金额单位:人民币元

0.62

# 信息披露 Disclosure

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

11 里安远小 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

基金柱管人中国银行股份有限公司《以下简称 中国银行" 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,利润分配销况,财务会计报告,投资组合报告等内容,保证复核内容 不存在虚假过载,误导性账述或者重大选漏。 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

视界力及具更新。 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。

基金名称	同盛证券投资基金	
基金简称	长盛同盛封闭	
基金主代码	184699	
交易代码	184699	
基金运作方式	契约型封闭式	
基金合同生效日	1999年 11 月 5 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	3,000,000,000.00 份	
基金合同存续期	15年	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	1999年 11 月 26 日	

2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金圖干成长价值复合型基金,主要找资于业绩能够转线高速增长的成长型上市公司 和市场价值被低估的价值型上市公司,利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更 好的分散和控制风险,实现基金货产的稳定增长。
投资策略	本基金将根据市场发展情况。确定在一段时间内市场发展的总体趋势,并在此基础上确定 股票和国值的和置比例以及股票投资中成长型投资和价值型投资的配置比例。并分别选 取成长型特征最明显的股票和价值型特征最明显的股票进行组合投资。
业绩比较基准	无

风险收益特征		无		
2.3 基金	管理人和基	金托管人		
J	页目	基金包	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
	姓名	叶金松		唐州徹
信息披露 负责人	联系电话	010-82019988		010-66594855
,,,,,,	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn		tgxxpl@bank-of-china.com
<b>400-888-2666</b> 客户服务电话 010-62350088		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.csf	unds.com.cn	
基金半年度报	年度报告备置地点 基金管理人和基		基金托管人的办公地址	
		00 + T	タルニ ちせ へ タ は	± 10

§3 主要财务指标和基金净值表现

	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	216,168,809.71
本期利润	-28,855,313.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0096
本期基金份額净值增长率	-1.04%
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額利润	0.0768
期末基金资产净值	3,729,000,796.30
期末基金份额净值	1.2430

所列敦学。

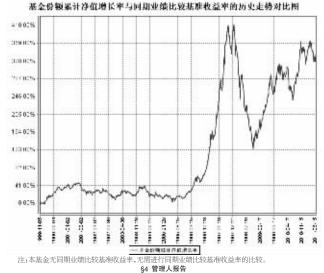
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入、伓含公允价值变动收益 加除相关费用后的余额、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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"均指本报台期最后一日,即6月30日。

3.2 基金净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②
过去一个月	3.47%	2.26%
过去三个月	-2.46%	2.13%
过去六个月	-1.04%	2.19%
过去一年	30.83%	2.36%
过去三年	41.63%	2.98%
自基金合同生效起至今	347.27%	2.64%

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



4.1 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路会证监案字 [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%。裁止 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系参核。

4.1.2	4.1.2 基金经理 咸基金经理小组 )及基金经理助理简介					
姓名	姓名 职务		任本基金的基金经理(助理)期 限		说明	
		任职日期	离任日期	限		
侯继雄	本基金基金经 理,研究发展部 总监。	2008年8月11日	-	10年	男,1974年5月出生,中国国籍。清华大学博士。2001年4月至2007年2月在國泰君安止蒙姆的於托研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司、现任研究发展都总算。同盛证券投资基金(本基金)基金经理。	
丁骏	本基金基金经理,长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理。	2008年4月25日	-	10年	男。1974年11月出生、中国国籍。中国社会 科学院经济学博士,历任中国建设银行浙江 省分行国际业务部本外币交易员,然济市。 国泰君安证券股份有限公司企业融资率业 务经理、高级经理、2003年6月加入长盛基 金管理有限公司、大语担任行业研究员。组 在经理助理。现任长度简等的成长混合量 证券投资基金基金经理。同盛证券投资基金	

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;

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、 能券从业年限"中 能券从业"的含义遵从行业协会 征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 征券投资基金法,没其各项实施准则、 伺盛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 征券投资基金管理公司公平交易制度指导意见,汲公司相关制度等规定,从投资投权,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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.33 开册又创了2010年905的 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年市场在对高通胀的恐惧中开启,通胀的预期不断上调,货币当局的紧缩则不断升温,1月份资金 面相当繁求,市场在恐怖中下跌;2月份通胀压力略有缓解,市场的反弹又超出预期;3月份通胀平再次超预期上升,但市场则呈现震荡平稳之势。2季度,通胀的严峻性超出了市场的预期,使得货币政策和信贷更更趋一房,加之前期的房地产限的废放中汽车消费补贴政策退出的影响也不彻克思,使得2季度经济下滑支持更加明显。乐观的投资者纠结于经济下滑和估值很低的矛盾中,悲观的投资者则纠结于硬着陆与软着 陆的困惑中。最终在股市中显现为逐渐下跌之势。总体看,通胀升、政策紧、市场跌"通胀降、政策松、市场

