

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）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 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金	
基金简称	长盛同庆封闭	
基金主代码	160806	
交易代码	160806	
基金运作方式	契约型。封闭期为三年，自基金合同生效之日，至三年期末对应日止。封闭期届满后，转换为上市开放式基金（LOF）。	
基金合同生效日	2009年5月12日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	14,686,733,239.06份	
基金合同存续期	封闭期为三年，自基金合同生效之日，至三年期末对应日止。封闭期届满后，转换为上市开放式基金（LOF），合同存续期为不定期。	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2009年5月26日	
下属分级基金的基金简称	长盛同庆封闭 A	长盛同庆封闭 B
下属分级基金的交易代码	150006	150007
报告期末下属分级基金的份额总额	5,874,693,295.62份	8,812,039,943.44份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于具有稳健成长和业绩优良的上市公司股票，力求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。	
投资策略	本基金在股票投资上，通过优选业绩优良、成长性稳定、在行业内具有核心竞争优势的上市公司股票进行投资，以谋求基金资产的长期稳定增长。在对市场趋势的有效判断的前提下，进行稳健的战略资产配置和积极的行业配置，同时根据对上市公司充分的基本面分析，挖掘行业中的价值个股。本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益。在实际的投资运作中，本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%	
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。	
下属分级基金的风险收益特征	长盛同庆封闭 A 将表现出低风险、收益相对稳定的特征。	长盛同庆封闭 B 将表现出高风险、收益相对较高的特征。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	尹东
	联系电话	010-82019988	010-67595003

	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	Yindong.zh@ccb.com
	客户服务电话	400-888-2666、010-62350088	010-67595096
	传真	010-82255988	010-66275853

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	-404,641,640.55
本期利润	-627,869,432.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0428
本期基金份额净值增长率	-3.95%
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	-0.0086
期末基金资产净值	15,003,198,779.39
期末基金份额净值	1.022

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（为期末余额，不是当期发生数）。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	2.30%	0.81%	0.89%	0.84%	1.41%	-0.03%
过去三个月	-4.58%	0.82%	-3.59%	0.77%	-0.99%	0.05%
过去六个月	-3.95%	1.00%	-1.32%	0.87%	-2.63%	0.13%
过去一年	14.19%	1.18%	13.44%	0.99%	0.75%	0.19%
自基金合同生效起至今	2.20%	1.30%	11.02%	1.16%	-8.82%	0.14%

