

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

送出日期:2012年3月28日

\$1 重要提示

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，并对本内容的真实性、准确性、完整性、及时性以及其法律责任承担连带责任。基金管理人、基金托管人对本基金合同的任何修改，将提前公告并报中国证监会备案。
基金管理人、中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《销售办法》、《基金合同》及其他法律法规的规定，于2012年3月27日复核了本报告中的相关指标、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，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本报告期未发生需要披露的重大事项，投资者欲了解详细情况的，应阅读年度报告全文。

本报告期财务报告已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2011年5月24日至2011年12月31日。

\$2 基金简介**2.1 基金基本情况**

基金简称 长盛同鑫保本混合

基金代码 080907

交易代码 080907

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2011年5月24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

报告期末基金资产总额 2,093,050,351.04份

基金份额持有人数 不适用

2.2 基金产品说明

投资目标 依据本基金的定位，本基金通过投资组合保险策略，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，力争在基金合同存续期内实现稳定的、并具有较高收益的投资回报。

投资策略 本基金将按照一定的比例配置保险策略，CPPI策略配置于资产类与风险资产，用投资于固定收益类资产的现金流收入来抵消风险资产组合带来的最大亏损，并通过投资股票等风险资产来获得剩余部分的收益。

业绩比较基准 3年期定期存款利率+收益差

风险收益特征 本基金属于债券投资基金中的低风险品种，未持有到期而赎回或转换的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购转换持有的基金份额，不享受保本担保。

2.3 基金管理人及基金托管人

基金管理人 基金托管人

名称 长盛基金管理有限公司 中银银行股份有限公司

姓名 叶金松 唐澍敏

信息披露负责人 联系电话 010-82019988

电子邮箱 yj@csfunds.com.cn tgxpl@bank-of-china.com

客户服务电话 400-888-2666,010-62350088

传真 95566

010-82255988

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告的管理人互联网网址 http://www.csfunds.com.cn

基金管理人和基金托管人的办公地址

\$3 主要财务指标、基金净值表现及费率分配情况

3.1 主要统计数据和财务指标

2011年5月24日 本基金合同生效日 2011年12月31日

本期已实现收益 51,919,639.35

本期利润 57,151,664.22

加权平均基金份额本期利润 0.0218

本期基金份额净值增长率 2.30%

3.1.2 本期数据和指标 2011年末

期末可供分配利润 0.0201

期末基金份额净值 2,140,442,718.63

期末基金份额总额 1,023

注:本基金净值并不代表认购或申购基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

2.本报告期内本基金基本份额持有人数、其他收入(不含公允价值变动收益)除利息获得的余额,本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.报告期内可供分配利润采用期末可供分配利润中已实现的最低的孰低(本期末余额,不是当期发生数,表中的“期初数”指报告期最后一日,即12月31日)。

4.本基金基金合同于2011年5月24日生效,截至报告日本基金合同尚未满一年。

5.2.1 基金净值表现增长及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净价增长 份额净值增长 算术平均数 基准收益率 算术平均数(%)

①-③ ②-③

过去六个月 1.69% 0.05% 1.18% 0.02% 0.51% 0.03%

过去六个月 2.10% 0.05% 2.38% 0.01% -0.28% 0.04%

自基金合同生效 2.30% 0.05% 2.89% 0.01% -0.59% 0.04%

注:本基金业绩比较基准的构成及平均平衡率:

本基金业绩比较基准为基金合同成立日在中华人民共和国银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益。

本基金是定期存款类基金,保本期为3年,3年期定期存款基准收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使投资者理性判断本基金产品的风险特性和合理预期。

3.2.2 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 份额净值增长 算术平均数 基准收益率 算术平均数(%)

①-③ ②-③

过去六个月 1.69% 0.05% 1.18% 0.02% 0.51% 0.03%

过去六个月 2.10% 0.05% 2.38% 0.01% -0.28% 0.04%

自基金合同生效 2.30% 0.05% 2.89% 0.01% -0.59% 0.04%

注:本基金业绩比较基准的构成及平均平衡率:

本基金业绩比较基准为基金合同成立日在中华人民共和国银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益。

本基金是定期存款类基金,保本期为3年,3年期定期存款基准收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使投资者理性判断本基金产品的风险特性和合理预期。

3.2.3 本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 份额净值增长 算术平均数 基准收益率 算术平均数(%)

①-③ ②-③

过去六个月 1.69% 0.05% 1.18% 0.02% 0.51% 0.03%

过去六个月 2.10% 0.05% 2.38% 0.01% -0.28% 0.04%

自基金合同生效 2.30% 0.05% 2.89% 0.01% -0.59% 0.04%

注:本基金业绩比较基准的构成及平均平衡率:

本基金业绩比较基准为基金合同成立日在中华人民共和国银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益。

