# 上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金

## 2010 第二季度报告

2010年6月30日

**基金管理人:工银瑞信基金管理有限公司**
**基金托管人:招商银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一〇年七月二十日**

### §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年7月16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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年4月1日起至6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 工银上证央企ETF |
| 交易代码 | 510060 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2009年08月26日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,019,959,219.00份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制策略,跟踪标的指数的表现,即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。但在特殊情况下,本基金可以选择其它证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换。 |
| 业绩比较基准 | 上证中央企业50指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制策略,跟踪上证中央企业50指数,是股票基金中风险中等、收益与市场平均水平大致相近的产品。 |
| 基金管理人 | 工银瑞信基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |

### §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(2010年4月1日-2010年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -126,790,111.31 |
| 2.本期利润 | -372,202,176.87 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.3468 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,242,960,025.75 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2186 |

注:(1)上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)本基金已于2009年09月28日进行了基金份额折算,折算比例为0.63964039。

(4)所列数据截止到2010年6月30日。

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 | -22.58% | 1.67% | -22.60% | 1.71% | 0.02% | -0.04% |

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

注:1、本基金基金合同于2009年8月26日生效,截至报告期末,本基金基金合同生效尚不满一年。

2、按基金合同规定,本基金建仓期不超过3个月。截至报告期末,本基金的各项投资比例符合基金合同的规定:本基金主要投资于标的指数成份股票、备选成份股票、一级市场新发股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,基金投资于标的指数成份股票及备选成份股票的比例不低于基金资产净值的90%,但因法律法规的规定而受限制的情形除外。

### §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 | | |
| 樊智 | 本基金的基金经理;工银瑞信沪深300基金的基金经理 | 2009年09月08日 | - | 7 | 中国籍,毕业于天津大学,获博士学位。2003年4月至2005年6月,任职于中信证券股份有限公司研究部,担任高级研究员。2005年7月加入工银瑞信基金管理有限公司市场营销部从事产品开发工作;2005年12月至2009年9月,任职于风险管理部,历任业务主管、风险管理部副总监。2009年9月8日至今,担任工银瑞信沪深300基金和工银瑞信上证央企ETF基金基金经理。 |
| 胡文彪 | 本基金的基金经理;工银瑞信沪深300基金的基金经理;工银瑞信中小盘基金的基金经理 | 2009年08月26日 | - | 9 | 中国籍,毕业于清华大学,获理学硕士学位。2001年7月至2003年10月,任职于国泰君安证券资产管理总部,担任研究员。2003年11月至2004年3月,任职于华林证券资产管理部,担任研究员。2004年4月至2006年7月,任职于海富通基金管理有限公司产品开发部,担任产品经理。2006年7月,加入工银瑞信基金管理有限公司,历任产品开发部高级经理和权益投资部高级经理、基金经理。2009年3月5日至今,担任工银瑞信沪深300基金基金经理。2009年8月26日至今,担任工银瑞信上证央企ETF基金基金经理。2010年2月10日至今,担任工银瑞信中小盘基金基金经理。 |

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》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无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

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》,对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定,并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大,可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期,按照时间优先、价格优先的原则,本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合,均采用了系统中的公平交易模块进行操作,实现了公平交易;未出现清算不到位的情况,且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

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

无,因报告期内本公司旗下没有与本基金投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期没有出现异常交易的情况。

4.4 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

本报告期内,本基金跟踪标的指数的日均偏离度为0.10%,偏离度年化标准差为1.89%。本基金跟踪误差产生的主要来源是:1)标的指数成份股中法律法规禁止本基金投资的股票的影响;2)申购赎回的影响;3)成份股票的停牌;4)指数中成份股票的调整;等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额累计净值为0.7795元。本报告期份额净值增长率为-22.58%,同期业绩比较基准增长率为-22.60%,高于比较基准0.02个百分点。

### §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 | 1,215,959,872.17 | 97.58 |
| | 其中:股票 | 1,215,959,872.17 | 97.58 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 19,644,270.96 | 1.58 |
| 6 | 其他资产 | 10,465,920.62 | 0.84 |
| 7 | 合计 | 1,246,070,063.75 | 100.00 |

