长盛积极配置债券型证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年 9 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10月25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 10 月 22 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 2010 年 7 月 1 日起至 2010 年 9 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	358,299,196.93 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 07 月 01 日-2010 年 09 月 30 日)
本期已实现收益	2,438,360.72
本期利润	12,219,262.27
加权平均基金份额本期利润	0.0871
期末基金资产净值	436,349,472.40
期末基金份额净值	1.2178

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 9 月 30 日。

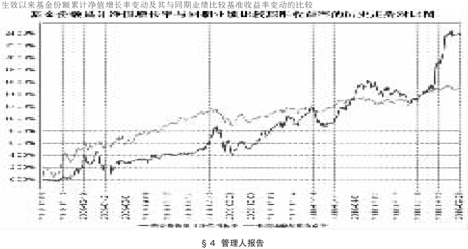
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	9.78%	0.37%	2.53%	0.14%	7.25%	0.23%

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,CFA(美国特许金融分析师)。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,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(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、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日;

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

三季度股票市场出现较大幅度的上涨,但结构分化依然明显。中小板指数涨幅 29.74%,收盘价创历史新高,但上证 50 指数本季度仅上涨 5.17%,大盘股和中小盘股票的分化继续扩大。

固定收益市场,由于 CPI 受猪肉、粮食等价格影响在季度内超出市场预期,利率产品收益率普遍有较小幅度的上行。在可转债市场,随着工行转债的顺利发行,转债市场的流动性得到进一步改善。

长盛积极配置债券基金在三季度初及时提高了包括股票和可转债在内的权益资产比重,较好的分享了本轮股票市场上涨的收益。由于遭遇到了较大幅度的申赎,同时基于对通胀不确定性的担忧,在债券市场上我们继续以保持流动性为主。

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 1.2178 元,本季度净值增长率为 9.78%,高于同期比较基准 7.25 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

就中国的未来发展来看,站在世界第二大经济体的起点上,未来若干时刻经济增速放缓几乎是必然的。不应该对未来增长寄予过高期望,但也没有必要过度悲观。

中国仍然有城镇化和消费升级的巨大潜力。从目前我国城镇化水平来看,我国目前的城镇化率约为 46%,这一水平不仅低于发达国家,也低于世界平均水平。03 年、06 年在汽车产业蓬勃之际,大量的声音质疑中国汽车消费遭遇需求、城市容量、居民消费力的瓶颈,产能过剩之音不绝于耳,可在 2009 年,中国就超越美国成为全球最大的汽车消费市场。站在国民利益的角度上,为什么不能预期中国的人均消费能力、生活质量会逐步达到中等发达国家水平呢?如果我们的人均消费能力、生活质量达到了中等发达国家水平,我们的经济总量会是一个什么样的水平?中期来看,城镇化、消费升级始终会是中国未来五到十年非常重要的投资命题

即便中国经济真的增速放缓,增长水平下一个台阶,仍然有一个重要的变量值得考虑,就是估值。在考虑结构性因素的前提下,股票市场很多传统产业的估值水平无论纵向还是横向比较,起码能用合理来形容。

基于上述判断,本基金将坚持绝对收益理念,密切关注通胀水平的变化,保持组合的流动性,并寻找有安全边际的投资机会。

§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	43,510,574.15	9.66
	其中:股票	43,510,574.15	9.66
2	固定收益投资	349,482,887.18	77.56
	其中:债券	349,482,887.18	77.56
	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	36,502,249.97	8.10
6	其他资产	21,092,843.99	4.68
7	合计	450,588,555.29	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	1,917,556.35	0.44
B	采掘业	1,416,600.00	0.32
C	制造业	26,879,287.12	6.16
C0	食品、饮料	8,740,747.30	2.00
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	3,032,549.84	0.69
C5	电子	1,626,849.87	0.37
C6	金属、非金属	1,571,200.00	0.36
C7	机械、设备、仪表	7,991,170.39	1.83
C8	医药、生物制品	3,916,769.72	0.90
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,412,230.68	0.32
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	3,745,500.00	0.86
H	批发和零售贸易	4,013,500.00	0.92
I	金融、保险业	1,308,000.00	0.30
J	房地产业	2,817,900.00	0.65
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	43,510,574.15	9.97

