

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

2011 年半年度报告 摘要

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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	张燕
	联系电话	010-82019988	0755-83199084
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95555
传真		010-82255988	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§ 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

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%

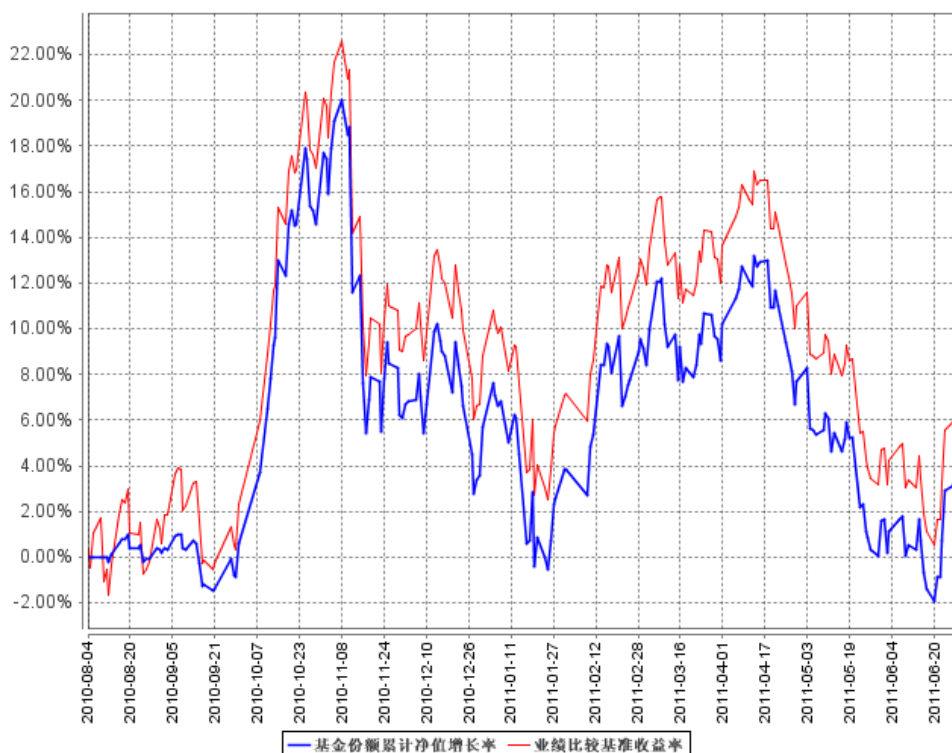
注：本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。

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

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《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，在认真控制投资风

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 报告期内本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等的简要展望

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 托管人对半年度报告中财务信息等信息的真实、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 半年度财务报表（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	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	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	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	15,344,678.23
应收利息	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	-	-
资产总计	217,270,447.35	280,268,401.46
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	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	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	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	213,721,854.86	248,638,296.11
未分配利润	-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	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	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	7,018,916.02	
基金投资收益	-	
债券投资收益	13,689.03	
资产支持证券投资收益	-	
衍生工具收益	-	
股利收益	1,757,553.88	
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-8,817,824.34	
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	-	
5. 其他收入（损失以“-”填列）	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	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	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 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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明：本报告期不存在会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明：本报告期不存在会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明：本报告期不存在会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 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。

6.4.4.1.2 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。

6.4.4.1.3 债券交易

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。

6.4.4.1.4 应支付关联方的佣金

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 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。

6.4.4.2.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本期末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。

6.4.4.4.2 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	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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期末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。

6.4.4.7 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。

6.4.5 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 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。

6.4.5.3.2 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。

6.4.6 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前十名股票投资明细

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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.csfunds.com.cn> 网站的半年度报告正文。

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前五名股票投资明细

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	占期初基金资产净值比例 (%)
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	占期初基金资产净值比例 (%)
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前十名资产支持证券投资 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人

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

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 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位的变更情况：无。