金额单位:人民币元

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 里安妮小 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 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

表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、误导性除述或者重大遗漏。 建全被担人诉诺以诚实信用、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

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。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

基金名称	长盛动态精选证券投资	5基金	
基金简称	长盛动态精选混合		
基金主代码	510081		
交易代码	510081 (前端)	511081 后端)	
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2004年 5 月 21 日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司	Ī	
基金托管人	中国农业银行股份有限	艮公司	
报告期末基金份额总额	1,247,309,423.02 份		
基金合同存续期	不定期		

机次日仁	本基金为开放式股票型基金。将通过积极投资于能够充分分享中国经济 期增长的、在各自行业中已经或将要取得领袖地位的50家上市公司股 展。在承担适度风险的前提下。追求当期收益和基金资产超过业结比较基 (
277	主的长期稳定回报。
	本基金为主动管理的股票型基金,投资策略上偏重选股能力的发挥,时机 的选择放在次要位置。
业绩比较基准	P信标普 A 股综合指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%
	x基金属于证券投资基金中的适度风险品种,在承担适度风险的前提下, 获取长期稳定的收益。

2.3 基金管理人和基金托管人 感基金管理有 00-888-2666 010-62350081 客户服务电话

010-63201816

§3 主要财务指标和基金净值表现

010-82255988

### 3.1 主要会计数据和财务指标

3.1 3.2 4.1 3.4 1.0 1.3 1.1 1.1	金额单位:人民币:
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	76,327,522.46
本期利润	-56,335,435.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0459
本期基金份额净值增长率	-4.18%
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	0.0764
期末基金资产净值	1,342,622,770.57
期末基金份额净值	1.0764
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

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 6为期 未余额,不是当期发生数)。表中的 期末"均指本报告期最后一日,即 6 月 30 日。 3.2.基余净值表即

3.2 ASM TEM.						
3.2.1 基金份额/	争值增长率》	及其与同期业绩と	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	2.98%	1.01%	2.15%	1.20%	0.83%	-0.19%
过去三个月	-4.19%	0.93%	-6.11%	1.11%	1.92%	-0.18%
过去六个月	-4.18%	1.11%	-3.90%	1.20%	-0.28%	-0.09%
过去一年	27.63%	1.26%	21.20%	1.33%	6.43%	-0.07%
过去三年	35.84%	1.59%	28.04%	1.90%	7.80%	-0.31%
自基金合同生效起 至今	293.75%	1.57%	188.73%	1.85%	105.02%	-0.28%
注:本基金业绩	新量基准=中	信标普 A 股综合	指数收益率×9	5%+金融同业存款和	引率×5%。	

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

# 基金份簽裝計等值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图 432...04 104 201 101.009 44:00% ——高全台報告计》的考示# · 一业场市最高等会位# §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

本基金管理人及共管理基金的登録 本基金管理人及共管理基金的登録 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%。新加坡量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 33%;安徽省信用担保集团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 33%。截止 2011 年 6月 30 日,基金管理人营理两支封闭式基金、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则及含效

姓名	全经理(或基金经理小组)及基金 任本基金的。 职务 助理》			证券	说明
		任职日期	离任日期	从业年限	
邓永明	本基金金屬原基本理、长增於公理等。	2008年8月11 日	-	12年	男。1971年7月出生,中国国籍学生第一门面吹水大学、珠宁生的工作生化。曾任天成基金管理有限公司研究员、交易员和基金经理有限公司研究员、交易员和基金经理。18年基金经理。18年基金经理。18年基金经理。18年基金经理。18年基金经理。18年基金经理。18年基金经理。18年基金经理。18年基金经理。18年18年18年18年18年18年18年18年18年18年18年18年18年1

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.上次基金宏定理的注职日期和属注日期的福公司决定确定的判注日期和解聘日期; 2、惟券从业年限"中 能券从业"的含义遵从行业协会 使券业从业人员资格管理办法》的相关规定。 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、低盛动态精选证券投资 基金基金合同 《和其他有关法律法规,监管部门的相关规定,依昭诚实信用,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

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

\*\*。 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

1111.434 4.33 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 管理人对据告期内基金的投资领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

