

基金管理人:长盛基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
重要提示
1.1 重要提示
基金管理人的董事会、基金管理人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法律责任...

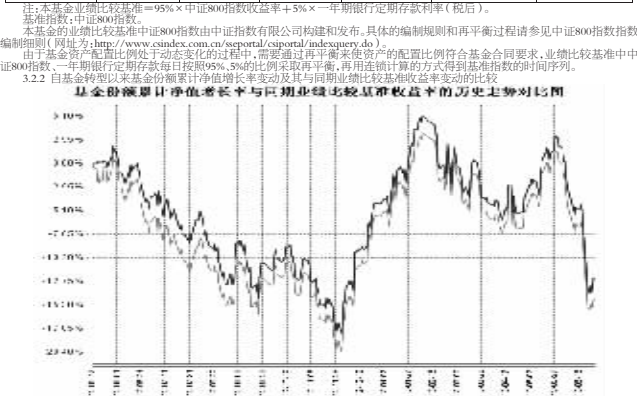
长盛同庆中证800指数分级证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30日

基金基本简介
基金名称:长盛同庆中证800分级证券投资基金(场内简称:长盛同庆)
基金代码:160806
交易代码:160806
基金运作方式:契约开放式
基金合同生效日:2012年5月12日
基金管理人:长盛基金管理股份有限公司
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:2,882,425,233.10份
基金合同存续期:不定期
上市证券交易所:深圳证券交易所

基金主要财务指标
项目 基金管理人 基金托管人
名称 长盛基金管理股份有限公司 中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人 叶金松 田雷
联系电话 010-82019988 010-67595066
电子邮箱 yej@csfund.com.cn tianr@ccb.com.cn



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)
风险收益特征:本基金为跟踪复制标的股票指数,具有高风险、高预期收益的特征...

基金管理人及基金托管人简介
姓名 职务 任期起始日期 任期截止日期 说明
王超 基金经理 2012年7月 至今
王志远 基金经理 2013年7月 至今

基金投资策略:本基金主要投资于中证800指数的成份股及备选成份股,采用被动式投资策略,紧密跟踪标的指数的表现...

基金资产净值及基金份额变动情况
项目 2013年6月30日 2012年12月31日
资产 158,010,915.49 220,448,885.81
负债 2,874,630.87 6,170,287.74
净资产 155,136,284.62 214,278,598.07

基金投资组合报告
截至2013年6月30日,本基金资产组合如下:
股票投资 2,270,067,077.31
债券投资 4,403,403,737.07
其他资产 1,000,000.00

基金主要财务指标
项目 本期 上期
一、收入 -85,304,252.86 -175,429,842.74
二、费用 882,100.02 8,180,714.81
三、利润总额 -86,186,352.88 -183,610,557.55

基金主要财务指标续
项目 本期 上期
1. 投资收益 882,100.02 8,180,714.81
2. 公允价值变动损益 2,651.12 12,708.55
3. 其他收入 2,651.12 12,708.55

基金业绩比较基准
项目 2013年1月1日至2013年6月30日
基金净值增长率 1.27%
沪深300指数收益率 1.73%
中证800指数收益率 1.76%

基金业绩比较基准续
项目 2012年5月12日至2012年6月30日
基金净值增长率 1.27%
沪深300指数收益率 1.73%
中证800指数收益率 1.76%

基金业绩比较基准续
项目 2012年5月12日至2012年6月30日
基金净值增长率 1.27%
沪深300指数收益率 1.73%
中证800指数收益率 1.76%

基金业绩比较基准续
项目 2012年5月12日至2012年6月30日
基金净值增长率 1.27%
沪深300指数收益率 1.73%
中证800指数收益率 1.76%

基金业绩比较基准续
项目 2012年5月12日至2012年6月30日
基金净值增长率 1.27%
沪深300指数收益率 1.73%
中证800指数收益率 1.76%

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
关联方名称 本期 上期
中国建设银行 158,010,915.49 813,325.72

6.4.8.6 期末按公允价值计量的金融资产
项目 期末余额 期初余额
股票 2,270,067,077.31 2,270,067,077.31

6.4.8.7 期末按公允价值计量的金融资产续
项目 期末余额 期初余额
债券 4,403,403,737.07 4,403,403,737.07

6.4.8.8 期末按公允价值计量的金融资产续
项目 期末余额 期初余额
其他 1,000,000.00 1,000,000.00

6.4.8.9 期末按公允价值计量的金融资产续
项目 期末余额 期初余额
其他 1,000,000.00 1,000,000.00

6.4.8.10 期末按公允价值计量的金融资产续
项目 期末余额 期初余额
其他 1,000,000.00 1,000,000.00

6.4.8.11 期末按公允价值计量的金融资产续
项目 期末余额 期初余额
其他 1,000,000.00 1,000,000.00

6.4.8.12 期末按公允价值计量的金融资产续
项目 期末余额 期初余额
其他 1,000,000.00 1,000,000.00

6.4.8.13 期末按公允价值计量的金融资产续
项目 期末余额 期初余额
其他 1,000,000.00 1,000,000.00

基金资产净值及基金份额变动情况
项目 2013年6月30日 2012年12月31日
资产 158,010,915.49 220,448,885.81

基金资产净值及基金份额变动情况续
项目 2013年6月30日 2012年12月31日
负债 2,874,630.87 6,170,287.74

基金资产净值及基金份额变动情况续
项目 2013年6月30日 2012年12月31日
净资产 155,136,284.62 214,278,598.07

基金资产净值及基金份额变动情况续
项目 2013年6月30日 2012年12月31日
股票 2,270,067,077.31 2,270,067,077.31

基金资产净值及基金份额变动情况续
项目 2013年6月30日 2012年12月31日
债券 4,403,403,737.07 4,403,403,737.07

基金资产净值及基金份额变动情况续
项目 2013年6月30日 2012年12月31日
其他 1,000,000.00 1,000,000.00

基金资产净值及基金份额变动情况续
项目 2013年6月30日 2012年12月31日
其他 1,000,000.00 1,000,000.00

基金资产净值及基金份额变动情况续
项目 2013年6月30日 2012年12月31日
其他 1,000,000.00 1,000,000.00

基金资产净值及基金份额变动情况续
项目 2013年6月30日 2012年12月31日
其他 1,000,000.00 1,000,000.00