

长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

2009 年半年度报告

2009 年 06 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：2009 年 08 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 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 2009 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
§ 2 基金简介	3
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
§ 4 管理人报告	8
§ 5 托管人报告	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
§ 7 投资组合报告	30
§ 8 基金份额持有人信息	39
§ 9 开放式基金份额变动	39
§ 10 重大事件揭示	40
§ 11 备查文件目录	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长盛创新先锋混合
交易代码	080002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月4日
报告期末基金份额总额	196,708,764.58份

2.2 基金产品说明

投资目标	选择具有创新能力和行业领先的上市公司，分享企业高速增长成果，在承担适度风险的基础上，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金为混合型证券投资基金，在资产配置上会考虑宏观经济因素、政策因素及市场估值水平。在个股选择上将根据不同行业景气度、“长盛创新选股体系”和“长盛优势选股体系”的股票筛选原则和方法优化个股投资比重。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金强调精选投资价值较大的创新领先企业，突出资产配置的灵活性和主动性，风险收益略低于股票型基金，高于债券型基金和平衡型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	叶金松	宁敏
	联系电话	010-82255818	010-66594977
	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	北京市西城区复兴门内大街 1

	号城建大厦 A 座 20-22 层	号
邮政编码	100088	100818
法定代表人	陈平	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	基金管理人的办公地址和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	长盛基金管理有限公司
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

§ 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(2009年01月01日-2009年06月30日)
本期已实现收益	91,932,685.16
本期利润	117,313,886.02
加权平均基金份额本期利润	0.3836
本期加权平均净值利润率	37.36%
本期基金份额净值增长率	41.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2009年01月01日-2009年06月30日)
期末可供分配利润	13,937,291.22
期末可供分配基金份额利润	0.0709
期末基金资产净值	214,394,951.92
期末基金份额净值	1.0899
3.1.3 累计期末指标	报告期(2009年01月01日-2009年06月30日)
基金份额累计净值增长率	22.15%

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	5.17%	0.96%	9.33%	0.79%	-4.16%	0.17%
过去三个月	15.77%	1.41%	16.70%	1.01%	-0.93%	0.40%
过去六个月	41.31%	1.55%	44.26%	1.27%	-2.95%	0.28%
过去一年	22.11%	1.30%	13.23%	1.67%	8.88%	-0.37%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	22.15%	1.26%	-4.01%	1.73%	26.16%	-0.47%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

业绩比较基准 = 沪深 300 指数 × 65% + 上证国债指数 × 35%

本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用上证国债指数。

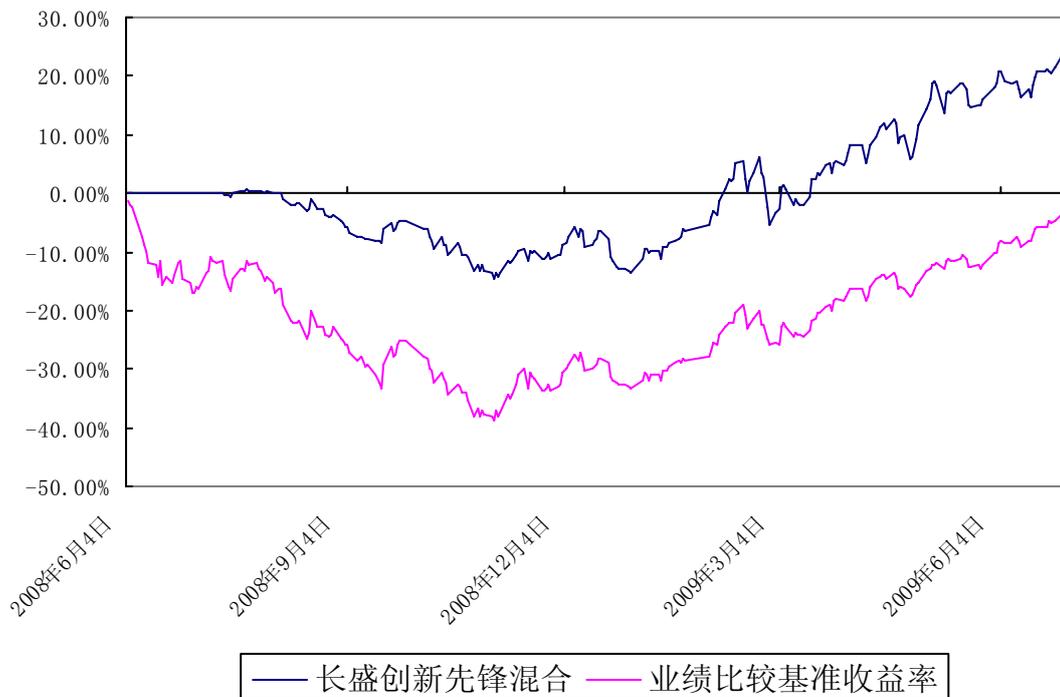
沪深 300 指数是沪深证券交易所联合发布的反映 A 股市场整体走势的成份股指数，由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成，样本覆盖了沪深市场约六成的市值，具有良好的市场代表性。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准，较为合适。

本基金的股票资产占基金资产的 30%-80%。在正常的市场情况下，基金的平均股票仓位约为 65%，所以，业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

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%、35%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

