

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行股份有限公司（以下简称：招商银行）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、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 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合规守信情况的说明	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的简要展望	10
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	14

6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	15
6.4	报表附注.....	15
§ 7	投资组合报告.....	30
7.1	期末基金资产组合情况.....	30
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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.....	31
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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... ..	40
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	40
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... ..	40
7.9	投资组合报告附注.....	40
§ 8	基金份额持有人信息.....	42
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2	期末上市基金前十名持有.....	42
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.....	42
§ 9	开放式基金份额变动.....	43
§ 10	重大事件揭示.....	44
10.1	基金份额持有人大会决议.....	44
10.2	本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4	基金投资策略的改变.....	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8	其他重大事件.....	45
§ 11	备查文件目录.....	47

11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	长盛沪深 300 指数 (LOF)
基金主代码	160807
交易代码	160807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 8 月 4 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	213,721,854.86 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 9 月 6 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资，跟踪沪深 300 指数，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%，以实现对其基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4% 的投资目标。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是股票指数型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	叶金松
	联系电话	010-82019988
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666 010-62350088	95555
传真	010-82255988	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100088	518040
法定代表人	凤良志	傅育宁

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	7,558,551.68
本期利润	-1,259,272.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0055
本期加权平均净值利润率	-0.54%
本期基金份额净值增长率	-2.23%
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	-3,358,818.42
期末可供分配基金份额利润	-0.0157
期末基金资产净值	210,363,036.44
期末基金份额净值	0.984
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	3.34%

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	1.76%	1.08%	1.37%	1.13%	0.39%	-0.05%
过去三个月	-4.84%	1.02%	-5.23%	1.04%	0.39%	-0.02%
过去六个月	-2.23%	1.16%	-2.44%	1.17%	0.21%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.34%	1.25%	6.14%	1.33%	-2.80%	-0.08%

注：本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，

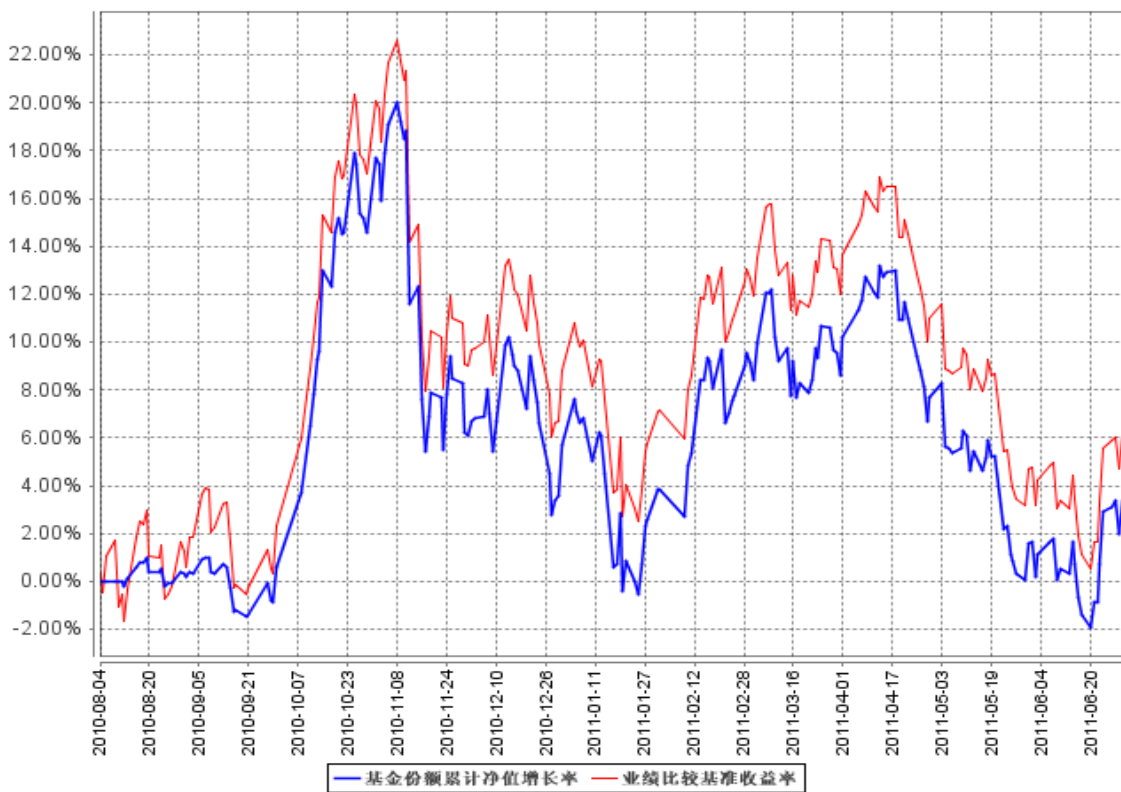
其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

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 95%、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 8 月 4 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：1、本基金合同生效日为 2010 年 8 月 4 日，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十三条（二）投资范围、（七）投资限制的有关约定。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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（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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘斌	本基金基金经理，长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理，金融工程与量化投资部副总监。	2010年8月4日	—	5年	男，1979年6月出生，中国国籍。清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司，在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理等职务，现任金融工程与量化投资部副总监，长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理，长盛沪深300指数证券投资基金（本基金）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合规守信情况的说明

