长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金 2010年半年度报告摘要

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：2010年8月24日

§1 重要提示

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2010年8月23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2010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	长盛创新先锋混合
基金主代码	080002
交易代码	080002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月4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	142,779,489.29份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	选择具有创新能力和行业领先的上市公司，分享企业高速增长成果，在承担适度风险的基础上，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金为混合型证券投资基金，在资产配置上会考虑宏观经济因素、政策因素及市场估值水平。在个股选择上将根据不同行业景气度、"长盛创新违股体系"和"长盛优势违股体系"的股票筛选原则和方法优化个股投资比重。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金强调精选投资价值较大的创新领先企业，突出资产配置的灵活性和主动性，风险收益略低于股票型基金，高于债券型基金和平衡型基金。

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	010-82255818	010-66594855
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666，010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

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	基金管理人的办公地址和基金托管人的住所

§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（2010年1月01日-2010年6月30日）
本期已实现收益	-9,093,013.44
本期利润	-24,863,475.76
加权平均基金份额本期利润	-0.1535
本期基金份额净值增长率	-12.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2010年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	-0.0055
期末基金资产净值	142,000,724.41
期末基金份额净值	0.9945

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	-5.89%	1.14%	-4.86%	1.08%	-1.03%	0.06%
过去三个月	-13.68%	1.23%	-15.38%	1.18%	1.70%	0.05%
过去六个月	-12.76%	1.06%	-18.41%	1.03%	5.65%	0.03%
过去一年	-1.29%	1.37%	-10.84%	1.23%	9.55%	0.14%
自基金合同生效起至今	20.57%	1.31%	-14.42%	1.51%	34.99%	-0.20%

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=沪深300指数×65%+上证国债指数×35%

本基金为混合型基金，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，选定沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用上证国债指数。

沪深300指数是沪深证券交易所联合发布的反映A股市场整体走势的成份股指数，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，样本覆盖了沪深市场约六成的市值，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，较为合适。

本基金的股票资产占基金资产的30%-80%。在正常的市场情况下，基金的平均股票仓位约为65%，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。

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，基准指数每日按照65%、35%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

（2008年6月4日至2010年6月30日）

§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2010年6月30日，基金管理人共管理两支封闭式基金（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		
邓永明	本基金基金经理，长盛动态精选证券投资基金基金经理。	2008年6月4日	—	11年	男，1971年7月出生，中国国籍，毕业于山西农业大学，获学士学位。1999年4月到2005年7月就职于大成基金管理有限公司，曾任职研究员、交易员和基金经理助理。2005年7月底加入长盛基金管理有限公司投资管理部，曾任同益证券投资基金基金经理助理，同德证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。现任长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛动态精选证券投资基金基金经理。
李庆林	本基金基金经理。	2010年3月3日	—	7年	男，1974年10月出生，中国国籍。中国人民大学硕士。曾先后在长城证券有限公司、国元证券有限公司和建信基金管理有限公司担任研究员等职务。2009年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究发展部副总监，现任长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理。
肖强	本基金基金经理。	2008年6月4日	2010年3月3日	17年	男，1967年12月出生，中国国籍。毕业于中国人民公安大学，获学士学位。历任中信证券股份有限公司北太平庄营业部总经理助理；中信证券股份有限公司研究咨询部副总经理、高级分析师；中信证券股份有限公司交易部高级交易员。2002年6月加入长盛基金管理有限公司，历任基金同盛基金经理助理、基金同益基金经理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、基金同智基金经理，投资管理部副总监，长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理等职务。现任长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理。

注：1、报经中国证券业协会同意，解聘邓永明先生长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理职务，同时聘任其担任长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。该事项公司已于2010年8月14日公告。

2、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日；

3、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券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，截至2010年4月2日，本基金持有的债券比例连续超过10个交易日低于基金资产的15%，不符合本基金合同关于"债券投资占基金资产的15%-65%"的约定，基金管理人已于2010年4月6日按基金合同完成调整。除此之外，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛创新先锋灵活配置混合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。