深"的逻辑仍是成立的。 同盛认可投资者对经济的担忧,但也认为市场估值已有相当吸引力。因此在仓位上维持在略偏高的水平,略微根据市场情绪的波动做少量的操作。主要方向则集中在结构调整和个股选择上。总体看上半年的运

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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 1.2430 元,本报告期份额净值增长率为-1.04%。 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 下半年,通帐回落的势头将是明确的,但通帐的绝对水平仍然会维持在高位,这限制了政府再次宽松货 币的空间和能力,就经济总量而言,保障房建设。高铁建设、水利建设,中西部发展和城市化仍能对推动经济 增长贡献力量。但经济结构调整的压力也在不断加大。具体表现为投资占比持续增加,内需不振,贫富差距 加大,政府和民间的经济能力相差太大,资源能源压力大,等等。因此,未来同盛的关注点更要放在细分行业 的发展和有特色竞争力的企业的发展之上。考虑等通畅胀的回落。经济环化压解贴近等因素,同盛短期将继续 对市场保持谨慎乐观的看法,重点考虑大盘监察。周期类成长股、稳定消费股的机会。 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,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 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但任估值小组组长)督察长。但任估值小组组长,及投资管理部、金融工程及量化投资部、研究发展部,监察储备部、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

刀。 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。

本基金不念约与日刊向值相大的定价服务。 4.7 管理人对报告期户基金种间分配情况的说明 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,本基金于 2011 年 3 月 25 日对 2010 年收益进行了分配,分配金额为 270,000,000.00 元。

## 同盛证券投资基金

### 2011 半年度 报告摘要

#### 2011年6月30日

关联方名称

本基金截至2011年6月30日,期末可供分配收益为230,410,359.98元,其中:未分配收益已实现部分 为 230,410,359.98 元,未分配收益未实现部分为 498,590,436.32 元。

副人人投資組合报告等数据具头、准确和 §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:同盛证券投资基金报告截止日:2011年6月30日

ater who	本期末	上年度末
资产	2011年6月30日	2010年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	202,133,136.99	127,966,145.6
结算备付金	627,103.46	3,812,267.2
存出保证金	1,106,357.38	1,009,265.4
交易性金融资产	3,548,466,374.43	3,895,502,661.8
其中:股票投资	2,779,916,440.83	3,022,017,574.5
基金投资	-	
债券投资	768,549,933.60	873,485,087.3
资产支持证券投资	_	
衍生金融资产	_	
买人返售金融资产	_	
应收证券清算款	_	
应收利息	8,221,410.66	11,043,514.7
应收股利	-	
应收申购款	_	
递延所得税资产	-	
其他资产	-	
资产总计	3,760,554,382.92	4,039,333,854.9
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	19,096,698.99	
应付赎回款	-	
应付管理人报酬	4,466,009.95	5,133,795.4
应付托管费	744,334.98	855,632.5
应付销售服务费	-	
应付交易费用	4,711,898.26	3,069,425.7
应交税费	1,823,891.66	1,823,891.6
应付利息	-	
应付利润	_	
递延所得税负债	-	
其他负债	710,752.78	595,000.0
负债合计	31,553,586.62	11,477,745.4
所有者权益:		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000,000.0
未分配利润	729,000,796.30	1,027,856,109.4
所有者权益合计	3,729,000,796.30	4,027,856,109.4
负债和所有者权益总计	3,760,554,382.92	4,039,333,854.9