上半年,欧债危机不断蔓延,多国无奈紧缩财政,民众示威抗议,中东北非政局扑朔迷离,利比亚战火 连连,政局非常不稳,经济上,美国复苏步伐放缓,中国在货币不断收紧的情况下通胀仍在继续走高,世界经济的不确定性加大,全球投资者陷入担忧之中。但是,由于流动性依然充裕以及主要经济体继续缓慢复苏,大宗商品价格阴显置于预期。 本基金认为,随着紧缩政策的持续,其效应将逐步显现,目前 PMI 已经连续回落,经济的活跃度在下

降,可以预见三季度通胀将逐步回落,过度担忧已没有必要,受到政策支持的两兴产业和联合受到抑制的传统产业等行业的优秀企业业绩可能会超出市场预期,结构性机会更加突出。在经济逐步探底过程中,选择性地增加仓位能更好地获取这个阶段的超额收益。上半年,本基金继续增持能受益于政策预期放松的周期类板块、如煤炭,有色板块以及调整充分的成长性公司等。 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 1.0764 元,本报告期份额净值增长率为-4.18%,同期业绩比较基准

增长率为-3.90%。

增长率为-3.90%。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
1.对宏观经济和证券市场的展望
下半年,从国际经济格局来看,美国失业率仍没有明显改善,但经济增长已出现放缓迹象,美联储将继续维持宽松政策,欧洲主权国债务危机基本走出阴影、债务环境大为改善。随着希腊债务危机的最终解决级及日本灾后重建的启动,全球经济低迷的负面影响将减弱。从国内形势着,上半年各类紧缩数策密集出台,其效应在下半年将逐步显观。虽然紧缩的惯性仍将持续,不过力度有望缓和、未来政府更可能进入。边走边看"的观察期,即便是小幅加息、上调准备金,还是其他行政措施,都不会再像上半年那样给市场造成更大冲击,投资者的信心将逐渐恢复,行情维持震荡向上的格局。
2.本基金下阶段投资策略
下阶段我们认为结构性机会仍然存在:首先是预期政策放松背景下,周期股的估值修复机会仍然存在:其次看度打那些政策支持力度较大的行业、营如保障房供应链上的受益板块;此外,有核心技术,有终端

在;其次看好那些政策支持力度较大的行业,譬如保障房供应链上的受益板块;此外,有核心技术、有终端需求、产品定价能力较强以及成长确定的优秀上市公司也是我们考虑的范围,包括消费类企业和中小企

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), ) · 首察长 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、经常经常从多公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外。 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

## 长盛动态精选证券投资基金

### 2011年6月30日

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 查並已建多于可值原规则和分定的以底上个多于同值原规则和分定的现金次保护目录而且值别预订。 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。

度。本基金子之11年1月10日对2016年度收益产行予配入劳运金额之间均1/公标于冯鉴金利的月间6项则的25 定。本基金截至2011年1月10日对2016年度收益产行了免记分配金额为116.403.6472,072。 本基金截至2011年6月30日,期末可供分配收益为95,313,347.55元,其中,未分配收益已实现部分为172.011.602.20元,未分配收益未实现部分为一76.698.254.65元。 85 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

5.1 报后别内平签金打 自人原始了信间记时 在托管长感力态精选证券投资基金的过程中,本基金托管人一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 长盛动态精选证券投资基金基金合同》、长盛动态精选证券 投资基金托管协议 的约定,对长盛动态精选证券投资基金管理人一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

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 他养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动态精选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

§6 半年度财务会计报告 (未经审计)

