

长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

2011 年半年度报告

2011 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2011 年 8 月 27 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 26 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15

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 ..	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注.....	19
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	37
7.3 报告期末按行业分类的权益投资组合	37
7.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 ..	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	41
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	42
7.7 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	42
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生产品投资明 细	42
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	42
7.11 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼	45

10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	47
§ 11 备查文件目录	49
11.1 备查文件目录	49
11.2 存放地点	49
11.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金
基金简称	长盛环球行业股票（QDII）
基金主代码	080006
交易代码	080006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月26日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	54,682,751.25份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球证券市场，把握全球经济趋势，精选景气投资行业，并在此基础上投资于其中的优势公司，实现充分分享全球经济增长收益的目标；同时在投资国家或地区配置上，有效实现全球分散化投资，力争充分分散风险，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法，运用 Black-Litterman 资产配置模型实现行业层面的风险最优配置，在行业内部，运用全球量化选股模型精选个股，投资人将两者进行有机结合，构建最优化的投资组合。
业绩比较基准	摩根斯坦利世界大盘股指数（MSCI World Large Cap Index）
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金。同时，本基金为全球股票型证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。此外，由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的股票型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	唐州徽
	联系电话	010-82019988	010-66594855
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942
注册地址		深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100088	100818
法定代表人		凤良志	肖钢

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	GOLDMAN SACHS ASSET MANAGEMENT, L. P.	BANK OF CHINA (HONG KONG LIMITED)
	中文	高盛资产管理有限责任公司	中国银行(香港)有限公司
注册地址		200 West Street, New York, NY 10282-2198	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		香港皇后大道中 2 号长江集团中心 68 楼	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 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》
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办公地址

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层

§ 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	报告期(2011年1月01日-2011年6月30日)
本期已实现收益	1,842,276.28
本期利润	-2,004,190.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0311
本期加权平均净值利润率	-3.05%
本期基金份额净值增长率	-3.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	-695,723.84
期末可供分配基金份额利润	-0.0127
期末基金资产净值	53,987,027.41
期末基金份额净值	0.987
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.45%

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	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	-2.95%	0.82%	-1.65%	1.02%	-1.30%	-0.20%
过去三个月	-4.08%	0.70%	-0.24%	0.88%	-3.84%	-0.18%
过去六个月	-3.86%	0.68%	3.80%	0.85%	-7.66%	-0.17%
过去一年	5.02%	0.62%	26.64%	0.89%	-21.62%	-0.27%
自基金合同生效起至今	3.45%	0.60%	25.50%	0.97%	-22.05%	-0.37%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

业绩比较基准 = 摩根斯坦利世界大盘股可投资指数 (MSCI World Large Cap IMI Index) x 100% (以下简称 MSCI 世界指数)。

本基金为股票型基金，主要投资范围为全球主要发达地区股票市场大盘类股票，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后选取上述指数。

摩根斯坦利世界大盘股可投资指数是按照自由流通市值调整方法编制的跟踪全球成熟市场的全球性投资指数，是 MSCI 标准化指数之一，适合作为全球市场投资业绩比较基准的指数。全球超过 80% 的基金经理人，是以 MSCIBARRA 编制的指数作为投资绩效评估的标准。在全球范围内，MSCI 世界指数已经成为全球市场投资工具的基准标尺之一，并且由 MSCIBARRA 每日在市场发布。截至 2010 年 12 月，摩根斯坦利世界大盘股可投资指数涵盖 23 个国家和地区的超过 730 只股票，代表了全球国家大约 75% 的总市值，与本基金主要投资方向比较吻合。

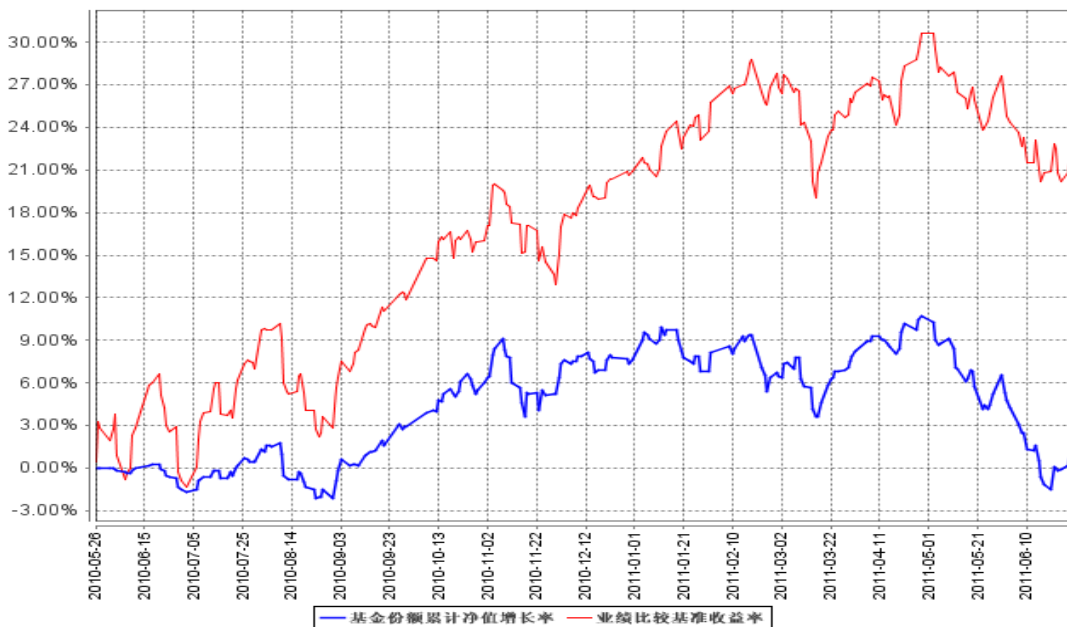
MSCI 世界指数样本覆盖了与证监会已经签立合作谅解备忘录的主要国家，并为许多国际著名股票投资基金选用为投资比较基准，具有良好的市场代表性。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准比较合适。