注:股票投资项含可退替代款估值增值。

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 | - | - |
| B | 采掘业 | 195,778,938.85 | 15.75 |
| C | 制造业 | 135,477,569.91 | 10.90 |
| C0 | 食品、饮料 | - | - |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | - | - |
| C5 | 电子 | - | - |
| C6 | 金属、非金属 | 60,933,826.30 | 4.90 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 74,543,743.61 | 6.00 |
| C8 | 医药、生物制品 | - | - |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 97,956,240.20 | 7.88 |
| E | 建筑业 | 88,509,542.16 | 7.12 |
| F | 交通运输、仓储业 | 63,508,921.88 | 5.11 |
| G | 信息技术业 | 44,418,525.06 | 3.57 |
| H | 批发和零售贸易 | 6,050,240.70 | 0.49 |
| I | 金融、保险业 | 561,841,642.06 | 45.20 |
| J | 房地产业 | 22,421,551.35 | 1.80 |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 1,215,963,172.17 | 97.83 |

注:1、合计项不含可退替代款估值增值;

2、由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.2 积极投资部分

无。

5.3 期末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 | 601328 | 交通银行 | 20,477,322 | 123,068,705.22 | 9.90 |
| 2 | 601939 | 建设银行 | 22,184,012 | 104,264,856.40 | 8.39 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 8,737,454 | 102,228,211.80 | 8.22 |
| 4 | 601988 | 中国银行 | 22,523,868 | 76,355,912.52 | 6.14 |
| 5 | 601601 | 中国太保 | 3,326,316 | 75,740,215.32 | 6.09 |
| 6 | 601088 | 中国神华 | 3,235,717 | 71,088,702.49 | 5.72 |
| 7 | 601628 | 中国人寿 | 2,574,294 | 63,585,061.80 | 5.12 |
| 8 | 600900 | 长江电力 | 4,339,400 | 54,199,106.00 | 4.36 |
| 9 | 600050 | 中国联通 | 8,333,682 | 44,418,525.06 | 3.57 |
| 10 | 601857 | 中国石油 | 3,709,462 | 38,021,985.50 | 3.06 |

期末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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金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

本基金报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

5.8.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 8,784,008.28 |
| 3 | 应收股利 | 1,678,350.62 |
| 4 | 应收利息 | 3,561.72 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,465,920.62 |

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 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。

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 | 1,248,959,219.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 487,000,000.00 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 716,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,019,959,219.00 |

注:本基金已于2009年09月28日进行了基金份额折算,折算比例为0.63964039。

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1.中国证监会核准上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

2.《上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3.《上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

4.基金管理人业务资格批件、营业执照

5.基金托管人业务资格批件、营业执照

6.报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人或基金托管人处。

7.3 查阅方式

投资者可到基金管理人或基金托管人的办公场所、营业场所及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。

# 长盛中信全债指数增强型债券投资基金

## 2010 第二季度报告

2010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**
**报告送出日期:2010年07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7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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2010年4月1日起至2010年6月30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 |
| 前端交易代码 | 510080 |
| 后端交易代码 | 511080 |
| 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 | 526,693,608.31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 | 中信标普全债指数收益率×92%+中信标普A股综合指数收益率×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(2010年04月01日-2010年06月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 4,712,678.04 |
| 2.本期利润 | -10,912,183.67 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0201 |
| 4.期末基金资产净值 | 646,759,857.31 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.2280 |

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2010年6月30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 | -1.68% | 0.32% | -0.91% | 0.15% | -0.77% | 0.17% |

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

### §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08月11日 | - | 10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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一、报告期内行情回顾

2季度,我国国民经济明显呈现出增速冲高见顶回落的趋势,投资、工业生产的同比数据在1季度末达到高点后已经连续几个月出现下滑,先行指标PMI也在连续两个月大幅下滑后创出了1年多来的最低水平,表明下半年中国经济放缓的大局已定。

创除去年基数逐渐抬升的因素,经济增速放缓的背后是刺激政策的逐渐退出以及调控政策接连出台,一方面存款准备金率在2季度第三次上调,公开市场资金不断被回笼;另一方面,对房地产泡沫的严厉调控政策在2季度连续出台,以及对地方融资平台的清查延续则对信贷的投放以及投资高增长的持续形成了明显制约。同时,我们注意到,出于对政策调整的统筹考虑,央行对利率工具的使用依旧保持着谨慎的态度。

