长盛同德主题增长股票型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009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:2009年08月27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2009年8月26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。

本报告会计期间:2009年1月1日至2009年6月30日。

§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
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
报告期末基金份额总额	12,815,659,271.43份

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	010-68424199
	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	010-68424181

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 2009年1月1日-2009年6月30日
本期已实现收益	79,891,156.28
本期利润	3,415,247,746.15
加权平均基金份额本期利润	0.2727
本期基金份额净值增长率	48.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期 2009年1月1日-2009年6月30日
期末可供分配基金份额利润	-0.1613
期末基金资产净值	10,676,512,229.00
期末基金份额净值	0.8331

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%	0.91%	11.62%	0.98%	-4.63%	-0.07%
过去三个月	17.60%	1.21%	20.74%	1.24%	-3.14%	-0.03%
过去六个月	48.48%	1.46%	56.52%	1.57%	-8.04%	-0.11%
过去一年	24.79%	1.84%	13.59%	2.06%	11.20%	-0.22%
过去三年	-22.27%	2.01%	-33.62%	2.16%	11.35%	-0.15%
自基金转型日起至今	-22.27%	2.01%	-33.62%	2.16%	11.35%	-0.15%

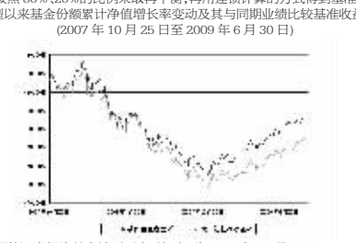
注:本基金业绩比较基准=沪深300指数×80%+上证国债指数×20%

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

(2007年10月25日至2009年6月30日)



注:1、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。

2、按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十三条(三)投资范围、(九)投资限制的有关约定。本报告期内,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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2009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,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		
儋凌蔚	本基金基金经理、公司总经理助理、投资管理部总监。	2007年10月25日	—	8年	男,1974年9月出生,中国国籍。厦门大学经济学硕士。历任融通新蓝筹基金经理、融通基金管理有限公司总经理助理、投资管理部总监、博时基金管理有限公司博时主题行业基金经理。2007年3月加入长盛基金管理有限公司,现任长盛基金管理有限公司总经理助理、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。
侯继雄	本基金基金经理(已离任),同盛证券投资基金基金经理。	2007年10月25日	2009年3月9日	8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,现任长盛同德主题增长股票型证券投资基金(本基金)基金经理(已离任),基金同盛证券投资基金基金经理。
王雪松	本基金基金经理助理,行业研究员。	2008年8月7日	—	7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,现任长盛同德主题增长股票型证券投资基金(本基金)基金经理助理,行业研究员。

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

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 报告期内行情回顾和本基金投资策略分析

2009年上半年,在充裕流动性和经济复苏预期推动下,市场震荡上行,上证指数半年涨幅61.46%。从投资拉动、估值修复、主题投资到复苏预期、通胀预期,热点板块轮动特征明显,市场结构分化。

由于对去库存化和流动性拐点有前瞻性认识,我们较早增持了质地优良的投资品公司和利率敏感型的地产股等,超配了小盘成长股和装备制造业,在一季度获得了较好的超额收益。但二季度表现不如人意,在与同行和基准的比较方面都相对落后,我们对组合的状况展开了全面反思。

面对充斥着宏观预期而不理会微观实际盈利能力的市场,面对群体性风险厌恶程度降低到极致的参与者,同德基金依旧坚持较为严格的选股标准和相对长期的价值判断,对于组合重仓品种,我们一直从公司内生增长能力、长期的公司治理记录、清晰可见的相对竞争优势以及较为放心的公司管理层与公司战略等方面进行评估。因为我们的重仓品种既然买入,就不会考虑在短期的一年内卖出;也因为我们相信,按照这样的标准,而不是从属于简单的经济周期判断、宏观通胀预期或某些突发性事件,去构建的重仓股组合虽然可能会在短期内牺牲一定的净值增长能力,但会更有可持续的生命力,也更能帮助持有人抵御未来必然会发生的风险。

