长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

【2012】半年度报告摘要

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2012年8月25日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年8月24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。

本报告期自2012年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛环球行业股票(QDII)
基金主代码	080006
交易代码	080006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月26日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	61,833,537.87份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球证券市场,把握全球经济趋势,精选景气投资行业,并在此基础上投资于其中的优势公司,实现充分分享全球经济增长收益的目标;同时在投资国家或地区配置上,有效实现全球分散化投资,力争充分分散风险,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法,运用Black-Litterman资产配置模型实现行业层面的风险最优配置,在行业内部,运用全球量化选股模型精选个股,投资管理人将两者进行有机结合,构建最优化的投资组合。
业绩比较基准	摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index)
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金。同时,本基金为全球股票型证券投资基金,除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。此外,由于投资国家与地区市场的分散,风险低于投资单一市场的股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	唐州徽
	联系电话	010-82019988	010-66594855
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	GOLDMAN SACHS ASSET MANAGEMENT,L.P.	BANK OF CHINA (HONG KONG LIMITED)
	中文	高盛资产管理有限责任合伙	中国银行(香港)有限公司
注册地址		200 West Street, New York, NY 10282-2198	香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港皇后大道中2号长江集团中心68楼	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	报告期(2012年1月1日-2012年6月30日)
本期已实现收益	-1,849,749.07
本期利润	2,069,894.91
加权平均基金份额本期利润	0.0344
本期基金份额净值增长率	3.72%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1626
期末基金资产净值	51,780,992.84
期末基金份额净值	0.837

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"为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	1.70%	0.91%	5.14%	1.26%	-3.44%	-0.35%
过去三个月	-4.99%	0.80%	-5.47%	1.11%	0.48%	-0.31%
过去六个月	3.72%	0.68%	4.70%	0.92%	-0.98%	-0.24%
过去一年	-15.20%	0.93%	-6.43%	1.43%	-8.77%	-0.50%
自基金合同生效起至今	-12.28%	0.77%	17.43%	1.21%	-29.71%	-0.44%

注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

业绩比较基准=摩根斯坦利世界大盘股可投资指数(MSCI World Large Cap IMI Index)x 100%(以下简称MSCI世界指数)。

本基金为股票型基金,主要投资范围为全球主要发达地区股票市场大盘类股票,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取上述指数。

摩根斯坦利世界大盘股可投资指数是按照自由流通市值调整方法编制的跟踪全球成熟市场的全球性投资指数,是MSCI标准化指数之一,适合作为全球市场投资业绩比较基准的指数。全球超过80%的基金经理人,是以MSCIBARRA编制的指数作为投资绩效评估的标准。在全球范围内,MSCI世界指数已经成为全球市场投资工具的基准标尺之一,并且由MSCIBARRA每日在市场发布。截至2010年12月,摩根斯坦利世界大盘股可投资指数涵盖23个国家和地区的超过730只股票,代表了全球国家大约75%的总市值,与本基金主要投资方向比较吻合。

MSCI世界指数样本覆盖了与证监会已经签立合作谅解备忘录的主要国家,并为许多国际著名股票投资基金选用为投资比较基准,具有良好的市场代表性。比较起来,该指数具有较好的权威性、市场代表性,用为衡量本基金业绩的基准比较合适。

本基金的股票资产占基金资产的60%-95%。在正常的市场情况下,基金的平均股票仓位约为85%,所以,业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

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

(2010年5月26日至2012年6月30日)

注:按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日,本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(三)投资范围、(九)投资限制的有关约定。

§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%;新加坡星展银行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2012年6月30日,基金管理人共管理两支封闭式基金、十八支开放式基金,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		
吴达	本基金基金经理、长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理、国际业务部总监。	2010年5月26日	—	10年	男,1979年8月出生,中国国籍。伦敦政治经济学院金融经济学硕士、CFA(美国特许金融分析师)。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理、专户投资组合经理;新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员;华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理;2007年8月起加入长盛基金管理有限公司,现任国际业务部总监、长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理、长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金(本基金)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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Len Ioffe	高盛全球量化股票团队的高级投资组合经理,全球量化股票投资政策委员会成员。	19年	俄罗斯圣彼得堡理工大学颁发的计算机科学硕士,纽约大学斯特恩商学院工商管理硕士,曾供职于史密斯·巴尼·希尔森公司。1994年加入高盛资产管理,曾负责美国国内及国际投资组合的建立及风险分析,并实施不同的交易策略。

4.3 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《基金法》及其各项实施准则、《长盛环球景气行业大盘精选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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有14次,其中1次为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易,其余13次交易为长盛同庆基金转型期间和其他组合发生的反向交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称"开放式基金")。为确保转型后的开放式基金保持充裕流动性,以保障基金份额持有人利益,该基金制定了数量化组合投资交易策略,并报经公司投资决策委员会批准,打开交易所公开竞价同日反向交易控制,因此而产生13笔交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

