长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

2011 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。

基金托管人中国银行股份有限公司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

基金简称	长盛创新先锋混合
基金主代码	080002
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
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
报告期末基金份额总额	138,081,045.88份
基金合同存续期	不定期

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	唐州徽
	联系电话	010-82019988	010-66594855
	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	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

§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	1,209,703.15
本期利润	-6,824,485.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0498
本期基金份额净值增长率	-4.67%
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	0.0600
期末基金资产净值	146,368,784.80
期末基金份额净值	1.0600

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	1.28%	0.81%	1.01%	0.77%	0.27%	0.04%
过去三个月	-2.69%	0.77%	-3.32%	0.71%	0.63%	0.06%
过去六个月	-4.67%	0.90%	-0.94%	0.80%	-3.73%	0.10%
过去一年	20.82%	1.02%	13.34%	0.91%	7.48%	0.11%
过去三年	45.62%	1.24%	14.41%	1.31%	31.21%	-0.07%
自基金合同生效起至今	45.67%	1.22%	-3.01%	1.34%	48.68%	-0.12%

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。

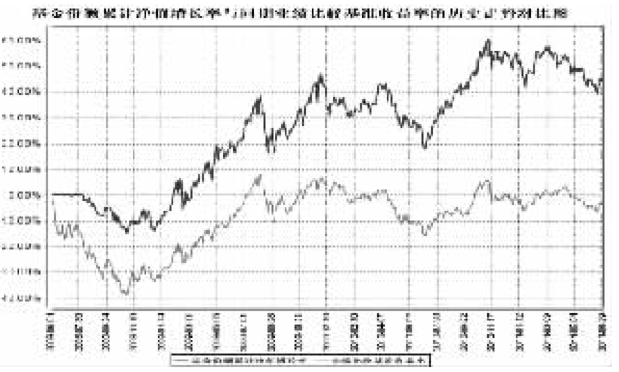
沪深300指数是沪深证券交易所联合发布的反映A股市场整体走势的成份股指数，由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成，样本覆盖了沪深市场约六成的市值，具有良好的市场代表性。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准，较为合适。

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2011年6月30日）



§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（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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李庆林	本基金基金经理。	2010年3月3日	—	8年	男，1974年10月出生，中国国籍。中国人民大学硕士。曾先后在长城证券有限公司、国元证券有限公司和建信基金管理有限公司担任研究员等职务。2009年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究发展部副总监，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。

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

2011年上半年，出于对通胀以及宏观调控的恐惧，市场出现一定幅度的回落。面对通胀节节攀高的压力，政府采取了一系列措施对宏观经济调控。其中最主要就是银行体系法定准备金率接近历史新高。准备金率的提高一方面有效地回收了外贸盈余和资本流入所带来的基础货币的扩张，另一方面也有效的限制了银行信贷的扩张。不过，凡事总有两方面。在通胀走高的情况下，流动性的紧缩也造成了实体经济增长的放缓。出于对未来经济的悲观预期，资本市场以调整为主。

上半年，本基金有效地调整了组合的行业配置。由于中等市值股票调整幅度过大，导致基金的上半年组合表现同基准相比并不理想。

4.4.2 本基金业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.0600元，本报告期份额净值增长率为-4.67%，同期业绩比较基准增长率为-0.94%。

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

下半年，我们认为国内经济仍处于放缓的过程中。一方面我们认为在通胀率高企的情况下政府宏观经济政策难以放松，另一方面，持续的通胀对实体经济的危害将逐渐显现。房地产和地方融资平台仍将是资本市场难以回避的两个难题。

预计随着调控效果的浮现，上市公司盈利增速将有一定程度的下滑。在整体估值水平较低水平的情况下，资本市场将处于震荡之中。短期内政府政策的变化会给市场带来一定的机会，长期内仍然要等待合理的投资机会。

4.5.2 本基金下阶段投资策略

本基金下阶段将精选个股，自下而上寻求投资机会。

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十七条中对基金利润分配原则的约定，2011年上半年度未实施利润分配。

本基金截至2011年6月30日，期末可供分配利润为8,287,738.92元，未分配利润已实现部分为10,518,812.44元，未分配利润未实现部分为-2,231,073.52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