主体:长盛动态精选证券投资基金 报告截止日:2011年6月30日

资产	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资产:	2011   072 30 11	2010   12 / 1 / 1
银行存款	113,798,591.99	156,709,869.7
结算备付金	1,133,796.66	4,554,545.20
存出保证金	1,609,174.02	1,521,349.8
交易性金融资产	1,230,561,171.07	1,271,297,935.7
其中:股票投资	1,230,561,171.07	1,241,261,935.7
基金投资	_	
债券投资	_	30,036,000.0
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	23,374.04	1,231,553.8
应收股利	_	.,
应收申购款	24,422.80	114,565.1
· ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・		,
其他资产	_	
资产总计	1,347,150,530.58	1,435,429,819.5
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	_	3,158,799.8
应付赎回款	916,689.70	525,934.4
应付管理人报酬	1,613,425.15	1,841,605.4
应付托管费	215,123.38	245,547.3
应付销售服务费	_	
应付交易费用	789,821.37	1,671,735.20
应交税费	62,550.40	62,550.4
应付利息	_	
应付利润	_	
递延所得税负债	_	
其他负债	930,150.01	840,829.2
负债合计	4,527,760.01	8,347,001.8
所有者权益:		,
实收基金	1,247,309,423.02	1,167,579,853.3
未分配利润	95,313,347.55	259,502,964.3
所有者权益合计	1,342,622,770.57	1,427,082,817.6
负债和所有者权益总计	1,347,150,530.58	1,435,429,819.50

		单位:人民币
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	-41,239,995.54	-363,964,388.80
1.利息收入	1,181,514.86	1,761,544.07
其中:存款利息收入	601,193.52	959,648.04
债券利息收入	549,937.58	801,896.03
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收人	30,383.76	-
其他利息收入	_	-
2.投资收益(损失以""号填列)	90,202,578.09	57,222,842.36
其中:股票投资收益	84,421,731.24	52,627,485.63
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-211,253.83	1,402,138.40
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	5,992,100.68	3,193,218.33
3.公允价值变动收益 假失以 ""号填列)	-132,662,957.48	-423,592,630.03
4.汇兑收益 假失以 ""号填列)	-	-
5.其他收入 假失以 ""号填列)	38,868.99	643,854.80
减:二、费用	15,095,439.48	24,721,408.16
1.管理人报酬	10,089,278.76	14,034,673.90
2.托管费	1,345,237.18	1,871,289.77
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,473,221.43	8,632,332.38
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)	-56,335,435.02	-388,685,796.96
减:所得税费用	-	
四、净利润(净亏损以""号填列)	-56,335,435.02	-388,685,796.96

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

	本期			
项目	2011年	1月1日至2011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 甚金净值)	1,167,579,853.34	259,502,964.34	1,427,082,817.68	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-56,335,435.02	-56,335,435.02	
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(争值减少以""号填列)	79,729,569.68	8,549,495.93	88,279,065.61	
其中:1.基金申购款	173,962,981.92	20,522,210.77	194,485,192.69	
2.基金赎回款	-94,233,412.24	-11,972,714.84	-106,206,127.08	
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)	-	-116,403,677.70	-116,403,677.70	
五、期末所有者权益 基金净值)	1,247,309,423.02	95,313,347.55	1,342,622,770.57	
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)	1,828,343,581.68	279,492,943.39	2,107,836,525.07	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-388,685,796.96	-388,685,796.96	
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)	-522,697,679.88	1,702,004.63	-520,995,675.25	
其中:1.基金申购款	33,882,614.19	2,221,660.39	36,104,274.58	
2.基金赎回款	-556,580,294.07	-519,655.76	-557,099,949.83	
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)	1,305,645,901.80	-107,490,848.94	1,198,155,052.86	
注:报表附注为财务报表的组成部分。				

单位:人民币元

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

杨思乐 主管会计工作负责人

基金管理公司负责人 会计机构负责人 6.4.1 本根告期所采用的的会计政策、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

戴君棉

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

0.4.3.1 年度市朔什住企制大东级共电里人利普大东的大联万及生变化的制化 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					
盛基金管理有限公司(长盛基金")	基金管理人、基金销售机构				
国农业银行	基金托管人、基金代销机构				

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

## 2011 半年度 报告摘要

				金额单位:人民币元		
关联方				本期 2011年1月1日至2011年6月30日		
名称	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	873,568,354.67	37.90%	2,577,158,394.88	47.32%		
64412 松证	ジ 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。

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		
名称	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	-	-	15,404,266.99	88.89%	
6.4.4.1.4 应支付关联方佣金					
				金额单位:人民币:	

金额单位:人民币元

本期 2011年1月1日至2011年6月30日 158,255 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 期末应付佣金 余额

在:1.上还明选项目域则或上引养。1871年18月,1871年18月,1871年18月,1871年18月,1871年18月, 信券及权证交易不计闸金。 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。