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、《长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，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

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年，经济增长略有放缓，通胀水平持续走高，央行货币政策趋紧，多次调高存款准备金率和加息。A股市场整体下行，钢铁、建材等低估值和政策受益的周期性行业，以及食品饮料、家电等成长性确定的消费类行业跑赢大盘，表现较差的行业是信息设备、信息服务和电子元器件。在风格特征上，大盘股的一年期反转效应非常显著。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

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0.984元，本报告期份额净值增长率为-2.23%，同期业绩比较基准增长率为-2.44%。本报告期内日均跟踪误差为0.0558%，年度化跟踪误差为0.8822%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济增长速度可能回升，并伴随物价指数的冲高回落。A股目前的利润率仍然处于高位，但后期有回落风险。随着IPO市场化的进程，A股各个板块的表现将更多取决于实际经营业绩与预期的对比，而消息面和政策面的影响将逐步减弱。

作为指数基金，我们将继续秉承指数化投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，控制基金的跟踪误差，在此基础上本基金将积极采用数量化投资策略增强指数，力争获取超额收益。

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十七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年度收益进行了分配，分配金额为12,324,172.31元。

本基金截至2011年6月30日，期末可供分配收益为-3,358,818.42元，未分配收益已实现部分为23,679,002.78元，未分配收益未实现部分为-27,037,821.20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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：长盛沪深 300 指数证券投资基金（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	18,326,491.26	15,528,299.09
结算备付金		-	-
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	198,221,088.97	247,936,270.17
其中：股票投资		197,511,123.37	247,885,885.27
基金投资		-	-
债券投资		709,965.60	50,384.90
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		-	15,344,678.23
应收利息	6.4.7.5	4,463.65	3,596.91
应收股利		280,061.04	-
应收申购款		188,342.43	1,205,557.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		217,270,447.35	280,268,401.46
负债和所有者权益	附注号	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		5,559,872.45	-
应付赎回款		191,797.28	16,451,644.80
应付管理人报酬		125,842.69	182,107.81
应付托管费		25,168.52	36,421.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	560,610.54	486,968.95
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	444,119.43	382,003.68
负债合计		6,907,410.91	17,539,146.79
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	213,721,854.86	248,638,296.11
未分配利润	6.4.7.10	-3,358,818.42	14,090,958.56
所有者权益合计		210,363,036.44	262,729,254.67
负债和所有者权益总计		217,270,447.35	280,268,401.46

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值：0.984，基金份额总额：
213,721,854.86 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金（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
一、收入		137,499.82
1. 利息收入		54,974.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	54,029.93
债券利息收入		944.16
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）		8,790,158.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,018,916.02
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	13,689.03
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	1,757,553.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	6.4.7.16	-8,817,824.34
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	6.4.7.17	110,191.14
减：二、费用		1,396,772.48
1. 管理人报酬		875,598.86
2. 托管费		175,119.77
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	159,166.09

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	186, 887. 76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1, 259, 272. 66
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1, 259, 272. 66

注：本基金合同于 2010 年 8 月 4 日生效，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金（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）	248, 638, 296. 11	14, 090, 958. 56	262, 729, 254. 67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1, 259, 272. 66	-1, 259, 272. 66
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）	-34, 916, 441. 25	-3, 866, 332. 01	-38, 782, 773. 26
其中：1. 基金申购款	49, 232, 228. 62	130, 668. 65	49, 362, 897. 27
2. 基金赎回款	-84, 148, 669. 87	-3, 997, 000. 66	-88, 145, 670. 53
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）	-	-12, 324, 172. 31	-12, 324, 172. 31
五、期末所有者权益（基金净值）	213, 721, 854. 86	-3, 358, 818. 42	210, 363, 036. 44

注：本基金合同于 2011 年 8 月 4 日生效，无上年度可比期间。

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

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (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[2010]第 646 号《关于核准长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》核准，由长盛基金管理有限公司依照《中华

《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 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 898,648,405.80 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 193 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2010 年 8 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 898,915,869.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 267,463.53 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，基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第 276 号文审核同意，本基金 112,932,582 份基金份额于 2010 年 9 月 6 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票资产投资比例不低于基金资产净值的 90%，其中，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5%的现金以及到期日在一年以内的政府债券。本基金力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+一年期银行定期存款利率(税后)×5%。本基金标的指数使用费由基金管理人长盛基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

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》、《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》和中国证券监督管理委员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、完整的反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间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一致的说明

本报告所采用的会计政策、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：本报告期不存在会计差错更正。

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[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，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、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- 3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- 4、基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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	18,326,491.26
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计	18,326,491.26

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	190,329,665.67	197,511,123.37	7,181,457.70
债券	交易所市场	656,000.00	709,965.60
	银行间市场	-	-
	合计	656,000.00	709,965.60
资产支持证券	-	-	-
其他	-	-	-
合计	190,985,665.67	198,221,088.97	7,235,423.30

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/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	3,553.66
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	909.94
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.05
其他	-
合计	4,463.65

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

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	560,610.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	560,610.54

