# 长盛积极配置债券型证券投资基金 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:中国建设银行股份有限公司**
**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。

基金托管人中国建设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 | 长盛积极配置债券 |
| 基金主代码 | 080003 |
| 交易代码 | 080003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年10月8日 |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 106,420,571.38份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳定增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。 |
| 投资策略 | 本基金为积极投资策略的债券型基金,不同与传统债券型基金的投资策略特点,本基金在债券类资产配置上更强调积极主动管理。在债券类资产配置上,本基金通过积极投资配置相对收益率较高的企业债、公司债、可转换债、可分离交易可转债、资产支持证券等创新债券品种,并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会,以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上,通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票,来获取股票市场的积极收益。此外,本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。 |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 叶金松 | 尹东 |
| | 联系电话 | 010-82255818 | 010-67595003 |
| | 电子邮箱 | yejs@csfunds.com.cn | yindong@ccb.cn |
| 客户服务电话 | | 400-888-2666.010-62350088 | 010-67595096 |
| 传真 | | 010-82255988 | 010-66275853 |

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 | 7,623,468.93 |
| 本期利润 | 3,271,142.09 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0269 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.42% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.23% |
| 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 | 11,631,066.51 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1093 |
| 期末基金资产净值 | 118,051,637.89 |
| 期末基金份额净值 | 1.1093 |
| 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 | 12.95% |

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 | -1.15% | 0.28% | -0.38% | 0.17% | -0.77% | 0.11% |
| 过去三个月 | -0.92% | 0.34% | -0.71% | 0.18% | -0.21% | 0.16% |
| 过去六个月 | 2.23% | 0.32% | 0.53% | 0.17% | 1.70% | 0.15% |
| 过去一年 | 7.99% | 0.34% | 1.80% | 0.20% | 6.19% | 0.14% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.95% | 0.30% | 12.39% | 0.25% | 0.56% | 0.05% |

注:本基金业绩比较基准:中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

沪深300指数是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的成份股指数。沪深300指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数。

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90%、10%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10月8日至2010年6月30日)

一波强劲的上涨行情,中证全债指数交易所上涨4.71%,企债指数上涨6.03%。

长盛积极配置债券基金持有的权益资产主要都是参与新股网下申购锁定的股票,在股市的剧烈下跌中遭受了较大的损失。在债券资产的投资上,出于对通胀的担忧,我们没有很好的获得债券市场上涨的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,截至2010年6月30日,长盛积极配置债券基金份额净值1.1093元,年初以来的净值增长率为2.23%,高于同期业绩比较基准1.70个百分点。

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

目前国内经济形势处在一个很复杂的环境中,转型中的经济增长受制于刘易斯拐点条件下人口红利的衰减;外部经济环境和国内经济规模的日益壮大,意味着中国不可能继续以过去10年的出口导向模式进行发展;超发的货币,导致资产泡沫和通胀预期成为短期挥之不去的心理阴影。但是从更长期一点的时间窗口来看,产业升级和城镇化仍然能让中国在相当长的时间里保持一个相对高的增长速度。

目前股票市场中相当多股票,特别是中大盘股的估值水平大约在10倍PE、2倍PB附近,分红收益率也高于同期银行存款利率。相对于收益率越来越低的企业债,股票市场正慢慢体现出相对更好投资价值,即使是对于低风险偏好的投资者也是如此。

基于上述判断,本基金将坚持绝对收益理念,加大可转债投资力度,控制组合的下行风险,保持足够的流动性。

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、估值目、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11,631,066.51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十六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2,744,166.13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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为2,744,166.13元。

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

本托管人复核审查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。

## §6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:长盛积极配置债券型证券投资基金

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 | 4,503,456.42 | 102,129,275.40 |
| 结算备付金 | 637,158.12 | 1,146,675.96 |
| 存出保证金 | 250,000.00 | 250,000.00 |
| 交易性金融资产 | 107,598,500.64 | 147,729,043.92 |
| 其中:股票投资 | 12,256,358.14 | 24,583,756.42 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 95,342,142.50 | 123,145,287.50 |
| 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 | 28,980,000.00 | 15,141,129.53 |
| 应收利息 | 1,634,749.42 | 986,863.66 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 32,444.81 | 20,834.91 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 143,636,309.41 | 267,403,823.38 |
| 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 | 25,000,000.00 | 112,199,711.20 |
| 应付证券清算款 | - | 616,348.56 |
| 应付赎回款 | 10,832.96 | 578,235.17 |
| 应付管理人报酬 | 73,969.99 | 98,664.19 |
| 应付托管费 | 19,725.30 | 26,310.46 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 58,874.12 | 153,502.87 |
| 应交税费 | 8,934.00 | 2,334.00 |
| 应付利息 | 3,625.00 | 13,774.08 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 408,710.15 | 310,973.81 |
| 负债合计 | 25,584,671.52 | 113,999,854.34 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 106,420,571.38 | 138,845,242.48 |
| 未分配利润 | 11,631,066.51 | 14,558,726.56 |
| 所有者权益合计 | 118,051,637.89 | 153,403,969.04 |
| 负债和所有者权益总计 | 143,636,309.41 | 267,403,823.38 |