6.2 利润表会计主体:同盛证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

1.利息收入			单位:人民币元
1.利息收入	項 目	2011年1月1日	2010年1月1日
集中: 存款利息收入 575,090.90 567,066.97 68余利息收入 14,794,541.09 7,239,074,31 66产 2持連券利息收入 14,794,541.09 7,239,074,31 66产 2持連券利息收入 125,736.42 -	一、收入	10,371,464.24	-618,465,441.38
關參利島收入 14.794.541.09 7.239.074.31	1.利息收入	15,495,368.41	7,806,131.28
渡产支持证券利息收入	其中:存款利息收入	575,090.90	567,056.97
	债券利息收入	14,794,541.09	7,239,074.31
其他利息收入 — — — — — — — — — — — — — — — — — — —	资产支持证券利息收人	_	_
24. 中級與投資收益	买人返售金融资产收人	125,736.42	_
其中,股票投資收益	其他利息收人	-	_
議金投資收益	2.投资收益(损失以"-"填列)	239,900,218.67	102,455,780.45
勝登投資收益	其中:股票投资收益	230,377,708.82	93,814,767.78
廃产支持证券投資收益 - 一方年工具収益 - 10,568,485,11 3,55分价值变动收益(損失以*-*域列) -245,024,122.84 -728,748,355,71 4,正兑收益(損失以*-*域列) - 21,0026,66 4,正兑收益(損失以*-*域列) - 21,0026,66 4,正免収益(損失以*-*域列) - 21,0026,66 4,正免収益(損失以*-*域列) - 21,0026,66 4,203,027,035,45 4,203,027,035,45 4,203,027,035,45 4,785,653,40 4,303,027,08 3,31曾服券費	基金投资收益	-	_
房生工具収益	债券投资收益	-2,501,043.47	-1,927,472.44
股利收益 12.023.553.32 10.568.485.11 3.公允价值变动收益(損失以""填列) -245.024,122.84 -728.748.355.71 (几.记收益(損失以""填列) - 121.002.66 (損失以""填列) - 21.002.66 (損失以""填列) 39.226.777.37 33.727.035.45 (且管理人根附 28.713,920.42 25.818.162.53 (上管管 4.785,653.40 4.303.027.05 (上管管 4.785,653.40 4.303.027.05 (自身股份) 4.003.027.05 (自身股份) 4.	资产支持证券投资收益	_	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"填列) -245,024,122.84 -728,748,355,71 -245,024,122.84 -728,748,355,71 -21,002.66 -21,002.66 -22,1002.66 -23,140%人(损失以"-"填列) -21,002.66 -23,140%人(损失以"-"填列) -21,002.66 -23,140% -24,140% -	衍生工具收益	_	_
4. 元泉収益(損失以**境列) - 21,002.66 (損失以**境列) - 21,002.66 (損失以**境列) - 21,002.66 (損失以**境列) - 21,002.66 (損害人) - 21,002.66 (損害人) - 25,818,162.53 (25,818,162.53 (25,818,162.53 (25,818,162.53 (25,818,162.53 (25,818,162.53 (25,818,162.53 (25,818,162.53 (25,818,162.53 (25,818)) - 25,818,162.53 (25,818)	股利收益	12,023,553.32	10,568,485.11
5.其他収入(損失以"-"填列)     -     21,002.66       歳;二、費用     39,226,777.37     33,727,035.45       1.管理人报酬     28,713,920.42     25,818.162.53       2.托管費     4,785,653.40     4,303,027.55       3.销售服务费     -     -       4.交易費用     3,955,175.60     3,294.678.72       5.利息支出     741,474.80     88,976.93       其中,卖出回购金融资产支出     741,474.80     88,976.93       法,他费用     1,030,553.15     222,190.22       三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)     -28,855,313.13     -652,192,476.83       点、所得税费用     -     -	3.公允价值变动收益(损失以"="填列)	-245,024,122.84	-728,748,355.71
議:	4.汇兑收益(损失以"="填列)	-	_
1.管理人报酬 28.713,920.42 25.818.162.53 2.月管費 4,785,653.40 4,303,027.05 3,319届服务費	5.其他收入(损失以"="填列)	_	21,002.60
2.托替費 4,785,653.40 4,303,027.05 3.销售服务費	减:二、费用	39,226,777.37	33,727,035.45
	1.管理人报酬	28,713,920.42	25,818,162.53
4.交易費用     3.955,175,60     3.294,678,72       5.利息支出     741,474,80     88,976,93       填中,卖出回购金融资产支出     741,474,80     88,976,93       5.利息、報告     741,474,80     88,976,93       5.根他費用     1.030,553,15     222,190,22       三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)     -28,855,313,13     -652,192,476,83       6家,所得稅费用     -     -	2.托管费	4,785,653.40	4,303,027.05
5.利息支出 741,474.80 88,976.93 其中,麦出回购金融资产支出 741,474.80 88,976.93 た北他费用 1.030.553.15 222.190.22 三.利润息額(予損息額以"-"号填列) -28.855,313.13 -652.192,476.83 味,所得稅费用 -	3.销售服务费	-	_
其中,卖出回购金融资产支出 741,474.80 88,976.93 6.其他费用 1,030,553.15 222,190.22 三、利润总额(亏损总额以"—"号填列) —28.855,313.13 —652,192,476.83 66,所得税费用	4.交易费用	3,955,175.60	3,294,678.72
6.其他费用 1,030,553.15 222,190.22 三.利润总额(亏损总额以"—"号填列) —28.855.313.13 —652,192,476.83 。 请,将段费用	5.利息支出	741,474.80	88,976.93
<ul><li>三、利润总额(亏损总额以"-"亏填列)</li><li>-28.855,313.13</li><li>-652,192,476.83</li><li>-</li><li>-</li></ul>	其中:卖出回购金融资产支出	741,474.80	88,976.93
域:所得税费用	6.其他费用	1,030,553.15	222,190.22
	三、利润总额(亏损总额以"="号填列)	-28,855,313.13	-652,192,476.83
四、净利润(净亏损以"-"号填列) -28,855,313.13 -652,192,476.83	减:所得税费用	-	_
	四、净利润(净亏损以"="号填列)	-28,855,313.13	-652,192,476.83

