

长盛成长价值证券投资基金

2011 年半年度报告

2011 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：2011 年 8 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 2011 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

|     |                                     |    |
|-----|-------------------------------------|----|
| 1.2 | 目录                                  |    |
| § 1 | 重要提示及目录                             | 1  |
| 1.1 | 重要提示                                | 1  |
| 1.2 | 目录                                  | 2  |
| § 2 | 基金简介                                | 4  |
| 2.1 | 基金基本情况                              | 4  |
| 2.2 | 基金产品说明                              | 4  |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人                         | 4  |
| 2.4 | 信息披露方式                              | 4  |
| 2.5 | 其他相关资料                              | 5  |
| § 3 | 主要财务指标和基金净值表现                       | 5  |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标                         | 5  |
| 3.2 | 基金净值表现                              | 5  |
| § 4 | 管理人报告                               | 7  |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况                        | 7  |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明              | 8  |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 8  |
| 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             | 8  |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 9  |
| 4.6 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 9  |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 10 |
| § 5 | 托管人报告                               | 11 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 11 |
| 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 | 11 |
| 5.3 | 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见      | 11 |
| § 6 | 半年度财务会计报告（未经审计）                     | 12 |
| 6.1 | 资产负债表                               | 12 |
| 6.2 | 利润表                                 | 13 |
| 6.3 | 所有者权益（基金净值）变动表                      | 14 |

|      |  |    |
|------|--|----|
| 6.4  | 报表附注.....                                  | 15 |
| § 7  | 投资组合报告.....                                | 30 |
| 7.1  | 期末基金资产组合情况.....                            | 30 |
| 7.2  | 期末按行业分类的股票投资组合.....                        | 30 |
| 7.3  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....         | 31 |
| 7.4  | 报告期内股票投资组合的重大变动.....                       | 32 |
| 7.5  | 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                      | 33 |
| 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...          | 34 |
| 7.7  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细<br>..... | 34 |
| 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...          | 34 |
| 7.9  | 投资组合报告附注.....                              | 34 |
| § 8  | 基金份额持有人信息.....                             | 36 |
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                     | 36 |
| 8.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....               | 36 |
| § 9  | 开放式基金份额变动.....                             | 36 |
| § 10 | 重大事件揭示.....                                | 37 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议.....                           | 37 |
| 10.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....           | 37 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....                | 37 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变.....                             | 37 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                      | 37 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....              | 37 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                     | 37 |
| 10.8 | 其他重大事件.....                                | 39 |
| § 11 | 备查文件目录.....                                | 40 |
| 11.1 | 备查文件目录.....                                | 40 |
| 11.2 | 存放地点.....                                  | 40 |
| 11.3 | 查阅方式.....                                  | 40 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 长盛成长价值证券投资基金       |
| 基金简称       | 长盛成长价值混合           |
| 基金主代码      | 080001             |
| 交易代码       | 080001             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2002年9月18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 | 1,072,649,092.78 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金为平衡型基金，通过管理人的积极管理，在控制风险的前提下挖掘价值、分享成长，谋求基金资产的长期稳定增值。   |
| 投资策略   | 本基金投资策略为主动性投资，在战略性资产、战术性资产、股票和债券选择三个层面进行积极配置，力争获得超过投资基准的业绩回报。在资产配置方面，股票资产比例为 35%-75%，债券资产比例为 20%-60%，现金资产比例不低于 5%。 |
| 业绩比较基准 | 中信标普 A 股综合指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%  |
| 风险收益特征 | 本基金属平衡型基金，在承担适度风险的前提下，获得长期稳定的收益。   |

### 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<br>负责人 | 姓名   | 叶金松                                  | 李芳菲  |
|             | 联系电话 | 010-82019988                         | 010-63201510   |
|             | 电子邮箱 | yejs@csfunds.com.cn                  | <a href="mailto:lifangfei@abchina.com">lifangfei@abchina.com</a> |
| 客户服务电话      |      | 400-888-2666、010-62350088            | 95599  |
| 传真          |      | 010-82255988                         | 010-63201816   |
| 注册地址        |      | 深圳市福田区福中三路 1006 号<br>诺德中心八楼 GH 单元    | 北京市东城区建国门内大街 69 号  |
| 办公地址        |      | 北京市海淀区北太平庄路 18 号<br>城建大厦 A 座 20-22 层 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号<br>凯晨世贸中心东座 F9                                 |
| 邮政编码        |      | 100088                               | 100031   |
| 法定代表人       |      | 凤良志                                  | 项俊波  |

### 2.4 信息披露方式

|                      |   |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》  |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a> |
| 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  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                             |
|--------|------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 长盛基金管理有限公司 | 北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层 |

## § 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(2011年1月1日至2011年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 124,264,434.15            |
| 本期利润          | -75,171,390.75            |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0687                   |
| 本期加权平均净值利润率   | -6.97%                    |
| 本期基金份额净值增长率   | -7.36%                    |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2011年6月30日)          |
| 期末可供分配利润      | -62,057,821.40            |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0579                   |
| 期末基金资产净值      | 1,010,591,271.38          |
| 期末基金份额净值      | 0.942                     |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2011年6月30日)          |
| 基金份额累计净值增长率   | 300.68%                   |

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。

### 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 | 1.51%    | 0.80%       | 1.77%      | 1.01%         | -0.26% | -0.21% |

|            |         |       |         |       |         |        |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|--------|
| 过去三个月      | -4.66%  | 0.77% | -5.04%  | 0.94% | 0.38%   | -0.17% |
| 过去六个月      | -7.36%  | 0.87% | -2.92%  | 1.01% | -4.44%  | -0.14% |
| 过去一年       | 17.36%  | 1.02% | 18.23%  | 1.11% | -0.87%  | -0.09% |
| 过去三年       | 33.93%  | 1.33% | 28.24%  | 1.60% | 5.69%   | -0.27% |
| 自基金合同生效起至今 | 300.68% | 1.28% | 105.02% | 1.52% | 195.66% | -0.24% |

