长盛同庆中证愿园园指数分级证券投资基金

（原长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型）

2012 第二季度 报告

圆园员圆年远月猿园日

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：圆园员圆年苑月圆园日

§员 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（以下简称：中国建设银行）根据《长盛同庆中证愿园园指数分级证券投资基金基金合同》（"本基金合同"）、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》规定，于圆园员圆年苑月员愿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。

圆园员圆年源月员远日，本基金管理人就长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金（"长盛同庆封闭"）转型事宜召开了基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，对长盛同庆封闭实施转型，上述决议已获中国证监会核准。

圆园员圆年缘月愿日，本基金管理人发布《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金之同庆粤、同庆月基金份额终止上市的公告》。自封闭期到期日次日即圆园员圆年缘月员远日起，长盛同庆封闭基金转型为长盛同庆中证愿园园指数分级证券投资基金，基础份额基金代码不变，仍为"员远园愿园远"。由《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同庆中证愿园园指数分级证券投资基金基金合同》生效，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《长盛同庆中证愿园园指数分级证券投资基金基金合同》为准。相关公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站（www.szse.cn）及本公司网站。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自圆园员圆年缘月员远日（基金合同生效日）起至圆园员圆年远月猿园日止（注：长盛同庆封闭报告期为自圆园员圆年源月员日起至圆园员圆年缘月员缘日（基金合同失效前日）止）。

§圆 基金产品概况（长盛同庆中证愿园园分级）

基金简称	长盛同庆中证愿园园分级
基金主代码	员远园愿园远
交易代码	员远园愿园远
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	圆园员圆年缘月员远日
报告期末基金份额总额	缘园圆远愿远缘远愿远份
投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在园.猿缘%以内，年跟踪误差控制在源%以内，以实现对中证愿园园指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上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平均跟踪误差小于园.猿缘%，且年化跟踪误差小于源%的投资目标。 当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证愿园园指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金将在基金合同生效远个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。
业绩比较基准	怨缘%×中证愿园园指数收益率+缘%×一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

下属三级基金的基金简称	长盛同庆愿园园粤	长盛同庆愿园园月	长盛同庆中证愿园园分级
下属三级基金的交易代码	员缘园园怨远	员缘园园怨苑	员远园愿园远
报告期末下属三级基金的份额总额	员猿怨苑缘缘远远员苑份	圆园怨远猿愿苑怨远份	员愿苑怨缘远园园源苑份
下属三级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	获取杠杆收益，风险和预期收益均高于长盛同庆中证愿园园分级份额。	高风险、高预期收益。

§圆 基金产品概况（长盛同庆封闭）

基金简称	长盛同庆封闭
基金主代码	员远园愿园远
交易代码	员远园愿园远
基金运作方式	契约型。自圆园园怨年缘月员圆日始，进入为期三年的封闭期。圆园员圆年缘月员缘日，封闭期届满，并于次日转型为长盛同庆中证愿园园指数分级证券投资基金。
基金合同生效日	圆园园怨年缘月员圆日
报告期末基金份额总额	员源远远苑缘缘源园园份
投资目标	长盛同庆封闭投资于具有稳健成长和业绩优良的上市公司股票，力求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	长盛同庆封闭在股票投资上，通过优选业绩优良、成长性稳定、在行业内具有核心竞争优势的上市公司股票进行投资，以谋求基金资产的长期稳定增长。在对市场趋势的有效判断的前提下，进行稳健的战略资产配置和积极的行业配置，同时根据对上市公司充分的基本面分析，挖掘行业中的价值个股。 长盛同庆封闭的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益。在实际的投资运作中，本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。
业绩比较基准	沪深猿园园指数收益率×愿园%+中证全债指数收益率×圆园%
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，长盛同庆封闭为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称	长盛同庆封闭粤	长盛同庆封闭月
下属两级基金的交易代码	员缘园园远远	员缘园园远苑
报告期末下属两级基金的份额总额	缘愿远远远猿园园园份	愿愿园园员圆源园园份
下属两级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、收益相对较高。

