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

长盛环球景气行业大盘精选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。

基金托管人中国银行股份有限公司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

基金简称	长盛环球行业股票(QDII)
基金主代码	080006
交易代码	080006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月26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	54,682,751.25份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球证券市场,把握全球经济趋势,精选景气投资行业,并在此基础上投资于其中的优势公司,实现充分分享全球经济增长收益的目标;同时在投资国家或地区配置上,有效实现全球分散化投资,力争充分分散风险,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法,运用Black-Litterman资产配置模型实现行业层面的风险最优配置,在行业内部,运用全球量化选股模型精选个股,投资管理人将两者进行有机结合,构建最优化的投资组合。
业绩比较基准	摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index)
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金。同时,本基金为全球股票型证券投资基金,除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。此外,由于投资国家与地区市场的分散,风险低于投资单一市场的股票型基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	唐州徽
	联系电话	010-82019988	010-66594855
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgcxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	GOLDMAN SACHS ASSET MANAGEMENT,L.P.	BANK OF CHINA (HONG KONG LIMITED)
	中文	高盛资产管理有限责任合伙	中国银行(香港)有限公司
注册地址		200 West Street, New York, NY 10282-2198	香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港皇后大道中2号长江集团中心68楼	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 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、基金净值表现及利润分配情况

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01日-2011年6月30日)
本期已实现收益	1,842,276.28
本期利润	-2,004,190.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0311
本期基金份额净值增长率	-3.86%
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	-0.0127
期末基金资产净值	53,987,027.41
期末基金份额净值	0.987

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	-2.95%	0.82%	-1.65%	1.02%	-1.30%	-0.20%
过去三个月	-4.08%	0.70%	-0.24%	0.88%	-3.84%	-0.18%
过去六个月	-3.86%	0.68%	3.80%	0.85%	-7.66%	-0.17%
过去一年	5.02%	0.62%	26.64%	0.89%	-21.62%	-0.27%
自基金合同生效起至今	3.45%	0.60%	25.50%	0.97%	-22.05%	-0.37%

注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

业绩比较基准=摩根斯坦利世界大盘股可投资指数(MSCI World Large Cap IMI Index)×100%(以下简称MSCI世界指数)。

本基金为股票型基金,主要投资范围为全球主要发达地区股票市场大盘类股票,在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后选取上述指数。

摩根斯坦利世界大盘股可投资指数是按照自由流通市值调整方法编制的跟踪全球成熟市场的全球性投资指数,是MSCI标准化指数之一,适合作为全球市场投资业绩比较基准的指数。全球超过80%的基金经理人,是以MSCIBARRA编制的指数作为投资绩效评估的标准。在全球范围内,MSCI世界指数已经成为全球市场投资工具的基准标尺之一,并且由MSCIBARRA每日在市场发布。截至2010年12月,摩根斯坦利世界大盘股可投资指数涵盖23个国家和地区的超过730只股票,代表了全球国家大约75%的总市值,与本基金主要投资方向比较吻合。

MSCI世界指数样本覆盖了与证监会已经签立合作谅解备忘录的主要国家,并为许多国际著名股票投资基金选用为投资比较基准,具有良好的市场代表性。比较起来,该指数具有较好的权威性、市场代表性,用为衡量本基金业绩的基准比较合适。

本基金的股票资产占基金资产的60%-95%。在正常的市场情况下,基金的平均股票仓位约为85%,所以,业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

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

(2010年5月26日至2011年6月30日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日,本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(二)投资范围、(九)投资限制的有关约定。

§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(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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴达	本基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,国际业务部总监。	2010年5月26日	-	9年	男,1979年8月出生,中国国籍。伦敦政治经济学院金融经济学硕士,CFA(美国特许金融分析师)。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理,专户投资组合经理;新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理,资产配置委员会成员;华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理;2007年8月起加入长盛基金管理有限公司,现任国际业务部总监,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金(本基金)基金经理。
邓永健	本基金基金经理。	2010年5月26日	-	16年	男,1967年10月出生,中国香港籍。英国兰卡斯特大学工商管理硕士,CFA(美国特许金融分析师)。历任恩佩投资管理有限公司助理基金经理;元大京华证券(香港)有限公司高级经理;大福资产管理有限公司助理董事;星展资产管理(香港)有限公司总监及高级基金经理;加拿大宏利资产管理(香港)有限公司股票部行政总监;2007年12月起加入长盛基金管理有限公司,现任长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金(本基金)基金经理。

注:1、报经中国证券业协会同意,目前邓永健同志已不再担任长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金经理,由吴达同志继续担任本基金基金经理。。该事项公司已于2011年8月3日进行公告。

2、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;

3、"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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Len Ioffe	高盛全球量化股票团队的高级投资组合经理,全球量化股票投资政策委员会成员。	16年	俄罗斯圣彼得堡理工大学硕发的计算机科学硕士,纽约大学斯特恩商学院工商管理硕士,曾供职于史密斯·巴尼·希尔森公司。1994年加入高盛资产管理,曾负责美国国内及国际投资组合的建立及风险分析,并实施不同的交易策略。

