长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:2011年10月26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2011年10月25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2011年7月1日起至2011年9月30日止。

§2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	69,499,095.22份	
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。	
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	
境外投资顾问	英文名称:GOLDMAN SACHS ASSET MANAGEMENT, L.P.	
	中文名称:高盛资产管理有限责任合伙	
境外资产托管人	英文名称:BANK OF CHINA（HONG KONG）	
	中文名称:中国银行（香港）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（2011年07月01日-2011年09月30日）
1.本期已实现收益	-5,837,868.92
2.本期利润	-12,527,194.44
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2022
4.期末基金资产净值	54,696,706.92
5.期末基金份额净值	0.787

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2011年9月30日。

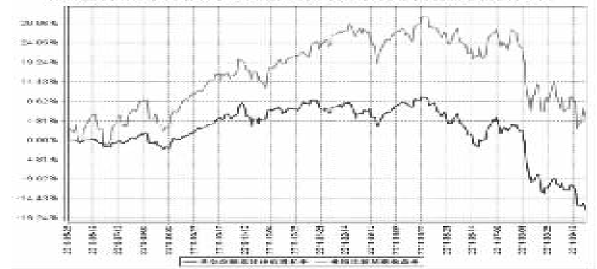
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-20.26%	1.25%	-16.65%	1.88%	-3.61%	-0.63%

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



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

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		
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	—	9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。
邓永健	本基金基金经理。	2010年5月26日	2011年8月2日	16年	男,1967年10月出生,中国香港籍。英国兰卡斯特大学工商管理硕士,CFA（美国特许金融分析师）。历任恩佩投资管理有限公司助理基金经理;元大京华证券（香港）有限公司高级经理;大福资产管理有限公司助理董事;星展资产管理（香港）有限公司总监及高级基金经理;加拿大宏利资产管理（香港）有限公司股票部行政总监;2007年12月起加入长盛基金管理有限公司,曾任本基金基金经理。目前已离职。

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。	17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《证券投资基金法》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 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.4.3 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。

4.5 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

在刚刚过去的三季度,全球资本市场在欧洲国家债务危机进一步恶化的背景下巨幅震荡下行,使本基金的净值承受了比较大的损失。在7月份市场仍主要以区间调整为主,美国及西欧核心国家上市公司良好的半年报表现是市场大体稳定的主要因素。然而,由于美国国债在到达法定上限后国会在提高上限和削减赤字方面存在种种分歧,标准普尔于8月5日宣布将美国的长期债券评级从最高等级AAA下调至AA+。这一标志性事件极大打击了市场信心,随即市场暴跌到今年以来的低位并反复震荡。

从经济的微观层面上看,美国经济的主要压力来自于房屋价格和就业市场的低迷,尽管复苏仍然在一个较缓慢的水平运行,但也没有进入二次衰退。美联储在资本市场信心缺失的情况下迅速表明态度,将在2013年之前维持较低的利率水平以促进企业的信贷和经济的复苏。然而较去年高的通货膨胀数字使得央行决策者无法立即推出市场期待的第三次量化宽松,仅仅是在9月的会议上宣布了债券购买计划的扭曲操作以进一步压低长期债券利率。

由于美国国债评级下调、欧洲债务危机深化等事件对经济的负面影响需要时间消化,本基金进一步降低了整体仓位,降低了包括欧洲、亚洲等市场的投资比重,但保持了对美国市场的投资仓位。由于欧债危机的不确定性以及中国政府货币紧缩的态度不变,以香港市场为首的亚太市场在9月跌幅迅速超越欧美市场,对本基金的影响相对较小。

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0.787元,本报告期份额净值增长率为-20.26%,同期业绩比较基准增长率为-16.65%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从美国经济分项数据来看,零售消费的增长情况没有高企的失业率数据反映的那么悲观。汽车消费的数据也超出市场预期,可能的原因来自于原油价格近期回落。虽然美国两党对于政府财政赤字的改善和就业促进计划方面的分歧依旧,美联储银行坚决执行宽松的货币政策有助于提振市场信心。另一方面,中国政府对于紧缩政策下部分中小企业融资困境的问题也表示了较大关注,市场开始憧憬政策的定向宽松。