项目 1,399,238.54 1,528,100.04

注: 文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 1.50%的年费率提,逐日累计至每月月底,按月支付。 共计算公式为:日基金管理人报酬-前一日基金资产净值×1.50%当年天数。 6.4.4.22 基金托管金

0		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	1,345,237.18	1,871,289.77
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

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%的年费当 于至每月用底:接对支付。 其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值x0.20%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。 本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间回业市场的债券 (含回购)交易。 6.4.4.1 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的情况 基金管理人全期大除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况 除基金管理人全外的其他关联方投资本基金的情况 除基金管理人全外的其他关联方投资本基金。 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

0.4.4.5 田大帆	JI IV E HJUKI J 17 SVAT I	枫久   州) 土山小瓜	12/	单位:人民币
关联方 名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			可比期间 2010年6月30日
石柳	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	113,798,591.99	573,880.17	269,360,859.91	928,987.99
注:本基金的银	设行存款由基金托管人	中国农业银行保管,持	安银行同业利率计息	0

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 6.4.5.1 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 期末持有的暂时停阱等流通受限股票 本基金本期末未持有暂时停阱等流通受限股票 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为批押的债券 6.4.5.3 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。 本金金本がポルスタのパロシの(以近上に)をディーショルパロショルから 6.4.6 有助于理解和分析会と计报表需要説明的其他事項 1.公允价值 0.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

2 以公允价值计量的金融工具

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 床经测整 的报价。 第三层级、直接 化如取自价格 域间接 化如根据价格推算的 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 1,230, 561,171.07 元.无属于第三层级和第三层级的余额 2010 年 12 月 31 日:第一层级 1,241,261,935.71 元,第 三层级 30,35 00000 元 平 第二三级

二层级 30,036,000.00 元 五第二层级 30 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人第 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 的其他重要事项。 7.1 期末基金资产组合情况

			金额单位:人民币元
序号	项目	金額	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	1,230,561,171.07	91.35
	其中:股票	1,230,561,171.07	91.35
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	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
-	细仁方物和什管タ什么人让	114 022 200 65	0.53

1,656,970.86

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	14,013,524.00	1.04
В	采掘业	224,269,597.71	16.70
С	制造业	655, 128, 189.94	48.79
C0	食品、饮料	149,633,406.28	11.14
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	41,875,415.18	3.12
C5	电子	24,689,803.32	1.84
C6	金属、非金属	209,338,301.38	15.59
C7	机械、设备、仪表	119,827,937.11	8.92
C8	医药、生物制品	109,763,326.67	8.18
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	20,115,900.00	1.50
E	建筑业	49,932,755.29	3.72
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	38,818,500.70	2.89
Н	批发和零售贸易	36, 105, 701.04	2.69
I	金融、保险业	166,542,112.19	12.40
J	房地产业	25,634,890.20	1.91
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	Ait	1 220 561 171 07	01.65

7.3 州	不1女公儿川 国	口盔並贝厂伊口	且レレアリノヘノハイトバ	『吖刖丨右収示汉贝明:	<b>III</b>
					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	000937	冀中能源	3,001,058	76,076,820.30	5.67
2	600036	招商银行	5,000,394	65,105,129.88	4.85
3	000581	威孚高科	1,544,363	59,535,193.65	4.43
4	000656	ST东源	4,000,910	54,812,467.00	4.08
5	600267	海正药业	1,201,267	44,855,309.78	3.34
6	000983	西山煤电	1,746,200	42,258,040.00	3.15
7	000568	泸州老窖	904,900	40,829,088.00	3.04
8	601088	中国神华	1,199,947	36,166,402.58	2.69
9	000858	五粮液	1,001,179	35,762,113.88	2.66
10	000060	中金岭南	2,597,727	34,549,769.10	2.57
注:投	资者欲了解本	报告期末基金	殳资的所有股?	票明细,应阅读登载于	http://www.csfunds.com.cn