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：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	15,256,858.65	12,938,913.70
结算备付金	96,352.26	381,722.23
存出保证金	1,000,000.00	1,000,000.00
交易性金融资产	131,560,740.71	145,266,352.42
其中：股票投资	104,713,010.71	115,708,792.42
基金投资	-	-
债券投资	26,847,730.00	29,557,560.00
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	-	-
应收利息	597,269.91	495,808.55
应收股利	116,536.46	-
应收申购款	471,645.18	43,745.97
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	149,099,403.17	160,126,542.87
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	867,177.25	-
应付赎回款	552,810.26	123,553.47
应付管理人报酬	176,831.18	224,422.14
应付托管费	29,471.85	37,403.68
应付销售服务费		-
应付交易费用	194,390.86	233,951.17
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	909,936.97	800,216.42
负债合计	2,730,618.37	1,419,546.88
所有者权益：		
实收基金	138,081,045.88	142,732,713.73
未分配利润	8,287,738.92	15,974,282.26
所有者权益合计	146,368,784.80	158,706,995.99
负债和所有者权益总计	149,099,403.17	160,126,542.87

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值：1.0600元，基金份额总额138,081,045.88份。

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：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	-5,003,524.82	-21,850,871.99
1.利息收入	493,355.68	455,483.92
其中：存款利息收入	43,015.81	138,001.47
债券利息收入	450,339.87	317,482.45
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）	2,492,520.57	-6,811,146.67
其中：股票投资收益	2,134,626.87	-6,677,950.28
基金投资收益	-188,960.00	-
债券投资收益	-	-344,841.01
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	546,853.70	211,644.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-8,034,188.97	-15,770,462.32
4.汇兑收益（损失以“-”填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”填列）	44,787.90	275,253.08
减：二、费用	1,820,961.00	3,012,603.77
1.管理人报酬	1,113,320.81	1,324,196.23
2.托管费	185,553.47	220,699.39
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	356,643.87	1,301,431.00
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	165,442.85	166,277.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-6,824,485.82	-24,863,475.76
所得税费用（以“-”号填列）	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-6,824,485.82	-24,863,475.76

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：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）	142,732,713.73	15,974,282.26	158,706,995.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		-6,824,485.82	-6,824,485.82
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）	-4,651,667.85	-862,057.52	-5,513,725.37
其中：1.基金申购款	32,686,312.67	3,473,478.42	36,159,791.09
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-37,337,980.52	-4,335,535.94	-41,673,516.46
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）	138,081,045.88	8,287,738.92	146,368,784.80
项目	上年度可比期间金额 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）	156,785,782.84	21,936,525.43	178,722,308.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-24,863,475.76	-24,863,475.76
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）	-14,006,293.55	2,148,185.45	-11,858,108.10
其中：1.基金申购款	186,486,570.29	23,820,380.43	210,306,950.72
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-200,492,863.84	-21,672,194.98	-222,165,058.82
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）	142,779,489.29	-778,764.88	142,000,724.41

注：后附财务报表附注为本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、注册登记机构、基金销售机构

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

本基金未开立关联方交易单元。

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
当期应支付的管理费	1,113,320.81	1,324,196.23
其中：支付销售机构的客户维护费	129,978.31	165,116.95

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。

6.4.4.2.2 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2009年6月30日
当期应支付的托管费	185,553.47	220,699.39

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。

6.4.4.3 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
中国银行	-	-	-	-	-	-
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
中国银行	-	39,879,141.54	-	-	-	-

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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2008年6月4日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	45,021,400.00	45,021,400.00
期间认购总份额	-	--
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	32.61%	31.53%

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	
	期末金额	当期利息收入	期末金额	当期利息收入
中国银行	15,256,858.65	41,366.19	28,871,387.43	127,017.94

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。

6.4.4.6 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未在承销期内参与关联方承销证券。

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

本基金本期末无因认购新发/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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000876	新希望	2011-06-29	重大事项停牌	19.95	2011-07-05	21.95	100,000	1,841,212.80	1,995,000.00	

注：本基金截至2011年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

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131,560,740.71元，无属于第二、第三层级的余额（2010年12月31日：第一层级132,980,352.42元，第二层级12,286,000.00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：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	104,713,010.71	70.23
	其中：股票	104,713,010.71	70.23
2	固定收益投资	26,847,730.00	18.01
	其中：债券	26,847,730.00	18.01
	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	15,353,210.91	10.30
6	其他各项资产	2,185,451.55	1.47
7	合计	149,099,403.17	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	1,960,000.00	1.34
B	采掘业	11,219,160.00	7.66
C	制造业	60,908,100.28	41.61
C0	食品、饮料	19,806,068.00	13.53
C1	纺织、服装、皮毛	1,710,793.12	1.17
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,969,800.00	4.08
C5	电子	1,342,000.00	0.92
C6	金属、非金属	10,855,800.00	7.42
C7	机械、设备、仪表	10,348,200.00	7.07
C8	医药、生物制品	10,875,439.16	7.43
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,026,000.00	2.75
F	交通运输、仓储业	3,029,947.83	2.07
G	信息技术业	4,059,702.60	2.77
H	批发和零售贸易	6,352,500.00	4.34
I	金融、保险业	10,427,400.00	7.12
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,730,200.00	1.87
	合计	104,713,010.71	71.54