注：本基金业绩比较基准=中信标普 A 股综合指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%

基准指数的构建考虑了三个原则：

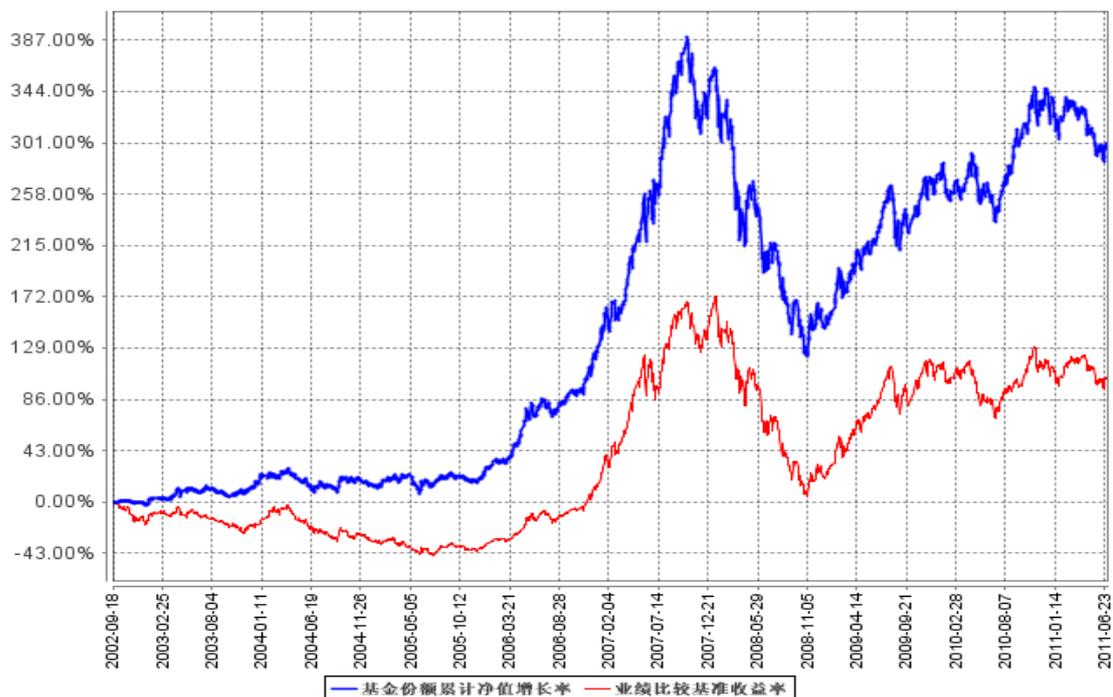
1、公允性。选择市场认同度比较高的中信标普 A 股综合指数和中信标普国债指数作为计算的基础指数。中信标普 A 股综合指数作为按流通股本加权的综合指数，其指数选股样本覆盖了上交所和深交所上市的所有 A 股，具有较强的指代作用。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金持有的股票资产比例为 35%-75%，债券资产比例为 20%-60%，现金资产比例不低于 5%。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 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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2011年6月30日，基金管理人共管理两支封闭式基金、十四支开放式基金（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<br>(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，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理，社保组合组合经理。 | 2010年1月27日           | —    | 9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经理助理，行业研究员，现任社保组合组合经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金（本基金）基金经理。             |
| 王宁  | 本基金基金经理，长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理，投资管理部总监。 | 2007年12月29日          | —    | 13年    | 男，1971年10月出生，中国国籍。毕业于北京大学光华管理学院，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理等职务。现任投资管理部总监，长盛成长价值证券投资基金（本基金）基金经理，长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理。 |

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解

聘日期；

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》的相关规定等。

#### **4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明**

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、《长盛成长价值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，在认真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**

2011年上半年，国际环境动荡不安，全球市场都剧烈波动。国内经济滞涨特征明显，增长乏力，通胀屡超预期，货币政策继续紧缩，市场整体表现黯淡，一季度震荡攀升之后，二季度阶梯式下行。中小盘成长股被持续挤泡沫，低估值蓝筹成长股、上游资源品等获得较好的相对收益。

在基金管理过程中，根据本基金的特点，坚持均衡加微调的操作策略，逐渐调整组合，优化配置。在大类资产方面，由于对紧缩政策和滞胀的担忧，我们对市场比较谨慎，股票配置比例保持在中性偏低水平；在行业和风格方面，遵守价值成长的组合设计原则，根据景气预期和市场估值的变化，向均衡方向调整。对品种选择，依旧坚持较为严格的选股标准和相对长期的价值判断，从壁垒、需求、转折等角度进行评估，

争取组合更可持续的生命力。

#### 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 0.942 元,本报告期份额净值增长率为-7.36%,同期业绩比较基准增长率为-2.92%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年下半年国际环境仍有较大不确定性,国内经济增速继续小幅回落,通胀触顶后可能长期维持较高水平,紧缩政策进入后期,预计市场仍将在反复的政策博弈中宽幅震荡。我们倾向于均衡配置,动态调整,重点关注资源、消费与成长,自下而上,优选竞争优势突出的子行业龙头,围绕转型与创新,不断评估新的市场环境下各个经济环节供求关系的变化,积极寻找兼具估值安全性和业绩成长性的投资品种。

本基金属于平衡型股票基金,长期关注具有低估值、高成长特征的行业及个股,将继续采取均衡加微调的操作策略,通过控制可能的组合下行风险,实际提高组合的长期累计收益增长率,坚持利用公开信息以及基本面和市场面相结合的策略,积极调整组合,保持组合的有效性,为基金份额持有人提供长期持续稳定回报。

#### 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**

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 2011 年 1 月 10 日对 2010 年度收益进行了利润分配，分配金额为 106,035,407.27 元。

本基金截至 2011 年 6 月 30 日，期末可供分配收益为-62,057,821.40 元，其中：未分配收益已实现部分为 282,870,350.15 元，未分配收益未实现部分为 -344,928,171.55 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