(2008 年 6 月 4 日至 2009 年 6 月 30 日)



注：按照基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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十四条（二）投资范围、（七）投资禁止行为与限制的有关约定。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2009年6月30日，基金管理人共管理两支封闭式基金、十支开放式基金，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		
肖强	本基金基金经理。	2008年6月4日	—	16年	男，1967年12月出生，中国国籍。毕业于中国人民公安大学，获学士学位。历任中信证券股份有限公司北太平庄营业部总经理助理；中信证券股份有限公司研究咨询部副总经理、高级分析师；中信证券股份有限公司交易部高级交易员。2002年6月加入长盛基金管理有限公司，历任基金同盛基金经理助理、基金同益基金经理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、基金同智基金经理，投资管理部副总监，长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理等职务。现任长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理。
邓永明	本基金基金经理，长盛动态精选证券投资基金基金经理。	2008年6月4日	—	10年	男，1971年7月出生，中国国籍。毕业于山西农业大学，获学士学位。1999年4月到2005年7月就职于大成基金管理有限公司，曾任职研究员、交易员和基金经

					理助理。2005年7月底加入长盛基金管理有限公司投资管理部，曾任基金同益基金经理助理，同德证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。现任长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛动态精选证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期、离任日期均指公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 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 报告期内行情回顾和本基金投资策略分析

2009年上半年，在全球中央银行为挽救经济而大规模释放流动性条件下，中国经济率先见底回升。全球资本市场的投资者历经从极度悲观到相对乐观的嬗变，在充足

流动性不断进入市场的作用下，在上市公司业绩会逐步回稳的预期中，包括中国在内的主要经济体股票市场都走出了持续上升态势。

4.4.2 本基金业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.0899元，本报告期份额净值增长率为41.31%，同期业绩比较基准增长率为44.26%。

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

4.5.1 管理人对宏观经济和证券市场的展望

目前，全球主要经济体中，中国复苏的最为明显，而美国和欧盟等还是没有见到明确的复苏信号。即便是中国政府也担心经济复苏会出现反复，因此不愿过早地改变始自去年全球金融、经济危机爆发时而采取的较为宽松的政策导向。

我们相信短期内，各国央行们还没有理由改变定量宽松的货币政策和刺激性财政政策，因为过早的未雨绸缪的行动可能是带来功亏一篑的结果。因此我们相信市场的流动性还会推动股市保持既定的趋势。但随着市场估值水平的提高和场内获利筹码的堆积，2009年下半年市场可能呈现宽幅振荡走势。

中国股市股改三年以来，已经基本形成了一个全流通的市场，越来越多的产业资本开始进入这个市场。在未来的投资活动中，市场会更多地以产业资本的标准和眼光给上市公司定价，我们必须不断学习、提高自己的投资技能，从中找到投资标的和机会。尤其是越来越多的国有大型企业正在通过这个市场进行兼并、收购、重组，上市公司凤凰涅槃式的变化方兴未艾，我们认为这将是下半年的一个重要投资主线。

4.5.2 本基金下阶段投资策略

未来一个季度，我们将继续保持较高的仓位，减少时机选择的操作。在大盘风险逐步积累的过程中，努力调整组合结构，在风格资产上更多地强调买入低PE、PB类的股票，在投资主题上坚持超配与经济复苏密切相关的资源类行业、中游制造行业、大金融行业（包括银行、保险和证券）、地产行业等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、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》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉有关衔接事宜的通知》（证监会计字[2007]15号）、《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》(证监会计字[2007]21号)与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2008]38号)等文件,本公司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,采取多种方式减少或避免估值偏差的发生。

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。

基金管理人设立基金估值小组时充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性,人员构成如下:

人员	职务	职责
杨思乐	长盛基金管理有限公司副总经理	长盛基金估值小组组长;领导、统筹估值小组工作,完成基金资产估值。
叶金松	长盛基金管理有限公司督察长	长盛基金估值小组组长;领导、统筹估值小组工作,完成基金资产估值。
白仲光	金融工程部总监,长盛中证100指数证券投资基金基金经理	出具估值时所采用的估值模型、假设、参数。
李庆林	研究发展部副总监	出具估值时所采用的假设、判定依据。
詹凌蔚	总经理助理和投资管理部总监,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理	判定估值价格合理性。
郝善勇	信息技术部总监	建立辅助估值系统,提供估值价格。
张利宁	监察稽核部总监	审查监督估值制度、程序执行过程的合规性。
戴君棉	业务运营部副总监	采用调整后价格进行基金资产估值。
龚珉	业务运营部副总监	采用调整后价格进行基金资产估值。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。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,托管银行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

本基金成立于2008年6月4日,根据中国证监会基金部通知[2008]12号《关于2007年证券投资基金年度报告编制及披露相关问题的通知》、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《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〉(试行)》等通知中对基金期末可分配利润计算方法的规定,以及《长盛创新先锋

灵活配置混合型证券投资基金基金合同》对基金利润分配原则的约定，2009年6月4日，本基金向全体基金持有人分配收益 25,930,985.88 元。截至 2009 年 6 月 30 日本基金可供分配收益为 13,937,291.22 元，按照上述通知及基金合同的规定，本公司经研究决定 2009 年上半年度不再进行分配。

§ 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”）在长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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核对无误。