4.3 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 报告期内行情回顾和本基金投资策略分析

上半年，证券市场的走势同宏观经济表现呈现了背离。在坚信经济复苏较为稳固的情况下，出于对价格水平的忧虑，政府二季度采取了一系列的宏观调控措施，包括房地产政策、地方投融资平台的清理以及汇率弹性的扩大等，这些政策也有效地限制了社会总需求的快速增长。尽管如此，经济总量仍然保持一个高位快速的增长。在我国宏观经济表现全球独树一帜的同时，资本市场的表现不尽如人意。除了医药等个别行业外，所有行业指数都大幅度下跌。

上半年，基金的表现不是特别理想，主要是因为二季度，我们在控制仓位的同时，加大了组合中股票的弹性。由于周期性行业的大幅度下跌，以及市场中大小风格并没有转换，基金表现不尽如人意。

4.4.2 本基金业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.9945元，本报告期份额净值增长率为-12.76%，同期业绩比较基准增长率为-18.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

4.5.1 管理人对宏观经济和证券市场的展望

展望下半年，我们认为尽管全球经济受欧债危机以及美国无就业复苏的困扰，短时间内难以较快地的增长，但是在全球经济体协调性提高的情况下，二次探底的风险较小。不过，经济体再平衡的过程仍将持续。

中国经济复苏较为稳固，但是对价格水平的担忧替代了对经济增长的重视。在经济增长质量没有得到有效改善的情况下，依靠货币扩张推动投资并带来经济增长的模式必然引起价格水平的快速提升。预计政府将继续对房地产行业和地方投融资平台采取较为严格的限制政策，在维持经济增长的同时，经济结构的调整将是未来的主要方向。

对于中国目前的证券市场，考虑到企业的盈利水平，目前的估值水平并不高，尤其是以金融行业为代表的蓝筹股，即使同国际化程度较高的香港市场相比，估值水平仍有一定的折扣。整体上看，中国证券市场仍然处于健康发展之中。目前证券市场的过度悲观也许反映了投资者对中国经济转型的长期性和艰苦性。

4.5.2 本基金下阶段投资策略

本基金下阶段将围绕经济结构调整的大主题，挖掘增长较为明确、相对估值较低的个股，力求获得较好的收益。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金截至2010年6月30日期末可供分配收益为-778,764.88元。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，2010年上半年度未实施利润分配。

§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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金（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，报告期内，本基金出现过持有的债券比例低于本基金合同规定的情况，托管人对此进行了提示，基金管理人已进行相应调整。

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），投资组合报告中的数据核对无误。

§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：长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2010年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
资产：		
银行存款	28,871,387.43	10,287,870.51
结算备付金	360,468.51	3,284,880.69
存出保证金	1,000,000.00	1,393,238.50
交易性金融资产	112,651,781.37	166,446,045.15
其中：股票投资	86,781,331.37	138,927,076.15
基金投资	-	-
债券投资	25,870,450.00	27,518,969.00
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		-
应收利息	461,619.97	602,203.11
应收股利		-
应收申购款	19,051.35	2,861.53
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	143,364,308.63	182,017,099.49
负债和所有者权益	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009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		515,887.35
应付赎回款	31,883.16	166,139.14
应付管理人报酬	184,725.01	252,555.54
应付托管费	30,787.49	42,092.57
应付销售服务费		-
应付交易费用	197,138.65	1,502,623.61
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	919,049.91	815,493.01
负债合计	1,363,584.22	3,294,791.22
所有者权益：		
实收基金	142,779,489.29	156,785,782.84
未分配利润	-778,764.88	21,936,525.43
所有者权益合计	142,000,724.41	178,722,308.27
负债和所有者权益总计	143,364,308.63	182,017,099.49

