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
送出日期:2012年3月28日

长盛积极配置债券型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年12月31日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司(以下简称:中国建设银行)根据本基金合同规定,于2012年3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2011年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛积极配置债券
基金主代码	080003
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8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
报告期末基金份额总额	910,119,615.60份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	尹东
	联系电话	010-82019988	010-67595003
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	010-67595096
传真		010-82255988	010-66275853

2.4 信息披露方式

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

§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

3.1.1期间数据和指标	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-6,384,569.26	22,522,612.44	18,541,351.89
本期利润	-38,511,681.95	25,745,673.81	16,107,821.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0341	0.0805	0.0524
本期基金份额净值增长率	-3.30%	15.54%	7.65%
3.1.2期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	0.0105	0.0197	0.0890
期末基金资产净值	972,633,837.69	1,419,051,887.30	153,403,969.04
期末基金份额净值	1.0687	1.1052	1.1049

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(为期末余额,不是当期发生数)。表中的"期末"均指本报告期最后一日,即12月31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
过去三个月	2.16%	0.35%	3.08%	0.18%	-0.92%	0.17%
过去六个月	-2.46%	0.32%	1.47%	0.17%	-3.93%	0.15%
过去一年	-3.30%	0.29%	2.49%	0.18%	-5.79%	0.11%
过去三年	20.27%	0.33%	10.64%	0.20%	9.63%	0.13%
自基金合同生效起至今	23.44%	0.32%	16.52%	0.22%	6.92%	0.10%

注:本基金业绩比较基准:中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%

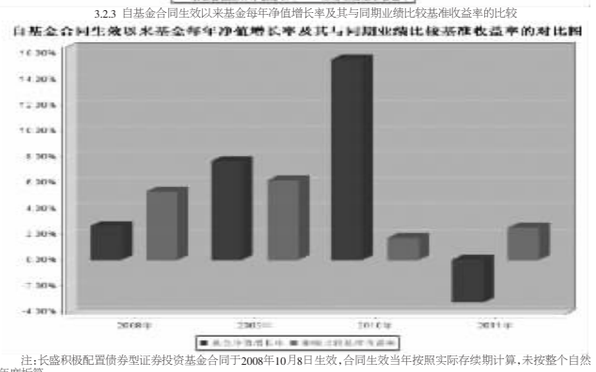
中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300支A股作为样本编制而成的成份股指数。沪深300指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照90%、10%的比例采取再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:长盛积极配置债券型证券投资基金合同于2008年10月8日生效,合同生效当年按照实际存续期计算,未按整个自然年度折算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红款	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011年	-	-	-	-	2011年度未分配收益
2010年	0.200	2,375,356.59	368,809.54	2,744,166.13	除息日:2010年1月20日
	1.500	130,383,451.47	43,489,083.33	173,872,534.80	除息日:2010年12月22日
2009年	-	-	-	-	2009年度未分配收益
合计	1.700	132,758,808.06	43,857,892.87	176,616,700.93	

§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2011年12月31日,基金管理人共管理两支封闭式基金、十七支开放式基金,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(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
蔡宾	本基金基金经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,固定收益部副总监。	2008年12月19日	—	7年	男,1978年11月出生,中国国籍,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。现任固定收益部副总监,长盛积极配置债券型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理。
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	—	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(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。
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	2011年2月15日	11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。曾任本基金基金经理,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。目前已离职。

注:1、上表基金经理及基金经理助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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定等;

3、投资中国证券业协会同意,目前蔡宾尚未已不再担任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,该基金由吴达同志继续负责管理,该事项公司已于2012年3月20日进行公告。

4.2 管理人对投资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》及其各项实施细则、《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,在认真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 管理人对投资期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对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

2011年,通货膨胀居高不下,经济下滑势头逐渐明显,滞胀的经济环境对资本市场产生严重的负面影响。年内出现了平台贷款的信用事件、通胀接连创出近3年的高位、房地产行业受到严格的调控、高铁安全事件影响到一系列的投资、贷款紧缩影响到相当大比例企业的资金状况,负面信息接踵而至,股票市场和债券市场均受到冲击。这种对于债券投资者和股票投资者均不利的局面是多年来很罕见的。

2011年,债券市场在通胀高企、货币紧缩的冲击下,利率产品收益率一度接近数年前的高点,信用产品收益率在经济下滑的担忧下创出了多年来的新高,而货币市场利率也在年中创出新高。在4季度随着通胀回落,债券市场出现一轮反弹行情。可转换债券在供给冲击和股票市场下跌的共同作用下,也出现剧烈的调整。2011年沪深300指数下跌25%,而由于估值过高和攻击冲击,中小板指数和创业板指数分别下跌37%和35.80%。