由于欧洲债务危机逐步波及到意大利、西班牙等大国和欧洲的银行系统,上述国家的政府融资利率也继续攀升,加重了拯救经济的成本。上月比利时德克夏银行由于持有希腊等国债务而出现流动性危机,随即被拆分并国有化。市场上反复出现的流动性问题加剧了资本市场的波动,迫使欧洲的执政者紧急磋商,力图在近期推出扩大欧洲稳定基金的规模、向欧洲银行业注资等方案。

在欧洲危机暂时缓解的情况下,部分超跌的市场例如德国、香港有机会进行估值修复。然而,经济进一步复苏需要尘埃落定后各国财政政策的明朗,近期比较确定的机会来自于品牌消费、医疗保健、IT网络系统等方面。

§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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	32,504,527.06	58.93
	其中:普通股	31,041,545.83	56.28
	房地产信托凭证	1,462,981.23	2.65
2	基金投资	1,572,309.13	2.85
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,926,111.79	37.94
8	其他各项资产	154,792.04	0.28
9	合计	55,157,740.02	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票投资及存托凭证分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	23,412,722.58	42.80
香港	5,868,019.38	10.73
澳大利亚	1,265,155.97	2.31
英国	839,824.20	1.54
瑞士	606,275.59	1.11
德国	512,529.34	0.94

5.3 报告期末按行业分类的股票投资及存托凭证组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	9,718,449.20	17.77
医疗	4,803,720.93	8.78
能源	3,712,240.58	6.79
金融	3,172,384.15	5.80
材料	2,756,676.09	5.04
非必需消费品	2,714,446.02	4.96
必需消费品	2,623,957.97	4.80
工业	1,184,108.52	2.16
电信服务	1,033,077.96	1.89
公用事业	785,465.64	1.44
合计	32,504,527.06	59.43

注:本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准（GICS）进行行业分类

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	APPLE INC	-	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	700	1,695,652.55	3.10
2	CHEVRON CORP	-	CVX US	纽约证券交易所	美国	2,450	1,440,490.60	2.63
3	CONO-COPHILLIPS		COP US	纽约证券交易所	美国	3,000	1,207,176.80	2.21
4	MICROSOFT CORP	-	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	7,000	1,107,214.23	2.02
5	KUNLUN ENERGY CO	昆仑能源	135 HK	香港证券交易所	中国香港	120,000	1,064,573.18	1.95
6	SHANGHAI PHARM-H	上海医药	2607 HK	香港证券交易所	中国香港	75,000	1,037,176.08	1.90
7	AT&T INC	-	T US	纽约证券交易所	美国	5,700	1,033,077.96	1.89
8	SIMON PROPERTY	-	SPG US	纽约证券交易所	美国	1,450	1,013,422.26	1.85
9	PRICELINE.COM	-	PCLN US	纳斯达克证券交易所	美国	300	856,882.01	1.57
10	ARM HOLDINGS	-	ARM LN	伦敦证券交易所	英国	15,000	839,824.20	1.54

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	DB X-TRACKERS S&P 500 INVERSE DAILY ETF	指数	ETF基金	DB PLATINUM ADVISOR SA	597,562.42	1.09
2	DB X -TRACKERS EURO STOXX 50 SHORT DAILY ETF	指数	ETF基金	DB PLATINUM ADVISOR SA	537,581.72	0.98
3	LYXOR ETF EURO STOXX 50 DAILY DOUBLE SHORT	指数	ETF基金	LYXOR INTERNATIONAL ASSET MANAGEMENT	437,164.99	0.80

注:本基金本报告期末仅持有上述三支基金

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	121,244.88
3	应收股利	24,259.46
4	应收利息	2,568.42
5	应收申购款	6,719.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	154,792.04

