长盛电子信息产业股票型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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:2012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2012年10月24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2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛电子信息产业股票
基金主代码	080012
交易代码	080012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月27日
报告期末基金份额总额	166,460,791.54份
投资目标	本基金主要投资于电子信息产业上市公司股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	(1)分析宏观经济运行状况、市场估值水平等因素,动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。(2)发挥基金管理人研究团队和投资团队"自下而上"的主动选股能力,判断公司的核心价值与成长能力,选择具有竞争优势且估值具有吸引力的公司作为投资标的,根据市场波动情况精选个股,构建股票投资组合。
业绩比较基准	80%*中证信息技术指数收益率+20%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金产品,风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金,属于高风险、高预期收益的基金产品。
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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	2,103,462.33
2.本期利润	-636,738.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0031
4.期末基金资产净值	159,940,188.66
5.期末基金份额净值	0.961

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2012年9月30日。

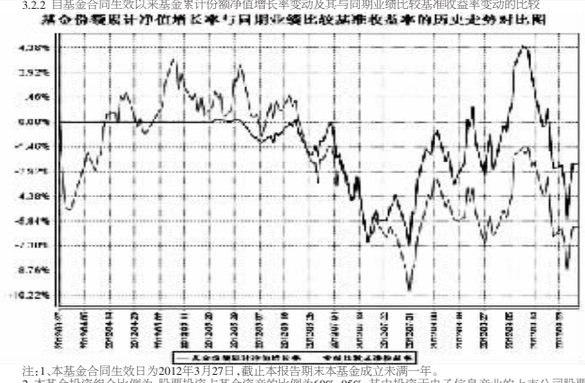
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-1.36%	1.30%	-4.09%	1.20%	2.73%	0.10%

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



注:1、本基金合同生效日为2012年3月27日,截止本报告期末本基金成立不满一年。

2、本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于电子信息产业的上市公司股票不低于股票类资产的80%;债券投资占基金资产的0%-40%;权证投资占基金资产的比例不高于3%;现金或者到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§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		
王克玉	本基金基金经理、同益证券投资基金基金经理。	2012年3月27日	—	9年	男,1979年12月出生,中国国籍。上海交通大学硕士。历任元大京华证券上海代表处研究员,天相投资顾问有限公司分析师,国都证券有限公司分析师。2006年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任同盛证券投资基金基金经理助理,高级行业研究员。现任同益证券投资基金基金经理,长盛电子信息产业股票型证券投资基金(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、《长盛电子信息产业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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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4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90%置信水平对1日、3日、5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。

4.3.2 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5%的交易共有12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。

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行情回顾及运作分析

2012年三季度A股市场呈现交替下跌的态势,期间上证指数和沪深300指数分别下跌6.26%和6.85%,而中小板指数和创业板指数分别下跌4.76%和5.10%。在7月份受到企业集中公布中期业绩盈利调整公告的影响,中小型公司出现集中下跌,导致中小板和创业板指数在7月份分别下跌了6.69%和6.84%;而进入8月份受到有效需求不足、地产价格波动等因素的影响,房地产等行业带动上证指数和沪深300指数出现下跌;尽管在9月上旬出现预期推动的短暂上涨,但是国际形势的复杂性导致反弹没有持续性。

从全市场行业指数的情况看,三季度各行业普遍下跌,跌幅相对较小的主要是信息服务、医药生物、餐饮旅游等稳定类行业,而跌幅较大的包括纺织服装、机械设备、房地产等。

三季度对基金从资产配置和个股两个层面进行调整。7月份在中小盘股票下跌的过程中,逐步增持了看好的个股,提高了权益类资产的市值占比。此后根据对行业主题和个股的研究,结合中期业绩和市场运行状况,集中增持了看好的个股,提高了组合的集中度。

4.4.2本基金业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为0.961元,本报告期份额净值增长率为-1.36%,同期业绩比较基准增长率为-4.09%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金是专注于投资电子信息产业上市公司的行业型基金,经过过去多年的快速增长,电子信息产业已经成为国内的支柱型产业,国内企业的综合竞争力得到大幅增强。在经济转型的背景下,电子信息行业既是转型的主要方向,同时也承担着为转型提供工具、改善效率的功能,必然会成为后期经济发展中的重点领域。同时我们也要看到行业内的技术发展很快,企业经营更容易受到技术进步、运营能力的影响,需要用更加开放的思维来观察、判断企业的投资价值。