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	002461	珠江啤酒	245,846	5,863,427.10	1.34
2	600256	广汇股份	90,000	2,817,900.00	0.65
3	000061	农 产 品	120,000	2,556,000.00	0.59
4	000729	燕京啤酒	89,970	2,038,720.20	0.47
5	600406	国电南瑞	30,000	1,880,700.00	0.43
6	000999	华润三九	70,000	1,845,900.00	0.42
7	600089	特变电工	100,833	1,764,577.50	0.40
8	600309	烟台万华	100,000	1,699,000.00	0.39
9	600425	青松建化	80,000	1,571,200.00	0.36
10	600765	中航重机	79,981	1,439,658.00	0.33

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	120,448,587.40	27.60
2	央行票据	59,801,000.00	13.70
3	金融债券	69,879,000.00	16.01
	其中:政策性金融债	69,879,000.00	16.01
4	企业债券	22,274,817.20	5.10
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	77,079,482.58	17.66
7	其他	-	-
8	合计	349,482,887.18	80.09

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	010112	21国债⑿	651,850	66,227,960.00	15.18
2	010110	21国债⑽	430,330	43,678,495.00	10.01
3	113002	工行转债	319,750	35,693,692.50	8.18
4	113001	中行转债	320,460	33,731,619.60	7.73
5	080222	08国开 22	300,000	29,913,000.00	6.86

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	564,794.63
3	应收股利	-
4	应收利息	3,924,224.41
5	应收申购款	16,353,824.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,092,843.99

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	110003	新钢转债	2,438,469.90	0.56
2	110007	博汇转债	860,860.00	0.20
3	110078	澄星转债	69,327.50	0.02

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	002461	珠江啤酒	5,863,427.10	1.34	新股流通受限
2	600765	中航重机	1,439,658.00	0.33	重大事项停牌

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	106,420,571.38
本报告期基金总申购份额	282,081,076.38
减:本报告期基金总赎回份额	30,202,450.83
本报告期期末基金份额总额	358,299,196.93

§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。

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

2010 第三季度报告

2010年 9 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10月25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 10 月 22 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 7 月 1 日起至 2010 年 9 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	442,597,019.04 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 7 月 1 日-2010 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	12,578,510.93
2.本期利润	27,540,056.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0568
4.期末基金资产净值	568,320,187.52
5.期末基金份额净值	1.2841

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 9 月 30 日。

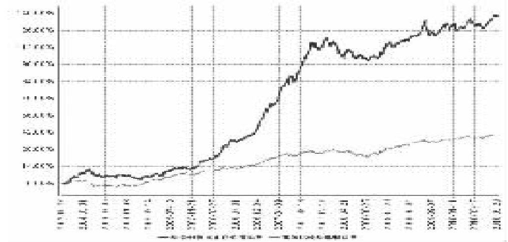
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	4.57%	0.23%	2.26%	0.11%	2.31%	0.12%

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 8 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、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日;

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

我们在中期报告中对宏观经济走势的判断在 3 季度得到了验证,市场参与者对宏观经济过度悲观的预期得到了修正,连续几个月的宏观经济数据也呈现出好于市场预期的格局,对经济二次探底的担忧出现了明显减退。物价走势上,在全球流动性泛滥的大格局下,我们前期持续关注的诸多冲击因素在 3 季度得到了集中体现,物价同比连创新高,市场对通胀的关注度陡然增加,对于不对称加息的关注度显著提升。

在基本面对债市影响趋于不利的大环境下,资金面的扰动还是影响了债市风险释放的进程,央行从 5 月末开始在公开市场连续 8 周净投放了近万亿资金,二次汇改的重启也在一定程度上影响了外部资金的流向,导致一度紧张的资金面重回充裕状态。