§猿 主要财务指标和基金净值表现

猿.员 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	长盛同庆中证愿园园分级 报告期（圆园员圆年缘月员远日-圆园员圆年远月猿园日）	长盛同庆封闭 报告期（圆园员圆年源月员日-圆园员圆年缘月员缘日）
员.本期已实现收益	-远猿缘猿缘远远源远.猿圆	源源员远怨缘园缘源远.远
圆.本期利润	-愿苑苑源缘怨远园.远缘	苑猿员苑猿远愿园猿.苑员
猿.加权平均基金份额本期利润	-园.园源园猿	园.园源园愿
源.期末基金资产净值	缘园缘源远园猿员园缘.园园	员园怨猿员缘园缘员园苑.苑员
缘.期末基金份额净值	园.怨远远	园.苑源远

注：员.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。

圆.长盛同庆中证愿园园分级所列数据截止到圆园员圆年远月猿园日；长盛同庆封闭所列数据截止到圆园员圆年缘月员缘日。

猿.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。

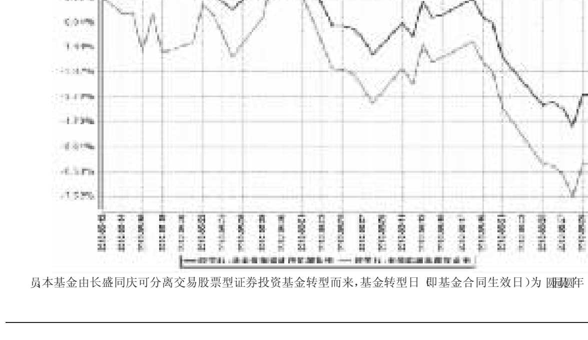
猿.圆 基金净值表现（长盛同庆中证愿园园分级）

猿.圆.员 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
圆园员圆年缘月员远日至圆园员圆年远月猿园日	-猿.源园%	园.愿愿%	-远.猿员%	员.园缘%	圆.怨员%	-园.员苑%

猿.圆.圆 自基金转型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

（圆园员圆年缘月员远日至圆园员圆年远月猿园日）



员.本基金由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为圆园员圆年缘月员远日，

猿.圆 基金净值表现（长盛同庆封闭）

猿.圆.员 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
圆园员圆年源月员日至圆园员圆年缘月员缘日	远.园愿%	园.怨缘%	缘.怨愿%	园.怨源%	园.员园%	园.园员%

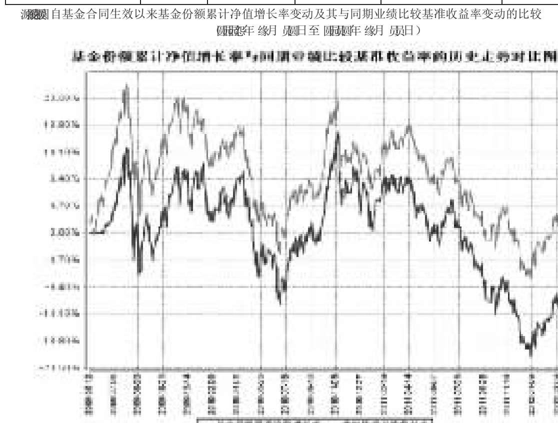
截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

圆.按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起远个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

猿.本基金的投资组合比例为：投资于股票的资产占基金资产的比例为怨园%-怨缘%，其中投资于中证愿园园指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的怨园%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为园-猿%，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缘%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

猿.圆.圆 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

（圆园园怨年缘月员圆日至圆园员圆年缘月员缘日）



§源 管理人报告

源.员 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王宁	本基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，投资管理部总监。	圆园园怨年缘月员圆日	原	员源年	男，员怨苑员年员圆月出生，中国国籍。毕业于北京大学光华管理学院，MBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。圆园园远年愿月加盟长盛基金管理有限公司，曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理等职务。现任投资管理部总监，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛同庆中证愿园园指数分级证券投资基金（本基金）基金经理。