注：本基金业绩比较基准 = 沪深300指数收益率 × 70% + 中证全债指数收益率 × 30%

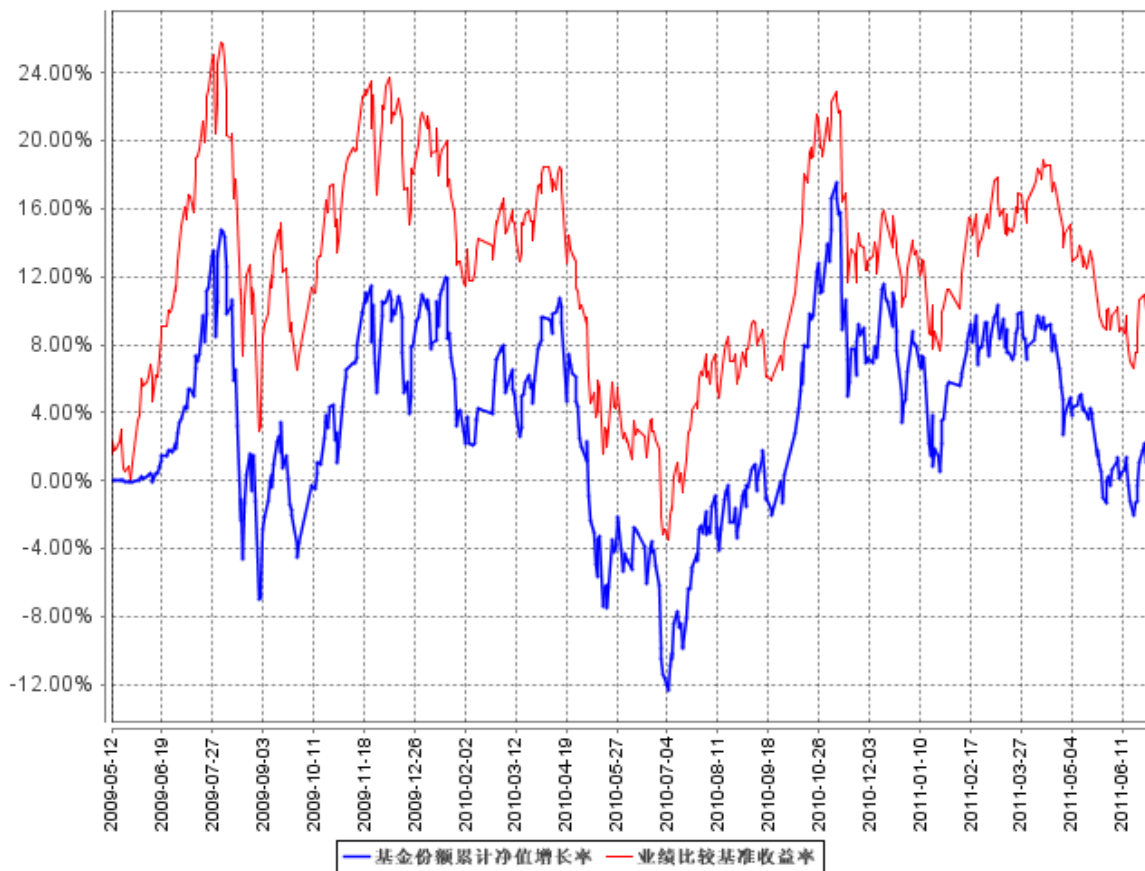
沪深300指数是由上海和深圳证券交易所中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。沪深300指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

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，基金基准指数每日按照 70%、30%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

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



3.3 其他指标

金额单位：人民币元

其他指标	报告期(2011年1月1日-2011年6月30日)
长盛同庆封闭A与长盛同庆封闭B基金份额配比	4:6
期末长盛同庆封闭A份额参考净值	1.120
期末长盛同庆封闭A份额累计参考净值	1.120
期末长盛同庆封闭B份额参考净值	0.957
期末长盛同庆封闭B份额累计参考净值	0.957
长盛同庆封闭A的预计年收益率	5.60%

§ 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		
王宁	本基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，投资管理部总监。	2009年5月12日	—	13年	男，1971年10月出生，中国国籍。毕业于北京大学光华管理学院，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理等职务。现任投资管理部总监，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金（本基金）基金经理。
黄瑞庆	本基金基金经理。	2009年5月12日	2011年1月11日	9年	男，1974年9月出生，中国国籍。2002年7月毕业于厦门大学，获博士学位。历任融通基金管理有限公司研究员；长城基金管理有限公司金融工程小组组长，长城货币市场基金基金经理；自2005年9月起加入长盛基金管理有限公司，曾任社保组合经理，长盛中证100指数证券投资基金基金经理，专户理财部总监，投资管理部副总监。曾任本基金基金经理，目前已离职。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解

聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛同庆可分离交易股票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 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年国际市场不断动荡，中东利比亚局势造成石油价格大幅度波动，日本出现地震、海啸、核爆，引起日本股市大幅度下跌，以希腊为首的欧洲债券危机不断升级，美国房地产和就业数据没有明显改善迹象，美联储第二轮量化宽松政策六月底退出，美国政府债务上限是否继续提高，还有国际货币基金组织行长涉嫌犯罪，美国击毙恐怖组织头目拉登等引起石油、黄金、白银等金融交易产品短期大幅度波动。

国内资本市场上半年宏观经济政策以控制物价为主要目的，连续向上调整存款准备金率、加息。国内股市与去年市场表现完全相反，创业板指数、中小板指数连续创新低，其中创业板市场出现历史新低，非周期性行业、中小股票、新兴产业股票表现

低迷，新股发行日益艰难，不断跌破发行价的情况，国际市场对中国概念股票的怀疑声音不断，出现做空中国某些股票的苗头。与之相反，周期性股票、大中型股票、传统行业股票曾出现过阶段性表现。