§ 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：长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2009年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.2.1	10,819,117.60	59,439,200.00
结算备付金		1,727,668.91	863,506.03
存出保证金		1,379,368.13	750,000.00
交易性金融资产	6.4.2.2	201,067,451.80	320,432,148.77
其中：股票投资		166,552,051.80	232,068,148.77
基金投资		-	-
债券投资		34,515,400.00	88,364,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.2.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.2.4	-	-
应收证券清算款		6,605,264.46	551,380.87
应收利息	6.4.2.5	628,918.47	2,070,178.76
应收股利		82,863.00	-
应收申购款		95,415.65	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.2.6	-	-
资产总计		222,406,068.02	384,106,414.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.2.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,908,588.70	1,656,602.47
应付赎回款		1,030,781.63	9,483.09
应付管理人报酬	6.4.5.2.1	266,315.88	526,970.07
应付托管费	6.4.5.2.2	44,385.98	87,828.36
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.2.7	1,091,681.98	393,261.29
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.2.8	669,361.93	500,035.73
负债合计		8,011,116.10	3,174,181.01
所有者权益：			
实收基金	6.4.2.9	196,708,764.58	440,690,225.95
未分配利润	6.4.2.10	17,686,187.34	-59,757,992.53
所有者权益合计		214,394,951.92	380,932,233.42
负债和所有者权益总计		222,406,068.02	384,106,414.43

注：1、报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值：1.0899 元，基金份额总额 196,708,764.58 份。

2、本基金合同生效日为：2008 年 6 月 4 日。

3、后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 6 月 4 日至 2008 年 6 月 30 日
一、收入		125,436,504.87	1,370,495.96
1. 利息收入		1,262,223.19	600,156.69
其中：存款利息收入	6.4.2.11	178,512.27	340,047.30
债券利息收入		1,083,710.92	192,328.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	67,780.62
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		98,402,512.26	779,939.27
其中：股票投资收益	6.4.2.12	97,420,540.82	779,939.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.2.13	193,045.00	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.2.14	-	-
股利收益	6.4.2.15	788,926.44	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	6. 4. 2. 16	25, 381, 200. 86	-9, 600. 00
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	6. 4. 2. 17	390, 568. 56	-
二、费用（以“-”号填列）		-8, 122, 618. 85	-1, 074, 751. 80
1. 管理人报酬	6. 4. 5. 2. 1	-2, 353, 467. 25	-903, 862. 40
2. 托管费	6. 4. 5. 2. 2	-392, 244. 55	-150, 643. 73
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6. 4. 2. 18	-5, 196, 724. 58	-5, 269. 76
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6. 4. 2. 19	-180, 182. 47	-14, 975. 91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		117, 313, 886. 02	295, 744. 16
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		117, 313, 886. 02	295, 744. 16

注：1、本基金合同生效日为：2008年6月4日。

2、后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009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）	440, 690, 225. 95	-59, 757, 992. 53	380, 932, 233. 42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	117, 313, 886. 02	117, 313, 886. 02
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）	-243, 981, 461. 37	-13, 938, 720. 27	-257, 920, 181. 64
其中：1. 基金申购款	57, 419, 517. 63	930, 267. 80	58, 349, 785. 43
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-301, 400, 979. 00	-14, 868, 988. 07	-316, 269, 967. 07
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）	-	-25, 930, 985. 88	-25, 930, 985. 88
五、期末所有者权益（基金净值）	196, 708, 764. 58	17, 686, 187. 34	214, 394, 951. 92

项目	上年度可比期间金额 2008年6月4日至2008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)	848,262,882.92	-	848,262,882.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	295,744.16	295,744.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	848,262,882.92	295,744.16	848,558,627.08

注：1、本基金合同生效日为：2008年6月4日。

2、后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

6.4 报表附注(未经审计)

6.4.1 本报告期采用的会计政策、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 重要财务报表项目的说明

6.4.2.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
活期存款	10,819,117.60
定期存款	-
其他存款	-
合计	10,819,117.60

6.4.2.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	157,428,411.12	166,552,051.80	9,123,640.68
债券	交易所市场	13,591,270.00	-51,870.00
	银行间市场	20,000,000.00	976,000.00
	合计	33,591,270.00	924,130.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	191,019,681.12	201,067,451.80	10,047,770.68

6.4.2.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末（2009年6月30日）的衍生金融资产/负债项目余额为零。

6.4.2.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末（2009年6月30日）的买入返售金融资产项目余额为零。

6.4.2.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应收活期存款利息	2,120.11
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	544.14
应收债券利息	626,253.94
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.28
其他	-
合计	628,918.47

6.4.2.6 其他资产

本基金本报告期末（2009年6月30日）的其他资产项目余额为零。

6.4.2.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,091,581.98
银行间市场应付交易费用	100.00
合计	1,091,681.98

6.4.2.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	3,238.32
预提费用	166,123.61
合计	669,361.93

6.4.2.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	440,690,225.95	440,690,225.95
本期申购	57,419,517.63	57,419,517.63
其中：红利再投资	1,501,280.37	1,501,280.37
本期赎回	-301,400,979.00	-301,400,979.00
本期末	196,708,764.58	196,708,764.58