本基金的股票资产占基金资产的 60%-95%。在正常的市场情况下，基金的平均股票仓位约为 85%，所以，业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

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

(2010 年 5 月 26 日至 2011 年 6 月 30 日)

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：按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（三）投资范围、（九）投资限制的有关约定。

§ 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

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6号文件批准，于1999年3月成立，注册资本为人民币15000万元。目前，本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%；新加坡星展资产管理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%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截止2011年6月30日，基金管理人共管理两支封闭式基金、十四支开放式基金（一支QDII基金），并于2002年12月，首批取得了全国社保基金管理资格。基金管理人于2007年9月，取得合格境内机构投资者资格，并于2008年2月，取得从事特定客户资产管理业务资格。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴达	本基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，国际业务部总监。	2010年5月26日	—	9年	男，1979年8月出生，中国国籍。伦敦政治经济学院金融经济学硕士，CFA（美国特许金融分析师）。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊瑚全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理，专户投资组合经理；新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理，资产配置委员会成员；华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理；2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，现任国际业务部总监，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金（本基金）基金经理。
邓永健	本基金基金经理。	2010年5月26日	—	16年	男，1967年10月出生，中国香港籍。英国兰卡斯特大学工商管理硕士，CFA（美国特许金融分析师）。历任恩佩

					投资管理有限公司助理基金经理；元大京华证券（香港）有限公司高级经理；大福资产管理有限公司助理董事；星展资产管理（香港）有限公司总监及高级基金经理；加拿大宏利资产管理（香港）有限公司股票部行政总监；2007年12月起加入长盛基金管理有限公司，现任长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金（本基金）基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、报经中国证券业协会同意，目前邓永健同志已不再担任长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金经理，由吴达同志继续担任本基金基金经理。。该事项公司已于2011年8月3日进行公告。

2、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；

3、“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》的相关规定等。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Len Ioffe	高盛全球量化股票团队的高级投资组合经理，全球量化股票投资政策委员会成员。	16年	俄罗斯圣彼得堡理工大学颁发的计算机科学硕士，纽约大学斯特恩商学院工商管理硕士，曾供职于史密斯·巴尼·希尔森公司。1994年加入高盛资产管理，曾负责美国国内及国际投资组合的建立及风险分析，并实施不同的交易策略。

4.3 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《基金法》及其各项实施准则、《长盛环球景气行业大盘精选股票型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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生异常交易情况。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年，全球资本市场走出了反复震荡的行情，对于金融危机以来复苏的认知多次受到突发事件的干扰。一季度北非和利比亚的局势动荡、日本福岛地震核危机推动股市在三月份完成获利回吐并迅速反弹。二季度中期，由于美国二次量化宽松6月底到期及欧洲债务危机的恶化市场再次剧烈调整，随后受希腊债务重组方案通过的事件刺激在6月的最后一周快速收复失地。市场的剧烈反复显示整体投资者的信心比较脆弱，对大规模量化宽松后超发货币推动的全球通货膨胀担忧，进而怀疑企业毛利率扩张的可持续性。

从企业微观层面上看，美国消费者信心恢复仍在缓慢进程中，以全球需求为主导的美国中大型企业盈利状况良好，在一定程度上也受益于疲软的美元。虽然由于缩减成本带来的毛利率上升空间已经不大，但从近月来营业收入增长趋势上看，下阶段可以期待以量补价的行情。

基于对美国企业基本面的乐观预期和宽松的联储货币政策，本基金保持了对美国市场的投资仓位，在上半年表现了比较高的波动性。出于对欧洲债务问题的长期担忧继续低配欧洲，但由于核心西欧市场的良好表现，低配效果并不明显。中国经济增速下滑使得组合在海外中国企业部分的投资受压，下半年基金将在通胀压力减轻的背景下寻找优质企业价值重估的机会。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 0.987 元，本报告期份额净值增长率为 -3.86%，同期业绩比较基准增长率为 3.80%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从美国经济分项数据来看，服务业相关的就业情况并没有像近期失业率数据反映的悲观，主要的反复来自于制造业对于库存管理的谨慎态度，日本地震对汽车和电子产品等相关产业链的供应打击。随着日本地震后重建在下半年陆续展开，全球经济预计在今年全年展现前低后高的格局。