2011 年上半年同庆基金股票组合基本采取谨慎操作策略，降低股票组合仓位比例，防御市场系统性风险，降低中小规模、新型行业的股票比重，适当参与低估值股票的交易投资。

2011 年上半年，由于央行不断向上调整存款准备金，市场资金在春节前后和六月底前后出现阶段性紧张，同庆适当参与交易所和银行间逆回购操作交易，取得无风险收益，提高现金收益水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.022 元，本报告期份额净值增长率为-3.95%，同期业绩比较基准增长率为-1.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过史无前例的廉价资金释放，土地、房产、人力等传统生产要素全部大幅度上涨。上半年宏观政策基本围绕控制物价水平展开，目前没有看到物价出现明显下降迹象的预期，不断提高存款准备金、加息使金融系统资金出现阶段性紧张，尤其是提高存款准备金的数量型货币政策，全社会资金数量紧张带动价格提高，银行变相吸储贷款的理财产品实际收益率已经明显高于存款水平，全社会资金价格水平已经全面上升。

国际投资者对于地方政府融资平台、房地产贷款、中国海外上市公司诚信产生怀疑，央行、银监会和国家审计署关于地方政府融资平台的描述都是引起国内股市上半年系统性调整的主要原因之一。

转变经济发展方式是长期过程，目前继续保持经济增长的动力还是来源于利用增量解决存量问题，主要体现在大力展开保障房建设，但是上半年保障房建设明显低于预期，下半年全国保障房建设是否超预期需要继续验证。

这些因素是否已经充分反映在市场定价水平里面还有待进一步观察。在不确定性因素下寻找业绩持续增长超预期的公司是降低组合不确定性因素的有效方法。

同庆基金将继续按照追求累计业绩的投资管理方式设计投资组合，控制组合下行风险，提高组合上涨收益，为同庆基金持有人提供长期持续稳定增长回报。

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》的规定及本基金基金合同第十九节中对基金利润分配原则的约定，本基金在封闭期内不单独对基金份额所分离的同庆A与同庆B基金份额进行利润分配。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

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	1,631,862,938.38	1,426,645,047.67
结算备付金	127,866,104.93	38,710,901.01
存出保证金	9,779,898.93	3,024,541.73
交易性金融资产	10,645,367,891.16	13,195,640,814.90
其中：股票投资	10,645,367,891.16	13,195,640,814.90
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,494,202,681.30	1,000,000,000.00
应收证券清算款	1,465,777,235.59	-
应收利息	1,908,718.21	975,715.32
应收股利	17,761,193.15	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	15,394,526,661.65	15,664,997,020.63
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	357,031,542.67	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	18,162,033.55	20,237,783.45
应付托管费	3,027,005.59	3,372,963.90
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	11,359,879.38	8,918,061.29
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,747,421.07	1,400,000.00
负债合计	391,327,882.26	33,928,808.64
所有者权益：		
实收基金	14,686,733,239.06	14,686,733,239.06
未分配利润	316,465,540.33	944,334,972.93
所有者权益合计	15,003,198,779.39	15,631,068,211.99
负债和所有者权益总计	15,394,526,661.65	15,664,997,020.63

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值：1.022元，基金份额总额：14,686,733,239.06份，其中A类基金份额总额5,874,693,295.62份，B类基金份额总额8,812,039,943.44份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、收入	-442,764,794.36	-2,979,663,115.13
1. 利息收入	38,187,585.71	9,421,080.65
其中：存款利息收入	13,420,313.74	8,633,733.08
债券利息收入	10,168.99	202,462.14
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	24,757,102.98	584,885.43
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）	-257,724,588.02	-215,735,994.62
其中：股票投资收益	-310,770,045.82	-261,216,898.05
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,323,033.41	673,675.88
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	47,722,424.39	44,807,227.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-223,227,792.05	-2,773,348,201.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	185,104,638.24	156,317,510.93
1. 管理人报酬	115,033,964.32	112,690,034.55
2. 托管费	19,172,327.38	18,781,672.38