注：员.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；

圆."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。

源.圆 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

圆园员圆年源月员日至圆园员圆年缘月员缘日，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、《长盛同庆可分离交易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。

圆园员圆年缘月员远日长盛同庆封闭基金转型为长盛同庆中证愿园园指数分级证券投资基金，即日起至报告期末，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、《长盛同庆中证愿园园指数分级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。

源.猿 公平交易专项说明

源.猿.员 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去源个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边怨缘%置信水平对员日、猿日、缘日的交易片段进行t检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

源.猿.圆 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的缘%的交易共有员次，为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

源.源 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

源.源.员 报告期内基金投资策略和运作分析

圆园员圆年圆季度，国际市场方面，欧洲危机持续升温，全球资本市场呈现不断下跌状态。

国内市场方面，虽然宏观预期经济政策有所放松和金融市场改革升温，但是实际宏观经济和上市公司业绩不断低于预期，打击国内市场不断下跌。

圆园员圆年圆季度，同庆基金顺利完成由主动基金向被动指数基金转型，在转型过程中本基金股票比例为适应转型方案，进行大规模调整。

在转型过程中，本基金继续利用市场资金阶段性紧张的机会，积极参与逆回购等交易提高组合资金利用效率。

源.源.圆 报告期内基金的业绩表现

截至圆园员圆年远月猿园日，长盛同庆中证愿园园分级份额净值为园.怨远远元，本报告期（圆园员圆年缘月员远日至圆园员圆年远月猿园日）份额净值增长率为-猿.源园%，同期业绩比较基准增长率为-远.猿员%。

截至圆园员圆年缘月员缘日，长盛同庆封闭份额净值为园.苑源远元，本报告期（圆园员圆年源月员日至圆园员圆年缘月员缘日）份额净值增长率为远.园愿%，同期业绩比较基准增长率为缘.怨愿%。

源.缘 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

圆季度，国内外市场在不断预期放松和救助的过程中，逐渐下跌，完全低于市场的想象。

由于欧洲危机属于格局性全面危机，可以预见短期之内难以出现实质性解决方案和完全好转迹象，市场仍然处在危机和拯救的不断反复过程中。

国内市场由于上市公司业绩整体低于预期，政策放松力度可能低于预期，行业和股票之间的差异会越来越大。

同庆基金由主动型基金转为指数基金，顺利完成转型，基金未来操作跟踪中证愿园园指数，属于标准型指数基金，本基金将按照基金合同规定为基金持有人提供优良的指数投资工具。

§缘 投资组合报告（长盛同庆中证愿园园分级）

（报告期为圆园员圆年缘月员远日至圆园员圆年远月猿园日）

缘.员 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（%）
员	权益投资	源愿员缘猿怨圆源猿员.远缘	愿缘.远缘
	其中：股票	源愿员缘猿怨圆源猿员.远缘	愿缘.远缘
圆	固定收益投资	原	原
	其中：债券	原	原
	资产支持证券	原	原
猿	金融衍生品投资	原	原
源	买入返售金融资产	原	原
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	原	原
缘	银行存款和结算备付金合计	怨源怨缘苑员园园缘.源猿	员远.怨怨
远	其他资产	员远缘源缘远猿远远.园员	园.猿远
苑	合计	缘远员圆缘园员园猿园.远愿	员园园.园园

