长盛积极配置债券型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31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
送出日期:2013年3月26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根据本基金合同规定,于2013年3月25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2012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	573,536,591.94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	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-43,799,935.22	-6,384,569.26	22,522,612.44
本期利润	-2,454,052.39	-38,511,681.95	25,745,673.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0033	-0.0341	0.0805
本期基金份额净值增长率	-0.52%	-3.30%	15.54%
3.1.2期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0547	0.0105	0.0197
期末基金资产净值	608,046,638.79	972,633,837.69	1,419,051,887.30
期末基金份额净值	1.0602	1.0687	1.1052

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	2.86%	0.24%	1.53%	0.13%	1.33%	0.11%
过去六个月	-2.12%	0.29%	0.70%	0.13%	-2.82%	0.16%
过去一年	-0.52%	0.31%	4.10%	0.14%	-4.62%	0.17%
过去三年	11.14%	0.33%	8.51%	0.17%	2.63%	0.16%
自基金合同生效起至今	22.80%	0.32%	21.31%	0.21%	1.49%	0.11%

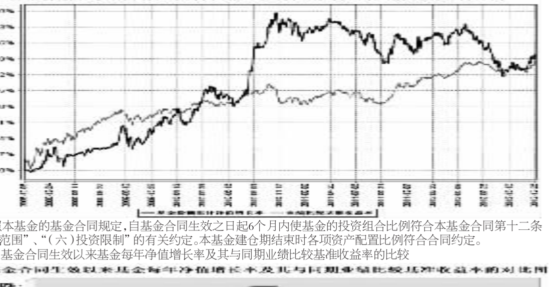
注:本基金业绩比较基准:中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%

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只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。

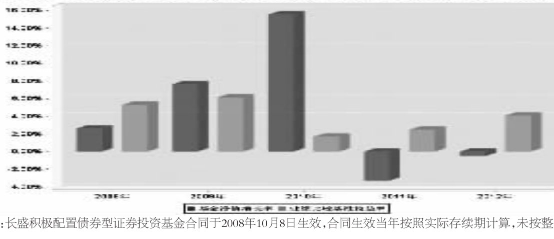
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照90%、10%的比例采取再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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。

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
2012年	0.030	1,800,080.79	901,281.54	2,701,362.33	除息日:2012年1月18日
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
合计	1.730	134,558,888.85	44,759,174.41	179,318,063.26	

§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%;安徽省投资集团控股有限公司(原"安徽省投资集团有限责任公司")占注册资本的13%。截止2012年12月31日,基金管理人共管理两支封闭式基金、二十三支开放式基金,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		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。
梁珂	本基金经理助理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理助理,长盛货币市场基金基金经理助理,债券研究员。	2012年2月29日	2012年11月19日	4年	男,1983年6月出生, 中国国籍。北京大学硕士。2008年7月加入长盛基金管理有限公司,任债券研究员,本基金经理助理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理助理,长盛货币市场基金基金经理助理,。目前已离任。
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,固定收益部总监。	2008年12月19日	2012年3月16日	8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。任固定收益部总监,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。目前已离任。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等;

3、报经中国证券投资基金业协会同意,目前吴达同志已不再担任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,该基金改由贾志敏同志负责管理。该事项公司已于2013年3月23日进行公告。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,为保证公司管理的所有投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,公司重新修订了《公司公平交易细则》。报告期内,公司根据该细则实际执行情况,对其进行了完善。该细则从研究、投资授权、投资决策、交易执行、投资组合信息隔离、行为监控评估与分析、报告与信息披露等环节对公平交易的管理提出明确要求。

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。投资组合经理在投资决策委员会授权范围内自主进行投资决策,超越授权范围的投资行为,需依照公司相关制度规定履行审批程序。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,对交易所公开竞价交易,公司开启恒生交易系统中的公平交易程序,对符合公平交易条件的投资指令强制执行公平交易,具体如下:

一、限价指令的执行原则:对于不同限价的同向指令,按照"价格优先、时间优先、同时均分"的原则执行;对于相同限价的同向交易指令,强制执行恒生交易系统中的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托比例,按比例具体执行。

二、市价指令的执行原则:对于市价同向交易指令,按照"时间优先"的原则执行交易指令,后到达指令后按照先到指令剩余数量和新到指令数量采用公平委托系统执行;对于同时同向交易指令,强制执行恒生交易系统中的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托比例,按比例具体执行。

三、部分限价指令与部分市价指令的执行原则:对于不同投资经理下达的不同类型的同向交易指令,按照"价格优先"的原则执行交易指令,在未满足限价执行条件时,先执行市价指令,后执行限价指令。

对债券一级市场申购、非公开发行股票等以公司名义进行的交易,公司依照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

