同益证券投资基金 2010年半年度报告摘要

2010年6月30日

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: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	长盛同益封闭
基金主代码	184690
交易代码	184690
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年4月8日
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
报告期末基金份额总额	2,000,000,000份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1999年4月21日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	始终如一地奉行“价值投资”的基本原则,并在不同的市场环境以及市场发展变化的不同阶段,灵活运用适合自身运作特点的投资原则、投资理念和投资技巧。在战略资产配置层,寻求现金、债券、股票资产的动态收益、风险最优配置;在战术资产配置层,寻求成长型股票和价值型股票的动态收益、风险最优配置。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	蒋松云
	联系电话	010-82255818	010-66105799
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	010-66105799
传真		010-82255988	010-66106904

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
基金半年度报告置备地点	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(2010年1月1日-2010年6月30日)
本期已实现收益	6,787,370.22
本期利润	-540,294,031.86
加权平均基金份额本期利润	-0.2701
本期基金份额净值增长率	-20.14%
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	0.0129
期末基金资产净值	2,025,782,261.41
期末基金份额净值	1.0129

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
过去一个月	-5.40%	2.30%
过去三个月	-15.84%	2.33%
过去六个月	-20.14%	2.11%
过去一年	-5.22%	2.51%
过去三年	-7.15%	3.47%
自基金合同生效起至今	490.45%	2.77%

注:本基金无业绩比较基准收益率,无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

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

注:本基金无同期业绩比较基准收益率,无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

§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、十二支开放式基金(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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯耀东	本基金基金经理。	2009年2月10日	-	9年	男,1974年9月出生,中国国籍。毕业于武汉大学,获硕士学位。2000年7月至2001年1月就职于武汉道博股份有限公司,曾任项目经理。2001年2月至2002年11月就职于长城证券有限责任公司金融研究所,曾任研究员。2002年12月加入长盛基金管理公司,曾任高级研究员和基金经理助理,同益证券投资基金(本基金)基金经理。

注:1、任职日期、离任日期均指公司作出决定之日。

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。

3、报经中国证券业协会同意,公司目前已解聘冯耀东先生基金同益基金经理资格,同时聘任王克玉先生担任基金同益基金经理。该事项公司已于2010年7月16日公告。

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、《同益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 报告期内行情回顾和本基金投资策略分析

2010年上半年在国内刺激政策退出和外部经济环境恶化的影响下,实体经济增速逐季放缓,一、二季度GDP增速分别为12.1%和10.3%。特别是4月份以来国内房地产价格在局部区域的大幅上涨引起了各级政府的关注,针对房地产价格的各类调控措施在短时间内密集出台,导致从4月份开始国内房地产成交量迅速下降,价格有所松动。在国际市场上,欧洲主权债务危机在二季度加速蔓延,欧元大幅贬值。国内与国际宏观经济的双重压力,使得A股市场在上半年出现大幅调整,其中下跌主要在二季度出现:HS300指数在一、二季度分别下跌了6.43%和23.39%,房地产、化工、黑色金属、采掘等房地产产业链相关的公司股价继续大幅下跌,行业指数下跌幅度达到27-32%,而医药、食品饮料和商业贸易等消费品相关行业的跌幅较小。上半年本基金的净值下跌幅度较大,主要是由于年初组合中的低市盈率、大市值的公司在流动性趋紧的情况下,出现较大幅度的调整;同时在4月份基金分红后股票仓位较重,低估了整体市场下跌的风险,尽管组合在医药、食品饮料和商贸等行业中进行重配,但是在品种选择上面的效果一般,没有取得明显的超额收益。

4.4.2 本基金业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.0129元,本报告期份额净值增长率为-20.14%。

4.5 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

4.5.1 对宏观经济和证券市场展望

经济紧缩政策的效果已经开始体现,从二季度开始,地产、汽车以及相关的钢铁、化工等周期性行业的增速明显下滑。金融监管部门对于房地产贷款、地方融资平台等监管要求的提高降低了房地产、基础设施建设等方面的投资,而耐用消费品需求在价格稳定和财政补贴减少的情况下,同比增速降低。在这种情况下,预计经济将在二季度的大幅回落之后趋于稳定,加快经济结构调整是政府在今后两年内的重要工作方向。

受目前宏观经济背景的影响,预计短期内市场将处于区间波动之中,实体经济的增速逐渐放缓,同时整体估值处于历史合理水平。从中长期看,政策要在结构调整和保持经济稳定增长之间取得均衡,经济结构调整、收入分配机制的改革是我们关注的主题性机会的方向。

4.5.2 本基金下阶段投资策略

在市场整体估值水平较低和经济政策调整方向确定的情况下,我们在下半年市场判断为区间震荡,看好的领域包括:①在收入分配机制改革的前提下,中低端品牌消费品将面临快速增长的机会;②大规模生产制造向中西部的转移将有力推动这些区域的城镇化建设,带来相关领域商业贸易等社会服务业的发展;③在新兴产业领域具有技术、工艺积累的中小市值公司。我们将在这些领域中自下而上挖掘有价值的公司进行重点投资。