在外围欧债危机深化,国内房地产遭遇严厉调控的背景下,市场对于经济二次探底的担心逐渐加重以及通货膨胀威胁的衰减从基本面上点燃了市场做多的信心。4月下半月开始,债市收益率水平在各类机构的推动下快速下移,虽然从5月中下旬开始,持续货币回笼的累积效应导致货币市场利率整体攀升了一个台阶,但中长期债券品种收益率在短暂上扬后重新向先前低点靠拢。总体来看,3季度债市国债及政策性银行债收益率曲线短端升幅明显,长端整体下移,收益率曲线平坦化加重,2009年末以来的信用债行情则得到延续,部分信用利差降至历史平均水平以下。

股票市场方面,随着"新国十条"的出台,股指在平台整理后出现了急剧下挫,单季度沪深300指数累计下跌幅度达到23.39%。分析其原因,主要在于前期市场表现已经充分消化了宏观经济和企业经营方面的有利因素,而对政策调控下资产泡沫遭受挤压的担心提升了市场的风险溢价水平,从而使市场估值水平出现了系统性的调整。从板块表现看,受益于结构调整政策的医药生物、食品饮料、商业贸易、电子元器件等跌幅相对较小,而政策调控影响较大的房地产、化工、黑色金属则表现较差。风格上看,侧重于新兴产业的中小盘股票指数表现仍然超越了大盘蓝筹。

二、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金在债券资产配置策略上继续保持一贯稳健投资风格,对组合采用战略性和战术性配置相结合的一贯策略。基于对市场在宏观大背景下风险和机会的博弈,本组合在本季度内,将组合久期适度提高,动态调节组合的久期和品种,获得了一定的收益,但由于本基金有基准久期的限定,因此超额收益不是很明显;另外由于对企业未来盈利下降,信用风险将面临上升的担心,致使信用债配置不够激进,这部分的收益相对较低。就权益类资产部分而言,2季度本基金坚持风险控制的原则,对该部分资产进行动态调整,投资期内基本保持较为积极的操作;策略上采取自上而下与自下而上相结合的资产配置策略;但由于对热点及政策导向带来的行业及个股机会把握不够及时和准确,部分影响了投资收益。另外,在报告期内增加了转债部分的投资,通过对重点券种的研究,对转债部分作了适当的增持,报告期间也获得一定的投资收益。

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1.2280元,本报告期份额净值增长率为-1.68%,同期业绩比较基准增长率为-0.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在欧洲债务危机持续深化的外部经济条件下,国内经济又面临着宏观调控刺激措施逐步退出,地方融资平台受到严控,房地产调控政策接连出台的不利影响;在这一状况下,市场对短中长期的国民经济走势均出现了相对悲观的看法。但是,从我们的视角看,市场参与者对经济的预期存在从过度悲观中逐步修正的需要,下半年的经济增长将通过"软着陆"的形态呈现,而非市场担心的二次探底。我们做出这一判断的依据在于,下半年持续不断出台的各项结构调整政策会更加注重与保增长的平衡,这将有效地遏制经济增速急剧下滑的风险,这些政策包括保障性住房建设、中西部崛起以及对民营经济支持力度的进一步加大。

物价方面,我们预计随着经济增速的放缓未来通胀急剧恶化的风险将显著降低,但CPI指数在三季度仍将维持在3%以上水平。此外,我们还将密切关注今年多变的气候条件、农牧产品生产中存在的结构性问题以及其它未可知因素推升物价走势的可能。

债券市场方面,我们预计资金面对债市的支持力度将持续减弱,而当前的收益率水平继续下行的空间已经不太大,保持对风险和流动性的关注程度,继续延续谨慎的投资原则,重点关注并挖掘信用类产品仍将可能继续存在的投资机会,并且继续加强对可转债市场的研究,在个券配置上下工夫,力争在此领域获得较好的超额收益。股票市场方面,本组合将继续采用自上而下和自下而上相结合的选股策略,一方面坚持以业绩增长确定为主线的投资原则,重点挖掘在经济回升过程中业绩增长超预期的公司;另一方面关注继续受益于政府促进经济发展的政策导向型的行业及公司。