在托管长盛成长价值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《长盛成长价值证券投资基金基金合同》、《长盛成长价值证券投资基金托管协议》的约定，对长盛成长价值证券投资基金管理人——长盛基金管理有限公司 2011 年 1 月 1 日至 2011 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成长价值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成长价值证券投资基金半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：长盛成长价值证券投资基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

| 资 产                    | 附注号     | 本期末<br>2011年6月30日       | 上年度末<br>2010年12月31日     |
|------------------------|---------|-------------------------|-------------------------|
| <b>资 产：</b>            |         |                         |                         |
| 银行存款                   | 6.4.7.1 | 145,288,960.83          | 128,911,826.55          |
| 结算备付金                  |         | 380,777.24              | 1,367,724.73            |
| 存出保证金                  |         | 1,160,000.00            | 1,160,000.00            |
| 交易性金融资产                | 6.4.7.2 | 902,014,725.18          | 1,065,222,804.84        |
| 其中：股票投资                |         | 613,926,725.18          | 794,091,598.44          |
| 基金投资                   |         | -                       | -                       |
| 债券投资                   |         | 288,088,000.00          | 271,131,206.40          |
| 资产支持证券投资               |         | -                       | -                       |
| 衍生金融资产                 | 6.4.7.3 | -                       | -                       |
| 买入返售金融资产               | 6.4.7.4 | -                       | -                       |
| 应收证券清算款                |         | -                       | -                       |
| 应收利息                   | 6.4.7.5 | 3,445,653.95            | 3,788,625.56            |
| 应收股利                   |         | 268,898.64              | -                       |
| 应收申购款                  |         | 37,396.08               | 868,853.93              |
| 递延所得税资产                |         | -                       | -                       |
| 其他资产                   | 6.4.7.6 | -                       | -                       |
| <b>资产总计</b>            |         | <b>1,052,596,411.92</b> | <b>1,201,319,835.61</b> |
| <b>负 债 和 所 有 者 权 益</b> |         |                         |                         |
|                        | 附注号     | 本期末<br>2011年6月30日       | 上年度末<br>2010年12月31日     |
| <b>负 债：</b>            |         |                         |                         |
| 短期借款                   |         | -                       | -                       |
| 交易性金融负债                |         | -                       | -                       |
| 衍生金融负债                 | 6.4.7.3 | -                       | -                       |
| 卖出回购金融资产款              |         | -                       | -                       |
| 应付证券清算款                |         | 38,637,649.23           | 3,700,577.00            |
| 应付赎回款                  |         | 699,114.14              | 738,826.64              |
| 应付管理人报酬                |         | 1,225,160.66            | 1,624,818.54            |
| 应付托管费                  |         | 204,193.47              | 270,803.08              |
| 应付销售服务费                |         | -                       | -                       |
| 应付交易费用                 | 6.4.7.7 | 554,970.84              | 952,636.73              |
| 应交税费                   |         | 2,600.00                | 2,600.00                |

|                   |          |                         |                         |
|-------------------|----------|-------------------------|-------------------------|
| 应付利息              |          | -                       | -                       |
| 应付利润              |          | -                       | -                       |
| 递延所得税负债           |          | -                       | -                       |
| 其他负债              | 6.4.7.8  | 681,452.20              | 593,079.44              |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>42,005,140.54</b>    | <b>7,883,341.43</b>     |
| <b>所有者权益：</b>     |          |                         |                         |
| 实收基金              | 6.4.7.9  | 1,072,649,092.78        | 1,069,771,685.47        |
| 未分配利润             | 6.4.7.10 | -62,057,821.40          | 123,664,808.71          |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>1,010,591,271.38</b> | <b>1,193,436,494.18</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>1,052,596,411.92</b> | <b>1,201,319,835.61</b> |

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值：0.942元，基金份额总额：1,072,649,092.78份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛成长价值证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2011年1月1日至<br>2011年6月30日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至<br>2010年6月30日 |
|------------------------|------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| <b>一、收入</b>            |            | <b>-62,722,525.68</b>          | <b>-91,324,784.37</b>               |
| 1. 利息收入                |            | 4,894,282.89                   | 3,894,758.60                        |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.11   | 487,593.99                     | 465,510.61                          |
| 债券利息收入                 |            | 4,406,688.90                   | 3,429,247.99                        |
| 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）      |            | 131,609,700.36                 | 66,894,407.18                       |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.12   | 129,216,093.60                 | 64,736,861.03                       |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.13   | -1,223,441.90                  | -542,790.83                         |
| 资产支持证券投资收益             |            | -                              | -                                   |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.14   | -                              | -                                   |
| 股利收益                   | 6.4.7.15   | 3,617,048.66                   | 2,700,336.98                        |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16   | -199,435,824.90                | -162,320,807.20                     |
| 4. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.17   | 209,315.97                     | 206,857.05                          |
| <b>减：二、费用</b>          |            | <b>12,448,865.07</b>           | <b>13,154,874.02</b>                |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 8,046,781.21                   | 8,414,863.35                        |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 1,341,130.17                   | 1,402,477.18                        |
| 3. 销售服务费               |            | -                              | -                                   |
| 4. 交易费用                | 6.4.7.18   | 2,873,251.58                   | 3,154,421.38                        |

|                          |             |                          |                           |
|--------------------------|-------------|--------------------------|---------------------------|
| 5. 利息支出                  |             | -                        | -                         |
| 其中：卖出回购金融资产支出            |             | -                        | -                         |
| 6. 其他费用                  | 6. 4. 7. 19 | 187, 702. 11             | 183, 112. 11              |
| <b>三、利润总额</b>            |             | <b>-75, 171, 390. 75</b> | <b>-104, 479, 658. 39</b> |
| 减：所得税费用                  |             | -                        | -                         |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b> |             | <b>-75, 171, 390. 75</b> | <b>-104, 479, 658. 39</b> |

