同盛证券投资基金2010年半年度报告摘要

2010年06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(以下简称"中国银行")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	长盛同盛封闭
基金主代码	184699
交易代码	184699
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	1999年11月5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	3,000,000,000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11月26日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属于成长价值复合型基金,主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和市场价值被低估的价值型上市公司,利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好的分散和控制风险,实现基金资产的稳定增长。
投资策略	本基金将根据市场发展情况,确定在一段时间内市场发展的总体趋势,并在此基础上确定股票和国债的配置比例以及股票投资中成长型投资和价值型投资的配置比例。并分别选取成长型特征最明显的股票和价值型特征最明显的股票进行组合投资。
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	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	叶金松	唐州徽
负责人	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	76,555,878.88
本期利润	-652,192,476.83
加权平均基金份额本期利润	-0.2174
本期基金份额净值增长率	-17.63%
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	-0.0200
期末基金资产净值	3,046,814,471.41
期末基金份额净值	1.0156

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
过去一个月	-6.03%	2.45%
过去三个月	-15.79%	2.62%
过去六个月	-17.63%	2.38%
过去一年	-2.56%	2.74%
过去三年	-6.76%	3.55%
自基金合同生效起至今	241.88%	2.67%

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

(1999年11月5日至2009年6月30日)

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+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		
侯继雄	本基金基金经理。	2008年8月11日	—	9年	男,1974年5月出生,中国国籍。清华大学博士。2001年4月至2007年2月在国泰君安证券研究所任研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司,现任同盛证券投资基金(本基金)基金经理。
丁骏	本基金基金经理,长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理。	2008年4月25日	—	9年	男,1974年11月出生,中国国籍。中国社会科学院经济学博士。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师;国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理;2003年6月加入长盛基金管理有限公司,先后担任研究发展部行业研究员、机构理财部组合经理助理。现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理,同盛证券投资基金(本基金)基金经理。
王克玉	本基金基金经理助理,高级行业研究员。	2010年1月12日	2010年5月19日	7年	男,1979年12月出生,中国国籍。毕业于上海交通大学,获硕士学位。历任元大京华证券上海代表处研究员;天相投资顾问有限公司分析师;国都证券有限公司分析师。2006年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任同盛证券投资基金(本基金)基金经理助理,高级行业研究员,同盛证券投资基金(本基金)基金经理助理。

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。

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、《同盛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年上半年的市场表现基本完全不同于年初时投资者的乐观预期,尤其是二季度暴跌更引发了新一轮熊市的预期。存货下行周期、房地产下行周期、技术进步的空白期、政策刺激手段的日益弱化,均使得中长期熊市的思维不断在市场蔓延,市场热情不断退却,投资者连续减仓,并不断自我强化,最终市场下跌的幅度远远超过了左侧操作型价值型投资者的预期。回顾上半年,同盛基金对经济基本面判断上基本符合事实,但在市场判断上则明显落后;低估了政策预期对市场的影响、也对市场的趋势下跌重视不够,左侧交易反而带来了更大的损失。总体上在仓位控制、行业配置和个股选择方面都有失误,需要反思。

4.4.2 本基金业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.0156元,本报告期份额净值增长率为-17.63%。

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

中国经济的转型压力已经成为市场共识,多空的差异在于中国经济总量增长是否能够维持和持续、全球资易失衡的纠偏过程中如何缓解出口下滑的影响。显然,下一步中国经济的向好需要依赖国内经济体制的二次改革,包括收入分配体制改革、中央控制型经济向民营自主发展型经济的改革、政府管理体制改革等全方位的改革,难度相当大。尽管如此,同盛对中国经济的总量增长仍具有信心,城市化发展滞后和广阔的中西部市场,都预示中国经济总量增长空间依然存在,未来城市化和城镇化、基建投资、保障房建设等,都可能成为中国经济保增长的政策施政点。相信在党的领导下,新一轮的改革将能带动国内经济总量和质量的双重提升。另一方面,在经济转型期,很难出现系统性牛市、市场的反复震荡反而会是一种常态。因而未来一方面要挖掘符合新经济发展的新行业和新龙头公司以获取长期超额收益,也需要通过估值安全性去寻找虽然较低、但报刊转为稳定的公司以获取阶段性回报。

4.5.2 本基金下阶段投资策略

鉴于目前市场的系统性风险已经释放较为充分,同盛下半年将优先从周期类行业中挖掘估值安全和竞争力突出的优秀个股,其次在市场调整过程中在新能源、新技术、新材料、新业务模式中选择长期成长股进行战略配置。