### §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 | 66,474,156.13 | 9.62 |
| | 其中:股票 | 66,474,156.13 | 9.62 |
| 2 | 固定收益投资 | 493,003,640.51 | 71.33 |
| | 其中:债券 | 493,003,640.51 | 71.33 |
| | 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 | 35,178,778.46 | 5.09 |
| 6 | 其他资产 | 96,463,538.73 | 13.96 |
| 7 | 合计 | 691,120,113.83 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采掘业 | 4,758,420.24 | 0.74 |
| C | 制造业 | 39,429,544.85 | 6.10 |
| C0 | 食品、饮料 | 8,515,286.08 | 1.32 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 1,078,694.40 | 0.17 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 1,766,621.17 | 0.27 |
| C5 | 电子 | 9,928,722.45 | 1.54 |
| C6 | 金属、非金属 | 1,994,856.25 | 0.31 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 9,457,125.00 | 1.46 |
| C8 | 医药、生物制品 | 6,688,239.50 | 1.03 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 1,814,214.88 | 0.28 |
| H | 批发和零售贸易 | 10,168,000.00 | 1.57 |
| I | 金融、保险业 | 3,903,000.00 | 0.60 |
| J | 房地产业 | 3,920,000.00 | 0.61 |
| K | 社会服务业 | 1,894,476.40 | 0.29 |
| L | 传播与文化产业 | 586,499.76 | 0.09 |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 66,474,156.13 | 10.28 |

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 | 002024 | 苏宁电器 | 500,000 | 5,700,000.00 | 0.88 |
| 2 | 601766 | 中国南车 | 1,100,000 | 5,302,000.00 | 0.82 |
| 3 | 300086 | 康芝药业 | 93,984 | 4,936,039.68 | 0.76 |
| 4 | 601101 | 昊华能源 | 157,668 | 4,758,420.24 | 0.74 |
| 5 | 002436 | 兴森科技 | 146,160 | 4,472,496.00 | 0.69 |
| 6 | 600628 | 新世界 | 400,000 | 4,468,000.00 | 0.69 |
| 7 | 002438 | 江苏神通 | 162,500 | 4,155,125.00 | 0.64 |
| 8 | 000895 | 双汇发展 | 89,880 | 3,913,375.20 | 0.61 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 300,000 | 3,903,000.00 | 0.60 |
| 10 | 002415 | 海康威视 | 43,224 | 2,995,423.20 | 0.46 |

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 | 60,329,773.00 | 9.33 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 200,425,000.00 | 30.99 |
| | 其中:政策性金融债 | 200,425,000.00 | 30.99 |
| 4 | 企业债券 | 221,156,150.51 | 34.19 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | 11,092,717.00 | 1.72 |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 493,003,640.51 | 76.23 |

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 | 090411 | 09农发11 | 600,000 | 60,192,000.00 | 9.31 |
| 2 | 080207 | 08国开07 | 500,000 | 50,330,000.00 | 7.78 |
| 3 | 010308 | 03国债(8) | 489,590 | 50,085,057.00 | 7.74 |
| 4 | 090306 | 09进出06 | 400,000 | 40,076,000.00 | 6.20 |
| 5 | 080223 | 08国开23 | 400,000 | 39,696,000.00 | 6.14 |

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资产。

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 | 1,020,524.98 |
| 2 | 应收证券清算款 | 87,828,948.11 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,569,924.70 |
| 5 | 应收申购款 | 44,140.94 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 96,463,538.73 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601101 | 昊华能源 | 4,758,420.24 | 0.74 | 网下新股处于锁定期 |
| 2 | 002436 | 兴森科技 | 4,472,496.00 | 0.69 | 网下新股处于锁定期 |
| 3 | 002438 | 江苏神通 | 4,155,125.00 | 0.64 | 网下新股处于锁定期 |
| 4 | 000895 | 双汇发展 | 3,913,375.20 | 0.61 | 公布重大事项 |
| 5 | 002415 | 海康威视 | 2,995,423.20 | 0.46 | 网下新股处于锁定期 |
| 6 | 300086 | 康芝药业 | 2,310,039.68 | 0.36 | 网下新股处于锁定期 |

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 | 569,746,155.72 |
| 本报告期基金总申购份额 | 8,505,342.01 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 51,557,889.42 |
| 本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 526,693,608.31 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》;

