长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF) 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:中国银行股份有限公司
送出日期:2010年8月24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。

本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、收益分配情况、财务会计报告和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。

本报告会计期间:2010年1月1日至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛同智优势混合(LOF)
基金主代码	160805
交易代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1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	3,224,375,868.51份
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年2月16日
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司,所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下,谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	本基金为混合型基金,根据对宏观经济、行业状况、公司成长性及资本市场的判断,综合评价各类资产的风险收益水平,对各类资产采取适度灵活的资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益—较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。

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
信披负责人	姓名	叶金松	唐州徽
	联系电话	010-82255818	010-66594855
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgzxpl@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日至2010年6月30日)
本期已实现收益	149,715,933.44
本期利润	-602,548,707.92
加权平均基金份额本期利润	-0.1839
本期加权平均净值利润率	-19.87%
本期基金份额净值增长率	-18.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年6月30日)
期末可供分配利润	-596,064,622.80
期末可供分配基金份额利润	-0.1849
期末基金资产净值	2,628,311,245.71
期末基金份额净值	0.8151
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2010年6月30日)
基金份额累计净值增长率	47.57%

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。

4.本基金由同智证券投资基金转型而来,转型日为2007年1月5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	-5.61%	1.03%	-4.86%	1.08%	-0.75%	-0.05%
过去三个月	-14.99%	1.23%	-15.40%	1.18%	0.41%	0.05%
过去六个月	-18.54%	1.14%	-18.47%	1.03%	-0.07%	0.11%
过去一年	-8.61%	1.49%	-10.90%	1.23%	2.29%	0.26%
过去三年	-12.99%	1.75%	-14.39%	1.55%	1.40%	0.20%
自基金转型日起至今	47.57%	1.82%	26.98%	1.57%	20.59%	0.25%

注:本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

基准指数的构建考虑了三个原则:

1.公允性。选择市场认同度比较高的沪深300指数和上证国债指数作为计算的基础指数。

2.可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响,本基金持有的股票投资占基金资产的比例范围为30%-95%;权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%;债券投资占基金资产的比例范围为0-65%;现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在5%以上。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数,使业绩比较更具有合理性。

3.再平衡。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%、30%、5%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 自基金转型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

(2007年1月5日至2010年6月30日)

注:本基金由同智证券投资基金转型而来,转型日为2007年1月5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、十支开放式基金,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		
丁骏	本基金基金经理,同盛证券投资基金基金经理。	2007年2月27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(本基金)基金经理,同盛证券投资基金基金经理。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,诚实信用、勤勉尽责地管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础前提下,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 报告期内本基金投资策略和运作分析

2010年上半年A股市场在09年下半年股指围绕3000点连续震荡的基础上选择向下突破,上证指数从09年底的3277.14点跌到了10年6月30日的2398.37点,跌幅达26.82%。从过程上看,A股市场1月份下跌8.78%,之后的两个半月在震荡中微弱反弹5.88%,随即市场深度调整,连续跌破年线,前期低点和全部均线位并于6月30日收于半年来最低点。从运行特点上看,上半年受中央房地产紧缩政策的影响,A股市场中与之相关的周期类行业地产、钢铁、有色、汽车、建材等,走势一直较弱;消费类的轻工制造、信息服务、食品饮料、纺织服装等,表现出一定抗跌性;而上半年处于行业景气高点的电子元器件和医药生物行业,表现非常抢眼,行业指数超越大盘20多个点。从运行风格上看,上半年小盘股表现明显强于大盘股,市值大的权重股往往领跌;价值因素被市场放弃,低PE的股票几乎没有超额受益;主题投资盛行,区域板块和创业板等被市场大肆追捧。

