长盛货币市场基金

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:兴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。

基金托管人兴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	长盛货币
基金主代码	080011
交易代码	080011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年12月12日
报告期末基金份额总额	1,105,684,467.05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

§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	9,137,535.58
2.本期利润	9,137,535.58
3.期末基金资产净值	1,105,684,467.05

注:1、所列数据截止到2012年9月30日。

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,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。

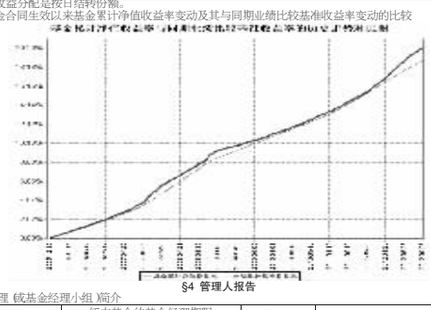
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	0.8146%	0.0028%	0.7596%	0.0002%	0.0550%	0.0026%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 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



§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		
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。	2011年2月15日	-	12年	女,1975年6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;2000年10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:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确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。

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 报告期内的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 行情回顾及运作分析

三季度GDP增速继续滑落,创下了自2009年二季度以来新低,股票和债券市场均呈现下跌格局。市场表现持续呈高度分化,信息服务、餐饮旅游、有色金属、医药生物、采掘等行业跌幅较少;交通运输、纺织服装、机械设备、房地产、商业贸易、交运设备等行业跌幅较大。从风格角度看,低下行波动率、低换手、高成长风格表现相对较好。

4.4.2 本基金业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.821元,本报告期份额净值增长率为-4.87%,同期业绩比较基准增长率为-4.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

未来2-3个季度经济仍处于需求收缩的通道中,经济环比持平略回升,4季度PPI和CPI都将温和回升,企业将出现一轮补库存。中长期看,中国经济将告别长期10%以上的持续高增长,进入以8%为中枢的窄幅波动区间,未来可能出现L型走势。当前的宏观经济形势,通胀水平缓慢持续回落,工业增加值底部徘徊;受政策放松、以及需求降低的影响,流动性将进入逐渐放松的通道。中期看,受益于流动性放松以及经济缓慢回暖,资本市场将重新进入缓慢上升的通道。

本基金采用数量化策略进行股票投资,按照红利价值型策略在价值层面深度挖掘,保持投资风格的长期稳定。

§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)	占基金资产净值的比例(%)
1	固定收益投资	431,579,715.02	38.97
	其中:债券	431,579,715.02	38.97
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	380,046,607.40	34.32
4	其他资产	295,861,566.45	26.71
5	合计	1,107,487,888.87	100.00

5.2 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(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.49	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

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20%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20%。

5.3 期末基金组合剩余期限

5.3.1 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	105
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	159
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	90

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明:

报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天情况。

5.3.2 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(%)
1	30天以内	5.25	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	14.30	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.73	-
3	60天(含)-90天	29.33	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.56	-
4	90天(含)-180天	7.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	17.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	73.40	-

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	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	59,701,000.36	5.40
3	金融债券	80,635,256.79	7.29
	其中:政策性金融债	80,635,256.79	7.29
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	291,243,457.87	26.34
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	431,579,715.02	39.03
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	80,635,256.79	7.29

5.5 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(%)
1	090407	09农发07	500,000	50,453,255.19	4.56
2	1101094	11央行票据94	400,000	39,784,204.14	3.60
3	041258014	12獐子岛CP001	200,000	20,195,996.82	1.83
4	041262012	12湘投集CP001	200,000	20,170,154.01	1.82
5	041252019	12裕廊化工CP001	200,000	20,080,675.60	1.82
6	041259021	12杭钢商贸CP001	200,000	20,079,796.69	1.82
7	041160013	11南航工CP001	200,000	20,076,246.81	1.82
8	110206	11国开06	200,000	20,063,845.61	1.81
9	041262020	12富通CP001	200,000	20,032,016.34	1.81
10	041262016	12赣长运CP001	200,000	20,000,675.96	1.81

5.6 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0.25%(含)-0.5%间的次数	7
报告期内偏离度的最高值	0.3156%
报告期内偏离度的最低值	0.0978%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1489%

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 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397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20%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20%的情况。

5.8.3 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不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。本报告期内无需说明的证券投资决策程序。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	12,157,858.82
4	应收申购款	283,676,350.88
5	其他应收款	27,356.75
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	295,861,566.45

5.8.5 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	1,086,622,054.66
本报告期基金总申购份额	2,064,468,120.69
减:本报告期基金总赎回份额	2,045,405,708.30
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	1,105,684,467.05

§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、《长盛货币市场基金基金合同》;

3、《长盛货币市场基金托管协议》;

4、《长盛货币市场基金招募说明书》;

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。

长盛量化红利策略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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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。

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	长盛量化红利股票
基金主代码	080005
交易代码	080005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年11月25日
报告期末基金份额总额	266,087,317.75份
投资目标	本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标,并追求风险调整后的收益最大化,满足投资人长期稳健的投资收益需求。
投资策略	本基金通过严格的数量化股票选择方法生成红利风格股票池,在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合,从而形成基于核心-卫星投资策略的股票资产组合。其中,大类资产配置策略综合考虑宏观经济、政策导向和市场环境(市场估值水平、资金供求)等因素,股票投资中将以红利股票投资为主导,以价值型企业及分红能力作为选择投资对象的核心标准。
业绩比较基准	75%×中证红利指数+25%×中证综合债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金产品,风险高于混合性基金、债券基金、货币市场基金,属于较高风险,较高回报的基金产品。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-14,918,118.67
2.本期利润	-11,579,736.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0425
4.期末基金资产净值	218,457,078.83
5.期末基金份额净值	0.821

