证 800 分级份额。场内的基金份额登记在证券登记结算系统，场外的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个

系统之间的转换。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-264,300,294.05	-105,309,787.92	-369,610,081.97
本期利润	-50,884,257.61	-39,028,098.30	-89,912,355.91
本期基金份额交易产生的变动数	-172,887,508.73	-131,110,391.96	-303,997,900.69
其中：基金申购款	-268,265,500.63	-180,131,086.26	-448,396,586.89
基金赎回款	95,377,991.90	49,020,694.30	144,398,686.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-488,072,060.39	-275,448,278.18	-763,520,338.57

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	466,829.55
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	16,030.35
其他	31,100.52
合计	513,960.42

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	1,096,508,781.36
减：卖出股票成本总额	1,154,107,851.44
买卖股票差价收入	-57,599,070.08

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	580,380.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	549,000.00

减：应收利息总额	181.44
债券投资收益	31,199.06

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内未取得衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	20,972,812.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	20,972,812.81

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-39,028,098.30
——股票投资	-39,000,822.20
——债券投资	-27,276.10
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-39,028,098.30

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	655,790.28
转换费收入	2.40
合计	655,792.68

注：1、本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率固定为 0.50%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25%

归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,207,707.43
银行间市场交易费用	-
合计	4,207,707.43

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	64,464.96
信息披露费	178,523.92
其他费用	360.00
深交所上市年费	29,752.93
银行划款费用	6,382.81
帐户维护费	9,000.00
合计	288,484.62

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金并无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,002,864.64	16,176,527.82
其中：支付销售机构的客户维护费	186,730.54	312,971.72

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,980,630.25	3,558,836.14

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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 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	181,492,286.97	466,829.55	158,010,915.49	813,325.72

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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本期及上年度可比期间无利润分配事项。

6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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
002252	上海莱士	2014 年 6 月 13 日	重大事项	63.30	-	-	136,679	8,792,188.61	8,651,780.70	-
000009	中国宝安	2014 年 5 月 28 日	重大事项	10.21	2014 年 8 月 15 日	9.33	767,349	7,870,741.23	7,834,633.29	-
600832	东方明珠	2014 年 5 月 29 日	重大事项	10.98	-	-	512,039	4,337,339.29	5,622,188.22	-
600637	百视通	2014 年 5 月 29 日	重大事项	32.03	-	-	172,585	6,304,724.90	5,527,897.55	-
002565	上海绿新	2014 年 6 月 16 日	重大事项	8.64	2014 年 7 月 7 日	9.10	627,834	5,041,890.77	5,424,485.76	-
601669	中国电建	2014 年 5 月 13 日	重大事项	2.79	-	-	840,902	2,875,675.71	2,346,116.58	-
000562	宏源证券	2013 年 10 月 31 日	重大事项	7.51	2014 年 7 月 28 日	8.93	278,248	2,550,421.94	2,089,642.48	-

002167	东方 锆业	2014 年 1 月 2 日	重大 事项	11. 39	2014 年 7 月 1 日	11. 10	96, 304	1, 214, 221. 65	1, 096, 902. 56	-
600260	凯乐 科技	2014 年 6 月 9 日	重大 事项	6. 59	-	-	149, 683	1, 236, 691. 12	986, 410. 97	-
600685	广船 国际	2014 年 4 月 7 日	重大 事项	17. 13	-	-	29, 664	325, 277. 45	508, 144. 32	-
000762	西藏 矿业	2014 年 4 月 29 日	重大 事项	10. 54	2014 年 7 月 28 日	11. 59	28, 215	342, 092. 34	297, 386. 10	-
002570	贝因 美	2014 年 6 月 19 日	重大 事项	14. 36	-	-	3, 764	49, 413. 38	54, 051. 04	-

注：本基金截至 2014 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. 12. 3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6. 4. 12. 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. 12. 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. 13 金融工具风险及管理

6. 4. 13. 1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.26% (2013 年 12 月 31 日：0.38%)，因此不存在重大信用风险 (2013 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管

理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市,因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均可以合理的价格适时变现。

于 2014 年 6 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2014 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	181,492,286.97	-	-	-	181,492,286.97
结算备付金	5,284,085.71	-	-	-	5,284,085.71
存出保证金	323,128.08	-	-	-	323,128.08
交易性金融资产	-	-	6,923,004.20	2,450,627,972.07	2,457,550,976.27
应收利息	-	-	-	96,946.25	96,946.25
其他资产	-	-	-	30,247.07	30,247.07
资产总计	187,099,500.76	-	6,923,004.20	2,450,755,165.39	2,644,777,670.35
负债					
应付证券清算款	-	-	-	19,700,582.50	19,700,582.50