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	54,682,751.25
报告期期间基金总申购份额	24,072,422.37
减:报告期期间基金总赎回份额	9,256,078.40
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	69,499,095.22

§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、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛环球景气行业大盘精选股票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和/或管理人互联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。

长盛动态精选证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:2011年10月26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2011年10月25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2011年7月1日起至2011年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛动态精选混合	
基金主代码	510081	
交易代码	前端:510081	后端:511081
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年5月21日	
报告期末基金份额总额	1,321,938,466.19份	
投资目标	本基金通过积极投资于能够充分分享中国经济长期增长的、在各自行业中已经或将要取得领袖地位的50家上市公司股票,在承担适度风险的前提下,追求当期收益和基金资产超过业绩比较基准的长期稳定回报。	
投资策略	本基金投资策略上偏重选股能力的发挥,时机的选择放在次要位置。	
业绩比较基准	中信标普A股综合指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的适度风险品种,在承担适度风险的前提下,获取长期稳定的收益。	
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（2011年7月1日-2011年9月30日）
1.本期已实现收益	8,058,903.09
2.本期利润	-150,487,474.89
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1141
4.期末基金资产净值	1,275,026,370.71
5.期末基金份额净值	0.9645

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2011年9月30日。

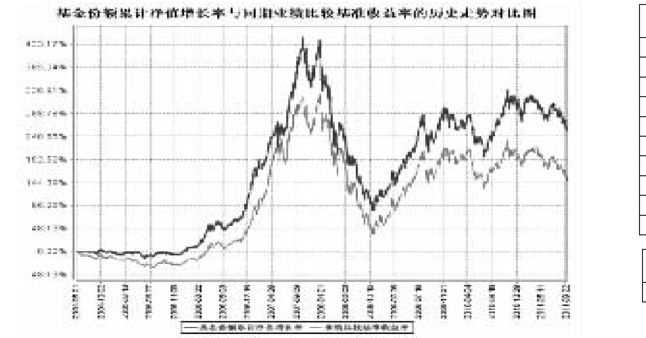
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-10.40%	1.09%	-14.16%	1.29%	3.76%	-0.20%

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		
邓永明	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,投资管理部副总监。	2008年8月11日	—	12年	男,1971年7月出生,中国国籍。毕业于山西农业大学,获学士学位。曾任大成基金管理有限公司研究员、交易员和基金经理助理。2005年7月底加入长盛基金管理有限公司投资管理部,曾任基金同益基金经理助理,同德证券投资基金基金经理,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任投资管理部副总监,长盛动态精选证券投资基金（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。

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、《长盛动态精选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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,金融危机的后遗症更加严重,"黑天鹅事件"频发。从国际形势看,欧美政府的偿债风险没有实质性解决,而通胀的抬头使得货币政策施展余地受限,市场信心受到极大的打击。就国内而言,经济也面临GDP增速放缓和通胀持续高位的双重压力,但通胀的高企,使得宏观调控政策首选了控通胀,与此同时,持续的紧缩政策导致民间实际利率上升,市场流动性持续吃紧,不断暴露出的地方政府融资平台偿债风险和民间高利贷资金链断裂风险,更使得市场信心不足。三季度,中国A股市场呈单边下跌之势。

本基金对欧债问题对市场的影响估计不足,主观判断从价值投资角度进行配置风险不大,导致仓位过高,净值受损,特别是对经济滞涨期的煤炭行业的风险判断出现偏差。

4.5 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0.9645元,本报告期份额净值增长率为-10.40%,同期业绩比较基准增长率为-14.16%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1、对宏观经济和证券市场的展望

从宏观角度分析,四季度,我们判断我国的实体经济会同比增速向下,通胀水平逐步见顶回落。从经济周期的角度看,经济将从广义的滞胀阶段开始走向衰退阶段。这个阶段绝对收益机会开始逐步来临。在通胀逐步见顶回落后,国家会把有质量的GDP增长作为下一个阶段经济增长的引擎,带动经济走出衰退。

