同益证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

2013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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2013年8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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称:中国工商银行)根据本基金合同规定,于2013年8月22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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛同益封闭(场内简称:基金同益)
基金主代码	184690
交易代码	184690
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年4月8日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,000,000,000份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1999年4月21日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	始终如一地奉行“价值投资”的基本原则,并在不同的市场环境以及市场发展变化的不同阶段,灵活运用适合自身运作特点的投资原则、投资理念和投资技巧。在战略资产配置层,寻求现金、债券、股票资产的动态收益、风险最优配置;在战术资产配置层,寻求成长型股票和价值型股票的动态收益、风险最优配置。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	赵会军
	联系电话	010-82019988	010-66105799
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	95588
传真		010-82255988	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

§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(2013年1月1日-2013年6月30日)
本期已实现收益	205,783,546.26
本期利润	105,712,758.41
加权平均基金份额本期利润	0.0529
本期基金份额净值增长率	6.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0893
期末基金资产净值	1,821,335,420.86
期末基金份额净值	0.9107

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。

3.2 基金净值表现

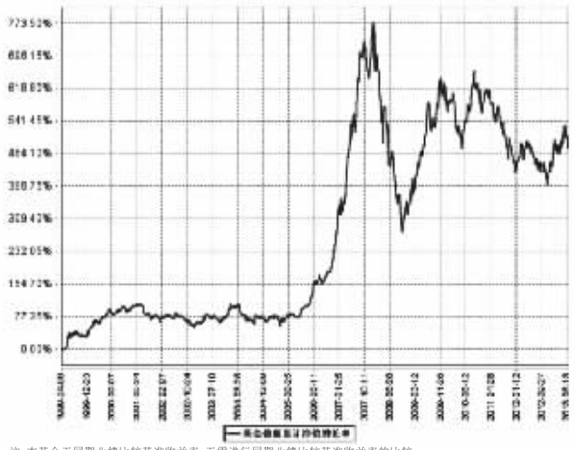
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②
过去一个月	-8.17%	1.94%
过去三个月	0.16%	2.32%
过去六个月	6.17%	2.63%
过去一年	2.49%	2.40%
过去三年	-1.25%	2.20%
自基金合同生效起至今	483.10%	3.20%

注:本基金无业绩比较基准收益率,无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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:本基金无同期业绩比较基准收益率,无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

§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。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6月30日,基金管理人共管理两只封闭式基金、二十七只开放式基金,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		
张锦灿	本基金基金经理	2012年11月20日	-	8年	男,1982年1月出生,中国国籍。北京大学光华管理学院金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员,银华基金管理有限公司研究员、研究主管、基金经理助理。2012年9月加入长盛基金管理有限公司,现任同益证券投资基金(本基金)基金经理。
王克玉	本基金基金经理(已离任),长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理。	2010年7月13日	2013年1月5日	10年	男,1979年12月出生,中国国籍。上海交通大学硕士。历任元大京华证券上海代表处研究员、天相投资顾问有限公司分析师、国都证券有限公司分析师。2006年7月加入长盛基金管理有限公司,先后担任高级行业研究员、同盛证券投资基金基金经理助理等职务,现任长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理、长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理。曾任本基金基金经理,目前已离任。

注:1.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遵规守信情况的说明

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、《同益证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金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,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 报告期内本基金投资策略和运作分析

2013年一季度,市场在春节前一路走高,节后上探至近一年的高点后开始一路下行。二季度市场分化极其严重,创业板、传媒板块里的成长股表现出巨大的结构性机会,与投资相关的行业跌幅巨大。市场热点板块从年初的金融、地产、投资品,切换到春节后的医药、乳制品,再到4-5月份的电子、传媒、环保,对经济的预期,从周期性复苏,转变为弱复苏,到持续衰退,最后到结构性转型,先跳后立。上半年表现最好的板块是TMT、医药、环保、汽车,最差的板块是煤炭、有色、钢铁、建材、非银金融等。

