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

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司(以下简称:中国建设银行)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

基金名称	长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金	
基金简称	长盛同庆封闭	
基金主代码	160806	
交易代码	160806	
基金运作方式	契约型。封闭期为三年,自基金合同生效之日,至三年期末对应日止。封闭期届满后,转换为上市开放式基金(LOF)。	
基金合同生效日	2009年 5 月 12 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	14,686,733,239.06 份	
基金合同存续期	封闭期为三年,自基金合同生效之日,至三年期末对应日止。封闭期届满后,转换为上市开放式基金(LOF),合同存续期为不定期。	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2009年 5 月 26 日	
下属分级基金的基金简称	长盛同庆封闭 A	长盛同庆封闭 B
下属分级基金的交易代码	150006	150007
报告期末下属分级基金的份额总额	5,874,693,295.62 份	8,812,039,943.44 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于具有稳健成长和业绩优良的上市公司股票,力求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	本基金在股票投资上,通过优选业绩优良、成长性稳定、在行业内具有核心竞争优势的上市公司股票进行投资,以谋求基金资产的长期稳定增长。在对市场趋势的有效判断的前提下,进行稳健的战略资产配置和积极的行业配置,同时根据对上市公司充分的基本面分析,挖掘行业中的价值个股。 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%
风险收益特征	从基金资产整体运作来看,本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
下属分级基金的风险收益特征	长盛同庆封闭 A 将表现出低风险、收益相对稳定的特征。 / 长盛同庆封闭 B 将表现出高风险、收益相对较高的特征。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	尹东
	联系电话	010-82019988	010-67595003
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	Yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	010-67595096
传真		010-82255988	010-66275853

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 日至 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-404,641,640.55
本期利润	-627,869,432.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0428
本期基金份额净值增长率	-3.95%
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	-0.0086
期末基金资产净值	15,003,198,779.39
期末基金份额净值	1.022

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(为期末余额,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	2.30%	0.81%	0.89%	0.84%	1.41%	-0.03%
过去三个月	-4.58%	0.82%	-3.59%	0.77%	-0.99%	0.05%
过去六个月	-3.95%	1.00%	-1.32%	0.87%	-2.63%	0.13%
过去一年	14.19%	1.18%	13.44%	0.99%	0.75%	0.19%
自基金合同生效起至今	2.20%	1.30%	11.02%	1.16%	-8.82%	0.14%

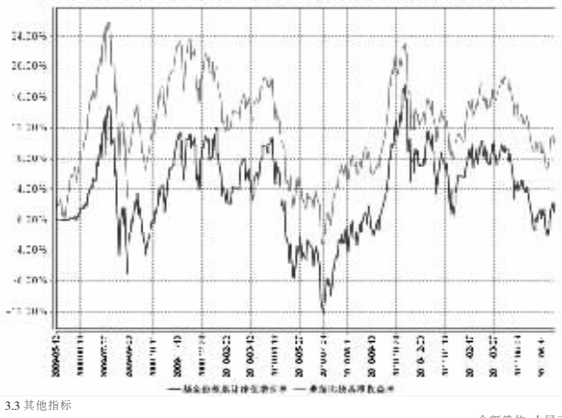
注:本基金业绩比较基准=沪深 300 指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%

沪深 300 指数是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的成份股指数。沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

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,基金基准指数每日按照 70%、30%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



3.3 其他指标

金额单位:人民币元

其他指标	报告期(2011 年 1 月 1 日-2011 年 6 月 30 日)
长盛同庆封闭 A 与长盛同庆封闭 B 基金份额配比	4:6
期末长盛同庆封闭 A 份额参考净值	1.120
期末长盛同庆封闭 A 份额累计参考净值	1.120
期末长盛同庆封闭 B 份额参考净值	0.957
期末长盛同庆封闭 B 份额累计参考净值	0.957
长盛同庆封闭 A 的预计年收益率	5.60%

§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		
王宁	本基金基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理、投资管理部总监。	2009年 5 月 12 日	—	13年	男,1971 年 10 月出生,中国国籍,毕业于北京大学光华管理学院,EMBA,历任华夏基金管理有限公司基金经理助理、兴业基金经理等职务。2005 年 8 月加盟长盛基金管理有限公司,曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理等职务。现任投资管理部总监,长盛成长价值证券投资基金基金经理,长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金(本基金)基金经理。
黄瑞庆	本基金基金经理。	2009年 5 月 12 日	2011 年 1 月 11 日	9年	男,1974 年 9 月出生,中国国籍,2002 年 7 月毕业于厦门大学,获博士学位。历任融通基金管理有限公司研究员;长城基金管理有限公司金融工程小组组长,长城货币市场基金基金经理;自 2005 年 9 月起加入长盛基金管理有限公司,曾任社保组合经理,长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理,专户理财部总监,投资管理部副总监。曾任本基金基金经理,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、《长盛同庆可分离交易股票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