6.3 所有者权益 基金净值 )变动表

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日。

			单位:人民币元
本期 項 目 2011年1月1日至2011年6月30日			30 ⊟
	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)	3,000,000,000.00	1,027,856,109.43	4,027,856,109.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本 期利润)	-	-28,855,313.13	-28,855,313.13
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 基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-270,000,000.00	-270,000,000.0
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	729,000,796.30	3,729,000,796.3
项目	上年度可比期间 2010 <sup>2</sup>	F 1 月 1 日至 2010 年 6 月	30 ⊟
	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)	3,000,000,000.00	699,006,948.24	3,699,006,948.2
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-652,192,476.83	-652, 192, 476.8
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 基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	46,814,471.41	3,046,814,471.4

戴君棉

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

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

本基金本报告期所采用的会计放策。会计估计与最近一期年度报告一致。 6.42。会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明 6.421。会计政策变更的说明,本报告期不存在会计改策变更。 6.422。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

6.4.2 关联方关系 6.4.2 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未发生变化的情况。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

基金发起人、基金管理

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 以下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3	C93			金额单位:人民币元
关联方名称	本 2011年1月1日至		上年度可 2010年1月1日至	
大联万石桥	成交金額	占当期股票成交总额的 比例	成交金額	占当期股票成交总额的 比例
长江证券	95,928,008.84	3.81%	-	-
中信证券	11,001,207.66	0.44%	-	-
日元证券	434,404,321.35	17.24%	873,510,604.85	41.91%
合计	541,333,537.85	21.48%	873,510,604.85	41.91%
6.4.4.1.2 权证3	Σ易			

本基金于本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

				金额单位:人民币元
<b>子学士なか</b>	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	
关联方名称 —	成交金額	占当期债券成交总额的 比例	成交金額	占当期债券成交总额的 比例
<b>公江证券</b>	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-
10元证券	-	-	21,504,949.24	100.00%
合计	-	-	21,504,949.24	100.00%
6.4.4.1.4 债券回	回购交易	•		

		ſ	
	金额单位:人民币元		
上年度可比期间			
2010年1月1日至2010年6月30日			
成交金額	占当年回购成交总额的		
从人工的	比例		
-	-		
_	-		

6.4.4.1.5 应支付关联方佣金 金额单位:人民币元

2011年1月1日至2011年6月30日

天联力名称	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末佣金余额	占期末应付佣金余额的 比例		
长江证券	77,941.79	3.69%	416,730.16	8.86%		
中信证券	8,938.54	0.42%	8,938.54	0.19%		
国元证券	368,256.86	17.42%	715,729.49	15.21%		
合计	455,137.19	21.53%	1,141,398.19	24.26%		
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					
大联刀右桥	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末佣金余額	占期末应付佣金余额的 比例		
长江证券	-	-	268,952.50	8.64%		
中信证券	-	-	-	-		
国元证券	731,968.46	42.04%	1,201,928.52	38.62%		
스壮	731 068 46	42.04%	1 470 881 02	47.26%		

