

长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

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。

本基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称：中国银行）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、收益分配情况、财务会计报告和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。

本报告会计期间：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 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	5
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	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	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
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	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6	半年度财务报表（未经审计）	15

6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
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	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
7.6 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	37
7.7 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	37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	37
7.9 投资组合报告附注	37
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末上市基金前十名持有人	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	40
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43

10.8 其他重大事件	45
§ 11 备查文件目录	46
11.1 备查文件目录	46
11.2 存放地点	46
11.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF)
基金简称	长盛同智优势混合 (LOF)
基金主代码	160805
交易代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1月5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	2,642,134,205.76份
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年2月16日
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司，所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	本基金为混合型基金，根据对宏观经济、行业状况、公司成长性及资本市场的判断，综合评价各类资产的风险收益水平，对各类资产采取适度灵活的资产配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益—较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。

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 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

2.5 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(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	54,002,594.34
本期利润	-214,668,710.20
加权平均基金份额本期利润	-0.0786
本期加权平均净值利润率	-8.24%
本期基金份额净值增长率	-7.94%
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	-209,403,182.21
期末可供分配基金份额利润	-0.0793
期末基金资产净值	2,432,731,023.55
期末基金份额净值	0.9207
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	67.56%

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、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为2007年1月5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	2.98%	0.88%	1.02%	0.77%	1.96%	0.11%
过去三个月	-5.13%	0.87%	-3.32%	0.71%	-1.81%	0.16%
过去六个月	-7.94%	1.00%	-0.95%	0.80%	-6.99%	0.20%
过去一年	13.54%	1.13%	13.36%	0.91%	0.18%	0.22%
过去三年	15.69%	1.42%	14.14%	1.31%	1.55%	0.11%
自基金转型日起至今	67.56%	1.70%	43.94%	1.45%	23.62%	0.25%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

基准指数的构建考虑了三个原则：

1、公允性。选择市场认同度比较高的沪深 300 指数和上证国债指数作为计算的基础指数。

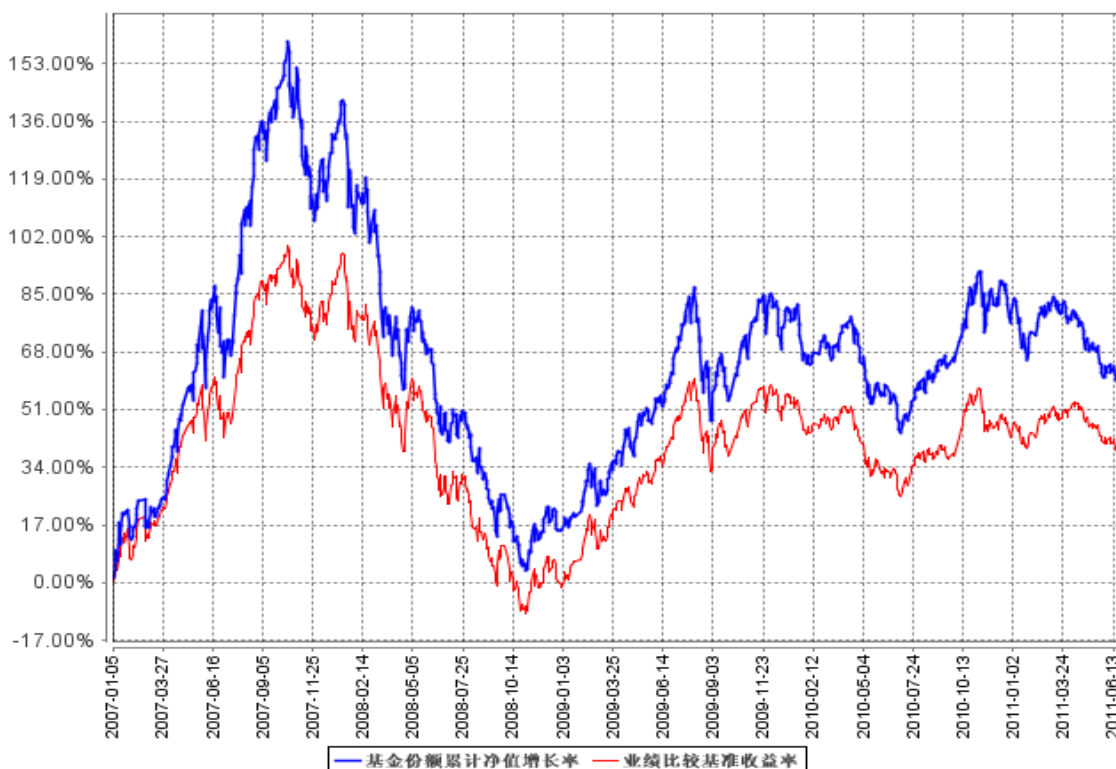
2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金持有的股票投资占基金资产的比例范围为 30%—95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0—3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0—65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。