6.4.2.10 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	-46,574,400.47	-13,183,592.06	-59,757,992.53
本期利润	91,932,685.16	25,381,200.86	117,313,886.02
本期基金份额交易产生的变动数	-5,490,007.59	-8,448,712.68	-13,938,720.27
其中：基金申购款	763,177.25	167,090.55	930,267.80
基金赎回款	-6,253,184.84	-8,615,803.23	-14,868,988.07
本期已分配利润	-25,930,985.88	-	-25,930,985.88
本期末	13,937,291.22	3,748,896.12	17,686,187.34

6.4.2.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
活期存款利息收入	163,082.00
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	15,421.46
其他	8.81
合计	178,512.27

6.4.2.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
卖出股票成交总额	1,767,516,033.18
卖出股票成本总额	-1,670,095,492.36
股票投资收益	97,420,540.82

6.4.2.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
卖出债券、债券到期兑付成交金额	74,001,716.22
卖出债券、债券到期兑付成本总额	-71,348,080.00
应收利息总额	-2,460,591.22
债券投资收益	193,045.00

6.4.2.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内（2009年1月1日至2009年6月30日）的衍生工具收益——买卖权证差价收入项目金额为零。

6.4.2.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
股票投资产生的股利收益	788,926.44
基金投资产生的股利收益	-
合计	788,926.44

6.4.2.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2009年1月1日至2009年6月30日
1. 交易性金融资产	25,381,200.86
—股票投资	25,560,590.86
—债券投资	-179,390.00
—资产支持证券投资	-
—基金投资	-
2. 衍生工具	-
—权证投资	-
3. 其他	-
合计	25,381,200.86

6.4.2.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2009年1月1日至2009年6月30日
基金赎回费收入	390,568.56
基金转换费收入	-
印花税返还收入	-
其他	-
合计	390,568.56

注：基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.2.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2009年1月1日至2009年6月30日
交易所市场交易费用	5,196,024.58
银行间市场交易费用	700.00
合计	5,196,724.58

6.4.2.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2009年1月1日至2009年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	133,891.13
债券托管账户维护费	9,000.00
银行手续费	5,058.86
合计	180,182.47

6.4.3 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.3.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.3.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、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

6.4.5 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。

6.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金未开立关联方交易单元。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至 2009年06月30日	上年度可比期间 2008年6月4日至 2008年6月30日
当期应支付的管理费	2,353,467.25	903,862.40
其中：当期已支付	2,087,151.37	-
期末未支付	266,315.88	903,862.40

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至 2009年06月30日	上年度可比期间 2008年6月4日至 2008年6月30日
当期应支付的托管费	392,244.55	150,643.73
其中：当期已支付	347,858.57	-
期末未支付	44,385.98	150,643.73

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/当年天数。

6.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易：无。

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 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 2009年1月1日至 2009年6月30日	上年度可比期间 2008年6月4日至 2008年6月30日
期初持有的基金份额	45,021,400.00	-
期间认购总份额	-	45,021,400.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	45,021,400.00	45,021,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	22.89	5.31

6.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2009年6月30日		上期末 2008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（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
安徽省投资集团有限责任公司	-	0.00	28,001,520.00	3.30
国元证券	-	0.00	29,000,305.00	3.42

6.4.5.5 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 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年6月4日至2008年6月30日	
	期末金额	当期利息收入	期末金额	当期利息收入
中国银行	10,819,117.60	163,082.00	24,303,061.41	340,047.30

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间及比较期间内未参与关联方承销证券交易。

6.4.6 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额 分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放 总额	利润分配合计	备注
1	2009-06-04	2009-06-04	1.300	24,312,005.03	1,618,980.85	25,930,985.88	

6.4.7 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.7.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金于期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.7.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金于期末未持有暂时停牌股票。

6.4.7.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金于期末无正回购余额。

6.4.8 金融工具风险及管理

6.4.8.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资。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“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”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。

6.4.8.2 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。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与该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，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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%。

6.4.8.3 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，因此除附注 6.4.7 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，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投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的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。

6.4.8.4 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。

6.4.8.4.1 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

银行存款及结算备付金等。

6.4.8.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。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。

单位：人民币元

本期末 2009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	10,819,117.60	-	-	-	10,819,117.60
结算备付金	1,727,668.91	-	-	-	1,727,668.91
存出保证金	-	-	-	1,379,368.13	1,379,368.13
交易性金融资产	13,539,400.00	20,976,000.00	-	166,552,051.80	201,067,451.80
应收证券清算款	-	-	-	6,605,264.46	6,605,264.46
应收股利	-	-	-	82,863.00	82,863.00
应收利息	-	-	-	628,918.47	628,918.47
应收申购款	2,964.43	-	-	92,451.22	95,415.65
资产总计	26,089,150.94	20,976,000.00	-	175,340,917.08	222,406,068.02
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,908,588.70	4,908,588.70
应付赎回款	-	-	-	1,030,781.63	1,030,781.63
应付管理人报酬	-	-	-	266,315.88	266,315.88
应付托管费	-	-	-	44,385.98	44,385.98
应付交易费用	-	-	-	1,091,681.98	1,091,681.98
其他负债	-	-	-	669,361.93	669,361.93
负债总计	-	-	-	8,011,116.10	8,011,116.10
利率敏感度缺口	26,089,150.94	20,976,000.00	-	167,329,800.98	214,394,951.92
上年度末 2008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	59,439,200.00	-	-	-	59,439,200.00
结算备付金	863,506.03	-	-	-	863,506.03
存出保证金	-	-	-	750,000.00	750,000.00
交易性金融资产	67,886,000.00	20,478,000.00	-	232,068,148.77	320,432,148.77
应收证券清算款	-	-	-	551,380.87	551,380.87
应收利息	-	-	-	2,070,178.76	2,070,178.76
资产总计	128,188,706.03	20,478,000.00	-	235,439,708.40	384,106,414.43
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,656,602.47	1,656,602.47
应付赎回款	-	-	-	9,483.09	9,483.09
应付管理人报酬	-	-	-	526,970.07	526,970.07
应付托管费	-	-	-	87,828.36	87,828.36