虽然二次量化宽松在 6 月份如期结束，美国政府对于刺激经济复苏的决心还是比较明显的。关于提高美国国债上限的讨论将在 8 月份提交结果，5 月份宣布本拉登被击毙为美国加快中东撤军的速度做了铺垫，为美国政府在未来 6 到 12 个月实施积极的财政政策打开了空间。美联储的议息会议纪要表明二次量化宽松结束后将继续保持宽松的货币政策环境，虽然核心通货膨胀率近期有所攀升，但美联储的主要关注点仍然是失业率的改善情况。近期政府促使能源总署 IEA 释放部分原油储备也向市场放出了明确信号，希望从打压油价入手控制通胀预期，从而为维持宽松的货币政策留下时间窗口。同时，美联储开始着手研究前两次量化宽松注入的流动性在银行系统沉淀的庞大超额储备，希望通过利率政策活化流动性，增强货币乘数促进信贷和工商业活动。

在 6 月最后一周希腊债务通过重组方案注入市场一只强心剂，同时对于中国通货膨胀在近期将触顶回落后带来的政策宽松预期升温，市场情绪转好迹象明显。下半年随着经济复苏的重新启动，预计为上游资源类行业、消费相关行业板块、日本复苏带动的 IT 电子类行业带来机会。

4.7 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副总经理（担任估值小组组长）、督察长（担任估值小组组长）及投资管理部、金融工程及量化投资部、研究发展部、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。

本基金未签约与任何估值相关的定价服务。

4.8 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十九条中对基金利润分配原则的约定，本基金于2011年1月13日对2010年度收益进行了分配，分配金额为3,684,366.98元。

本基金截至2011年6月30日，期末可供分配收益为-695,723.84元，未分配收益已实现部分为2,069,625.08元，未分配收益未实现部分为-2,765,348.92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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	11,015,054.26	15,291,408.17
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	43,884,519.66	63,545,669.45
其中：股票投资		43,884,519.66	63,545,669.45
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
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		1,149,821.54	2,635,117.19
应收利息	6.4.7.5	320.46	973.07
应收股利		52,602.08	26,834.13
应收申购款		8,101.80	255,249.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		56,110,419.80	81,755,251.56
负债和所有者权益		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010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		1,787,527.89	-
应付赎回款		79,285.13	540,350.51
应付管理人报酬		79,483.61	126,941.35
应付托管费		13,247.28	21,156.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-

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	163,848.48	62,036.49
负债合计		2,123,392.39	750,485.23
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	54,682,751.25	75,304,253.96
未分配利润	6.4.7.10	-695,723.84	5,700,512.37
所有者权益合计		53,987,027.41	81,004,766.33
负债和所有者权益总计		56,110,419.80	81,755,251.56

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.987 元，基金份额总额 54,682,751.25 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日 至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年5月26日（基 金合同生效日）至 2010年6月30日
一、收入		-992,755.20	-4,155,026.91
1. 利息收入		6,085.14	198,533.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,085.14	198,533.64
债券利息收入		-	-
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）		2,839,002.89	3,072.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,462,981.41	
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	376,021.48	3,072.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	6.4.7.16	-3,846,466.58	-3,883,508.02
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	6.4.7.17	-22,236.03	-473,125.09
5. 其他收入（损失以“-”填列）		30,859.38	-
减：二、费用		1,011,435.10	810,957.55

1. 管理人报酬		590,316.21	586,072.59
2. 托管费		98,386.02	97,678.77
3. 销售服务费	6.4.5.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	154,279.62	95,557.71
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	168,453.25	31,648.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,004,190.30	-4,965,984.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,004,190.30	-4,965,984.46

注：本基金合同生效日为2010年5月26日，截至本报告期末，利润表无完整的可比期间。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年1月1日 至2011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）	75,304,253.96	5,700,512.37	81,004,766.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,004,190.30	-2,004,190.30
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）	-20,621,502.71	-707,678.93	-21,329,181.64
其中：1. 基金申购款	4,069,822.13	91,898.19	4,161,720.32
2. 基金赎回款	-24,691,324.84	-799,577.12	-25,490,901.96
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）	-	-3,684,366.98	-3,684,366.98
五、期末所有者权益（基金净值）	54,682,751.25	-695,723.84	53,987,027.41
项 目	上年度可比期间 2010年5月26日（基金合同生效日）至2010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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,965,984.46	-4,965,984.46
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）	340,041,384.63	-	340,041,384.63

其中：1. 基金申购款	340,041,384.63	-	340,041,384.63
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)	340,041,384.63	-4,965,984.46	335,075,400.17

注：本基金合同生效日为2010年5月26日，截至本报告期末，所有者权益(基金净值)变动表无完整的可比期间。

报表附注为本会计报表的组成部分。

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

戴君棉

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

长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2009]第1501号《关于核准长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币339,898,507.52元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第122号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》于2010年5月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为340,041,384.63份基金份额，其中认购资金利息折合142,877.11份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司，境外投资顾问为高盛资产管理有限责任合伙。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为在全球证券市场公开发行上市的股票、货币市场工具以及

中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中对股票及其他权益类证券投资占本基金基金资产的目标比例为60%-95%，其中投资于业绩比较基准内23个全球发达地区市场大盘类上市公司股票的部分不低于本基金股票资产总额的80%；投资现金、货币市场工具及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产净值的5%-40%。本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index)。

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、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”)、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》和如财务报表附注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。

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2011年6月30日的财务状况以及2011年1月1日至6月30日年度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：本报告期不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明：本报告期不存在会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明：本报告期不存在差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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。

2、基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

3、基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

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 2011年6月30日
活期存款	11,015,054.26
定期存款	-
其他存款	-
合计	11,015,054.26