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛成长价值证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

| 项 目                                    | 本期<br>2011年1月1日至2011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）                        | 1, 069, 771, 685. 47            | 123, 664, 808. 71         | 1, 193, 436, 494. 18        |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | -75, 171, 390. 75         | -75, 171, 390. 75           |
| 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）      | 2, 877, 407. 31                 | -4, 515, 832. 09          | -1, 638, 424. 78            |
| 其中：1. 基金申购款                            | 168, 442, 879. 56               | -2, 620, 326. 48          | 165, 822, 553. 08           |
| 2. 基金赎回款                               | -165, 565, 472. 25              | -1, 895, 505. 61          | -167, 460, 977. 86          |
| 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） | -                               | -106, 035, 407. 27        | -106, 035, 407. 27          |
| <b>五、期末所有者权益（基金净值）</b>                 | <b>1, 072, 649, 092. 78</b>     | <b>-62, 057, 821. 40</b>  | <b>1, 010, 591, 271. 38</b> |
| 项 目                                    | 上年度可比期间<br>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）                        | 1, 289, 141, 169. 44            | -42, 334, 763. 10         | 1, 246, 806, 406. 34        |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                               | -104, 479, 658. 39        | -104, 479, 658. 39          |
| 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）      | -95, 891, 758. 13               | 5, 228, 647. 39           | -90, 663, 110. 74           |
| 其中：1. 基金申购款                            | 71, 886, 836. 08                | -4, 671, 319. 93          | 67, 215, 516. 15            |
| 2. 基金赎回款                               | -167, 778, 594. 21              | 9, 899, 967. 32           | -157, 878, 626. 89          |
| 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） | -                               | -                         | -                           |
| <b>五、期末所有者权益（基金净值）</b>                 | <b>1, 193, 249, 411. 31</b>     | <b>-141, 585, 774. 10</b> | <b>1, 051, 663, 637. 21</b> |

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：

周 兵

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 基金基本情况

长盛成长价值证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2002]第57号《关于同意长盛成长价值证券投资基金设立的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《长盛成长价值证券投资基金基金契约》(后更名为《长盛成长价值证券投资基金基金合同》)发起,并于2002年9月18日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,166,886,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第95号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛成长价值证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票资产比例为35%-75%,债券资产比例为20%-60%,现金资产比例不低于5%。本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%,投资于权证的比例不得超过基金资产净值的3%。股票投资在成长和价值类资产中根据市值大小在大盘成长、中盘成长、小盘成长、大盘价值、中盘价值和小盘价值六类资产间进行二次配置,具体配置比例限制如下表所示:

|       | 投资下限 | 投资上限 |       | 投资下限 | 投资上限 |
|-------|------|------|-------|------|------|
| 大盘成长  | 5%   | 40%  | 大盘价值  | 5%   | 40%  |
| 中盘成长  | 5%   | 50%  | 中盘价值  | 5%   | 50%  |
| 小盘成长  | 5%   | 40%  | 小盘价值  | 5%   | 40%  |
| 成长类合计 | 30%  | 70%  | 价值类合计 | 30%  | 70%  |

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《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>》、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》、《长盛成长价值证券投

资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明：本报告期不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明：本报告期不存在会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明：本报告期不存在差错更正。

#### 6.4.6 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]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、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。
- 2、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。
- 3、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。

4、基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2011 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 145,288,960.83         |

|           |                       |
|-----------|-----------------------|
| 定期存款      | -                     |
| 其他存款      | -                     |
| <b>合计</b> | <b>145,288,960.83</b> |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2011年6月30日     |                       |                     |
|-----------|-----------------------|-----------------------|---------------------|
|           | 成本                    | 公允价值                  | 公允价值变动              |
| 股票        | 600,493,734.91        | 613,926,725.18        | 13,432,990.27       |
| 债券        | 交易所市场                 | -                     | -                   |
|           | 银行间市场                 | 291,623,760.00        | 288,088,000.00      |
|           | 合计                    | 291,623,760.00        | 288,088,000.00      |
| 资产支持证券    | -                     | -                     | -                   |
| 基金        | -                     | -                     | -                   |
| 其他        | -                     | -                     | -                   |
| <b>合计</b> | <b>892,117,494.91</b> | <b>902,014,725.18</b> | <b>9,897,230.27</b> |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2011年6月30日   |
|------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 15,698.98           |
| 应收定期存款利息   | -                   |
| 应收其他存款利息   | -                   |
| 应收结算备付金利息  | 154.17              |
| 应收债券利息     | 3,429,735.83        |
| 应收买入返售证券利息 | -                   |
| 应收申购款利息    | 0.17                |
| 其他         | 64.80               |
| <b>合计</b>  | <b>3,445,653.95</b> |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2011年6月30日 |
|----|-------------------|
|----|-------------------|

|             |            |
|-------------|------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 553,945.84 |
| 银行间市场应付交易费用 | 1,025.00   |
| 合计          | 554,970.84 |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2011年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 500,000.00        |
| 应付赎回费       | 2,635.09          |
| 预提费用        | 178,522.11        |
| 其他          | 295.00            |
| 合计          | 681,452.20        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |                  |
|---------------|----------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,069,771,685.47           | 1,069,771,685.47 |
| 本期申购          | 168,442,879.56             | 168,442,879.56   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -165,565,472.25            | -165,565,472.25  |
| 本期末           | 1,072,649,092.78           | 1,072,649,092.78 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | 268,764,985.02  | -145,100,176.31 | 123,664,808.71  |
| 本期利润           | 124,264,434.15  | -199,435,824.90 | -75,171,390.75  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,123,661.75   | -392,170.34     | -4,515,832.09   |
| 其中：基金申购款       | 34,872,633.09   | -37,492,959.57  | -2,620,326.48   |
| 基金赎回款          | -38,996,294.84  | 37,100,789.23   | -1,895,505.61   |
| 本期已分配利润        | -106,035,407.27 | -               | -106,035,407.27 |
| 本期末            | 282,870,350.15  | -344,928,171.55 | -62,057,821.40  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 475,229.11                 |
| 定期存款利息收入  | -                          |
| 其他存款利息收入  | -                          |
| 结算备付金利息收入 | 9,949.31                   |

|    |            |
|----|------------|
| 其他 | 2,415.57   |
| 合计 | 487,593.99 |

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 979,987,345.19             |
| 减：卖出股票成本总额 | 850,771,251.59             |
| 买卖股票差价收入   | 129,216,093.60             |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 218,633,142.43             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 212,644,399.90             |
| 减：应收利息总额                | 7,212,184.43               |
| 债券投资收益                  | -1,223,441.90              |

#### 6.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本期未取得衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 3,617,048.66               |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 3,617,048.66               |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -199,435,824.90            |
| ——股票投资     | -199,796,948.40            |
| ——债券投资     | 361,123.50                 |
| ——资产支持证券投资 | -                          |
| ——基金投资     | -                          |
| 2. 衍生工具    | -                          |
| ——权证投资     | -                          |
| 3. 其他      | -                          |
| 合计         | -199,435,824.90            |