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	250,000.00
预提费用	193,396.69
应付赎回费	722.74
合计	444,119.43

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	248,638,296.11	248,638,296.11
本期申购	49,232,228.62	49,232,228.62
本期赎回（以“-”号填列）	-84,148,669.87	-84,148,669.87
本期末	213,721,854.86	213,721,854.86

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	31,593,225.59	-17,502,267.03	14,090,958.56
本期利润	7,558,551.68	-8,817,824.34	-1,259,272.66
本期基金份额交易产生的变动数	-3,148,602.18	-717,729.83	-3,866,332.01
其中：基金申购款	4,472,057.42	-4,341,388.77	130,668.65
基金赎回款	-7,620,659.60	3,623,658.94	-3,997,000.66
本期已分配利润	-12,324,172.31	-	-12,324,172.31
本期末	23,679,002.78	-27,037,821.20	-3,358,818.42

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	53,728.27
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	209.99
其他	91.67
合计	54,029.93

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	68,284,154.07
减：卖出股票成本总额	61,265,238.05
买卖股票差价收入	7,018,916.02

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	116,743.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	103,000.00
减：应收利息总额	54.17
债券投资收益	13,689.03

6.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本期的衍生工具收益——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	1,757,553.88
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,757,553.88

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	-8,817,824.34
——股票投资	-8,862,405.04
——债券投资	44,580.70

——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-8,817,824.34

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	110,191.14
合计	110,191.14

注：本基金的场内赎回费率为0.5%，场外赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.7.18 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	159,166.09
银行间市场交易费用	-
合计	159,166.09

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	19,752.78
信息披露费	133,891.13
上市年费	29,752.78
银行手续费	3,491.07
合计	186,887.76

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”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行	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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国元证券	66,252,151.36	75.65%

注：本基金合同于2010年8月4日生效，无上年度可比期间。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期未通过关联方交易单元发生权证交易。本基金合同于2010年8月4日生效，无上年度可比期间。

6.4.10.1.3 债券交易

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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国元证券	116,743.20	100.00%

注：本基金合同于2010年8月4日生效，无上年度可比期间。

6.4.10.1.4 应支付关联方佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	56,314.69	76.47%	119,592.98	21.33%

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和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。

3、本基金合同于2010年8月4日生效，无上年度可比期间。

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
当期发生的基金应支付的管理费	875,598.86
其中：支付给销售机构的客户维护费	461,898.66

注：1、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0.75%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 × 0.75% / 当年天数。

2、本基金合同于2010年8月4日生效，无上年度可比期间。

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
当期发生的基金应支付的托管费	175,119.77

注：1、支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

2、本基金合同于2010年8月4日生效，无上年度可比期间。

6.4.10.3 关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本期无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金合同于2010年8月4日生效，无上年度可比期间。

6.4.10.4 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

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。本基金合同于2010年8月4日生效，无上年度可比期间。

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

关联方名称	本期	
	2011年1月1日至2011年6月30日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）	5,001,000.00	2.34%

注：本基金合同于2010年8月4日生效，无上年度可比期间。

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	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	18,326,491.26	53,728.27

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。本基金合同于2010年8月4日生效，无上年度可比期间。

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。本基金合同于2010年8月4日生效，无上年度可比期间。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

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	2011-01-18	2011-01-17	0.500	11,393,698.00	930,474.31	12,324,172.31
合计	-	-	-	0.500	11,393,698.00	930,474.31	12,324,172.31

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

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
600170	上海建工	11/06/29	重大事项	15.59	11/07/04	16.25	15,174	207,392.44	236,562.66
600216	浙江医药	11/06/27	重大事项	31.39	11/07/04	32.60	2,777	92,410.55	87,170.03
600369	西南证券	11/03/01	重大事项	11.87	11/08/16	12.49	20,380	261,082.01	241,910.60
000652	泰达股份	10/11/22	重大事项	7.68	11/07/08	7.68	64,696	528,975.32	496,865.28
000876	新希望	11/06/29	重大事项	19.95	11/07/05	21.95	10,921	261,018.29	217,873.95
000959	首钢股份	10/10/29	重大事项	4.42	-	-	74,725	310,640.97	330,284.50
合计								1,661,519.58	1,610,667.02

注：本基金截至2011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。

6.4.12.3 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债的债券。

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债的债券。

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

本基金为抽样复制的指数型基金，采用抽样复制指数的投资策略，跟踪沪深 300 指数。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招商银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，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和债券投资。