缘.圆 报告期末按行业分类的股票投资组合

缘.圆.员 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（%）
粤	农、林、牧、渔业	猿远员愿怨远缘愿园	园.苑圆
月	采掘业	猿远员远圆源源缘源苑	苑.员远
悦	制造业	员远园圆愿员员愿园园缘	猿员.苑园
悦园	食品、饮料	猿缘源缘苑苑远缘园员员	远.苑缘
悦员	纺织、服装、皮毛	猿远园园苑愿源缘远苑	园.苑员
悦圆	木材、家具	原	原
悦猿	造纸、印刷	原	原
悦源	石油、化学、塑胶、塑料	员猿怨猿苑猿缘圆远远	圆.苑远
悦缘	电子	愿远园源愿愿怨远远	员.苑园
悦远	金属、非金属	猿猿员园愿员愿缘苑远	远.缘缘
悦苑	机械、设备、仪表	源源愿远远园员缘园员	怨.园缘
悦愿	医药、生物制品	圆园怨缘员源源苑员苑	源.员源
悦怨	其他制造业	员缘园愿远源愿远园	园.猿园
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	员缘园员缘园苑猿远	圆.怨苑
耘	建筑业	苑远园员员缘苑远远	员.缘园
云	交通运输、仓储业	员猿愿员缘员苑远远	圆.苑猿
郧	信息技术业	员源远园园缘猿远园	圆.愿怨
匀	批发和零售贸易	员源猿猿员怨远愿	圆.愿猿
陨	金融、保险业	员员员远园园愿愿远园	圆圆.园员
允	房地产业	圆园远苑园猿苑苑园	缘.园怨
运	社会服务业	源远员圆园远员园	园.怨员
蕴	传播与文化产业	猿缘苑远源愿远远	园.苑员
酝	综合类	苑园远园苑园远远	员.源员
	合计	源愿员缘猿怨圆源猿员	愿缘.远缘

缘.圆.圆 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（%）
粤	农、林、牧、渔业	原	原
月	采掘业	原	原
悦	制造业	原	原
悦园	食品、饮料	原	原
悦员	纺织、服装、皮毛	原	原
悦圆	木材、家具	原	原
悦猿	造纸、印刷	原	原
悦源	石油、化学、塑胶、塑料	原	原
悦缘	电子	原	原
悦远	金属、非金属	原	原
悦苑	机械、设备、仪表	原	原
悦愿	医药、生物制品	原	原
悦怨	其他制造业	原	原
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	原	原
耘	建筑业	原	原
云	交通运输、仓储业	原	原
郧	信息技术业	原	原
匀	批发和零售贸易	原	原
陨	金融、保险业	原	原
允	房地产业	原	原
运	社会服务业	原	原
蕴	传播与文化产业	原	原
酝	综合类	原	原
	合计	原	原

缘.猿 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（%）
员	远园员猿员愿	中国平安	圆源缘猿远缘	员园圆远园源园缘远园	圆.园猿
圆	园园园园园圆	万科粤	员员源园怨园远	怨员源远愿猿远园	员.愿员
猿	远园园园员远	民生银行	员远园园源远怨	愿愿源园苑猿远园	员.苑缘
源	远园园园猿远	招商银行	怨圆缘远园园	愿愿源缘缘源远园	员.苑缘
缘	远园员猿怨愿	工商银行	员猿猿源愿源缘	苑远远园猿怨园缘	员.缘圆
远	远园员猿圆愿	交通银行	员圆远猿愿缘猿	苑缘远源远缘苑员	员.缘园
苑	远园园园猿园	中信证券	缘员苑缘园园	苑猿园怨缘远园	员.源缘
愿	远园园缘员怨	贵州茅台	猿猿园苑	苑圆园愿源苑园	员.源猿
怨	远园员员远远	兴业银行	缘缘园缘员苑	远愿员远远缘远圆	员.猿缘
员园	远园园园园园	浦发银行	愿园源远远	远远园缘源远愿	员.猿员

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

缘.源 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

缘.缘 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。

缘.远 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。

缘.苑 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。

缘.愿 投资组合报告附注

缘.愿.员 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。

缘.愿.圆 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。

缘.愿.猿 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
员	存出保证金	猿愿缘员园园园园园
圆	应收证券清算款	原
猿	应收股利	苑猿远员远缘园
源	应收利息	猿园源缘园源员
缘	应收申购款	源缘怨源怨园
远	其他应收款	原
苑	待摊费用	原
愿	其他	原
怨	合计	员远缘源缘远猿远远园员