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 209,119.60           |
| 基金转换费收入 | 196.37               |
| 合计      | 209,315.97           |

注：1、基金的赎回费率为赎回金额的0.5%，赎回费总额的25%归入基金资产。

2、本基金的转换费总额的25%归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 2,871,676.58         |
| 银行间市场交易费用 | 1,575.00             |
| 合计        | 2,873,251.58         |

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| 审计费用      | 44,630.98            |
| 信息披露费     | 133,891.13           |
| 债券托管账户维护费 | 9,000.00             |
| 银行划款手续费   | 180.00               |
| 合计        | 187,702.11           |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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、注册登记机构、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 |
|------|-----------------|

#### 6.4.10 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。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010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  | 1,207,180,110.15           | 65.24%       | 990,741,281.74                  | 49.66%       |

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年6月30日 |              |
|-------|----------------------------|--------------|---------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                            | 占当期债券成交总额的比例 |
| 国元证券  | 32,529,038.00              | 100.00%      | -                               | -            |

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2011年1月1日至2011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   | 占期末应付佣金总量的比例 |
| 国元证券  | 1,026,103.39                    | 66.26%     | 358,328.26 | 64.69%       |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>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   | 占期末应付佣金总量的比例 |
| 国元证券  | 842,122.60                      | 50.40%     | 557,803.02 | 66.83%       |

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和经手费后的净额列示。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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                  | 2011年1月1日至2011年6月30日 | 2010年1月1日至2010年6月30日 |
|------------------|----------------------|----------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 8,046,781.21         | 8,414,863.35         |
| 其中：支付给销售机构的客户维护费 | 1,480,621.31         | 1,184,997.94         |

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2011年1月1日至2011年6月30日 | 2010年1月1日至2010年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,341,130.17         | 1,402,477.18         |

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。

#### 6.4.10.3 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(2011年1月1日至2011年6月30日)及比较期内(2010年1月1日至2010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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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                   | 上年度可比期间              |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
|                            | 2011年1月1日至2011年6月30日 | 2010年1月1日至2010年6月30日 |
| 基金合同生效日(2002年9月18日)持有的基金份额 | -                    | -                    |
| 期初持有的基金份额                  | 14,109,387.26        | 14,109,387.26        |
| 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                  | 14,109,387.26        | 14,109,387.26        |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例          | 1.32%                | 1.18%                |

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

#### 6.4.10.4.2 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

本基金其他关联方及其控制的机构于本报告期末（2011年6月30日）及上年度末（2010年12月31日）均未投资基金份额。

#### 6.4.10.5 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<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |            | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010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 | 145,288,960.83             | 475,229.11 | 148,445,466.97                  | 454,842.15 |

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。

#### 6.4.10.6 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（2011年1月1日至2011年6月30日）及比较期内（2010年1月1日至2010年6月30日）未参与关联方承销证券交易。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明：无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日     | 除息日       | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额     | 本期利润分配合计       |
|----|-----------|-----------|-------------|---------------|---------------|----------------|
| 1  | 2011-1-10 | 2011-1-10 | 1.000       | 74,665,086.03 | 31,370,321.24 | 106,035,407.27 |
| 合计 | -         | -         | 1.000       | 74,665,086.03 | 31,370,321.24 | 106,035,407.27 |

#### 6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动

中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与金融工程部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与金融工程部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面

来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.7 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整

投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2011年6月30日   | 6个月以内                 | 6个月至1年                | 1至5年                 | 不计息                   | 合计                      |
|---------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------|
| <b>资产</b>           |                       |                       |                      |                       |                         |
| 银行存款                | 145,288,960.83        | -                     | -                    | -                     | 145,288,960.83          |
| 结算备付金               | 380,777.24            | -                     | -                    | -                     | 380,777.24              |
| 存出保证金               | 160,000.00            | -                     | -                    | 1,000,000.00          | 1,160,000.00            |
| 交易性金融资产             | 238,338,000.00        | -                     | 49,750,000.00        | 613,926,725.18        | 902,014,725.18          |
| 应收利息                | -                     | -                     | -                    | 3,445,653.95          | 3,445,653.95            |
| 应收股利                | -                     | -                     | -                    | 268,898.64            | 268,898.64              |
| 应收申购款               | -                     | -                     | -                    | 37,396.08             | 37,396.08               |
| <b>资产总计</b>         | <b>384,167,738.07</b> | <b>-</b>              | <b>49,750,000.00</b> | <b>618,678,673.85</b> | <b>1,052,596,411.92</b> |
| <b>负债</b>           |                       |                       |                      |                       |                         |
| 应付证券清算款             | -                     | -                     | -                    | 38,637,649.23         | 38,637,649.23           |
| 应付赎回款               | -                     | -                     | -                    | 699,114.14            | 699,114.14              |
| 应付赎回费               | -                     | -                     | -                    | 2,635.09              | 2,635.09                |
| 应付管理人报酬             | -                     | -                     | -                    | 1,225,160.66          | 1,225,160.66            |
| 应付托管费               | -                     | -                     | -                    | 204,193.47            | 204,193.47              |
| 应付交易费用              | -                     | -                     | -                    | 554,970.84            | 554,970.84              |
| 应付税费                | -                     | -                     | -                    | 2,600.00              | 2,600.00                |
| 其他负债                | -                     | -                     | -                    | 678,817.11            | 678,817.11              |
| <b>负债总计</b>         | <b>-</b>              | <b>-</b>              | <b>-</b>             | <b>42,005,140.54</b>  | <b>42,005,140.54</b>    |
| <b>利率敏感度缺口</b>      | <b>384,167,738.07</b> | <b>-</b>              | <b>49,750,000.00</b> | <b>576,673,533.31</b> | <b>1,010,591,271.38</b> |
| 上年度末<br>2010年12月31日 | 6个月以内                 | 6个月至1年                | 1至5年                 | 不计息                   | 合计                      |
| <b>资产</b>           |                       |                       |                      |                       |                         |
| 银行存款                | 128,911,826.55        | -                     | -                    | -                     | 128,911,826.55          |
| 结算备付金               | 1,367,724.73          | -                     | -                    | -                     | 1,367,724.73            |
| 存出保证金               | 160,000.00            | -                     | -                    | 1,000,000.00          | 1,160,000.00            |
| 交易性金融资产             | 118,966,000.00        | 101,482,206.40        | 50,683,000.00        | 794,091,598.44        | 1,065,222,804.84        |
| 应收利息                | -                     | -                     | -                    | 3,788,625.56          | 3,788,625.56            |
| 应收申购款               | 99.40                 | -                     | -                    | 868,754.53            | 868,853.93              |
| <b>资产总计</b>         | <b>249,405,650.68</b> | <b>101,482,206.40</b> | <b>50,683,000.00</b> | <b>799,748,978.53</b> | <b>1,201,319,835.61</b> |
| <b>负债</b>           |                       |                       |                      |                       |                         |
| 应付证券清算款             | -                     | -                     | -                    | 3,700,577.00          | 3,700,577.00            |
| 应付赎回款               | -                     | -                     | -                    | 738,826.64            | 738,826.64              |