从流动性分析,为应对债务危机,欧美仍会保持宽松的货币政策,全球流动性宽松的局面仍将存在,并将通过贸易和资本项目传导到我国,央行的外汇占款压力仍然存在,我们判断货币政策仍难以有全面性的放松,但为缓解中小企业融资困境,局部的结构性定向宽松将会出现。

展望后市,经过本轮下跌,A股的估值水平已经接近2008年金融危机时的同期水平,市场估值基本反映了对未来经济的悲观预期。随着市场对企业盈利业绩的向下修正,市场将完成最后一波情绪性的杀跌,底部构筑将更加坚实,我们将紧紧围绕通胀见顶和有质量的GDP增长两个主题,积极寻找投资机会。

2、本基金下阶段投资策略

我们看好以下阶段性投资机会:寻找受益于政府投资相关的信息服务业、节能环保、新材料等行业中业绩确定性高、估值合理的企业;寻找受益居民消费能力提高的品牌消费企业;此外,具有盈利模式或技术创新能力、能够跨越经济周期的一些科技类企业值得关注;关注未来政策可能放松后,一些与经济周期密切相关联的行业估值修复机会;此外,一些资源品中矿产资源增量与估值水平匹配的企业也值得关注。

§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	1,015,148,314.96	72.81
	其中:股票	1,015,148,314.96	72.81
2	固定收益投资	49,195,000.00	3.53
	其中:债券	49,195,000.00	3.53
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	100,000,000.00	7.17
	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	227,916,317.15	16.35
6	其他资产	1,915,189.77	0.14
7	合计	1,394,174,821.88	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	11,210,819.20	0.88
B	采掘业	220,654,291.64	17.31
C	制造业	480,304,272.63	37.67
C0	食品、饮料	166,772,178.43	13.08
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	70,341,534.16	5.52
C5	电子	12,200,000.00	0.96
C6	金属、非金属	55,504,567.66	4.35
C7	机械、设备、仪表	69,706,219.64	5.47
C8	医药、生物制品	105,779,772.74	8.30
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	13,492,450.00	1.06
E	建筑业	17,070,111.00	1.34
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	47,327,117.65	3.71
H	批发和零售贸易	32,506,828.90	2.55
I	金融、保险业	135,763,322.92	10.65
J	房地产业	45,602,775.90	3.58
K	社会服务业	11,216,325.12	0.88
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,015,148,314.96	79.62

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	600036	招商银行	5,300,394	58,622,357.64	4.60
2	000937	冀中能源	2,201,850	51,985,678.50	4.08
3	000858	五粮液	1,303,101	47,302,566.30	3.71
4	000983	西山煤电	1,991,200	42,432,472.00	3.33
5	601088	中国神华	1,604,947	40,669,356.98	3.19
6	600887	伊利股份	2,201,520	40,287,816.00	3.16
7	600267	海正药业	1,201,267	39,593,760.32	3.11
8	000581	威孚高科	1,200,118	39,147,849.16	3.07
9	000656	金科股份	2,979,807	36,353,645.40	2.85
10	600549	厦门钨业	904,509	35,990,413.11	2.82

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	49,195,000.00	3.86
	其中:政策性金融债	49,195,000.00	3.86
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	49,195,000.00	3.86

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	110245	11国开45	500,000	49,195,000.00	3.86

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。

一、根据西山煤电股份有限公司2011年4月6日公告的《山西西山煤电股份有限公司关于山西证监局现场检查有关问题的整改报告的公告》显示,公司在公司治理、独立性、内部控制的建立和执行、信息披露、对外担保、财务核算等六方面的问题,被监管部门要求进行整改,并出具了整改报告。本基金做出以下说明:

1、基于相关研究,本基金判断,随着经济的复苏,下游钢铁、水泥、化工等行业的开工量逐渐加大,冶金煤在未来会出现持续紧张的局面,同时由于冶金煤的稀缺性,国家提出对冶金煤的保护性开采政策,这也加剧了冶金煤长期偏紧的供需格局。作为冶金煤储量最大、最优质的龙头企业,西山煤电的资源价值应该得到资本市场的溢价。同时公司未来有继续收购集团优质资产最终完成整体上市的可能,无论从内生性还是外延式都具备投资价值。

