长盛中信全债指数增强型债券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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	长盛全债指数增强债券	
基金主代码	510080	
交易代码	510080(前端)	511080(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年10月25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	381,353,298.13份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为开放式债券型基金,将运用增强的指数化投资策略,在力求本金安全的基础上,追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用"自上而下"的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值,同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益。
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率×92%+中信标普A股综合指数收益率×8%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金。

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	-477,988.22
本期利润	-8,230,501.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0198
本期基金份额净值增长率	-1.72%
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	0.0576
期末基金资产净值	449,310,371.97
期末基金份额净值	1.1782

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	-0.76%	0.21%	0.06%	0.13%	-0.82%	0.08%
过去三个月	-1.71%	0.20%	-0.01%	0.11%	-1.70%	0.09%
过去六个月	-1.72%	0.24%	0.95%	0.12%	-2.67%	0.12%
过去一年	3.90%	0.29%	2.17%	0.14%	1.73%	0.15%
过去三年	16.31%	0.31%	13.89%	0.17%	2.42%	0.14%
自基金合同生效起至今	136.65%	0.35%	40.13%	0.17%	96.52%	0.18%

注:本基金业绩比较基准=中信标普全债指数收益率×92%+中信标普A股综合指数收益率×8%。

本基金业绩比较基准的构建:本基金为增强性指数化债券型投资基金,对目标指数的投资在资产配置中最低比例为64%,股票资产配置最高比例为16%,现金持有最低比例为3%。由于本基金主要投资于债券,股票投资是作为增强型投资提高收益的一种手段,预计股票投资比例的平均值为8%,因此将基金业绩比较基准设定为:中信标普全债指数收益率×92%+中信标普A股综合指数收益率×8%。目前投资人可以通过登录中信证券研究网获取中信标普全债指数和中信标普A股综合指数的相关信息。如果中信指数体系信息发布渠道增加,本基金管理人将另行公告。

本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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		
梁婷	本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理。	2011年2月15日	—	11年	女,1975年6月出生,中国国籍。中国社会科学院研究生院经济学博士,曾任中国对外经济贸易信托投资公司投资银行部项目经理;2000年10月加入长盛基金管理有限公司,先后担任产品设计经理、固定收益研究员、社保组合经理助理,社保组合经理。现任长盛中信全债指数增强型债券投资基金(本基金)基金经理,长盛货币市场基金基金经理。
梁珂	本基金经理助理,长盛货币市场基金基金经理助理,债券研究员。	2010年12月10日	—	3年	男,1983年6月出生,中国国籍。北京大学硕士。2008年7月加入长盛基金管理有限公司,现任债券研究员,长盛中信全债指数增强型债券投资基金(本基金)基金经理助理,长盛货币市场基金基金经理助理。
刘静	本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。	2008年8月11日	2011年2月15日	11年	女,1977年1月出生,中国国籍,中央财经大学经济学硕士。2000年7月至2003年6月就职于北京证券有限责任公司;2003年7月加入长盛基金管理有限公司,先后担任交易部交易员、首席债券交易员。曾任本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。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、《长盛中信全债指数增强型债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

一、报告期内行情回顾

2011年上半年,通胀预期和货币政策紧缩力度都不断强化,伴随着政策调控,各项宏观经济数据也在2季度起逐渐回落。

由于宏观调控效果需要一个逐渐的显现过程,1季度债券市场和货币市场资金面仍然相对宽裕,债券收益率特别是短端收益率抬生幅度相对较小。2季度随着调控政策的逐渐加强,边际效应逐渐显现,收益率不断抬升,收益率曲线逐渐平坦化,特别是2季度末,货币市场资金面极度紧张,银行间7天回购利率达到历史高位,债券市场出现大幅下跌,特别是短期利率债、浮息债和信用债跌幅较大。

股票市场方面,1季度市场在多种因素交织下纠结和震荡,市场结构性分化,行业轮动明显,但仍不乏机会,比如低估值蓝筹的估值修复,周期性行业中部分供给受限的行业等也有亮丽表现。进入2季度,随着1季报企业盈利低于预期、通胀水平不断抬高、宏观经济数据下滑、央行连续采取紧缩政策、国际环境不利因素较多,股票市场2季度走出了一轮普遍下跌行情,结构性机会较少。直至6月末,由于预期通胀高点将至,以及紧缩政策接近尾声,市场出现大幅反弹。