3、再平衡。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，基准指数每日按照 65%、30%、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

(2007 年 1 月 5 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：本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 日。

§ 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（包括一支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		
丁骏	本基金基金经理，同盛证券投资基金基金经理。	2007年2月27日	—	10年	男，1974年11月出生，中国国籍。中国社会科学院经济学博士。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师；国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理；2003年6月加入长盛基金管理有限公司，先后担任行业研究员、组合经理助理。现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金（本基金）基金经理，同盛证券投资基金基金经理。

注：1、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；

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》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《长

盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，诚实信用、勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础前提下，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

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。

4.3.2 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。

4.3.3 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。

4.4 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

2011 年上半年市场走了一个过山车的行情。年初到 4 月份，上证指数上涨了 14.6%，4 月份到 6 月下旬，市场资金面明显收紧，上证指数又下跌了 15%，随后，在调控政策放松的预期下，市场从底部开始一波反弹。整个上半年，以低市盈率周期股（以水泥为代表的建材股、煤炭股为代表的资源股和家电类股票等），在需求端受益于政策支出保障和供应端行业竞争结构改善的背景下，表现最为优异。

我们上半年根据一贯的投资理念和市场判断对基金投资组合进行了结构性调整：第一、经济结构转型已经正式进入启动阶段，传统人力密集型和资源消耗型的行业和企业将难以为继，保持我国宏观经济健康发展的希望在于技术含量较高的高端装备、与国际技术水平基本处于同一起跑线的新能源及提高装备现代化背景下的军工行业等；第二、结构升级需要相应的配套政策支持，管理层结合政经大环境逐步推出相应的产业指导政策和行业支持政策，也是指明部分投资机会的方向。例如，资源类上市公司的行业整合政策对资源价格、行业结构产生了极其显著的影响。第三、继续综合考虑上市公司业绩预期（宏观经济转型及波动背景下未来业绩的确定性）和考虑资金

松紧水平及变化趋势背景下的相对估值水平等方面。

由此整个上半年的前期（6月中下旬之前），我们在保持仓位相对稳定的前提下，主要增加了机械行业的配置比例。但是下述两个事件对我们的操作形成较大的负面影响：原铁道部长刘志军的落马和日本大地震海啸并导致的核电站事故。这两个事件分别导致了市场对以高铁概念股和核电概念股为代表的机械股的抛售。我们理解市场的逻辑，但是我们认为高铁是我国在“市场换技术”的策略下，引入技术加以消化吸收并进一步自主创新的成功案例，对比汽车和飞机等行业，这是我们能够自主生产并有望走出国门走入发达市场的一个先进技术产业。令人遗憾的是近日温州发生动车组追尾事故，导致了重大的生命财产损失。在事故责任结论落实之前，市场出于对铁路运营效率的失望和高铁建设进度推迟的担心，再次对高铁股进行了抛售。实际上，铁路运营是复杂的系统工程，我们企望铁路部门能够从这次代价高昂的血的教训中吸取经验教训，切实提高高速列车运行的安全性和稳定性。

6月中下旬，市场对宏观调控政策放松的预期再次升温。判断依据是温总理出访欧洲临行之际给《金融时报》发表的文章，文中明确表示中国的通货膨胀将得到牢牢控制。由此，市场乐观认为原先从紧的宏观政策将不会更加严厉，市场估值将得到部分修复。虽然我们认为，考虑到未来7、8月份的CPI指数恐怕不会明显下降，政策力度不会大幅减小，此次反弹不能抱太大预期。但从市场本身而言，大幅下跌之后自身有反弹的动力。因此，我们着重增加了部分基本素质较好、成长性可靠性较高的中小市值股票的配置。此外，我们还增加配置了一些基本面触底反弹的消费品行业类股票。

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0.9207元，本报告期份额净值增长率为-7.94%，同期业绩比较基准增长率为-0.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

