长盛成长价值证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31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
报告送出日期:2010年01月20日

§1 重要提示

基金管理人长盛基金管理有限公司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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2009年10月1日起至2009年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛成长价值混合
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09月18日
报告期末基金份额总额	1,289,141,169.44份
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	中信综合指数收益率×80%+中信国债指数收益率×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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年10月01日-2009年12月31日)
1.本期已实现收益	17,861,067.40
2.本期利润	159,810,961.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.1216
4.期末基金资产净值	1,246,806,406.34
5.期末基金份额净值	0.967

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到2009年12月31日。

3、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	14.30%	1.08%	18.19%	1.40%	-3.89%	-0.32%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自本基金成立三个月内,使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十六条(二)投资范围、(七)投资限制的有关约定。本报告期内,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
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,投资管理部副总监。	2007年12月29日	-	11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。现任投资管理部副总监,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、任职日期、离任日期均指公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛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,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国际经济和市场方面,关于经济刺激政策是否退出的讨论逐渐激烈,有些国家已经开始加息,哥本哈根会议关于节能减排的声音吸引着全球投资者的目光。

国内宏观经济和资本市场方面,经济增长速度在巨量资金刺激下,保八"已经成为定局,房地产成交创天量,轿车、家电成为经济的新消费亮点。

4季度,在保持股票组合配置比例的情况下,微调大中小盘风格比例,适当增加大型股票的比例。

在债券组合方面,由于债券市场持续没有系统性投资交易机会,继续维持基金最低债券配置比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.967元,本报告期份额净值增长率为14.30%,同期业绩比较基准增长率为18.19%。

4.4.3 市场展望和投资策略

展望2010年,贷款和财政政策的释放资金对经济的刺激影响还有多少作用,成为投资者关注市场估值水平的因素,另外宏观经济复苏对上市公司业绩的真实影响,也会成为影响投资者设计投资组合的关键因素之一。

本基金属于平衡型股票基金,在资产配置的前提下,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上涨复合累积收益增长的持续组合管理策略,坚持利用公开信息以及基本面和市场面相结合的策略,为基金份额持有人提供长期持续稳定回报。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	权益投资	872,660,000.00	69.68
	其中:股票	872,660,000.00	69.68
2	固定收益投资	258,649,616.00	20.65
	其中:债券	258,649,616.00	20.65
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	117,607,784.06	9.39
6	其他各项资产	3,430,439.12	0.27
7	合计	1,252,347,839.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	0.00
B	采掘业	91,180,000.00	7.31
C	制造业	307,905,000.00	24.70
C0	食品、饮料	90,710,000.00	7.28
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	14,440,000.00	1.16
C4	石油、化学、塑胶、塑料	48,595,000.00	3.90
C5	电子	0	0.00
C6	金属、非金属	31,075,000.00	2.49
C7	机械、设备、仪表	61,995,000.00	4.97
C8	医药、生物制品	61,090,000.00	4.90
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	37,760,000.00	3.03
F	交通运输、仓储业	49,600,000.00	3.98
G	信息技术业	157,310,000.00	12.62
H	批发和零售贸易	49,970,000.00	4.01
I	金融、保险业	120,995,000.00	9.70
J	房地产业	35,420,000.00	2.84
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	22,520,000.00	1.81
M	综合类	-	0.00
	合计	872,660,000.00	69.99

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600028	中国石化	4,000,000	56,360,000.00	4.52
2	000895	双汇发展	1,000,000	53,100,000.00	4.26
3	600050	中国联通	7,000,000	51,030,000.00	4.09
4	600104	上海汽车	1,500,000	39,195,000.00	3.14
5	601668	中国建筑	8,000,000	37,760,000.00	3.03
6	600600	青岛啤酒	1,000,000	37,610,000.00	3.02
7	600664	哈药股份	2,000,000	36,940,000.00	2.96
8	601088	中国神华	1,000,000	34,820,000.00	2.79
9	600487	亨通光电	1,000,000	31,960,000.00	2.56
10	600030	中信证券	1,000,000	31,770,000.00	2.55

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	37,121,616.00	2.98
2	央行票据	60,460,000.00	4.85
3	金融债券	161,068,000.00	12.92
	其中:政策性金融债	161,068,000.00	12.92
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	258,649,616.00	20.74