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(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。

4.7 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-59,901,976.18元,其中:未分配收益已实现部分为-59,901,976.18元,未分配收益未实现部分为106,716,447.59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,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")在对同盛证券投资基金(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、基金费用开支等方面进行了认真地复核,本报告期内,投资中航重机非公开发行股票市值占净值比例曾经被动超过公司内部有关"单只流通受限证券投资不得超过基金资产净值的2%"的规定,托管人对此进行了提示,基金管理人已经进行了适当调整。

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

本半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、投资组合报告等数据核对无误。(注:财务会计报告中的"金融工具风险管理"部分未在托管人复核范围内。)

§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:同盛证券投资基金

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	293,114,752.82	18,139,363.46
结算备付金	2,190,910.57	1,939,761.48
存出保证金	784,015.15	905,029.66
交易性金融资产	2,743,858,622.57	3,682,706,248.54
其中:股票投资	2,067,234,311.57	2,926,160,751.14
基金投资	-	-
债券投资	676,624,311.00	756,545,497.40
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	10,401,862.50	-
应收利息	6,837,374.64	4,553,062.78
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,057,187,538.25	3,708,243,465.92
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	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,967,774.27	4,665,466.06
应付托管费	661,295.73	777,577.68
应付销售服务费		-
应付交易费用	3,114,352.40	1,374,582.28
应交税费	1,823,891.66	1,823,891.66
应付利息		-
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	10,373,066.84	9,236,517.68
所有者权益:		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	46,814,471.41	699,006,948.24
所有者权益合计	3,046,814,471.41	3,699,006,948.24
负债和所有者权益总计	3,057,187,538.25	3,708,243,465.92

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值1.0156元,基金份额总额3,000,000,000.00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:同盛证券投资基金

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	-618,465,441.38	932,457,303.07
1.利息收入	7,806,131.28	10,829,649.43
其中:存款利息收入	567,056.97	587,297.05
债券利息收入	7,239,074.31	10,242,352.38
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)	102,455,780.45	-85,152,813.98
其中:股票投资收益	93,814,767.78	-99,719,989.68
基金投资收益		-
债券投资收益	-1,927,472.44	83,130.72
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	10,568,485.11	14,484,044.98
3.公允价值变动收益(损失以"-"填列)	-728,748,355.71	1,006,780,467.62
4.汇兑收益(损失以"-"填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"填列)	21,002.60	-
减:二、费用	33,727,035.45	27,818,357.67
1.管理人报酬	25,818,162.53	19,884,285.92
2.托管费	4,303,027.05	3,314,047.64
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,294,678.72	4,398,570.44
5.利息支出	88,976.93	-
其中:卖出回购金融资产支出	88,976.93	-
6.其他费用	222,190.22	221,453.67
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-652,192,476.83	904,638,945.40
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-652,192,476.83	904,638,945.40

注:后附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:同盛证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年06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)	3,000,000,000.00	699,006,948.24	3,699,006,948.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-652,192,476.83	-652,192,476.83
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)	3,000,000,000.00	46,814,471.41	3,046,814,471.41
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)	3,000,000,000.00	-777,611,115.48	2,222,388,884.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	904,638,945.40	904,638,945.40
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)	3,000,000,000.00	127,027,829.92	3,127,027,829.92

注:后附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(未经审计)

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

本基金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
长江证券	基金发起人
中信证券	基金发起人
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
长江证券	-	-	1,399,495,988.87	48.64%
中信证券	-	-	565,668,504.44	19.66%
国元证券	873,510,604.85	41.91%	1,295,237.02	0.05%
合计	873,510,604.85	41.91%	1,966,459,730.33	68.35%

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
长江证券	-	-	94,705,155.63	79.94%
国元证券	21,504,949.24	100.00%	-	-
中信证券	-	-	13,056,798.39	11.02%
合计	21,504,949.24	100.00%	107,761,954.02	90.96%

6.4.3.1.4 债券回购交易

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	占当年回购成交总额的比例	成交金额	占当年回购成交总额的比例
国元证券	100,000,000.00	100.00%	-	-
合计	100,000,000.00	100.00%	-	-

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			
	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
长江证券	-	-	268,952.50	8.64%
中信证券	-	-	-	-
国元证券	731,968.46	42.04%	1,201,928.52	38.62%
合计	731,968.46	42.04%	1,470,881.02	47.26%
关联方名称	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
长江证券	1,189,567.02	49.27%	1,189,567.02	34.30%
中信证券	459,608.39	19.04%	459,608.39	13.25%
国元证券	1,052.34	0.04%	749,794.75	21.62%
合计	1,650,227.75	68.35%	2,398,970.16	69.17%