影响2011年全年市场表现的最主要因素是通货膨胀的变化趋势及与其对应的宏观调控政策的变化预期。对于6月下旬的反弹行情我们并不算太乐观，“具体的说，市场目前较主流的预期是6月份CPI见顶，然后通胀逐步回落，同时考虑到PMI预示的GDP增速也逐步回落，那么政策放松的空间就相当的大。这种预期的风险之处主要在于通胀的回落态势。根据部分机构的悲观预期，即使CPI在6月见顶之后，整个第3季度的CPI仍然可能维持在6以上。这种情况下，市场已经反弹一个阶段而经济实

际情况虽然在好转却比预期的要逊色一些，那么也许市场会再次回落一个波段。”（本基金 2011 年 2 季度报告）。

我们判断市场在 3 季度仍然保持震荡的格局，较好的市场投资机会估计会在 4 季度出现。那么，在 3 季度的震荡市场行情中，一方面我们要尽力把握波段性投资机会，另一方面也要选择配置素质优秀的个股坚决持有。我们将通过对组合的动态调整来获取超额收益。近期本组合关注的要点是紧密跟踪周期行业的产品价格走势、产能利用率变化等，准备适度适时减持部分涨幅比较大的投资品股票，关注已经下降幅度较大时间较长的消费类公司和部分估值合理的中小盘成长股。在 4 季度行情来临之前，我们要继续紧密跟踪及预判通胀形势的变化，控制仓位，关注具备长期投资价值价值股和进入合理估值区间的成长股，从风格主题上看，包括但不限于：经济结构转型带来的产业升级概念。在国家倡导和鼓励产业升级的背景下，相关节能减排、技术改良类和高端装备制造类企业的投资机会将是长期的。科技创新类股票的投资机会。例如无线互联领域、新能源、生物医药、生物化学及新型农业等等。

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。

4.7 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二十条中对基金利润分配原则的约定，本基金于 2011 年 1 月 17 日对 2010 年度收益进行了利润分配，分配金额为 14,050,041.24 元。

本基金截至 2011 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-209,403,182.21 元，未分配利润已实现部分为 620,913,674.55 元，未分配利润未实现部分为-830,316,856.76 元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）（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合规守信、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的真实、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）、投资组合报告中的数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务报表（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

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	695,674,800.48	620,363,130.07
结算备付金		2,607,304.07	4,245,960.73
存出保证金		1,773,318.35	1,638,549.12
交易性金融资产	6.4.7.2	1,788,991,795.14	2,218,778,576.05
其中：股票投资		1,788,991,795.14	2,210,999,057.05
基金投资		-	-
债券投资		-	7,779,519.00
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		-	9,625,531.70
应收利息	6.4.7.5	123,765.13	137,127.09
应收股利		554,236.20	-
应收申购款		28,119.97	82,354.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,489,753,339.34	2,854,871,228.98
负债和所有者权益	附注号	本期期末 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		47,820,054.64	-
应付赎回款		1,063,213.22	6,741,902.07
应付管理人报酬		2,927,717.83	3,689,997.13
应付托管费		487,952.98	614,999.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,274,719.73	3,805,380.18
应交税费		305,932.19	305,932.19
应付利息		-	-
应付利润		428,798.09	428,798.09

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,713,927.11	1,622,969.78
负债合计		57,022,315.79	17,209,978.97
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,642,134,205.76	2,822,777,253.57
未分配利润	6.4.7.10	-209,403,182.21	14,883,996.44
所有者权益合计		2,432,731,023.55	2,837,661,250.01
负债和所有者权益总计		2,489,753,339.34	2,854,871,228.98

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值：0.9207 元，基金份额总额 2,642,134,205.76 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

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1月1日至2010 年6月30日
一、收入		-187,600,743.38	-567,341,867.50
1. 利息收入		2,801,657.44	3,085,184.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,560,678.88	3,085,184.18
债券利息收入		1,731.94	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		239,246.62	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		78,233,518.13	181,796,472.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	66,728,467.16	175,572,097.88
债券投资收益	6.4.7.13	1,036,037.94	-
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	10,469,013.03	6,224,374.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-268,671,304.54	-752,264,641.36
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	35,385.59	41,117.01
减：二、费用		27,067,966.82	35,206,840.42
1. 管理人报酬	6.4.5.2.1	19,422,609.17	22,568,021.41
2. 托管费	6.4.5.2.2	3,237,101.53	3,761,336.83
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.7.2.18	4,177,898.84	8,654,578.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.7.7.19	230,357.28	222,903.45

