基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2011 年 8 月 27 日

长盛中证 100 指数证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年 6 月 30 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称"中国农业银行")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,投资者在作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

基金简称	长盛中证 100 指数
基金主代码	519100
交易代码	519100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年 11 月 22 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,186,763,533.13 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在 4%以下,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用复制指数投资策略,按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪基准指数。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金,风险中等,将获得证券市场平均收益率。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略,在投资管理上将最大限度的分散非系统性风险。对于跟踪误差的风险,本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	李芳菲
	联系电话	010-82019988	010-63201510
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95599
传真		010-82255988	010-63201816

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—2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,545,447.39
本期利润	6,786,178.57
加权平均基金份额本期利润	0.0056
本期基金份额净值增长率	0.29%
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	-0.1556
期末基金资产净值	1,002,120,160.58
期末基金份额净值	0.8444

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的"期末"均指本报告期最后一日,即 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

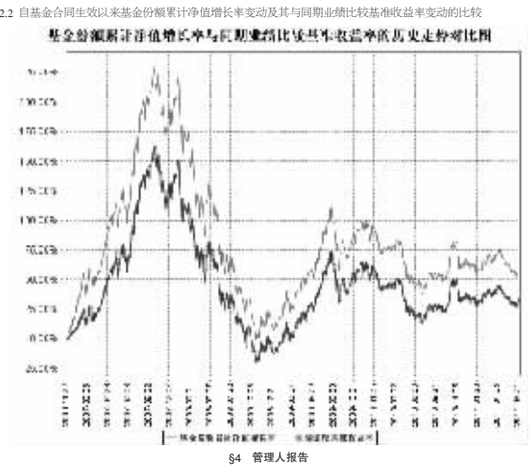
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.03%	1.07%	0.52%	1.09%	0.51%	-0.02%
过去三个月	-3.76%	1.00%	-4.41%	1.02%	0.65%	-0.02%
过去六个月	0.29%	1.12%	-0.35%	1.14%	0.64%	-0.02%
过去一年	15.85%	1.31%	14.66%	1.31%	1.19%	0.00%
过去三年	2.27%	1.92%	-1.23%	1.91%	3.50%	0.01%
自基金合同生效起至今	32.96%	2.06%	59.98%	2.10%	-27.02%	-0.04%

注:本基金基准指数:中证 100 指数

本基金的业绩比较基准中证 100 指数由中证指数有限公司构建和发布。具体的编制规则和再平衡过程请参见中证 100 指数指数编制细则。(网址为:http://www.csindex.com.cn/sseportal/csiportal/zs/jbxx/100bzxz.jsp)

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



§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(包含一支 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		
白仲光	本基金基金经理。	2009年 3 月 9 日	-	8年	男,1969 年 8 月出生,中国国籍。天津大学博士。1991 年至 1997 年在石家庄经济学院任教,2003 年 2 月加入长盛基金管理有限公司,在公司期间历任研究员、高级金融工程师、基金经理、金融工程与量化投资部总监等职务,现任长盛中证 100 指数证券投资基金(本基金)基金经理。

注:1、报经中国证券业协会同意,目前白仲光同志已不再担任长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理,由冯雨生同志担任本基金基金经理。该事项公司已于 2011 年 7 月 13 日进行公告。

2、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;

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛中证 100 指数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,经济增长略有放缓,通胀水平持续走高,央行货币政策趋紧,多次调高存款准备金率和加息。A 股市场整体下行,钢铁、建材等低估值和政策受益的的周期性行业,以及食品饮料、家电等成长性确定的消费类行业跑赢大盘,表现较差的行业是信息设备、信息服务和电子元器件。在风格特征上,大盘股的一年期反转效应非常显著。

在操作中,我们严格遵守基金合同,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为 0.8444 元,本报告期份额净值增长率为 0.29%,同期业绩比较基准增长率为-0.35%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0425%,年度化跟踪误差为 0.6725%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济增长速度可能回升,并伴随物价指数的冲高回落。A 股目前的利润率仍然处于高位,但后期有回落风险。随着 IPO 市场化的进程,A 股各个板块的表现将更多取决于实际经营业绩与预期的对比,而消息面和政策面的影响将逐步减弱。