面对政府强力干预而使得经济周期波动更加频繁的现实,我们认为,股票市场的投资者实际面临的不确定性在加大,我们对市场采取相对谨慎态度的根本原因在于,基本的传统的宏观与投资分析框架可能正在瓦解,虽然我们仍然能寻找到很多优秀的公司投资标的,但由于宏观经济波动的不稳定性,我们不能确保这些优秀公司在中短期内能够抵御系统风险而给股东带来和过去的记录一样优秀的回报,特别是在市场预期充分,股价普遍缺乏安全边际的背景之下。

我们在二季度组合平衡过程中犯的最大错误就是没有能很好地控制组合的换手率。在过去的半年中,组合换手率达到135%,这实际上反映出我们基本研究深度不足,行业轮动过于频繁,对短期业绩排名压力做出的妥协太大等缺点。

针对组合集中度不高的特点,我们的理解是:个股集中度应该提高,而提高应该建立在整个团队研究具备更强的深入性、前瞻性的基础之上,包括管理团队自身也应该努力这样去做;但我们不太认同组合行业集中度片面提高的做法,我们还是坚持自己的看法,在这样的经济发展阶段,只有夕阳的企业,而没有夕阳的行业。那种根据宏观假设的预期就把组合行业集中度无限制提高的做法无疑风险是比较大的。数量统计也证明,与大类资产配置和品种选择相比,行业主动配置与轮动的超额收益在长期看是微乎其微的。

4.4.2 本基金业绩表现

截至2009年6月30日,本基金份额净值为0.8331元,本报告期份额净值增长率为48.48%,同期业绩比较基准收益率为56.52%。

4.5 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

展望未来,我们认为中国有以下几个行业正在发生结构性变化,其中可能会涌现出较好的投资机会,值得我们去关注:通信运营、航空服务、发电与输变电等等。而宏观经济复苏和企业回报能力恢复的可持续性需要继续观察,贸易顺差迅速减少乃至逆转,巨额信贷投放的质量都可能成为影响未来市场估值信心的因素。

我们可能正处在一个比较重要的历史阶段,就全球而言,推动生产力提高的主要贡献已经难以依靠体制变化带来的持续的劳动力、资金、传统资源等要素价格边际下降,而转而去寻找技术创新的突破。就中国而言,在既定框架下的帕累托改善已经走到尽头,分配的公平、社会的和谐一定会越来越重要,其中给我们带来的投资机会将是全新的,需要我们努力去把握。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行(企业会计准则)有关衔接事宜的通知》(证监会计字[2007]15号)、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(证监会计字[2007]21号)与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2008]38号)等文件,本公司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,采取多种方式减少或避免估值偏差的发生。

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。

基金管理人设立基金估值小组时充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性,人员构成如下:

人员	职务	职责
杨思乐	长盛基金管理有限公司副总经理	长盛基金估值小组组长;领导、统筹估值小组工作,完成基金资产估值。
叶金松	长盛基金管理有限公司督察长	长盛基金估值小组组长;领导、统筹估值小组工作,完成基金资产估值。
白仲光	金融工程部总监,长盛中证100指数证券投资基金基金经理	出具估值时所采用的估值模型、假设、参数。
李庆林	研究发展部副总监	出具估值时所采用的假设,判定依据。
儋凌蔚	总经理助理和投资管理部总监,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理	判定估值价格合理性。
郝善勇	信息技术部总监	建立辅助估值系统,提供估值价格。
张利宁	监察稽核部总监	审查监督估值制度,程序执行过程的合规性。
戴君樱	业务运营部副总监	采用调整后价格进行基金资产估值。
黄联	业务运营部副总监	采用调整后价格进行基金资产估值。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。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,托管银行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