注：报告截止日2010年6月30日，基金份额净值：0.9945元，基金份额总额142,779,489.29份。

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
一、收入	-21,850,871.99	125,436,504.87
1.利息收入	455,483.92	1,262,223.19
其中：存款利息收入	138,001.47	178,512.27
债券利息收入	317,482.45	1,083,710.92
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）	-6,811,146.67	98,402,512.26
其中：股票投资收益	-6,677,950.28	97,420,540.82
基金投资收益		-
债券投资收益	-344,841.01	193,045.00
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	211,644.62	788,926.44
3.公允价值变动收益（损失以"-"填列）	-15,770,462.32	25,381,200.86
4.汇兑收益（损失以"-"填列）		-
5.其他收入（损失以"-"填列）	275,253.08	390,568.56
减：二、费用	3,012,603.77	8,122,618.85
1.管理人报酬	1,324,196.23	2,353,467.25
2.托管费	220,699.39	392,244.55
3.销售服务费	0	-
4.交易费用	1,301,431.00	5,196,724.58
5.利息支出	0	-
其中：卖出回购金融资产支出	0	-
6.其他费用	166,277.15	180,182.47
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-24,863,475.76	117,313,886.02
所得税费用（以"-"号填列）		-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-24,863,475.76	117,313,886.02

注：后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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）	156,785,782.84	21,936,525.43	178,722,308.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-24,863,475.76	-24,863,475.76
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）	-14,006,293.55	2,148,185.45	-11,858,108.10
其中：1.基金申购款	186,486,570.29	23,820,380.43	210,306,950.72
2.基金赎回款（以"-"号填列）	-200,492,863.84	-21,672,194.98	-222,165,058.82
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）	142,779,489.29	-778,764.88	142,000,724.41
	上年度可比期间金额 2009年1月1日至2009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）	440,690,225.95	-59,757,992.53	380,932,233.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	117,313,886.02	117,313,886.02
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）	-243,981,461.37	-13,938,720.27	-257,920,181.64
其中：1.基金申购款	57,419,517.63	930,267.80	58,349,785.43
2.基金赎回款（以"-"号填列）	-301,400,979.00	-14,868,988.07	-316,269,967.07
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）	-	-25,930,985.88	-25,930,985.88
五、期末所有者权益（基金净值）	196,708,764.58	17,686,187.34	214,394,951.92

注：后附财务报表附注为本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：

陈礼华　　杨思乐　　戴君梅

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（未经审计）

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 关联方关系

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（"中国银行"）	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

6.4.3 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。

6.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金未开立关联方交易单元。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
当期应支付的管理费	1,324,196.23	2,353,467.25
其中：支付销售机构的客户维护费	165,116.95	92,689.47

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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
当期应支付的托管费	220,699.39	392,244.55

注：支付基金托管人中国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。

6.4.3.3 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 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	
	基金买入	基金卖出
中国银行	-	39,879,141.54
上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	
	基金买入	基金卖出
-	-	-

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	-	-
期初持有的基金份额	45,021,400.00	45,021,400.00
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	45,021,400.00	45,021,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	31.53%	22.89%

6.4.3.4.2 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（2010年6月30日）及上年度末（2009年12月31日）均未投资本基金份额。

6.4.3.5 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 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日	
	期末金额	当期利息收入	期末金额	当期利息收入
中国银行	28,871,387.43	127,017.94	10,819,117.60	163,082.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.3.6 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（2010年1月1日至2010年6月30日）及比较期内（2009年1月1日至2009年6月30日）未参与关联方承销证券交易。

6.4.4 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末（2010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

截至本报告期末（2010年6月30日）止本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601318	中国平安	2010-06-29	重大事项停牌	46.81	-	-	124,950	6,077,532.67	5,848,909.50	
000001	深发展A	2010-06-30	重大事项停牌	17.51	-	-	329,950	6,835,032.13	5,777,424.50	
000895	双汇发展	2010-03-22	重大事项停牌	43.54	-	-	90,000	4,602,903.49	3,918,600.00	