应付赎回款	-	-	-	3,211,590.22	3,211,590.22
应付管理人报酬	-	-	-	1,776,571.42	1,776,571.42
应付托管费	-	-	-	390,845.73	390,845.73
应付交易费用	-	-	-	1,792,986.30	1,792,986.30
其他负债	-	-	-	1,366,989.31	1,366,989.31
负债总计	-	-	-	28,239,565.48	28,239,565.48
利率敏感度缺口	187,099,500.76	-	6,923,004.20	2,422,515,599.91	2,616,538,104.87
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	96,653,973.20	-	-	-	96,653,973.20
结算备付金	3,075,367.98	-	-	-	3,075,367.98
存出保证金	447,075.55	-	-	-	447,075.55
交易性金融资产	-	-	7,013,280.30	1,721,173,750.57	1,728,187,030.87
应收利息	-	-	-	25,764.35	25,764.35
应收申购款	9,998,000.00	-	-	-	9,998,000.00
资产总计	110,174,416.73	-	7,013,280.30	1,721,199,514.92	1,838,387,211.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	372,979.57	372,979.57
应付管理人报酬	-	-	-	1,582,174.24	1,582,174.24
应付托管费	-	-	-	348,078.34	348,078.34
应付交易费用	-	-	-	982,898.63	982,898.63
其他负债	-	-	-	1,847,860.74	1,847,860.74
负债总计	-	-	-	5,133,991.52	5,133,991.52
利率敏感度缺口	110,174,416.73	-	7,013,280.30	1,716,065,523.40	1,833,253,220.43

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.26%(2013 年 12 月 31 日：0.38%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2013 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪中证 800 指数为原则，进行指数化长期投资，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,450,627,972.07	93.66	1,721,173,750.57	93.89
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,450,627,972.07	93.66	1,721,173,750.57	93.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	129,972,450.58	90,640,968.62
业绩比较基准下降 5%	-129,972,450.58	-90,640,968.62	

6.4.14 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 2014 年 6 月 30 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 2,417,111,336.70 元，属于第二层级的余额为 40,439,639.57 元，无属于第三层级的余额(2013 年 12 月 31 日：第一层级 1,706,170,859.50 元，第二层级 22,016,171.37 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(2013 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(2013 年上半年度：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)。

(2)除公允价值外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,450,627,972.07	92.66
	其中：股票	2,450,627,972.07	92.66
2	固定收益投资	6,923,004.20	0.26
	其中：债券	6,923,004.20	0.26
	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	186,776,372.68	7.06
7	其他各项资产	450,321.40	0.02
8	合计	2,644,777,670.35	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	8,047,612.88	0.31
B	采矿业	76,491,966.13	2.92
C	制造业	1,258,472,906.93	48.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,040,952.73	2.45
E	建筑业	36,701,428.92	1.40
F	批发和零售业	103,917,138.00	3.97
G	交通运输、仓储和邮政业	36,109,906.95	1.38
H	住宿和餐饮业	837,090.51	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,509,825.38	2.50
J	金融业	557,482,545.92	21.31
K	房地产业	67,575,578.48	2.58
L	租赁和商务服务业	26,354,742.15	1.01
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	52,689,250.50	2.01
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	9,613,899.94	0.37
S	综合	14,630,737.41	0.56
	合计	2,378,475,582.83	90.90

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	3,301,175.16	0.13
C	制造业	50,613,508.00	1.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,058,515.95	0.04
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,651,507.82	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,814,569.45	0.26
J	金融业	2,014,846.46	0.08
K	房地产业	2,698,266.40	0.10
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	72,152,389.24	2.76

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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所有股票投资明细

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	15,764,646	158,119,399.38	6.04
2	000333	美的集团	3,318,233	64,108,261.56	2.45
3	601398	工商银行	17,092,040	57,942,015.60	2.21
4	000538	云南白药	862,514	45,023,230.80	1.72
5	600196	复星医药	2,220,731	44,836,558.89	1.71
6	600998	九州通	3,270,082	43,786,397.98	1.67
7	601318	中国平安	1,075,209	42,298,722.06	1.62