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	50,629,905.82	24,565,868.60
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	268,440.72	279,935.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-627,869,432.60	-3,135,980,626.06
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-627,869,432.60	-3,135,980,626.06

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

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）	14,686,733,239.06	944,334,972.93	15,631,068,211.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-627,869,432.60	-627,869,432.60
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	-	-	-
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）	14,686,733,239.06	316,465,540.33	15,003,198,779.39
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	14,686,733,239.06	1,596,393,164.24	16,283,126,403.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,135,980,626.06	-3,135,980,626.06
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	-	-	-
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）	14,686,733,239.06	-1,539,587,461.82	13,147,145,777.24
-----------------	-------------------	-------------------	-------------------

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周 兵	杨思乐	戴君棉
基金管理人负责人	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政策变更。

6.4.2.3 差错更正的说明：本报告期不存在会计政策变更。

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、基金销售机构
中国建设银行	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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 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		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国元证券	6,650,556,354.52	20.61%	7,308,423,653.76	47.01%

6.4.4.1.2 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期回购 成交总额的比例	成交金额	占当期回购 成交总额的比例
国元证券	16,310,000,000.00	16.78%	-	-

6.4.4.1.3 应支付关联方佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国元证券	5,652,960.38	20.88%	1,081,250.84	9.53%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国元证券	6,212,149.78	47.60%	4,626,429.84	72.64%

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。

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	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月 30日
	当期发生的基金应支付的管理费	115,033,964.32
其中：支付给销售机构的客户维护费	469,936.87	507,622.09

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：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

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	上年度可比期间 2010年1月1日至2010 年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费	19,172,327.38

注：支付基金托管人中国建设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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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

单位：人民币元

本期 2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金 买入	基金 卖出	交易金额	利息收入	交易 金额	利息支 出
中国建设银行	-	-	3,498,755,000.00	1,229,461.13	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金 买入	基金 卖出	交易金额	利息收入	交易 金额	利息支 出
-	-	-	-	-	-	-

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

本基金基金管理人于本报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）及上年度可比期间（2010年1月1日至2010年6月30日）均未投资本基金份额。

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

本基金其他关联方及其控制的机构于本报告期末（2011年6月30日）及上年度末（2010年12月31日）均未投资本基金份额。

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		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,631,862,938.38	12,707,684.32	2,828,857,286.85	8,526,859.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内（2011年1月1日至2011年6月30日）及比较期内（2010年1月1日至2010年6月30日）未参与关联方承销证券交易。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明：无。

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

金额单位：人民币元

6.4.7.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600166	福田汽车	10/09/16	11/09/14	非公开发行	18.06	8.68	7,000,000	126,420,000.00	60,760,000.00	-
600166	福田汽车	-	11/09/14	非公开发行送股	-	8.68	7,000,000	-	60,760,000.00	-

注：本基金持有的非公开发行股票福田汽车，于2011年5月16日实施2010年度利润分配方案，向全体股东每10股派送股票10股并派送2.8元（含税）。本基金因此次利润分配新增7,000,000股，并将与原持有非公开发行部分同时上市流通。

基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

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和衍生工具金融资产，其中属于第一层级的余额为 10,523,847,891.16 元，属于第二层级的余额为 121,520,000.00 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级 13,056,480,814.90 元，第二层级 139,160,000.00 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2010 年度可比期间：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	10,645,367,891.16	69.15
	其中：股票	10,645,367,891.16	69.15
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,494,202,681.30	9.71
	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	1,759,729,043.31	11.43
6	其他各项资产	1,495,227,045.88	9.71
7	合计	15,394,526,661.65	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	155,739,048.75	1.04
B	采掘业	419,320,064.48	2.79
C	制造业	5,956,734,861.95	39.70
C0	食品、饮料	925,014,593.51	6.17
C1	纺织、服装、皮毛	46,538,787.48	0.31
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	16,011,544.86	0.11
C4	石油、化学、塑胶、塑料	585,985,859.96	3.91
C5	电子	458,679,470.08	3.06
C6	金属、非金属	1,280,787,121.87	8.54
C7	机械、设备、仪表	1,940,381,240.37	12.93
C8	医药、生物制品	703,336,243.82	4.69
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	758,842,499.56	5.06
E	建筑业	302,758,380.37	2.02
F	交通运输、仓储业	469,243,899.72	3.13
G	信息技术业	839,168,930.84	5.59
H	批发和零售贸易	593,731,500.25	3.96
I	金融、保险业	560,020,288.80	3.73
J	房地产业	132,097,675.04	0.88
K	社会服务业	30,958,036.60	0.21
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	426,752,704.80	2.84
	合计	10,645,367,891.16	70.95