三、利润总额		-214,668,710.20	-602,548,707.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-214,668,710.20	-602,548,707.92

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

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）	2,822,777,253.57	14,883,996.44	2,837,661,250.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-214,668,710.20	-214,668,710.20
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）	-180,643,047.81	4,431,572.79	-176,211,475.02
其中：1. 基金申购款	22,867,031.46	-1,311,347.49	21,555,683.97
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-203,510,079.27	5,742,920.28	-197,767,158.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-14,050,041.24	-14,050,041.24
五、期末所有者权益（基金净值）	2,642,134,205.76	-209,403,182.21	2,432,731,023.55
项目	上年度可比期间 2010年1月1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）	3,342,730,432.92	78,464,304.73	3,421,194,737.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-602,548,707.92	-602,548,707.92
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）	-118,354,564.41	3,736,539.13	-114,618,025.28
其中：基金申购款	65,969,591.75	-3,451,110.66	62,518,481.09
基金赎回款（以“-”号填列）	-184,324,156.16	7,187,649.79	-177,136,506.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-75,716,758.74	-75,716,758.74
五、期末所有者权益（基金净值）	3,224,375,868.51	-596,064,622.80	2,628,311,245.71

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

戴君棉

基金管理公司负责人

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

长盛同智优势成长混合型证券投资基金（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[2006]260 号文《关于核准同智证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》批准，由封闭式基金同智证券投资基金转型而成，自 2007 年 1 月 5 日起，《长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金于 2007 年 1 月 22 日（“转换基准日”）的基金净值为人民币 955,116,003.53 元，于 2007 年 1 月 23 日（“转换日”）折合基金份额 955,116,000.00 份。本基金为契约型上市开放式，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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券，权证以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资占基金资产的比例范围为 30%-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。本基金将不低于 80%的股票资产投资于具有较大成长潜力的上市公司的股票。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

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（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《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》和《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编制。

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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 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

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[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。

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；

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，由上市公司、债券发行企业在向基金派发时代扣代缴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。

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	695,674,800.48
定期存款	-
其他存款	-
合计	695,674,800.48

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	1,685,659,587.56	1,788,991,795.14	103,332,207.58
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	1,685,659,587.56	1,788,991,795.14	103,332,207.58

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末（2011年6月30日）未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末（2011年6月30日）买入返售金融资产项目余额为零。

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	122,653.00
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	1,055.97
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.09
其他	56.07
合计	123,765.13

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（2011年6月30日）的其他资产项目余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,274,719.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,274,719.73

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	1,500,000.00
应付赎回费	694.63
预提费用	213,232.48
合计	1,713,927.11

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	2,822,777,253.57	2,822,777,253.57
本期申购	22,867,031.46	22,867,031.46
本期赎回（以“-”号填列）	-203,510,079.27	-203,510,079.27
本期末	2,642,134,205.76	2,642,134,205.76

注：申购含红利再投资。

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	622,700,375.38	-607,816,378.94	14,883,996.44
本期利润	54,002,594.34	-268,671,304.54	-214,668,710.20
本期基金份额交易产生的变动数	-41,739,253.93	46,170,826.72	4,431,572.79
其中：基金申购款	5,163,468.80	-6,474,816.29	-1,311,347.49
基金赎回款	-46,902,722.73	52,645,643.01	5,742,920.28
本期已分配利润	-14,050,041.24	-	-14,050,041.24
本期末	620,913,674.55	-830,316,856.76	-209,403,182.21

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	2,540,561.60
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	19,072.41
其他	1,044.87
合计	2,560,678.88

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	1,452,930,509.08
减：卖出股票成本总额	1,386,202,041.92
买卖股票差价收入	66,728,467.16

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	7,631,646.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,585,000.00
减：应收利息总额	10,608.16
债券投资收益	1,036,037.94

6.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期间（2011年1月1日至2011年6月30日）衍生工具收益——买卖权证差价收入项目金额为零。

6.4.7.15 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	10,469,013.03
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,469,013.03

6.4.7.16 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	-268,671,304.54
——股票投资	-267,476,785.54
——债券投资	-1,194,519.00
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-268,671,304.54

6.4.7.17 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	35,385.59
合计	35,385.59

6.4.7.18 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	4,177,898.84
银行间市场交易费用	-
合计	4,177,898.84

6.4.7.19 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
审计费用	49,040.61
信息披露费	133,891.13
账户维护费	9,000.00
上市年费	29,752.78
汇划手续费	8,672.76
合计	230,357.28