(a) 货币资金中包括以下外币余额：

	本期末 2011年6月30日		
	外币金额	汇率	折合人民币
美元	867,849.78	6.4716	5,616,376.64
港币	3,204,116.36	0.8316	2,664,607.25
英镑	9,460.36	10.3986	98,374.50
日元	137,533.00	0.0802	11,036.06
欧元	62,177.68	9.3612	582,057.70
加拿大元	75,437.29	6.6923	504,847.58
瑞士法郎	3,412.12	7.7588	26,473.96
人民币	1,511,280.57	1.0000	1,511,280.57
合 计			11,015,054.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	42,403,090.95	43,884,519.66	1,481,428.71
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	42,403,090.95	43,884,519.66	1,481,428.71
----	---------------	---------------	--------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本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 2011年6月30日
应收活期存款利息	320.40
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.06
其他	-
合计	320.46

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	204.57
预提费用	163,643.91
合计	163,848.48

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	75,304,253.96	75,304,253.96

本期申购	4,069,822.13	4,069,822.13
本期赎回(以“-”号填列)	-24,691,324.84	-24,691,324.84
本期末	54,682,751.25	54,682,751.25

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	4,382,773.62	1,317,738.75	5,700,512.37
本期利润	1,842,276.28	-3,846,466.58	-2,004,190.30
本期基金份额交易产生的变动数	-471,057.84	-236,621.09	-707,678.93
其中：基金申购款	94,293.39	-2,395.20	91,898.19
基金赎回款	-565,351.23	-234,225.89	-799,577.12
本期已分配利润	-3,684,366.98	-	-3,684,366.98
本期末	2,069,625.08	-2,765,348.92	-695,723.84

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日
活期存款利息收入	6,069.01
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	-
其他	16.13
合计	6,085.14

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日
卖出股票成交总额	57,880,509.86
减：卖出股票成本总额	55,417,528.45
买卖股票差价收入	2,462,981.41

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本期未取得衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期

	2011年1月1日至 2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	376,021.48
基金投资产生的股利收益	-
合计	376,021.48

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,846,466.58
——股票投资	-3,846,466.58
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-3,846,466.58

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日
基金赎回费收入	30,859.38
其他	-
合计	30,859.38

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日
交易所市场交易费用	154,279.62
银行间市场交易费用	-
合计	154,279.62

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至
----	------------------

	2011年6月30日
信息披露费	133,891.13
审计费用	29,752.78
银行汇划费用	2,051.49
债券托管账户维护费	2,757.85
其他	-
合计	168,453.25

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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（“长盛基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
国元证券经纪（香港）有限公司 （GUOYUAN SECURITIES BROKERAGE（HONG KONG） LIMITED）	基金管理人股东控制的公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日		上年度可比期间 2010年5月26日（基金合同生效日） 至2010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
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	-	-	13,512,999.54	19.50%
国元证券经纪 （香港）有限公 司	5,374,993.23	5.51%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金总额	占期末应付佣金总额的比例
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	-	-	-	-
国元证券经纪（香港）有限公司	5,374.99	5.82%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年5月26日（基金合同生效日）至2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金总额	占期末应付佣金总额的比例
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	20,869.15	37.58%	-	-
国元证券经纪（香港）有限公司	-	-	-	-

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 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年5月26日（基金合同生效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	590,316.21	586,072.59
其中：支付给销售机构的客户维护费	185,277.00	204,402.64

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1.8%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 × 1.8% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年5月26日（基金合同生效日）至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	98,386.02	97,678.77

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.30%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×0.30%/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

本基金本期及上年度可比期间未发生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

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年5月26日至2010 年6月30日
基金合同生效日(2008年6月4日) 持有的基金份额	-	18,003,410.00
期初持有的基金份额	18,003,410.00	-
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	18,003,410.00	18,003,410.00
期末持有的基金份额占基金总份额 比例	32.92%	5.29%

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

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。

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 2011年1月1日至 2011年6月30日		上年度可比期间 2010年5月26日(基金合同生效日)至2010 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
中国银行	1,511,280.57	6,069.01	245,324,844.58	198,533.64
中银香港	9,503,773.69	-	32,547,808.64	-
合计	11,015,054.26	6,069.01	277,872,653.22	198,533.64

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管。其中，中国银行保管部分的资金按适用利率或约定利率计息，中银香港保管部分的资金不计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 与关联方进行的外汇远期交易

本基金本期末未与关联方进行外汇远期交易。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	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	本期利润分配 合计	备注
1	2011-01-13	2011-01-12	0.500	3,423,031.64	261,335.34	3,684,366.98	
合计				3,423,031.64	261,335.34	3,684,366.98	

6.4.12 期末(2011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

本基金本期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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交易中作为抵押的债券。

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

本基金主要投资于全球证券市场。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、基金投资及衍生工具等。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、监察稽核部与金融工程部、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金融工程部负责，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银行及境外资产托管人中银香港，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，在境内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，违约风险发生的可能性很小。