|                |                       |                       |                      |                       |                         |
|----------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------|
| 应付管理人报酬        | -                     | -                     | -                    | 1,624,818.54          | 1,624,818.54            |
| 应付托管费          | -                     | -                     | -                    | 270,803.08            | 270,803.08              |
| 应付交易费用         | -                     | -                     | -                    | 952,636.73            | 952,636.73              |
| 应付税费           | -                     | -                     | -                    | 2,600.00              | 2,600.00                |
| 其他负债           | -                     | -                     | -                    | 593,079.44            | 593,079.44              |
| <b>负债总计</b>    | -                     | -                     | -                    | <b>7,883,341.43</b>   | <b>7,883,341.43</b>     |
| <b>利率敏感度缺口</b> | <b>249,405,650.68</b> | <b>101,482,206.40</b> | <b>50,683,000.00</b> | <b>791,865,637.10</b> | <b>1,193,436,494.18</b> |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                              |                     |
|----|--------------------|------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对期末基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币万元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2011年6月30日            | 上年度末<br>2010年12月31日 |
|    | 市场利率下降25个基点        | 增加约49                        | 增加约60               |
|    | 市场利率上升25个基点        | 下降约49                        | 下降约60               |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产比例为基金总资产的35%-75%，债券资产比例为20%-60%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度

量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项 目          | 本期末<br>2011年6月30日 |               | 上年度末<br>2010年12月31日 |               |
|--------------|-------------------|---------------|---------------------|---------------|
|              | 公允价值              | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 613,926,725.18    | 60.75         | 794,091,598.44      | 66.54         |
| 衍生金融资产—权证投资  | -                 | -             | -                   | -             |
| 合计           | 613,926,725.18    | 60.75         | 794,091,598.44      | 66.54         |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                              |                     |
|----|----------------------|------------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对期末基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币万元) |                     |
|    |                      | 本期末<br>2011年6月30日            | 上年度末<br>2010年12月31日 |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 增加约 3,773                    | 增加约 4,531           |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | 下降约 3,773                    | 下降约 4,531           |

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项：

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具为交易性金融资产和衍生金融资产，其中属于第一层级的余额为 613,926,725.18 元，属于第二层级的余额为 288,088,000.00 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级

806,629,804.84 元，第二层级 258,593,000.00 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2010 年度可比期间：同)。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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              | 613,926,725.18   | 58.32         |
|    | 其中：股票             | 613,926,725.18   | 58.32         |
| 2  | 固定收益投资            | 288,088,000.00   | 27.37         |
|    | 其中：债券             | 288,088,000.00   | 27.37         |
|    | 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      | 145,669,738.07   | 13.84         |
| 6  | 其他各项资产            | 4,911,948.67     | 0.47          |
| 7  | 合计                | 1,052,596,411.92 | 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       | 5,016,378.48   | 0.50          |
| B   | 采掘业            | 37,779,933.44  | 3.74          |
| C   | 制造业            | 359,287,126.22 | 35.55         |
| C0  | 食品、饮料          | 14,010,000.00  | 1.39          |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 14,584,000.00  | 1.44          |
| C2  | 木材、家具          | -              | -             |
| C3  | 造纸、印刷          | -              | -             |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 61,600,057.35  | 6.10          |
| C5  | 电子             | 46,387,210.24  | 4.59          |
| C6  | 金属、非金属         | 120,591,802.78 | 11.93         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 41,817,674.90  | 4.14          |
| C8  | 医药、生物制品        | 60,296,380.95  | 5.97          |
| C99 | 其他制造业          | -              | -             |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 8,971,498.32   | 0.89          |
| E   | 建筑业            | 32,075,307.96  | 3.17          |
| F   | 交通运输、仓储业       | -              | -             |
| G   | 信息技术业          | 48,692,847.81  | 4.82          |
| H   | 批发和零售贸易        | 31,832,996.64  | 3.15          |
| I   | 金融、保险业         | 46,229,494.20  | 4.57          |
| J   | 房地产业           | 40,709,142.11  | 4.03          |
| K   | 社会服务业          | -              | -             |