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须做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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
国元证券	基金管理人的股东、基金代销机构

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

金额单位：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1月1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
国元证券	-	-	3,963,019,045.45	73.12%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国元证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国元证券	3,346,040.89	73.72%	3,346,040.89	73.72%

注：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、经手费和适用期内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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。

6.4.10.2 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1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,422,609.17	22,568,021.41
其中：支付给销售机构的客户维护费	3,124,393.67	3,571,308.31

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。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,237,101.53	3,761,336.83

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：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

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

本基金本报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至 2011年6月30日	2010年1月1日至 2010年6月30日
基金合同生效日（2007年1月5日）持有的基金份额	-	-
期初持有基金份额	62,276,368.00	62,276,368.00
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	-	-
期末持有基金份额	62,276,368.00	62,276,368.00
期末持有的基金份额占基金总 份额比例	2.36%	1.93%

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末（2011年6月30日）及上年度可比期末（2010年6月30日）均未持有本基金份额。

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	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年1月1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	695,674,800.48	2,540,561.60	1,071,733,428.82	3,055,517.21

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）及上年度可比期间（2010年1月1日至2010年6月30日）均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

无。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：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
		场内	场外				
1	2011-01-17	201-01-18	2011-01-17	0.0500	7,415,122.41	6,634,918.83	14,050,041.24
合计	-	-	-	0.0500	7,415,122.41	6,634,918.83	14,050,041.24

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

本基金本年末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限证券

本基金本年末未持有暂时停牌等流通受限证券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人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。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注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，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	695,674,800.48	-	-	-	-	-	695,674,800.48
结算备付金	2,607,304.07	-	-	-	-	-	2,607,304.07
存出保证金	138,549.12	-	-	-	-	1,634,769.23	1,773,318.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,788,991,795.14	1,788,991,795.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	123,765.13	123,765.13

应收股利	-	-	-	-	-	554,236.20	554,236.20
应收申购款	-	-	-	-	-	28,119.97	28,119.97
资产总计	698,420,653.67	-	-	-	-	1,791,332,685.67	2,489,753,339.34
负债							
卖出回购金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	47,820,054.64	47,820,054.64
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,063,213.22	1,063,213.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,927,717.83	2,927,717.83
应付托管费	-	-	-	-	-	487,952.98	487,952.98
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,274,719.73	2,274,719.73
应交税费	-	-	-	-	-	305,932.19	305,932.19
应付利润	-	-	-	-	-	428,798.09	428,798.09
其他负债	-	-	-	-	-	1,713,927.11	1,713,927.11
负债总计						57,022,315.79	57,022,315.79
利率敏感度缺口	698,420,653.67	-	-	-	-	1,734,310,369.88	2,432,731,023.55
上年度末 2010年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	620,363,130.07	-	-	-	-	-	620,363,130.07
结算备付金	4,245,960.73	-	-	-	-	-	4,245,960.73
存出保证金	138,549.12	-	-	-	-	1,500,000.00	1,638,549.12
交易性金融资产	-	-	7,779,519.00	-	-	2,210,999,057.05	2,218,778,576.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,625,531.70	9,625,531.70
应收利息	-	-	-	-	-	137,127.09	137,127.09
应收申购款	-	-	-	-	-	82,354.22	82,354.22
资产总计	624,747,639.92	-	7,779,519.00	-	-	2,222,344,070.06	2,854,871,228.98
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,741,902.07	6,741,902.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,689,997.13	3,689,997.13
应付托管费	-	-	-	-	-	614,999.53	614,999.53
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,805,380.18	3,805,380.18
应交税费	-	-	-	-	-	305,932.19	305,932.19
应付利润	-	-	-	-	-	428,798.09	428,798.09
其他负债	-	-	-	-	-	1,622,969.78	1,622,969.78
负债总计						17,209,978.97	17,209,978.97
利率敏感度缺口	624,747,639.92	-	7,779,519.00	-	-	2,205,134,091.09	2,837,661,250.01

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2011年6月30日，本基金未持有固定收益类资产，2010年12月31日，本基金持有的固定收益类资产全部为可转换债券，因此在利率发生的合理、可能的变动幅度为

25个基点而其他变量保持不变时，则本基金资产净值在2011年6月30日和2010年12月31日均不会发生重大变动。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中，股票投资占基金资产的比例范围为 30%—95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0—3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0—65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。于 2011 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