注:1.上述佣金按市场佣金率计算,以打除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费,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。 6.4.4.2.1 基金管理费

本期 2011年1月1日 至 2011年6月30 上年度可比期间 2010年1月1日 至2010年6月30日 项目

注:在通常情况的每条户编标或 注:在通常情况下,基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提,本基金成立三个月 后、若持有现金的比例超过本基金资产净值的 20%,超出部分不计提基金管理费。计算方法如下: H=Ex1.50%当年天数 H为每日应计提的基金管理费 E.为前一日的基金资产净值 们除本基金持有现金比例超过 20%部分的基金资产净值) 基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内 从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.4.2.2 基金托管费	21-12-12-12-13-13-13-13-13-13-13-13-13-13-13-13-13-	
		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	4,785,653.40	4,303,027.05
注:基金托管费按前一日的基金资产净 H=E×0.25%/当年天数 H为每日应计提的基金托管费 E为前一日的基金资产净值		

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 焓回购 )交易:

						单位:人民币元	
银行间市场 交易的			本 2011年1月1日至	期 2011年6月30日			
各关联方名	债券交易。	金額	基金逆回购		基金正回购		
称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金额	利息支出	
中国银行	49,724,291.76	-	-	-	-	-	
合计	49,724,291.76	-	-	-	-	-	
银行间市场 交易的		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日					
各关联方名	债券交易。	金額	基金逆回购		基金正回购		
称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出	
中国银行	79,708,909.59	-	-	-	345,600,000.00	60,219.62	
合计	79,708,909.59	-	-	-	345,600,000.00	60,219.62	
6.4.4.4	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(1999年11月5日)持 有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
期初持有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
期间申购/买人总份额	_	-
期间因拆分增加的份额	_	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.20%	0.20%

6.4.4.4.2 报告期末除	基金管理人之外的其	其他关联方投资本基:	金的情况	
				份额单位:份
关联方名称	本月 2011年 6	明末 6月30日	上年 2010年 13	度末 2月31日
大联万名称	持有的 基金份額	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
基金发起人、基金管理人股 东-国元证券股份有限公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
基金发起人=天津北方国际 信托投资股份有限公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
基金发起人-长江证券股份 有限公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
基金发起人=中信证券股份 有限公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%

9.4.4.5 田天联万床首的银行任款未确及当州广至时间总权人 单位:人民币元							
关联方名称	7比期间 2010年6月30日						
	期末余額	当期利息收入	期末余额	当期利息收入			
中国银行	202,133,136.99	558,119.94	293,114,752.82	554,400.88			
注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计算。 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况							
6.4.4.6 小品令	# 化承销期以参与天跃	力 本 铂 山 寿 的 简 份					

本基金于本报告期间及上年度可比期间均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

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 本基金本报告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

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通交限股票 本基金本报告期末持有暂时停牌等流通变限股票。 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中作为抵押的债券。 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

§7 投资组合报告 7.1 期末基金资产组合情况

占基金总资产比例(%)	金额	项目	序号
73.9	2,779,916,440.83	权益投资	1
73.9	2,779,916,440.83	其中:股票	
20.4	768,549,933.60	固定收益投资	2
20.4	768,549,933.60	其中:债券	
	-	资产支持证券	
	-	金融衍生品投资	3
	-	买人返售金融资产	4
	-	其中:买断式回购的买人返售金融资产	
5.3	202,760,240.45	银行存款和结算备付金合计	5
0.2	9,327,768.04	其他各项资产	6
100.0	3,760,554,382.92	合计	7