|   |         |                |       |
|---|---------|----------------|-------|
| L | 传播与文化产业 | -              | -     |
| M | 综合类     | 3,332,000.00   | 0.33  |
|   | 合计      | 613,926,725.18 | 60.75 |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 600267 | 海正药业 | 1,000,000 | 37,340,000.00 | 3.69         |
| 2  | 600111 | 包钢稀土 | 400,000   | 28,572,000.00 | 2.83         |
| 3  | 601601 | 中国太保 | 1,124,988 | 25,188,481.32 | 2.49         |
| 4  | 600050 | 中国联通 | 4,500,000 | 23,625,000.00 | 2.34         |
| 5  | 601166 | 兴业银行 | 1,560,906 | 21,041,012.88 | 2.08         |
| 6  | 000623 | 吉林敖东 | 673,495   | 20,750,380.95 | 2.05         |
| 7  | 600172 | 黄河旋风 | 1,295,412 | 20,597,050.80 | 2.04         |
| 8  | 600170 | 上海建工 | 1,249,924 | 19,486,315.16 | 1.93         |
| 9  | 600409 | 三友化工 | 1,600,000 | 18,560,000.00 | 1.84         |
| 10 | 600176 | 中国玻纤 | 599,939   | 18,130,156.58 | 1.79         |
| 11 | 600208 | 新湖中宝 | 2,800,000 | 17,444,000.00 | 1.73         |
| 12 | 600549 | 厦门钨业 | 399,930   | 16,569,099.90 | 1.64         |
| 13 | 000708 | 大冶特钢 | 1,001,145 | 15,327,529.95 | 1.52         |
| 14 | 600060 | 海信电器 | 1,100,000 | 14,762,000.00 | 1.46         |
| 15 | 000501 | 鄂武商A | 859,410   | 14,678,722.80 | 1.45         |
| 16 | 600259 | 广晟有色 | 200,000   | 14,584,000.00 | 1.44         |
| 17 | 600809 | 山西汾酒 | 200,000   | 14,010,000.00 | 1.39         |
| 18 | 002001 | 新和成  | 475,299   | 13,997,555.55 | 1.39         |
| 19 | 000528 | 柳工   | 599,964   | 13,577,185.32 | 1.34         |
| 20 | 600403 | 大有能源 | 422,701   | 13,238,995.32 | 1.31         |
| 21 | 000926 | 福星股份 | 1,102,463 | 13,196,482.11 | 1.31         |
| 22 | 000725 | 京东方A | 4,799,998 | 13,103,994.54 | 1.30         |
| 23 | 600496 | 精工钢构 | 999,920   | 12,588,992.80 | 1.25         |
| 24 | 000983 | 西山煤电 | 499,909   | 12,097,797.80 | 1.20         |
| 25 | 600571 | 信雅达  | 999,903   | 11,828,852.49 | 1.17         |
| 26 | 000822 | 山东海化 | 1,099,953 | 11,659,501.80 | 1.15         |
| 27 | 000968 | 煤气化  | 413,208   | 10,466,558.64 | 1.04         |
| 28 | 600741 | 华域汽车 | 937,858   | 10,438,359.54 | 1.03         |
| 29 | 000937 | 冀中能源 | 400,000   | 10,140,000.00 | 1.00         |
| 30 | 000024 | 招商地产 | 550,200   | 10,068,660.00 | 1.00         |
| 31 | 600096 | 云天化  | 500,000   | 9,945,000.00  | 0.98         |
| 32 | 000778 | 新兴铸管 | 938,101   | 9,896,965.55  | 0.98         |
| 33 | 002484 | 江海股份 | 399,970   | 9,523,285.70  | 0.94         |
| 34 | 600861 | 北京城乡 | 937,592   | 9,160,273.84  | 0.91         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 35 | 002179 | 中航光电 | 399,908 | 8,997,930.00 | 0.89 |
| 36 | 601139 | 深圳燃气 | 856,059 | 8,971,498.32 | 0.89 |
| 37 | 000418 | 小天鹅A | 499,944 | 8,029,100.64 | 0.79 |
| 38 | 600859 | 王府井  | 200,000 | 7,994,000.00 | 0.79 |
| 39 | 000404 | 华意压缩 | 999,991 | 7,399,933.40 | 0.73 |
| 40 | 000786 | 北新建材 | 400,000 | 6,364,000.00 | 0.63 |
| 41 | 600117 | 西宁特钢 | 500,000 | 5,135,000.00 | 0.51 |
| 42 | 000933 | 神火股份 | 333,700 | 5,075,577.00 | 0.50 |
| 43 | 600251 | 冠农股份 | 151,278 | 5,016,378.48 | 0.50 |
| 44 | 600486 | 扬农化工 | 200,000 | 4,348,000.00 | 0.43 |
| 45 | 000540 | 中天城投 | 200,000 | 3,332,000.00 | 0.33 |
| 46 | 002263 | 大东南  | 300,000 | 3,090,000.00 | 0.31 |
| 47 | 601766 | 中国南车 | 333,300 | 2,373,096.00 | 0.23 |
| 48 | 600079 | 人福医药 | 100,000 | 2,206,000.00 | 0.22 |

#### 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比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 600172 | 黄河旋风 | 26,527,533.89 | 2.22            |
| 2  | 600050 | 中国联通 | 25,204,974.90 | 2.11            |
| 3  | 600170 | 上海建工 | 22,437,804.93 | 1.88            |
| 4  | 000926 | 福星股份 | 21,128,838.88 | 1.77            |
| 5  | 000623 | 吉林敖东 | 20,662,038.75 | 1.73            |
| 6  | 600176 | 中国玻纤 | 18,619,585.89 | 1.56            |
| 7  | 601006 | 大秦铁路 | 17,396,959.42 | 1.46            |
| 8  | 000877 | 天山股份 | 17,392,589.00 | 1.46            |
| 9  | 600380 | 健康元  | 16,887,909.59 | 1.42            |
| 10 | 600409 | 三友化工 | 16,683,364.15 | 1.40            |
| 11 | 600581 | 八一钢铁 | 16,425,700.25 | 1.38            |
| 12 | 601166 | 兴业银行 | 16,338,920.31 | 1.37            |
| 13 | 600425 | 青松建化 | 16,122,376.48 | 1.35            |
| 14 | 000501 | 鄂武商A | 16,047,949.32 | 1.34            |
| 15 | 600060 | 海信电器 | 15,988,812.62 | 1.34            |
| 16 | 600765 | 中航重机 | 15,820,377.12 | 1.33            |
| 17 | 600782 | 新钢股份 | 15,786,967.39 | 1.32            |
| 18 | 600208 | 新湖中宝 | 15,757,642.35 | 1.32            |
| 19 | 600403 | 大有能源 | 15,387,007.27 | 1.29            |
| 20 | 600259 | 广晟有色 | 15,263,556.00 | 1.28            |