8	600372	中航电子	1,806,278	40,948,322.26	1.56
9	000002	万科A	4,918,643	40,677,177.61	1.55
10	600887	伊利股份	1,200,156	39,749,166.72	1.52
11	601299	中国北车	8,721,492	39,595,573.68	1.51
12	000063	中兴通讯	2,953,993	38,756,388.16	1.48
13	600549	厦门钨业	1,499,862	38,096,494.80	1.46
14	600016	民生银行	5,715,251	35,491,708.71	1.36
15	600000	浦发银行	3,742,940	33,873,607.00	1.29
16	600703	三安光电	1,333,625	31,246,833.75	1.19
17	000625	长安汽车	2,434,859	29,973,114.29	1.15
18	000895	双汇发展	810,390	29,003,858.10	1.11
19	600030	中信证券	2,370,942	27,170,995.32	1.04
20	600315	上海家化	741,278	27,167,838.70	1.04
21	000651	格力电器	901,561	26,550,971.45	1.01
22	600271	航天信息	1,237,574	25,828,169.38	0.99
23	600837	海通证券	2,756,516	25,222,121.40	0.96
24	000826	桑德环境	1,074,177	24,544,944.45	0.94
25	002415	海康威视	1,417,049	24,004,810.06	0.92
26	600104	上汽集团	1,563,501	23,921,565.30	0.91
27	600352	浙江龙盛	1,455,656	23,508,844.40	0.90
28	600519	贵州茅台	155,449	22,070,649.02	0.84
29	601088	中国神华	1,351,862	19,656,073.48	0.75
30	600517	置信电气	1,907,435	19,379,539.60	0.74
31	002400	省广股份	787,064	19,346,033.12	0.74
32	601600	中国铝业	6,352,888	19,312,779.52	0.74
33	601601	中国太保	1,048,131	18,646,250.49	0.71
34	600036	招商银行	1,770,473	18,129,643.52	0.69
35	600690	青岛海尔	1,220,581	18,015,775.56	0.69
36	600100	同方股份	2,019,620	17,994,814.20	0.69
37	600900	长江电力	2,728,677	16,972,370.94	0.65
38	600872	中炬高新	1,528,577	16,309,916.59	0.62
39	000001	平安银行	1,615,663	16,011,220.33	0.61
40	002573	国电清新	875,680	15,394,454.40	0.59
41	000049	德赛电池	375,352	15,077,889.84	0.58
42	000848	承德露露	752,662	14,955,393.94	0.57
43	601288	农业银行	5,915,320	14,906,606.40	0.57
44	600795	国电电力	6,857,265	14,880,265.05	0.57
45	601169	北京银行	1,831,361	14,760,769.66	0.56
46	600511	国药股份	636,459	14,447,619.30	0.55

47	600835	上海机电	918,806	14,314,997.48	0.55
48	002440	闰土股份	763,418	14,123,233.00	0.54
49	600292	中电远达	741,220	14,112,828.80	0.54
50	600535	天士力	350,333	13,582,410.41	0.52
51	600028	中国石化	2,523,286	13,297,717.22	0.51
52	600978	宜华木业	2,711,520	13,232,217.60	0.51
53	000157	中联重科	2,951,474	13,075,029.82	0.50
54	601006	大秦铁路	2,060,588	13,002,310.28	0.50
55	600019	宝钢股份	2,961,194	12,140,895.40	0.46
56	600893	航空动力	470,919	12,135,582.63	0.46
57	002508	老板电器	421,476	11,915,126.52	0.46
58	000858	五粮液	636,709	11,416,192.37	0.44
59	600309	万华化学	738,838	11,200,784.08	0.43
60	600048	保利地产	2,165,039	10,738,593.44	0.41
61	002701	奥瑞金	525,681	10,602,985.77	0.41
62	600079	人福医药	331,693	9,901,036.05	0.38
63	600089	特变电工	1,161,593	9,861,924.57	0.38
64	600741	华域汽车	986,846	9,651,353.88	0.37
65	600276	恒瑞医药	288,564	9,568,782.24	0.37
66	002024	苏宁云商	1,440,547	9,449,988.32	0.36
67	601555	东吴证券	1,306,755	9,304,095.60	0.36
68	600111	包钢稀土	470,249	9,240,392.85	0.35
69	000581	威孚高科	333,954	9,006,739.38	0.34
70	000783	长江证券	918,543	8,818,012.80	0.34
71	600585	海螺水泥	560,349	8,808,686.28	0.34
72	002252	上海莱士	136,679	8,651,780.70	0.33
73	000776	广发证券	864,294	8,470,081.20	0.32
74	000686	东北证券	1,179,364	8,456,039.88	0.32
75	000100	TCL 集团	3,693,159	8,420,402.52	0.32
76	600584	长电科技	950,947	8,396,862.01	0.32
77	601857	中国石油	1,094,559	8,252,974.86	0.32
78	600066	宇通客车	495,845	8,002,938.30	0.31
79	002673	西部证券	735,852	7,947,201.60	0.30
80	600660	福耀玻璃	943,547	7,925,794.80	0.30
81	002465	海格通信	493,763	7,865,644.59	0.30
82	000009	中国宝安	767,349	7,834,633.29	0.30
83	002241	歌尔声学	287,557	7,666,269.62	0.29
84	600999	招商证券	757,347	7,656,778.17	0.29
85	601899	紫金矿业	3,482,674	7,592,229.32	0.29