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 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,788,991,795.14	73.54	2,210,999,057.05	77.92
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,788,991,795.14	73.54	2,210,999,057.05	77.92

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

假设	(1) 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变； (2) 用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险； (3) Beta 系数是根据组合在过去一年的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	+5%	154,684,742.00	139,885,348.98
-5%	-154,684,742.00	-139,885,348.98	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至2011年6月30日，本基金并无须作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	1,788,991,795.14	71.85
	其中：股票	1,788,991,795.14	71.85
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	698,282,104.55	28.05
6	其他各项资产	2,479,439.65	0.10
7	合计	2,489,753,339.34	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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	57,699,636.00	2.37
B	采掘业	147,031,167.15	6.04
C	制造业	1,029,269,545.23	42.31
C0	食品、饮料	181,557,533.51	7.46
C1	纺织、服装、皮毛	14,614,501.86	0.60
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	92,261,374.21	3.79
C5	电子	9,882,391.20	0.41
C6	金属、非金属	90,122,344.48	3.70
C7	机械、设备、仪表	438,362,876.83	18.02
C8	医药、生物制品	183,088,689.31	7.53
C99	其他制造业	19,379,833.83	0.80
D	电力、煤气及水的生产和供应业	12,487,914.48	0.51
E	建筑业	41,755,533.85	1.72
F	交通运输、仓储业	75,572,058.40	3.11
G	信息技术业	48,649,601.54	2.00
H	批发和零售贸易	79,599,314.42	3.27
I	金融、保险业	178,732,593.33	7.35
J	房地产业	87,040,753.50	3.58

K	社会服务业	11,104,800.00	0.46
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	20,048,877.24	0.82
	合计	1,788,991,795.14	73.54

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

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	600036	招商银行	11,062,167	144,029,414.34	5.92
2	600518	康美药业	8,779,285	115,535,390.60	4.75
3	601766	中国南车	10,099,928	71,911,487.36	2.96
4	600519	贵州茅台	317,249	67,456,654.87	2.77
5	000400	许继电气	2,041,156	62,888,016.36	2.59
6	000858	五粮液	1,749,942	62,507,928.24	2.57
7	601989	中国重工	4,059,293	55,977,650.47	2.30
8	600354	敦煌种业	1,880,003	45,909,673.26	1.89
9	601699	潞安环能	1,319,610	43,296,404.10	1.78
10	600256	广汇股份	1,804,800	42,918,144.00	1.76
11	600812	华北制药	3,649,957	42,047,504.64	1.73
12	000895	双汇发展	598,429	39,538,204.03	1.63
13	600009	上海机场	3,088,866	39,537,484.80	1.63
14	600125	铁龙物流	3,418,840	36,034,573.60	1.48
15	000792	盐湖股份	605,813	35,742,967.00	1.47
16	601601	中国太保	1,549,941	34,703,178.99	1.43
17	600631	百联股份	2,125,517	31,627,692.96	1.30
18	600150	中国船舶	399,922	29,590,228.78	1.22
19	000012	南玻A	1,790,222	29,538,663.00	1.21
20	000527	美的电器	1,600,000	29,424,000.00	1.21
21	600031	三一重工	1,517,268	27,371,514.72	1.13
22	000651	格力电器	1,100,000	25,850,000.00	1.06
23	600683	京投银泰	3,025,240	25,593,530.40	1.05
24	600284	浦东建设	1,499,915	24,553,608.55	1.01
25	600835	上海机电	1,999,998	23,659,976.34	0.97
26	600581	八一钢铁	1,599,918	23,438,798.70	0.96
27	000937	冀中能源	899,804	22,810,031.40	0.94
28	600858	银座股份	1,107,428	22,635,828.32	0.93
29	002155	辰州矿业	659,514	21,559,512.66	0.89
30	600309	烟台万华	1,127,429	21,094,196.59	0.87
31	600392	太工天成	850,497	20,760,631.77	0.85
32	000550	江铃汽车	788,411	20,711,556.97	0.85
33	000540	中天城投	1,203,414	20,048,877.24	0.82