缘.愿.源 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可转换债券。

缘.愿.缘 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。

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

缘.愿.远 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。

§苑 投资组合报告（长盛同庆封闭）

（报告期为圆园员圆年源月员日至圆园员圆年缘月员缘日）

苑.员 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（%）
员	权益投资	缘愿员缘园员缘远园远	园.源员
	其中：股票	缘愿员缘园员缘远园远	园.源员
圆	固定收益投资	原	原
	其中：债券	原	原
	资产支持证券	原	原
猿	金融衍生品投资	原	原
源	买入返售金融资产	员园愿园园园园园园园园园	源苑.缘源
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	原	原
缘	银行存款和结算备付金合计	员员愿怨缘园圆源园园远源远	缘圆.园怨
远	其他资产	缘缘源员园园源远	园.园苑
苑	合计	圆园远苑缘远缘远缘远园	员园园.园园

苑.圆 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（%）
粤	农、林、牧、渔业	原	原
月	采掘业	原	原
悦	制造业	缘愿员缘园员缘远园远	园.源圆
悦园	食品、饮料	原	原
悦员	纺织、服装、皮毛	原	原
悦圆	木材、家具	原	原
悦猿	造纸、印刷	原	原
悦源	石油、化学、塑胶、塑料	缘愿员缘园员缘远园远	园.源圆
悦缘	电子	原	原
悦远	金属、非金属	原	原
悦苑	机械、设备、仪表	原	原
悦愿	医药、生物制品	原	原
悦怨	其他制造业	原	原
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	原	原
耘	建筑业	原	原
云	交通运输、仓储业	原	原
郧	信息技术业	原	原
匀	批发和零售贸易	原	原
陨	金融、保险业	原	原
允	房地产业	原	原
运	社会服务业	原	原
蕴	传播与文化产业	原	原
酝	综合类	原	原
	合计	缘愿员缘园员缘远园远	园.源圆

苑.猿 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（%）
员	远园园园远远	云天化	猿源缘源园园	缘愿员缘园员缘远园远	园.源圆

注：长盛同庆封闭报告期末仅持有一只股票。

苑.源 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

长盛同庆封闭报告期末未持有债券。

苑.缘 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

长盛同庆封闭报告期末未持有债券。

苑.远 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

长盛同庆封闭报告期末未持有资产支持证券。

苑.苑 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

长盛同庆封闭报告期末未持有权证。

苑.愿 投资组合报告附注

苑.愿.员 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。

本报告期内长盛同庆封闭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。

苑.愿.圆 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。

长盛同庆封闭投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

苑.愿.猿 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
员	存出保证金	猿愿缘员园园园园园
圆	应收证券清算款	原
猿	应收股利	缘苑远园猿员圆
源	应收利息	员员缘员猿员园员员
缘	应收申购款	原
远	其他应收款	原
苑	待摊费用	原
愿	其他	原
怨	合计	缘缘源员园园源远

苑.愿.源 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭报告期末未持有可转换债券。

苑.愿.缘 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
员	远园园园远远	云天化	缘愿员缘园员缘远园远	园.源圆	重大资产重组

苑.愿.远 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。

§愿 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛同庆愿园园粤	长盛同庆愿园园月	长盛同庆中证愿园园分级
基金合同生效日（圆园员圆年缘月员远日）基金份额总额	原	原	员源远远苑缘缘源园园
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	原	原	怨源源园远苑缘愿苑
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	原	原	怨远苑猿缘园源愿源
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	员猿怨苑缘缘远远员苑	圆园怨远猿愿苑怨远	-员源远远苑缘缘源园园
报告期期末基金份额总额	员猿怨苑缘缘远远员苑	圆园怨远猿愿苑怨远	员愿苑怨缘远园园源苑