尽管如此,整个 3 季度来看,债市风险还是得到一定程度的释放。前两个月,非信用品市场收益率水平持续窄幅波动,我们一直相对看好的信用债收益率则进一步下探至年内新低,导致市场整体的信用利差水平再次迫近历史低点。结构上看,在保险公司投资限制放宽的预期下,低评级和无担保品种信用利差下降幅度尤为明显。但进入 9 月份,持续胶着的非信用债收益率水平开始波动上行,而在担忧加重的情况下,信用债收益率先期上行,信用利差触底回升。

股票市场则在 3 季度走出了一波恢复性上涨行情,上证综指从 2380 点最高冲至 2700 点,回顾来看,这一波行情大致可以分为估值性恢复和成长性上涨两个阶段。估值性恢复主要体现在银行、地产、机械等行业在 2 季度紧缩预期下,经历了一轮大幅下跌,从 7 月开始走出了一波估值性反弹;成长性上涨体现从 8 月中开始,银行、地产为代表的反弹开始结束,并趋于弱势,但农业、医药、食品在通胀预期下走出了一波强势反弹行业,有不少股票已经见到了年内新高。从风格表现看,成长性代表中小板指数更是见到了年内新高。

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。基于未来市场将进入弱市窄幅震荡下跌的判断,本组合在本季度内,将组合久期降到规定范围的最低限,较好的抵御了利率上行的风险,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。就权益类资产部分而言,4 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仓位;策略上采取自上而下与自下而上相结合的资产配置策略;总体来说,还是取得了相对较好的投资收益,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,在报告期内继续加强了转债部分的投资,通过对重点券种的研究,对转债部分作了适当的结构调整,报告期间获得了相当一部分的投资收益。

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 1.2841 元,本报告期份额净值增长率为 4.57%,同期业绩比较基准增长率为 2.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对于 4 季度的宏观经济走势仍然维持着先前的看法,认为经济增长的放缓将以"软着陆"的形态呈现,二次探底的概率极小。我们做出这一判断的依据在于,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。经济结构上,我们认为内需放缓、外需强劲的特征将得到修正,内需转强、外需趋弱将导致贸易顺差逐步回落,外部流动性增长的根基将遭到削弱。

物价方面,我们则继续持有相对谨慎的态度。虽然年内物价上涨尚属可控,但在全球流动性泛滥的格局下,多变的气候条件、农牧产品生产中存在的结构性问题以及诸多预期外因素进一步推升物价的可能将是我们持续关注的投资要点。

债券市场方面,在风险释放的初期阶段,我们将继续保持对风险和流动性的关注程度,延续谨慎的投资原则,重点关注并挖掘票息保护能力较强信用类产品的配置价值,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,本基金一方面将继续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;同时,在全球流动性泛滥大背景下,本基金将加强对人民币升值背景下资产重估脉络的把握;此外,将继续重点关注诸如有重组或资产注入等题材或热点事件的个股。

§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	87,489,359.46	15.10
	其中:股票	87,489,359.46	15.10
2	固定收益投资	444,067,421.60	76.66
	其中:债券	444,067,421.60	76.66
	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	38,962,342.06	6.73
6	其他资产	8,776,071.62	1.51
7	合计	579,295,194.74	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	10,671,497.50	1.88
B	采掘业	-	-
C	制造业	44,090,861.96	7.76
C0	食品、饮料	5,206,748.40	0.92
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	5,134,798.00	0.90
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	18,099,375.20	3.18
C8	医药、生物制品	12,258,279.56	2.16
C99	其他制造业	3,391,660.80	0.60
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,066,000.00	0.54
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	14,373,000.00	2.53
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	15,288,000.00	2.69
M	综合类	-	-
	合计	87,489,359.46	15.39