应付交易费用	-	-	-	393,261.29	393,261.29
其他负债	-	-	-	500,035.73	500,035.73
负债总计	-	-	-	3,174,181.01	3,174,181.01
利率风险敞口	128,188,706.03	20,478,000.00	-	232,265,527.39	380,932,233.42

6.4.8.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对期末基金资产净值的影响金额(万元)	
分析		本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
	1、市场利率下降25个基点	增加约22	增加约91
	2、市场利率上升25个基点	下降约22	下降约91

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。

6.4.8.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金类别资产配置比例为：股票投资占基金资产的 30%至 80%，债券投资占基金资产的 15%至 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不少于 5%。其中，权证投资占基金资产净值的 0%至 3%。于 2009 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日		上年度末 2008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	166,552,051.80	77.68	232,068,148.77	60.92
衍生金融资产—权证投资	-	0.00	-	0.00
合计	166,552,051.80	77.68	232,068,148.77	60.92

6.4.8.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对期末基金资产净值的影响金额(万元)	
		本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
	1、业绩比较基准上升5%	增加约 1184	增加约 701
2、业绩比较基准下降5%	下降约 1184	下降约 701	

§ 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	166,552,051.80	74.89
	其中：股票	166,552,051.80	74.89
2	固定收益投资	34,515,400.00	15.52
	其中：债券	34,515,400.00	15.52
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	12,546,786.51	5.64
6	其他资产	8,791,829.71	3.95
7	合计	222,406,068.02	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	-	0.00
B	采掘业	13,416,005.00	6.26
C	制造业	47,182,336.00	22.01
C0	食品、饮料	-	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	5,516,000.00	2.57
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	4,326,000.00	2.02
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,173,636.00	6.14
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	4,997,800.00	2.33
C7	机械、设备、仪表	18,902,500.00	8.82
C8	医药、生物制品	266,400.00	0.12
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	164,900.00	0.08
E	建筑业	3,404,000.00	1.59
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	5,617,471.00	2.62
H	批发和零售贸易	5,412,000.00	2.52

I	金融、保险业	61,020,980.00	28.46
J	房地产业	27,794,359.80	12.96
K	社会服务业	2,540,000.00	1.18
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	166,552,051.80	77.68

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	000002	万科A	1,200,000	15,300,000.00	7.14
2	600036	招商银行	630,000	14,118,300.00	6.59
3	000983	西山煤电	229,950	6,875,505.00	3.21
4	002092	中泰化学	534,800	6,856,136.00	3.20
5	601939	建设银行	1,100,000	6,633,000.00	3.09
6	600016	民生银行	830,000	6,573,600.00	3.07
7	600166	福田汽车	480,000	6,360,000.00	2.97
8	600141	兴发集团	475,000	6,317,500.00	2.95
9	601328	交通银行	700,000	6,307,000.00	2.94
10	002128	露天煤业	230,000	6,145,600.00	2.87
11	600246	万通地产	539,950	5,799,063.00	2.70
12	000063	中兴通讯	199,910	5,617,471.00	2.62
13	600177	雅戈尔	400,000	5,516,000.00	2.57
14	600153	建发股份	400,000	5,412,000.00	2.52
15	000616	亿城股份	700,000	5,313,000.00	2.48
16	600000	浦发银行	214,000	4,926,280.00	2.30
17	601166	兴业银行	130,000	4,824,300.00	2.25
18	601398	工商银行	840,000	4,552,800.00	2.12
19	600015	华夏银行	350,000	4,385,500.00	2.05
20	000718	苏宁环球	300,000	4,326,000.00	2.02
21	000800	一汽轿车	280,000	4,323,200.00	2.02
22	000060	中金岭南	200,000	4,298,000.00	2.00
23	601169	北京银行	250,000	4,065,000.00	1.90
24	600067	冠城大通	300,000	3,897,000.00	1.82
25	600875	东方电气	100,000	3,890,000.00	1.81
26	002142	宁波银行	300,000	3,858,000.00	1.80
27	600266	北京城建	200,000	3,404,000.00	1.59
28	000685	中山公用	100,000	2,540,000.00	1.18
29	000006	深振业A	53,199	702,226.80	0.33
30	601318	中国平安	10,000	494,600.00	0.23
31	600585	海螺水泥	10,000	421,400.00	0.20

32	601699	潞安环能	10,000	394,900.00	0.18
33	600048	保利地产	13,000	362,570.00	0.17
34	000024	招商地产	10,000	317,500.00	0.15
35	600030	中信证券	10,000	282,600.00	0.13
36	600449	赛马实业	10,000	278,400.00	0.13
37	600216	浙江医药	10,000	266,400.00	0.12
38	000157	中联重科	10,000	223,300.00	0.10
39	000651	格力电器	10,000	209,000.00	0.10
40	601918	国投新集	10,000	164,900.00	0.08

