长城久泰中信标普300指数证券投资基金 2008年半年度报告摘要

基金管理人:长城基金管理有限公司　基金托管人:招商银行股份有限公司　披露日期:2008年8月29日

第一节 重要提示

长城久泰中信标普300指数证券投资基金管理人的董事会及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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2008年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告期财务会计报告未经审计。

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。

第二节 基金简介

(一)基金基本情况

基金名称:长城久泰中信标普300指数证券投资基金

基金简称:长城久泰

基金代码:200002(前端收费)\201002(后端收费)

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2004年5月21日

报告期末基金份额总额:1,949,788,984.20份

(二)基金投资基本情况

投资目标:以增强指数化投资方法跟踪目标指数,分享中国经济的长期增长,在严格控制与目标指数偏离风险的前提下,力争获得超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值。

投资策略:(1)资产配置策略:本基金为增强型指数基金,以中信标普300指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因,本基金将保持相对固定的股票投资比例,通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术,控制与目标指数的跟踪误差,追求适度超越目标指数的收益。在正常情况下,本基金投资于股票的比例为基金净资产的90~95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%。(2)股票投资策略:本基金的指数化投资采用分层抽样法,实现对中信标普300指数的跟踪,即按照中信标普300指数的行业配置比例构建投资组合,投资组合中具体股票的投资比重将以流通市值权重为基础进行调整。股票投资范围以中信标普300指数的成份股为主,少量补充流动性好、可能成为成份股的其他股票,并基于基本面研究进行有限度的优化调整。(3)债券投资策略:本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标,主要投资于到期日一年以内的政府债券等。

业绩比较基准:95%×中信标普300指数收益率+5%×银行同业存款利率。

风险收益特征:承担市场平均风险,获取市场平均收益。

(三)基金管理人

名称:长城基金管理有限公司

信息披露负责人:彭洪波

联系电话:0755-23982338

传真:0755-23982328

电子邮箱:support@ccfund.com.cn

(四)基金托管人

名称:招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")

信息披露负责人:姜然

联系电话:0755-83195226

传真:0755-83195201

电子邮箱:jiangran@cmbchina.com

(五)信息披露方式

基金选定的信息披露报纸名称:证券时报、中国证券报、上海证券报

登载半年度报告正文的管理人互联网网址:www.ccfund.com.cn

基金半年度报告置备地点:深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

第三节 主要财务指标和基金净值表现

下述基金业绩指标不包括持有人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。

(一)主要财务指标

单位:人民币元

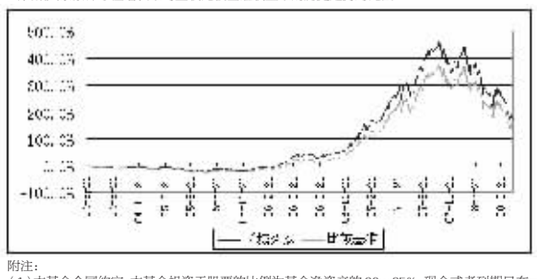
主要财务指标	报告期(2008年1月1日-6月30日)
1.基金本期利润	-1,722,356,760.62
2.本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-299,613,479.85
3.加权平均份额本期利润	-0.9000
4.期末可供分配利润	-386,284,867.89
5.期末可供分配份额利润	-0.1981
6.期末基金资产净值	2,085,287,787.26
7.期末基金份额净值	1.0695
8.加权平均净值利润率	-58.71%
9.本期份额净值增长率	-45.20%
10.份额累计净值增长率	176.70%

(二)基金净值表现

1、长城久泰历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	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	-20.30%	3.21%	-20.58%	3.19%	0.28%	0.02%
过去三个月	-24.30%	3.11%	-24.33%	3.10%	0.03%	0.01%
过去六个月	-45.20%	2.92%	-44.50%	2.91%	-0.70%	0.01%
过去一年	-26.25%	2.50%	-22.97%	2.49%	-3.28%	0.01%
过去三年	241.35%	1.93%	212.79%	1.95%	28.56%	-0.02%
自基金合同@生效起至今	176.70%	1.77%	142.16%	1.79%	34.54%	-0.02%

2、长城久泰累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



附注:

(1)本基金合同约定:本基金投资于股票的比例为基金净资产的90~95%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金净资产的5%。