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	601989	中国重工	50,007,556	689,604,197.24	4.60
2	601288	农业银行	200,007,246	560,020,288.80	3.73
3	600050	中国联通	100,007,204	525,037,821.00	3.50
4	600010	包钢股份	49,999,431	417,495,248.85	2.78
5	600085	同仁堂	10,000,000	356,600,000.00	2.38
6	000758	中色股份	10,005,731	353,702,590.85	2.36
7	000540	中天城投	20,000,000	333,200,000.00	2.22
8	000768	西飞国际	29,999,975	330,299,724.75	2.20
9	000822	山东海化	29,995,805	317,955,533.00	2.12
10	600795	国电电力	100,007,602	296,022,501.92	1.97

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比例（%）
1	000758	中色股份	981,736,345.90	6.28
2	600050	中国联通	726,417,908.31	4.65
3	600027	华电国际	377,648,934.83	2.42
4	600585	海螺水泥	361,484,335.15	2.31
5	600795	国电电力	345,589,325.97	2.21
6	601288	农业银行	329,735,726.95	2.11
7	600068	葛洲坝	322,954,167.05	2.07
8	600111	包钢稀土	303,913,871.94	1.94
9	600569	安阳钢铁	303,171,879.98	1.94
10	601333	广深铁路	292,686,579.94	1.87
11	601600	中国铝业	292,667,363.75	1.87
12	600010	包钢股份	291,573,610.58	1.87
13	601006	大秦铁路	272,006,890.49	1.74
14	000401	冀东水泥	269,904,853.78	1.73
15	600176	中国玻纤	268,265,310.29	1.72
16	600271	航天信息	267,713,067.52	1.71
17	601989	中国重工	254,889,332.97	1.63
18	601179	中国西电	253,888,184.78	1.62
19	000768	西飞国际	245,483,848.06	1.57
20	000063	中兴通讯	223,988,500.42	1.43

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	000758	中色股份	868,625,531.68	5.56
2	600256	广汇股份	784,886,236.44	5.02
3	000069	华侨城A	741,386,745.25	4.74
4	600016	民生银行	655,442,437.49	4.19
5	601857	中国石油	537,766,479.74	3.44
6	600585	海螺水泥	525,094,705.74	3.36
7	601002	晋亿实业	520,799,108.23	3.33
8	600739	辽宁成大	423,736,761.66	2.71
9	601179	中国西电	384,180,366.00	2.46
10	601299	中国北车	377,877,926.05	2.42
11	600271	航天信息	369,252,155.62	2.36
12	601766	中国南车	368,135,641.35	2.36
13	601166	兴业银行	334,664,026.82	2.14
14	000063	中兴通讯	331,438,889.64	2.12
15	600111	包钢稀土	329,271,075.52	2.11
16	600498	烽火通信	329,187,521.00	2.11
17	600036	招商银行	321,330,565.96	2.06
18	600028	中国石化	301,701,430.47	1.93
19	600176	中国玻纤	287,177,258.54	1.84
20	601106	中国一重	276,226,798.15	1.77

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	15,128,336,196.77
卖出股票收入（成交）总额	17,144,611,282.64

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）填写，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.9.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,779,898.93
2	应收证券清算款	1,465,777,235.59
3	应收股利	17,761,193.15
4	应收利息	1,908,718.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,495,227,045.88

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 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

份额级别	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
长盛同庆封闭 A	12,162	483,036.78	2,974,471,800.72	50.63%	2,900,221,494.90	49.37%
长盛同庆封闭 B	29,897	294,746.63	3,748,567,229.67	42.54%	5,063,472,713.77	57.46%
合计	42,059	349,193.59	6,723,039,030.39	45.78%	7,963,694,208.67	54.22%