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	18,326,491.26	-	-	-	18,326,491.26
存出保证金	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	709,965.60	-	-	197,511,123.37	198,221,088.97
应收利息	-	-	-	4,463.65	4,463.65
应收股利	-	-	-	280,061.04	280,061.04
应收申购款	297.15	-	-	188,045.28	188,342.43
资产总计	19,036,754.01	-	-	198,233,693.34	217,270,447.35
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,559,872.45	5,559,872.45
应付赎回款	-	-	-	191,797.28	191,797.28
应付管理人报酬	-	-	-	125,842.69	125,842.69
应付托管费	-	-	-	25,168.52	25,168.52
应付交易费用	-	-	-	560,610.54	560,610.54
其他负债	-	-	-	444,119.43	444,119.43
负债总计	-	-	-	6,907,410.91	6,907,410.91
利率风险敞口	19,036,754.01	-	-	191,326,282.43	210,363,036.44
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	15,528,299.09	-	-	-	15,528,299.09
存出保证金	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	50,384.90	-	-	247,885,885.27	247,936,270.17
应收证券清算款	-	-	-	15,344,678.23	15,344,678.23
应收利息	-	-	-	3,596.91	3,596.91
应收申购款	-	-	-	1,205,557.06	1,205,557.06
资产总计	15,578,683.99	-	-	264,689,717.47	280,268,401.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,451,644.80	16,451,644.80
应付管理人报酬	-	-	-	182,107.81	182,107.81
应付托管费	-	-	-	36,421.55	36,421.55
应付交易费用	-	-	-	486,968.95	486,968.95
其他负债	-	-	-	382,003.68	382,003.68
负债总计	-	-	-	17,539,146.79	17,539,146.79
利率风险敞口	15,578,683.99	-	-	247,150,570.68	262,729,254.67

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

于2011年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.34%(2010年12月31日：0.02%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2010年12月31日：同)。

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。

本基金采用抽样复制指数的投资策略，股票资产跟踪的标的指数为沪深300指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例占基金资产净值的比例不低于90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的80%。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	占基金资产净值的比例(%)	公允价值	占基金资产净值的比例(%)
交易性金融资产—股票投资	197,511,123.37	93.89	247,885,885.27	94.35
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	197,511,123.37	93.89	247,885,885.27	94.35

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2011年6月30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。

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

(a) 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。

(b) 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为交易性金融资产，其中属于第一层级的余额为196,610,421.95元，属于第二层级的余额为1,610,667.02元，无属于第三层级的余额(2010年12月31日：第一层级245,854,965.33元，第二层级2,081,304.84元，无第三层级。)

对于持有的重大事项停牌股票，本基金根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值转入的层级(2010年度，同)。

(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	197,511,123.37	90.91
	其中：股票	197,511,123.37	90.91
2	固定收益投资	709,965.60	0.33
	其中：债券	709,965.60	0.33
	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	18,326,491.26	8.43
6	其他资产	722,867.12	0.33
7	合计	217,270,447.35	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	717,606.49	0.34
B	采掘业	24,108,785.28	11.46
C	制造业	70,169,059.26	33.36
C0	食品、饮料	11,014,347.47	5.24
C1	纺织、服装、皮毛	740,409.18	0.35
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,040,813.85	2.40
C5	电子	1,475,480.54	0.70
C6	金属、非金属	19,208,380.16	9.13
C7	机械、设备、仪表	24,855,477.97	11.82
C8	医药、生物制品	6,984,683.91	3.32
C99	其他制造业	849,466.18	0.40
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,858,393.43	2.31
E	建筑业	6,888,606.35	3.27
F	交通运输、仓储业	8,434,979.11	4.01
G	信息技术业	6,969,517.61	3.31
H	批发和零售贸易	6,334,815.81	3.01
I	金融、保险业	52,146,726.14	24.79
J	房地产业	10,163,990.84	4.83
K	社会服务业	1,634,571.33	0.78
L	传播与文化产业	241,767.94	0.11
M	综合类	4,842,303.78	2.30

	合计	197,511,123.37	93.89
--	----	----------------	-------

7.2.2 期末积极投资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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

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

7.3.1 期末指数投资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	600016	民生银行	1,161,967	6,658,070.91	3.17
2	601318	中国平安	124,936	6,030,660.72	2.87
3	600000	浦发银行	502,607	4,945,652.88	2.35
4	601166	兴业银行	346,183	4,666,546.84	2.22
5	601328	交通银行	757,906	4,198,799.24	2.00
6	601088	中国神华	125,396	3,779,435.44	1.80