		7万.ロバー・ロエ・シストグリリンロ		
行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)		
农、林、牧、渔业	-	-		
采掘业	325,283,450.85	8.72		
制造业	1,597,900,546.28	42.85		
食品、饮料	289,232,840.88	7.76		
纺织、服装、皮毛	36,213,763.00	0.97		
木材、家具	-	-		
造纸、印刷	-	-		
石油、化学、塑胶、塑料	331,529,272.04	8.89		
电子	-	-		
金属、非金属	185,492,231.21	4.97		
机械、设备、仪表	442,135,886.36	11.86		
医药、生物制品	313,296,552.79	8.4		
其他制造业	-	-		
电力、煤气及水的生产和供应业	-	-		
建筑业	105,350,000.00	2.83		
交通运输、仓储业	27,727,788.80	0.74		
信息技术业	114,376,616.32	3.07		
批发和零售贸易	203,930,547.27	5.47		
金融、保险业	259,323,000.00	6.95		
房地产业	86,253,294.33	2.31		
社会服务业	32,058,000.00	0.86		
传播与文化产业	-	-		
综合类	27,713,196.98	0.74		
	农、林、牧、渔业  荣耀业  前造业  食品、饮料  均效、服装、皮毛  不材、深具  造纸、印刷  石油、化学、型胶、塑料  电子  全属、华金属  机械、设备、仅表  医药、生物制品  其他制造业  也力、煤气及水的生产和供应业 建筑业  交通运输。仓储业  信息技术业  批发和零售贸易  全融、保险业  防地产业  社会服务业  传播与文化产业	夜,林,枚,漁业     325,283,450.85       菜屋业     325,283,450.85       割造业     1,597,900,546.28       食品,饮料     289,232,840.88       炒煎,服装,皮毛     36,213,763.00       木材,深具     -       遺産紙,印刷     -       石油,化学,型胶、塑料     331,529,272.04       电子     -       金属,非金属     185,492,231.21       机械,设备,仅表     442,135,886.36       医药,生物制品     313,296,552.79       对他制造业     -       也力,被气及水的生产和供应业     -       建筑业     105,350,000.00       交通运输,仓储业     27,727,788.80       信息技术业     114,376,616.32       批发和零售贸易     203,930,547.27       金融,保险业     229,323,000.00       房地产业     86,233,294.33       社会服务业     32,058,000.00       传播与文化产业     -		

			比例大小排序的前-		金额单位:人民币:
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	600309	烟台万华	13,928,923	260,610,149.33	6.99
2	601318	中国平安	3,700,000	178,599,000.00	4.79
3	600031	三一重工	9,750,000	175,890,000.00	4.72
4	000937	冀中能源	4,700,000	119,145,000.00	3.20
5	600123	兰花科创	2,600,000	108,628,000.00	2.91
6	600519	贵州茅台	500,000	106,315,000.00	2.85
7	600266	北京城建	7,000,000	105,350,000.00	2.83
8	000581	威孚高科	2,280,682	87,920,291.10	2.36
9	000926	福星股份	7,205,789	86,253,294.33	2.31
10	601607	上海医药	5,072,357	85,215,597.60	2.29

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1	电针型 1	公蛎却山 拥知甘	公次立分估	२०१ नो लेत	20 17	65B几亚印日4m

序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值的比例(%)
1	601607	上海医药	118,278,384.81	2.94
2	600418	江淮汽车	71,780,467.35	1.78
3	000933	神火股份	67,315,631.38	1.67
4	600309	烟台万华	55,851,191.33	1.39
5	600720	祁连山	49,713,539.85	1.23
6	600425	青松建化	46,132,210.17	1.15
7	600325	华发股份	43,214,778.26	1.07
8	600123	兰花科创	39,409,038.75	0.98
9	000629	攀钢钒钛	35,585,996.25	0.88
10	600702	沱牌舍得	34,016,588.72	0.84
11	601618	中国中冶	33,817,317.40	0.84
12	002232	启明信息	32,357,921.23	0.80
13	600125	铁龙物流	30,869,273.79	0.77
14	600570	恒生电子	30,541,685.11	0.76
15	000157	中联重科	29,819,503.55	0.74
16	000786	北新建材	28,892,636.26	0.72
17	600585	海螺水泥	28,493,686.23	0.71
18	000926	福星股份	25,655,845.76	0.64
19	000063	中兴通讯	24,327,508.21	0.60
20	600486	扬农化工	24,128,002.34	0.60