3、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金托管协议》;

4、《长盛中信全债指数增强型债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。

7.2 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。

7.3 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/或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。

# 长盛积极配置债券型证券投资基金

## 2010 第二季度报告

2010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:中国建设银行股份有限公司**
**报告送出日期:2010年07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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年7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。

本报告会计期自2010年4月1日起至2010年6月30日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 长盛积极配置债券 |
| 交易代码 | 080003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年10月08日 |
| 报告期末基金份额总额 | 106,420,571.38份 |
| 投资目标 | 在控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳定增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。 |
| 投资策略 | 本基金为积极投资策略的债券型基金,不同与传统债券型基金的投资策略特点,本基金在债券类资产配置上更强调积极主动管理。在债券类资产配置上,本基金通过积极投资配置相对收益率较高的企业债、公司债、可转换债、可分离交易可转债、资产支持证券等创新债券品种,并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会,以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上,通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票,来获取股票市场的积极收益。此外,本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

### §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(2010年04月01日-2010年06月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 5,829,249.06 |
| 本期利润 | -1,064,005.88 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0097 |
| 期末基金资产净值 | 118,051,637.89 |
| 期末基金份额净值 | 1.1093 |

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、所列数据截止到2010年6月30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 | -0.92% | 0.34% | -0.71% | 0.18% | -0.21% | 0.16% |

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

### §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 | | |
| 蔡宾 | 本基金基金经理。 | 2008年12月19日 | — | 7年 | 男,1978年11月出生。毕业于中央财经大学,获硕士学位。2004年6月至2006年2月就职于宝盈基金管理有限公司,曾任研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究员、社保组合助理、投资经理等。现任长盛积极配置债券型证券投资基金(本基金)基金经理。 |
| 刘静 | 本基金基金经理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理。 | 2008年10月8日 | — | 10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(本基金)基金经理。 |
| 吴达 | 本基金基金经理,长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金经理。国际业务部总监。 | 2008年10月8日 | — | 8年 | 男,1979年8月出生,伦敦政治经济学院金融经济学硕士,(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(本基金)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、《长盛积极配置债券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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度股票市场出现剧烈的下跌,下跌初期银行、地产等中大市值公司率先下跌,随后医药等中小市值公司补跌。二季度,沪深300指数跌幅达到23.39%,上证指数跌幅达到22.86%,成为近20年来仅次于08年二季度的第二大跌幅。大量的避险资金堆积到固定收益资产上,加上市场对于央行加息预期的弱化,债券资产特别是信用产品继一季度的大涨之后又走出一波强劲的上涨行情,交易所企债指数单季度上涨2.32%

长盛积极配置债券基金本季度持有的权益资产主要都是参与新股网下申购锁定的股票,本季度遭受了较大的损失。在债券资产的投资上,出于对通胀的担忧,我们没有很好的获得债券市场上涨的收益。

4.4.2 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1.1093元,本季度净值增长率为-0.92%,低于同期比较基准0.21个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在政府严格控制贷款并且流动性较充裕的背景下,债券资产成为避险资金为数不多的避风港。目前的债券收益率水平比历史均值大约低40bp,在潜在的通胀风险没有充分体现的条件下,持有中长期债券品种的风险收益比无疑是没有吸引力的。对于信用产品,目前的信用利差虽处在较高水平,但是如果利率产品收益上行,也会受到影响。我们总的策略还是谨慎对待。

目前股市的方向处在一个较弱的环境中已经没有疑义。从估值上来看市场整体并不昂贵,但是相当部分的特别是中小市值的股票也没有足够便宜。未来6-12个月中国经济可能都处在调整和应对通胀的复杂环境中,或者说滞胀的中期风险比较大,那么对于要求在这个时间窗口内获得正回报的投资来说,目前投资权益市场的风险仍然是较大的。当前最需要的做的,也许就是等待。