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§怨 备查文件目录

怨.员 备查文件目录

员.中国证监会核准基金募集的文件；

圆.《长盛同庆中证愿园园指数分级证券投资基金基金合同》；

猿.《长盛同庆中证愿园园指数分级证券投资基金托管协议》；

源.《长盛同庆中证愿园园指数分级证券投资基金招募说明书》；

缘.《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》；

远.《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金托管协议》；

苑.《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金招募说明书》；

愿.法律意见书；

怨.基金管理人业务资格批件、营业执照；

员园.基金托管人业务资格批件、营业执照。

怨.圆 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。

怨.猿 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：源园园愿愿愿愿远远远、园员园原远圆猿缘园园愿愿

网址：http://www.csfunds.com.cn

长盛货币市场基金

2012 第二季度 报告

圆园员圆年远月猿园日

基金管理人：长盛基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司
报告送出日期：圆园员圆年苑月圆园日

§员 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于圆园员圆年苑月员怨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。

本报告期自圆园员圆年源月员日起至圆园员圆年远月猿园日止。

§圆 基金产品概况

基金简称	长盛货币
基金主代码	园愿园园员员
交易代码	园愿园园员员
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	圆园园缘年员圆月员圆日
报告期末基金份额总额	员园愿远远园园怨愿苑远份
投资目标	在力争本金安全、保证资产高流动性的基础上，追求高于业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金在投资组合管理中将采用主动投资策略，在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用，以提高投资决策的科学性与及时性，在控制风险的前提下，追求收益最大化。
业绩比较基准	银行一年定期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§猿 主要财务指标和基金净值表现

猿.员 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（圆园员圆年源月员日-圆园员圆年远月猿园日）
员.本期已实现收益	愿缘源怨源远苑愿怨
圆.本期利润	愿缘源怨源远苑愿怨
猿.期末基金资产净值	员园愿远远园园怨愿苑远

注：员.所列数据截止到圆园员圆年远月猿园日。

圆.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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

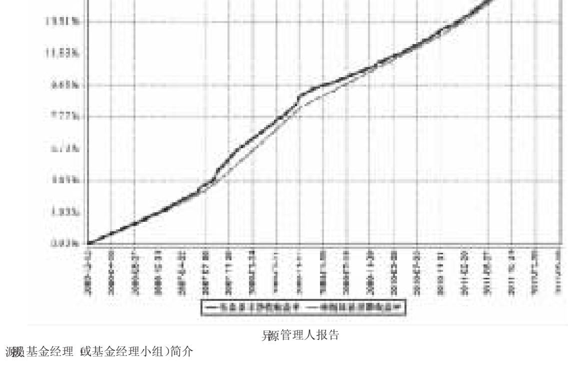
猿.圆 基金净值表现

猿.圆.员 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	员.园怨园苑%	园.园园源愿%	园.苑苑园苑%	园.园园园怨%	园.猿圆园园%	园.园园猿怨%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

猿.圆.圆 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§源 管理人报告

源.员 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
梁婷	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，社保组合组合经理，社保业务管理部副总监。	圆园员员年圆月员怨日	原	员猿年	女，员怨苑缘年远月出生，中国国籍。中国社会科学院研究生院经济学博士。曾任中国对外经济贸易信托投资公司投资银行部项目经理；圆园园圆年员月加入长盛基金管理有限公司，先后担任产品设计经理、固定收益研究员、社保组合经理助理，社保组合经理。现任社保业务管理部副总监，社保组合组合经理，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（本基金）基金经理。

注：员.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；

圆."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。

源.圆 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、《长盛货币市场基金基金合同》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。

源.猿 公平交易专项说明

源.猿.员 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去源个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边怨缘%置信水平对员日、猿日、缘日的交易片段进行t检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

源.猿.圆 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的缘%的交易共有员次，为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

源.源 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

源.源.员 行情回顾及运作分析

员.报告期内行情回顾

圆园员圆年圆季度，国内宏观经济继续下行，通胀大幅回落，信贷增速低于预期，央行降准、降息陆续进行，货币政策逐渐转向适度宽松。

货币市场上，圆季度整体利率水平呈下行趋势，公开市场操作总体平衡，央票继续停发。央行缘月份降准后利率水平明显下行，银行间市场苑天回购利率的中枢水平降至圆.缘%附近，各期限Shibor利率呈现明显的陡峭化下行，仅在季度末出现了明显的上行。短券方面，央票、短融在圆季度收益率都大幅下行，员年期央票收益率下行愿园bp左右，高评级短融收益率大幅下行了员园园bp，而AA、AA-等中低评级短融收益率平均大幅下行了员缘园bp左右。