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值:1.1093元,基金份额总额106,420,571.38份。

6.2 利润表

会计主体:长盛积极配置债券型证券投资基金

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 | 4,664,291.91 | 9,480,181.20 |
| 1.利息收入 | 1,436,147.91 | 8,117,759.06 |
| 其中:存款利息收入 | 143,134.78 | 155,072.45 |
| 债券利息收入 | 1,293,013.13 | 7,962,686.61 |
| 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) | 7,550,724.25 | 6,646,054.37 |
| 其中:股票投资收益 | 7,282,922.12 | 9,274,095.92 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 247,110.68 | -2,698,191.55 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 20,691.45 | 70,150.00 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"填列) | -4,352,326.84 | -5,631,064.25 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"填列) | 29,746.59 | 347,432.02 |
| 减:费用 | 1,393,149.82 | 3,251,012.77 |
| 1.管理人报酬 | 502,184.94 | 1,743,125.29 |
| 2.托管费 | 133,915.94 | 464,833.32 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 125,071.39 | 516,651.46 |
| 5.利息支出 | 465,519.73 | 334,414.39 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 465,519.73 | 334,414.39 |
| 6.其他费用 | 166,457.82 | 191,988.31 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 3,271,142.09 | 6,229,168.43 |
| 所得税费用(以"-"号填列) | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 3,271,142.09 | 6,229,168.43 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛积极配置债券型证券投资基金

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) | 138,845,242.48 | 14,558,726.56 | 153,403,969.04 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 3,271,142.09 | 3,271,142.09 |
| 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) | -32,424,671.10 | -3,454,636.01 | -35,879,307.11 |
| 其中:1.基金申购款 | 13,912,187.84 | 1,722,911.49 | 15,635,099.33 |
| 2.基金赎回款 | -46,336,858.94 | -5,177,547.50 | -51,514,406.44 |
| 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) | - | -2,744,166.13 | -2,744,166.13 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 106,420,571.38 | 11,631,066.51 | 118,051,637.89 |
| 项 目 | 本期 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) | 694,276,210.72 | 18,326,417.72 | 712,602,628.44 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 6,229,168.43 | 6,229,168.43 |
| 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) | -391,364,933.15 | -10,639,470.95 | -402,004,404.10 |
| 其中:1.基金申购款 | 59,145,053.01 | 2,093,785.37 | 61,238,838.38 |
| 2.基金赎回款(以"-"号填列) | -450,509,986.16 | -12,733,256.32 | -463,243,242.48 |
| 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) | 302,911,277.57 | 13,916,115.20 | 316,827,392.77 |

注:后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

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 |
|---|---|
| 长盛基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行 | 基金托管人、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

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 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 502,184.94 | 1,743,125.29 |
| 其中:支付给销售机构的客户维护费 | 36,104.42 | 149,881.15 |

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0.75%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:

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/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 | 133,915.94 | 464,833.32 |

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.2%/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 |
| 中国建设银行 | 10,061,056.16 | 9,992,976.30 | - | - | - | - |
| 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 |
| 中国建设银行 | - | 9,965,030.41 | - | - | 1,236,600,000.00 | 204,216.15 |

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10月8日)持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 50,001,240.00 | 50,001,240.00 |
| 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 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 50,001,240.00 | 50,001,240.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 46.98% | 16.51% |

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 |
| 中国建设银行 | 4,503,456.42 | 136,983.03 | 39,655,363.00 | 148,293.37 |