4.3 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《基金法》及其各项实施准则、《长盛环球景气行业大盘精选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,在严格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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年上半年,全球资本市场走出了反复震荡的行情,对于金融危机以来复苏的认知多次受到突发事件的干扰。一季度北非和利比亚的局势动荡、日本福岛地震核危机推动股市在三月份完成获利回吐并迅速反弹。二季度中期,由于美国二次量化宽松6月底到期及欧洲债务危机的恶化市场再次剧烈调整,随后受希腊债务重组方案通过的事件刺激在6月的最后一周快速收复失地。市场的剧烈反复显示整体投资者的信心比较脆弱,对大规模量化宽松后超发货币推动的全球通货膨胀担忧,进而怀疑企业毛利率扩张的可持续性。

从企业微观层面上看,美国消费者信心恢复仍在缓慢进程中,以全球需求为主导的美国中大型企业盈利状况良好,在一定程度上也受益于疲软的美元。虽然由于缩减成本带来的毛利率上升空间已经不大,但从近月来营业收入增长趋势上看,下阶段可以期待以量补价的行情。

基于对美国企业基本面的乐观预期和宽松的联储货币政策,本基金保持了对美国市场的投资仓位,在上半年表现了比较高的波动性。出于对欧洲债务问题的长期担忧继续低配欧洲,但由于核心西欧市场的良好表现,低配效果并不明显。中国经济增速下滑使得组合在海外中国企业部分的投资受压,下半年基金将在通胀压力减轻的背景下寻找优质企业价值重估的机会。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.987元,本报告期份额净值增长率为-3.86%,同期业绩比较基准增长率为3.80%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从美国经济分项数据来看,服务业相关的就业情况并没有像近期失业率数据反映的悲观,主要的反复来自于制造业主对于库存管理的谨慎态度,日本地震对汽车和电子产品等相关产业链的供应打击。随着日本地震后重建在下半年陆续展开,全球经济预计在今年全年展现前低后高的格局。

虽然二次量化宽松在6月份如期结束,美国政府对于刺激经济复苏的决心还是比较明显的。关于提高美国国债上限的讨论将在8月份提交结果,5月份宣布本拉登被击毙为美国加快中东撤军的速度做了铺垫,为美国政府在未来6到12个月实施积极的财政政策打开了空间。美联储的议息会议纪要表明二次量化宽松结束后将继续保持宽松的货币政策环境,虽然核心通货膨胀率近期有所攀升,但美联储的主要关注点仍然是失业率的改善情况。近期政府促使能源总署IEA释放部分原油储备也向市场放出了明确信号,希望从打压油价入手控制通胀预期,从而为维持宽松的货币政策留下时间窗口。同时,美联储开始着手研究前两次量化宽松注入的流动性在银行系统沉淀的庞大超额储备,希望通过利率政策活化流动性,增强货币乘数促进信贷和工商业活动。

在6月最后一周希腊债务通过重组方案注入市场一只强心剂,同时对于中国通货膨胀在近期将触顶回落后带来的政策宽松预期升温,市场情绪转好迹象明显。下半年随着经济复苏的重新启动,预计为上游资源类行业、消费相关行业板块、日本复苏带动的IT电子类行业带来机会。

4.7 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《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。

4.8 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十九条中对基金利润分配原则的约定,本基金于2011年1月13日对2010年度收益进行了分配,分配金额为3,684,366.98元。

本基金截至2011年6月30日,期末可供分配收益为-695,723.84元,末分配收益已实现部分为2,069,625.08元,未分配收益未实现部分为-2,765,348.92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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:长盛环球景气行业大盘精选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	11,015,054.26	15,291,408.17
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	43,884,519.66	63,545,669.45
其中:股票投资	43,884,519.66	63,545,669.45
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	-	-
应收证券清算款	1,149,821.54	2,635,117.19
应收利息	320.46	973.07
应收股利	52,602.08	26,834.13
应收申购款	8,101.80	255,249.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	56,110,419.80	81,755,251.56
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	1,787,527.89	-
应付赎回款	79,285.13	540,350.51
应付管理人报酬	79,483.61	126,941.35
应付托管费	13,247.28	21,156.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	163,848.48	62,036.49
负债合计	2,123,392.39	750,485.23
所有者权益:		
实收基金	54,682,751.25	75,304,253.96
未分配利润	-695,723.84	5,700,512.37
所有者权益合计	53,987,027.41	81,004,766.33
负债和所有者权益总计	56,110,419.80	81,755,251.56

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值0.987元,基金份额总额54,682,751.25份。

6.2 利润表

会计主体:长盛环球景气行业大盘精选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5月26日(基金合同生效日)至2010年6月30日
一、收入	-992,755.20	-4,155,026.91
1.利息收入	6,085.14	198,533.64
其中:存款利息收入	6,085.14	198,533.64
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	2,839,002.89	3,072.56
其中:股票投资收益	2,462,981.41	
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	376,021.48	3,072.56
3.公允价值变动收益(损失以"-"填列)	-3,846,466.58	-3,883,508.02
4.汇兑收益(损失以"-"填列)	-22,236.03	-473,125.09
5.其他收入(损失以"-"填列)	30,859.38	-
减:二、费用	1,011,435.10	810,957.55
1.管理人报酬	590,316.21	586,072.59
2.托管费	98,386.02	97,678.77
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	154,279.62	95,557.71
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	168,453.25	31,648.48
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-2,004,190.30	-4,965,984.46
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-2,004,190.30	-4,965,984.46