2011 年上半年国际市场不断动荡,中东利比亚局势造成石油价格大幅度波动,日本出现地震、海啸、核爆,引起日本股市大幅度下跌,以希腊为首的欧洲债券危机不断升级,美国房地产和就业数据没有明显改善迹象,美联储第二轮量化宽松政策六月底退出,美国政府债务上限是否继续提高,还有国际货币基金组织行长涉嫌犯罪,美国击毙恐怖组织头目拉登等引起石油、黄金、白银等金融交易产品短期大幅度波动。

国内资本市场上半年宏观经济政策以控制物价为主要目的,连续向上调整存款准备金率、加息。国内股市与去年市场表现完全相反,创业板指数、中小板指数连续创新低,其中创业板市场出现历史新低,非周期性行业、中小股票、新兴产业股票表现低迷,新股发行日益艰难,不断跌破发行价的情况,国际市场对中国概念股票的怀疑声音不断,出现做空中国某些股票的苗头。与之相反,周期性股票、大中型股票、传统行业股票曾出现过阶段性表现。

2011 年上半年同庆基金股票组合基本采取谨慎操作策略,降低股票组合仓位比例,防御市场系统性风险,降低中小规模、新型行业的股票比重,适当参与低估值股票的交易投资。

2011 年上半年,由于央行不断向上调整存款准备金,市场资金在春节前后和六月底前后出现阶段性紧张,同庆适当参与交易所和银行间逆回购操作交易,取得无风险收益,提高现金收益水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为 1.022 元,本报告期份额净值增长率为-3.95%,同期业绩比较基准增长率为-1.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过史无前例的廉价资金释放,土地、房产、人力等传统生产要素全部大幅度上涨。上半年宏观政策基本围绕控制物价水平展开,目前没有看到物价出现明显下降迹象的预期,不断提高存款准备金、加息使金融系统资金出现阶段性紧张,尤其是提高存款准备金的数量型货币政策,全社会资金数量紧张带动价格提高,银行变相吸储贷款的理财产品实际收益率已经明显高于存款水平,全社会资金价格水平已经全面上升。

国际投资者对于地方政府融资平台、房地产贷款、中国海外上市公司诚信产生怀疑,央行、银监会和国家审计署关于地方政府融资平台的描述都是引起国内股市上半年系统性调整的主要原因之一。

转变经济发展方式是长期过程,目前继续保持经济增长的动力还是来源于利用增量解决存量问题,主要体现在大力展开保障防建设,但是上半年保障房建设明显低于预期,下半年全国保障房建设是否超预期需要继续验证。

这些因素是否已经充分反映在市场定价水平里面还有待进一步观察。在不确定性因素下寻找业绩持续增长超预期的公司是降低组合不确定性因素的有效方法。

同庆基金将继续按照追求累计业绩的投资管理方式设计投资组合,控制组合下行风险,提高组合上涨收益,为同庆基金持有人提供长期持续稳定增长回报。

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,当存在异议时,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》的规定及本基金基金合同第十九节中对基金利润分配原则的约定,本基金在封闭期内不单独对基金份额所分离的同庆 A 与同庆 B 基金份额进行利润分配。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定,基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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:长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

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	1,631,862,938.38	1,426,645,047.67
结算备付金	127,866,104.93	38,710,901.01
存出保证金	9,779,898.93	3,024,541.73
交易性金融资产	10,645,367,891.16	13,195,640,814.90
其中:股票投资	10,645,367,891.16	13,195,640,814.90
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	1,494,202,681.30	1,000,000,000.00
应收证券清算款	1,465,777,235.59	-
应收利息	1,908,718.21	975,715.32
应收股利	17,761,193.15	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	15,394,526,661.65	15,664,997,020.63
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	357,031,542.67	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	18,162,033.55	20,237,783.45
应付托管费	3,027,005.59	3,372,963.90
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	11,359,879.38	8,918,061.29
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,747,421.07	1,400,000.00
负债合计	391,327,882.26	33,928,808.64
所有者权益:		
实收基金	14,686,733,239.06	14,686,733,239.06
未分配利润	316,465,540.33	944,334,972.93
所有者权益合计	15,003,198,779.39	15,631,068,211.99
负债和所有者权益合计	15,394,526,661.65	15,664,997,020.63

注:报告截止日 2011 年 6 月 30 日,基金份额净值:1.022 元,基金份额总额:14,686,733,239.06 份,其中 A 类基金份额总额 5,874,693,295.62 份,B 类基金份额总额 8,812,039,943.44 份。