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的比例(%)
1	601318	中国平安	42,054,591.84	11.04
2	600031	三一重工	38,593,186.98	10.13
3	000983	西山煤电	31,243,388.63	8.20
4	600036	招商银行	30,169,834.14	7.92
5	600028	中国石化	29,441,438.88	7.73
6	600000	浦发银行	29,379,361.04	7.71
7	000937	金牛能源	29,188,256.72	7.66
8	600875	东方电气	25,505,365.76	6.70
9	600089	特变电工	25,183,821.16	6.61
10	000651	格力电器	24,730,238.73	6.49
11	600166	福田汽车	24,456,865.54	6.42
12	600449	赛马实业	23,911,825.68	6.28
13	000800	一汽轿车	22,948,625.91	6.02
14	000060	中金岭南	22,166,065.08	5.82
15	600432	吉恩镍业	22,127,137.03	5.81
16	002128	露天煤业	22,102,675.69	5.80
17	002266	浙富股份	22,069,503.02	5.79
18	000024	招商地产	20,823,599.38	5.47
19	600837	海通证券	20,523,521.00	5.39
20	600067	冠城大通	19,926,546.49	5.23
21	600138	中青旅	19,095,635.63	5.01
22	000550	江铃汽车	18,824,962.76	4.94
23	000157	中联重科	18,669,720.66	4.90
24	600258	首旅股份	17,883,013.15	4.69
25	000422	湖北宜化	17,733,841.16	4.66
26	600141	兴发集团	17,624,320.62	4.63
27	600030	中信证券	17,507,729.60	4.60

28	000877	天山股份	16,820,974.58	4.42
29	000002	万科 A	16,342,220.00	4.29
30	601169	北京银行	16,251,362.36	4.27
31	600664	哈药股份	15,823,219.30	4.15
32	600104	上海汽车	15,160,315.71	3.98
33	600900	长江电力	14,900,000.00	3.91
34	000623	吉林敖东	14,768,629.22	3.88
35	000069	华侨城 A	14,420,210.65	3.79
36	001696	宗申动力	14,174,305.39	3.72
37	601168	西部矿业	14,103,317.20	3.70
38	600500	中化国际	13,338,354.47	3.50
39	600153	建发股份	13,093,220.47	3.44
40	000792	盐湖钾肥	13,076,458.87	3.43
41	600739	辽宁成大	12,742,480.40	3.35
42	600425	青松建化	12,644,122.31	3.32
43	000581	威孚高科	12,461,977.12	3.27
44	601666	平煤股份	12,421,206.03	3.26
45	000793	华闻传媒	12,387,509.82	3.25
46	600550	天威保变	12,043,736.18	3.16
47	600216	浙江医药	11,708,171.14	3.07
48	000917	电广传媒	11,690,792.95	3.07
49	600516	方大炭素	11,649,922.60	3.06
50	600261	浙江阳光	11,581,351.80	3.04
51	600428	中远航运	11,509,671.71	3.02
52	600498	烽火通信	11,465,940.73	3.01
53	002215	诺普信	11,432,810.84	3.00
54	600027	华电国际	11,215,855.03	2.94
55	600995	文山电力	11,054,575.62	2.90
56	000088	盐田港	11,005,588.40	2.89
57	600642	申能股份	10,916,397.75	2.87
58	000970	中科三环	10,869,471.50	2.85
59	000428	华天酒店	10,833,004.12	2.84
60	002115	三维通信	10,753,922.51	2.82
61	000718	苏宁环球	10,509,127.03	2.76
62	000539	粤电力 A	10,425,186.11	2.74
63	600098	广州控股	10,388,930.80	2.73
64	600331	宏达股份	10,386,997.99	2.73
65	601918	国投新集	10,292,185.68	2.70
66	600048	保利地产	10,272,425.44	2.70
67	000839	中信国安	10,146,915.69	2.66
68	600581	八一钢铁	9,959,165.31	2.61

69	600289	亿阳信通	9,703,809.60	2.55
70	000690	宝新能源	9,662,793.09	2.54
71	601699	潞安环能	9,629,472.40	2.53
72	600196	复星医药	9,586,270.69	2.52
73	002004	华邦制药	9,572,912.23	2.51
74	000932	华菱钢铁	9,445,012.38	2.48
75	000625	长安汽车	9,269,958.09	2.43
76	601600	中国铝业	9,216,898.12	2.42
77	000559	万向钱潮	9,038,111.42	2.37
78	600639	浦东金桥	8,869,001.00	2.33
79	000959	首钢股份	8,838,195.41	2.32
80	600839	四川长虹	8,689,745.00	2.28
81	000012	南玻 A	8,549,790.43	2.24
82	600060	海信电器	8,514,363.64	2.24
83	600150	中国船舶	8,490,533.48	2.23
84	600685	广船国际	8,432,274.50	2.21
85	000528	柳 工	8,346,893.86	2.19
86	000755	山西三维	8,288,596.93	2.18
87	600269	赣粤高速	8,213,111.00	2.16
88	601919	中国远洋	8,189,635.17	2.15
89	600686	金龙汽车	7,960,628.24	2.09
90	600177	雅 戈 尔	7,828,096.68	2.05
91	000758	中色股份	7,794,150.30	2.05
92	600780	通宝能源	7,620,962.32	2.00