2、对于该公司被监管部门要求整改的事件,本基金经过认真调研,做出如下判断:在中国证监会山西监管局对该公司进行了现场检查并下发了《关于对山西西山煤电股份有限公司的责令改正决定书》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2011年4月6日就整改报告进行了公告,截至本公告签署之日,公司已经着手落实整改措施。因此,我们审慎地将西山煤电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。

二、根据宜宾五粮液股份有限公司2011年5月27日公告的《关于收到中国证监会行政处罚决定书的公告》显示,公司因违规披露、信息披露不及时、不完整等事项受到中国证监会行政处罚,公司表示接受证监会的行政处罚,吸取教训,不断完善公司治理和合规经营。本基金做出如下说明:

1、对于白酒行业及五粮液,本公司研究员自二季度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,随着我国国民收入的提高、城镇化的快速推进,我国白酒行业将继续维持高速增长,作为国内最大的白酒生产企业,高端白酒中的代表性企业之一,五粮液公司的投资价值会得到提升,对于该公司被监管部门处罚的事件,本基金经过认真研究,做出如下判断:公司自2009年底以来,对公司治理、信息披露、关联交易进行了很大改进,并使得公司业绩保持了良好的发展势头。公司也在2011年5月27日的公告中,对公司整改情况进行了披露。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。

本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	1,460,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	349,282.10
5	应收申购款	105,907.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,915,189.77

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

报告期期初基金份额总额	1,247,309,423.02
报告期期间基金总申购份额	104,735,178.20
减:报告期期间基金总赎回份额	30,106,135.03
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,321,938,466.19

§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、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》;
3、《长盛动态精选证券投资基金托管协议》;
4、《长盛动态精选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。

长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）

2011 第三季度 报告

2011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:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2011年10月26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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月25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其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至2011年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛沪深300指数（LOF）
基金主代码	160807
交易代码	160807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年8月4日
报告期末基金份额总额	223,232,664.36份
投资目标	本基金采取指数化投资,跟踪沪深300指数,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于4%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性,通过抽样方式构建基金股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×沪深300指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金是股票指数型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型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	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（2011年7月1日-2011年9月30日）
1.本期已实现收益	-391,197.92
2.本期利润	-30,707,233.91
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1417
4.期末基金资产净值	188,189,110.08
5.期末基金份额净值	0.843

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2011年9月30日。

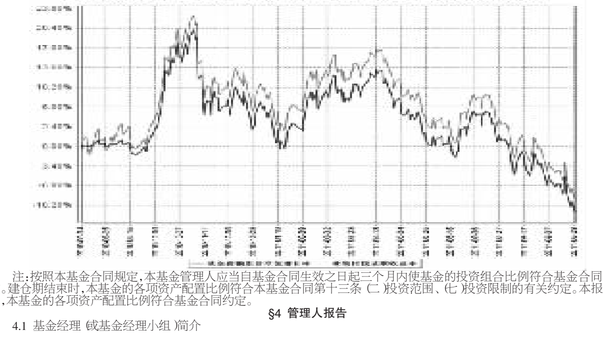
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-14.33%	1.24%	-14.44%	1.25%	0.11%	-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



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

注:按照本基金合同规定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起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、（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		
刘斌	本基金基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,金融工程与量化投资部副总监。	2010年8月4日	—	5年	男,1979年6月出生,中国国籍。清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司,在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理等职务,现任金融工程与量化投资部副总监,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金（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 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、《长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）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运作分析

3季度在全球经济前景持续恶化和欧洲债务危机影响下,A股市场连续下行,其估值水平已创出历史新低。其中食品饮料、餐饮旅游和信息服务等防御性板块跌幅较少,而建筑建材、家用电器和交运设备等周期性板块领跌大市。在风格特征上,小盘股和大盘股表现相差不大。