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25,782,261.41元,其中:未分配收益已实现部分为51,126,967.11元,未分配收益未实现部分为-25,344,705.70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十七部分中对基金利润分配原则的约定,本基金于2010年3月31日对2009年可分配收益进行了利润分配,分配金额为600,000,000.00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

在托管同益证券投资基金的过程中,本基金托管人——中国工商银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《同益证券投资基金基金合同》、《同益证券投资基金托管协议》的约定,对同益证券投资基金管理人——长盛基金管理有限公司2009年1月1日至2009年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,长盛基金管理有限公司在同益证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的同益证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:同益证券投资基金

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	227,410,012.92	96,803,776.97
结算备付金	783,805.46	2,496,228.99
存出保证金	1,117,756.32	1,171,399.74
交易性金融资产	1,806,399,067.94	3,164,284,667.03
其中:股票投资	1,361,476,035.94	2,520,902,018.65
基金投资	--	-
债券投资	444,923,032.00	643,382,648.38
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	-	6,247,534.35
应收利息	4,104,366.02	3,541,163.83
应收股利	195,750.00	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,040,010,758.66	3,274,544,770.91
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	-	100,000,000.00
应付证券清算款	4,934,320.97	-
应付赎回款		-
应付管理人报酬	2,617,667.78	3,986,966.36
应付托管费	436,277.93	664,494.39
应付销售服务费		-
应付交易费用	4,618,778.11	2,384,617.19
应交税费	815,699.68	815,699.68
应付利息	-	21,700.02
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	805,752.78	595,000.00
负债合计	14,228,497.25	108,468,477.64
所有者权益:		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	25,782,261.41	1,166,076,293.27
所有者权益合计	2,025,782,261.41	3,166,076,293.27
负债和所有者权益总计	2,040,010,758.66	3,274,544,770.91

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值1.0129元,基金份额总额2,000,000,000.00份。后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:同益证券投资基金

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	-511,186,880.04	866,090,687.43
1.利息收入	7,034,127.75	9,099,549.34
其中:存款利息收入	674,478.63	477,173.82
债券利息收入	6,359,649.12	8,622,375.52
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)	28,858,916.20	-65,490,999.70
其中:股票投资收益	22,277,847.44	-75,354,542.01
基金投资收益		
债券投资收益	1,025,985.13	361,546.60
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	5,555,083.63	9,501,995.71
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	-547,081,402.08	922,482,137.79
4.汇兑收益(损失以“-”填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	1,478.09	-
减:二、费用	29,107,151.82	23,722,186.50
1.管理人报酬	19,445,343.33	16,645,243.12
2.托管费	3,240,890.51	2,774,207.20
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	4,406,101.47	4,081,032.52
5.利息支出	14,466.65	-
其中:卖出回购金融资产支出	14,466.65	-
6.其他费用	2,000,349.86	221,703.66
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-540,294,031.86	842,368,500.93

注:后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:同益证券投资基金

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)	2,000,000,000.00	1,166,076,293.27	3,166,076,293.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-540,294,031.86	-540,294,031.86
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(以“-”号填列)	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-600,000,000.00	-600,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	25,782,261.41	2,025,782,261.41
项 目	上年度可比期间 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)	2,000,000,000.00	-175,004,779.53	1,824,995,220.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	842,368,500.93	842,368,500.93
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(以“-”号填列)	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	667,363,721.40	2,667,363,721.40

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:

陈礼华 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 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

截至资产负债表日,存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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	基金发起人、基金管理人
国元证券	基金发起人、基金管理人股东
中国工商银行	基金托管人

6.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下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

6.4.3.1.1 股票交易

金额单位: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	
	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	988,795,406.76	36.92%	822,932,785.12	31.11%

6.4.3.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.3.1.3 债券交易

金额单位: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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国元证券	-	-	52,362,862.60	92.83%

6.4.3.1.4 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.3.1.5 应支付关联方佣金

金额单位: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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末佣金余额	占期末应付佣金余额的比例	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末佣金余额	占期末应付佣金余额的比例
国元证券	803,402.11	35.88%	1,146,777.57	24.84%	697,361.68	31.55%	2,009,775.50	46.95%

注: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、经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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。

6.4.3.2 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
当期发生的基金应支付的管理费	19,445,343.33	16,645,243.12
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提,基金成立三个月后,如果现金持有比例超过基金资产净值的20%,超出部分不计提基金管理费。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值(扣除超过规定比例现金后的资产净值)

基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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
当期发生的基金应支付的托管费	3,240,890.51	2,774,207.20

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

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:

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)未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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(1999年4月8日)持有的基金份额	20,000,000.00	20,000,000.00
期初持有的基金份额	28,000,079.00	28,000,079.00
期间申购/买入总份额	-	-
本期因拆分变动的份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	28,000,079.00	28,000,079.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例(%)	1.40	1.40