6.2 利润表

会计主体:长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

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	-442,764,794.36	-2,979,663,115.13
1.利息收入	38,187,585.71	9,421,080.65
其中:存款利息收入	13,420,313.74	8,633,733.08
债券利息收入	10,168.99	202,462.14
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	24,757,102.98	584,885.43
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"号填列)	-257,724,588.02	-215,735,994.62
其中:股票投资收益	-310,770,045.82	-261,216,898.05
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,323,033.41	673,675.88
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	47,722,424.39	44,807,227.55
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-223,227,792.05	-2,773,348,201.16
4.汇兑收益(损失以"-" 号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-" 号填列)	-	-
减:二、费用	185,104,638.24	156,317,510.93
1.管理人报酬	115,033,964.32	112,690,034.55
2.托管费	19,172,327.38	18,781,672.38
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	50,629,905.82	24,565,868.60
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	268,440.72	279,935.40
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-627,869,432.60	-3,135,980,626.06
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-627,869,432.60	-3,135,980,626.06

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

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)	14,686,733,239.06	944,334,972.93	15,631,068,211.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-627,869,432.60	-627,869,432.60
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	-	-	-
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)	14,686,733,239.06	316,465,540.33	15,003,198,779.39
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)	14,686,733,239.06	1,596,393,164.24	16,283,126,403.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,135,980,626.06	-3,135,980,626.06
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	-	-	-
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)	14,686,733,239.06	-1,539,587,461.82	13,147,145,777.24

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政策变更。

6.4.2.3 差错更正的说明:本报告期不存在会计政策变更。

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
中国建设银行	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	6,650,556,354.52	20.61%	7,308,423,653.76	47.01%

6.4.4.1.2 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	16,310,000,000.00	16.78%	-	-

6.4.4.1.3 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	5,652,960.38	20.88%	1,081,250.84	9.53%
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	6,212,149.78	47.60%	4,626,429.84	72.64%

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	115,033,964.32	112,690,034.55
其中:支付给销售机构的客户维护费	469,936.87	507,622.09

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:

日基金管理费=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 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,172,327.38	18,781,672.38

注:支付基金托管人中国建设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
中国建设银行	-	-	3,498,755,000.00	1,229,461.13	-	-
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
-	-	-	-	-	-	-

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

本基金基金管理人于本报告期(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)及上年度可比期间(2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日)均未投资本基金份额。

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

本基金其他关联方及其控制的机构于本报告期末(2011 年 6 月 30 日)及上年度末(2010 年 12 月 31 日)均未投资本基金份额。

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
中国建设银行	1,631,862,938.38	12,707,684.32	2,828,857,286.85	8,526,859.80

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,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

本基金本报告期内(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)及比较期内(2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日)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:无。

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

金额单位:人民币元

6.4.7.1.1 受限证券类别:股票										
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:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600166	福田汽车	10/09/16	11/09/14	非公开发行	18.06	8.68	7,000,000	126,420,000.00	60,760,000.00	-
600166	福田汽车	-	11/09/14	非公开发行送股	-	8.68	7,000,000	-	60,760,000.00	-

注:本基金持有的非公开发行股票福田汽车,于 2011 年 5 月 16 日实施 2010 年度利润分配方案,向全体股东每 10 股派送股票 10 股并派送 28 元(含税)。本基金因此次利润分配新增 7,000,000 股,并将与原持有非公开发行部分同时上市流通。

基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

(a)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。

(b)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为交易性金融资产和衍生工具金融资产,其中属于第一层级的余额为 10,523,847,891.16 元,属于第二层级的余额为 121,520,000.00 元,无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日:第一层级 13,056,480,814.90 元,第二层级 139,160,000.00 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 年度可比期间: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	10,645,367,891.16	69.15
	其中:股票	10,645,367,891.16	69.15
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	1,494,202,681.30	9.71
	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	1,759,729,043.31	11.43
6	其他各项资产	1,495,227,045.88	9.71
7	合计	15,394,526,661.65	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	155,739,048.75	1.04
B	采掘业	419,320,064.48	2.79
C	制造业	5,956,734,861.95	39.70
C0	食品、饮料	925,014,593.51	6.17
C1	纺织、服装、皮毛	46,538,787.48	0.31
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	16,011,544.86	0.11
C4	石油、化学、塑胶、塑料	585,985,859.96	3.91
C5	电子	458,679,470.08	3.06
C6	金属、非金属	1,280,787,121.87	8.54
C7	机械、设备、仪表	1,940,381,240.37	12.93
C8	医药、生物制品	703,336,243.82	4.69
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水