34	000969	安泰科技	992,311	19,379,833.83	0.80
35	000063	中兴通讯	659,941	18,663,131.48	0.77
36	600208	新湖中宝	2,974,170	18,529,079.10	0.76
37	000528	柳工	792,230	17,928,164.90	0.74
38	600263	路桥建设	1,170,199	17,201,925.30	0.71
39	600141	兴发集团	810,393	16,904,797.98	0.69
40	600859	王府井	413,361	16,522,039.17	0.68
41	002073	软控股份	789,375	16,261,125.00	0.67
42	000968	煤气化	637,848	16,156,689.84	0.66
43	000999	华润三九	890,787	15,989,626.65	0.66
44	600362	江西铜业	440,000	15,593,600.00	0.64
45	002013	中航精机	715,000	14,872,000.00	0.61
46	600884	杉杉股份	799,918	14,614,501.86	0.60
47	601808	中海油服	788,699	14,086,164.14	0.58
48	600967	北方创业	749,851	13,542,309.06	0.56
49	600578	京能热电	1,286,088	12,487,914.48	0.51
50	601168	西部矿业	816,173	12,095,683.86	0.50
51	600559	老白干酒	427,019	12,054,746.37	0.50
52	300143	星河生物	537,618	11,789,962.74	0.48
53	000983	西山煤电	478,952	11,590,638.40	0.48
54	300070	碧水源	277,620	11,104,800.00	0.46
55	300159	新研股份	283,486	9,034,698.82	0.37
56	002024	苏宁电器	688,037	8,813,753.97	0.36
57	300080	新大新材	199,913	8,776,180.70	0.36
58	600585	海螺水泥	294,258	8,168,602.08	0.34
59	000423	东阿阿胶	182,656	7,536,386.56	0.31
60	002158	汉钟精机	338,696	7,519,051.20	0.31
61	000887	中鼎股份	568,112	7,368,412.64	0.30
62	000680	山推股份	389,892	6,858,200.28	0.28
63	600486	扬农化工	300,000	6,522,000.00	0.27
64	002065	东华软件	249,965	5,924,170.50	0.24
65	002185	华天科技	499,990	5,439,891.20	0.22
66	002128	露天煤业	249,933	5,436,042.75	0.22
67	300169	天晟新材	150,000	4,629,000.00	0.19
68	300064	豫金刚石	259,375	4,606,500.00	0.19
69	002308	威创股份	299,879	3,301,667.79	0.14
70	000050	深天马A	300,000	3,252,000.00	0.13
71	002011	盾安环境	147,406	2,047,469.34	0.08
72	300138	晨光生物	70,757	1,979,780.86	0.08
73	300217	东方电热	65,401	1,895,320.98	0.08
74	002484	江海股份	50,000	1,190,500.00	0.05

75	002249	大洋电机	48,005	1,020,106.25	0.04
----	--------	------	--------	--------------	------

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	600284	浦东建设	62,326,777.87	2.20
2	601766	中国南车	59,016,475.00	2.08
3	600256	广汇股份	46,093,387.20	1.62
4	601106	中国一重	44,506,289.20	1.57
5	000792	盐湖股份	44,069,015.82	1.55
6	600585	海螺水泥	42,152,388.15	1.49
7	600518	康美药业	40,551,083.45	1.43
8	600125	铁龙物流	38,520,087.49	1.36
9	601699	潞安环能	38,078,907.25	1.34
10	600036	招商银行	37,944,192.00	1.34
11	600683	京投银泰	35,918,202.19	1.27
12	600100	同方股份	33,396,570.60	1.18
13	601268	二重重装	29,813,021.98	1.05
14	600150	中国船舶	28,406,749.03	1.00
15	600835	上海机电	27,086,907.55	0.95
16	002123	荣信股份	26,916,474.64	0.95
17	600631	百联股份	26,026,950.19	0.92
18	002122	天马股份	25,335,407.48	0.89
19	600858	银座股份	24,291,110.15	0.86
20	000540	中天城投	22,577,279.01	0.80

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	601318	中国平安	90,488,288.06	3.19
2	600089	特变电工	64,676,426.65	2.28
3	002073	软控股份	46,631,308.64	1.64
4	600694	大商股份	45,745,896.75	1.61
5	000050	深天马A	44,910,593.83	1.58
6	002123	荣信股份	43,869,216.30	1.55
7	601808	中海油服	43,867,816.32	1.55
8	000401	冀东水泥	41,288,321.00	1.46
9	600284	浦东建设	40,990,327.89	1.44
10	000680	山推股份	39,497,297.95	1.39