86	000970	中科三环	638,371	7,583,847.48	0.29
87	600739	辽宁成大	488,671	7,442,459.33	0.28
88	600050	中国联通	2,279,210	7,361,848.30	0.28
89	002236	大华股份	269,739	7,269,466.05	0.28
90	601989	中国重工	1,484,549	7,155,526.18	0.27
91	002038	双鹭药业	158,782	7,076,913.74	0.27
92	002410	广联达	266,730	7,052,341.20	0.27
93	600518	康美药业	458,544	6,855,232.80	0.26
94	600256	广汇能源	968,106	6,796,104.12	0.26
95	600201	金宇集团	217,217	6,759,793.04	0.26
96	600011	华能国际	1,178,435	6,669,942.10	0.25
97	600037	歌华有线	617,868	6,499,971.36	0.25
98	002223	鱼跃医疗	255,927	6,206,229.75	0.24
99	002353	杰瑞股份	154,067	6,201,196.75	0.24
100	000793	华闻传媒	520,506	6,115,945.50	0.23
101	600109	国金证券	305,500	6,070,285.00	0.23
102	000750	国海证券	630,881	5,961,825.45	0.23
103	000997	新大陆	335,741	5,828,463.76	0.22
104	601633	长城汽车	229,608	5,809,082.40	0.22
105	600832	东方明珠	512,039	5,622,188.22	0.21
106	000725	京东方 A	2,571,359	5,579,849.03	0.21
107	600675	中华企业	1,147,607	5,565,893.95	0.21
108	600637	百视通	172,585	5,527,897.55	0.21
109	601628	中国人寿	405,407	5,517,589.27	0.21
110	600438	通威股份	570,430	5,413,380.70	0.21
111	601118	海南橡胶	880,012	5,403,273.68	0.21
112	002254	泰和新材	624,453	5,276,627.85	0.20
113	000768	中航飞机	488,468	5,143,568.04	0.20
114	002203	海亮股份	463,717	5,105,524.17	0.20
115	601117	中国化学	950,224	4,950,667.04	0.19
116	601688	华泰证券	656,336	4,935,646.72	0.19
117	002202	金风科技	497,750	4,723,647.50	0.18
118	000069	华侨城 A	1,002,597	4,702,179.93	0.18
119	002271	东方雨虹	183,433	4,558,310.05	0.17
120	000501	鄂武商 A	387,539	4,534,206.30	0.17
121	600547	山东黄金	292,151	4,522,497.48	0.17
122	600600	青岛啤酒	111,901	4,482,754.06	0.17
123	601009	南京银行	555,811	4,446,488.00	0.17
124	002304	洋河股份	86,770	4,403,577.50	0.17

125	600018	上港集团	984,784	4,382,288.80	0.17
126	600643	爱建股份	465,573	4,278,615.87	0.16
127	600804	鹏博士	292,938	4,230,024.72	0.16
128	600009	上海机场	321,208	4,143,583.20	0.16
129	000568	泸州老窖	249,607	4,088,562.66	0.16
130	000338	潍柴动力	229,628	4,085,082.12	0.16
131	000024	招商地产	391,204	4,076,345.68	0.16
132	600406	国电南瑞	304,172	4,054,612.76	0.15
133	002344	海宁皮城	319,625	3,985,723.75	0.15
134	600031	三一重工	784,263	3,952,685.52	0.15
135	600583	海油工程	533,057	3,928,630.09	0.15
136	601186	中国铁建	837,435	3,860,575.35	0.15
137	600839	四川长虹	1,246,033	3,837,781.64	0.15
138	600029	南方航空	1,593,727	3,681,509.37	0.14
139	002292	奥飞动漫	99,684	3,658,402.80	0.14
140	002594	比亚迪	75,809	3,600,169.41	0.14
141	000012	南玻A	506,811	3,461,519.13	0.13
142	000869	张裕A	143,075	3,449,538.25	0.13
143	002230	科大讯飞	128,840	3,427,144.00	0.13
144	002081	金螳螂	231,976	3,284,780.16	0.13
145	601933	永辉超市	512,619	3,239,752.08	0.12
146	600369	西南证券	373,344	3,192,091.20	0.12
147	601377	兴业证券	362,924	3,128,404.88	0.12
148	600316	洪都航空	180,568	3,085,907.12	0.12
149	002065	东华软件	152,820	3,074,738.40	0.12
150	600694	大商股份	119,585	3,053,005.05	0.12
151	600115	东方航空	1,317,337	3,043,048.47	0.12
152	600587	新华医疗	40,800	3,041,640.00	0.12
153	600570	恒生电子	100,581	2,957,081.40	0.11
154	600827	友谊股份	268,827	2,951,720.46	0.11
155	600010	包钢股份	810,722	2,934,813.64	0.11
156	600718	东软集团	215,039	2,900,876.11	0.11
157	601390	中国中铁	1,114,415	2,875,190.70	0.11
158	002450	康得新	125,246	2,849,346.50	0.11
159	600150	中国船舶	134,869	2,840,341.14	0.11
160	600118	中国卫星	153,483	2,836,365.84	0.11
161	002392	北京利尔	306,886	2,820,282.34	0.11
162	601766	中国南车	611,232	2,750,544.00	0.11
163	002152	广电运通	161,306	2,748,654.24	0.11