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	070417	07农发17	600,000	60,162,000.00	4.83
2	080308	08进出08	500,000	50,965,000.00	4.09
3	0901051	09央行票据51	400,000	39,868,000.00	3.20
4	010004	20国债(4)	368,270	37,121,616.00	2.98
5	050406	05农发06	300,000	30,105,000.00	2.41

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,160,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,197,914.98
5	应收申购款	72,524.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,430,439.12

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告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。

5.8.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,337,384,247.92
本报告期期间基金总申购份额	18,004,520.21
减:本报告期期间基金总赎回份额	66,247,598.69
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,289,141,169.44

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛成长价值证券投资基金的批复

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、报告期内披露的各项公告原件

5、长盛基金管理有限公司营业执照和公司章程

7.2 存放地点

以上相关备查文件,置备于基金管理人的办公场所。本季度报告分别置备于基金管理人和基金托管人的办公场所。本季度报告至少登载在一种由中国证监会指定的全国性报刊及本基金管理人的互联网网站上。

7.3 查阅方式

在办公时间内可查阅,也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

长盛中证100指数证券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31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
报告送出日期:2010年01月20日

§1 重要提示

基金管理人长盛基金管理有限公司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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2009年10月1日起至2009年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛中证100指数
交易代码	519100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月22日
报告期末基金份额总额	1,302,134,429.53份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在4%以下,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用复制指数投资策略,按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪基准指数。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金,风险中等,将获得证券市场平均收益率。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略,在投资管理上将最大限度的分散非系统性风险。对于跟踪误差的风险,本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年10月01日—2009年12月31日)
1.本期已实现收益	39,913,968.77
2.本期利润	236,688,366.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.1637
4.期末基金资产净值	1,399,953,030.61
5.期末基金份额净值	1.0751

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到2009年12月31日。

3、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	15.65%	1.67%	16.15%	1.66%	-0.50%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自本基金成立三个月内,使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资限制的有关约定。本报告期内,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
白仲光	本基金基金经理,金融工程部总监。	2009年03月09日	—	6年	男,1969年8月出生,中国国籍。天津大学博士。1991年至1997年在石家庄经济学院任教,2003年2月加入长盛基金管理有限公司,在公司期间历任研究员、高级金融工程师、基金经理等职务,现任金融工程部总监,长盛中证100指数证券投资基金(本基金)基金经理。

注:1、任职日期、离任日期均指公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛中证100指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

4季度市场在经济趋势明朗下震荡上行,中证100指数上涨16.98%,其中电子元器件、餐饮旅游、家用电器、信息设备等行业涨幅居前,金融、地产,有色等行业涨幅落后市场。在操作中,我们严格遵守基金合同,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2009年12月31日,本基金净值1.0751元,本季度份额净值增长率为15.65%,日均跟踪误差为0.05%,年度化跟踪误差为0.77%。

4.4.3 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

目前货币供给充足、工商业活动依然活跃,企业盈利水平回升显著,市场估值处于历史均位,中小盘和大盘蓝筹估值差距处于历史高位。展望2010年,以大盘蓝筹为成分的中证100指数基金将更具有战略配置意义。作为指数基金,我们将继续秉承指数化投资策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,控制基金的跟踪误差,在此基础上本基金将积极采用数量化投资策略增强指数,力争获取超额收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	权益投资	1,330,644,002.73	94.09
	其中:股票	1,330,644,002.73	94.09
2	固定收益投资	-	0.00
	其中:债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	79,218,670.90	5.60
6	其他资产	4,423,828.29	0.31
7	合计	1,414,286,501.92	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 指数投资部分

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	-	0.00
B	采掘业	164,220,565.10	11.73
C	制造业	235,806,838.53	16.84
C0	食品、饮料	53,378,264.86	3.81
C1	纺织、服装、皮毛	5,697,061.30	0.41
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	20,034,428.54	1.43
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	99,294,671.16	7.09
C7	机械、设备、仪表	57,402,412.67	4.10
C8	医药、生物制品	-	0.00
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	49,522,459.78	3.54
E	建筑业	21,309,697.36	1.52
F	交通运输、仓储业	79,331,109.42	5.67
G	信息技术业	45,277,118.71	3.23
H	批发和零售贸易	19,451,721.62	1.39
I	金融、保险业	627,803,733.93	44.84
J	房地产业	60,123,045.98	4.29
K	社会服务业	12,962,491.50	0.93
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	6,374,720.80	0.46
	合计	1,322,183,502.73	94.44