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	000917	电广传媒	700,000	15,288,000.00	2.69
2	002024	苏宁电器	900,000	14,373,000.00	2.53
3	300086	康芝药业	173,164	12,258,279.56	2.16
4	600066	宇通客车	499,922	10,453,369.02	1.84
5	600741	华域汽车	500,000	6,415,000.00	1.13
6	000895	双汇发展	89,880	5,206,748.40	0.92
7	002477	雏鹰农牧	100,565	5,194,182.25	0.91
8	002415	海康威视	50,000	3,614,500.00	0.64
9	002342	巨力索具	199,980	3,391,660.80	0.60
10	000713	丰乐种业	200,000	3,234,000.00	0.57

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	50,421,094.30	8.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	150,516,000.00	26.48
	其中:政策性金融债	150,516,000.00	26.48
4	企业债券	158,831,436.00	27.95
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	84,298,891.30	14.83
7	其他	-	-
8	合计	444,067,421.60	78.14

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	010308	03国债(8)	489,590	50,315,164.30	8.85
2	113001	中行转债	476,340	50,139,548.40	8.82
3	090411	09农发 11	400,000	40,276,000.00	7.09
4	080207	08国开 07	400,000	40,268,000.00	7.09
5	080223	08国开 23	400,000	39,792,000.00	7.00

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。

根据宇通客车股份有限公司 2009 年 12 月 11 日公告的《郑州宇通客车股份有限公司 2009 年巡检整改报告》显示,宇通客车被监管部门要求整改,并出具了整改报告,本基金做出以下说明:

1、宇通客车属于汽车行业,受益于大中型客车市场繁荣,公司销量显著提升,公司盈利持续较快增长,且盈利能力有望维持。公司的估值水平在汽车行业中一直属于较低的水平,投资价值逐渐被市场认可,估值水平有望得到提升。

2、对于该公司被监管部门要求整改的事件,本基金经过认真分析,做出如下判断:宇通客车通过中国证监会河南监管局现场巡检,改正了在公司治理、规范运作方面存在的不足。公司将进一步强化相关法律、法规、规范性文件的学习和贯彻,不断提高公司治理水平,确保公司持续、健康、稳定地发展。公司于 2009 年 12 月 11 日就整改报告进行了公告。因此,我们审慎地将宇通客车在配置上作为组合的阶段性投资品种。

3、今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述情况外,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	960,000.00
2	应收证券清算款	2,894,450.62
3	应收股利	-
4	应收利息	4,737,299.43
5	应收申购款	184,321.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,776,071.62

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 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	000895	双汇发展	5,206,748.40	0.92	重大事项
2	002477	雏鹰农牧	1,578,682.25	0.28	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	526,693,608.31
本报告期基金总申购份额	8,354,130.11
减:本报告期基金总赎回份额	92,450,719.38
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	442,597,019.04

§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。

长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

2010 第三季度报告

2010年 9 月 30 日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月25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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2010 年 10 月 22 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 2010 年 7 月 1 日起至 2010 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同智优势混合(LOF)
交易代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年 01 月 05 日
报告期末基金份额总额	3,129,330,248.35 份
投资目标	主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司,所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下,谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	本基金为主动管理的混合型基金,对各类资产采取适度灵活的资产配置。主要选股思路是采用自上而下的路径,投资策略上偏重选股能力的发挥。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益-较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。
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 07 月 01 日-2010 年 09 月 30 日)
本期已实现收益	2,480,597.34
本期利润	348,465,517.36
加权平均基金份额本期利润	0.1092
期末基金资产净值	2,891,883,587.58
期末基金份额净值	0.9241