注：本基金截至2010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的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末（2010年6月30日）止本基金未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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	86,781,331.37	60.53
	其中：股票	86,781,331.37	60.53
2	固定收益投资	25,870,450.00	18.05
	其中：债券	25,870,450.00	18.05
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	29,231,855.94	20.39
6	其他各项资产	1,480,671.32	1.03
7	合计	143,364,308.63	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	-	-
B	采掘业	6,174,150.00	4.35
C	制造业	38,155,134.85	26.87
C0	食品、饮料	12,156,887.00	8.56
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	1,977,278.00	1.39
C5	电子	3,385,629.00	2.38
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	12,254,720.00	8.63
C8	医药、生物制品	8,380,620.85	5.90
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,474,898.14	2.45
F	交通运输、仓储业	928,137.00	0.65
G	信息技术业	1,472,800.00	1.04
H	批发和零售贸易	5,988,905.88	4.22
I	金融、保险业	24,434,534.00	17.21
J	房地产业	832,000.00	0.59
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	5,320,771.50	3.75
	合计	86,781,331.37	61.11

7.3 期末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

金额单位：人民币元

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	000581	威孚高科	500,000	6,800,000.00	4.79
2	601318	中国平安	124,950	5,848,909.50	4.12
3	000001	深发展A	329,950	5,777,424.50	4.07
4	600157	鲁润股份	240,650	5,320,771.50	3.75
5	600036	招商银行	360,000	4,683,600.00	3.30
6	600016	民生银行	700,000	4,235,000.00	2.98
7	000895	双汇发展	90,000	3,918,600.00	2.76
8	600000	浦发银行	286,000	3,889,600.00	2.74
9	600694	大商股份	89,948	3,805,699.88	2.68
10	000415	*ST汇通	442,099	3,474,898.14	2.45

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.csfunds.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

金额单位：人民币元

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的比例（%）
1	000001	深发展A	26,888,887.31	15.05
2	000581	威孚高科	24,689,233.30	13.81
3	601318	中国平安	24,591,280.46	13.76
4	000937	冀中能源	18,574,205.23	10.39
5	600036	招商银行	17,471,503.67	9.78
6	600016	民生银行	17,064,270.84	9.55
7	000837	秦川发展	10,847,215.64	6.07
8	600267	海正药业	9,577,533.78	5.36
9	000625	长安汽车	9,186,533.00	5.14
10	600157	鲁润股份	9,156,339.99	5.12
11	000656	ST东源	8,929,391.12	5.00
12	000858	五粮液	8,283,067.40	4.63
13	600081	东风科技	8,152,224.98	4.56
14	600143	金发科技	8,114,957.25	4.54
15	000759	武汉中百	8,039,954.19	4.50
16	000630	铜陵有色	7,991,101.43	4.47
17	600879	航天电子	7,881,408.00	4.41
18	000729	燕京啤酒	7,875,634.00	4.41
19	600168	武汉控股	7,553,476.00	4.23
20	600188	兖州煤业	6,823,656.82	3.82
21	601088	中国神华	6,561,377.40	3.67
22	600031	三一重工	6,340,041.91	3.55
23	000061	农产品	5,650,471.50	3.16
24	000895	双汇发展	5,625,770.93	3.15
25	600352	浙江龙盛	5,085,233.50	2.85
26	600694	大商股份	5,030,989.00	2.81
27	600125	铁龙物流	4,776,797.00	2.67
28	600380	健康元	4,729,955.20	2.65
29	600866	星湖科技	4,693,233.02	2.63
30	000063	中兴通讯	4,503,479.98	2.52
31	002172	澳洋科技	4,492,791.66	2.51
32	600521	华海药业	4,377,442.00	2.45
33	600983	合肥三洋	4,349,127.00	2.43
34	600527	江南高纤	4,347,693.48	2.43
35	600596	新安股份	4,267,260.24	2.39
36	000402	金融街	4,168,451.71	2.33
37	000415	*ST汇通	3,952,187.88	2.21
38	600391	成发科技	3,896,190.03	2.18
39	600395	盘江股份	3,831,781.19	2.14
40	000652	泰达股份	3,729,865.73	2.09
41	600312	平高电气	3,626,410.50	2.03
42	600309	烟台万华	3,597,184.12	2.01

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

金额单位：人民币元

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	601318	中国平安	25,485,138.96	14.26
2	000001	深发展A	19,339,051.36	10.82
3	600036	招商银行	19,161,802.42	10.72
4	000581	威孚高科	15,621,310.39	8.74
5	002019	鑫富药业	14,531,220.16	8.13
6	000625	长安汽车	13