本基金考虑到经济周期和市场运行特征的变化,在前半期较为乐观,保持了一个相对高贝塔的组合,在水泥、环保等方面获得了较好的回报。后半期,随着内外环境的演变,认识到“市场存量资金博弈的格局”并未发生改变,降低了配置型标的的投资比重,重新回归到“选股”的思路上去。在消费股方面获得了较好的选股收益,成长股投资方面也有斩获,但偏保守。上半年,本基金的表现大幅优于指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为0.9107元,本报告期份额净值增长率为6.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,周期性问题可能仍不是经济和市场的主要矛盾,结构性问题和政策还是主线。“自上而下”的投资模式在短期可能仍不适用。对于传统行业,不能以估值论价值,关键还是要看有没有景气的积极变化,需要发掘结构性的机会,“自下而上”的去研究和选择。

成长股的表现可能会受制于市场整体流动性的进一步萎缩、估值过高的压力、业绩兑现的不确定性等因素。当然,有盈利支撑、良好商业模式、创新资本运作模式的公司仍可能会继续保持强势。对于成长股投资,我们坚持商业模式、市值与估值双重标准,选择从实业角度看有价值的公司,同时控制好投资比例。

市场到了这个阶段,“抱团”现象和对趋势、强势股的过分追逐日趋明显。考虑到估值和涨幅,从消费类和成长股里增加配置反而是更困难的。因此,在保持较低仓位的同时,我们打算从关注度较低的板块、行业里,包括传统行业,寻找一些基本面有积极变化的个股,逐渐买入。同时,密切跟踪政策的导向及其对现有市场均衡的影响,从而寻找新的机遇,调整配置结构。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项说明

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、金融工程与量化投资部、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》的规定以及本基金基金合同第十七条中对基金利润分配原则的约定,本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至2013年6月30日,期末可供分配收益为-178,664,579.14元,其中:未分配收益已实现部分为-171,014,976.71元,未分配收益未实现部分为-7,649,602.43元。

§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

本报告期内,本基金托管人在对同益证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,同益证券投资基金的管理人——长盛基金管理有限公司在同益证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的同益证券投资基金2013年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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:同益证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:		
银行存款	204,999,032.57	100,952,012.88
结算备付金	6,304,131.70	4,650,381.52
存出保证金	1,095,143.80	861,191.88
交易性金融资产	1,520,664,582.24	1,630,460,937.06
其中:股票投资	1,120,912,001.23	1,229,274,637.03
基金投资	-	-
债券投资	399,752,581.01	401,186,300.03
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	50,000,000.00	-
应收证券清算款	38,752,506.11	-
应收利息	6,500,307.24	5,785,394.50
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,828,315,703.66	1,742,709,917.84
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负债:		
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	-	20,336,449.59
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,332,095.14	2,059,854.64
应付托管费	388,682.51	343,309.13
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,733,052.69	2,416,942.35
应交税费	815,699.68	815,699.68
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	710,752.78	1,115,000.00
负债合计	6,980,282.80	27,087,255.39
所有者权益:		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	-178,664,579.14	-284,377,337.55
所有者权益合计	1,821,335,420.86	1,715,622,662.45
负债和所有者权益总计	1,828,315,703.66	1,742,709,917.84

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.9107元,基金份额总额2,000,000,000份。

6.2 利润表

会计主体:同益证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	131,233,857.44	82,414,552.75
1.利息收入	8,510,769.27	9,164,906.33
其中:存款利息收入	403,044.45	357,828.65
债券利息收入	7,437,778.07	7,812,724.67
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	669,946.75	994,353.01
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	222,793,876.02	-109,633,060.09
其中:股票投资收益	216,613,863.18	-123,155,216.37
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,049,704.66	1,764,526.06
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	7,229,717.50	11,757,630.22
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-100,070,787.85	182,864,603.82
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	18,102.69
减:二、费用	25,521,099.03	19,938,288.93
1.管理人报酬	13,690,902.01	13,345,479.92
2.托管费	2,281,816.99	2,224,246.68
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	9,321,385.24	4,146,433.64
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	226,994.79	222,128.69
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	105,712,758.41	62,476,263.82
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	105,712,758.41	62,476,263.82