截止本报告披露时点,由于份额变动原因导致现金及到期日一年以内的政府债券投资市值的指标低于5%的基金合同约定标准外,其它各项资产配置比例符合基金合同约定,本基金基金经理将在相关法律规定的10个工作日内调整上述指标,使其达到基金合同规定的标准。

(2)本基金业绩比较基准的选择符合基金合同、基金招募说明书的规定。

第四节 管理人报告

(一)基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人简介

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第15家基金管理公司,由长城证券有限责任公司(40%)、东方证券股份有限公司(15%)、西北证券有限责任公司(15%)、北方国际信托投资股份有限公司(15%)、中原信托投资有限公司(15%)于2001年12月27日共同出资设立,当时注册资本为壹亿元人民币。2007年5月21日,经中国证监会批准,公司完成股权结构调整,现有股东为长城证券有限责任公司(47.059%)、东方证券股份有限公司(17.647%)、北方国际信托投资股份有限公司(17.647%)和中原信托有限公司(17.647%)。2007年10月12日,经中国证监会批准,将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。目前,公司管理的基金有封闭式基金:久嘉证券投资基金;开放式基金:长城久富核心成长股票型证券投资基金(LOF)、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金和长城品牌优选股票型证券投资基金。

2、基金经理简介

杨建华先生,北京大学力学系理学学士,北京大学光华管理学院经济学硕士,注册会计师。曾就职于华为技术有限公司财务部、长城证券有限责任公司投资银行部;2001年10月进入长城基金管理公司基金投资部任基金经理助理;自2004年5月21日"长城久泰中信标普300指数证券投资基金"基金合同生效至今任该基金基金经理;自2007年9月25日开始兼任"长城安心回报混合型证券投资基金"基金经理。

(二)基金运作遵规守信情况声明

本报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城久泰中信标普300指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制和防范风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大的利益,未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况,无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况,不存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期运作过程中曾出现投资组合指标被动偏离规定标准的情况,本基金管理人在规定的合理期限内进行了调整,有效地保护了基金持有人利益。

(三)公平交易专项说明

1、公平交易制度的执行情况

本报告期本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定,各基金在研究支持、投资决策上享有公平的机会。

公司严格执行了公平交易分配制度和公平交易程序,保证各基金获得了公平的交易机会。

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

本基金为增强指数型基金,投资风格与公司所管理的其他投资组合均不同。

3、异常交易行为的专项说明

本报告期公司内部风险控制和监察稽核工作中未发现异常交易行为,未发现直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

(四)投资策略和业绩表现说明及解释

本报告期内,国际国内经济形势错综复杂。国际上,不断攀升的油价触动着所有人的神经,美国次贷危机波及范围越来越大,对美国乃至全球经济和金融秩序的冲击都超出了大多数人的预期;再看国内,从紧的调控政策进一步引发了投资者对国内宏观经济的忧虑,加之突如其来的一月份南方冰雪灾害、"512"汶川特大地震灾害和六月份南方地区肆虐的洪涝灾害,更加重了投资者对经济前景的担忧,对上市公司盈利预期也愈发悲观,此外还有限售股解禁带来的短期供求失衡的预期,投资者信心受到多重打击,市场估值重心不断下移,尽管出现调降印花税利好刺激的反弹,但也不过是昙花一现。作为跟踪中信标普300指数为主的增强型指数基金,本基金在市场大幅度回落的情况下,净值也出现较大幅度的下降。面对大幅波动的市场、混乱的估值标准、难以把握的投资机会,本基金在操作策略上以跟踪目标指数、控制跟踪误差为主,较少进行增强操作。

本报告期内,中信标普300指数涨幅为-46.37%,本基金比较基准涨幅为-44.50%,本基金净值增长率为-45.20%,落后比较基准0.7%,本报告期日累计跟踪误差为0.0850%(年化指标为1.3162%)。