前期我们对今后一个阶段行业内的关键主题从行业的长期空间、中短期内的业绩状况、企业技术和经营能力等方面进行初步的分析,从中选择云计算、市场营销、地理信息/导航、专用设备、照明等领域作为我们投资的重点,从目前的情况看有得有失,与预期的差异点主要是在于业绩的增速。后面需要保持对这类投资主题的观测和跟踪研究,及时主动的对组合进行调整,同时也会积极寻找新的投资机会。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	143,981,990.65	84.87
	其中:股票	143,981,990.65	84.87
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	24,522,849.24	14.45
6	其他各项资产	1,153,808.83	0.68
7	合计	169,658,648.72	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	51,112,919.82	31.96
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	43,744,333.90	27.35
C6	金属、非金属		
C7	机械、设备、仪表	7,368,585.92	4.61
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	73,375,482.46	45.88
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	7,431,681.45	4.65
L	传播与文化产业	12,061,906.92	7.54
M	综合类	-	-
	合计	143,981,990.65	90.02

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	300027	华谊兄弟	509,937	7,883,626.02	4.93
2	002400	省广股份	361,639	7,431,681.45	4.65
3	300182	捷成股份	290,889	7,126,780.50	4.46
4	300017	网宿科技	353,795	6,757,484.50	4.23
5	002465	海格通信	235,657	6,315,607.60	3.95
6	300177	中海达	512,632	6,223,352.48	3.89
7	002396	星网锐捷	364,258	6,177,815.68	3.86
8	002376	新北洋	309,682	6,165,768.62	3.86
9	002583	海能达	399,749	5,864,317.83	3.67
10	600460	士兰微	1,326,923	5,374,038.15	3.36

5.4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。

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

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。

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或受到公开谴责、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	737,177.88
3	应收股利	-
4	应收利息	5,215.81
5	应收申购款	161,415.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,153,808.83

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	占基金净资产比例(%)	流通受限情况说明
1	002583	海能达	5,864,317.83	3.67	临时停牌

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

报告期期初基金份额总额	228,478,280.85
报告期期间基金总申购份额	13,336,623.01
减:报告期期间基金总赎回份额	75,354,112.32
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	166,460,791.54

§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、《长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛电子信息产业股票型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛电子信息产业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。

长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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:2012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2012年10月24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2012年7月1日起至2012年 9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛创新先锋混合
基金主代码	080002
交易代码	080002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年06月04日
报告期末基金份额总额	178,379,924.79份
投资目标	选择具有创新能力和行业领先的上市公司,分享企业高速增长成果,在承担适度风险的基础上,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金为混合型证券投资基金,在资产配置上会考虑宏观经济因素、政策因素及市场估值水平。在个股选择上将根据不同行业景气度、"长盛创新选股体系"和"长盛优势选股体系"的股票筛选原则和方法优化个股投资比重。
业绩比较基准	沪深300指数x65%+上证国债指数x35%
风险收益特征	本基金强调精选投资价值较大的创新领先企业,突出资产配置的灵活性和主动性,风险收益略低于股票型基金,高于债券型基金和平衡型基金。
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

§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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-2,322,093.46
2.本期利润	-4,762,248.55
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0268
4.期末基金资产净值	174,224,360.80
5.期末基金份额净值	0.9767

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2012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	-2.68%	0.85%	-4.13%	0.77%	1.45%	0.08%

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

注:按照基金合同规定,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,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四条(二)投资范围、(七)投资禁止行为与限制的有关约定。

§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		
李庆林	本基金基金经理,长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理,社保组合组合经理。	2010年3月3日	—	9年	男,1974年10月出生,中国国籍。中国人民大学硕士。曾先后在长城证券有限公司、国元证券有限公司和建信基金管理有限公司担任研究员等职务。2009年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究发展部副总监。现任社保组合组合经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛同祥泛资源主题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、《长盛创新先锋灵活配置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

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4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90%置信水平对1日、3日、5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。

4.3.2 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5%的交易共有12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。

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

三季度,中国经济增速显著下降,尤其是名义经济增速更是下降明显。中国经济的调整更多地是政府主动宏观调控的结果。经济的调整对资本市场影响很大,指数在上半年下降的通道中持续调整。尽管指数跌幅较小,但是对市场参与人士的心理冲击较大。整体市场处于一种悲观观望的情绪之中,即便偶有反弹,但基本上也是昙花一现。

三季度,我们基本上维持了上半年的配置,依然重仓持有大消费板块,包括食品饮料和医药行业。

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0.9767元,本报告期份额净值增长率为-2.68%,同期业绩比较基准增长率为-4.13%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

九月份的数据给了投资者一些乐观的理由:中国的经济增速依然保持在高位,出口数据创历史新高。这其实说明中国依然有保持持续增长的基础。不过,相关数据都是在社会融资总量、货币供给保持高位运行的结果。在社会流动性依然充足的情况下,资产价格的泡沫得以维系。中国经济增长结构仍然呈现病态。