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:同益证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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
一、期初所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	-284,377,337.55	1,715,622,662.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	105,712,758.41	105,712,758.41
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	2,000,000,000.00	-178,664,579.14	1,821,335,420.86
	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
项目	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)	2,000,000,000.00	-285,186,854.06	1,714,813,145.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	62,476,263.82	62,476,263.82
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	2,000,000,000.00	-222,710,590.24	1,777,289,409.76

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 杨思乐 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

同益证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[1999]8号文《关于同意同益证券投资基金设立的批复》的核准,由中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、天津北方国际信托投资股份有限公司、国元证券股份有限公司和长盛基金管理有限公司五家发起人共同发起并向社会募集设立,基金合同于1999年4月2日正式生效,首次设立募集规模为20亿份基金份额。本基金为契约型封闭式,存续期为15年。本基金经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[1999]21号文审核同意,于1999年4月21日在深交所挂牌交易。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金只投资于具有良好流动性的金融工具,其中主要投资于国内依法公开发行、上市的股票、债券。本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%,本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%。本基金并未就业绩比较基准作出相关规定。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号(年度报告的内容与格式)》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号(会计报表附注的编制及披露)》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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于2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至2013年6月30日期间的经营成果和净值变动情况。

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:本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明:本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明:本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资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.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会联合发布财税[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》的规定,自2013年1月1日起,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得,按照本通知的规定计征个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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	基金发起人、基金管理人
国元证券	基金发起人、基金管理人股东
中国工商银行	基金托管人

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	1,548,690,773.69	25.55%	-	-

6.4.8.1.2 权证交易

注:本基金于本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

注:本基金于本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.8.1.4 债券回购交易

注:本基金于本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.5 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6月30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	1,346,566.79	24.69%	136,733.70	5.01%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	-	-	-	-

注:1.上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费后的净额列示。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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,690,902.01	13,345,479.92
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提,基金成立三个月后,如果现金持有比例超过基金资产净值的20%,超出部分不计提基金管理费。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值(扣除超过规定比例现金后的资产净值)

基金管理人的管理费每日计算,管理费逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人根据基金管理人的划款通知于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,281,816.99	2,224,246.68

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,基金托管费逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人根据基金管理人的划款通知于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
期初持有的基金份额	28,000,079	28,000,079
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	28,000,079	28,000,079
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.40%	1.40%

6.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
长江证券	6,000,000	0.30%	6,000,000	0.30%
天津国际信托	4,000,000	0.20%	4,000,000	0.20%
中信证券	6,000,000	0.30%	6,000,000	0.30%
国元证券	4,000,000	0.20%	4,000,000	0.20%

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

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国工商银行	204,999,032.57	349,542.23	40,602,275.21	315,318.36

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计算。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明:无。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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
600983	合肥三洋	20130514	重大事项停牌	9.96	2013/08/14	10.90	3,100,045.00	27,433,521.99	30,876,448.20	-

注:本基金截至2013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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	1,120,912,001.23	61.31
	其中:股票	1,120,912,001.23	61.31
2	固定收益投资	399,752,581.01	21.86
	其中:债券	399,752,581.01	21.86
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,000.00	2.73
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	211,303,164.27	11.56
6	其他各项资产	46,347,957.15	2.54
7	合计	1,828,315,703.66	100.00

7.2 期末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	9,610,734.42	0.53
B	采矿业	-	-
C	制造业	850,762,387.45	46.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	136,021,176.72	7.47
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,991,000.00	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,806,874.90	3.23
J	金融业	35,644,000.00	1.96
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和