圆.报告期内本基金投资策略分析

报告期内，综合考虑收益性和流动性要求，以及未来市场利率的变动趋势，本基金主要以银行存款、短期融资券、央票配置为主，适当进行逆回购操作。

源.源.圆 本基金业绩表现

圆园员圆年圆季度，长盛货币净值收益率为员.园怨园苑%，同期业绩比较基准收益率园.苑苑园苑%。

源.缘 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

员.圆园员圆年猿季度宏观经济和货币市场展望

展望猿季度，国内需求依然没有明显起色，物价虽已大幅下行但趋势依然向下，消费增速提升和基建投资扩张的空间相当有限。微观层面上，物价下行伴随着企业收入和利润的明显下行，经济中各类企业为应对经济调整而采取压缩长期资本开支、降低经营成本等自我调整，使得经济实际上已经处于向下自我加强的收缩阶段。

宏观政策方面，鉴于实体经济进一步衰退的状况得到确认，预计未来几个月主要央行还会继续采取宽松政策，放松货币条件，促进银行对实体经济的信贷支持，降准、降息政策有望继续出台，资金面将呈现适度宽松格局，货币市场利率有望在低位维持或继续下行。

圆.本基金圆园员圆年猿季度投资策略

基于上述判断，我们认为，由于利率水平已经明显下降，猿季度货币基金运作空间较圆季度减小，但风险依然不大；短券收益率未来收益率水平仍有下降的空间，但空间已缩小。信用产品方面，由于企业盈利处于下降趋势中，在获取票息收益的同时我们将高度重视信用风险的防范。此外，滚动配置银行存款到期期限。同时，我们须防范年末资金面紧张对于市场的冲击。基金将根据市场变化适时调整组合中类属资产的配置比例，适当缩短组合的平均剩余期限，努力做到组合资产流动性与收益性的良好匹配。

§缘 投资组合报告

缘.员 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（%）
员	固定收益投资	源愿园员员远怨愿猿园	猿圆.愿怨
	其中：债券	源愿园员员远怨愿猿园	猿圆.愿怨
	资产支持证券	原	原
圆	买入返售金融资产	员源源怨愿园远圆园源	员员.员缘
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	原	原
猿	银行存款和结算备付金合计	源愿圆怨员源远员缘	猿缘.猿远
源	其他资产	员缘源猿圆苑员远	愿.缘远
缘	合计	员园圆远园远源员缘苑	员园园.园园

缘.圆 报告期债券回购融资情况

序号	项目		占基金资产净值的比例（%）
员	报告期内债券回购融资余额		园.员猿
	其中：买断式回购融资		原
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
圆	报告期末债券回购融资余额	员缘苑怨怨缘园园园	员.缘猿
	其中：买断式回购融资	原	原

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的圆园%的说明：

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的圆园%。

缘.猿 基金投资组合平均剩余期限

缘.猿.员 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	员远园
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	员苑怨
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	员圆园

报告期内投资组合平均剩余期限超过员愿园天情况说明：

报告期内无投资组合平均剩余期限超过员愿园天情况。

缘.猿.圆 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
员	猿园天以内	员源.员源	员.缘猿
	其中：剩余存续期超过猿怨苑天的浮动利率债	原	原
圆	猿园天（含）—远园天	怨.缘怨	原
	其中：剩余存续期超过猿怨苑天的浮动利率债	园.怨猿	原
猿	远园天（含）—怨园天	怨.缘怨	原
	其中：剩余存续期超过猿怨苑天的浮动利率债	源.缘远	原
源	怨园天（含）—员愿园天	猿缘.圆怨	原
	其中：剩余存续期超过猿怨苑天的浮动利率债	原	原
缘	员愿园天（含）—猿怨苑天（含）	圆怨.愿缘	原
	其中：剩余存续期超过猿怨苑天的浮动利率债	原	原
	合计	员园愿.园远	员.缘猿