二、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金在债券资产配置策略上继续保持一贯稳健投资风格,对组合采用战略性和战术性配置相结合的一贯策略。基于在通胀高企、政策紧缩环境下对债券投资的不利影响,本基金在2011年上半年,大部分时间组合久期保持在略低于基准附近的位置,但由于跟踪基准的限制,久期水平仍然高于市场平均水平,整体上承担了一定的利率风险。在半年末债券市场快速下跌的过程中,各类债券资产也遭遇了一定的损失;就权益类资产部分而言,报告期内本基金坚持风险控制的原则,对该部分资产进行动态调整,该期限内基本保持相对中性的仓位,策略上采取自上而下与自下而上相结合的资产配置策略;总体来说,由于市场整体下跌幅度较大,对组合收益还是产生了明显的负贡献,并且由于对部分行业走势及政策导向带来的影响把握不够准确,也部分影响了投资收益。另外,在报告期内转债资产的投资也没有产生预期的投资收益。

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1.1782元,本报告期份额净值增长率为-1.72%,同期业绩比较基准增长率为0.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前宏观经济增速如期回落,紧缩性货币政策以及经济结构调整效应逐步显现。我们认为,3季度起,货币政策紧缩的压力大大减小,宏观经济将呈现软着陆态势,并且4季度逐渐企稳后或有望步入短周期的回升。

通货膨胀方面,食品价格反季节增长推动物价持续上涨,3季度起物价同比将随翘尾因素的逐渐减弱而有所回落,但年内低点大概率下仍将维持在4%左右的较高水平上。虽然短期经济出现了一定程度放缓,但这种放缓更多反映的决策层主动调控的效果,在保障房建设及中西部城镇化推动下固定资产投资增速保持在较高水平,经济增长底部支撑依旧坚实,同时,中国人口红利的逐渐衰退以及劳动观念的逐渐转变,中期看,通胀波动的中枢水平会较以往有所抬高。

展望下半年债券市场,随着紧缩政策逐渐接近尾声,短期内政策紧缩的利空因素已经得到很大程度的释放,资金面也将有所缓解,利率产品有望看到一定的投资机会,但由于年内收益率曲线的中长端,特别是长期国债的收益率调整并不充分,因此,收益率下行的空间相对有限,本基金将会保持久期与基准久期相近;信用品种方面,由于供给集中增加,且经济下行过程中违约风险的增加,信用产品的投资仍然宜采取谨慎策略,重点配置中、高等级信用品种;转债资产方面,由于转债估值水平明显降低,投资价值明显提高,本基金将相对积极参与大盘转债的投资。

股票市场方面,在紧缩政策即将结束、估值水平相对较低的情况下,3季度反弹行情有望继续,但由于经济仍处于下行过程中,因此市场反转机会仍需等待宏观经济面的逐步明朗。本基金将适度谨慎参与股票投资,密切关注宏观经济走势,适时对股票仓位进行调整。

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(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,本基金于2011年1月10日对2010年度收益进行了分配,分配金额为42,812,460.00元。

本基金截至2011年6月30日,期末可供分配利润为21,971,030.51元,未分配利润已实现部分为21,971,030.51元,未分配利润未实现部分为45,986,043.33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

在托管长盛中信全债指数增强型债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》相关法律法规的规定以及《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金托管协议》的约定,对长盛中信全债指数增强型债券投资基金管理人—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信全债指数增强型债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信全债指数增强型债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:长盛中信全债指数增强型债券投资基金

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	36,373,506.85	38,823,900.00
结算备付金	3,158,820.85	2,730,793.67
存出保证金	960,000.00	960,000.00
交易性金融资产	487,700,441.79	489,984,643.85
其中:股票投资	32,237,498.15	77,121,368.65
基金投资	-	-
债券投资	455,462,943.64	412,863,275.20
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	-	8,580,503.39
应收利息	5,122,460.78	2,384,906.08
应收股利	-	-
应收申购款	16,166.98	20,109,890.78
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	533,331,397.25	563,574,637.77
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	73,000,000.00	-
应付证券清算款	5,199,926.53	-
应付赎回款	806,378.85	782,813.21
应付管理人报酬	289,565.32	346,653.14
应付托管费	77,217.44	92,440.82
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	840,497.37	384,459.76
应交税费	3,111,981.25	2,981,320.81
应付利息	24,225.30	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	671,233.22	580,612.47
负债合计	84,021,025.28	5,168,300.21
所有者权益:		
实收基金	381,353,298.13	430,121,047.91
未分配利润	67,957,073.84	128,285,289.65
所有者权益合计	449,310,371.97	558,406,337.56
负债和所有者权益总计	533,331,397.25	563,574,637.77

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值1.1782元,基金份额总额381,353,298.13份。

