

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2011年08月27日

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、董事承诺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法律责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司以下简称“中国工商银行”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。

Table with 2 columns: 基金基本情况, 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金份额总额, 基金合同存续期.

2.2 基金产品说明
本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标,并追求风险调整后收益最大化,满足投资者长期稳健的投资收益需求。

Table with 2 columns: 2.3 基金管理人, 基金管理人, 基金托管人, 名称, 姓名, 联系电话, 电子邮箱, 客户服务电话, 传真.

Table with 2 columns: 2.4 信息披露方式, 基金半年度报告正文的披露网址, 基金半年度报告备置地点.

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

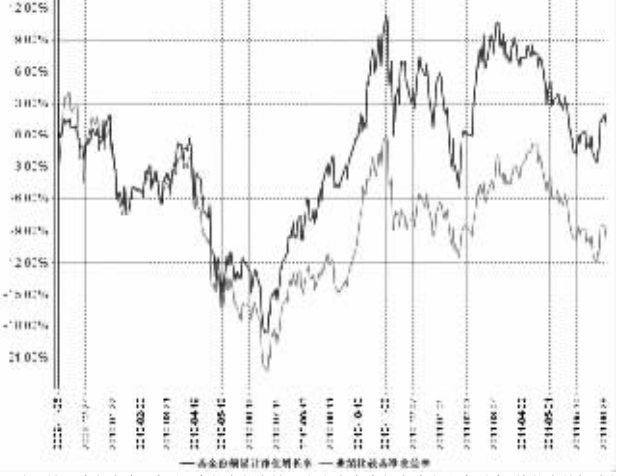
Table with 2 columns: 3.1.1 期间数据和指标, 本期, 上年同期.

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。

Table with 2 columns: 3.2 基金业绩比较基准, 阶段, 跟踪偏离度, 跟踪偏离度标准差, 业绩比较基准收益率, 业绩比较基准收益率标准差.

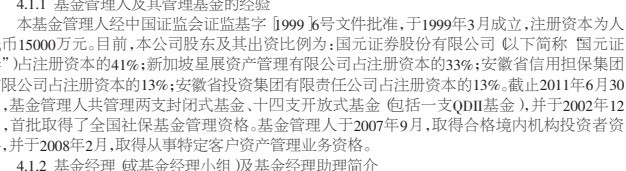
注:本基金业绩比较基准=75%×中证红利指数+25%×中证综合指数
其中,中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的100只股票作为样本,以反映A股市场高红利股票的整体状况和走势,比较起来,该指数具有较好的权威性、市场代表性,作为衡量本基金业绩的基准,较为合适。

3.2.1 基金净值增长与同期业绩比较基准收益率的对比



注:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自本基金成立六个月内,使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第一部分投资范围、投资限制的有关约定。本报告期内,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的对比



注:本基金业绩比较基准=75%×中证红利指数+25%×中证综合指数
其中,中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的100只股票作为样本,以反映A股市场高红利股票的整体状况和走势,比较起来,该指数具有较好的权威性、市场代表性,作为衡量本基金业绩的基准,较为合适。

3.3 基金管理人及其基金业绩情况
3.3.1 基金管理人及其基金业绩情况
3.3.2 基金管理人及其基金业绩情况

Table with 2 columns: 基金管理人, 基金管理人, 基金托管人, 姓名, 性别, 年龄, 学历, 工作经历.

注:1.上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决议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 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛量化红利策略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的利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况
本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易管理制度指导意见》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。

4.4 管理人报告期内基金资产净值变动情况的专项说明
本报告期内,本基金未发生异常交易情况。
4.4.1 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛量化红利策略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的利益的行为。

4.4.3 公平交易制度的执行情况
本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金公平交易管理制度指导意见》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。

4.4.4 管理人报告期内基金资产净值变动情况的专项说明
本报告期内,本基金未发生异常交易情况。
4.4.5 管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

长盛量化红利策略股票型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

4.6 管理人对于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。

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交易
6.4.4.1.1 股票交易

Table with 2 columns: 关联方名称, 与本基金的关系. Rows include 长盛基金管理有限公司, 中国工商银行, 天元证券.

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 天元证券, 中国工商银行, 长盛基金管理有限公司.

6.4.4.1.2 支付关联方佣金
6.4.4.1.2.1 股票交易

Table with 2 columns: 关联方名称, 本期, 上年度可比期间. Rows include 天元证券, 中国工商银行, 长盛基金管理有限公司.

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。债券及期货交易不计佣金。
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。

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的基金管理费, 其中:支付给基金托管人的客户服务费.

6.4.4.2 基金管理费
6.4.4.2.1 股票交易

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Rows include 当期发生的基金应支付的托管费, 其中:支付给基金托管人的客户服务费.

注:支付基金托管人中国工商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x0.25%/当年天数。
6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 回购交易
本基金本报告期自2011年1月1日至2011年6月30日,及较同期自2010年1月1日至2010年6月30日,未与关联方进行银行间同业市场的债券 回购交易。

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

Table with 2 columns: 项目, 本期, 上年度可比期间. Rows include 基金合同生效日, 期初持有的基金份额, 期间买入的基金份额, 期间买出的基金份额, 期末持有的基金份额.