我们总结市场出现上述特征的基本因素主要包括:①去年股指连续上涨并高位盘整后,市场分化较为严重,小盘股估值过高,权重股估值低位徘徊;②年初房价大幅上涨招致政策严厉紧缩,市场不仅要面对资金面收紧,而且对后期房价、固定资产投资的预期大幅下调;③.08和09年的刺激政策逐步到期,国内经济在经历暂繁荣后二季度增长大幅回落,集中体现在工业增加值从1季度的19.4%下挫至2季度的16%,市场对未来若干年中国经济增速的预期被迫连续下调。从本基金操作的角度而言,上半年我们从经济运行特点出发,综合考虑政府政策紧缩的实际效果、外部需求变化和市场估值水平等因素,力求坚持价值投资理念的基础上尽量跟上政策引导下市场的快节奏变化,上半年重点在医药、电力设备等行业进行了布局。遗憾的是,出于对小盘股估值过高和政策面收紧的担忧,本基金对上半年小盘股行情的参与程度不够,在一定程度上影响了基金的上半年业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为0.8151元,本报告期份额净值增长率为-18.54%,同期业绩比较基准增长率为-18.47%。

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

如果用比较简单的概念来看,我们认为影响A股下半年走势的主要因素有两个:①)不利的因素:宏观经济的前景不是很明朗,尤其是旧的粗放型增长模式走向终结,经济增长无法走回靠出口和投资拉动的老路,而新的经济增长点还没有形成,消费型经济体系还远未成型;②)有利的因素:市场大幅下跌后估值已经比较低,我们认为中国经济能够摆脱困扰,在未来几年继续实现快速增长,长期而言上半年市场的下跌给了投资者深入思考的机会,也给予市场上涨奠定了良好的基础。

展望A股下半年行情,我们保持相对谨慎偏乐观的态度。短期看,市场下半年存在一定的继续调整的可能性,①)经济尚未触底,我们判断下半年仍然是处在收缩的通道中,目前市场静态估值基本合理;②)政策面临两难,流动性过剩和有效需求不足将导致政府很难短期内再刺激经济,否则可能面临通胀大幅上行的风险;③)流通股扩容(限售股解禁、IPO和再融资)节奏明显加快,尤其是创业板的解禁潮即将到来,届时可能对小股票高企的估值造成很大压力。需要强调的是,我们认为,只要世界经济复苏的趋势不变,这种调整与08年的市场回落是有本质区别的,其在一定意义上是为后续的健康发展提供了空间。下半年对于基金来说,超额收益来自于对个股的精心选择和持之以恒的价值投资信念。整体策略是保持相对平衡的仓位,重视结构和品种的有效性。我们会抓住三季度的时机对持仓结构进行适当的调整,主要方向是:①)盈利模式成熟、成长性确定,估值已经调整合理的中小盘股;②)资产重组预期明确的板块,比如军工等企业;③)市场调整后估值水平回落到合理位置,有较高安全边际的新兴产业的个股,比如新材料、新能源电池等相关企业。

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日期末可供分配利润为-596,064,622.80元,其中:未分配利润已实现部分为579,799,581.74元,未分配利润未实现部分为-1,175,864,204.54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二十条中对基金利润分配原则的约定,本基金于2010年1月20日对2009年度收益进行了利润分配,分配金额为75,716,758.74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(以下简称"本托管人")在长盛同智优势成长混合型证券投资基金(以下简称"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 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

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	1,071,733,428.82	501,804,704.16
结算备付金	3,025,727.42	2,738,119.77
存出保证金	2,718,391.49	1,888,549.12
交易性金融资产	1,562,811,128.67	2,932,487,415.56
其中:股票投资	1,562,811,128.67	2,932,487,415.56
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	-	-
应收利息	194,261.70	92,728.57
应收股利	-	-
应收申购款	60,365.37	204,853.59
递延所得税资产	-	-
其它资产	-	-
资产总计	2,640,543,303.47	3,439,216,370.77
负债和所有者权益	本期期末 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	909,846.72	7,822,391.46
应付管理人报酬	3,415,491.26	4,346,707.95
应付托管费	569,248.54	724,451.34
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,538,834.59	2,538,024.83
应交税费	305,932.19	305,932.19
应付利息	-	-
应付利润	428,798.09	428,798.09
递延所得税负债	-	-
其它负债	2,063,906.37	1,855,327.26
负债合计	12,232,057.76	18,021,633.12
所有者权益:		
实收基金	3,224,375,868.51	3,342,730,432.92
未分配利润	-596,064,622.80	78,464,304.73
所有者权益合计	2,628,311,245.71	3,421,194,737.65
负债和所有者权益总计	2,640,543,303.47	3,439,216,370.77