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	25,818,162.53	19,884,285.92
其中:支付给销售机构的客户维护费	-	-

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。

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	4,303,027.05	3,314,047.64

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。

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。

6.4.3.2.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	79,708,909.59	-	-	-	345,600,000.00	60,219.62
中信证券	-	-	-	-	-	-
合计	79,708,909.59	-	-	-	345,600,000.00	60,219.62
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	71,773,871.23	82,782,995.61	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
合计	71,773,871.23	82,782,995.61	-	-	-	-

6.4.3.2.4 各关联方投资本基金的情况

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11月5日)持有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
期初持有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
本期认购总份额	-	-
本期申购/买入总份额	-	-
本期因拆分增加的份额	-	-
本期赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例(%)	0.20	0.20

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、基金管理人股东-国元证券股份有限公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
基金发起人-天津北方国际信托投资股份有限公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
基金发起人-长江证券股份有限公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
基金发起人-中信证券股份有限公司	3,000,000.00	0.10%	18,927,640.00	0.63%

6.4.3.2.5 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
中国银行	293,114,752.82	554,400.88	70,577,288.32	573,219.07

6.4.3.2.6 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。

6.4.4 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

金额单位:人民币元

受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601101	吴华能源	2010-03-25	2010-07-01	新股认购	29.80	30.18	262,780	7,830,844.00	7,930,700.40	-

6.4.5.2 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	-	-	3,461,490	154,584,450.59	162,032,346.90	
000895	双汇发展	2010-3-22	重大事项	43.54	-	-	456,741	12,101,300.77	19,886,503.14	

6.4.5.3 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	项目	金额	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,067,234,311.57	67.62
	其中:股票	2,067,234,311.57	67.62
2	固定收益投资	676,624,311.00	22.13
	其中:债券	676,624,311.00	22.13
	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	295,305,663.39	9.66
6	其他资产	18,023,252.29	0.59
7	合 计	3,057,187,538.25	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	258,665,796.91	8.49
C	制造业	970,256,537.64	31.84
C0	食品、饮料	147,342,002.36	4.84
C1	纺织、服装、皮毛	15,447,600.00	0.51
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3,809,542.72	0.13
C4	石油、化学、塑胶、塑料	149,842,780.24	4.92
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	56,632,750.00	1.86
C7	机械、设备、仪表	296,470,141.70	9.73
C8	医药、生物制品	300,711,720.62	9.87
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	25,000,000.00	0.82
E	建筑业	38,345,208.75	1.26
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	75,246,219.69	2.47
H	批发和零售贸易	199,908,104.46	6.56
I	金融、保险业	379,902,868.25	12.47
J	房地产业	53,280,191.88	1.75
K	社会服务业	44,726,995.75	1.47
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	21,902,388.24	0.72
合 计		2,067,234,311.57	67.85

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	3,461,490	162,032,346.90	5.32
2	000338	潍柴动力	1,804,387	110,969,800.50	3.64
3	600031	三一重工	5,905,323	107,890,251.21	3.54
4	600016	民生银行	17,699,987	107,084,921.35	3.51
5	600309	烟台万华	5,703,847	83,219,127.73	2.73
6	600655	豫园商城	3,184,175	70,433,951.00	2.31
7	600739	辽宁成大	2,781,529	69,983,269.64	2.30
8	600479	千金药业	4,627,453	64,784,342.00	2.13
9	000423	东阿阿胶	1,798,490	62,515,512.40	2.05
10	600123	兰花科创	2,420,725	61,897,938.25	2.03

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	600031	三一重工	66,335,029.23	1.79
2	600267	海正药业	45,112,556.82	1.22
3	600332	广州药业	37,995,248.66	1.03
4	600557	康缘药业	37,916,526.62	1.03
5	000937	冀中能源	36,373,430.70	0.98
6	600309	烟台万华	36,133,013.87	0.98
7	002051	中工国际	34,916,473.96	0.94
8	600739	辽宁成大	34,046,448.30	0.92
9	000926	福星股份	33,200,845.56	0.90
10	601699	潞安环能	33,113,320.80	0.90
11	000939	凯迪电力	29,918,812.58	0.81
12	000568	泸州老窖	28,656,090.00	0.77
13	000983	西山煤电	26,702,305.41	0.72
14	600266	北京城建	25,798,839.41	0.70
15	601318	中国平安	23,973,763.58	0.65
16	002376	新北洋	23,348,917.39	0.63
17