对于银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价的交易,则按照"时间优先、价格优先、同时申报时要求价格差异趋于零且申购量等比分配"的原则进行。

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。风险管理部每日通过系统监控不同组合的反向交易等,监控分析发现异常情况时,要求相关人员作出合理性解释备查,每月度出具上月度公平交易监控分析报告,每季度和每年度分别出具公平交易专项分析报告;公司通过系统记录场内异常交易情况,监察稽核部定期对其进行分析评估,每月度出具异常交易总结报告;针对场外交易,监察稽核部每月度对公司旗下所有投资组合场外交易进行专项检查,检查范围包括但不限于:银行间市场、交易所大宗交易等,每月度出具检查报告;监察稽核部对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案、分配过程进行监督,确保分配结果符合公平交易原则。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》各项规定,保证公平对待旗下的每一个投资组合。各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;交易环节中,严格执行集中交易制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;事后监控分析环节中,公司定期对投资组合公平交易情况和异常交易情况进行分析,并出具公平交易执行情况分析报告;同时,公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查,并对发现的问题进行及时报告。

报告期内,公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》的规定对公司所有投资组合同向交易价差进行了分析,取最近4个季度交易记录,分别以1、3、5日为时间片段分析不同基金间以及公募基金、社保组合、专户组合等大类资产间的同向交易情况。对于同向交易次数足够进行T检验的情况,以95%置信水平对其进行假设检验排查;对于同向交易次数较少的情况考察交易价差对基金净值带来的累计贡献。分析结果显示本投资组合与公司其它组合间同向交易价差未见异常。

本报告期内,公司严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.3 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37次,其中24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;13次为长盛同庆封闭式基金转型为指数型基金前的反向交易。

本报告期1季度内,长盛同庆报经公司投资决策委员会批准,打开交易所公开竞价同日反向交易控制,因此而产生13笔交易所公开竞价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5%的交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称"开放式基金")。为确保转型后的开放式基金保持充裕流动性,以保障基金份额持有人利益,该基金一季度制定了数量化组合投资交易策略,并申请打开与公司旗下其他投资组合交易所市场的反向交易控制。上述申请已报经公司投资决策委员会批准。打开反向交易控制期间,长盛同庆严格执行既定数量化组合投资交易策略,批量下达投资指令。公司交易部对上述指令进行严格审核,在指令分发后,通过恒生交易系统自动委托交易程序执行指令,以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平,杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

本报告期内,未发现本组合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

2012年上半年,国内货币信贷政策趋于宽松,而偏弱的经济增长强度下企业融资需求总体下降,在这种情况下,债务融资环境得到明显改善,在市场风险偏好有限度上升的情况下,债券市场呈现结构性变化特征,中低评级信用债收益率大幅下降,带动整体信用利差水平回归至历史均值以下;在风险溢价下降及政策进一步放松预期推动下,非信用债与高等级信用债自年初以来收益率有所调整,但5月之后则随着政策大幅放松预期的消散以及通胀水平的大幅回落,收益率开始再度向年初水平回归。

整个下半年期间,央行以公开市场操作的方式维持了市场的流动性,虽然在3季度中受资金面拖累和市场风险偏好的上升的影响,3季度债市从短端向中端有一轮较大幅度的调整,但随着理财类资金的配置需求,信用债市场利差伴随着不同品种收益率的渐次调整,信用利差整体呈下降趋势并维持在中性略低水平。宏观经济面在十八大召开的同时呈现出企稳回升的态势,纯债市场在年末表现比较疲软,也有年末资金面的因素扰动。

纯债资产以外,上半年A股整体指数呈现震荡整理格局,但行业及个股分化特征十分明显,在3季度宏观经济弱势的影响下市场整体下跌幅度大。转债市场上半年也呈现出类似的结构分化特征,行情热点由1季度的股性个券向2季度以电力转债为代表的中盘转债轮换, 而大盘转债虽有波段性机会但整体回报并不理想,3季度也跟随大盘有大幅的调整。4季度权益类资产前后半段展现了逆转行情,虽然政策面没有太多的明显刺激方向,但经济数据的小幅回暖和改革信号的逐步释放推动了市场预期,使得A股市场在12月放量反弹,并一路收复全年的所有跌幅。转债市场在3季度开始逐步止跌,股性较强的转债并且跟随股票市场展开了一轮反弹。

在报告期内,本基金继续在一二级市场择优配置了一些资质有保障的高收益债券,在此基础上对持仓结构进行了优化,同时于2季度在风险可控前提下对于非信用债的波段性机会进行了参与, 于3季度对信用债市场进行了顺应市场利率波动的调整,一定程度规避了利率风险。我们在下半年对之前持仓比例过高的可转债进行了部分减持,但仍维持着对于贴近价值底线,长期增值空间较大的品种的配置力度。