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值:0.8151元,基金份额总额3,224,375,868.51份。

6.2 利润表

会计主体:长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

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	-567,341,867.50	1,086,165,225.78
1.利息收入	3,085,184.18	3,599,437.55
其中:存款利息收入	3,085,184.18	2,992,707.11
债券利息收入	-	606,730.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其它利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	181,796,472.67	-237,112,151.84
其中:股票投资收益	175,572,097.88	-252,493,589.00
债券投资收益	-	771,634.71
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	6,224,374.79	14,609,802.45
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-752,264,641.36	1,319,543,718.56
4.其它收入(损失以"-"号填列)	41,117.01	134,221.51
减:二、费用	35,206,840.42	34,318,285.63
1.管理人报酬	22,568,021.41	23,145,351.07
2.托管费	3,761,336.83	3,857,558.52
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	8,654,578.73	7,111,669.81
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其它费用	222,903.45	203,706.23
三、利润总额	-602,548,707.92	1,051,846,940.15
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-602,548,707.92	1,051,846,940.15

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

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)	3,342,730,432.92	78,464,304.73	3,421,194,737.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-602,548,707.92	-602,548,707.92
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)	-118,354,564.41	3,736,539.13	-114,618,025.28
其中:1.基金申购款	65,969,591.75	-3,451,110.66	62,518,481.09
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-184,324,156.16	7,187,649.79	-177,136,506.37
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)	-	-75,716,758.74	-75,716,758.74
五、期末所有者权益(基金净值)	3,224,375,868.51	-596,064,622.80	2,628,311,245.71
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)	4,151,329,641.29	-1,447,499,231.13	2,703,830,410.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,051,846,940.15	1,051,846,940.15
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)	-306,122,046.30	58,526,907.13	-247,595,139.17
其中:1.基金申购款	49,956,733.73	-10,965,625.24	38,991,108.49
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-356,078,780.03	69,492,532.37	-286,586,247.66
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)	3,845,207,594.99	-337,125,383.85	3,508,082,211.14

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

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、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

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	3,963,019,045.45	73.12%	1,326,127,907.36	28.45%

6.4.3.1.2 债券交易

本基金本报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)及上年度可比期间(2009年1月1日至2009年6月30日)内未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.3.1.3 债券回购交易

本基金本报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)及上年度可比期间(2009年1月1日至2009年6月30日)内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.3.1.4 权证交易

本基金本报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)及上年度可比期间(2009年1月1日至2009年6月30日)内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.3.1.5 应支付关联方的佣金

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	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	3,346,040.89	73.72%	3,346,040.89	73.72%
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	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	1,127,205.33	28.90%	454,729.15	22.66%

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、经手费和适用期内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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	22,568,021.41	23,145,351.07
其中,支付给销售机构的客户维护费	3,571,308.31	3,665,379.19

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
当期发生的基金应支付的托管费	3,761,336.83	3,857,558.52

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

本基金本报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)及上年度可比期间(2009年1月1日至2009年6月30日)与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易为零。

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(2007年1月5日)持有的基金份额	-	-
期初持有基金份额	62,276,368.00	62,276,368.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有基金份额	62,276,368.00	62,276,368.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.93%	1.62%

6.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其它关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末(2010年6月30日)及上年度末(2009年12月31日)均未持有本基金份额。