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名股票明细

金额单位：人民币元

序号	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的比例(%)
1	601318	中国平安	55,769,934.53	14.64
2	600031	三一重工	39,305,553.40	10.32
3	600030	中信证券	36,962,284.79	9.70
4	600089	特变电工	33,474,942.85	8.79
5	000937	金牛能源	32,321,008.73	8.48
6	600028	中国石化	29,399,059.11	7.72
7	600036	招商银行	28,897,492.92	7.59
8	600000	浦发银行	27,448,302.00	7.21
9	600048	保利地产	27,391,882.54	7.19
10	000983	西山煤电	25,790,929.39	6.77
11	000651	格力电器	24,636,800.56	6.47
12	000069	华侨城 A	24,025,869.91	6.31
13	600449	赛马实业	23,929,099.28	6.28

14	000024	招商地产	23,849,185.04	6.26
15	600875	东方电气	23,581,634.00	6.19
16	600432	吉恩镍业	23,452,393.85	6.16
17	002266	浙富股份	23,331,759.84	6.12
18	601169	北京银行	22,330,336.96	5.86
19	000012	南玻 A	21,882,632.06	5.74
20	000550	江铃汽车	21,404,677.71	5.62
21	600104	上海汽车	21,166,455.53	5.56
22	000726	鲁泰 A	21,149,679.52	5.55
23	000800	一汽轿车	20,769,644.97	5.45
24	000060	中金岭南	20,428,252.00	5.36
25	600837	海通证券	20,265,768.88	5.32
26	000157	中联重科	19,992,929.07	5.25
27	600258	首旅股份	19,676,805.76	5.17
28	600664	哈药股份	19,281,024.74	5.06
29	600067	冠城大通	19,205,882.77	5.04
30	002128	露天煤业	19,083,597.98	5.01
31	600138	中青旅	18,815,309.74	4.94
32	600269	赣粤高速	18,603,178.31	4.88
33	600166	福田汽车	17,533,137.67	4.60
34	000877	天山股份	16,554,164.82	4.35
35	001696	宗申动力	16,314,111.06	4.28
36	000422	湖北宜化	16,033,914.49	4.21
37	600886	国投电力	15,867,466.84	4.17
38	000002	万科 A	15,597,495.00	4.09
39	600879	火箭股份	15,503,683.85	4.07
40	600309	烟台万华	15,284,511.50	4.01
41	000623	吉林敖东	15,243,646.77	4.00
42	600428	中远航运	14,994,714.20	3.94
43	000528	柳工	14,358,202.35	3.77
44	600739	辽宁成大	14,077,567.37	3.70
45	601168	西部矿业	13,757,187.35	3.61
46	600500	中化国际	13,755,131.56	3.61
47	000581	威孚高科	13,555,773.48	3.56
48	600900	长江电力	13,379,173.47	3.51
49	000792	盐湖钾肥	12,991,445.28	3.41
50	600425	青松建化	12,908,119.62	3.39
51	600498	烽火通信	12,745,793.24	3.35
52	000793	华闻传媒	12,358,765.46	3.24
53	601699	潞安环能	12,012,514.66	3.15
54	002115	三维通信	11,819,232.23	3.10

55	000428	华天酒店	11,740,433.44	3.08
56	600331	宏达股份	11,732,179.83	3.08
57	601666	平煤股份	11,692,702.86	3.07
58	600027	华电国际	11,675,621.60	3.07
59	600642	申能股份	11,569,198.76	3.04
60	000839	中信国安	11,554,701.02	3.03
61	600521	华海药业	11,457,524.18	3.01
62	600550	天威保变	11,450,660.25	3.01
63	601918	国投新集	11,278,685.51	2.96
64	002215	诺普信	11,219,725.35	2.95
65	600995	文山电力	11,140,522.15	2.92
66	600261	浙江阳光	11,038,535.18	2.90
67	000690	宝新能源	10,959,292.62	2.88
68	000088	盐田港	10,849,837.30	2.85
69	600216	浙江医药	10,745,126.95	2.82
70	600660	福耀玻璃	10,657,444.55	2.80
71	000860	顺鑫农业	10,468,423.04	2.75
72	002004	华邦制药	10,437,144.64	2.74
73	000917	电广传媒	10,251,505.20	2.69
74	000768	西飞国际	10,190,690.94	2.68
75	600196	复星医药	10,155,703.63	2.67
76	000970	中科三环	10,150,155.50	2.66
77	000625	长安汽车	10,004,782.58	2.63
78	600581	八一钢铁	9,995,187.25	2.62
79	601628	中国人寿	9,993,959.86	2.62
80	000559	万向钱潮	9,961,211.64	2.61
81	600141	兴发集团	9,953,590.23	2.61
82	600839	四川长虹	9,870,152.07	2.59
83	000539	粤电力A	9,857,744.55	2.59
84	600098	广州控股	9,855,401.04	2.59
85	600289	亿阳信通	9,799,251.74	2.57
86	600516	方大炭素	9,766,746.40	2.56
87	600639	浦东金桥	9,660,796.73	2.54
88	000755	山西三维	9,501,239.47	2.49
89	000932	华菱钢铁	9,481,870.20	2.49
90	601006	大秦铁路	9,377,766.56	2.46
91	000959	首钢股份	9,208,744.42	2.42
92	600685	广船国际	9,009,820.66	2.37
93	000901	航天科技	8,808,538.61	2.31
94	601600	中国铝业	8,780,834.10	2.31
95	600060	海信电器	8,532,020.33	2.24