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.2 期末上市基金前十名持有人

长盛同庆封闭 A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	896,658,591.00	15.53%
2	新华人寿保险股份有限公司	449,227,579.00	7.78%
3	中国平安保险(集团)股份有限公司—集团本级—自有资金	414,999,905.00	7.19%
4	中国人寿保险(集团)公司	271,270,913.00	4.70%
5	中诚信托有限责任公司—交行固定收益单一信托	267,321,560.00	4.63%
6	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC	206,132,576.00	3.57%
7	财通证券有限责任公司	200,002,045.00	3.46%
8	中信证券股份有限公司	190,281,878.00	3.30%
9	中英人寿保险有限公司	148,951,058.00	2.58%
10	中国人民人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	144,514,118.00	2.50%

长盛同庆封闭 B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	2,094,219,908.00	24.17%
2	中国平安保险(集团)股份有限公司	430,699,851.00	4.97%
3	中国人寿财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	272,040,328.00	3.14%
4	太平人寿保险有限公司	237,148,755.00	2.74%
5	中英人寿保险有限公司	223,466,443.00	2.58%

6	信诚人寿保险有限公司	215,360,812.00	2.49%
7	幸福人寿保险股份有限公司-分红	187,537,246.00	2.16%
8	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红-019L-FH002 深	152,851,296.00	1.76%
9	中国人民财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	143,241,171.00	1.65%
10	嘉禾人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	97,981,695.00	1.13%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

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	份额级别	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	长盛同庆封闭 A	-	-
	长盛同庆封闭 B	-	-
	合计	-	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	长盛同庆封闭 A	长盛同庆封闭 B
基金合同生效日（2009年5月12日）基金份额总额	5,874,693,295.62	8,812,039,943.44
本报告期期初基金份额总额	5,874,693,295.62	8,812,039,943.44
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	5,874,693,295.62	8,812,039,943.44

注：本基金封闭期为三年，自基金合同生效之日，至三年期末对应日止。封闭期内不接受投资者的申购与赎回。

§ 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 基金经理变动情况

本基金管理人于 2011 年 1 月 13 日发布公告，经公司第五届董事会第十三次会议审议批准，同意黄瑞庆先生不再担任本基金基金经理。

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 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

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

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
海通证券	1	3,696,132,733.48	11.45%	3,141,701.74	11.61%
联合证券	1	1,522,171,658.12	4.72%	1,236,774.79	4.57%
高华证券	1	-	-	-	-
兴业证券	1	2,074,490,052.07	6.43%	1,685,540.00	6.23%
申银万国	1	2,771,257,785.54	8.59%	2,355,559.70	8.70%
国泰君安	1	4,085,771,466.98	12.66%	3,472,882.85	12.83%
银河证券	1	-	-	-	-
国元证券	1	6,650,556,354.52	20.61%	5,652,960.38	20.88%
招商证券	1	4,130,037,317.63	12.80%	3,355,691.43	12.40%
中投证券	1	817,571,390.53	2.53%	694,936.78	2.57%
中金公司	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
国信证券	1	724,226,058.03	2.24%	588,440.27	2.17%
长江证券	1	3,023,430,943.12	9.37%	2,569,902.07	9.49%
东兴证券	1	1,513,747,029.05	4.69%	1,286,682.90	4.75%
中航证券	1	1,263,554,690.34	3.92%	1,026,644.93	3.79%

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	交易单元数量	债券交易		回购交易	
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
海通证券	1	-	-	8,400,000,000.00	8.64%
联合证券	1	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-
申银万国	1	71,613,202.40	100.00%	-	-
国泰君安	1	-	-	13,838,400,000.00	14.24%
银河证券	1	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	16,310,000,000.00	16.78%
招商证券	1	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	11,900,000,000.00	12.24%
中金公司	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	32,564,300,000.00	33.50%

东兴证券	1	-	-	14,185,300,000.00	14.59%
中航证券	1	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	中航证券	深圳	1
2	东兴证券	上海	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无