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 9 月 30 日。

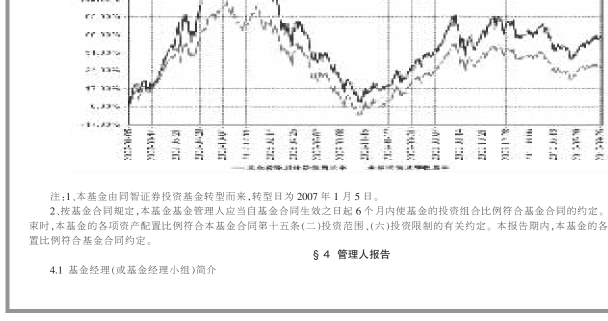
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	13.37%	0.88%	9.65%	0.85%	3.72%	0.03%

3.2.2 自基金转型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:1、本基金由同智证券投资基金转型而来,转型日为 2007 年 1 月 5 日。

2、按基金合同规定,本基金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。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十五条(二)投资范围、(六)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		
丁骏	本基金基金经理,同盛证券投资基金基金经理。	2007年 2 月 27 日	—	9年	男,1974 年 11 月出生,中国国籍。中国社会科学院经济学博士。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师;国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理;2003 年 6 月加入长盛基金管理有限公司,先后担任研究发展部行业研究员、机构理财部组合经理助理。现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金(本基金)基金经理,同盛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作出决定之日;

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、《长盛同智优势成长混合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

2010 年三季度 A 股市场在二季度的大跌之后触底反弹,首先是中大盘股短暂启动,接着立即进入又一轮中小盘股和主题投资的牛市,整个三季度上证指数上涨 11%,沪深 300 指数上涨 15%,涨幅大的股票集中在稀土、食品饮料、商业和医药,走势落后的主要是金融、交通运输和钢铁。7 月初采掘和工程机械行业在宏观调控放松的预期下率先反弹,随后类消费的食品饮料、中小市值商业零售企业和主题投资类公司大幅上涨。考虑到当时的估值风险,本基金在中小市值股票上的配置不高,并于 9 月初开始逐步对高估值的小盘股进行了减仓,由于对小盘股行情的节奏把握不到位,事后证明是减仓时间偏早,本基金的净值表现在三季度低于平均水平。但是,从稍长的投资时间段考虑,我们更倾向于逐渐将资金配置到很长时间以来都被低估的大盘蓝筹股。

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 0.9241 元,本报告期份额净值增长率为 13.37%,同期本基金业绩比较基准收益率为 9.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从国际综合经济环境看,美日等国的经济复苏进程缓慢,力度日减,经济发达国家存在很强的再次放松银根,加注流动性的预期,由此,各国货币汇率纷纷贬值,全球通胀预期高涨;从我国宏观经济形势看,整体上呈现出 GDP 增长率触底走稳,CPI 高位徘徊的态势;从我国经济政策取向来看,基本出发点是保持 GDP 持续稳定增长是作为第一位的政策目标,因此,对当前的 CPI 的容忍度在无形中不得不提高了,对于部分热点领域(如房地产价格问题)主要通过点对点式的行政手段来解决来遏制;从 A 股市场运行的自身特点来看,在流动性保持相对宽松的背景下,成长性较好的中小市值股票高歌猛进,其与大盘蓝筹股的估值差异接近或达到了历史高点。

综上所述,在较短的时期内,通胀预期将是 A 股市场的经济主背景。本基金下一阶段的投资策略将坚持上文所述的一方面逐步配置于估值水平较合理的中大盘蓝筹股票,另一方面重点关注通胀背景下的资源资产类股票。

由于通胀行情的特点是迅速猛烈,来的快也去的快。对于这类行情的风险,本基金判断如下:首先,密切跟踪国内 CPI 指数和资产价格变化的趋势,通胀形势越发展,政府采取措施的可能性和力度也随之增加;其次,关注调控政策的重心转移,一方面经济结构要转型要升级,另一方面,恐怕调控政策也要从过度依赖财政货币政策向放开垄断领域,提高整个经济的效率和竞争水平转变。最后,紧盯人民币升值预期变化导致的热线流动及其对货币政策的反向制约。