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券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的证券不得超过该证券的10%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金投资于同一机构发行的证券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同一机构发行的具有投票权的证券不得超过该类证券发行总量的 10%。本基金投资于每只境外基金的比例不超过基金资产净值的 20%。本基金所持所有证券和衍生工具均在境内外证券交易所上市或在场外市场交易，因此均能及时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为三个月以内且不计息，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,511,280.57	-	-	9,503,773.69	11,015,054.26
交易性金融资产	-	-	-	43,884,519.66	43,884,519.66
应收证券清算款	-	-	-	1,149,821.54	1,149,821.54
应收利息	-	-	-	320.46	320.46
应收股利	-	-	-	52,602.08	52,602.08
应收申购款	-	-	-	8,101.80	8,101.80
资产总计	1,511,280.57	-	-	54,599,139.23	56,110,419.80
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,787,527.89	1,787,527.89
应付赎回款	-	-	-	79,285.13	79,285.13
应付管理人报酬	-	-	-	79,483.61	79,483.61
应付托管费	-	-	-	13,247.28	13,247.28
其他负债	-	-	-	163,848.48	163,848.48
负债总计	-	-	-	2,123,392.39	2,123,392.39
利率敏感度缺口	1,511,280.57	-	-	52,475,746.84	53,987,027.41
上年度末 2010年12月31日					
	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,296,942.67	-	-	11,994,465.50	15,291,408.17
交易性金融资产	-	-	-	63,545,669.45	63,545,669.45
应收证券清算款	-	-	-	2,635,117.19	2,635,117.19
应收利息	-	-	-	973.07	973.07
应收股利	-	-	-	26,834.13	26,834.13
应收申购款	-	-	-	255,249.55	255,249.55
资产总计	3,296,942.67	-	-	78,458,308.89	81,755,251.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	540,350.51	540,350.51
应付管理人报酬	-	-	-	126,941.35	126,941.35
应付托管费	-	-	-	21,156.88	21,156.88
其他负债	-	-	-	62,036.49	62,036.49
负债总计	-	-	-	750,485.23	750,485.23
利率敏感度缺口	3,296,942.67	-	-	77,707,823.66	81,004,766.33

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大

影响。

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

项目	本期末 2011年6月30日							
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	英镑 折合人民币	日元 折合人民币	欧元 折合人民币	加拿大元 折合人民币	瑞士法郎 折合人民币	合计
以外币计价的资产								
银行存款	5,616,376.64	2,664,607.25	98,374.50	11,036.06	582,057.70	504,847.58	26,473.96	9,503,773.69
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	21,686,176.28	14,465,896.85	2,029,702.73	-	2,805,762.27	1,385,101.52	1,511,880.01	43,884,519.66
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,073,082.42	-	76,739.12	-	1,149,821.54
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	30,232.08	-	-	-	-	-	-	30,232.08
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-
资产合计	27,332,785.00	17,130,504.10	2,128,077.23	1,084,118.48	3,387,819.97	1,966,688.22	1,538,353.97	54,568,346.97
以外币计价的负债								
应付证券清算款	507,714.95	1,279,812.94	-	-	-	-	-	1,787,527.89
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-
负债合计	507,714.95	1,279,812.94	-	-	-	-	-	1,787,527.89
资产负债表外汇风 险敞口净额	26,825,070.05	15,850,691.16	2,128,077.23	1,084,118.48	3,387,819.97	1,966,688.22	1,538,353.97	52,780,819.08

项目	上年度末 2010年12月31日							
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	英镑 折合人民币	欧元 折合人民币	加拿大元 折合人民币	瑞士法郎 折合人民币	新加坡 折合人民币	合计
以外币计价的资产								
银行存款	3,733,554.41	3,158,604.89	3,952,421.12	625,191.93	500,547.78	24,145.37	-	11,994,465.50
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	29,880,304.50	23,480,817.71	668,398.01	3,939,323.59	2,220,537.31	2,483,800.59	872,487.74	63,545,669.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	927,966.30	1,707,150.89	-	-	-	-	-	2,635,117.19
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	21,728.55	5,105.58	-	-	-	-	-	26,834.13
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-
资产合计	34,563,553.76	28,351,679.07	4,620,819.13	4,564,515.52	2,721,085.09	2,507,945.96	872,487.74	78,202,086.27
以外币计价的负债								
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	34,563,553.76	28,351,679.07	4,620,819.13	4,564,515.52	2,721,085.09	2,507,945.96	872,487.74	78,202,086.27

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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：人民币万元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	所有外币相对人民币升值5%	增加约264	增加约324
所有外币相对人民币贬值5%	减少约264	减少约324	

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交易的股票和基金，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，采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的配置策略，在宏观经济与地区经济分析、掌握全球经济趋势的基础上，通过量化分析，确定资产种类与权重，并定期进行回顾和动态调整。本基金将全球股票市场分为成熟市场和新兴市场两类，根据全球经济以及区域化经济发展，结合全球范围的资本流动，确定两类市场具体的资产配置比例并定期进行调整，争取构建具备中长期发展潜力的资产组合。在成熟市场和新兴市场中根据不同国家和地区经济发展及证券市场的发展变化对资产进行国家及区域配置，在不同国家或地区的配置比例上采用“全球资产配置量化”模型进行配置和调整。由于短期市场会受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动，基金经理将根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票和其他权益类投资比例为基金资产的60%-95%，货币市场工具及其他金融工具占基金资产的5%-40%。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 2011年6月30日		上年度末 2010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	43,884,519.66	81.29	63,545,669.45	78.45

产—股票投资				
交易性金融资 产—基金投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	43,884,519.66	81.29	63,545,669.45	78.45

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		
	相关风险变量的变动	对期末基金资产净值的影响金额(万元)	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
分析	1、业绩比较基准上升 5%	增加约 193	于 2010 年 12 月 31 日，本基金运营不满一年，无足够历史数据分析其他价格风险敏感性。
	2、业绩比较基准下降 5%	减少约 193	