164	600545	新疆城建	321,877	2,639,391.40	0.10
165	000039	中集集团	196,081	2,639,250.26	0.10
166	600270	外运发展	218,224	2,636,145.92	0.10
167	000401	冀东水泥	323,876	2,633,111.88	0.10
168	600220	江苏阳光	880,359	2,614,666.23	0.10
169	600068	葛洲坝	704,746	2,614,607.66	0.10
170	600312	平高电气	184,197	2,567,706.18	0.10
171	000488	晨鸣纸业	580,137	2,529,397.32	0.10
172	600153	建发股份	448,219	2,442,793.55	0.09
173	000006	深振业 A	530,980	2,431,888.40	0.09
174	600054	黄山旅游	190,234	2,425,483.50	0.09
175	000876	新希望	214,527	2,422,009.83	0.09
176	000712	锦龙股份	160,480	2,395,966.40	0.09
177	600362	江西铜业	193,957	2,379,852.39	0.09
178	600879	航天电子	200,748	2,364,811.44	0.09
179	601669	中国电建	840,902	2,346,116.58	0.09
180	601888	中国国旅	70,896	2,342,403.84	0.09
181	601808	中海油服	132,031	2,322,425.29	0.09
182	600183	生益科技	376,732	2,320,669.12	0.09
183	600489	中金黄金	304,534	2,314,458.40	0.09
184	002375	亚厦股份	101,286	2,285,012.16	0.09
185	600654	飞乐股份	251,642	2,277,360.10	0.09
186	002142	宁波银行	246,342	2,266,346.40	0.09
187	000792	盐湖股份	148,070	2,231,414.90	0.09
188	002385	大北农	192,039	2,181,563.04	0.08
189	600770	综艺股份	234,846	2,174,673.96	0.08
190	600058	五矿发展	205,762	2,170,789.10	0.08
191	002249	大洋电机	153,472	2,133,260.80	0.08
192	603000	人民网	53,914	2,112,889.66	0.08
193	000562	宏源证券	278,248	2,089,642.48	0.08
194	600880	博瑞传播	176,314	2,087,557.76	0.08
195	000988	华工科技	219,219	2,058,466.41	0.08
196	600588	用友软件	146,142	2,056,217.94	0.08
197	000636	风华高科	323,388	2,017,941.12	0.08
198	600171	上海贝岭	247,245	2,017,519.20	0.08
199	601800	中国交建	535,926	2,015,081.76	0.08
200	600572	康恩贝	143,226	1,986,544.62	0.08
201	600704	物产中大	238,651	1,976,030.28	0.08
202	600528	中铁二局	424,802	1,966,833.26	0.08

203	601018	宁波港	843,710	1,915,221.70	0.07
204	600809	山西汾酒	143,879	1,910,713.12	0.07
205	000939	凯迪电力	258,120	1,910,088.00	0.07
206	002153	石基信息	37,199	1,908,308.70	0.07
207	601618	中国中冶	1,095,240	1,872,860.40	0.07
208	000598	兴蓉投资	387,039	1,846,176.03	0.07
209	601258	庞大集团	419,603	1,842,057.17	0.07
210	601111	中国国航	558,100	1,836,149.00	0.07
211	000629	攀钢钒钛	864,863	1,798,915.04	0.07
212	600426	华鲁恒升	246,641	1,775,815.20	0.07
213	000973	佛塑科技	333,336	1,760,014.08	0.07
214	000759	中百集团	215,176	1,742,925.60	0.07
215	600597	光明乳业	108,318	1,737,420.72	0.07
216	600580	卧龙电气	222,142	1,703,829.14	0.07
217	000652	泰达股份	432,421	1,673,469.27	0.06
218	002190	成飞集成	28,254	1,666,986.00	0.06
219	601991	大唐发电	468,041	1,666,225.96	0.06
220	000823	超声电子	137,161	1,663,762.93	0.06
221	000983	西山煤电	311,838	1,643,386.26	0.06
222	600284	浦东建设	173,027	1,628,184.07	0.06
223	000969	安泰科技	175,049	1,610,450.80	0.06
224	002092	中泰化学	259,326	1,602,634.68	0.06
225	601099	太平洋	249,874	1,591,697.38	0.06
226	000735	罗牛山	258,958	1,584,822.96	0.06
227	600198	大唐电信	106,260	1,583,274.00	0.06
228	600811	东方集团	298,176	1,547,533.44	0.06
229	002310	东方园林	93,263	1,539,772.13	0.06
230	600112	天成控股	119,415	1,530,900.30	0.06
231	601002	晋亿实业	181,716	1,526,414.40	0.06
232	000528	柳工	261,751	1,523,390.82	0.06
233	601898	中煤能源	377,224	1,520,212.72	0.06
234	601717	郑煤机	311,028	1,511,596.08	0.06
235	002431	棕榈园林	84,135	1,497,603.00	0.06
236	600884	杉杉股份	86,122	1,480,437.18	0.06
237	600395	盘江股份	230,314	1,467,100.18	0.06
238	601158	重庆水务	292,891	1,446,881.54	0.06
239	002056	横店东磁	73,844	1,437,004.24	0.05
240	600038	哈飞股份	50,442	1,403,800.86	0.05
241	601699	潞安环能	183,207	1,390,541.13	0.05