基金管理人长盛基金管理有限公司持有基金份额均为认购期内认购所得,认购委托国元证券办理,认购费率为1.0000%。
6.4.4.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

Table with 2 columns: 关联方名称, 持有的基金份额, 持有的基金份额比例. Rows include 安徽省投资集团, 国元证券, 中国工商银行.

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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: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
6.4.5.2 期末未持有因认购新发增发证券而于期末持有的流通受限证券。
6.4.5.3 期末未持有暂时停牌等流通受限股票。
6.4.5.4 期末未持有暂时停牌等流通受限股票。
6.4.5.5 期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
6.4.6.1 公允价值
6.4.6.1.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.6.2 公允价值
6.4.6.2.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.2.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.2.3 公允价值
6.4.6.2.4 公允价值

6.4.6.3 公允价值
6.4.6.3.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.3.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.3.3 公允价值
6.4.6.3.4 公允价值

6.4.6.4 公允价值
6.4.6.4.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.4.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.4.3 公允价值
6.4.6.4.4 公允价值

6.4.6.5 公允价值
6.4.6.5.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.5.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.5.3 公允价值
6.4.6.5.4 公允价值

6.4.6.6 公允价值
6.4.6.6.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.6.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.6.3 公允价值
6.4.6.6.4 公允价值

6.4.6.7 公允价值
6.4.6.7.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.7.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.7.3 公允价值
6.4.6.7.4 公允价值

6.4.6.8 公允价值
6.4.6.8.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.8.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.8.3 公允价值
6.4.6.8.4 公允价值

6.4.6.9 公允价值
6.4.6.9.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.9.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.9.3 公允价值
6.4.6.9.4 公允价值

6.4.6.10 公允价值
6.4.6.10.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.10.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.10.3 公允价值
6.4.6.10.4 公允价值

6.4.6.11 公允价值
6.4.6.11.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.11.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.11.3 公允价值
6.4.6.11.4 公允价值

6.4.6.12 公允价值
6.4.6.12.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.12.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.12.3 公允价值
6.4.6.12.4 公允价值

6.4.6.13 公允价值
6.4.6.13.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.13.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.13.3 公允价值
6.4.6.13.4 公允价值

6.4.6.14 公允价值
6.4.6.14.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.14.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.14.3 公允价值
6.4.6.14.4 公允价值

6.4.6.15 公允价值
6.4.6.15.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.15.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.15.3 公允价值
6.4.6.15.4 公允价值

6.4.6.16 公允价值
6.4.6.16.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.16.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.16.3 公允价值
6.4.6.16.4 公允价值

6.4.6.17 公允价值
6.4.6.17.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.17.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.17.3 公允价值
6.4.6.17.4 公允价值

6.4.6.18 公允价值
6.4.6.18.1 不以公允价值计量的金融工具
6.4.6.18.2 以公允价值计量的金融工具
6.4.6.18.3 公允价值
6.4.6.18.4 公允价值

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.csfund.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

Table with 5 columns: 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比例(%)

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 5 columns: 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比例(%)

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本, 卖出股票收入.

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)填写,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
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序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序的所有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序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 报告期内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。
7.9.2 报告期内本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。
7.9.3 期末其他各项资产构成

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

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
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金, 2 应收证券清算款, 3 应收股利, 4 应收利息, 5 应收申购款, 6 其他应收款, 7 待摊费用, 8 其他, 9 合计.

8.2 期末基金管理人从业人数持有本基金开放式基金的情况

Table with 2 columns: 项目, 持有份额总数(份), 占基金总份额比例.

8.3 开放式基金份额变动
8.3.1 基金份额变动
8.3.2 基金份额变动

8.3.3 基金份额变动
8.3.3.1 基金份额变动
8.3.3.2 基金份额变动

8.3.4 基金份额变动
8.3.4.1 基金份额变动
8.3.4.2 基金份额变动

8.3.5 基金份额变动
8.3.5.1 基金份额变动
8.3.5.2 基金份额变动

8.3.6 基金份额变动
8.3.6.1 基金份额变动
8.3.6.2 基金份额变动

8.3.7 基金份额变动
8.3.7.1 基金份额变动
8.3.7.2 基金份额变动

8.3.8 基金份额变动
8.3.8.1 基金份额变动
8.3.8.2 基金份额变动

8.3.9 基金份额变动
8.3.9.1 基金份额变动
8.3.9.2 基金份额变动

8.3.10 基金份额变动
8.3.10.1 基金份额变动
8.3.10.2 基金份额变动

8.3.11 基金份额变动
8.3.11.1 基金份额变动
8.3.11.2 基金份额变动

8.3.12 基金份额变动
8.3.12.1 基金份额变动
8.3.12.2 基金份额变动

8.3.13 基金份额变动
8.3.13.1 基金份额变动
8.3.13.2 基金份额变动

8.3.14 基金份额变动
8.3.14.1 基金份额变动
8.3.14.2 基金份额变动

8.3.15 基金份额变动
8.3.15.1 基金份额变动
8.3.15.2 基金份额变动

8.3.16 基金份额变动
8.3.16.1 基金份额变动
8.3.16.2 基金份额变动

8.3.17 基金份额变动
8.3.17.1 基金份额变动
8.3.17.2 基金份额变动