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名股票明纸

				金额单位:人民币:
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	000338	潍柴动力	118,363,170.79	2.9
2	601088	中国神华	79,673,953.47	1.9
3	600655	豫园商城	78,177,221.32	1.9
4	600089	特变电工	68,372,378.15	1.7
5	601699	潞安环能	64,520,518.95	1.6
6	600309	烟台万华	52,363,175.96	1.3
7	000063	中兴通讯	45,855,007.17	1.1
8	600266	北京城建	44,040,210.76	1.0
9	600271	航天信息	43,560,597.65	1.0
10	000880	潍柴重机	43,228,748.28	1.0
11	600325	华发股份	40,731,186.43	1.0
12	000937	冀中能源	40,291,745.16	1.0
13	000729	燕京啤酒	38,399,227.17	0.9
14	601618	中国中冶	33,232,471.52	0.8
15	600739	辽宁成大	33,021,945.77	0.8
16	600664	哈药股份	32,616,659.95	0.8
17	000157	中联重科	29,561,839.93	0.7
18	000933	神火股份	28,877,772.41	0.7
19	600519	贵州茅台	28,588,191.00	0.7

20 600723 首商股份 7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额 24,811,464.99

1,374,190,559.48 主:本项中 7.4.1,7.4.2,7.4.3 表中的 写人金额"或 写人股票成本")、 买卖成交金额 成交单价乘以成交数量 减列,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 102,871,933.6 539,175,000.0 14.46 539,175,000. 14.46

100209 1,500,000 1,000,000 1,000,000 97,250,000.00

100230 500,000

7.7 州水区公园间面包含金页。停值比例人小州石印刷(石页)又将证外本基金期末来并有资产支持证券。 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报告期末未持有权证。 7.9 投资组合报告附注

7.9 1 文财组合报告附注 7.9.1 声明本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查记录,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。

则公开通讯、XXII)。 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 本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:,				
序号	名称	金額		
1	存出保证金	1,106,357.38		
2	应收证券清算款	-		
3	应收股利	-		
4	应收利息	8,221,410.66		
5	应收申购款	-		
6	其他应收款	-		
7	待摊费用	-		
8	其他	-		
0	AH	0.227.769.04		

88 基金份额持有人户数及持有人结构

121,851,744.00 4.06% 110.207.522.00 3.67% 63,039,147.00 UBS AG 48,476,339.00 1.62%

\$9 重大事件揭示

9.1 基金价额持有人大会决议
本报告期未召开基金份额持有人大会。
9.2 本报告期外基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动
9.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况
本基金管理人有限。1年5月14日发布公告,经长废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。
9.2.2 基金经理的变动情况
本报告期本基金基金经理作管部门重大人事变动情况
本报告期本基金基金经理传部们重大人事变动情况
本报告期内,根据证监会 铁干核准中国银行银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一一中国该行程贷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。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。从基金财产,基金托管业务的诉讼

本报告期內元涉及本基金管理人、基金财产、基金杆管业务的诉讼事项。

9.基金投资策略的改变。
本报告期內本基金投资策略改变。

9.5 为基金进行审计的会计师事务所请况
本基金聘任的会计师事务所为安本华明会计师事务所,本报告期内本基金未更换会计师事务所。

9.6 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。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

9.7.1 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

J.7.1 (153L)	Z   111/13 HL / 3 Z A	-1,2,5,4,5,0,2,11,0,2	元汉以及/四亚文门 旧	00	金额单位:人民币:
券商名称	交易单元 数量	股票	交易	应支付该多	<b>幹商的佣金</b>
		成交金額	占当期股票成交总额 的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例
国泰君安	2	605,999,159.01	24.05%	492,376.33	23.29%
招商证券	1	-	-	-	-
中信证券	1	11,001,207.66	0.44%	8,938.54	0.42%
银河证券	2	1,270,086,276.64	50.40%	1,079,569.68	51.06%
国元证券	2	434,404,321.35	17.24%	368,256.86	17.42%
国信证券	1	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-
长江证券	2	95,928,008.84	3.81%	77,941.79	3.69%
东方证券	1	102,552,172.08	4.07%	87,169.36	4.12%
<b>齐鲁</b> 证券	1		_	_	

9.7.2 基金	和用证券公	司交易单元进行其代	bir券投资的情况		
	. 122/13/11/3/ 24	- 12030   2000  1200			金额单位:人民币元
	交易单元 数量	债券	交易	债券回	购交易
券商名称		成交金額	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
国泰君安	2	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
银河证券	2	19,171,099.20	65.78%	-	-
国元证券	2	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-
东方证券	1	9,975,000.00	34.22%	-	-
玄鱼证券	1		_		_

6 对外发展的。仅实自建寺间门及印刷元加四期列加四期列加西山东西。 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于续。评价结果如不符合条件则终上试用。 6 )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,或签约机构结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

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:无。