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1.0602元,本报告期份额净值增长率为-0.52%,同期业绩比较基准增长率为4.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年,宏观经济已经在去年下半年呈现出企稳并小幅回暖的迹象,虽然短期内经济仍未找到迅速回升的契机,但政府的改革将逐步推进。随着经济的逐步回暖,全年的通货膨胀水平可能有小幅上升压力,而债市收益率水平随着4季度的调整再次回到中性位置,意味着债券品种仍然具备一定的配置和交易性机会。短期的债券市场风险可能仍然在于弱势经济格局及地方债务清理的过程中出现的信用事件冲击造成的信用债收益变化超预期。

1季度我们的投资策略主要以高收益信用债配置为主,兼以中短久期品种套利策略为辅,考虑到有可能出现信用事件冲击,提升组合中短久期配置比例以保证流动性。同时,由于经济企稳格局渐显,风险偏好有所回升,偏权益资产方面有可能具备延续上升势头,但随着4季末的快速上涨,A股市场存在调整的压力,我们将关注偏权益资产方面的有效配置,获取更多增强组合收益的投资机会。

无论市场如何发展变化,在操作方面,我们都将继续秉承谨慎原则,在组合流动性得到保证的前提下,通过资产配置和个券个股甄别分析,做好组合配置,力求确保基金资产在维持价值底线基础上实现稳定增值。

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、估值日、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总经理(担任估值小组组长)、公司副总经理和督察长(担任估值小组副组长)、权益投资部、金融工程及量化投资部、研究部、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2012年12月31日,期末可供分配收益为-31,354,962.69元,其中:未分配收益已实现部分为-31,354,962.69元,未分配收益未实现部分为65,865,009.54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,发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人,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,本基金实施利润分配的金额为2,701,362.33元。

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、张晓艺2013年3月20日对本基金2012年12月31日的资产负债表、2012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(2013)第21298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:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	11,116,166.21	39,340,994.19
结算备付金	22,737,637.20	7,213,521.75
存出保证金	500,000.00	250,000.00
交易性金融资产	808,474,070.81	1,126,807,236.11
其中:股票投资	111,238,241.31	109,739,200.34
基金投资	-	-
债券投资	697,235,829.50	1,017,068,035.77
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	2,075,396.69	26,980,676.17
应收利息	8,407,688.06	9,716,750.30
应收股利	-	-
应收申购款	49,007.59	2,433.58
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	853,359,966.56	1,210,311,612.10
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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	240,000,000.00	178,999,912.90
应付证券清算款	1,603,585.07	54,064,234.14
应付赎回款	1,349,033.66	2,571,928.64
应付管理人报酬	386,264.14	633,911.53
应付托管费	103,003.78	169,043.09
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	130,972.90	61,306.93
应交税费	839,021.10	521,857.50
应付利息	40,689.64	41,407.10
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	860,757.48	614,172.58
负债合计	245,313,327.77	237,677,774.41
所有者权益:		
实收基金	573,536,591.94	910,119,615.60
未分配利润	34,510,046.85	62,514,222.09
所有者权益合计	608,046,638.79	972,633,837.69
负债和所有者权益总计	853,359,966.56	1,210,311,612.10

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.0602元,基金份额总额573,536,591.94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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
一、收入	16,595,700.40	-21,731,047.06
1.利息收入	25,686,082.59	26,815,794.36
其中:存款利息收入	3,825,093.62	545,768.18
债券利息收入	21,833,013.91	24,776,473.00
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	27,975.06	1,493,553.18
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-50,609,612.75	-17,008,186.15
其中:股票投资收益	-41,702,127.43	11,523,705.11
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-11,015,172.35	-29,610,749.57
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,107,687.03	1,078,858.31
3.公允价值变动收益(损失以"-"填列)	41,345,882.83	-32,127,112.69
4.汇兑收益(损失以"-"填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"填列)	173,347.73	588,457.42
减:二、费用	19,049,752.79	16,780,634.89
1.管理人报酬	5,947,922.05	9,273,572.51
2.托管费	1,586,112.52	2,472,952.69
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,456,339.59	1,081,481.57
5.利息支出	9,648,255.91	3,526,283.04
其中:卖出回购金融资产支出	9,648,255.91	3,526,283.04
6.其他费用	411,122.72	426,345.08
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-2,454,052.39	-38,511,681.95
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-2,454,052.39	-38,511,681.95

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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	910,119,615.60	62,514,222.09	972,633,837.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,454,052.39	-2,454,052.39
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)	-336,583,023.66	-22,848,760.52	-359,431,784.18
其中:1. 基金申购款	18,415,194.84	1,383,996.63	19,799,191.47
2. 基金赎回款	-354,998,218.50	-24,232,757.15	-379,230,975.65
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)	-	-2,701,362.33	-2,701,362.33
五、期末所有者权益(基金净值)	573,536,591.94	34,510,046.85	608,046,638.79
项目	上年度可比期间 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