242	002083	孚日股份	336,339	1,375,626.51	0.05
243	600325	华发股份	221,209	1,373,707.89	0.05
244	600729	重庆百货	69,787	1,363,637.98	0.05
245	600348	阳泉煤业	240,899	1,358,670.36	0.05
246	600177	雅戈尔	191,772	1,348,157.16	0.05
247	000510	金路集团	205,023	1,347,001.11	0.05
248	601958	金铂股份	188,999	1,334,332.94	0.05
249	600820	隧道股份	273,145	1,324,753.25	0.05
250	600851	海欣股份	201,476	1,307,579.24	0.05
251	600143	金发科技	296,268	1,306,541.88	0.05
252	600750	江中药业	82,247	1,288,810.49	0.05
253	000816	江淮动力	294,914	1,274,028.48	0.05
254	002368	太极股份	37,911	1,269,639.39	0.05
255	600720	祁连山	200,052	1,254,326.04	0.05
256	000877	天山股份	204,832	1,251,523.52	0.05
257	600885	宏发股份	56,072	1,231,901.84	0.05
258	600008	首创股份	199,134	1,230,648.12	0.05
259	002266	浙富股份	165,652	1,174,472.68	0.04
260	000930	中粮生化	315,976	1,172,270.96	0.04
261	002064	华峰氨纶	136,771	1,170,759.76	0.04
262	000050	深天马 A	92,304	1,153,800.00	0.04
263	002029	七匹狼	142,550	1,151,804.00	0.04
264	002028	思源电气	121,745	1,144,403.00	0.04
265	002168	深圳惠程	153,269	1,124,994.46	0.04
266	600158	中体产业	116,986	1,097,328.68	0.04
267	002069	獐子岛	75,788	1,059,516.24	0.04
268	000937	冀中能源	176,310	1,027,887.30	0.04
269	600260	凯乐科技	149,683	986,410.97	0.04
270	600874	创业环保	122,049	970,289.55	0.04
271	601965	中国汽研	77,704	961,198.48	0.04
272	601866	中海集运	449,333	948,092.63	0.04
273	600737	中粮屯河	192,715	921,177.70	0.04
274	002405	四维图新	55,347	919,867.14	0.04
275	600801	华新水泥	133,144	888,070.48	0.03
276	601098	中南传媒	61,157	883,107.08	0.03
277	600239	云南城投	204,758	882,506.98	0.03
278	002480	新筑股份	120,433	865,913.27	0.03
279	600188	兖州煤业	123,763	856,439.96	0.03
280	002123	荣信股份	111,392	854,376.64	0.03

281	600409	三友化工	192,984	843,340.08	0.03
282	600754	锦江股份	51,011	837,090.51	0.03
283	601718	际华集团	326,693	803,664.78	0.03
284	600392	盛和资源	44,591	801,746.18	0.03
285	000685	中山公用	69,170	703,458.90	0.03
286	600138	中青旅	31,248	680,581.44	0.03
287	601336	新华保险	32,019	676,561.47	0.03
288	600298	安琪酵母	44,973	655,706.34	0.03
289	000703	恒逸石化	92,824	611,710.16	0.02
290	000669	金鸿能源	34,643	595,166.74	0.02
291	600748	上实发展	78,263	581,494.09	0.02
292	600797	浙大网新	84,093	576,037.05	0.02
293	601369	陕鼓动力	99,343	557,314.23	0.02
294	601139	深圳燃气	82,445	550,732.60	0.02
295	601928	凤凰传媒	56,820	527,289.60	0.02
296	600428	中远航运	178,006	521,557.58	0.02
297	601566	九牧王	48,640	512,665.60	0.02
298	600685	广船国际	29,664	508,144.32	0.02
299	600289	亿阳信通	52,106	466,348.70	0.02
300	002063	远光软件	21,430	438,243.50	0.02
301	600435	北方导航	34,266	419,758.50	0.02
302	002204	大连重工	29,517	376,636.92	0.01
303	002345	潮宏基	21,802	373,250.24	0.01
304	002078	太阳纸业	108,889	343,000.35	0.01
305	000762	西藏矿业	28,215	297,386.10	0.01
306	002091	江苏国泰	16,509	252,752.79	0.01
307	002238	天威视讯	18,478	231,529.34	0.01
308	002008	大族激光	12,825	222,385.50	0.01
309	002315	焦点科技	5,184	221,149.44	0.01
310	000503	海虹控股	11,278	219,921.00	0.01
311	600503	华丽家族	36,922	150,641.76	0.01
312	600110	中科英华	25,503	133,890.75	0.01
313	000563	陕国投 A	15,876	102,082.68	0.00
314	600765	中航重机	7,543	90,516.00	0.00
315	002570	贝因美	3,764	54,051.04	0.00
316	002456	欧菲光	700	15,001.00	0.00