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。

4.5 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0.843元,本报告期份额净值增长率为-14.33%,同期业绩比较基准增长率为-14.44%。本报告期内日均跟踪误差为0.0458%,年度化跟踪误差为0.7235%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前股票市场处于各种因素的弱平衡状态,指数可能在一段时间内维持震荡格局。市盈率已经到达历史低位,估值修复行情亦有望在4季度出现。能够影响这种弱平衡的阶段性因素包括:国内财政和货币政策的微调、欧债危机的发展趋势和相关产业政策变化等。

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）	占基金总资产比例（%）
1	权益投资	174,542,465.06	92.37
	其中:股票	174,542,465.06	92.37
2	固定收益投资	668,282.50	0.35
	其中:债券	668,282.50	0.35
	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	12,939,731.21	6.85
6	其他资产	802,393.83	0.42
7	合计	188,952,872.60	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	1,024,435.88	0.54
B	采掘业	21,110,495.75	11.22
C	制造业	59,507,509.07	31.62
C0	食品、饮料	11,073,787.82	5.88
C1	纺织、服装、皮毛	661,758.00	0.35
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,829,201.96	2.03
C5	电子	1,638,424.49	0.87
C6	金属、非金属	14,921,375.97	7.93
C7	机械、设备、仪表	19,820,720.11	10.53
C8	医药、生物制品	7,020,342.16	3.73
C99	其他制造业	541,898.56	0.29
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,797,767.16	2.02
E	建筑业	5,067,153.68	2.69
F	交通运输、仓储业	6,187,705.98	3.29
G	信息技术业	5,182,103.29	2.75
H	批发和零售贸易	5,549,517.61	2.95
I	金融、保险业	53,379,352.94	28.36
J	房地产业	8,142,069.33	4.33
K	社会服务业	1,226,453.01	0.65
L	传播与文化产业	386,810.98	0.21
M	综合类	3,658,278.38	1.94
	合计	174,219,653.06	92.58

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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	322,812.00	0.17
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	322,812.00	0.17
C7	机械、设备、仪表	-	-
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	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
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	-	-
M	综合类	-	-
	合计	322,812.00	0.17

5.3 报告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	600016	民生银行	1,456,567	8,040,249.84	4.27
2	601166	兴业银行	433,883	5,375,810.37	2.86
3	601328	交通银行	1,044,997	4,681,586.56	2.49
4	600000	浦发银行	511,407	4,367,415.78	2.32
5	601318	中国平安	127,136	4,267,955.52	2.27
6	600030	中信证券	339,806	3,822,817.50	2.03
7	600519	贵州茅台	15,816	3,014,371.44	1.60
8	601088	中国神华	117,896	2,987,484.64	1.59
9	601398	工商银行	744,127	2,961,625.46	1.57
10	601601	中国太保	143,383	2,651,151.67	1.41

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	000959	首钢股份	74,725	322,812.00	0.17

注:本基金本报告期末仅持有上述一支积极投资股票。

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	中期票据	-	-
7	可转债	668,282.50	0.36
8	其他	-	-
9	合计	668,282.50	0.36

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	110015	石化转债	6,200	541,942.00	0.29
2	110018	国电转债	970	94,487.70	0.05
3	110016	川投转债	360	31,852.80	0.02

注:本基金本报告期末仅持有上述三支债券。

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

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	-
3	应收股利	21,671.51
4	应收利息	4,328.88
5	应收申购款	526,393.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	802,393.83

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	110015	石化转债	541,942.00	0.29
2	110016	川投转债	31,852.80	0.02

5.8.5 报告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不存在流通受限情况。

报告期末积极投资前五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	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000959	首钢股份	322,812.00	0.17	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	213,721,854.86
本报告期期间基金总申购份额	19,697,923.92
减:本报告期期间基金总赎回份额	10,187,114.42
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	223,232,664.36

§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沪深300指数证券投资基金（LOF）的批复;
2、《长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）基金合同》;
3、《长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）托管协议》;
4、《长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）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/或管理人互联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。