

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

2011 第二季度 报告

2011年 6月 30日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告期截止日:2011 年 6 月 19 日

\$1 重要提示

基金管理人声明本基金的董事会及监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责任。

基金托管人声明本基金的董事会及监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责任。

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。

本报告期内的财务资料未审计。

本报告期自 2011 年 4 月 1 日起至 2011 年 6 月 30 日止。

S2 基金产品概况

基金简称 长盛沪深 300 指数 (LOF)

基金代码 160807

交易代码 160807

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2010 年 8 月 4 日

报告期末基金份额总额 213,721,854.86份

基金类型 本基金采取指数化投资策略，跟踪沪深 300 指数，通过严格的的投资纪律约束和数据化的风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值对值偏差率小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%。以实现对标的指数的有效追踪。

投资目标 本基金采用被动复制指数的投资策略，综合考虑的因素指指数本身个股的权重、行业分布、风格特征、历史表现等多方面的因素，通过量化分析和数学模型选择出其中的权重股，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值偏差率小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%的既定目标。

投资策略 本基金采用被动复制指数的投资策略，综合考虑的因素指指数本身个股的权重、行业分布、风格特征、历史表现等多方面的因素，通过量化分析和数学模型选择出其中的权重股，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值偏差率小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%的既定目标。

业绩比较基准 95%×深证成份指数+4%×定期定额计划的预期收益率(之后)。

风险收益特征 本基金是股票型基金，风险等级较高，预期收益较高，风险收益特征与货币市场基金、债券型基金与货币市基金等不同。

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2011 年 4 月 1 日-2011 年 6 月 30 日)

1.本期已实现收益 4,911,321.13

2.本期利润 -9,148,026.14

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0428

4.期末基金份额净值 210,363,066.44

5.期末基金份额总额 213,721,854.86份

注:1.所列基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或申购基金的各项费用,计算入账后实际收益水平要低于所列数据。

2.所有数据截至 2010 年 6 月 30 日。

3.本公司已实现收益系本期利息收入、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。

4.3 报告期基金的业绩表现

3.2.1 本基金的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益(%) 单位净值(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -8.46% -5.23% 1.04% -0.39% -0.02%

3.2.2 日基金额合同期以来基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

序号 期间(月) 基金资产净值增长率(%) 业绩比较基准收益率(%) 备注

1 1 1.161,967 6,658,070.91

2 6,630,660.72

3 502,607 4,945,652.88

4 346,183 4,666,546.84

5 757,906 4,198,799.24

6 125,396 3,779,435.44

7 271,206 3,547,374.48

8 14,578 3,057,194.14

9 352,204 2,976,123.80

10 593,627 2,647,576.42

3.4 报告期末按投资品种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

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000016 民生银行 1,161,967 3.17

2 601318 中国平安 124,936 2.87

3 600000 中国银行 502,607 2.35

4 601166 兴业银行 346,183 2.22

5 601328 交通银行 757,906 2.00

6 601088 中国神华 125,396 1.80

7 600030 中信证券 271,206 1.69

8 600519 贵州茅台 14,578 1.45

9 600002 万科 A 352,204 1.41

10 601398 中国银行 593,627 1.26

3.4.1 管理人报告期内本基金的前十名股票投资组合重仓股情况

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000016 民生银行 1,161,967 3.17

2 601318 中国平安 124,936 2.87

3 600000 中国银行 502,607 2.35

4 601166 兴业银行 346,183 2.22

5 601328 交通银行 757,906 2.00

6 601088 中国神华 125,396 1.80

7 600030 中信证券 271,206 1.69

8 600519 贵州茅台 14,578 1.45

9 600002 万科 A 352,204 1.41

10 601398 中国银行 593,627 1.26

3.4.2 期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农林、牧、渔业 717,606.49 0.34

2 制造业 24,108,765.28 11.46

3 信息传输、计算机服务和软件业 70,169,692.26 33.36

4 金融、租赁业 11,014,347.47 5.24

5 批发、零售业 740,409.18 0.35

6 木材、家具 1 0.00

7 造纸、印刷 1,040,813.85 2.40

8 电子、通信和其他制造业 1,475,480.54 0.70

9 金属、非金属 19,208,380.16 9.13

10 机械设备 24,855,477.97 11.82

3.4.3 公平交易制度的执行情况

3.4.4 公平交易制度的执行情况

3.4.5 公平交易制度的执行情况

3.4.6 公平交易制度的执行情况

3.4.7 公平交易制度的执行情况

3.4.8 公平交易制度的执行情况

3.4.9 公平交易制度的执行情况

3.4.10 公平交易制度的执行情况

3.4.11 公平交易制度的执行情况

3.4.12 公平交易制度的执行情况

3.4.13 公平交易制度的执行情况

3.4.14 公平交易制度的执行情况

3.4.15 公平交易制度的执行情况

3.4.16 公平交易制度的执行情况

3.4.17 公平交易制度的执行情况

3.4.18 公平交易制度的执行情况

3.4.19 公平交易制度的执行情况

3.4.20 公平交易制度的执行情况

3.4.21 公平交易制度的执行情况

3.4.22 公平交易制度的执行情况

3.4.23 公平交易制度的执行情况

3.4.24 公平交易制度的执行情况

3.4.25 公平交易制度的执行情况

3.4.26 公平交易制度的执行情况

3.4.27 公平交易制度的执行情况

3.4.28 公平交易制度的执行情况

3.4.29 公平交易制度的执行情况

3.4.30 公平交易制度的执行情况

3.4.31 公平交易制度的执行情况

3.4.32 公平交易制度的执行情况

3.4.33 公平交易制度的执行情况

3.4.34 公平交易制度的执行情况

3.4.35 公平交易制度的执行情况

3.4.36 公平交易制度的执行情况

3.4.37 公平交易制度的执行情况

3.4.38 公平交易制度的执行情况

3.4.39 公平交易制度的执行情况

3.4.40 公平交易制度的执行情况

3.4.41 公平交易制度的执行情况

3.4.42 公平交易制度的执行情况

3.4.43 公平交易制度的执行情况

3.4.44 公平交易制度的执行情况

3.4.45 公平交易制度的执行情况

3.4.46 公平交易制度的执行情况

3.4.47 公平交易制度的执行情况

3.4.48 公平交易制度的执行情况

3.4.49 公平交易制度的执行情况

3.4.50 公平交易制度的执行情况

3.4.51 公平交易制度的执行情况

3.4.52 公平交易制度的执行情况

3.4.53 公平交易制度的执行情况

3.4.54 公平交易制度的执行情况

3.4.55 公平交易制度的执行情况

3.4.56 公平交易制度的执行情况

3.4.57 公平交易制度的执行情况

3.4.58 公平