中国经济仍然处于漫长的结构调整过程中。与之相对对应取的是股市调整也将漫漫长夜无期时。我们仍然会坚持大消费的配置策略,在市场震荡的情况下,寻找一些安全边际较大的个股进行投资。

§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	122,204,222.80	67.85
	其中:股票	122,204,222.80	67.85
2	固定收益投资	31,400,000.00	17.43
	其中:债券	31,400,000.00	17.43
	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	24,828,309.20	13.78
6	其他资产	1,681,636.95	0.93
7	合计	180,114,168.95	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	102,461,047.34	58.81
C0	食品、饮料	39,920,372.70	22.91
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	2,658,000.00	1.53
C5	电子	5,031,200.00	2.89
C6	金属、非金属	3,161,204.40	1.81
C7	机械、设备、仪表	14,283,810.22	8.20
C8	医药、生物制品	37,406,460.02	21.47
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	6,936,000.00	3.98
I	金融、保险业	12,807,175.46	7.35
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	122,204,222.80	70.14

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	600887	伊利股份	709,950	15,121,935.00	8.68
2	600267	海正药业	809,779	12,656,845.77	7.26
3	000895	双汇发展	199,934	12,096,007.00	6.94
4	600521	华海药业	699,886	9,826,399.44	5.64
5	600030	中信证券	550,000	6,484,500.00	3.72
6	000581	威孚高科	255,000	6,341,850.00	3.64
7	600837	海通证券	659,987	6,322,675.46	3.63
8	600519	贵州茅台	23,500	5,776,300.00	3.32
9	000963	华东医药	160,000	5,520,000.00	3.17
10	600276	恒瑞医药	176,000	5,334,560.00	3.06

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	12,084,000.00	6.94
2	央行票据	19,316,000.00	11.09
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	31,400,000.00	18.02

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	1101086	11央票86	200,000	19,316,000.00	11.09
2	010308	03国债(8)	120,000	12,084,000.00	6.94

注:本基金本报告期末仅持有上述两支债券。

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。

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。

5.8.2 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	1,000,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	635,478.71
5	应收申购款	46,158.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,681,636.95

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

本报告期期初基金份额总额	177,742,711.24
本报告期基金总申购份额	6,941,976.77
减:本报告期基金总赎回份额	6,304,763.22
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	178,379,924.79

§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、《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛创新先锋灵活配置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。

长盛成长价值证券投资基金

2012 第三季度 报告

2012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:2012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2012年10月24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2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛成长价值混合
基金主代码	080001
交易代码	080001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年9月18日
报告期末基金份额总额	968,762,938.29份
投资目标	本基金为平衡型基金,通过管理人的积极管理,在控制风险的前提下挖掘价值、分享成长,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略为主动性投资,在战略性资产、战术性资产、股票和债券选择三个层面进行积极配置,力争获得超过投资基准的业绩回报。在资产配置方面,股票资产比例为35%-75%,债券资产比例为20%-60%,现金资产比例不低于5%。
业绩比较基准	中信标普A股综合指数收益率x80%+中信标普国债指数收益率x20%
风险收益特征	本基金属平衡型基金,在承担适度风险的前提下,获得长期稳定的收益。
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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-632,450.25
2.本期利润	-29,036,862.27
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0291
4.期末基金资产净值	753,922,163.27
5.期末基金份额净值	0.778

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2012年9月30日。

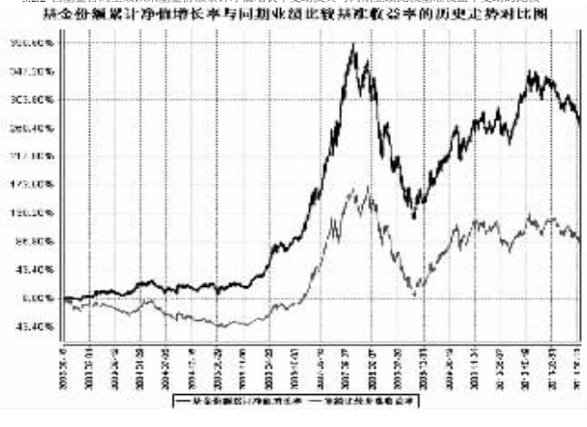
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-3.59%	0.67%	-5.35%	1.00%	1.76%	-0.33%

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



注:1、本基金合同生效日为2012年3月27日,截止本报告期末本基金成立不满一年。

2、本基金投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于电子信息产业的上市公司股票不低于股票类资产的80%;债券投资占基金资产的0%-40%;权证投资占基金资产的比例不高于3%;现金或者到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§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,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理,金融工程与量化投资部执行总监。	2012年7月20日	—	6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、长盛沪深300指数证券投资基金基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部执行总监,长盛成长价值证券投资基金(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,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理。