注:本基金合同生效日为2010年5月26日,截至本报告期末,利润表无完整的可比期间。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛环球景气行业大盘精选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)	75,304,253.96	5,700,512.37	81,004,766.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,004,190.30	-2,004,190.30
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)	-20,621,502.71	-707,678.93	-21,329,181.64
其中:1.基金申购款	4,069,822.13	91,898.19	4,161,720.32
2.基金赎回款	-24,691,324.84	-799,577.12	-25,490,901.96
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)	-	-3,684,366.98	-3,684,366.98
五、期末所有者权益(基金净值)	54,682,751.25	-695,723.84	53,987,027.41

项 目	上年度可比期间 2010年5月26日(基金合同生效日)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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,965,984.46	-4,965,984.46
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)	340,041,384.63	-	340,041,384.63
其中:1.基金申购款	340,041,384.63	-	340,041,384.63
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)	340,041,384.63	-4,965,984.46	335,075,400.17

注:本基金合同生效日为2010年5月26日,截至本报告期末,所有者权益(基金净值)变动表无完整的可比期间。

报表附注为本会计报表的组成部分。

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("长盛基金公司")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
国元证券经纪(香港)有限公司(GUOYUAN SECURITIES BROKERAGE (HONG KONG) LIMITED)	基金管理人股东控制的公司

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

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5月26日(基金合同生效日)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
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	-	-	13,512,999.54	19.50%
国元证券经纪(香港)有限公司	5,374,993.23	5.51%	-	-

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 应支付关联方的佣金

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	期末应付佣金总额	占期末应付佣金总额的比例
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	-	-	-	-
国元证券经纪(香港)有限公司	5,374.99	5.82%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年5月26日(基金合同生效日)至2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金总额	占期末应付佣金总额的比例
GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL	20,869.15	37.58%	-	-
国元证券经纪(香港)有限公司	-	-	-	-

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5月26日(基金合同生效日)至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	590,316.21	586,072.59
其中:支付给销售机构的客户维护费	185,277.00	204,402.64

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1.8%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×1.8%/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5月26日(基金合同生效日)至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	98,386.02	97,678.77

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.30%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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.30%/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发生银行间同业市场的债券(含回购)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

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5月26日至2010年6月30日
基金合同生效日(2008年6月4日)持有的基金份额	-	18,003,410.00
期初持有的基金份额	18,003,410.00	-
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	18,003,410.00	18,003,410.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	32.92%	5.29%

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5月26日(基金合同生效日)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
中国银行	1,511,280.57	6,069.01	245,324,844.58	198,533.64
中银香港	9,503,773.69	-	32,547,808.64	-
合计	11,015,054.26	6,069.01	277,872,653.22	198,533.64

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管。其中,中国银行保管部分的资金按适用利率或约定利率计息,中银香港保管部分的资金不计息。

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

6.4.4.7.1 与关联方进行的外汇远期交易

本基金本期未与关联方进行外汇远期交易。

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

本基金本期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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交易中作为抵押的债券。

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。

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43,884,519.66元,无属于第二层级和第三层级的余额(2010年12月31日:第一层级63,545,669.45元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

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	43,884,519.66	78.21
	其中:普通股	43,884,519.66	78.21
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,015,054.26	19.63
8	其他各项资产	1,210,845.88	2.16
9	合计	56,110,419.80	100.00

7.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
美国	21,686,176.28	40.17
香港	14,465,896.85	26.80
法国	2,331,336.65	4.32
英国	2,029,702.73	3.76
瑞士	1,511,880.01	2.80
加拿大	1,385,101.52	2.57
德国	474,425.62	0.88

7.3 报告期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
信息技术	9,183,232.40	17.01
金融	6,913,320.81	12.81
能源	6,727,317.71	12.46
非必需消费品	6,590,344.46	12.21
材料	5,943,971.41	11.01
医疗	5,331,191.12	9.87
工业	2,614,670.99	4.84
必需消费品	580,470.76	1.08
合计	43,884,519.66	81.29

注:本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准(GICS)进行行业分类

7.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	JPMORGAN CHASE & CO	-	JPM US	纽约证券交易所	美国	9,500	2,516,999.39	4.66
2	APPLE INC	-	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,000	2,172,321.97	4.02
3	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源有限公司	135 HK	香港证券交易所	中国香港	160,000	1,780,332.10	3.30
4	PNC FINANCIAL SERVICE	-	PNC US	纽约证券交易所	美国	4,000	1,543,088.30	2.86
5	HUA HAN BIO-PHARMACEUTICAL HOLDING LIMITED	华翰生物制药控股有限公司	587 HK	香港证券交易所	中