根据中国证监会基金部通知[2008]12号《关于2007年证券投资基金年度报告编制及披露相关问题的通知》、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>(试行)》等通知中对基金期末可分配利润计算方法的规定,以及《长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金合同》对基金利润分配原则的约定,本基金截至2009年6月30日可供分配收益为-2,066,717,116.45元,按照上述通知及基金合同的规定,本基金2009年上半年度不进行分配。

§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股票型证券投资基金的过程中,本基金托管人——中国农业银行严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金合同》、《长盛同德主题增长股票型证券投资基金托管协议》的约定,对长盛同德主题增长股票型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长盛同德主题增长股票型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股票型证券投资基金年度报告中的财务指标、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:2009年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资产:		
银行存款	1,529,833,038.93	535,461,840.96
结算备付金	7,386,757.80	805,585,594.97
存出保证金	2,999,362.57	1,912,405.17
交易性金融资产	9,105,648,186.71	5,849,437,020.24
其中:股票投资	8,832,517,821.31	5,356,078,387.18
基金投资	-	-
债券投资	273,130,365.40	493,358,633.06
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	3,075,456.88	2,544,942.55
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	64,568,012.20	1,825,602.31
应收利息	4,461,798.06	5,838,969.13
应收股利	4,726,401.92	-
应收申购款	464,525.75	272,912.25
递延所得税资产	-	-
其他资产	30,000.00	30,000.00
资产总计	10,723,193,540.82	7,202,909,287.58
负债和所有者权益	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008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	6,703,897.00	1,406,198.90
应付赎回款	13,503,560.41	1,799,448.58
应付管理人报酬	12,292,812.95	9,423,537.80
应付托管费	2,048,802.20	1,570,589.63
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	10,623,950.04	3,334,264.72
应交税费	276,950.72	189,955.72
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,231,338.50	753,963.70
负债总计	46,681,311.82	18,477,959.05
所有者权益:		
实收基金	11,840,376,745.07	11,830,421,291.71
未分配利润	-1,163,864,516.07	-4,645,989,963.18
所有者权益合计	10,676,512,229.00	7,184,431,328.53
负债和所有者权益总计	10,723,193,540.82	7,202,909,287.58

注:报告截止日2009年6月30日,基金份额净值:0.8331元,基金份额总额12,815,659,271.43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:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
一、收入	3,511,439,567.46	-5,807,488,577.79
1.利息收入	10,388,800.48	12,028,873.14
其中:存款利息收入	5,658,571.81	10,306,321.28
债券利息收入	4,730,228.67	1,404,120.23
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	318,431.63
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	165,340,395.77	-826,006,356.21
其中:股票投资收益	103,855,845.90	-878,775,574.01
基金投资收益	-	-
债券投资收益	16,211,774.79	421,775.86
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	11,725,169.74
股利收益	45,272,775.08	40,622,272.20
3.公允价值变动收益(损失以"-"填列)	3,335,356,589.87	-4,996,664,540.45
4.汇兑收益(损失以"-"填列)	-	-
其他收入	353,781.34	3,153,445.73
二、费用(以"-"号填列)	-96,191,821.31	-170,794,962.08
1.管理人报酬	-65,702,990.58	-91,982,644.27
2.托管费	-10,950,498.41	-15,330,440.72
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	-19,321,057.43	-63,283,909.09
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	-217,274.89	-197,968.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	3,415,247,746.15	-5,978,283,539.87
所得税费用(以"-"号填列)	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	3,415,247,746.15	-5,978,283,539.87

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:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

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)	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(以"-"号填列)	-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数(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
项 目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008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)	11,247,723,730.42	1,991,801,799.97	13,239,525,530.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,978,283,539.87	-5,978,283,539.87
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)	1,322,083,202.20	499,042,996.36	1,821,126,198.56
其中:1.基金申购款	3,282,981,063.86	531,610,842.55	3,814,591,906.41
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-1,960,897,861.66	-32,567,846.19	-1,993,465,707.85
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)	12,569,806,932.62	-3,487,438,743.54	9,082,368,189.08

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,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

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 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008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	914,795,287.95	4.97