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所有股票投资明细

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	002584	西陇化工	524,191	8,151,170.05	0.31
2	002518	科士达	400,005	6,864,085.80	0.26
3	002228	合兴包装	699,171	6,837,892.38	0.26
4	002268	卫士通	183,929	6,814,569.45	0.26
5	002215	诺普信	846,770	6,333,839.60	0.24
6	600717	天津港	708,209	5,651,507.82	0.22
7	002565	上海绿新	627,834	5,424,485.76	0.21
8	300303	聚飞光电	230,646	4,241,579.94	0.16
9	002283	天润曲轴	570,581	3,651,718.40	0.14
10	300157	恒泰艾普	255,114	3,301,175.16	0.13
11	600499	科达洁能	158,132	2,821,074.88	0.11
12	601788	光大证券	253,759	2,014,846.46	0.08
13	600638	新黄浦	128,988	1,896,123.60	0.07
14	600069	银鸽投资	391,008	1,407,628.80	0.05
15	002167	东方锆业	96,304	1,096,902.56	0.04
16	600326	西藏天路	164,111	1,058,515.95	0.04
17	002006	精功科技	101,215	668,019.00	0.03
18	600072	*ST 钢构	76,556	663,740.52	0.03
19	600779	水井坊	82,871	594,185.07	0.02
20	002493	荣盛石化	64,030	521,204.20	0.02
21	000042	深长城	43,683	474,397.38	0.02
22	600841	上柴股份	35,651	350,092.82	0.01
23	600077	宋都股份	91,549	327,745.42	0.01
24	002386	天原集团	36,630	274,725.00	0.01
25	600388	龙净环保	10,916	263,621.40	0.01
26	000936	华西股份	67,489	256,458.20	0.01
27	002651	利君股份	11,518	191,083.62	0.01

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	601166	兴业银行	117,041,846.69	6.38

2	600998	九州通	65,959,266.02	3.60
3	000333	美的集团	54,261,109.51	2.96
4	600196	复星医药	50,379,801.48	2.75
5	000538	云南白药	47,868,169.49	2.61
6	601299	中国北车	42,005,062.83	2.29
7	600372	中航电子	40,409,232.97	2.20
8	000651	格力电器	40,220,232.57	2.19
9	600549	厦门钨业	37,890,732.33	2.07
10	000063	中兴通讯	35,791,142.13	1.95
11	600887	伊利股份	32,910,307.88	1.80
12	000625	长安汽车	31,649,518.97	1.73
13	601766	中国南车	30,861,610.00	1.68
14	600703	三安光电	30,587,074.22	1.67
15	002415	海康威视	27,330,289.37	1.49
16	000895	双汇发展	26,604,785.70	1.45
17	600315	上海家化	25,518,544.81	1.39
18	000826	桑德环境	24,490,395.35	1.34
19	600271	航天信息	23,447,177.05	1.28
20	601600	中国铝业	22,653,447.89	1.24

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	600036	招商银行	46,198,624.49	2.52
2	601166	兴业银行	41,419,875.32	2.26
3	000651	格力电器	36,086,078.31	1.97
4	601766	中国南车	29,640,343.75	1.62
5	601989	中国重工	20,615,347.56	1.12
6	601398	工商银行	15,974,197.20	0.87
7	601318	中国平安	11,273,137.38	0.61
8	000002	万科A	10,300,824.07	0.56
9	600660	福耀玻璃	10,218,983.16	0.56
10	600998	九州通	10,043,895.51	0.55
11	600000	浦发银行	9,574,741.82	0.52
12	600570	恒生电子	8,909,487.33	0.49
13	600016	民生银行	8,801,151.95	0.48

14	600383	金地集团	8,422,654.98	0.46
15	600642	申能股份	7,723,471.45	0.42
16	000625	长安汽车	7,618,922.91	0.42
17	600196	复星医药	7,525,167.19	0.41
18	000538	云南白药	7,500,479.71	0.41
19	600887	伊利股份	7,363,305.33	0.40
20	600030	中信证券	7,114,471.53	0.39

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	1,920,420,194.19
卖出股票收入（成交）总额	1,096,508,781.36

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	6,923,004.20	0.26
8	其他	-	-
9	合计	6,923,004.20	0.26

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	113005	平安转债	64,810	6,923,004.20	0.26

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所有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

根据中国平安股份有限公司 2013 年 10 月 14 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有限责任公司（以下简称“平安证券”）近日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》（〔2013〕48 号）。中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）决定责令平安证券改正及给予警告，没收其在万福生科（湖南）农业开发股份有限公司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，暂停其保荐业务许可 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，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2

本基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 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	323,128.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	96,946.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.07
8	其他	-
9	合计	450,321.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113005	平安转债	6,923,004.20	0.26

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 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