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。

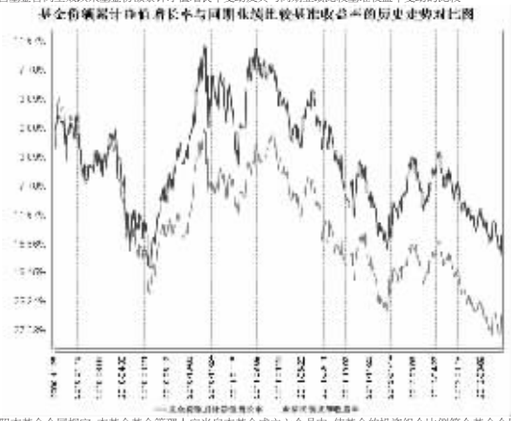
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-4.87%	0.82%	-4.50%	0.85%	-0.37%	-0.03%

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:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自本基金成立六个月内,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基金合同投资组合中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 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,长盛成长价值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。	2009年11月25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基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金(本基金)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。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《长盛量化红利策略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 报告期内的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 行情回顾及运作分析

三季度GDP增速继续滑落,创下了自2009年二季度以来新低,股票和债券市场均呈现下跌格局。市场表现持续呈高度分化,信息服务、餐饮旅游、有色金属、医药生物、采掘等行业跌幅较少;交通运输、纺织服装、机械设备、房地产、商业贸易、交运设备等行业跌幅较大。从风格角度看,低下行波动率、低换手、高成长风格表现相对较好。

4.4.2 本基金业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.821元,本报告期份额净值增长率为-4.87%,同期业绩比较基准增长率为-4.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

未来2-3个季度经济仍处于需求收缩的通道中,经济环比持平略回升,4季度PPI和CPI都将温和回升,企业将出现一轮补库存。中长期看,中国经济将告别长期10%以上的持续高增长,进入以8%为中枢的窄幅波动区间,未来可能出现L型走势。当前的宏观经济形势,通胀水平缓慢持续回落,工业增加值底部徘徊;受政策放松、以及需求降低的影响,流动性将进入逐渐放松的通道。中期看,受益于流动性放松以及经济缓慢回暖,资本市场将重新进入缓慢上升的通道。

本基金采用数量化策略进行股票投资,按照红利价值型策略在价值层面深度挖掘,保持投资风格的长期稳定。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	资产项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	153,357,773.87	69.76
	其中:股票	153,357,773.87	69.76
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	65,923,815.75	29.99
6	其他资产	545,814.02	0.25
7	合计	219,827,403.64	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	113,578.00	0.05
B	采掘业	6,075,241.79	2.78
C	制造业	77,886,889.32	35.65
C0	食品、饮料	17,808,428.09	8.15
C1	纺织、服装、皮毛	1,730,798.75	0.79
C2	木材、家具	120,870.00	0.06
C3	造纸、印刷	1,707,733.00	0.78
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,774,510.15	4.93
C5	电子	639,411.40	0.29
C6	金属、非金属	1,547,044.56	0.71
C7	机械、设备、仪表	23,315,388.69	10.67
C8	医药、生物制品	19,631,804.68	8.99
C99	其他制造业	610,900.00	0.28
D	电力、煤气及水的生产和供应业	307,802.00	0.14
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	12,480,376.87	5.71
G	信息技术业	11,931,405.32	5.46
H	批发和零售贸易	5,375,219.47	2.46
I	金融、保险业	26,475,265.88	12.12
J	房地产业	8,830,987.92	4.04
K	社会服务业	1,269,881.34	0.58
L	传播与文化产业	2,408,445.96	1.10
M	综合类	202,680.00	0.09
	合计	153,357,773.87	70.20

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	600016	民生银行	1,239,740	7,004,531.00	3.21
2	600000	浦发银行	750,000	5,535,000.00	2.53
3	000858	五粮液	156,042	5,289,823.80	2.42
4	601006	大秦铁路	760,000	4,636,000.00	2.12
5	600048	保利地产	417,352	4,490,707.52	2.06
6	600030	中信证券	369,781	4,359,717.99	2.00
7	601318	中国平安	103,000	4,319,820.00	1.98
8	600329	中新药业	380,000	4,233,200.00	1.94
9	000895	双汇发展	56,891	3,441,905.50	1.58
10	000002	万科A	404,500	3,409,935.00	1.56

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	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	13,905.00
4	应收利息	12,531.08
5	应收申购款	19,377.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	545,814.02

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

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	275,687,906.41
报告期期间基金总申购份额	1,819,490.48
减:报告期期间基金总赎回份额	11,420,079.14
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	266,087,317.75

§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、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛量化红利策略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。

长盛积极配置债券型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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
报告期末基金份额总额	656,959,783.28份
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,不同于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。
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

§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	-20,793,901.12
2.本期利润	-36,719,899.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0527
4.期末基金资产净值	677,151,788.54
5.期末基金份额净值	1.0307

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	-4.85%	0.32%	-0.81%	0.13%	-4.04%	0.19%

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:按照本基金的基金合同规定,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本基金合同第十二条"二、投资范围"、"六、投资限制"的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
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	—	10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、星展珊顿证券亚洲收益基金经理助理、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。

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