本基金是定期存款类基金,保本期为3年,3年期定期存款基准收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使投资者理性判断本基金产品的风险特性和合理预期。

3.2.4 本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 份额净值增长 算术平均数 基准收益率 算术平均数(%)

①-③ ②-③

过去六个月 1.69% 0.05% 1.18% 0.02% 0.51% 0.03%

过去六个月 2.10% 0.05% 2.38% 0.01% -0.28% 0.04%

自基金合同生效 2.30% 0.05% 2.89% 0.01% -0.59% 0.04%

注:本基金业绩比较基准的构成及平均平衡率:

本基金业绩比较基准为基金合同成立日在中华人民共和国银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益。

本基金是定期存款类基金,保本期为3年,3年期定期存款基准收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使投资者理性判断本基金产品的风险特性和合理预期。

3.2.5 本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 份额净值增长 算术平均数 基准收益率 算术平均数(%)

①-③ ②-③

过去六个月 1.69% 0.05% 1.18% 0.02% 0.51% 0.03%

过去六个月 2.10% 0.05% 2.38% 0.01% -0.28% 0.04%

自基金合同生效 2.30% 0.05% 2.89% 0.01% -0.59% 0.04%

注:本基金业绩比较基准的构成及平均平衡率:

本基金业绩比较基准为基金合同成立日在中华人民共和国银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益。

本基金是定期存款类基金,保本期为3年,3年期定期存款基准收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使投资者理性判断本基金产品的风险特性和合理预期。

3.2.6 本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 份额净值增长 算术平均数 基准收益率 算术平均数(%)

①-③ ②-③

过去六个月 1.69% 0.05% 1.18% 0.02% 0.51% 0.03%

过去六个月 2.10% 0.05% 2.38% 0.01% -0.28% 0.04%

自基金合同生效 2.30% 0.05% 2.89% 0.01% -0.59% 0.04%

注:本基金业绩比较基准的构成及平均平衡率:

本基金业绩比较基准为基金合同成立日在中华人民共和国银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益。

本基金是定期存款类基金,保本期为3年,3年期定期存款基准收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使投资者理性判断本基金产品的风险特性和合理预期。

3.2.7 本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 份额净值增长 算术平均数 基准收益率 算术平均数(%)

①-③ ②-③

过去六个月 1.69% 0.05% 1.18% 0.02% 0.51% 0.03%

过去六个月 2.10% 0.05% 2.38% 0.01% -0.28% 0.04%

自基金合同生效 2.30% 0.05% 2.89% 0.01% -0.59% 0.04%

注:本基金业绩比较基准的构成及平均平衡率:

本基金业绩比较基准为基金合同成立日在中华人民共和国银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益。

本基金是定期存款类基金,保本期为3年,3年期定期存款基准收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使投资者理性判断本基金产品的风险特性和合理预期。

3.2.8 本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 份额净值增长 算术平均数 基准收益率 算术平均数(%)

①-③ ②-③

过去六个月 1.69% 0.05% 1.18% 0.02% 0.51% 0.03%

过去六个月 2.10% 0.05% 2.38% 0.01% -0.28% 0.04%

自基金合同生效 2.30% 0.05% 2.89% 0.01% -0.59% 0.04%

注:本基金业绩比较基准的构成及平均平衡率:

本基金业绩比较基准为基金合同成立日在中华人民共和国银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益。

本基金是定期存款类基金,保本期为3年,3年期定期存款基准收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使投资者理性判断本基金产品的风险特性和合理预期。

3.2.9 本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 份额净值增长 算术平均数 基准收益率 算术平均数(%)

①-③ ②-③

过去六个月 1.69% 0.05% 1.18% 0.02% 0.51% 0.03%

过去六个月 2.10% 0.05% 2.38% 0.01% -0.28% 0.04%

自基金合同生效 2.30% 0.05% 2.89% 0.01% -0.59% 0.04%

注:本基金业绩比较基准的构成及平均平衡率:

本基金业绩比较基准为基金合同成立日在中华人民共和国银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益。

本基金是定期存款类基金,保本期为3年,3年期定期存款基准收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使投资者理性判断本基金产品的风险特性和合理预期。

3.2.10 本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 份额净值增长 算术平均数 基准收益率 算术平均数(%)

①-③ ②-③

过去六个月 1.69% 0.05% 1.18% 0.02% 0.51% 0.03%

过去六个月 2.10% 0.05% 2.38% 0.01% -0.28% 0.04%

自基金合同生效 2.30% 0.05% 2.89% 0.01% -0.59% 0.04%

注:本基金业绩比较基准的构成及平均平衡率:

本基金业绩比较基准为基金合同成立日在中华人民共和国银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益。

本基金是定期存款类基金,保本期为3年,3年期定期存款基准收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使投资者理性判断本基金产品的风险特性和合理预期。

3.2.11 本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 份额净值增长 算术平均数 基准收益率 算术平均数(%)