长盛积极配置债券基金在2011年的利率产品和信用产品的投资维持了低久期和低杠杆的策略,有效规避了债券市场大幅下跌对基金的影响。但由于在2011年持有较高比例的可转换债券资产和部分股票资产遭遇了较大损失,造成全年净值的下跌。

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1.0687元,本报告期份额净值增长率为-3.30%,同期业绩比较基准增长率为2.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年的经济形势至少比2011年会有所改善。一方面,通胀压力得到有效缓解,另一方面,政策微调对于稳定预期有着重要意义。总体上,滞胀的经济环境在2012年将会出现变化。债券市场收益率曲线有望在通胀回落的大背景下进一步陡峭化下移。

2011年由于信贷政策的紧缩,相当比例的企业在资金上遇到了很大困难,企业的经营环境较为恶劣,2012年如果得到更多的信贷支持,企业的经营状况将有明显改善,从而提高企业的信用水平和偿付能力。当前的信用利差仍然维持在多年来的历史高位,信用债券在2012年的表现较为乐观。与此同时,出于对政策放松条件下企业经营的宽松环境和股票资产较低的估值水平,可转换债券和部分股票资产可能会有较好的投资机会。

吸取教训,我们将更加重视每一类资产获取绝对收益的能力,特别是权益资产,虽然当前估值并不昂贵,但是我们仍然希望寻找能够持续提高内在价值的好公司,并结合价格的合理评估,来增加基金整体的长期价值。

4.6 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、估值目、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由公司副总经理(担任估值小组组长)、督察长(担任估值小组组长)及投资管理部、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。

4.7 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十六条中对基金利润分配原则的约定,本基金于2012年1月18日对2011年度收益进行了分配,分配金额为2,701,362.33元。

本基金截至2011年12月31日,期末可供分配收益为9,571,813.41元,其中:未分配收益已实现部分为9,571,813.41元,未分配收益未实现部分为52,942,408.68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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司注册会计师汪棣、张鸿2012年3月20日对本基金2011年12月31日的资产负债表、2011年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2012)第20323号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:长盛积极配置债券型证券投资基金

报告截止日:2011年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产:		
银行存款	39,340,994.19	38,192,015.64
结算备付金	7,213,521.75	8,639,210.51
存出保证金	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	1,126,807,236.11	1,387,219,432.70
其中:股票投资	109,739,200.34	250,106,207.87
基金投资	-	-
债券投资	1,017,068,035.77	1,137,113,224.83
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	26,980,676.17	1,802,931.31
应收利息	9,716,750.30	12,079,801.49
应收股利	-	-
应收申购款	2,433.58	16,022,561.15
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,210,311,612.10	1,464,205,952.80
负债和所有者权益	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010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	178,999,912.90	15,000,000.00
应付证券清算款	54,064,234.14	21,262,935.93
应付赎回款	2,571,928.64	7,052,719.68
应付管理人报酬	633,911.53	879,879.28
应付托管费	169,043.09	234,634.48
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	61,306.93	342,181.03
应交税费	521,857.50	65,796.90
应付利息	41,407.10	313.24
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	614,172.58	315,604.96
负债合计	237,677,774.41	45,154,065.50
所有者权益:		
实收基金	910,119,615.60	1,283,982,793.81
未分配利润	62,514,222.09	135,069,093.49
所有者权益合计	972,633,837.69	1,419,051,887.30
负债和所有者权益总计	1,210,311,612.10	1,464,205,952.80

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值1.0687元,基金份额总额910,119,615.60份。

7.2 利润表

会计主体:长盛积极配置债券型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入	-21,731,047.06	32,294,788.62
1.利息收入	26,815,794.36	7,685,114.51
其中:存款利息收入	545,768.18	487,537.84
债券利息收入	24,776,473.00	7,197,576.67
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,493,553.18	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-17,008,186.15	20,849,001.28
其中:股票投资收益	11,523,705.11	22,319,583.22
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-29,610,749.57	-1,508,113.39
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,078,858.31	37,531.45
3.公允价值变动收益(损失以"-"填列)	-32,127,112.69	3,223,061.37
4.汇兑收益(损失以"-"填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"填列)	588,457.42	537,611.46
减:二、费用	16,780,634.89	6,549,114.81
1.管理人报酬	9,273,572.51	2,797,466.21
2.托管费	2,472,952.69	745,990.98
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,081,481.57	818,889.45
5.利息支出	3,526,283.04	1,829,918.54
其中:卖出回购金融资产支出	3,526,283.04	1,829,918.54
6.其他费用	426,345.08	356,849.63
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-38,511,681.95	25,745,673.81
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-38,511,681.95	25,745,673.81