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	600036	招商银行	460,000	5,989,200.00	4.09
2	000581	威孚高科	150,000	5,782,500.00	3.95
3	000963	华东医药	200,000	4,854,000.00	3.32
4	000895	双汇发展	70,000	4,624,900.00	3.16
5	000538	云南白药	79,700	4,549,276.00	3.11
6	000656	ST东源	330,000	4,521,000.00	3.09
7	000001	深发展A	260,000	4,438,200.00	3.03
8	600362	江西铜业	120,000	4,252,800.00	2.91
9	600887	伊利股份	250,000	4,162,500.00	2.84
10	000415	ST汇通	300,000	4,026,000.00	2.75

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	000001	深发展A	8,362,257.93	5.27
2	600036	招商银行	6,248,600.00	3.94
3	600060	海信电器	4,733,063.22	2.98
4	600887	伊利股份	4,465,920.35	2.81
5	600309	烟台万华	3,874,690.20	2.44
6	600498	烽火通信	3,598,073.80	2.27
7	000895	双汇发展	3,368,746.15	2.12
8	601006	大秦铁路	3,357,880.42	2.12
9	601088	中国神华	3,263,959.14	2.06
10	600739	辽宁成大	3,212,529.49	2.02
11	600585	海螺水泥	3,041,935.00	1.92
12	000540	中天城投	2,942,551.39	1.85
13	000935	四川双马	2,914,437.00	1.84
14	000024	招商地产	2,496,123.00	1.57
15	600557	康缘药业	2,312,482.16	1.46
16	000680	山推股份	2,135,124.18	1.35
17	601111	中国国航	2,105,197.94	1.33
18	600425	青松建化	2,095,738.28	1.32
19	600252	中恒集团	2,083,383.75	1.31
20	002534	杭锅股份	2,053,815.47	1.29

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	000001	深发展A	10,476,423.97	6.60
2	000937	冀中能源	5,925,250.47	3.73
3	000729	燕京啤酒	5,650,491.56	3.56
4	002367	康力电梯	5,324,578.31	3.35
5	000581	威孚高科	4,369,865.00	2.75
6	002010	传化股份	4,212,306.43	2.65
7	000513	丽珠集团	4,014,128.78	2.53
8	600060	海信电器	3,298,182.73	2.08
9	600585	海螺水泥	3,239,702.77	2.04
10	600588	用友软件	3,192,837.23	2.01
11	600739	辽宁成大	3,177,601.00	2.00
12	600498	烽火通信	2,943,985.00	1.85
13	000415	ST汇通	2,590,424.00	1.63
14	000024	招商地产	2,503,064.70	1.58
15	000540	中天城投	2,476,427.58	1.56
16	600815	厦工股份	2,444,338.30	1.54
17	600252	中恒集团	2,415,128.02	1.52
18	000935	四川双马	2,363,100.00	1.49
19	000680	山推股份	2,340,244.82	1.47
20	600790	轻纺城	2,081,348.80	1.31

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	114,360,130.31
卖出股票收入（成交）总额	119,480,969.92

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	26,847,730.00	18.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	26,847,730.00	18.34

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	010110	21国债10	214,000	21,361,480.00	14.59
2	010112	21国债12	55,000	5,486,250.00	3.75

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 期末其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,000,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	116,536.46
4	应收利息	597,269.91
5	应收申购款	471,645.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,185,451.55

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

本基金本报告期末未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
16,493	8,372.10	56,151,801.59	40.67%	81,929,244.29	59.33%

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

项目	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	297,390.80	0.22%

§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
本报告期期初基金份额总额	142,732,713.73
本报告期基金总申购份额	32,686,312.67
减：本报告期基金总赎回份额	37,337,980.52
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	138,081,045.88

§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 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理；因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理。该人事变动已按相关规定备案并公告。

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		债券交易		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	成交金额	占当期债券成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
银河证券	1	-	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-	-
光大证券	1	12,474,327.93	5.33%	-	-	10,135.43	5.21%
华宝证券	1	104,183,805.32	44.55%	-	-	84,649.69	43.55%
安信证券	1	-	-	-	-	-	-
平安证券	1	34,899,689.06	14.92%	-	-	29,664.91	15.26%
国金证券	1	82,283,277.92	35.19%	7,503,750.00	100.00%	69,940.83	35.98%

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、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：无。

（2）本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。