(五)宏观经济、证券市场及行业走势简要展望

尽管遇到了国内外诸多不确定性因素的困扰,上半年中国经济依然增长态势依旧,根据国家统计局公布的数据,上半年GDP增长为10.4%,继续保持平稳快速增长,CPI为7.9%,呈现逐月回落态势,因此,考虑到政府对国内外复杂形势把握能力的提高、综合运用各种经济手段日取成熟,我们有理由对下半年乃至未来数年国内经济继续充满信心,对经济增长的信心也必将逐步反应到资本市场层面,证券市场经过深幅调整后整体估值已经非常具有吸引力,如果国内宏观经济如我们预期的那样以更稳健、更可持续的增长速度前行,国际市场情况不再恶化,下半年证券市场将会有稳定的表现。我们将通过对基金合同的严格遵守,对跟踪误差的严格控制,将本基金打造成为供广大投资者对A股市场进行投资的良好工具。对长期看好中国宏观经济发展前景的人来说,投资于跟踪有代表性指数的指数基金依然是分享中国经济增长最好的投资选择之一,而"定期定额"("定投")无疑是对抗短期波动、获得长期收益的最佳投资方式。

第五节 托管人报告

托管人声明:在本报告期内,基金托管人不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内基金管理人在投资运作、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,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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。

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

第六节 财务会计报告(未经审计)

(一)长城久泰半年度财务报表

1、长城久泰2008年6月30日及2007年12月31日的比较式资产负债表

单位:人民币元

项目	2008年6月30日	2007年12月31日
资产:		
银行存款	82,070,419.61	171,879,161.15
结算备付金	2,508,457.96	12,900,478.71
存出保证金	881,936.07	2,600,367.62
交易性金融资产	1,983,272,198.01	3,485,948,990.91
其中:股票投资	1,979,545,977.61	3,484,343,091.33
债券投资	3,726,220.40	1,605,899.58
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	950,513.76	268,864.03
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	7,546,177.39	-
应收利息	42,976.22	55,916.54
应收股利	1,188,081.26	-
应收申购款	11,544,287.12	30,255,302.66
其他资产	-	-
合计	2,090,005,047.40	3,703,909,081.62
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	760,297.42	15,466,984.20
应付管理人报酬	1,979,180.77	2,765,233.98
应付托管费	403,914.46	564,333.47
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	890,884.57	3,220,812.40
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
其他负债	682,982.92	618,817.01
负债合计	4,717,260.14	22,636,181.06
所有者权益:		
实收基金	1,949,788,984.20	1,886,093,536.38
未分配利润	135,498,803.06	1,795,179,364.18
所有者权益合计	2,085,287,787.26	3,681,272,900.56
负债和所有者权益总计	2,090,005,047.40	3,703,909,081.62

附注:每基金份额净值　1.0695　1.9518

2、长城久泰本报告期及上年度可比期间的比较式利润表

单位:人民币元

项目	本期数	上年同期数
一、收入	-1,695,721,380.37	500,885,152.86
1.利息收入	949,828.48	445,122.15
其中:存款利息收入	945,046.56	443,388.64
债券利息收入	4,781.92	1,733.51
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-276,693,945.77	160,326,681.57
其中:股票投资收益	-296,688,351.41	149,723,223.41
债券投资收益	409,431.46	76,864.44
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	830,161.78	2,251,849.35
股利收益	18,754,812.4	8,274,744.37
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-1,422,743,280.77	338,931,207.26
4.其他收入(损失以"-"号填列)	2,766,017.69	1,182,141.88
二、费用	26,635,380.25	10,770,409.50
1、管理人报酬	14,358,907.76	5,029,464.55
2、托管费	2,930,389.35	1,026,421.32
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	9,162,460.15	4,529,469.36
5、利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6、其他费用	183,622.99	185,054.27
三、利润总额	-1,722,356,760.62	490,114,743.36

3、长城久泰本报告期及上年度可比期间的比较式所有者权益(基金净值)变动表

项目	本期数		
	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)	1,886,093,536.38	1,795,179,364.18	3,681,272,900.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-1,722,356,760.62	-1,722,356,760.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	63,695,447.82	62,676,199.50	126,371,647.32
其中:1.基金申购款	1,401,850,919.24	938,954,913.22	2,340,805,832.46
2.基金赎回款	1,338,155,471.42	876,278,713.72	2,214,434,185.14
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	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,949,788,984.20	135,498,803.06	2,085,287,787.26