5.2.2 积极投资部分

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	-	0.00
B	采掘业	2,409,000.00	0.17
C	制造业	-	0.00
C0	食品、饮料	-	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	-	0.00
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	0.00
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	-	0.00
C7	机械、设备、仪表	-	0.00
C8	医药、生物制品	-	0.00
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	4,720,000.00	0.34
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	-	0.00
H	批发和零售贸易	-	0.00
I	金融、保险业	-	0.00
J	房地产业	1,331,500.00	0.10
K	社会服务业	-	0.00
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	8,460,500.00	0.60

5.3 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	3,872,928	69,906,350.40	4.99
2	601318	中国平安	1,156,651	63,719,903.59	4.55
3	601328	交通银行	6,423,652	60,061,146.20	4.29
4	600016	民生银行	6,850,457	54,187,114.87	3.87
5	600030	中信证券	1,637,145	52,012,096.65	3.72
6	601166	兴业银行	1,246,082	50,229,565.42	3.59
7	601088	中国神华	1,361,847	47,419,512.54	3.39
8	600000	浦发银行	1,870,123	40,562,967.87	2.90
9	000002	万 科A	3,414,194	36,907,437.14	2.64
10	600050	中国联通	4,293,433	31,299,126.57	2.24

积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601668	中国建筑	1,000,000	4,720,000.00	0.34
2	600547	山东黄金	30,000	2,409,000.00	0.17
3	000024	招商地产	50,000	1,331,500.00	0.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

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,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,050,000.00
2	应收证券清算款	3,006,224.01
3	应收股利	-
4	应收利息	15,678.68
5	应收申购款	351,925.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,423,828.29

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.8.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,706,860,233.56
本报告期期间基金总申购份额	131,218,977.69
减:本报告期基金总赎回份额	535,944,781.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,302,134,429.53

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛中证100指数证券投资基金的批复

2、长盛中证100指数证券投资基金基金合同

3、长盛中证100指数证券投资基金托管协议

4、报告期内披露的各项公告原件

5、长盛基金管理有限公司营业执照和公司章程

7.2 存放地点

以上相关备查文件,置备于基金管理人的办公场所。本季度报告分别置备于基金管理人和基金托管人的办公场所。本季度报告至少登载在一种由中国证监会指定的全国性报刊及本基金管理人的互联网网站上。

7.3 查阅方式

在办公时间内可查阅,也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

2009 第四季度报告

2009年12月31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
报告送出日期:2010年01月20日

§1 重要提示

基金管理人长盛基金管理有限公司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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2009年10月1日起至2009年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛全债指数增强债券	
交易代码	510080(前端收费模式)	511080(后端收费模式)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年10月25日	
报告期末基金份额总额	605,133,452.00份	
投资目标	本基金为开放式债券型基金,将运用增强的指数化投资策略,在力求本金安全的基础上,追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳定增值	
投资策略	本基金采用"自上而下"的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值,同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益	
业绩比较基准	中信全债指数收益率×92%+中信综合指数收益率×8%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金	
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	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年10月01日-2009年12月31日)
1.本期已实现收益	27,211,016.26
2.本期利润	35,804,050.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0510
4.期末基金资产净值	750,868,888.06
5.期末基金份额净值	1.2408

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到2009年12月31日。

3、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	3.83%	0.34%	2.07%	0.15%	1.76%	0.19%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自本基金成立六个月内,使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四条(二)投资范围、(八)投资限制的有关约定。本报告期内,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
刘静	本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。	2008年8月11日	—	9年	女,1977年1月出生,中国国籍。中央财经大学经济学硕士。2000年7月至2003年6月就职于北京证券有限责任公司;2003年7月加入长盛基金管理有限公司,先后担任交易部交易员、首席债券交易员。现任长盛中信全债指数增强型债券投资基金(本基金)基金经理,长盛货币市场基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期、离任日期均指公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内行情回顾和本基金投资策略分析

2009年是我国大力度实施经济刺激政策的一年,也是我国经济由危机走向复苏的一年,四季度成为这一年成果的阶段性总结。统计局最新公布数据显示,2009年四季度全国企业景气指数为130.60,比上季度提高6.2点。四季度企业家信心指数为127.70,比上季度提高7.6点。该数据进一