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

(1) 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。

(2) 以公允价值计量的金融工具

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)。

于 2011 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 43,884,519.66 元，无属于第二层级和第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级 63,545,669.45 元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

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。

§ 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	43,884,519.66	78.21
	其中：普通股	43,884,519.66	78.21
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,015,054.26	19.63
8	其他各项资产	1,210,845.88	2.16
9	合计	56,110,419.80	100.00

7.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	21,686,176.28	40.17
香港	14,465,896.85	26.80
法国	2,331,336.65	4.32
英国	2,029,702.73	3.76
瑞士	1,511,880.01	2.80
加拿大	1,385,101.52	2.57
德国	474,425.62	0.88

7.3 报告期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
信息技术	9,183,232.40	17.01
金融	6,913,320.81	12.81

能源	6,727,317.71	12.46
非必需消费品	6,590,344.46	12.21
材料	5,943,971.41	11.01
医疗	5,331,191.12	9.87
工业	2,614,670.99	4.84
必需消费品	580,470.76	1.08
合计	43,884,519.66	81.29

注：本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准（GICS）进行行业分类

7.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在证券 市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值 (人民币元)	占基金资产净 值比例 (%)
1	JPMORGAN CHASE & CO	-	JPM US	纽约 证券交易所	美国	9,500	2,516,999.39	4.66
2	APPLE INC	-	AAPL US	纳斯达克 证券交易所	美国	1,000	2,172,321.97	4.02
3	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源有 限公司	135 HK	香港 证券交易所	中国香港	160,000	1,780,332.10	3.30
4	PNC FINANCIAL SERVICE	-	PNC US	纽约 证券交易所	美国	4,000	1,543,088.30	2.86
5	HUA HAN BIO-PHARM ACEUTICAL HOLDING LIMITED	华翰生物制 药控股有限 公司	587 HK	香港 证券交易所	中国香港	788,000	1,428,590.10	2.65
6	BANK OF AMERICA CORP	-	BAC US	纽约 证券交易所	美国	20,000	1,418,574.72	2.63
7	ROYAL DUTCH SHELL PLC	-	RDSB LN	伦敦 证券交易所	英国	6,000	1,387,589.18	2.57
8	VISA INC	-	V US	纽约 证券交易所	美国	2,500	1,363,242.54	2.53
9	CHEVRON CORP	-	CVX US	纽约 证券交易所	美国	2,000	1,331,078.69	2.47
10	GOOGLE INC	-	GOOG US	纳斯达克 证券交易所	美国	400	1,310,835.52	2.43
11	THE UNITED LABORATOR	联邦制药控 股有限公司	3933 HK	香港 证券交易所	中国香港	130,000	1,241,109.69	2.30

	IES HOLDING LIMITED							
12	AMAZON.COM INC	-	AMZN US	纳斯达克 证券交易所	美国	900	1,191,039.74	2.21
13	UNITED PARCEL SERVIC	-	UPS US	纽约 证券交易所	美国	2,500	1,179,934.47	2.19
14	LVMH MOET HENNESSY L	-	MC FP	巴黎 证券交易所	法国	1,000	1,161,724.92	2.15
15	HIDILI INDUSTRY INTL	恒鼎实业国际发展有限公司	1393 HK	香港 证券交易所	中国香港	200,000	1,119,360.52	2.07
16	SCHLUMBERGER LTD	-	SLB US	纽约 证券交易所	美国	2,000	1,118,292.48	2.07
17	TC INTERCONNECT HOLDING	达进精电控股有限公司	515 HK	香港 证券交易所	中国香港	400,000	1,047,841.20	1.94
18	MING FUNG JEWELLERY	明丰珠宝集团有限公司	860 HK	香港 证券交易所	中国香港	1,280,000	1,043,184.13	1.93
19	MONSANTO CO	-	MON US	纽约 证券交易所	美国	2,200	1,032,789.70	1.91
20	SHANGPHARMA CORP	-	SHP US	纽约 证券交易所	美国	14,000	948,607.13	1.76
21	CITIGROUP INC	-	C US	纽约 证券交易所	美国	3,500	943,170.98	1.75
22	PAX GLOBAL TECHNOLOGY LTD	百富环球科技有限公司	327 HK	香港 证券交易所	中国香港	450,000	916,861.05	1.70
23	CF INDUSTRIES HOLDING	-	CF US	纽约 证券交易所	美国	1,000	916,831.57	1.70
24	MERCK & CO. INC.	-	MRK US	纽约 证券交易所	美国	4,000	913,531.06	1.69
25	BARRICK GOLD CORP	-	ABX CN	多伦多 证券交易所	加拿大	3,000	879,165.03	1.63
26	CIE FINANCIERE RICHE	-	CFR VX	瑞士 证券交易所	瑞士	2,000	854,244.02	1.58
27	ANXIN-CHINA	中国安芯控股有限公司	1149 HK	香港 证券交易所	中国香港	540,000	799,353.14	1.48