项目	上年同期数		
	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)	228,735,502.44	230,105,864.16	458,841,366.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	490,114,743.36	490,114,743.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	280,317,982.74	624,350,109.67	904,668,092.41
其中:1.基金申购款	571,350,065.91	1,281,936,915.40	1,853,286,981.31
2.基金赎回款	291,032,083.17	657,586,805.73	948,618,888.90
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	-	-11,739,600.79	-11,739,600.79
五、期末所有者权益(基金净值)	509,053,485.18	1,332,831,116.40	1,841,884,601.58

(二)长城久泰半年度财务报表附注

货币单位:人民币元(特别说明除外)

附注1.半年度财务报表所采用的会计政策、会计估计与上年度财务报表相一致。

附注2.主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

基金买卖股票于2008年4月24日前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税,自2008年4月24日起按0.1%的税率缴纳。

基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

附注3.本报告期重大会计差错的内容和更正金额

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

附注4.关联方关系及交易

1.关联方关系

关联方名称	与本基金关系	发生的变化
长城基金管理有限公司	本基金管理人及发起人、本基金管理人主要股东控制的机构、本基金注册与登记机构、本基金销售机构	无
招商银行股份有限公司	本基金托管人、本基金销售机构	无
长城证券有限责任公司	本基金管理人的主要股东、租赁交易席位、本基金销售机构	无
东方证券股份有限公司	本基金管理人的股东、租赁交易席位、本基金销售机构	无
中原信托有限公司	本基金管理人的股东	无
北方国际信托投资股份有限公司	本基金管理人的股东	无
景顺长城基金管理有限公司	本基金管理人主要股东控制的机构	无

2. 关联方交易:

(1)本基金通过关联方席位进行的交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

关联方名称	项目	本期数		上年同期数	
		金额	占总额比例%	金额	占总额比例%
1.股票投资或交金额					
①长城证券有限责任公司	成交量	619,072,982.42	22.63	123,628,101.11	7.06
②东方证券股份有限公司	成交量	2,106,161,779.01	77.00	651,319,173.13	37.22
合计		2,725,234,761.43	99.63	774,947,274.24	44.28
2.债券投资或交金额					
①长城证券有限责任公司	成交量	607,424.96	9.80	---	---
②东方证券股份有限公司	成交量	---	---	---	---
合计		607,424.96	9.80	---	---
3.权证交易					
①长城证券责任有限公司	成交量	---	---	---	---
②东方证券股份有限公司	成交量	---	---	1,939,789.95	78.10
合计		---	---	1,939,789.95	78.10
4.支付的佣金					
①长城证券有限责任公司	支付佣金	502,998.90	21.85	96,739.94	6.83
②东方证券股份有限公司	支付佣金	1,790,235.36	77.78	534,083.23	37.70
合计		2,293,234.26	99.63	630,823.17	44.53

* 本基金对关联方席位交易佣金的计算方式及佣金比率与其他非关联方交易佣金的计算方式及佣金比率一致。

** 佣金协议的服务范围:

除进行证券交易外,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。

(2)本基金提取的关联方报酬

关联方名称	本期数	上年同期数	计算标准	计算方式
长城基金管理有限公司	14,358,907.76	5,029,464.55	年费率0.98%	按前一天基金资产净值乘以费率每天计提
招商银行股份有限公司	2,930,389.35	1,026,421.32	年费率2‰	
合计	17,289,297.11	6,055,885.87		

(3)与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内,无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

(4)各关联方投资本基金的情况

A.本基金管理人本期投资本基金的情况

本基金管理人本期及上期均未投资本基金,期末也未持有本基金份额。

B.基金管理人主要股东及其控制的机构在期末持有本基金份额的情况

本基金管理人主要股东及其控制的其它机构本期末未持有本基金。

(5)关联方保管的银行存款余额

关联方名称	项目	期末数	上年同期期末数
招商银行股份有限公司	银行存款	82,070,419.61	96,375,774.74

(6)从关联方取得的利息收入

关联方名称	项目	本期数	上年同期数
招商银行股份有限公司	存款利息收入	760,902.67	240,318.05

(7)关联方往来款项余额

往来项目	关联方名称	经济内容	期末数	上年同期期末数
应付管理人报酬	长城基金管理有限公司	管理费	1,979,180.77	1,530,862.77
应付托管费	招商银行股份有限公司	托管费	403,914.46	312,420.96
应付交易费用	长城证券有限责任公司	佣金	183,368.59	86,720.66
应付交易费用	东方证券股份有限公司	佣金	707,515.98	511,264.89
其他应付款	长城证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	250,000.00	250,000.00
其他应付款	西北证券有限责任公司	代垫席位交易保证金	-	250,000.00
应收利息	招商银行股份有限公司	存款利息	40,740.17	24,985.09
合计			3,564,719.97	2,966,254.37