在此期间内,长盛同庆严格执行既定数量化组合投资交易策略,批量下达投资指令。公司交易部对上述指令进行严格审核,在指令分发后,通过恒生交易系统自动委托交易程序执行指令,以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平,杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

就2012年上半年来说,环球市场的走势给人一种似曾相识的感觉,一季度展开春季攻势,二季度经济数据开始环比走软提醒仍然是弱复苏。然而与2011年不同,今年的市场上下的波动幅度有所加大,且美国在复苏的道路上领先全球的概念正在为更多的市场参与者所接受。反观欧洲,则展现出更加令人担心的后危机问题,更多的周边市场国家,包括较大的经济体西班牙也加入了要求欧盟救助的阵营。二季度开始的欧洲多个国家选举也为欧债危机的解决带来很多变数,整个二季度市场都在围绕希腊、法国、西班牙等国传出的坏消息盘整,兼之美国的经济数据季度性环比显现疲态,一季度表现较好的成长股和行业回调较多,而代表美国本土消费和房地产市场复苏的概念较为抗跌。

美国本土经济继续表现出比较好的韧性,企业在开年之初加大了开支和招工的力度,表现为库存的主动回补和招工人数的上升,推动了市场投行指标的超预期回升和失业率从年初的8.7%下降到3月份的8.3%。然而由于欧债危机的局部升级、房地产复苏速度仍然缓慢,二季度美国经济再次落入就业创造陷阱,私人部门的招工人数难以有效补足政府部门就业的退出,失业率在8.2%的水平停滞。美联储银行在最新一期的会议上宣布延长变相宽松的国债利率扭曲操作,继续保持宽松的货币政策,但降低了市场对于推出第三次量化宽松的预期,石油价格和大宗商品在二季度发生大幅度调整。

希腊选举和债务问题谈判最终拖到了最后期限,欧盟峰会在6月底终于又在问题解决方向上向前走了一步,宣布欧洲稳定机制可以直接参与银行业的救助,推出经济刺激计划并将建立统一的银行业监管,结果引发了市场的反弹。在运作期内本基金的没有选择激进的仓位配制,并在季度间做了一定调整,适当提高了欧洲市场投资但仍然低配较多。虽然美国科技和消费板块承受了一定调整压力担半年表现较好,能源行业成为表现最差的板块。考虑到中国国内的经济下滑趋出预期,政府对于房地产市场的调控出现有选择性的松动,在港股市场调整后组合重点加大了对应的配置。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.837元,本报告期份额净值增长率为3.72%,同期业绩比较基准增长率为4.70%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2012年三季度及下半年的全球市场,政策预期可能成为未来3个月的主要推动因素,无论是欧盟危机救助时间表、中国是否进一步放松还是即将到来的美国选举都是市场关注的焦点。越接近年底,经济数据则将接过政策的接力棒,数据同比改善可能成为主旋律。

欧洲债务危机艰难度过了希腊政府债务重组置换的谈判,也初步解决了西班牙银行的问题,但最根本的财政整合仍然没有时间表,欧洲经济的基本面伤害在短期内难以复原,欧洲市场下半年将继续围绕几次欧盟峰会振荡。

中国国内经济下滑的持续时间超出市场预期,央行已经完成两次降息,但由于投资意愿不足经济很难在短期内走出弱势盘整的格局。下半年全球经济弱复苏局势不改,机会仍然可能来自于基本面良好的基础消费、科技、医疗保健、以及受益政策放松的相关板块。

4.7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公司总经理(但任估值小组组长)、公司副总经理和督察长(但任估值小组副组长)、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。

4.8 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十九条中对基金利润分配原则的约定,本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2012年6月30日,期末可供分配收益为-10,052,545.03元,未分配收益已实现部分为-6,692,683.03元,未分配收益未实现部分为-3,359,862.00元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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:长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

报告截止日:2012年6月30日

单位:人民币元

姓名	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	12,961,474.54	16,387,068.93
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	38,020,917.13	38,764,186.69
其中:股票投资	37,542,202.91	37,227,612.39
基金投资	478,714.22	1,536,574.30
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	920.01	2,760.19
应收股利	149,834.78	30,385.90
应收申购款	1,494,559.81	139,916.03
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	--
资产总计	52,627,706.27	55,324,317.74
负债和所有者权益	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011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	242,808.39	-
应付赎回款	358,548.14	34,691.74
应付管理人报酬	72,868.66	80,863.35
应付托管费	12,144.79	13,477.23
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	160,343.45	330,108.10
负债合计	846,713.43	459,140.42
所有者权益:		
实收基金	61,833,537.87	67,990,591.98
未分配利润	-10,052,545.03	-13,125,414.66
所有者权益合计	51,780,992.84	54,865,177.32
负债和所有者权益总计	52,627,706.27	55,324,317.74