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛积极配置债券型证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31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)	1,283,982,793.81	135,069,093.49	1,419,051,887.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-38,511,681.95	-38,511,681.95
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)	-373,863,178.21	-34,043,189.45	-407,906,367.66
其中:1.基金申购款	362,249,057.85	36,864,367.19	399,113,425.04
2.基金赎回款	-736,112,236.06	-70,907,556.64	-807,019,792.70
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)	910,119,615.60	62,514,222.09	972,633,837.69
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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)	138,845,242.48	14,558,726.56	153,403,969.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,745,673.81	25,745,673.81
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)	1,145,137,551.33	271,381,394.05	1,416,518,945.38
其中:1.基金申购款	1,741,230,574.96	412,180,619.69	2,153,411,194.65
2.基金赎回款	-596,093,023.63	-140,799,225.64	-736,892,249.27
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)	-	-176,616,700.93	-176,616,700.93
五、期末所有者权益(基金净值)	1,283,982,793.81	135,069,093.49	1,419,051,887.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛积极配置债券型证券投资基金(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")正监许可[2008]第984号《关于核准长盛积极配置债券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《长盛积极配置债券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1,361,279,052.21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(2008)第144号验资报告予以验证,经向中国证监会备案,《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》于2008年10月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,362,144,547.24份基金份额,其中认购资金利息折合865,495.03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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛积极配置债券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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,其中投资于债券等固定收益类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%;投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的20%,其中,权证投资的比例不超过基金资产的3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于2012年3月20日批准报出。

7.4.2 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》、《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011年度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2011年12月31日的财务状况以及2011年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本期及上年度可比期间无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本期及上年度可比期间无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期及上年度可比期间无会计差错。

7.4.6 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[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,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)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

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、基金销售机构、注册登记机构
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构
国元证券	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展资产管理有限公司	基金管理人的原股东(2011年9月2日以前)
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东(2011年9月2日起)
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人的股东

注:1、根据本基金的基金管理人2011年9月2日发布的公告,经中国证监会证监许可[2011]1315号文核准,本基金的基金管理人原股东新加坡星展资产管理有限公司将其持有的本基金的基金管理人33%股权全部转让给新加坡星展银行有限公司。此次变更后本基金的基金管理人的股东及持股比例为:国元证券股份有限公司41%,新加坡星展银行有限公司33%,安徽省信用担保集团有限公司13%,安徽省投资集团有限责任公司13%。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金未开立关联方交易单元。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,273,572.51	2,797,466.21
其中:支付销售机构的客户维护费	1,787,172.23	421,325.69

注:支付基金管理人长盛基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,472,952.69	745,990.98

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2011年1月1日至2011年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	-	-	20,000,000.00	1,116.30
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	20,219,396.98	9,992,976.30	-	-	648,200,000.00	200,595.34

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
基金合同生效日(2008年10月8日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	50,001,240.00	50,001,240.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	50,001,240.00	50,001,240.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.49%	3.89%

7.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2011年12月31日		上年度末 2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国元证券	39,700,651.10	4.36%	39,700,651.10	3.09%

7.4.8.5 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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	39,340,994.19	377,273.95	38,192,015.64	451,540.56

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2011年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别:股票								
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
601669	中国水电	2011-9-29	2012-01-18	新股流通受限	4.50	4.09	8,594,675	38,676,037.50	35,152,220.75
300270	中威电子	2011-9-29	2012-01-12	新股流通受限	35.00	42.63	500,000	17,500,000.00	21,315,000.00
300283	温州宏丰	2011-12-30	-	新股流通受限	20.00	20.00	700,000	14,000,000.00	14,000,000.00
601555	东吴证券	2011-12-6	2012-03-12	新股流通受限	6.50	6.57	1,012,971	6,584,311.50	6,655,219.47
601928	凤凰传媒	2011-11-24	2012-02-29	新股流通受限	8.80	8.36	398,920	3,510,496.00	3,334,971.20
合计								80,270,845.00	80,457,411.42
7.4.9.1.2 受限证券类别:债券								
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受