缘.源 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值的比例（%）
员	国家债券	原	原
圆	央行票据	缘怨园怨员园园苑远	缘.愿愿
猿	金融债券	怨圆苑愿怨怨源员怨	愿.缘猿
	其中：政策性金融债	怨圆苑愿怨怨源员怨	愿.缘猿
源	企业债券	原	原
缘	企业短期融资券	猿愿圆员怨愿苑缘员苑	圆园.愿缘
远	中期票据	原	原
苑	其他	原	原
愿	合计	源愿园员员远怨愿猿园	源源.圆远
怨	剩余存续期超过猿怨苑天的浮动利率债券	愿园苑愿员苑园园	苑.缘愿

缘.缘 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
员	园愿园圆苑远	园愿农发圆苑	缘园园园园园	缘园远缘远园圆员员	源.远远
圆	员员园员园源	员员央行票据源园	源园园园园园	猿怨源苑怨缘苑怨远	猿.远圆
猿	园远员圆园园圆	员圆湘投集CP园员	圆园园园园园	圆园园怨缘远缘远	员.愿远
源	园远员圆园远猿	员圆南航工CP园员	圆园园园园园	圆园园源园员怨远	员.愿缘
缘	园远员圆源园源	员圆粤打捞局CP园员	圆园园园园园	圆园园苑怨员员缘	员.愿缘
远	园远员圆怨怨员	员圆杭钢商贸CP园员	圆园园园园园	圆园员愿远远源园	员.愿缘
苑	园远员圆怨怨怨	员圆裕廊化工CP园员	圆园园园园园	圆园员员缘员缘	员.愿缘
愿	员员园员远	员园国开圆远	圆园园园园园	圆园园源员远员	员.愿缘
怨	园远员圆园员园	员圆富通CP园员	圆园园园园园	圆园园猿园远园园	员.愿缘
员园	园远员圆园远	员圆赣长运CP园员	圆园园园园园	圆园园园怨远源	员.愿缘

缘.远 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在园.圆%（含）-园.缘%间的次数	猿
报告期内偏离度的最高值	园.圆员怨愿%
报告期内偏离度的最低值	园.园员缘猿%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	园.园愿缘源%

缘.苑 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。

缘.愿 投资组合报告附注

缘.愿.员 基金计价方法说明

本基金的债券投资采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

缘.愿.圆 若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于猿怨苑天但剩余存续期超过猿怨苑天的浮动利率债券，应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的圆园%的情况。

本报告期内不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的圆园%的情况。

缘.愿.猿 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。本报告期内无需说明的证券投资决策程序。

缘.愿.源 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
员	存出保证金	原
圆	应收证券清算款	原
猿	应收利息	苑远远猿愿园园愿
源	应收申购款	怨苑苑缘源缘远远
缘	其他应收款	园远苑猿员源圆
远	待摊费用	原
苑	其他	原
愿	合计	员缘源猿圆苑员远

缘.愿.缘 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。

§远 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	远怨远远员猿苑源圆猿
本报告期基金总申购份额	圆圆苑员远员怨愿园苑
减：本报告期基金总赎回份额	员苑怨怨员怨源远怨
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	原
本报告期期末基金份额总额	员园愿远远园园怨愿苑远

§苑 备查文件目录

苑.员 备查文件目录

员.中国证监会核准基金募集的文件；

圆.《长盛货币市场基金基金合同》；

猿.《长盛货币市场基金托管协议》；

源.《长盛货币市场基金招募说明书》；

缘.法律意见书；

远.基金管理人业务资格批件、营业执照；

苑.基金托管人业务资格批件、营业执照。

苑.圆 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。

苑.猿 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：源园园愿愿愿愿远远远、园员园原远圆猿缘园园愿愿

网址：http://www.csfunds.com.cn