6.4.3.1.2 权证交易

本基金本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)及上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)通过关联方交易单元进行的权证交易为零。

6.4.3.1.3 债券交易

本基金本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)及上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)通过关联方交易单元进行的债券交易为零。

6.4.3.1.4 债券回购交易

本基金本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)及上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)通过关联方交易单元进行的债券回购交易为零。

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 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	943,262.56	8.93	943,262.56	8.88
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008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	777,577.52	5.06	777,577.52	5.06

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、经手费和适用期间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 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的管理费	65,702,990.58	91,982,644.27
其中:当期已支付	53,410,177.63	79,903,876.67
期末未支付	12,292,812.95	12,078,767.60

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 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
当期应支付的托管费	10,950,498.41	15,330,440.72
其中:当期已支付	8,901,696.21	13,317,312.75
期末未支付	2,048,802.2	2,013,127.97

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(2009年1月1日至2009年6月30日)及上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)通过关联方进行的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 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
期初持有的基金份额	105,755,791.00	105,755,791.00
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
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(%)	0.83	0.78

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	本期末 2009年6月30日		上年度可比期末 2008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(%)
国元证券	0.00	-	100,013,500.09	0.74

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 2009年1月1日至2009年6月30日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日	
	期末金额	当期利息收入	期末金额	当期利息收入
中国农业银行	1,529,833,038.93	5,453,742.44	1,549,875,484.51	9,896,961.51

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间及比较期间内未参与关联方承销证券交易。

6.4.4 期末(2009年6月30日)本基金持有的流通受限证券

期末(2009年6月30日)本基金未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股票

本基金截至2009年6月30日止未持有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。

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	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,832,517,821.31	82.37
	其中:股票	8,832,517,821.31	82.37
2	固定收益投资	273,130,365.40	2.55
	其中:债券	273,130,365.40	2.55
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	3,075,456.88	0.03
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	1,537,219,796.73	14.34
6	其他资产	77,250,100.50	0.72
	合计	10,723,193,540.82	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	-	0.00
B	采掘业	556,776,495.08	5.21
C	制造业	2,201,440,644.55	20.62
C0	食品、饮料	115,532,244.00	1.08
C1	纺织、服装、皮毛	20,910,059.10	0.20
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	22,327,744.25	0.21
C4	石油、化学、塑胶、塑料	342,504,805.85	3.21
C5	电子	187,433,232.16	1.76
C6	金属、非金属	196,017,283.58	1.84
C7	机械、设备、仪表	1,251,208,549.20	11.72
C8	医药、生物制品	7,000,000.00	0.07
C99	其他制造业	58,506,726.41	0.55
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,066,653,339.17	9.99
E	建筑业	267,251,269.43	2.50
F	交通运输、仓储业	714,064,078.89	6.69
G	信息技术业	411,676,842.00	3.86
H	批发和零售贸易	688,295,250.14	6.45
I	金融、保险业	1,947,055,048.25	18.24
J	房地产业	619,082,664.50	5.80
K	社会服务业	303,119,438.10	2.84
L	传播与文化产业	52,446,482.31	0.49
M	综合类	4,656,268.89	0.04
	合计	8,832,517,821.31	82.73

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	000001	深发展A	27,979,960	610,522,727.20	5.72
2	000024	招商地产	15,430,182	489,908,278.50	4.59
3	600028	中国石化	44,906,210	478,700,198.60	4.48
4	600900	长江电力	32,541,886	448,427,189.08	4.20
5	600875	东方电气	10,721,209	417,055,030.10	3.91
6	600036	招商银行	17,099,912	383,209,027.92	3.59
7	601006	大秦铁路	27,124,363	287,247,004.17	2.69
8	601398	工商银行	47,999,994	260,159,967.48	2.44
9	601186	中国铁建	24,139,499	248,395,444.71	2.33
10	601939	建设银行	38,785,277	233,875,220.31	2.19

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	600036	招商银行	304,790,534.69	4.24
2	600900	长江