长盛同德主题增长股票型证券投资基金 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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(以下简称:中国农业银行)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,投资者在作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	长盛同德主题股票
基金主代码	519039
交易代码	519039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月25日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,758,784,624.63份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型证券投资基金,投资目标是在确定促进中国经济持续增长的主题背景下,挖掘中国经济持续增长的动力之所在,选取具有高成长性和具备持续增长潜力的上市公司,分享中国经济高速增长的成果;在严格控制投资风险的前提下,努力保持基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将沿着全球化、城镇化、消费升级、制度变革四大主题进行大类资产配置;根据企业获利能力、增长能力、资产回报率、资产管理能力等定量指标,结合公司治理结构状况等定性指标对行业内上市公司进行综合评价,动态的寻找行业与个股的最佳结合点。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准=沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金。风险高于混合型基金、债券基金,属于较高风险、较高回报的基金产品。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	李芳菲
	联系电话	010-82255818	010-66060069
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	95599
传真		010-82255988	010-63201816

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	295,811,266.20
本期利润	-2,156,112,200.95
加权平均基金份额本期利润	-0.1958
本期基金份额净值增长率	-20.53%
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	-0.1618
期末基金资产净值	8,199,274,201.40
期末基金份额净值	0.7621

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。

4、本基金由同德证券投资基金转型而来,转型日为2007年10月25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	-6.99%	1.25%	-6.03%	1.34%	-0.96%	-0.09%
过去三个月	-15.72%	1.38%	-18.88%	1.45%	3.16%	-0.07%
过去六个月	-20.53%	1.22%	-22.77%	1.27%	2.24%	-0.05%
过去一年	-8.52%	1.43%	-14.34%	1.52%	5.82%	-0.09%
过去三年	-28.89%	1.82%	-43.14%	1.94%	14.25%	-0.12%
自基金转型起至今	-28.89%	1.82%	-43.14%	1.94%	14.25%	-0.12%

注:本基金业绩比较基准=沪深300指数×80%+上证国债指数×20%

本基金为股票型基金,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。

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80%、20%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

注:本基金由同德证券投资基金转型而来,转型日为2007年10月25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、十二支开放式基金(包含一支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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王雪松	本基金基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理。	2009年8月24日	—	8年	男,1968年10月出生,中国国籍。北京大学硕士。历任巨田证券有限公司研究员、新世纪基金管理公司研究员。2007年8月加入长盛基金管理有限公司,曾任长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金赎回款-771,024,188.93 13,827,375.34 -757,196,813.59
戴春平	本基金基金经理、投资管理部总监。	2010年1月11日	—	9年	男,1976年2月出生,中国国籍。中国人民大学经济学博士。历任泰康保险资产管理中心投资经理;鹏华基金管理有限公司基金经理助理;中国人寿资产管理公司投资经理助理;融通基金管理公司投资决策委员会委员和融通新蓝筹基金经理。2009年10月加入长盛基金管理有限公司,现任投资管理部总监,长盛同德主题增长股票型证券投资基金(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。

3、报经中国证券业协会同意,已解聘戴春平先生长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理职务。同时聘任邓永明先生担任长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理,与该基金原基金经理王雪松先生共同管理该支基金。该事项公司已于2010年8月14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、《长盛同德主题增长股票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 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年,宏观经济出现放缓的迹象。四万亿的财政刺激政策效果在逐渐消退,同时,政府出于对通货膨胀的恐惧,有意地采取了一系列的宏观调控政策,尤其是在房地产领域,新的国十条至少是在短期内有效地遏制了房地产泡沫的蔓延。资本市场也跟随政策的调控在2季度出现了大幅度的回落,同时大小盘风格转换在2季度本出现了转换的迹象。

上半年我们有效地控制了组合的股票仓位。不过,由于对风格转换得过早预期,导致基金半年来操作并不理想。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.7621元,本报告期份额净值增长率为-20.53%,同期业绩比较基准增长率为-22.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年,我们认为全球经济仍处于在平衡的过程之中。受欧洲债务危机和美国无就业复苏的困扰,短期内难以看到全球经济有比较明显的改善。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。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。

尽管按照目前的盈利水平证券市场的整体估值水平在可接受范围之内,不过,中国式的去杠杠化才刚刚开始。如果考虑到泡沫的破裂,目前的估值仍然并不安全。特别是一些中小市值公司估值水平仍然难以接受。预计未来指数将处于震荡之中。短期内政府政策的变化会给市场带来一定的机会,长期内仍然需要等待。

本基金下阶段将继续围绕经济结构转型这个大主题,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(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、研发发展部、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-1,740,751,495.63元,其中:未分配利润已实现部分为-1,173,551,083.03元,未分配利润未实现部分为-567,200,412.60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条中对基金利润分配原则的约定,本报告期内未实施利润分配。