7	600030	中信证券	271,206	3,547,374.48	1.69
8	600519	贵州茅台	14,378	3,057,194.14	1.45
9	000002	万科A	352,204	2,976,123.80	1.41
10	601398	工商银行	593,627	2,647,576.42	1.26
11	000858	五粮液	72,095	2,575,233.40	1.22
12	601601	中国太保	114,483	2,563,274.37	1.22
13	601668	中国建筑	596,760	2,404,942.80	1.14
14	002024	苏宁电器	174,733	2,238,329.73	1.06
15	600104	上海汽车	115,926	2,172,453.24	1.03
16	000063	中兴通讯	73,386	2,075,356.08	0.99
17	600031	三一重工	104,885	1,892,125.40	0.90
18	000001	深发展A	110,273	1,882,360.11	0.89
19	601939	建设银行	375,128	1,853,132.32	0.88
20	600050	中国联通	349,604	1,835,421.00	0.87
21	600585	海螺水泥	65,790	1,826,330.40	0.87
22	600111	包钢稀土	24,711	1,765,106.73	0.84
23	601006	大秦铁路	210,077	1,720,530.63	0.82
24	601169	北京银行	172,247	1,717,302.59	0.82
25	601857	中国石油	148,374	1,615,792.86	0.77
26	000983	西山煤电	64,298	1,556,011.60	0.74
27	600837	海通证券	169,095	1,525,236.90	0.73
28	600028	中国石化	175,231	1,442,151.13	0.69
29	000527	美的电器	78,230	1,438,649.70	0.68
30	600089	特变电工	109,397	1,415,597.18	0.67
31	601899	紫金矿业	188,651	1,365,833.24	0.65
32	600900	长江电力	188,067	1,355,963.07	0.64
33	600048	保利地产	123,033	1,352,132.67	0.64
34	600015	华夏银行	121,884	1,324,879.08	0.63
35	600019	宝钢股份	216,509	1,305,549.27	0.62
36	000568	泸州老窖	28,836	1,301,080.32	0.62
37	000157	中联重科	81,103	1,247,364.14	0.59
38	601989	中国重工	89,920	1,239,996.80	0.59
39	600362	江西铜业	34,186	1,211,551.84	0.58
40	601699	潞安环能	36,856	1,209,245.36	0.57
41	000792	盐湖钾肥	20,468	1,207,612.00	0.57
42	601288	农业银行	408,431	1,143,606.80	0.54
43	601628	中国人寿	59,479	1,115,231.25	0.53
44	601788	光大证券	80,025	1,100,343.75	0.52
45	000338	潍柴动力	23,426	1,064,243.18	0.51
46	600489	中金黄金	38,750	1,057,487.50	0.50
47	600068	葛洲坝	88,001	1,055,131.99	0.50
48	600739	辽宁成大	37,474	1,041,777.20	0.50
49	601168	西部矿业	69,997	1,037,355.54	0.49
50	600795	国电电力	349,340	1,034,046.40	0.49
51	000783	长江证券	95,072	1,023,925.44	0.49
52	000651	格力电器	42,396	996,306.00	0.47

53	600256	广汇股份	41,587	988,938.86	0.47
54	600383	金地集团	147,704	946,782.64	0.45
55	601600	中国铝业	84,604	931,490.04	0.44
56	600690	青岛海尔	33,204	928,051.80	0.44
57	601299	中国北车	137,184	919,132.80	0.44
58	600188	兖州煤业	25,865	913,034.50	0.43
59	000069	华侨城A	115,313	912,125.83	0.43
60	000039	中集集团	41,375	905,285.00	0.43
61	601988	中国银行	286,586	899,880.04	0.43
62	000423	东阿阿胶	21,549	889,111.74	0.42
63	000060	中金岭南	66,740	887,642.00	0.42
64	600010	包钢股份	102,788	858,279.80	0.41
65	600309	烟台万华	44,505	832,688.55	0.40
66	600018	上港集团	212,468	828,625.20	0.39
67	601390	中国中铁	203,260	811,007.40	0.39
68	600348	国阳新能	33,444	807,338.16	0.38
69	601186	中国铁建	131,977	798,460.85	0.38
70	600547	山东黄金	17,530	786,045.20	0.37
71	000709	唐钢股份	170,834	772,169.68	0.37
72	000895	双汇发展	11,644	769,319.08	0.37
73	000009	中国宝安	44,450	765,429.00	0.36
74	601618	中国中冶	192,855	759,848.70	0.36
75	600518	康美药业	57,424	755,699.84	0.36
76	600881	亚泰集团	90,622	754,881.26	0.36
77	601009	南京银行	83,736	751,111.92	0.36
78	601919	中国远洋	90,472	750,012.88	0.36
79	000402	金融街	100,083	747,620.01	0.36
80	601958	金钼股份	38,747	745,879.75	0.35
81	000937	冀中能源	29,392	745,087.20	0.35
82	000528	柳工	32,360	732,306.80	0.35
83	600887	伊利股份	43,688	727,405.20	0.35
84	600005	武钢股份	174,899	725,830.85	0.35
85	601898	中煤能源	72,210	722,100.00	0.34
86	000933	神火股份	45,079	685,651.59	0.33
87	600058	五矿发展	19,881	681,520.68	0.32
88	000768	西飞国际	60,167	662,438.67	0.31
89	601666	平煤股份	46,899	657,054.99	0.31
90	000401	冀东水泥	25,705	642,367.95	0.31
91	000425	徐工机械	25,840	640,573.60	0.30
92	000623	吉林敖东	20,637	635,825.97	0.30
93	600642	申能股份	124,702	632,239.14	0.30
94	601111	中国国航	65,612	629,219.08	0.30
95	000878	云南铜业	28,580	626,187.80	0.30
96	600415	小商品城	50,806	624,405.74	0.30
97	601766	中国南车	85,375	607,870.00	0.29
98	600550	天威保变	33,558	604,379.58	0.29

