

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
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。

基金管理人招商银行股份有限公司(以下简称:招商银行)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。
本报告中所载资料未经审计。

本报告自2011年7月1日起至2011年6月30日止。

§2 基金简介

Table with 2 columns: 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, 基金运作币种, 基金资产总值, 基金资产净值, 基金份额持有人户数, 基金份额上市证券交易所, 上市日期

§3 主要财务数据和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标
单位:人民币元

Table with 2 columns: 项目, 本报告期(2011年1月1日至2011年6月30日), 本报告期末, 本报告期初

3.2 基金净值表现

基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, 净值增长率偏离度③, 净值增长率偏离度④

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理简介
基金管理人招商银行股份有限公司(以下简称:招商银行)经中国证监会核准,于1999年3月成立,注册资本为人民币15000万元。

长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

§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
托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,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
本报告期内基金管理人投资运作、基金资产净值的计算、利息分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

5.3 托管人对年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表:长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)
报告截止日:2011年6月30日

Table with 3 columns: 资产, 本报告期末(2011年6月30日), 上年度末(2010年12月31日)

Table with 3 columns: 负债和所有者权益, 本报告期末(2011年6月30日), 上年度末(2010年12月31日)

注:本基金截至2011年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌股票,该些股票将在公告停牌期间予以跟踪,经交易所批准复牌后,经交易所批准复牌。

6.4.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本期未发生银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本期未发生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
0公允价值
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。

6.4.6.1 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(比如报价)或间接(比如根据价格推算)可观察到的、除第一层级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,其中属于第一层级的余额为196,610,421.95元,属于第二层级的余额为1,610,667.02元,无属于第三层级的余额。

于2011年6月30日,第一层级为245,854,965.33元,第二层级为2,081,304.84元,无第三层级。

对于持有的重大事项停牌股票,本基金根据估值技术采用不可观察输入值对于公允价值的重大影响,确定相关股票公允价值所处的层级为2010年度。

0 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
单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合
单位:人民币元

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
单位:人民币元

Table with 5 columns: 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(%)

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
注:投资者每个月对本报告期末基金投资的所有股票明细,应网络登录于http://www.csfund.com.cn网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
注:投资者每个月对本报告期末基金投资的所有股票明细,应网络登录于http://www.csfund.com.cn网站的半年度报告正文。

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
单位:人民币元

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
单位:人民币元

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(%)

买入股票成本/成交总额
卖出股票收入/成交总额
注:本期7.4.1、7.4.2、7.4.3表格中的“买入金额”、“卖出金额”、“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交金额以成交数量*成交价)计算,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
单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

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
单位:人民币元

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

注:本基金本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该些股票将在公告停牌期间予以跟踪,经交易所批准复牌后,经交易所批准复牌。

6.4.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本期未发生银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本期未发生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
0公允价值
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。

6.4.6.1 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(比如报价)或间接(比如根据价格推算)可观察到的、除第一层级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,其中属于第一层级的余额为196,610,421.95元,属于第二层级的余额为1,610,667.02元,无属于第三层级的余额。

于2011年6月30日,第一层级为245,854,965.33元,第二层级为2,081,304.84元,无第三层级。

对于持有的重大事项停牌股票,本基金根据估值技术采用不可观察输入值对于公允价值的重大影响,确定相关股票公允价值所处的层级为2010年度。

0 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
单位:人民币元

Table with 3 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%)

7.2 期末按行业分类的股票投资组合
单位:人民币元

Table with 4 columns: 序号, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合
单位:人民币元

Table with 4 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例(%)

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细
单位:人民币元

Table with 5 columns: 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(%)

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
注:投资者每个月对本报告期末基金投资的所有股票明细,应网络登录于http://www.csfund.com.cn网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
注:投资者每个月对本报告期末基金投资的所有股票明细,应网络登录于http://www.csfund.com.cn网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前