7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	000060	中金岭南	51,181,681.55	3.59
2	000983	西山煤电	47,334,809.26	3.32
3	600549	厦门钨业	46,252,365.28	3.24
4	600000	浦发银行	41,775,768.44	2.93
5	600036	招商银行	36,117,703.97	2.53
6	601088	中国神华	36,031,015.73	2.52
7	000877	天山股份	35,574,626.03	2.49
8	600068	葛洲坝	34,930,081.55	2.45
9	000001	深发展 A	34,627,290.85	2.43
10	000937	冀中能源	32,478,878.11	2.28
11	600547	山东黄金	30,017,362.37	2.10
12	002013	中航精机	29,992,454.35	2.10
13	000968	煤气化	29,382,384.59	2.06
14	600123	兰花科创	27,800,581.38	1.95
15	600425	青松建化	27,700,450.32	1.94
16	600651	飞乐音响	27,111,071.02	1.90
17	600585	海螺水泥	26,755,279.74	1.87
18	000157	中联重科	26,732,262.90	1.87
19	601318	中国平安	26,347,757.10	1.85
20	002226	汀南化丁	25,522,338.19	1.79

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

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	000937	冀中能源	71,791,467.48	5.03
2	000581	威孚高科	62,521,131.39	4.38
3	601318	中国平安	41,921,464.38	2.94
4	601111	中国国航	35,418,996.56	2.48
5	000933	神火股份	34,507,919.23	2.42
6	002011	盾安环境	31,993,192.31	2.24
7	600547	山东黄金	31,725,358.90	2.22
8	600284	浦东建设	31,570,450.68	2.21
9	600029	南方航空	31,247,498.63	2.19
10	600739	辽宁成大	29,589,465.53	2.07
11	000157	中联重科	28,152,471.63	1.97
12	000713	丰乐种业	27,374,418.12	1.92
13	601601	中国太保	26,696,685.78	1.87
14	002484	江海股份	26,631,530.54	1.87
15	600651	飞乐音响	24,996,532.86	1.75
16	600765	中航重机	24,947,168.08	1.75
17	600195	中牧股份	24,174,313.73	1.69
18	000540	中天城投	22,832,330.33	1.60
19	000012	南玻A	22,004,908.87	1.54
20	002010	传化股份	21,756,135.51	1.52

7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额 单位:人民币元 1,171,474,008.47 1,133,597,486.87

卖出股票收入 (成交)总额 人" 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 7.3 纳木球原外面针刀类的原分球原建设 本基金本报告期末未持有债券。 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投资明细

本基金本报告期末未持有债券。 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

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

1931 产明年基本以及时间1 石皿分的发门主体平规定百世光版血昌间 辽柔河直,或住区石洞间口生内交到公开谴责,处罚的情形。 一、根据西山煤电股份有限公司 2011 年 4 月 6 日公告的《山西西山煤电股份有限公司关于山西证监 局现场检查有关问题的整改报告的公告,是示,公司在公司治理、独立性、内部经制的建立和执行、信息披露、对外担保、财务核算等六方面的问题,被监管部门要求进行整改,并出具了整改报告。本基金做出以下

1、基于相关研究,本基金判断,随着经济的复苏,下游钢铁、水泥、化工等行业的开工量逐渐加大,冶金 、2011年(天)11、平至金大河),1000年20日以及少,下份的铁大八亿七十三十1至6月)——从全南加入,行金煤在未来会出现持续紧张价质面。同时由于治金煤的新岭胜、国家提出对治金煤的房户性干采改策,这也加剧了冶金煤长期偏紧的供需格局。作为冶金煤储量最大、最优质的龙头企业,西山煤电的资源价值应该 得到资本市场的溢价。同时公司未来有继续收购集团优质资产最终完成整体上市的可能,无论从内生性还

2、对于该公司被监管部门要求整改的事件,本基金经过认真调研,做出如下判断:在中国证监会山西 监管局对该公司进行了现场检查并下发了 侯于对山西西山煤电股份有限公司的责令改正决定书》之后、该公司过即组织相关人员进行认真学习,对照现场检查发现的问题制定了切实可行的整改措施,于2011年4月6日就整改报告进行了公告,截至本公告签署之日、公司已经着手落实整改措施。因此,我们审慎地将西山煤电在配置上作为组合的阶段性投资品种。