附注5.流通受限制不能自由转让的基金资产

本基金截至2008年6月30日止流通受限制不能自由转让的基金资产如下:

(1)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	期末成本总额(元)	期末估值总额(元)
600027	华电国际	2008-6-30	重大事项	4.85	2008-7-1	4.85	520,289	4,656,110.53	2,523,401.65
600089	特变电工	2008-6-30	股东大会	14.96	2008-7-1	15.24	431,281	8,201,626.20	6,451,963.76
600096	云天化	2008-3-21	重大事项	61.60	-	-	119,645	6,254,237.91	7,370,132.00
600220	江苏阳光	2008-6-30	股东大会	6.50	2008-7-1	6.42	515,272	4,199,998.20	3,349,268.00
600269	赣粤高速	2008-6-30	股东大会	9.79	2008-7-1	9.85	309,003	5,247,010.24	3,025,139.37
600348	国阳新能	2008-6-30	股东大会	45.11	2008-7-1	45.59	113,456	6,579,672.10	5,118,000.16
600415	小商品城	2008-6-27	重大事项	92.50	2008-7-4	92.30	44,384	3,658,653.69	4,105,520.00
600628	新世界	2008-6-30	董事会	8.77	2008-7-1	8.82	256,660	4,051,005.01	2,250,908.20
600638	新黄浦	2008-6-30	股东大会	16.08	2008-7-1	16.10	244,944	5,698,827.99	3,938,699.52
600651	飞乐音响	2008-6-30	股东大会	6.23	2008-7-1	6.26	254,220	3,021,829.91	1,583,790.60
600655	豫园商城	2008-2-25	重大事项	32.44	2008-7-28	29.20	307,417	10,743,939.16	9,972,607.48
600811	东方集团	2008-6-30	股东大会	7.69	2008-7-1	7.80	473,231	9,811,768.91	3,639,146.39
600832	东方明珠	2008-6-30	股东大会	10.60	2008-7-1	10.78	541,037	9,337,430.51	5,734,992.20
600839	四川长虹	2008-6-30	股东大会	5.02	2008-7-1	5.06	740,436	6,437,485.31	3,716,988.72
600900	长江电力	2008-5-8	重大事项	14.65	-	-	2,777,723	51,965,334.43	40,693,641.95
000024	招商地产	2008-6-30	股东大会	14.94	2008-7-1	14.50	270,174	12,801,911.26	4,036,399.56
000060	中金岭南	2008-6-30	股东大会	14.02	2008-7-1	14.08	374,756	13,203,567.26	5,254,079.12
000089	深圳机场	2008-6-30	股东大会	6.13	2008-7-1	6.21	397,172	4,670,168.33	2,434,664.36
000422	湖北宜化	2008-6-30	股东大会	17.16	2008-7-1	17.47	294,963	6,181,382.45	5,061,565.08
000423	东阿阿胶	2008-6-30	股东大会	25.80	2008-7-1	25.87	252,470	7,490,573.93	6,513,726.00
000425	徐工科技	2008-6-13	重大事项	14.59	2008-7-25	15.98	252,349	5,676,593.75	3,681,771.91
000488	晨鸣纸业	2008-6-30	股东大会	10.40	2008-7-1	10.45	467,266	7,036,677.13	4,859,566.40
000528	柳工	2008-6-30	股东大会	19.25	2008-7-1	19.05	187,480	5,714,476.59	3,608,990.00
000751	锌业股份	2008-6-30	股东大会	5.75	2008-7-1	5.76	439,861	7,345,315.69	2,529,200.75
000792	盐湖钾肥	2008-6-26	重大事项	88.12	-	-	224,489	14,705,211.90	19,781,970.68
000897	津滨发展	2008-6-30	股东大会	4.80	2008-7-1	4.81	564,583	5,427,535.95	2,709,988.40

(2)因认购新发或增发证券而于期末持有的流通受限证券:

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	期末成本总额	期末估值总额
126016	08宝钢债	2008-6-20	2008-7-4	分离式可转债认购	76.27	75.08	49,630	3,785,373.14	3,726,220.40
580024	宝钢CWB1	2008-6-20	2008-7-4	分离式可转债认购	1.48	1.1970	794,080	1,177,626.86	950,513.76

第七节 投资组合报告

(一)期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益类投资	1,979,545,977.61	94.71
	其中:股票	1,979,545,977.61	94.71
2	固定收益类投资	3,726,220.40	0.18
	其中:债券	3,726,220.40	0.18
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	950,513.76	0.05
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	84,578,877.57	4.05
6	其他资产	21,203,458.06	1.01
7	合计	2,090,005,047.40	100.00

(二)期末按行业分类的股票投资组合

(1)本报告期末基金积极类股票投资按行业分类的投资组合:

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
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	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
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	-	-

(2)本报告期末基金指数类股票投资按行业分类的投资组合:

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,585,101.99	0.56
B	采掘业	219,089,624.77	10.51
C	制造业	570,364,001.55	27.36
C0	食品、饮料	83,543,127.68	4.01
C1	纺织、服装、皮毛	17,734,930.06	0.85
C2	木材、家具	979,158.20	0.05
C3	造纸、印刷	8,732,916.18	0.42
C4	石油、化学、塑胶、塑料	68,418,977.79	3.28
C5	电子	12,294,158.08	0.59
C6	金属、非金属	203,664,143.98	9.77
C7	机械、设备、仪表	125,395,393.18	6.01
C8	医药、生物制品	43,406,354.78	2.08
C99	其他制造业	6,194,841.62	0.30
D	电力、煤气及水的生产和供应业	105,417,734.66	5.06
E	建筑业	29,967,446.77	1.44
F	交通运输、仓储业	121,057,291.66	5.81
G	信息技术业	83,863,611.80	4.02
H	批发和零售贸易	81,355,554.19	3.90
I	金融、保险业	579,788,642.28	27.80
J	房地产业	97,753,657.45	4.69
K	社会服务业	32,203,757.66	1.54
L	传播与文化产业	7,219,618.78	0.35
M	综合类	39,879,934.05	1.91
	合计	1,979,545,977.61	94.93

(三)期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票明细

(1)本报告期末基金积极投资类股票投资前五名明细:

报告期末基金未持有积极投资类股票。

(2)本报告期末基金指数投资类股票投资前五名明细:

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末公允价值(元)	占基金资产净值比例%
1	601318	中国平安	2,159,121	106,358,300.46	5.10
2	601328	交通银行	9,366,214	70,059,280.72	3.36
3	600000	浦发银行	3,179,417	69,947,174.00	3.35
4	600030	中信证券	2,396,869	57,333,106.48	2.75
5	601398	工商银行	10,163,760	50,412,249.60	2.42

注:①以上股票名称以2008年6月30日公布的股票简称为准。

②投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于长城基金管理有限公司网站(www.ccfund.com.cn)的半年度报告正文。

(四)投资组合的重大变动

1、本报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前二十名股票明细如下:

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例(%)
1	601318	中国平安	143,369,693.11	3.89
2	601328	交通银行	82,653,514.36	2.25
3	601166	兴业银行	59,370,217.60	1.61
4	601088	中国神华	44,879,852.79	1.22
5	600030	中信证券	43,280,069.48	1.18
6	601628	中国人寿	40,838,625.68	1.11
7	600000	浦发银行	39,244,374.64	1.07
8	000002	万科A	37,252,291.91	1.01
9	601939	建设银行	30,159,673.71	0.82
10	600016	民生银行	29,026,737.54	0.79
11	601601	中国太保	28,744,657.86	0.78
12	601857	中国石油	27,335,741.24	0.74
13	601398	工商银行	25,662,953.92	0.70
14	601600	中国铝业	23,717,956.00	0.64
15	000001	深发展A	18,781,838.73	0.51
16	600050	中国联通	17,277,274.52	0.47
17	601006	大秦铁路	16,478,926.54	0.45
18	601898	中煤能源	15,803,576.99	0.43
19	600519	贵州茅台	14,272,192.09	0.39
20	600019	宝钢