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

份额单位:份

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	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
基金发起人-长江证券有限责任公司	6,000,000.00	0.30	6,000,000.00	0.30
基金发起人-天津北方国际信托投资股份有限公司	4,000,000.00	0.20	4,000,000.00	0.20
基金发起人-中信证券股份有限公司	6,000,000.00	0.30	6,000,000.00	0.30
基金发起人、基金管理人股东-国元证券股份有限公司	4,000,000.00	0.20	4,000,000.00	0.20

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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	227,410,012.92	658,982.44	44,613,465.67	464,653.39

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计算。

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期间及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.3.7 其他关联交易事项的说明:无。

6.4.4 (2010年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告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。

6.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

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	46.81	-	-	2,500,000	88,743,570.48	117,025,000.00	

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金于期末无正回购余额。

§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	资产项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,361,476,035.94	66.74
	其中:股票	1,361,476,035.94	66.74
2	固定收益投资	444,923,032.00	21.81
	其中:债券	444,923,032.00	21.81
	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	228,193,818.38	11.19
6	其他资产	5,417,872.34	0.27
7	资产合计	2,040,010,758.66	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

序号	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	46,960,000.00	2.32
C	制造业	660,652,396.34	32.61
C0	食品、饮料	223,407,450.80	11.03
C1	纺织、服装、皮毛	2,044,598.40	0.10
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	108,083,500.00	5.34
C5	电子	14,280,000.00	0.70
C6	金属、非金属	55,772,733.08	2.75
C7	机械、设备、仪表	192,552,114.06	9.51
C8	医药、生物制品	64,512,000.00	3.18
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	24,510,000.00	1.21
G	信息技术业	98,647,973.60	4.87
H	批发和零售贸易	131,905,037.52	6.51
I	金融、保险业	301,091,000.00	14.86
J	房地产业	23,789,057.88	1.17
K	社会服务业	4,405,709.00	0.22
L	传播与文化产业	11,071,861.60	0.55
M	综合类	58,443,000.00	2.88
	合计	1,361,476,035.94	67.21

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	601318	中国平安	2,500,000	117,025,000.00	5.78
2	600036	招商银行	6,700,000	87,167,000.00	4.30
3	000568	泸州老窖	2,814,540	79,426,318.80	3.92
4	600016	民生银行	11,500,000	69,575,000.00	3.43
5	600521	华海药业	4,800,000	64,512,000.00	3.18
6	600298	安琪酵母	1,700,000	59,432,000.00	2.93
7	600875	东方电气	1,350,750	58,825,162.50	2.90
8	600858	银座股份	2,300,000	58,443,000.00	2.89
9	000401	冀东水泥	3,350,388	49,954,285.08	2.47
10	600693	东百集团	4,800,000	48,672,000.00	2.40

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	601006	大秦铁路	69,086,429.76	2.18
2	000401	冀东水泥	54,427,387.98	1.72
3	600019	宝钢股份	48,095,323.31	1.52
4	601601	中国太保	47,825,171.85	1.51
5	000858	五粮液	46,779,498.85	1.48
6	000792	盐湖钾肥	46,032,040.21	1.45
7	600395	盘江股份	37,802,990.00	1.19
8	600309	烟台万华	36,594,591.55	1.16
9	600410	华胜天成	35,731,892.88	1.13
10	600739	辽宁成大	34,236,568.94	1.08
11	000568	泸州老窖	30,854,127.28	0.97
12	600581	八一钢铁	30,658,181.14	0.97
13	000718	苏宁环球	30,330,696.94	0.96
14	000581	威孚高科	28,446,865.11	0.90
15	600693	东百集团	28,208,521.08	0.89
16	600875	东方电气	23,929,172.43	0.76
17	600143	金发科技	22,932,048.83	0.72
18	002376	新北洋	22,819,051.02	0.72
19	600016	民生银行	22,394,776.59	0.71
20	000400	许继电气	21,742,100.55	0.69

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	601088	中国神华	73,608,672.09	2.32
2	000001	深发展A	72,054,561.23	2.28
3	600048	保利地产	68,477,293.77	2.16
4	600019	宝钢股份	67,250,005.76	2.12
5	000527	美的电器	60,992,048.88	1.93
6	002004	华邦制药	60,343,210.18	1.91
7	600521	华海药业	48,156,077.04	1.52
8	000933	神火股份	45,101,231.70	1.42
9	600409	三友化工	44,933,403.58	1.42
10	000825	太钢不锈	44,765,804.37	1.41
11	600858	银座股份	43,997,092.00	1.39
12	600036	招商银行	43,735,264.95	1.38
13	600000	浦发银行	40,002,393.69	1.26
14	002073	软控股份	38,755,423.41	1.22
15	600005	武钢股份	38,753,102.44	1.22
16	600028	中国石化	37,712,681.63	1.19
17	002019	鑫富药业	36,193,783.56	1.14
18	601699	潞安环能	36,039,668.30	1.14
19	600426	华鲁恒升	35,716,898.83	1.13
20	601998	中信银行	35,473,035.52	1.12

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	1,025,240,321.77
卖出股票收入(成交)总额	1,662,824,649.55

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)填列,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

金额单位:人民币元

序号	债券类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)