99	000825	太钢不锈	117,122	603,178.30	0.29
100	600660	福耀玻璃	57,891	599,750.76	0.29
101	600100	同方股份	57,188	598,186.48	0.28
102	002202	金风科技	39,868	595,229.24	0.28
103	600123	兰花科创	13,532	565,366.96	0.27
104	600600	青岛啤酒	16,302	556,550.28	0.26
105	000100	TCL 集团	186,084	556,391.16	0.26
106	600832	东方明珠	71,615	555,016.25	0.26
107	600320	振华重工	82,944	551,577.60	0.26
108	000422	湖北宜化	26,066	545,561.38	0.26
109	000758	中色股份	15,408	544,672.80	0.26
110	000960	锡业股份	18,559	540,066.90	0.26
111	002142	宁波银行	49,533	538,919.04	0.26
112	601607	上海医药	31,907	536,037.60	0.25
113	600583	海油工程	82,631	530,491.02	0.25
114	000898	鞍钢股份	76,280	518,704.00	0.25
115	600655	豫园商城	47,468	516,451.84	0.25
116	000012	南玻A	31,262	515,823.00	0.25
117	600143	金发科技	31,233	514,095.18	0.24
118	600664	哈药股份	32,713	513,594.10	0.24
119	000652	泰达股份	64,696	496,865.28	0.24
120	600177	雅戈尔	49,714	490,677.18	0.23
121	000729	燕京啤酒	28,199	478,537.03	0.23
122	600741	华域汽车	42,920	477,699.60	0.23
123	000024	招商地产	26,018	476,129.40	0.23
124	600694	大商股份	12,114	463,118.22	0.22
125	601001	大同煤业	27,204	462,468.00	0.22
126	600875	东方电气	18,068	460,734.00	0.22
127	600276	恒瑞医药	15,313	458,930.61	0.22
128	000778	新兴铸管	43,220	455,971.00	0.22
129	000800	一汽轿车	31,682	448,617.12	0.21
130	600153	建发股份	50,154	446,370.60	0.21
131	600271	航天信息	17,273	446,334.32	0.21
132	000059	辽通化工	32,580	442,436.40	0.21
133	600009	上海机场	34,406	440,396.80	0.21
134	600316	洪都航空	13,656	440,132.88	0.21
135	601333	广深铁路	105,397	433,181.67	0.21
136	600219	南山铝业	45,323	426,489.43	0.20
137	600196	复星医药	38,265	416,323.20	0.20
138	002155	辰州矿业	12,697	415,064.93	0.20
139	000538	云南白药	7,167	409,092.36	0.19
140	000061	农产品	25,409	405,527.64	0.19
141	000839	中信国安	38,843	404,355.63	0.19
142	600997	开滦股份	25,154	401,457.84	0.19
143	000680	山推股份	22,594	397,428.46	0.19
144	600132	重庆啤酒	6,916	396,978.40	0.19

145	600352	浙江龙盛	41,367	396,295.86	0.19
146	600066	宇通客车	16,950	392,223.00	0.19
147	600497	驰宏锌锗	17,751	391,409.55	0.19
148	601998	中信银行	82,262	390,744.50	0.19
149	000969	安泰科技	19,978	390,170.34	0.19
150	600598	北大荒	26,541	371,574.00	0.18
151	600331	宏达股份	27,856	370,763.36	0.18
152	600406	国电南瑞	10,207	370,514.10	0.18
153	600125	铁龙物流	34,898	367,824.92	0.17
154	600169	太原重工	36,196	367,389.40	0.17
155	000562	宏源证券	21,922	366,316.62	0.17
156	600150	中国船舶	4,946	365,954.54	0.17
157	600812	华北制药	31,386	361,566.72	0.17
158	600649	城投控股	44,451	360,942.12	0.17
159	600208	新湖中宝	57,299	356,972.77	0.17
160	600085	同仁堂	9,839	350,858.74	0.17
161	600418	江淮汽车	31,379	348,620.69	0.17
162	601106	中国一重	71,757	348,021.45	0.17
163	600108	亚盛集团	57,007	346,032.49	0.16
164	600115	东方航空	64,019	332,898.80	0.16
165	000959	首钢股份	74,725	330,284.50	0.16
166	601117	中国化学	37,194	329,538.84	0.16
167	600811	东方集团	47,826	329,042.88	0.16
168	600516	方大炭素	24,848	326,254.24	0.16
169	002001	新和成	10,973	323,154.85	0.15
170	601101	昊华能源	5,092	321,356.12	0.15
171	600221	海南航空	44,533	317,965.62	0.15
172	600062	双鹤药业	12,778	316,766.62	0.15
173	600588	用友软件	15,182	313,660.12	0.15
174	601866	中海集运	85,937	312,810.68	0.15
175	600839	四川长虹	93,135	311,070.90	0.15
176	600808	马钢股份	89,166	310,297.68	0.15
177	600601	方正科技	86,065	308,112.70	0.15
178	600879	航天电子	24,837	302,017.92	0.14
179	600595	中孚实业	29,850	299,694.00	0.14
180	600118	中国卫星	13,233	296,551.53	0.14
181	601158	重庆水务	35,739	295,204.14	0.14
182	600432	吉恩镍业	13,154	293,071.12	0.14
183	600635	大众公用	49,135	289,896.50	0.14
184	600779	水井坊	12,881	288,792.02	0.14
185	601688	华泰证券	23,293	287,668.55	0.14
186	002092	中泰化学	21,899	287,314.88	0.14
187	000807	云铝股份	26,539	285,559.64	0.14
188	600029	南方航空	35,557	278,766.88	0.13
189	600500	中化国际	27,402	273,745.98	0.13
190	000612	焦作万方	15,327	273,433.68	0.13