作为指数基金,我们将继续秉承指数化投资策略,积极应对成份股调整、基金申赎赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,控制基金的跟踪误差,在此基础上本基金将积极采用数量化投资策略增强指数,力争获取超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定,本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值小组,参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据,确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司副总经理(担任估值小组组长)、督察长(担任估值小组组长)及投资管理部、金融工程及量化投资部、研究发展部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组,负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验,具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金未签约与任何估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十八条中对基金利润分配原则的约定,2011 年上半度未实施利润分配。

本基金截至 2011 年 6 月 30 日,期末可供分配利润为-184,643,372.55 元,其中:未分配利润已实现部分为 315,679,907.31 元,未分配利润未实现部分为-500,323,279.86 元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管长盛中证 100 指数证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》等相关法律法规的规定以及《长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》、《长盛中证 100 指数证券投资基金托管协议》的约定,对长盛中证 100 指数证券投资基金管理人—长盛基金管理有限公司 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,长盛基金管理有限公司在长盛中证 100 指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对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

本托管人认为,长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的长盛中证 100 指数证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:长盛中证 100 指数证券投资基金

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	60,758,209.46	55,803,833.19
结算备付金	414,252.89	608,902.98
存出保证金	1,050,000.00	1,050,000.00
交易性金融资产	941,595,231.39	976,673,355.40
其中:股票投资	941,595,231.39	976,673,355.40
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	14,364.19	15,797.91
应收股利	1,802,994.35	-
应收申购款	38,669.69	2,341,522.65
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,005,673,721.97	1,036,493,412.13
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	-	-
应付赎回款	581,772.94	295,509.40
应付管理人报酬	604,366.48	667,080.91
应付托管费	120,873.30	133,416.16
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,316,531.86	1,437,018.12
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	930,016.81	840,418.04
负债合计	3,553,561.39	3,373,442.63
所有者权益:		
实收基金	1,186,763,533.13	1,226,954,396.65
未分配利润	-184,643,372.55	-193,834,427.15
所有者权益合计	1,002,120,160.58	1,033,119,969.50
负债和所有者权益总计	1,005,673,721.97	1,036,493,412.13

注:报告截止日 2011 年 6 月 30 日,基金份额净值 0.8444 元,基金份额总额 1,186,763,533.13 份。

6.2 利润表

会计主体:长盛中证 100 指数证券投资基金

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	12,461,334.25	-383,819,311.90
1.利息收入	240,117.46	255,935.52
其中:存款利息收入	239,499.01	254,085.91
债券利息收入	618.45	1,849.61
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	2,779,970.66	-6,631,609.78
其中:股票投资收益	-8,272,377.93	-13,658,998.50
基金投资收益	-	-
债券投资收益	319,047.85	82,538.89
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	10,733,300.74	6,944,849.83
3.公允价值变动收益(损失以"-"填列)	9,331,625.96	-377,541,563.17
4.汇兑收益(损失以"-"填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"填列)	109,620.17	97,925.53
减:二、费用	5,675,155.68	6,548,027.42
1.管理人报酬	3,849,183.09	4,398,622.62
2.托管费	769,836.58	879,724.57
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	868,433.90	1,086,568.12
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	187,702.11	183,112.11
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	6,786,178.57	-390,367,339.32
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	6,786,178.57	-390,367,339.32

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛中证 100 指数证券投资基金

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)	1,226,954,396.65	-193,834,427.15	1,033,119,969.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,786,178.57	6,786,178.57
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)	-40,190,863.52	2,404,876.03	-37,785,987.49
其中:1.基金申购款	127,213,877.34	-18,901,023.73	108,312,853.61
2.基金赎回款	-167,404,740.86	21,305,899.76	-146,098,841.10
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)	1,186,763,533.13	-184,643,372.55	1,002,120,160.58
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)	1,302,134,429.53	97,818,601.08	1,399,953,030.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-390,367,339.32	-390,367,339.32
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)	48,369,991.22	-9,124,282.38	39,245,708.84
其中:1.基金申购款	172,174,535.81	-17,726,580.90	154,447,954.91
2.基金赎回款	-123,804,544.59	8,602,298.52	-115,202,246.07
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)	-	-64,463,414.53	-64,463,414.53
五、期末所有者权益(基金净值)	1,350,504,420.75	-366,136,435.15	984,367,985.60

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

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本报告期不存在会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本报告期不存在会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本报告期不存在差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内,未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司("长盛基金")	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行	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	490,117,854.75	89.02%	525,059,542.32	74.68%