注:报告截止日2012年6月30日,基金份额净值0.837元,基金份额总额61,833,537.87份。

6.2 利润表

会计主体:长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入	2,829,018.40	-992,755.20
1.利息收入	12,414.96	6,085.14
其中:存款利息收入	12,414.96	6,085.14
债券利息收入	-	-
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)	-1,123,505.94	2,839,002.89
其中:股票投资收益	-1,323,022.47	2,462,981.41
基金投资收益	-188,184.19	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	387,700.72	376,021.48
3.公允价值变动收益(损失以"-"填列)	3,919,643.98	-3,846,466.58
4.汇兑收益(损失以"-"填列)	3,433.28	-22,236.03
5.其他收入(损失以"-"填列)	17,032.12	30,859.38
减:二、费用	759,123.49	1,011,435.10
1.管理人报酬	459,959.76	590,316.21
2.托管费	76,660.02	98,386.02
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	71,617.24	154,279.62
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	150,886.47	168,453.25
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	2,069,894.91	-2,004,190.30
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	2,069,894.91	-2,004,190.30

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012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)	67,990,591.98	-13,125,414.66	54,865,177.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,069,894.91	2,069,894.91
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)	-6,157,054.11	1,002,974.72	-5,154,079.39
其中:1.基金申购款	11,694,002.78	-1,701,498.86	9,992,503.92
2.基金赎回款	-17,851,056.89	2,704,473.58	-15,146,583.31
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	61,833,537.87	-10,052,545.03	51,780,992.84
	上年度可比期间 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)	75,304,253.96	5,700,512.37	81,004,766.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,004,190.30	-2,004,190.30
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)	-20,621,502.71	-707,678.93	-21,329,181.64
其中:1.基金申购款	4,069,822.13	91,898.19	4,161,720.32
2.基金赎回款	-24,691,324.84	-799,577.12	-25,490,901.96
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)	-	-3,684,366.98	-3,684,366.98
五、期末所有者权益(基金净值)	54,682,751.25	-695,723.84	53,987,027.41

注:报表附注为本会计报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

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

长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金(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[2009]1501号《关于核准长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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339,898,507.52元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第122号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》于2010年5月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为340,041,384.63份基金份额,其中认购资金利息折合142,877.11份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司,境外投资顾问为高盛资产管理有限责任合伙。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为在全球证券市场公开发行上市的股票、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中对股票及其他权益类证券投资占本基金基金资产的目标比例为60%-95%,其中投资于业绩比较基准内23个全球发达地区市场大盘类上市公司股票的部分不低于本基金股票资产总额的80%;投资现金、货币市场工具及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产净值的5%-40%。本基金的业绩比较基准为:摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index)。

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》、《长盛环球景气行业大盘精选股票型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2012年6月30日的财务状况以及2012年1月1日至6月30日止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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作,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、基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂免征营业税和企业所得税。

3、基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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("长盛基金公司")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人、基金代销机构
中国银行(香港)有限公司("中银香港")	境外资产托管人

6.4.8 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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
国元证券经纪(香港)有限公司	-	-	5,374,993.23	5.51%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金总额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券经纪(香港)有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	期末应付佣金总额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券经纪(香港)有限公司	5,374.99	5.82%	-	-

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	459,959.76	590,316.21
其中:支付给销售机构的客户维护费	146,530.66	185,277.00

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1.8%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x1.8%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	76,660.02	98,386.02

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值x0.30%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间未发生银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
基金合同生效日(2010年5月26日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	18,003,410.00	18,003,410.00
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	18,003,410.00	18,003,410.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	29.12%	32.92%

6.4.8.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方本期及上年度可比期间未投资本基金。

6.4.8.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,620,964.76	12,323.17	1,511,280.57	6,069.01
中银香港	9,340,509.78	-	9,503,773.69	-
合计	12,961,474.54	12,323.17	11,015,054.26	6,069.01

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管。其中,中国银行保管部分的资金按适用利率或约定利率计息,中银香港保管部分的资金不计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 与关联方进行的外汇远期交易

本基金本期未与关联方进行外汇远期交易。

6.4.9 期末(2012年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
923 HK	FOOK WOO GROUP	2011/11/28	公司内部整改接受审计调查	1.12	未知	未知	200,000	245,037.99	223,370.28
合计								245,037.99	223,370.28

注:本基金截至2012年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.10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

(1) 不