§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	1,921,185,911.03	65.35
	其中:股票	1,921,185,911.03	65.35
2	固定收益投资	7,350,835.50	0.25
	其中:债券	7,350,835.50	0.25
	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	1,009,042,172.18	34.32
6	其他资产	2,096,566.31	0.07
7	合计	2,939,675,485.02	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	8,988,800.00	0.31
B	采掘业	201,708,911.57	6.98
C	制造业	1,028,721,527.57	35.57
C0	食品、饮料	116,214,610.08	4.02
C1	纺织、服装、皮毛	16,134,346.06	0.56
C2	木材、家具	4,092,882.20	0.14
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	27,616,452.70	0.95
C5	电子	11,209,092.00	0.39
C6	金属、非金属	109,664,360.61	3.79
C7	机械、设备、仪表	503,757,203.40	17.42
C8	医药、生物制品	224,215,080.52	7.75
C99	其他制造业	15,817,500.00	0.55
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,880,000.00	0.41
E	建筑业	13,995,580.04	0.48
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	14,580,860.91	0.50
H	批发和零售贸易	161,849,736.81	5.60
I	金融、保险业	412,811,050.12	14.27
J	房地产业	13,798,675.20	0.48
K	社会服务业	14,235,067.66	0.49
L	传播与文化产业	38,615,701.15	1.34
M	综合类	-	-
	合计	1,921,185,911.03	66.43

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	601318	中国平安	2,966,298	156,887,501.22	5.43
2	600036	招商银行	10,792,244	139,759,559.80	4.83
3	600518	康美药业	4,549,611	84,895,741.26	2.94
4	600016	民生银行	13,423,445	68,459,569.50	2.37
5	002073	青岛软控	2,939,445	61,757,739.45	2.14
6	600694	大商股份	1,014,668	59,824,825.28	2.07
7	600089	特变电工	3,235,361	56,618,817.50	1.96
8	600631	百联股份	2,893,077	50,137,024.41	1.73
9	000858	五 粮 液	1,449,942	49,776,508.86	1.72
10	600031	三一重工	1,664,212	48,694,843.12	1.68

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	7,350,835.50	0.25
7	其他	-	-
8	合计	7,350,835.50	0.25

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	113002	工行转债	65,850	7,350,835.50	0.25

注:本基金本报告期末仅持有上述一支债券。

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

根据五粮液股份有限公司 2009 年 12 月 23 日公告的《宜宾五粮液股份有限公司关于完善公司治理结构的整改方案》显示,五粮液被监管部门要求整改,并出具了整改报告,本基金做出以下说明:

1、对于整个食品饮料行业和五粮液公司,本公司研究员今年以来一直看好和积极推荐,并有相关的研究报告。

2、基于相关研究,本基金判断,随着国家对整个消费类行业的支持,作为典型的消费类行业,食品饮料行业未来将保持稳定增长。同时五粮液作为国内高端酒具有较好的稀缺性以及提价空间;今年以来地方政府对公司的高管实行市值考核,使得高管的利益和股东的利益保持一致。对于该公司被监管部门要求整改的事件,本基金经过认真研,做出如下判断:在当地证监局进行现场检查并下发了《关于五粮液股份有限公司现场检查限期整改通知书》之后,该公司立即组织相关人员进行认真学习,对照现场检查发现的问题制定了切实可行的整改措施,于 2009 年 12 月 23 日就整改报告进行了公告。因此,我们审慎地将五粮液在配置上作为组合的阶段性重要投资品种。

3、今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述情况外,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	1,888,549.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	188,512.34
5	应收申购款	19,504.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,096,566.31

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

本基金报告期末未持有可转换债券。

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)	占基金资净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600631	百联股份	50,137,024.41	1.73	重大事项停牌

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	3,224,375,868.51
本报告期期间基金总申购份额	4,826,435.85
减:本报告期期间基金总赎回份额	99,872,056.01
本报告期期末基金份额总额	3,129,330,248.35

§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同智优势成长混合型证券投资基金的批复;
2、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛同智优势成长混合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。