6.4.4.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

6.4.4.1.3 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国元证券	4,350,666.30	100.00%	8,121,388.50	100.00%

6.4.4.1.4 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	415,414.05	89.43%	232,840.14	17.69%
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	446,301.03	75.53%	874,161.93	39.81%

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	3,849,183.09	4,398,622.62
其中:支付销售机构的客户维护费	932,020.88	1,074,105.93

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 0.75%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

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	769,836.58	879,724.57

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/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

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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

除基金管理人之外的其他关联方本期及上年度可比期间未投资本基金。

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
中国农业银行	60,758,209.46	231,521.82	52,842,438.24	246,035.37

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,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

本基金本期及上年度可比期间均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

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2011 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期未无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.6.1 公允价值

1、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。

2、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中属于第一层级的余额为 941,595,231.39 元,无属于第二层级的余额和第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日:第一层级 976,673,355.40 元,无属于第二层级的余额和第三层级的余额)。

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:同)。

6.4.6.2 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	941,595,231.39	93.63
	其中:股票	941,595,231.39	93.63
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	-	-
	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	61,172,462.35	6.08
6	其他各项资产	2,906,028.23	0.29
7	合计	1,005,673,721.97	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	128,223,256.84	12.80
C	制造业	231,662,951.01	23.12
C0	食品、饮料	51,654,505.11	5.15
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,088,592.09	1.31
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	46,804,011.36	4.67
C7	机械、设备、仪表	114,879,082.45	11.46
C8	医药、生物制品	1,548,400.00	0.15
C99	其他制造业	3,688,360.00	0.37
D	电力、煤气及水的生产和供应业	19,074,941.96	1.90
E	建筑业	28,843,738.45	2.88
F	交通运输、仓储业	34,662,963.86	3.46
G	信息技术业	22,669,463.25	2.26
H	批发和零售贸易	14,553,671.58	1.45
I	金融、保险业	384,941,996.35	38.41
J	房地产业	32,741,014.22	3.27
K	社会服务业	6,160,893.34	0.61
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	3,344,551.25	0.33
	合计	906,879,442.11	90.50

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,402,400.00	0.24
B	采掘业	-	-
C	制造业	23,099,960.00	2.31
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	10,000,200.00	1.00
C7	机械、设备、仪表	4,958,000.00	0.49
C8	医药、生物制品	8,141,760.00	0.81
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	2,080,000.00	0.21
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	7,133,429.28	0.71
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	34,715,789.28	3.46

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	3,766,508	49,039,934.16	4.89
2	601318	中国平安	951,651	45,936,193.77	4.58
3	600016	民生银行	6,566,848	37,628,039.04	3.75
4	601328	交通银行	5,631,000	31,195,740.00	3.11
5	600000	浦发银行	3,027,596	29,791,544.64	2.97
6	601088	中国神华	892,447	26,898,352.58	2.68
7	600030	中信证券	2,015,417	26,361,654.36	2.63
8	601166	兴业银行	1,932,013	26,043,535.24	2.60
9	600519	贵州茅台	104,745	22,271,929.35	2.22
10	000002	万 科 A	2,618,873	22,129,476.85	2.21

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

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600111	包钢稀土	140,000	10,000,200.00	1.00
2	600256	广汇股份	299,976	7,133,429.28	0.71
3	000425	徐工机械	200,000	4,958,000.00	0.49
4	000538	云南白药	72,000	4,109,760.00	0.41
5	601607	上海医药	240,000	4,032,000.00	0.40

注:投资者欲了解本报告期末基金的所有积极投资股票明细,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	600016	民生银行	32,000,454.50	3.10
2	600050	中国联通	18,184,160.49	1.76
3	600111	包钢稀土	10,117,773.50	0.98
4	600036	招商银行	9,808,149.48	0.95
5	000338	潍柴动力	8,645,889.76	0.84
6	600048	保利地产	7,580,000.00	0.73
7	600256	广汇股份	6,968,694.20	0.67
8	600115	东方航空	6,749,854.75	0.65
9	600583	海油工程	6,659,645.11	0.64
10	600547	山东黄金	6,470,562.60	0.63
11	601788	光大证券	5,834,973.00	0.56
12	601111	中国国航	5,824,241.00	0.56
13	600585	海螺水泥	5,465,771.76	0.53
14	600104	上海汽车	5,290,000.00	0.51
15	601989	中国重工	5,134