§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

在托管长盛同德主题增长证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《长盛同德主题增长证券投资基金基金合同》、《长盛同德主题增长证券投资基金托管协议》的约定,对长盛同德主题增长证券投资基金管理人—长盛基金管理有限公司2010年1月1日至2010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长盛同德主题增长证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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长盛同德主题增长证券投资基金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:长盛同德主题增长股票型证券投资基金

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	1,854,672,424.25	29,926,429.40
结算备付金	5,380,318.75	1,417,424,613.27
存出保证金	13,474,128.64	7,185,929.41
交易性金融资产	5,448,844,949.23	9,643,475,009.46
其中:股票投资	5,230,344,119.23	9,394,815,559.26
基金投资	-	-
债券投资	218,500,830.00	248,659,450.20
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	1,641,716.62
买入返售金融资产	897,901,746.85	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	4,438,715.54	2,842,218.26
应收股利	194,170.23	-
应收申购款	369,624.28	208,521.03
递延所得税资产	-	-
其他资产	30,000.00	30,000.00
资产总计	8,225,306,077.77	11,102,734,437.45
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	2,267,990.94	13,994,662.15
应付管理人报酬	10,772,595.38	14,187,194.43
应付托管费	1,795,432.56	2,364,532.40
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	8,093,606.58	7,748,080.90
应交税费	1,393,945.72	1,306,950.72
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,708,305.19	1,658,001.72
负债总计	26,031,876.37	41,259,422.32
所有者权益:		
实收基金	9,940,025,697.03	10,657,091,570.40
未分配利润	-1,740,751,495.63	404,383,444.73
所有者权益合计	8,199,274,201.40	11,061,475,015.13
负债和所有者权益总计	8,225,306,077.77	11,102,734,437.45

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值0.7621元,基金份额总额10,758,784,624.63份。

6.2 利润表

会计主体:长盛同德主题增长股票型证券投资基金

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	-2,026,101,179.29	3,511,439,567.46
1.利息收入	15,379,872.22	10,388,800.48
其中:存款利息收入	8,187,700.40	5,658,571.81
债券利息收入	2,909,476.01	4,730,228.67
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,282,695.81	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	410,204,887.67	165,340,395.77
其中:股票投资收益	393,436,176.00	103,855,845.90
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,299,807.32	16,211,774.79
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-96,263.84	-
股利收益	18,164,782.83	45,272,775.08
3.公允价值变动收益(损失以"-"填列)	-2,451,923,467.15	3,335,356,589.87
4.汇兑收益(损失以"-"填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"填列)	237,527.97	353,781.34
减:二、费用	130,011,021.66	96,191,821.31
1.管理人报酬	71,765,067.63	65,702,990.58
2.托管费	11,960,844.60	10,950,498.41
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	46,076,504.54	19,321,057.43
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	208,604.89	217,274.89
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-2,156,112,200.95	3,415,247,746.15
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-2,156,112,200.95	3,415,247,746.15

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛同德主题增长股票型证券投资基金

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)	10,657,091,570.40	404,383,444.73	11,061,475,015.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,156,112,200.95	-2,156,112,200.95
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)	-717,065,873.37	10,977,260.59	-706,088,612.78
其中:1.基金申购款	53,958,315.56	-2,850,114.75	51,108,200.81
2.基金赎回款	-771,024,188.93	13,827,375.34	-757,196,813.59
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)	9,940,025,697.03	-1,740,751,495.63	8,199,274,201.40
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)	11,830,421,291.71	-4,645,989,963.18	7,184,431,328.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,415,247,746.15	3,415,247,746.15
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)	9,955,453.36	66,877,700.96	76,833,154.32
其中:1.基金申购款	777,457,067.10	-93,550,474.02	683,906,593.08
2.基金赎回款	-767,501,613.74	160,428,174.98	-607,073,438.76
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)	11,840,376,745.07	-1,163,864,516.07	10,676,512,229.00

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
中国农业银行	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

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	-	-	1,109,735,391.92	8.81%

6.4.3.1.2 权证交易

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)通过关联方交易单元进行的权证交易量为零。

6.4.3.1.3 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	占应付佣金余额的比例
国元证券	-	-	-	-
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	占应付佣金余额的比例
国元证券	943,262.56	8.93%	943,262.56	8.88%

注:1、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和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2、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	71,765,067.63	65,702,990.58
其中:支付销售机构的客户维护费	15,236,128.50	14,455,691.44

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:日基金管理费=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	11,960,844.60	10,950,498.41

注:支付基金托管人中国农业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(2007年10月25日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	105,755,791.00	105,755,791.00
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	105,755,791.00	105,755,791.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.98%	0.83%

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)及上年度可比期间末(2009年6月30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
中国农业银行	1,854,672,424.25	7,834,654.84	1,529,833,038.93	5,453,742.44