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。

6.4.3.7 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

金额单位:人民币元

| 6.4.4.1.1 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:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
| 300073 | 当升科技 | 2010-4-16 | 2010-7-27 | 新股认购 | 36.00 | 58.75 | 20,373 | 733,428.00 | 1,196,913.75 |
| 002390 | 信邦制药 | 2010-4-8 | 2010-7-16 | 新股认购 | 33.00 | 33.46 | 33,061 | 1,091,013.00 | 1,106,221.06 |
| 300077 | 国民技术 | 2010-4-23 | 2010-8-2 | 新股认购 | 87.50 | 116.75 | 8,519 | 745,412.50 | 994,593.25 |
| 300082 | 奥克股份 | 2010-5-10 | 2010-8-20 | 新股认购 | 85.00 | 67.55 | 14,099 | 1,198,415.00 | 952,387.45 |
| 002387 | 黑牛食品 | 2010-4-2 | 2010-7-13 | 新股认购 | 27.00 | 36.96 | 23,974 | 647,298.00 | 886,079.04 |
| 300086 | 康芝药业 | 2010-5-17 | 2010-8-26 | 新股认购 | 60.00 | 52.52 | 15,523 | 931,380.00 | 815,267.96 |
| 002436 | 兴森科技 | 2010-6-4 | 2010-9-20 | 新股认购 | 36.50 | 30.60 | 26,574 | 969,951.00 | 813,164.40 |
| 002424 | 贵州百灵 | 2010-5-26 | 2010-9-3 | 新股认购 | 40.00 | 40.71 | 17,904 | 716,160.00 | 728,871.84 |
| 002401 | 交技发展 | 2010-4-28 | 2010-8-6 | 新股认购 | 26.40 | 35.17 | 18,927 | 499,672.80 | 665,662.59 |
| 002381 | 双箭股份 | 2010-3-26 | 2010-7-2 | 新股认购 | 32.00 | 32.08 | 17,210 | 550,720.00 | 552,096.80 |

6.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于期末未持有银行间同业市场的债券正回购作为质押的债券。

6.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额25,000,000.00元,于2010年7月6日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

## §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 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 12,256,358.14 | 8.53 |
| | 其中:股票 | 12,256,358.14 | 8.53 |
| 2 | 固定收益投资 | 95,342,142.50 | 66.38 |
| | 其中:债券 | 95,342,142.50 | 66.38 |
| | 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 | 5,140,614.54 | 3.58 |
| 6 | 其它各项资产 | 30,897,194.23 | 21.51 |
| 7 | 合计 | 143,636,309.41 | 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 | - | - |
| C | 制造业 | 8,045,595.55 | 6.82 |
| C0 | 食品、饮料 | 886,079.04 | 0.75 |
| 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 | 1,504,484.25 | 1.27 |
| C5 | 电子 | 1,807,757.65 | 1.53 |
| C6 | 金属、非金属 | 1,196,913.75 | 1.01 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | - | - |
| C8 | 医药、生物制品 | 2,650,360.86 | 2.25 |
| C99 | 其它制造业 | - | - |
| 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 | - | - |
| G | 信息技术业 | 665,662.59 | 0.56 |
| H | 批发和零售贸易 | - | - |
| I | 金融、保险业 | 3,545,100.00 | 3.00 |
| 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 | 12,256,358.14 | 10.38 |

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 | 600016 | 民生银行 | 550,000 | 3,327,500.00 | 2.82 |
| 2 | 300073 | 当升科技 | 20,373 | 1,196,913.75 | 1.01 |
| 3 | 002390 | 信邦制药 | 33,061 | 1,106,221.06 | 0.94 |
| 4 | 300077 | 国民技术 | 8,519 | 994,593.25 | 0.84 |
| 5 | 300082 | 奥克股份 | 14,099 | 952,387.45 | 0.81 |
| 6 | 002387 | 黑牛食品 | 23,974 | 886,079.04 | 0.75 |
| 7 | 300086 | 康芝药业 | 15,523 | 815,267.96 | 0.69 |
| 8 | 002436 | 兴森科技 | 26,574 | 813,164.40 | 0.69 |
| 9 | 002424 | 贵州百灵 | 17,904 | 728,871.84 | 0.62 |
| 10 | 002401 | 交技发展 | 18,927 | 665,662.59 | 0.56 |