191	002146	荣盛发展	27,673	271,195.40	0.13
192	600631	百联股份	18,009	267,973.92	0.13
193	000999	三九医药	14,772	265,157.40	0.13
194	600508	上海能源	10,774	262,562.38	0.12
195	600895	张江高科	27,698	261,469.12	0.12
196	000968	煤气化	10,223	258,948.59	0.12
197	000725	京东方A	94,218	257,215.14	0.12
198	600210	紫江企业	42,812	256,872.00	0.12
199	600717	天津港	31,144	254,757.92	0.12
200	600675	中华企业	36,921	251,062.80	0.12
201	600266	北京城建	16,619	250,115.95	0.12
202	600220	江苏阳光	49,550	249,732.00	0.12
203	600312	平高电气	24,369	247,345.35	0.12
204	600582	天地科技	10,942	242,255.88	0.12
205	000625	长安汽车	26,445	241,971.75	0.12
206	600369	西南证券	20,380	241,910.60	0.12
207	600037	歌华有线	23,726	241,767.94	0.11
208	601918	国投新集	19,849	241,363.84	0.11
209	000686	东北证券	11,987	240,938.70	0.11
210	000780	平庄能源	15,108	240,217.20	0.11
211	000027	深圳能源	31,650	238,641.00	0.11
212	002128	露天煤业	10,898	237,031.50	0.11
213	600804	鹏博士	30,014	236,810.46	0.11
214	600170	上海建工	15,174	236,562.66	0.11
215	600528	中铁二局	27,175	236,150.75	0.11
216	000690	宝新能源	46,739	234,629.78	0.11
217	600428	中远航运	32,417	234,050.74	0.11
218	600008	首创股份	41,137	232,835.42	0.11
219	600456	宝钛股份	8,013	231,255.18	0.11
220	002122	天马股份	18,020	230,656.00	0.11
221	002422	科伦药业	3,907	230,513.00	0.11
222	600096	云天化	11,491	228,555.99	0.11
223	600166	福田汽车	26,292	228,214.56	0.11
224	000046	泛海建设	25,596	224,732.88	0.11
225	002007	华兰生物	6,545	222,137.30	0.11
226	600663	陆家嘴	15,601	218,101.98	0.10
227	000876	新希望	10,921	217,873.95	0.10
228	600481	双良节能	15,066	217,854.36	0.10
229	600017	日照港	52,098	216,727.68	0.10
230	601818	光大银行	64,469	215,971.15	0.10
231	600674	川投能源	14,950	214,383.00	0.10
232	000021	长城开发	25,710	212,878.80	0.10
233	600269	赣粤高速	44,986	211,884.06	0.10
234	600395	盘江股份	6,283	208,532.77	0.10
235	000951	中国重汽	11,091	204,961.68	0.10
236	000718	苏宁环球	25,389	203,112.00	0.10

237	600863	内蒙华电	22,864	202,575.04	0.10
238	600549	厦门钨业	4,887	202,468.41	0.10
239	601727	上海电气	29,252	202,423.84	0.10
240	000667	名流置业	67,670	202,333.30	0.10
241	600737	中粮屯河	19,663	201,545.75	0.10
242	601179	中国西电	32,853	200,403.30	0.10
243	600026	中海发展	23,708	200,095.52	0.10
244	600970	中材国际	7,277	198,880.41	0.09
245	600183	生益科技	21,659	198,829.62	0.09
246	600380	健康元	21,055	193,916.55	0.09
247	600151	航天机电	16,737	192,977.61	0.09
248	000031	中粮地产	33,712	192,832.64	0.09
249	600823	世茂股份	13,098	191,623.74	0.09
250	600087	长航油运	65,043	189,275.13	0.09
251	600596	新安股份	17,963	188,970.76	0.09
252	002244	滨江集团	15,162	186,492.60	0.09
253	600033	福建高速	52,603	170,433.72	0.08
254	000900	现代投资	10,419	169,829.70	0.08
255	600517	置信电气	13,927	168,098.89	0.08
256	600307	酒钢宏兴	30,570	167,523.60	0.08
257	600718	东软集团	14,454	164,486.52	0.08
258	600109	国金证券	11,240	163,542.00	0.08
259	600161	天坛生物	9,646	163,499.70	0.08
260	600300	维维股份	31,325	161,323.75	0.08
261	600611	大众交通	23,334	160,071.24	0.08
262	002399	海普瑞	4,105	158,904.55	0.08
263	600376	首开股份	11,622	153,526.62	0.07
264	002415	海康威视	3,868	151,973.72	0.07
265	601808	中海油服	8,046	143,701.56	0.07
266	000961	中南建设	13,046	137,504.84	0.07
267	600006	东风汽车	31,299	137,089.62	0.07
268	601268	二重重装	12,625	136,855.00	0.07
269	601107	四川成渝	24,280	136,453.60	0.06
270	600004	白云机场	17,134	135,187.26	0.06
271	002028	思源电气	9,853	134,887.57	0.06
272	601369	陕鼓动力	11,708	128,436.76	0.06
273	000927	一汽夏利	17,698	124,947.88	0.06
274	600597	光明乳业	15,685	124,382.05	0.06
275	600748	上实发展	15,949	115,470.76	0.05
276	002405	四维图新	3,570	111,205.50	0.05
277	000685	中山公用	6,675	111,072.00	0.05
278	002242	九阳股份	8,827	110,337.50	0.05
279	600657	信达地产	17,081	108,805.97	0.05
280	601099	太平洋	11,226	105,748.92	0.05
281	600350	山东高速	25,133	104,050.62	0.05
282	601139	深圳燃气	9,339	97,872.72	0.05