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。

§ 8 基金份额持有人信息

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	8,259	58,536.48	232,805,012.00	48.15%	250,647,738.00	51.85%
长盛同庆 800B	11,474	63,201.95	118,336,408.00	16.32%	606,842,718.00	83.68%
长盛同庆中证 800 分级	14,983	130,595.13	1,830,850,050.93	93.57%	125,856,759.06	6.43%
合计	34,716	91,178.09	2,181,991,470.93	68.93%	983,347,215.06	31.07%

注：1、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。

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

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	15.56%
2	上海真爱梦想公益基金会	65,623,268.00	13.57%
3	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	28,322,488.00	5.86%
4	中银保险有限公司—传统保险产品	22,905,427.00	4.74%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	17,440,608.00	3.61%
6	东方证券股份有限公司	16,668,250.00	3.45%
7	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	3.15%
8	银河证券—光大—银河智远有限补偿 1 号集	13,600,000.00	2.81%

	合资产管理计划		
9	银河证券—光大银行—银河证券安心收益 2 号集合资产管理计划	12,000,000.00	2.48%
10	魏小艳	10,392,197.00	2.15%

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	信诚人寿保险有限公司—分红—一个险分红	63,097,700.00	8.70%
2	西南证券股份有限公司	20,063,620.00	2.77%
3	魏小艳	15,588,296.00	2.15%
4	程冰	13,336,132.00	1.84%
5	上海盛筑投资咨询有限公司	12,500,000.00	1.72%
6	廖雪静	10,000,000.00	1.38%
7	赵云平	10,000,000.00	1.38%
8	高贤	9,000,000.00	1.24%
9	戚淑琴	8,530,000.00	1.18%
10	张延涛	8,320,701.00	1.15%

注：1、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。

2、对于长盛同庆 800A、长盛同庆 800B 前十名持有人持有份额比例的分母采用各自级别的份额。

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、基金投资和相关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

§ 9 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	565,266,514.00	847,899,772.00	585,058,105.67
本报告期基金总申购份额	-	-	1,715,780,255.37
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	630,438,521.74
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-81,813,764.00	-122,720,646.00	286,306,970.69
本报告期末基金份额总额	483,452,750.00	725,179,126.00	1,956,706,809.99

注：1、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。

2、依照本基金合同的规定，本基金于 2014 年 5 月 21 日进行了份额折算。

§ 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

本基金管理人于 2014 年 4 月 16 日发布公告，经公司第五届董事会第五十七次会议以及第六届董事会第一次会议审议通过，并报中国证监会审核批准，由高新先生担任公司董事长，凤良志先生因年龄原因不再担任公司董事长职务。根据公司章程相关规定，“董事长为公司的法定代表人”。公司已于 2014 年 4 月 14 日完成相关工商登记变更手续。

10.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

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 2014 年 2 月 7 日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

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

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	
中信证券	1	1,324,899,177.65	43.92%	1,206,194.15	43.92%	-
光大证券	1	581,906,437.45	19.29%	529,768.83	19.29%	-
中航证券	1	557,200,763.58	18.47%	507,276.37	18.47%	-
申银万国	1	487,925,409.34	16.17%	444,205.70	16.17%	-
东北证券	1	64,997,187.53	2.15%	59,173.29	2.15%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	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
中信证券	580,380.50	100.00%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
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，并能为本公司基金提供全面的信息服。

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：无。

10.8 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及本公司网站	2014 年 6 月 18 日
2	关于增加上海证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购费率优惠活动的公告	同上	2014 年 6 月 16 日
3	关于长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及同庆 800A 份额恢复交易的公告	同上	2014 年 5 月 23 日
4	关于长盛同庆 800A 份额定期份额折算后次日前收盘价调整的公告	同上	2014 年 5 月 23 日
5	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之同庆 800A 份额约定年收益率变更的公告	同上	2014 年 5 月 22 日
6	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间同庆 800A 份额停复牌的公告	同上	2014 年 5 月 22 日
7	同庆中证 800 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告	同上	2014 年 5 月 16 日

8	关于长盛同庆 800A、同庆 800B 定期份额折算后次日前收盘价调整的提示公告	同上	2014 年 5 月 16 日
9	关于中证 800 指数分级基金办理定期份额折算业务期间暂停申赎及定投业务的公告	同上	2014 年 5 月 16 日
10	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的提示性公告	同上	2014 年 5 月 14 日
11	长盛基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	同上	2014 年 4 月 16 日
12	长盛基金管理有限公司关于董事长变更的公告	同上	2014 年 4 月 16 日
13	关于增加恒天明泽为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2014 年 3 月 24 日
14	长盛基金管理有限公司关于在兴业银行开通旗下部分基金转换业务的公告	同上	2014 年 2 月 24 日
15	关于旗下部分开放式基金在中信建投证券开通转换业务的公告	同上	2014 年 2 月 12 日
16	关于增加同花顺为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2014 年 1 月 20 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会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。

- 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、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 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。

11.3 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>。

长盛基金管理有限公司

2014 年 8 月 28 日