6.2 利润表

会计主体:长盛中信全债指数增强型债券投资基金

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	-3,570,933.45	-612,858.96
1.利息收入	5,889,800.09	8,455,031.61
其中:存款利息收入	179,453.26	617,764.04
债券利息收入	5,626,021.29	7,837,267.57
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	84,325.54	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"号填列)	-1,745,059.84	7,454,767.42
其中:股票投资收益	-3,617,305.14	6,553,251.29
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,621,473.80	566,175.37
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	250,771.50	335,340.76
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-7,752,512.97	-16,556,574.80
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	36,839.27	33,916.81
减:二、费用	4,659,567.74	5,847,245.30
1.管理人报酬	1,863,633.94	2,612,649.26
2.托管费	496,969.11	696,706.49
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,559,814.79	1,083,710.47
5.利息支出	571,366.59	1,276,026.37
其中:卖出回购金融资产支出	571,366.59	1,276,026.37
6.其他费用	167,783.31	178,152.71
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-8,230,501.19	-6,460,104.26
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-8,230,501.19	-6,460,104.26

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛中信全债指数增强型债券投资基金

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)	430,121,047.91	128,285,289.65	558,406,337.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-8,230,501.19	-8,230,501.19
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)	-48,767,749.78	-9,285,254.62	-58,053,004.40
其中:1.基金申购款	39,239,911.25	7,954,500.44	47,194,411.69
2.基金赎回款	-88,007,661.03	-17,239,755.06	-105,247,416.09
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)	-	-42,812,460.00	-42,812,460.00
五、期末所有者权益(基金净值)	381,353,298.13	67,957,073.84	449,310,371.97
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)	605,133,452.00	145,735,436.06	750,868,888.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,460,104.26	-6,460,104.26
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)	-78,439,843.69	-19,209,082.80	-97,648,926.49
其中:1.基金申购款	18,816,878.66	4,525,108.12	23,341,986.78
2.基金赎回款	-97,256,722.35	-23,734,190.92	-120,990,913.27
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)	526,693,608.31	120,066,249.00	646,759,857.31

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	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	630,650,038.43	62.89%	348,602,080.24	52.71%

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	701,219,810.42	98.47%	355,156,970.88	87.35%

6.4.4.1.4 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	1,988,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.4.1.5 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	536,051.84	63.93%	536,051.84	63.93%
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	296,311.30	53.83%	161,192.68	55.58%

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	1,863,633.94	2,612,649.26
其中:支付给销售机构的客户维护费	327,398.04	418,564.13

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:日基金管理人报酬=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	496,969.11	696,706.49

注:支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%/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
中国农业银行	30,226,890.41	10,079,465.75	-	-	-	-
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
中国农业银行	-	-	-	-	-	-

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(2003年10月25日)持有的基金份额	-	-
期初持有基金份额	29,937,118.12	29,937,118.12
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	29,937,118.12	29,937,118.12
期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.85%	5.68%

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	36,373,506.85	157,470.49	32,682,915.69	593,889.65

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

6.4.7.1.1受限证券类别:债券									
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:张)	期末成本总额	期末估值总额
122813	11宁交通	2011.04.29	2011.07.22	新债认购	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00
合计								20,000,000.00	20,000,000.00

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

本基金本期末从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额73,000,000.00元,于2011年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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308,610,441.79元,属于第二层级的余额为179,090,000.00元,无属于第三层级的余额(2010年12月31日:第一层级330,407,643.85元,第二层级159,577,000.00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	32,237,498.15	6.04
	其中:股票	32,237,498.15	6.04
2	固定收益投资	455,462,943.64	85.40
	其中:债券	455,462,943.64	85.40
	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	39,532,327.70	7.41
6	其他各项资产	6,098,627.76	1.14
7	合计	533,331,397.25	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	-	-
B	采掘业	1,060,500.00	0.24
C	制造业	17,261,332.43	3.84
C0	食品、饮料	1,673,494.50	0.37
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	2,322,400.00	0.52
C5	电子	945,100.00	0.21
C6	金属、非金属	1,698,930.00	0.38
C7	机械、设备、仪表	5,710,200.00	1.27
C8	医药、生物制品	4,243,092.00	0.94
C99	其他制造业	668,115.93	0.15
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,478,000.00	0.55
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,403,800.00	0.53
H	批发和零售贸易	1,799,700.00	0.40
I	金融、保险业	3,400,800.00	0.76
J	房地产业	2,721,260.00	0.61
K	社会服务业	1,112,105.72	0.25
L	传播与文化产业	-	-
M