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,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。

6.4.3.7 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

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。

6.4.4.2 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	备注
000895	双汇发展	1003/22	重大事项	43.54	-	-	7,450,963	297,543,386.20	324,414,929.02	
601318	中国平安	1006/29	重大事项	46.81	-	-	2,500,000	119,110,746.02	117,025,000.00	

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。

6.4.4.3 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权。

§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	5,230,344,119.23	63.59
	其中:股票	5,230,344,119.23	63.59
2	固定收益投资	218,500,830.00	2.66
	其中:债券	218,500,830.00	2.66
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	897,901,746.85	10.92
	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	1,860,052,743.00	22.61
6	其他各项资产	18,506,638.69	0.22
7	合计	8,225,306,077.77	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	59,081,082.02	0.72
B	采掘业	428,387,829.21	5.22
C	制造业	2,705,563,059.82	33.00
C0	食品、饮料	339,758,525.52	4.14
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	5,931,333.10	0.07
C4	石油、化学、塑胶、塑料	892,745,637.48	10.89
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	308,026,553.38	3.76
C7	机械、设备、仪表	574,236,190.37	7.00
C8	医药、生物制品	584,864,819.97	7.13
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	60,874,778.95	0.74
E	建筑业	199,085,681.76	2.43
F	交通运输、仓储业	740,169,801.56	9.03
G	信息技术业	356,994,836.19	4.35
H	批发和零售贸易	126,081,609.88	1.54
I	金融、保险业	117,025,000.00	1.43
J	房地产业	102.30	0.00
K	社会服务业	26,981,375.00	0.33
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	410,098,962.54	5.00
	合计	5,230,344,119.23	63.79

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	600125	铁龙物流	26,239,722	354,498,644.22	4.32
2	000792	盐湖钾肥	8,745,464	341,073,096.00	4.16
3	000895	双汇发展	7,450,963	324,414,929.02	3.96
4	601111	中国国航	29,023,407	298,360,623.96	3.64
5	600458	时代新材	9,158,170	273,829,283.00	3.34
6	600157	鲁润股份	11,612,006	256,741,452.66	3.13
7	600309	烟台万华	14,464,653	211,039,287.27	2.57
8	600050	中国联通	36,999,733	197,208,576.89	2.41
9	000090	深天健	19,582,958	159,796,937.28	1.95
10	000762	西藏矿业	5,797,716	147,841,758.00	1.80

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	000792	盐湖钾肥	455,648,497.30	4.12
2	601318	中国平安	450,331,984.05	4.07
3	600000	浦发银行	400,025,305.20	3.62
4	601111	中国国航	367,054,601.97	3.32
5	600125	铁龙物流	363,067,327.16	3.28
6	000983	西山煤电	334,285,253.56	3.02
7	600309	烟台万华	318,734,254.26	2.88
8	600050	中国联通	298,128,796.07	2.70
9	000090	深天健	283,783,564.14	2.57
10	600581	八一钢铁	280,764,224.98	2.54
11	600060	海信电器	272,710,254.09	2.47
12	600123	兰花科创	246,481,159.41	2.23
13	600458	时代新材	239,061,994.12	2.16
14	600239	云南城投	232,576,853.32	2.10
15	600031	三一重工	231,519,575.65	2.09
16	601601	中国太保	226,838,535.68	2.05
17	600026	中海发展	216,741,506.90	1.96
18	600048	保利地产	214,350,233.50	1.94
19	000157	中联重科	205,024,114.76	1.85
20	600595	中孚实业	203,611,166.34	1.84

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	000001	深发展A	620,781,345.54	5.61
2	600036	招商银行	467,542,389.79	4.23
3	601318	中国平安	412,745,937.78	3.73
4	600000	浦发银行	384,511,817.16	3.48
5	600050	中国联通	361,622,738.67	3.27
6	000338	潍柴动力	357,397,583.14	3.23
7	600188	兖州煤业	321,707,756.09	2.91
8	000937	冀中能源	320,264,168.95	2.90
9	000063	中兴通讯	313,244,182.99	2.83
10	601601	中国太保	274,983,403.36	2.49
11	000527	美的电器	261,232,276.58	2.36
12	000983	西山煤电	221,487,604.85	2.00
13	000024	招商地产	217,841,301.78	1.97
14	600060	海信电器	215,397,252.29	1.95
15	000581	威孚高科	205,323,350.10	1.86
16	000400	许继电气	203,941,232.61	1.84
17	000800	一汽轿车	203,564,827.87	1.84
18	600031	三一重工	197,748,548.76	1.79
19	000002	万科A	196,286,844.45	1.77
20	000933	神火股份	191,451,085.94	1.73

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	13,785,090,173.90
卖出股票收入(成交)总额	15,882,644,931.32

注:本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3表中的"买入金额"(或"买入