96	000758	中色股份	8,498,424.98	2.23
97	600780	通宝能源	8,374,919.43	2.20
98	600150	中国船舶	8,054,939.60	2.11
99	601919	中国远洋	7,974,444.22	2.09
100	600686	金龙汽车	7,959,702.00	2.09
101	600050	中国联通	7,876,399.20	2.07

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	1,579,018,804.53
卖出股票收入（成交）总额	1,767,516,033.18

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	13,539,400.00	6.32
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	20,976,000.00	9.78
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	34,515,400.00	16.10

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	088050	08 渝城投债	200,000	20,976,000.00	9.78
2	010004	20 国债(4)	133,000	13,539,400.00	6.32

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。

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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,379,368.13
2	应收证券清算款	6,605,264.46
3	应收股利	82,863.00
4	应收利息	628,918.47
5	应收申购款	95,415.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,791,829.71

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债。

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 (%)
4,459	44,115.00	128,263,758.81	65.20	68,445,005.77	34.80

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

份额单位：份

项目	持有份额总数	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	472,247.68	0.24

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年6月4日）基金份额总额	848,262,882.92
报告期期初基金份额总额	440,690,225.95
报告期期间基金总申购份额	57,419,517.63
报告期期间基金总赎回份额	301,400,979.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	196,708,764.58

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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

本基金管理人的高级管理人员未发生重大人事变动。

10.2.2 基金经理的变动情况

本基金的基金经理未变更。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

本报告期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普华永道中天会计师事务所有限公司，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 本期基金租用证券公司交易单元股票交易的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		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 (%)
国金证券股份有限公司	1	753,014,893.77	22.50	640,062.85	22.90
光大证券股份有限公司	1	510,128,991.16	15.24	414,485.31	14.83
华宝证券经纪有限责任公司	1	7,068,491.17	0.21	5,743.31	0.21

平安证券有限责任公司	1	1,261,624,715.32	37.70	1,072,375.94	38.37
东吴证券有限责任公司	1	-	0.00	-	0.00
第一创业证券有限责任公司	1	814,697,746.29	24.34	661,952.58	23.69

10.7.2 本期基金租用证券公司交易单元债券及债券回购交易的有关情况

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 (%)
国金证券股份有限公司	1	21,745,875.00	100.00	-	0.00
光大证券股份有限公司	1	-	0.00	-	0.00
华宝证券经纪有限责任公司	1	-	0.00	-	0.00
平安证券有限责任公司	1	-	0.00	-	0.00
东吴证券有限责任公司	1	-	0.00	-	0.00
第一创业证券有限责任公司	1	-	0.00	-	0.00

10.7.3 本期基金租用证券公司交易单元权证交易的有关情况

本基金本报告期间未发生权证交易。

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) 资历雄厚，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、本报告期内本基金租用证券公司交易单元未发生变更。

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	关于长盛基金管理有限公司变更站点证书的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2009-01-08
2	关于旗下基金通过中国工商银行开办定投及参加优惠活动的公告	同上	2009-01-16
3	长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)全文及其摘要	同上	2009-01-20
4	关于提醒投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的通知	同上	2009-02-04
5	关于增加瑞银证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告	同上	2009-02-09
6	关于长盛网上直销定期定额业务升级的公告	同上	2009-02-09
7	关于旗下基金参与瑞银证券有限责任公司网上交易费率优惠活动的公告	同上	2009-02-20

8	关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司基智定投业务的公告	同上	2009-02-25
9	关于农行卡和建行卡网上交易费率优惠活动的公告	同上	2009-02-27
10	关于旗下基金参与中国工商银行网上交易申购费率优惠活动的公告	同上	2009-03-31
11	关于旗下部分基金参加中国建设银行电话银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2009-04-10
12	关于增加中国建银投资证券有限公司为我公司旗下基金代销机构的公告	同上	2009-04-25
13	关于旗下基金继续参与中国银行网上银行及定期定额申购费率优惠活动的公告	同上	2009-05-04
14	关于开通招商银行卡网上支付的公告	同上	2009-05-25
15	长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金首次收益分配公告	同上	2009-06-01
16	关于旗下部分基金参与兴业银行基金定投优惠活动的公告	同上	2009-06-09

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

(一) 关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金的批复

(二) 长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(三) 长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金托管协议

(四) 报告期内披露的各项公告原件

(五) 长盛基金管理有限公司营业执照和公司章程

11.2 存放地点

以上相关备查文件，置备于基金管理人的办公场所。本报告分别置备于基金管理人的办公场所和基金托管人的住所。本报告至少登载在一种由中国证监会指定的全国性报刊及本基金管理人的互联网网站上。上述备查文件可在长盛基金管理有限公司互联网站上查阅。

11.3 查阅方式

在办公时间内可查阅，也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

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>。