11	600585	海螺水泥	36,782,838.29	1.30
12	000012	南玻A	35,300,852.94	1.24
13	600123	兰花科创	32,885,141.13	1.16
14	000423	东阿阿胶	32,626,770.15	1.15
15	601106	中国一重	32,610,548.38	1.15
16	600100	同方股份	30,808,108.35	1.09
17	600546	山煤国际	30,418,089.31	1.07
18	600655	豫园商城	29,038,636.32	1.02
19	600517	置信电气	27,178,675.46	0.96
20	600739	辽宁成大	27,141,347.55	0.96

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	1,231,671,565.55
卖出股票收入（成交）总额	1,452,930,509.08

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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

根据宜宾五粮液股份有限公司 2011 年 5 月 27 日公告的《关于收到中国证监会行政处罚决定书的公告》显示，公司因违规披露、信息披露不及时、不完整等事项受到中国证监会行政处罚，公司表示接受证监会的行政处罚，吸取教训，不断完善公司治理和合规经营。本基金做出如下说明：

1、对于白酒行业及五粮液，本公司研究员自跟踪研究以来一直看好和积极推荐，

并有相关的研究报告。

2、基于相关研究，本基金判断，随着我国国民收入的提高、城镇化的快速推进，我国白酒行业将继续维持高速增长，作为国内最大的白酒生产企业，高端白酒中的代表性企业之一，五粮液公司的投资价值会得到提升，对于该公司被监管部门处罚的事件，本基金经过认真研究，做出如下判断：公司自 2009 年底以来，对公司治理、信息披露、关联交易进行了很大改进，并使得公司业绩保持了良好的发展势头。公司也在 2011 年 5 月 27 日的公告中，对公司整改情况进行了披露。因此，我们审慎地将五粮液在配置上作为组合的阶段性重要投资品种。

3、今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，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记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.9.2 声明基金投资的前十名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。

7.9.3 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	1,773,318.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	554,236.20
4	应收利息	123,765.13
5	应收申购款	28,119.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,479,439.65

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 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
118,931	22,215.69	2,565,798,731.93	97.11%	76,335,473.83	2.89%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	长盛基金管理有限公司	62,276,368.00	36.06%
2	天津开创投资有限责任公司	1,986,564.00	1.15%
3	张顶康	1,600,000.00	0.93%
4	黄晓峰	709,737.00	0.41%
5	高兆明	577,298.00	0.33%
6	黄带顺	540,000.00	0.31%
7	王明瑞	486,832.00	0.28%
8	陈国光	405,636.00	0.23%
9	陈克明	387,000.00	0.22%
10	王远芳	283,326.00	0.16%

注：持有人为场内持有人。

8.3 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	7,676.85	0.00%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年1月5日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,822,777,253.57
本报告期期间基金总申购份额	22,867,031.46
减：本报告期期间基金总赎回份额	203,510,079.27
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,642,134,205.76

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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

本报告期内本基金投资策略不曾改变。

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安永华明会计师事务所，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	
		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
招商证券	1	-	-	-	-
长江证券	1	115,477,261.55	4.32%	98,156.06	4.39%
中信证券	1	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-
广发证券	1	327,707,645.31	12.26%	278,549.19	12.46%
中信建投	2	323,283,422.03	12.09%	274,790.51	12.29%
申银万国	1	-	-	-	-
国信证券	1	25,034,065.31	0.94%	20,340.19	0.91%
华泰联合	1	185,234,974.47	6.93%	150,504.05	6.73%
中金公司	1	936,734,039.76	35.04%	796,218.58	35.61%
国泰君安	1	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-
安信证券	1	759,986,036.28	28.43%	617,495.10	27.62%

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	交易单元数量	债券交易		债券回购交易	
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交总额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	1	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-
华泰联合	1	-	-	-	-

中金公司	1	7,631,646.10	100%	600,000,000.00	100%
国泰君安	1	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-

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) 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：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元：无。

(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	公告名称/事项	法定披露方式	披露日期
1	关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2011-06-30
2	长盛基金管理有限公司总经理变更公告	同上	2011-05-14
3	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
4	关于旗下部分基金参与银河证券基金申购业务费率优惠的公告	同上	2011-04-12
5	关于开通汇付天下“天天盈”网上直销业务的公告	同上	2011-04-01
6	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
7	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
8	长盛基金管理有限公司关于旗下基金持有的“双汇发展”估值方法调整的公告	同上	2011-03-22
9	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	同上	2011-02-19
10	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）收益分配公告	同上	2011-01-13

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛同智优势成长混合型证券投资基金的批复；
- 2、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同智优势成长混合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及/或管理人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>。