

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：2013年8月29日

## 重要提示

1.1 重要提示  
基金管理人、基金托管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的法律责任。本公司承诺本报告所载信息符合有关法律法规、基金合同的规定和真实、准确、完整、及时地披露了所有重大信息。  
基金管理人、基金托管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。  
基金管理人的从业人员不得利用职务之便，从事损害基金利益的活动。  
基金的过往业绩并不代表其未来表现，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其更新。  
本基金未经基金份额持有人大会决议通过，不得从基金资产中计提销售服务费。  
本基金不接受货币申购。

本报告期末未进行分红。

本报告期未对基金份额持有人进行定期报告。

## 2.1 基金简介

基金名称	长盛同庆中证800分级 钻石份额
基金代码	160806
交易状态	正常
基金运作方式	契约型开放式
基金的成立日	2012年5月10日
报告期末基金份额总额	1,782,159,800.00份
报告期末基金资产净值	1,173,329,746.00元
报告期末基金份额总额	927,025,657.00份

## 2.2 基金产品风险

本基金运用指数化投资方式，通过严苛的股指期货和量化风险管理手段，力图将本基金的收益与中证800指数的表现尽可能地挂钩。本基金的预期收益为中证800指数的0.95%加上平均的管理费率0.04%，即实现收益为中证800指数的预期收益率。

本基金原计划上市前采用指数复制的证券投资策略，综合考虑本产品的自流动性市值规模、行业属性、标的指数的行业集中度等多方面的因素，选择适当的指数成分股进行投资组合构建，优化持仓结构，以期获得与中证800指数相匹配的收益。

投资策略：本基金在基金合同期生效3个月内将投资组合比例调整到达到基金合同的相关规定。

当期初指数成份股发生调整，成份股发生停牌、增发、停牌等行为，以及因基金的申购和赎回对基金资产规模产生影响，导致无法有效复制和跟踪指数成份股时，本基金将根据指数成份股的可投资性、流动性、规模、行业属性、标的指数的行业集中度等多方面的因素，选择适当的指数成分股进行投资组合构建，优化持仓结构，以期获得与中证800指数相匹配的收益。

本基金为分级基金，因此在基金合同期内，将根据基金合同约定的条款，定期向持有不同份额级别的基金持有人分配收益。

本基金的业绩比较基准：中证800指数×95%+中证800指数收益率×5%+一年定期存款利率(税后)。

业绩比较基准：95%-98%的股票收益+5%-5%一年定期存款利率(税后)。

风险收益特征：本基金为分级基金，属于股票型基金，具有较高的风险和预期收益。

本基金的风险收益特征：高风险、高收益。

长盛同庆800A、低风险、收益稳健；长盛同庆800B、高风险、高预期收益。

长盛同庆中证800分级基金持有人在购买本基金时，需根据不同的风险承受能力，选择适合自己的份额类别。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

名称：长盛基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司

姓名：叶青松 职务：董事

信息披露负责人：010-82019988 电子邮箱：yej@fundsm.com.cn

客户服务电话：400-888-2666, 010-62350000

传真：010-82255988

2.4 会计核算方式

基金现金头寸报告公告网址：<http://www.stcn.com>

基金年度报告披露地点：中国建设银行股份有限公司

3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位：人民币元

3.1 本期份额数据和指标 报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)

本期实现收益 234,158,174.42

本期均场份额利润 -113,134,441.02

加权平均基金份额本期利润 -0.0342

本期基金份额净增长率 -8.73%

3.1.2 利润数据和指标 报告期(2013年6月30日)

期初可供分配基金份额利润 -0.548

期末可供分配基金份额利润 2,442,818,905.50

基金份额净值 0.847

注：1.本基金的业绩指标是指持有人认购或交易基金的总费用后，计入费用后的收益水平要低于原始数据。

2.本期利润为本期利息收入、投资收益、公允价值变动收益减去必要的费用后的余额。

3.本期可供分配利润指截至本报告期末可供分配的基金份额利润，其中包含本报告期及以前期间已实现的损益。

4.本期基金份额净增长率=当期可供分配利润/期末可供分配利润。

5.3.2 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.3 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.4 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.5 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.6 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.7 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.8 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.9 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.10 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.11 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.12 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.13 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.14 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.15 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.16 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.17 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.18 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.19 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.20 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.21 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.22 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.23 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.24 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.25 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.26 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.27 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.28 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.29 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.30 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.31 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.32 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.33 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.34 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.35 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.36 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.37 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.38 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合同期(即基金的同生日)为2012年5月10日。

5.3.39 基金的净值增长及其对行业业绩的比较

本基金在基金合同期内分属两只交易型开放式基金，基金合