、今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规

二、根据宜宾五粮淹股份有限公司 2011 年 5 月 27 日公告的 关于收到中国证监会行政处罚决定书的公告》是示,公司因违规披露、信息披露不及时、不完整等事项受到中国证监会行政处罚,公司表示接受证监会的行政处罚,吸取教训,不断完善公司治理和台规经营。本基金做出如下说明:

1、对于白酒行业及五粮液,本公司研究员自跟踪研究以来一直看好和积极推荐,并有相关的研究报 2、基于相关研究,本基金判断,随着我国国民收入的提高、城镇化的快速推进,我国白酒行业将继续维

持高連續长,作为国内最大的白酒生产企业,高端白酒中的代表性企业之一,五粮液公司的投资价值会得到提升,对于该公司被监管部门处罚的事件。本基金经过认真研究,做出如下判断:公司自 2009 年底以来,对公司治理、信息披露、关联交易进行了很大改进,并使得公司业绩保持了良好的发展势头。公司也在 2011年5月27日的公告中,对公司整改情况进行了披露。因此,我们审慎地将五粮液在配置上作为组合的

3、今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规

除上述情况外,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,无在报告编制日 前一年内受到公开谴责、处罚。

7.9.3	明木具他各坝宽广构成	单位:人民币
序号	名称	金额
1	存出保证金	1,609,174.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,374.04
5	应收申购款	24,422.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
0	∆i+	1 656 070 96

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 由于四舍五人的原因,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:	
			持有	人结构		
持有人户数	户均持有的基	机构投资者		个人投资	Š	
(户)	金份额	持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份额比例	
85,094	14,658.02	93,103,730.68	7.46%	1,154,205,692.34	92.54%	
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	版比例	

基金管理公司所有从业人员持有 本开放式基金		64,830.58	0.01%
•	§9 开放式基金	分份额变动	•
			单位:
基金合同生效日 2004年5月21日	日)基金份额总额		4,108,187,244.80
本报告期期初基金份额总额			1,167,579,853.34
本报告期基金总申购份额			173,962,981.92

咸:本报告期基金总赎回份额 94,233,412.24 本报告期期末基金份额总额 1,247,309,423,02 10.1 基金份额持有人大会决议

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 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

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

2011年1月21日,中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格 证监许可 [2011 ]116号),张健任中国农业银行股份有限公司托管业务都总经理。 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 10.3 必及基金自译人、基金则人、基金儿自业分的诉讼事项。 本报告期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 本报告期基金投资策略没有改变。

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

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 基金相)	用证券公司3	2.易单元进行股票投	资及佣金支付情况			
				金	额单位:人民币	
	± H M	股票	交易	应支付该券商的佣金		
券商名称	交易单 元数量	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
国元证券	2	873,568,354.67	37.90%	713,005.01	37.18%	
广发华福证券	1	602,907,767.67	26.16%	512,469.43	26.72%	
中银国际	1	450,773,194.77	19.56%	383,151.97	19.98%	
光大证券	1	319,679,314.70	13.87%	259,741.06	13.54%	
申银万国	1	58,142,863.53	2.52%	49,421.35	2.58%	
中金公司	1	-	-	-	-	
中信建掛	1	_	_	_		

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行债券投资及债券回购的情况								
金额单位:人民币:								
	债券交	易	债券回	购交易				
券商名称	成交金额	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				
国元证券	-	-	-	-				
广发华福证券	1,414,271.00	100.00%	100,000,000.00	33.33%				
中银国际	-	-	200,000,000.00	66.67%				
光大证券	-	-	-	-				
申银万国	-	-	-	-				
中金公司	-	-	-	-				
中信建投	_	_	-	-				

10.7.3 基金和用证券公司交易单元进行权证投资的情况

本报告期内本基金未发生权证交易。 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

2) 溶力雄厚, 信誉良好

6 期分状况每乎,日言以对。 6 期分状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。 6 烃营行为规范,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。 6 內部管理规范、严格、具备健全的內控制度、并能滿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、本公司和用券商交易单元的程序 公 所究机构提出服务意向,并提供相关研究报告;
 C 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;
 6 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

(4) 就用期满后,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

6 体之间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、本报告期内本基金租用证券公司交易单元情况:无