	HOLDINGS LTD							
28	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技集团有限公司	2382 HK	香港证券交易所	中国香港	450,000	793,365.48	1.47
29	SCHNEIDER ELECTRICS	-	SU FP	巴黎证券交易所	法国	700	754,887.17	1.40
30	CHINA METAL RECYCLING	中国金属再生资源(控股)有限公司	773 HK	香港证券交易所	中国香港	90,000	708,789.73	1.31
31	CHINA AUTOMATION GROUP	中国自动化集团有限公司	569 HK	香港证券交易所	中国香港	150,000	679,849.35	1.26
32	SWATCH GROUP	-	UHR VX	瑞士证券交易所	瑞士	200	657,635.99	1.22
33	JIANGXI COPPER CO LTD	江西铜业股份有限公司	358 HK	香港证券交易所	中国香港	30,000	644,921.31	1.19
34	ANGLO AMERICAN PLC	-	AAL LN	伦敦证券交易所	英国	2,000	642,113.55	1.19
35	ORACLE CORP	-	ORCL US	纳斯达克证券交易所	美国	3,000	638,941.07	1.18
36	JUNIPER NETWORKS INC	-	JNPR US	纽约证券交易所	美国	3,000	611,566.20	1.13
37	CNOOC LTD	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	中国香港	40,000	604,088.77	1.12
38	ZTE CORP-H	中兴通讯有限公司	763 HK	香港证券交易所	中国香港	25,000	586,292.10	1.09
39	YOUYUAN INTERNATIONAL HOLDING	优源控股有限公司	2268 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000	580,470.76	1.08
40	YAHOO! INC	-	YH00 US	纳斯达克证券交易所	美国	5,500	535,330.75	0.99
41	SUNCOR ENERGY INC	-	SU CN	多伦多证券交易所	加拿大	2,000	505,936.49	0.94
42	IND & COMM BK OF CHINA	中国工商银行	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	491,487.42	0.91

43	VOLKSWAGEN AG	-	VOW GR	德意志交易所	德国	400	474,425.62	0.88
44	FAURECIA	-	EO FP	巴黎证券交易所	法国	1,500	414,724.56	0.77

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	YAHOO! INC	YH00 US	1,798,398.20	2.22
2	PNC FINANCIAL SERVICE	PNC US	1,613,675.39	1.99
3	FANUC CORP	6954 JP	1,414,343.64	1.75
4	THE UNITED LABORATOR	3933 HK	1,392,243.56	1.72
5	ROYAL DUTCH SHELL PL	RDSB LN	1,374,499.24	1.70
6	CSR CORP LTD	1766 HK	1,335,914.88	1.65
7	MERCK & CO. INC.	MRK US	1,326,357.60	1.64
8	CHEVRON CORP	CVX US	1,280,567.51	1.58
9	SINO PROSPER STATE	766 HK	1,205,595.86	1.49
10	HUA HAN BIO-PHARMACE	587 HK	1,183,639.81	1.46
11	CHINA NATIONAL MATER	1893 HK	1,161,551.09	1.43
12	ORACLE CORP	ORCL US	1,153,152.27	1.42
13	CIE FINANCIERE RICHE	CFR VX	1,104,373.41	1.36
14	CITIGROUP INC	C US	1,102,343.38	1.36
15	TC INTERCONNECT HOLD	515 HK	1,080,199.38	1.33
16	UNITED CO RUSAL PLC	486 HK	1,078,064.28	1.33
17	SHANGPHARMA CORP	SHP US	1,077,133.71	1.33
18	ANXIN-CHINA HOLDINGS	1149 HK	1,051,389.00	1.30
19	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	955,588.14	1.18
20	CF INDUSTRIES HOLDING	CF US	914,184.93	1.13

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名股票明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	PFIZER INC	PFE US	2,366,315.28	2.92
2	VARIAN MEDICAL SYSTE	VAR US	2,033,358.34	2.51
3	BANK OF NEW YORK MEL	BK US	2,024,217.03	2.50
4	MICROSOFT CORP	MSFT US	2,019,098.34	2.49
5	BOUYGUES SA	EN FP	1,843,278.75	2.28
6	COMBA TELECOM SYSTEM	2342 HK	1,830,204.85	2.26

7	HSBC HOLDINGS PLC	5 HK	1,824,076.76	2.25
8	CREDIT SUISSE GROUP	CSGN VX	1,781,691.05	2.20
9	SIJIA GROUP CO	1863 HK	1,734,846.09	2.14
10	FANUC CORP	6954 JP	1,586,389.07	1.96
11	CSR CORP LTD	1766 HK	1,501,326.21	1.85
12	CHINA YURUN FOOD GRO	1068 HK	1,310,111.88	1.62
13	CHINA SHINWAY PHARM	2877 HK	1,300,876.76	1.61
14	CHINA MENGNIU DAIRY	2319 HK	1,288,168.25	1.59
15	CPMC HOLDINGS LTD	906 HK	1,260,708.53	1.56
16	VEECO INSTRUMENTS INC	VECO US	1,236,123.67	1.53
17	YAHOO! INC	YHOO US	1,232,409.84	1.52
18	SINO BIOPHARMACEUTIC	1177 HK	1,183,710.75	1.46
19	HUABAO INTERNATIONAL	336 HK	1,182,050.65	1.46
20	UNITED CO RUSAL PLC	486 HK	1,146,551.12	1.42

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	39,602,845.24
卖出股票收入（成交）总额	57,880,509.86

注：本表中的买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额均按
 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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本期末未持有债券。