基于上述判断,本基金将坚持绝对收益理念,重点关注未来几个月基金资产的下行风险并保持足够的流动性。

### §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) | 占基金总资产比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 12,256,358.14 | 8.53 |
| | 其中:股票 | 12,256,358.14 | 8.53 |
| 2 | 固定收益投资 | 95,342,142.50 | 66.38 |
| | 其中:债券 | 95,342,142.50 | 66.38 |
| | 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 | 5,140,614.54 | 3.58 |
| 6 | 其他资产 | 30,897,194.23 | 21.51 |
| 7 | 资产合计 | 143,636,309.41 | 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 | - | - |
| B | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 8,045,595.55 | 6.82 |
| C0 | 食品、饮料 | 886,079.04 | 0.75 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 1,504,484.25 | 1.27 |
| C5 | 电子 | 1,807,757.65 | 1.53 |
| C6 | 金属、非金属 | 1,196,913.75 | 1.01 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | - | - |
| C8 | 医药、生物制品 | 2,650,360.86 | 2.25 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | - | - |
| G | 信息技术业 | 665,662.59 | 0.56 |
| H | 批发和零售贸易 | - | - |
| I | 金融、保险业 | 3,545,100.00 | 3.00 |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | - | - |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 12,256,358.14 | 10.38 |

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 | 600016 | 民生银行 | 550,000 | 3,327,500.00 | 2.82 |
| 2 | 300073 | 当升科技 | 20,373 | 1,196,913.75 | 1.01 |
| 3 | 002390 | 信邦制药 | 33,061 | 1,106,221.06 | 0.94 |
| 4 | 300077 | 国民技术 | 8,519 | 994,593.25 | 0.84 |
| 5 | 300082 | 奥克股份 | 14,099 | 952,387.45 | 0.81 |
| 6 | 002387 | 黑牛食品 | 23,974 | 886,079.04 | 0.75 |
| 7 | 300086 | 康芝药业 | 15,523 | 815,267.96 | 0.69 |
| 8 | 002436 | 兴森科技 | 26,574 | 813,164.40 | 0.69 |
| 9 | 002424 | 贵州百灵 | 17,904 | 728,871.84 | 0.62 |
| 10 | 002401 | 交技发展 | 18,927 | 665,662.59 | 0.56 |

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 | 53,047,593.60 | 44.94 |
| 2 | 央行票据 | 19,632,000.00 | 16.63 |
| 3 | 金融债券 | 20,002,000.00 | 16.94 |
| | 其中:政策性金融债 | 20,002,000.00 | 16.94 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | 2,660,548.90 | 2.25 |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 95,342,142.50 | 80.76 |

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 | 010110 | 21国债(10) | 300,330 | 30,423,429.00 | 25.77 |
| 2 | 010112 | 21国债(12) | 223,140 | 22,624,164.60 | 19.16 |
| 3 | 080225 | 08国开25 | 200,000 | 20,002,000.00 | 16.94 |
| 4 | 0901042 | 09央票42 | 200,000 | 19,632,000.00 | 16.63 |
| 5 | 125731 | 美丰转债 | 10,000 | 1,049,000.00 | 0.89 |

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 | 250,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 28,980,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,634,749.42 |
| 5 | 应收申购款 | 32,444.81 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 30,897,194.23 |

5.8.4 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110007 | 博汇转债 | 535,000.00 | 0.45 |
| 2 | 110003 | 新钢转债 | 513,498.90 | 0.44 |

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300073 | 当升科技 | 1,196,913.75 | 1.01 | 新股流通受限 |
| 2 | 002390 | 信邦制药 | 1,106,221.06 | 0.94 | 新股流通受限 |
| 3 | 300077 | 国民技术 | 994,593.25 | 0.84 | 新股流通受限 |
| 4 | 300082 | 奥克股份 | 952,387.45 | 0.81 | 新股流通受限 |
| 5 | 002387 | 黑牛食品 | 886,079.04 | 0.75 | 新股流通受限 |
| 6 | 300086 | 康芝药业 | 815,267.96 | 0.69 | 新股流通受限 |
| 7 | 002436 | 兴森科技 | 813,164.40 | 0.69 | 新股流通受限 |
| 8 | 002424 | 贵州百灵 | 728,871.84 | 0.62 | 新股流通受限 |
| 9 | 002401 | 交技发展 | 665,662.59 | 0.56 | 新股流通受限 |

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 | 113,248,571.19 |
| 本报告期基金总申购份额 | 11,193,847.51 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 18,021,847.32 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 106,420,571.38 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛积极配置债券型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛积极配置债券型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。

7.2 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。

7.3 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/或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。