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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,071,733,428.82	3,055,517.21	641,330,503.66	2,967,130.82

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(2010年1月1日至2010年6月30日)及上年度可比期间(2009年1月1日至2009年6月30日)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 期末(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

本基金于期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.4.2 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
601318	中国平安	2010-6-29	重大事项	46.81	-	-	2,966,298	129,778,312.13	138,852,409.38
000895	双汇发展	2010-3-22	重大事项	43.54	-	-	368,465	19,553,920.30	16,042,966.10

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末无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	1,562,811,128.67	59.19
	其中:股票	1,562,811,128.67	59.19
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	1,074,759,156.24	40.70
6	其它各项资产	2,973,018.56	0.11
7	合计	2,640,543,303.47	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	19,332,755.60	0.74
B	采掘业	91,311,749.85	3.47
C	制造业	898,739,803.61	34.19
C0	食品、饮料	112,148,660.62	4.27
C1	纺织、服装、皮毛	25,976,436.00	0.99
C2	木材、家具	14,526,204.44	0.55
C3	造纸、印刷	6,400,000.00	0.24
C4	石油、化学、塑胶、塑料	62,129,619.92	2.36
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	68,361,094.07	2.60
C7	机械、设备、仪表	405,826,029.88	15.44
C8	医药、生物制品	188,691,758.68	7.18
C99	其它制造业	14,680,000.00	0.56
D	电力、煤气及水的生产和供应业	27,762,817.05	1.06
E	建筑业	12,134,963.63	0.46
F	交通运输、仓储业	15,099,943.30	0.57
G	信息技术业	7,147,559.45	0.27
H	批发和零售贸易	152,108,144.24	5.79
I	金融、保险业	339,173,391.94	12.90
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,562,811,128.67	59.46

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	2,966,298	138,852,409.38	5.28
2	600016	民生银行	17,019,699	102,969,178.95	3.92
3	600036	招商银行	6,205,214	80,729,834.14	3.07
4	600518	康美药业	5,549,611	68,149,223.08	2.59
5	600312	平高电气	5,532,658	56,267,131.86	2.14
6	002073	青岛软控	2,939,514	43,916,339.16	1.67
7	600694	大商股份	999,901	42,305,811.31	1.61
8	600893	航空动力	1,658,231	40,195,519.44	1.53
9	600631	百联股份	2,893,077	38,043,962.55	1.45
10	600519	贵州茅台	297,249	37,857,632.64	1.44

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 报告期内权益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比例(%)
1	600312	平高电气	83,942,576.61	2.45
2	600036	招商银行	79,059,572.98	2.31
3	600123	兰花科创	67,915,045.32	1.99
4	000060	中金岭南	61,904,320.57	1.81
5	600529	山东药玻	51,519,103.05	1.51
6	000400	许继电气	50,870,664.42	1.49
7	601169	XD北京银	48,779,746.05	1.43
8	600893	航空动力	46,918,840.37	1.37
9	600016	民生银行	46,249,507.65	1.35
10	000059	辽通化工	46,149,494.72	1.35
11	600309	烟台万华	44,731,889.74	1.31
12	600066	宇通客车	42,809,477.07	1.25
13	600153	建发股份	40,976,397.68	1.20
14	600823	世茂股份	38,628,852.35	1.13
15	600495	晋西车轴	37,473,555.96	1.10
16	600362	江西铜业	37,465,361.07	1.10
17	600322	天房发展	37,461,600.28	1.09
18	600096	云天化	36,941,433.30	1.08
19	600517	置信电气	36,919,888.98	1.08
20	600184	新华光	36,251,805.44	1.06

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

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比例(%)
1	600036	招商银行	117,059,631.34	3.42
2	600028	中国石化	113,016,971.34	3.30
3	600153	建发股份	108,142,093.05	3.16
4	601166	兴业银行	99,574,624.01	2.91