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 | 600016 | 民生银行 | 4,506,567.14 | 2.94 |
| 2 | 000565 | 渝三峡A | 1,954,454.00 | 1.27 |
| 3 | 002336 | 人人乐 | 1,696,313.54 | 1.11 |
| 4 | 600256 | 广汇股份 | 1,221,283.80 | 0.80 |
| 5 | 300082 | 奥克股份 | 1,198,415.00 | 0.78 |
| 6 | 300045 | 华力创通 | 1,190,484.60 | 0.78 |
| 7 | 002359 | 齐星铁塔 | 1,112,308.86 | 0.73 |
| 8 | 002390 | 信邦制药 | 1,091,013.00 | 0.71 |
| 9 | 002362 | 汉王科技 | 1,002,667.00 | 0.65 |
| 10 | 002436 | 兴森科技 | 969,951.00 | 0.63 |
| 11 | 600036 | 招商银行 | 948,871.00 | 0.62 |
| 12 | 300086 | 康芝药业 | 931,380.00 | 0.61 |
| 13 | 002347 | 泰尔重工 | 867,915.00 | 0.57 |
| 14 | 300077 | 国民技术 | 745,412.50 | 0.49 |
| 15 | 300073 | 当升科技 | 733,428.00 | 0.48 |
| 16 | 002424 | 贵州百灵 | 716,160.00 | 0.47 |
| 17 | 002376 | 新北洋 | 707,499.14 | 0.46 |
| 18 | 600227 | 赤天化 | 702,011.70 | 0.46 |
| 19 | 002351 | 漫步者 | 677,973.00 | 0.44 |
| 20 | 002373 | 联信永益 | 655,200.00 | 0.43 |

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 | 002362 | 汉王科技 | 3,783,733.94 | 2.47 |
| 2 | 000565 | 渝三峡A | 3,741,311.22 | 2.44 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 1,962,617.84 | 1.28 |
| 4 | 002336 | 人人乐 | 1,846,785.14 | 1.20 |
| 5 | 600999 | 招商证券 | 1,573,551.27 | 1.03 |
| 6 | 600256 | 广汇股份 | 1,508,253.36 | 0.98 |
| 7 | 601618 | 中国中冶 | 1,389,665.16 | 0.91 |
| 8 | 002326 | 永太科技 | 1,377,466.50 | 0.90 |
| 9 | 300041 | 回天胶业 | 1,364,615.49 | 0.89 |
| 10 | 300045 | 华力创通 | 1,354,011.80 | 0.88 |
| 11 | 002359 | 齐星铁塔 | 1,243,383.60 | 0.81 |
| 12 | 600036 | 招商银行 | 1,217,800.00 | 0.79 |
| 13 | 002376 | 新北洋 | 1,165,277.43 | 0.76 |
| 14 | 300034 | 钢研高纳 | 986,612.82 | 0.64 |
| 15 | 002347 | 泰尔重工 | 934,115.74 | 0.61 |
| 16 | 002301 | 齐心文具 | 922,066.72 | 0.60 |
| 17 | 002320 | 海峡股份 | 907,562.60 | 0.59 |
| 18 | 002305 | 南国置业 | 839,967.33 | 0.55 |
| 19 | 002364 | 中恒电气 | 782,795.18 | 0.51 |
| 20 | 600227 | 赤天化 | 771,930.10 | 0.50 |

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 | 35,790,999.31 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 51,583,057.36 |

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 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 53,047,593.60 | 44.94 |
| 2 | 央行票据 | 19,632,000.00 | 16.63 |
| 3 | 金融债券 | 20,002,000.00 | 16.94 |
| | 其中:政策性金融债 | 20,002,000.00 | 16.94 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | 2,660,548.90 | 2.25 |
| 7 | 合计 | 95,342,142.50 | 80.76 |

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 010110 | 21国债(01) | 300,330 | 30,423,429.00 | 25.77 |
| 2 | 010112 | 21国债(02) | 223,140 | 22,624,164.60 | 19.16 |
| 3 | 080225 | 08国开25 | 200,000 | 20,002,000.00 | 16.94 |
| 4 | 0901042 | 09央票42 | 200,000 | 19,632,000.00 | 16.63 |
| 5 | 125731 | 美丰转债 | 10,000 | 1,049,000.00 | 0.89 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.9.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.9.3 期末其它各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 250,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 28,980,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,634,749.42 |
| 5 | 应收申购款 | 32,444.81 |
| 6 | 其它应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其它 | - |
| 9 | 合计 | 30,897,194.23 |

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110007 | 博汇转债 | 535,000.00 | 0.45 |
| 2 | 110003 | 新钢转债 | 513,498.90 | 0.44 |

7.9.5 期末前十名股票中在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300073 | 当升科技 | 1,196,913.75 | 1.01 | 新股流通受限 |
| 2 | 002390 | 信邦制药 | 1,106,221.06 | 0.94 | 新股流通受限 |
| 3 | 300077 | 国民技术 | 994,593.25 | 0.84 | 新股流通受限 |
| 4 | 300082 | 奥克股份 | 952,387.45 | 0.81 | 新股流通受限 |
| 5 | 002387 | 黑牛食品 | 886,079.04 | 0.75 | 新股流通受限 