##### 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  | 000895 | 双汇发展 | 48,430,126.83 | 4.06            |
| 2  | 600406 | 国电南瑞 | 39,884,601.18 | 3.34            |
| 3  | 600458 | 时代新材 | 38,881,613.31 | 3.26            |
| 4  | 601299 | 中国北车 | 32,185,851.19 | 2.70            |
| 5  | 600496 | 精工钢构 | 26,729,580.49 | 2.24            |
| 6  | 000401 | 冀东水泥 | 25,569,671.17 | 2.14            |
| 7  | 600549 | 厦门钨业 | 23,529,899.45 | 1.97            |
| 8  | 000581 | 威孚高科 | 22,232,766.23 | 1.86            |
| 9  | 600712 | 南宁百货 | 20,690,217.69 | 1.73            |
| 10 | 600664 | 哈药股份 | 20,418,016.02 | 1.71            |
| 11 | 000425 | 徐工机械 | 20,381,076.94 | 1.71            |
| 12 | 600267 | 海正药业 | 20,251,095.74 | 1.70            |
| 13 | 600525 | 长园集团 | 19,500,125.81 | 1.63            |
| 14 | 600280 | 南京中商 | 19,200,186.48 | 1.61            |
| 15 | 600500 | 中化国际 | 18,818,077.59 | 1.58            |
| 16 | 600765 | 中航重机 | 18,577,221.27 | 1.56            |
| 17 | 600380 | 健康元  | 17,585,598.82 | 1.47            |
| 18 | 600096 | 云天化  | 16,695,958.05 | 1.40            |
| 19 | 601006 | 大秦铁路 | 16,527,195.13 | 1.38            |
| 20 | 600581 | 八一钢铁 | 15,586,318.09 | 1.31            |

#### 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 | 870,403,326.73 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 979,987,345.19 |

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      | -              | -             |
| 2  | 央行票据      | 129,015,000.00 | 12.77         |
| 3  | 金融债券      | 159,073,000.00 | 15.74         |
|    | 其中：政策性金融债 | 159,073,000.00 | 15.74         |
| 4  | 企业债券      | -              | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -             |
| 6  | 中期票据      | -              | -             |
| 7  | 可转债       | -              | -             |

|   |    |                |       |
|---|----|----------------|-------|
| 8 | 其他 | -              | -     |
| 9 | 合计 | 288,088,000.00 | 28.51 |

#### 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（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 1101023 | 11 央行票据 23 | 800,000 | 79,400,000.00 | 7.86         |
| 2  | 080221  | 08 国开 21   | 700,000 | 69,559,000.00 | 6.88         |
| 3  | 080308  | 08 进出 08   | 500,000 | 49,750,000.00 | 4.92         |
| 4  | 1101029 | 11 央行票据 29 | 500,000 | 49,615,000.00 | 4.91         |
| 5  | 080207  | 08 国开 07   | 400,000 | 39,764,000.00 | 3.93         |

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,160,000.00 |
| 2  | 应收证券清算款 |              |
| 3  | 应收股利    | 268,898.64   |
| 4  | 应收利息    | 3,445,653.95 |
| 5  | 应收申购款   | 37,396.08    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,911,948.67 |

#### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### **7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### **7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构          |        |                |        |
|----------|-----------|----------------|--------|----------------|--------|
|          |           | 机构投资者          |        | 个人投资者          |        |
|          |           | 持有份额           | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 91,334   | 11,744.25 | 121,884,015.08 | 11.36% | 950,765,077.70 | 88.64% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目                   | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|----------------------|-----------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 30,953.31 | 0.00%    |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2002年9月18日)基金份额总额 | 3,166,886,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 1,069,771,685.47 |
| 本报告期基金总申购份额               | 168,442,879.56   |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 165,565,472.25   |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -                |
| 本报告期期末基金份额总额              | 1,072,649,092.78 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本基金管理人于 2011 年 5 月 14 日发布公告，经长盛基金管理有限公司第五届董事会第十五次会议审议通过，并报中国证监会审核批准，聘任公司副总经理周兵先生担任公司总经理，陈礼华先生不再担任公司总经理。

#### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2011 年 1 月 21 日，中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格（证监许可【2011】116 号），张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 应支付该券商的佣金    |            |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|
|      |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |
| 广发证券 | 2      | 170,573,175.02   | 9.22%        | 138,591.64   | 8.95%      |
| 国元证券 | 1      | 1,207,180,110.15 | 65.24%       | 1,026,103.39 | 66.26%     |

|      |   |                |        |            |        |
|------|---|----------------|--------|------------|--------|
| 联合证券 | 1 | 442,231,700.77 | 23.90% | 359,316.43 | 23.20% |
| 银河证券 | 1 | -              | -      | -          | -      |
| 中信证券 | 1 | -              | -      | -          | -      |
| 东北证券 | 1 | 14,024,430.61  | 0.76%  | 11,394.85  | 0.74%  |
| 中信建投 | 1 | 16,381,255.37  | 0.89%  | 13,309.92  | 0.86%  |

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 债券交易          |              |
|------|--------|---------------|--------------|
|      |        | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 |
| 广发证券 | 2      | -             | -            |
| 国元证券 | 1      | 32,529,038.00 | 100.00%      |
| 联合证券 | 1      | -             | -            |
| 银河证券 | 1      | -             | -            |
| 中信证券 | 1      | -             | -            |
| 东北证券 | 1      | -             | -            |
| 中信建投 | 1      | -             | -            |

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资金雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的所需，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

#### 2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

### 3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无

## 10.8 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事件如下：

| 序号 | 公告事项                                       | 法定披露方式                       | 法定披露日期    |
|----|--|------------------------------|-----------|
| 1  | 关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站 | 2011-6-30 |
| 2  | 长盛基金管理有限公司总经理变更公告                          | 同上                           | 2011-5-14 |
| 3  | 长盛基金管理有限公司关于开通旗下开放式基金在中信证券定期定额投资业务的公告      | 同上                           | 2011-5-13 |
| 4  | 长盛成长价值证券投资基金招募说明书更新                        | 同上                           | 2011-4-22 |
| 5  | 关于旗下部分基金参与银河证券基金申购业务费率优惠活动的公告              | 同上                           | 2011-4-12 |
| 6  | 关于开通汇付天下“天天盈”网上直销业务的公告                     | 同上                           | 2011-4-1  |
| 7  | 长盛基金管理有限公司关于由周兵先生代为履行公司总经理职务的公告            | 同上                           | 2011-3-30 |
| 8  | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金持有的“双汇发展”估值方法调整的公告         | 同上                           | 2011-3-22 |
| 9  | 长盛成长价值基金收益分配公告                             | 同上                           | 2011-1-6  |

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛成长价值证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛成长价值证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛成长价值证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所

### 11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。