

**长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金**

**2009 年半年度报告摘要**

**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 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.....   | 4  |
| § 4 管理人报告.....           | 6  |
| § 5 托管人报告.....           | 11 |
| § 6 半年度财务会计报告(未经审计)..... | 12 |
| § 7 投资组合报告.....          | 18 |
| § 8 基金份额持有人信息.....       | 27 |
| § 9 开放式基金份额变动.....       | 27 |
| § 10 重大事件揭示.....         | 28 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 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<br>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             |

### 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 | <a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a> |
| 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   |

## § 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                       |

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 | 份额净值增长率<br>标准差 | 业绩比较基准<br>收益率 | 业绩比较基准收<br>益率标准差 | -      | -      |
|------------|---------|----------------|---------------|------------------|--------|--------|
| 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。

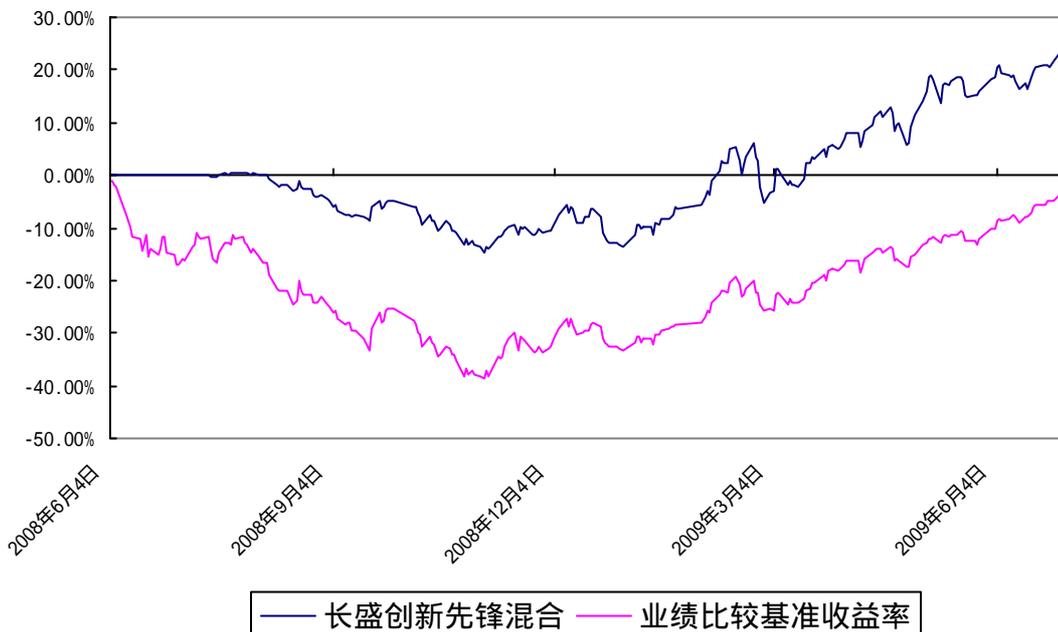
沪深 300 指数是沪深证券交易所联合发布的反映 A 股市场整体走势的成份股指数，由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成，样本覆盖了沪深市场约六成的市值，具有良好的市场代表性。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准，较为合适。

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遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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              | 本期末<br>2009年6月30日         | 上年度末<br>2008年12月31日         |
|-----------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |                           |                             |
| 银行存款            | 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         | 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          | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        | -                         | -                           |
| 应收证券清算款         | 6,605,264.46              | 551,380.87                  |
| 应收利息            | 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            | -                         | -                           |
| <b>资产总计</b>     | <b>222,406,068.02</b>     | <b>384,106,414.43</b>       |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2009年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2008年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>      |                           |                             |
| 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         | 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         | 266,315.88                | 526,970.07                  |
| 应付托管费           | 44,385.98                 | 87,828.36                   |
| 应付销售服务费         | -                         | -                           |

|                   |                       |                       |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| 应付交易费用            | 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              | 669,361.93            | 500,035.73            |
| <b>负债合计</b>       | <b>8,011,116.10</b>   | <b>3,174,181.01</b>   |
| <b>所有者权益：</b>     |                       |                       |
| 实收基金              | 196,708,764.58        | 440,690,225.95        |
| 未分配利润             | 17,686,187.34         | -59,757,992.53        |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>214,394,951.92</b> | <b>380,932,233.42</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>222,406,068.02</b> | <b>384,106,414.43</b> |

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。

## 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                    | 本期<br>2009 年 1 月 1 日至<br>2009 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2008 年 6 月 4 日至<br>2008 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           | <b>125,436,504.87</b>                    | <b>1,370,495.96</b>                           |
| 1. 利息收入               | 1,262,223.19                             | 600,156.69                                    |
| 其中：存款利息收入             | 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             | 97,420,540.82                            | 779,939.27                                    |
| 基金投资收益                | -  | -   |
| 债券投资收益                | 193,045.00                               | -   |
| 资产支持证券投资收益            | -  | -   |
| 衍生工具收益                | -  | -   |
| 股利收益                  | 788,926.44                               | -   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列） | 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)           | 390,568.56            | -                    |
| <b>二、费用(以“-”号填列)</b>       | <b>-8,122,618.85</b>  | <b>-1,074,751.80</b> |
| 1.管理人报酬                    | -2,353,467.25         | -903,862.40          |
| 2.托管费                      | -392,244.55           | -150,643.73          |
| 3.销售服务费                    | -                     | -                    |
| 4.交易费用                     | -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                     | -180,182.47           | -14,975.91           |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> | <b>117,313,886.02</b> | <b>295,744.16</b>    |
| 所得税费用(以“-”号填列)             | -                     | -                    |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   | <b>117,313,886.02</b> | <b>295,744.16</b>    |

注:本基金合同生效日为:2008年6月4日。

### 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<br>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<br>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：本基金合同生效日为：2008年6月4日。

#### 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 关联方关系

##### 6.4.2.1 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。

##### 6.4.2.2 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     |

##### 6.4.3 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。

##### 6.4.3.1 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。

##### 6.4.3.2 关联方报酬

##### 6.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2009年1月1日至<br>2009年06月30日 | 上年度可比期间<br>2008年6月4日至<br>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。

#### 6.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2009年1月1日至<br>2009年06月30日 | 上年度可比期间<br>2008年6月4日至<br>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。

#### 6.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

#### 6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.3.4.1 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<br>2009年1月1日至<br>2009年6月30日 | 上年度可比期间<br>2008年6月4日至<br>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                                |

#### 6.4.3.4.2 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<br>2009年6月30日 |                     | 上期末<br>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                |

#### 6.4.3.5 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<br>2009年1月1日至2009年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>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。

#### 6.4.3.6 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。

#### 6.4.4 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.4.1 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。

##### 6.4.4.2 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。

##### 6.4.4.3 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。

## §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  | 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         |

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。

### 7.4 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前十名资产支持证券明细

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券。

#### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构          |                |               |                |
|--------------|---------------|----------------|----------------|---------------|----------------|
|              |               | 机构投资者          |                | 个人投资者         |                |
|              |               | 持有<br>份额       | 占总份额<br>比例 (%) | 持有<br>份额      | 占总份额<br>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、本报告期内本基金租用证券公司交易单元未发生变更。