7.7 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

本基金本期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资 明细

本基金本期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生产品投 资明细

本基金本期末未持有金融衍生产品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案

调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

7.11.2 声明基金投资的前十只股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	1,149,821.54
3	应收股利	52,602.08
4	应收利息	320.46
5	应收申购款	8,101.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,210,845.88

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期末前十名股票不存在流通受限情况。

7.11.6 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。

§ 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

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 (%)
5,337	10,245.97	18,398,823.71	33.65	36,283,927.54	66.35

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	446,894.15	0.82

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010年5月26日) 基金份额总额	340,041,384.63
本报告期期初基金份额总额	75,304,253.96
本报告期基金总申购份额	4,069,822.13
减：本报告期基金总赎回份额	24,691,324.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	54,682,751.25

§ 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 2011 年 5 月 14 日发布公告，经长盛基金管理有限公司第五届董事会第十五次会议审议通过，并报中国证监会审核批准，聘任公司副总经理周兵先生担任公司总经理，陈礼华先生不再担任公司总经理。

10.2.2 基金经理的变动情况

本报告期基金经理未发生变动。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

10.3 涉及基金管理人、基金资产、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有限公司，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	
MERRILL LYNCH	1	37,240,535.95	38.20%	28,825.11	31.19%	-
SHENYIN WANGUO SECURITIES (HK) LTD	1	15,127,063.87	15.52%	15,127.07	16.37%	-
CLSA LTD.	1	13,789,765.61	14.15%	17,476.48	18.91%	-
CHINA MERCHANTS SECURITIES (HK) CO. LTD.	1	9,292,079.85	9.53%	9,292.09	10.05%	-
KIM ENG SECURITIES (HONG KONG) LTD	1	7,407,317.34	7.60%	7,407.31	8.01%	-
GUOYUAN SECURITIES BROKERAGE (HONG KONG) LTD	1	5,374,993.23	5.51%	5,374.99	5.82%	-
YUANTA SECURITIES (HONG KONG) COMPANY LTD.	1	4,208,454.59	4.32%	4,208.46	4.55%	-
CITIC SECURITIES BROKERAGE (HK) LTD.	1	3,326,058.00	3.41%	2,993.46	3.24%	-
TAIFOOK SECURITIES COMPANY LTD.	1	1,717,085.66	1.76%	1,717.08	1.86%	-
NOMURA INTERNATIONAL PLC	1	-	-	-	-	-
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	1	-	-	-	-	-
BOCI INTERNATIONAL LTD.	1	-	-	-	-	-
THE ROYAL BANK OF SCOTLAND PLC (HONG KONG) BRANCH	1	-	-	-	-	-
BOCOM INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	1	-	-	-	-	-
UBS SECURITIES ASIA LTD.	1	-	-	-	-	-
KGI ASIA LTD.	1	-	-	-	-	-
MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC	1	-	-	-	-	-
PHILLIP SECURITIES (HONG KONG) COMPANY LTD.	1	-	-	-	-	-
CCB INTERNATIONAL SECURITIES LTD	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

于本报告期本基金租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

注：1、本公司选择境外交易券商的标准

(1) 在评估交易券商的过程中应当考虑以下方面，包括但不限于：财务状况，例如股本金、净资产、总资产等；国际评级机构例如标普、穆迪等发布的信用评级；

(2) 前台业务评估，包括交易执行、客户服务、交易价格、交易量、投资研究、市场信息等；

(3) 后台业务评估，包括交易确认的及时性与准确性，交割的质量、信息反馈的质量评估；

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到所在国家/地区证券监管机构处罚；

(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) 针对新交易券商机构，一律先由投资部门根据试用期评价结果提请公司领导核准后完成开户并列入常用券商机构列表；

(4) 常用券商机构定期由基金经理、研究员、交易员、运营及清算人员根据券商研究服务品质、交易执行能力进行评分进行综合评价；

(5) 本公司每半年对开户券商机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为开户券商的服务不能满足要求，或开户券商违规受到相关市场有关部门的处罚，予以停用该券商的服务并终止开户协议。

3、基金租用证券公司交易单元变更情况

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元

序号	证券公司名称	数量
1	BOCOM INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元：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件如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金招募说明书（更新）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2011-06-28
2	关于长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金节假日暂停申购和赎回业务的公告	同上	2011-05-30
3	长盛基金管理有限公司总经理变更公告	同上	2011-05-14
4	长盛基金管理有限公司关于开通旗下开放式基金在中信证券定期定额投资业务的公告	同上	2011-05-13
5	关于长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金节假日暂停申购和赎回业务的公告	同上	2011-05-10
6	关于长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金节假日暂停申购和赎回业务的公告	同上	2011-04-29
7	关于长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金节假日暂停申购和赎回业务的公告	同上	2011-04-22
8	关于旗下部分基金参与银河证券基金申购业务费率优惠活动的公告	同上	2011-04-12
9	关于开通汇付天下“天天盈”网上直销业务的公告	同上	2011-04-1
10	长盛基金管理有限公司关于由周兵先生代为履行公司总经理职务的公告	同上	2011-03-30
11	关于增加中信证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	同上	2011-03-28
12	关于长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金节假日暂停申购和赎回业务的公告	同上	2011-02-21
13	关于长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金节假日暂停申购和赎回业务的公告	同上	2011-01-17
14	长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金收益分配公告	同上	2011-01-11
15	长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2011-01-5

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛环球景气行业大盘精选股票型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>。