283	002385	大北农	2,991	96,908.40	0.05
284	600216	浙江医药	2,777	87,170.03	0.04
285	600703	三安光电	4,520	74,128.00	0.04
286	600809	山西汾酒	874	61,223.70	0.03
287	601877	正泰电器	2,969	51,452.77	0.02
288	600535	天士力	476	19,577.88	0.01

7.3.2 期末积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	占期末基金资产净值 比例 (%)
1	601668	中国建筑	2,676,304.00	1.02
2	600016	民生银行	2,517,936.00	0.96
3	601788	光大证券	1,059,771.00	0.40
4	000895	双汇发展	1,033,854.38	0.39
5	601166	兴业银行	850,926.00	0.32
6	601318	中国平安	459,033.00	0.17
7	600518	康美药业	232,779.32	0.09
8	601088	中国神华	219,100.00	0.08
9	600030	中信证券	213,293.00	0.08
10	600005	武钢股份	203,532.30	0.08
11	600519	贵州茅台	178,733.00	0.07
12	000858	五粮液	154,806.00	0.06
13	000338	潍柴动力	138,940.00	0.05
14	002024	苏宁电器	135,868.00	0.05
15	600795	国电电力	127,174.00	0.05
16	600104	上海汽车	126,253.20	0.05
17	000063	中兴通讯	123,935.00	0.05
18	600177	雅戈尔	121,122.00	0.05
19	600143	金发科技	120,975.20	0.05
20	600050	中国联通	118,931.00	0.05

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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	4,237,770.99	1.61
2	601318	中国平安	2,969,974.59	1.13
3	601166	兴业银行	1,567,332.49	0.60
4	600000	浦发银行	1,519,708.54	0.58
5	000651	格力电器	1,430,625.01	0.54
6	601328	交通银行	1,251,375.30	0.48
7	601088	中国神华	972,035.60	0.37
8	600030	中信证券	932,210.21	0.35
9	000002	万科A	864,788.87	0.33
10	601601	中国太保	757,318.00	0.29
11	601398	工商银行	749,195.89	0.29
12	600519	贵州茅台	697,632.57	0.27
13	600111	包钢稀土	648,574.22	0.25
14	000858	五粮液	634,895.22	0.24
15	002024	苏宁电器	630,934.43	0.24
16	000338	潍柴动力	626,390.07	0.24
17	000063	中兴通讯	591,589.45	0.23
18	601169	北京银行	587,913.58	0.22
19	600256	广汇股份	577,632.09	0.22
20	601668	中国建筑	565,564.01	0.22

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	19,752,881.19
卖出股票收入（成交）总额	68,284,154.07

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债	709,965.60	0.34
8	其他	-	-
9	合计	709,965.60	0.34

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	6,200	668,670.00	0.32
2	110016	川投转债	360	41,295.60	0.02

注：本基金本报告期末仅持有上述两支债券。

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。

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，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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	280,061.04
4	应收利息	4,463.65
5	应收申购款	188,342.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	722,867.12

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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
10,357	20,635.50	206,731,453.29	96.73%	6,990,401.57	3.27%

8.2 期末上市基金前十名持有

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	国元证券股份有限公司	5,001,000.00	36.82%
2	黄常跃	1,000,080.00	7.36%
3	杨静芳	990,049.00	7.29%
4	侯羿	300,018.00	2.21%
5	田兵	300,015.00	2.21%
6	王顺体	200,016.00	1.47%
7	李艳萍	198,159.00	1.46%
8	莫作钦	178,243.00	1.31%
9	刘莹	172,804.00	1.27%
10	陈放	158,443.00	1.17%

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	351,614.40	0.16%

§ 9 开放式基金份额变动

份额单位：份

基金合同生效日（2010年8月4日）基金份额总额	898,915,869.33
本报告期期初基金份额总额	248,638,296.11
本报告期基金总申购份额	49,232,228.62
减：本报告期基金总赎回份额	84,148,669.87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	213,721,854.86

§ 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 本报告期内基金管理人、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

本基金托管人招商银行股份有限公司基金托管部原总经理夏博辉先生已调离招商银行股份有限公司，根据招银发[2011]311 号文，夏博辉先生不再担任招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理职务，聘任吴晓辉先生担任总行资产托管部总经理。

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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		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	成交金额	占当期债券成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
联合证券	1	-	-	-	-	-	-
招商证券	1	21,325,456.32	24.35%	-	-	17,326.90	23.53%

国元证券	1	66,252,151.36	75.65%	116,743.20	100.00%	56,314.69	76.47%
------	---	---------------	--------	------------	---------	-----------	--------

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：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	长盛基金管理有限公司总经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2011-05-14
2	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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)	同上	2011-03-18
9	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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沪深 300 指数证券投资基金（LOF）的批复；

2、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）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>。