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")证监许可[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2013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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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2012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2012年12月31日的财务状况以及2012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[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)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

(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
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司("国元证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司 ("安徽省投资集团有限责任公司")	基金管理人的股东

注:1、根据长盛基金公司2012年8月29日《关于公司股东名称变更及公司章程修改的公告》,长盛基金公司的股东安徽省投资集团有限责任公司更名为安徽省投资集团控股有限公司,相关工商变更登记手续已办理完毕。

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 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,947,922.05	9,273,572.51
其中:支付销售机构的客户维护费	1,062,459.92	1,787,172.23

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 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,586,112.52	2,472,952.69

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 2012年1月1日至2012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	-	-	-	-	140,000,000.00	60,245.62
上年度可比期间 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

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 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011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	8.72%	5.49%

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 2012年12月31日		上年度末 2011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%

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 2012年1月1日至 2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至 2011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	11,116,166.21	170,426.47	39,340,994.19	377,273.95

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(2012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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额240,000,000.00元,于2013年1月4日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(ⅰ)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ⅱ)各层级金融工具公允价值

于2012年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为687,058,070.81元,属于第二层级的余额为121,416,000.00元,无属于第三层级的余额(2011年12月31日:第一层级996,773,236.11元,第二层级130,034,000.00元,无属于第三层级的余额)。

(ⅲ)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(ⅳ)第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2011年12月31日:同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元(2011年度:净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元),涉及内蒙古伊利实业集团股份有限公司发行的股票(涉及河南双汇投资发展股份有限公司发行的股票)。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	111,238,241.31	13.04
	其中:股票	111,238,241.31	13.04
2	固定收益投资	697,235,829.50	81.70
	其中:债券	697,235,829.50	81.70
	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	33,853,803.41	3.97
6	其他各项资产	11,032,092.34	1.29
7	合计	853,359,966.56	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	15,261,672.24	2.51
C	制造业	24,773,223.94	4.07
C0	食品、饮料	17,581,955.86	2.89
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	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	7,191,268.08	1.18
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,960,000.00	2.62
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	16,028,797.75	2.64
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	32,917,892.02	5.41
J	房地产业	6,296,655.36	1.04
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	111,238,241.31	18.29

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	549,938	24,906,692.02	4.10
2	600887	伊利股份	799,907	17,581,955.86	2.89
3	600406	国电南瑞	999,925	16,028,797.75	2.64
4	601390	中国中铁	5,250,000	15,960,000.00	2.62
5	600547	山东黄金	399,939	15,261,672.24	2.51
6	601166	兴业银行	480,000	8,011,200.00	1.32
7	002275	桂林三金	519,976	7,191,268.08	1.18
8	600376	首开股份	479,928	6,296,655.36	1.04

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	41,374,998.21	4.25
2	300351	永贵电器	31,000,000.00	3.19
3	000001	平安银行	28,398,328.91	2.92
4	000858	五 粮 液	26,688,213.80	2.74
5	601166	兴业银行	23,945,065.83	2.46
6	601328	交通银行	23,533,228.00	2.42
7	600000	浦发银行	22,515,881.38	2.31
8	600887	伊利股份	21,651,239.64	2.23
9	600406	国电南瑞	15,740,182.04	1.62
10	601390	中国中铁	15,384,763.24	1.58
11	600547	山东黄金	15,194,300.84	1.56
12	300330	华虹计通	15,000,000.00	1.54
13	600519	贵州茅台	12,234,553.82	1.26
14	601601	中国太保	11,903,603.44	1.22
15	600028	中国石化	10,733,847.00	1.10
16	600837	海通证券	7,976,570.21	0.82
17	601628	中国人寿	7,595,067.00	0.78
18	002275	桂林三金	7,389,695.61	0.76
19	601965	中国汽研	6,541,123.60	0.67
20	600376	首开股份	6,208,632.34	0.64

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601669	中国水电	35,090,687.47	3.61
2	300351	永贵电器	28,357,457.43	2.92
3	000001	平安银行	26,689,120.12	2.74
4	000858	五 粮 液	25,688,177.32	2.64
5	601328	交通银行	21,750,228.00	2.24
6	600000	浦发银行	19,610,264.58	2.02
7	300270	中威电子	19,512,444.06	2.01
8	601166	兴业银行	15,927,243.72	1.64
9	601318	中国平安	15,577,991.41	1.60
10	300330	华虹计通	15,302,750.35	1.57
11	300283	温州宏丰	14,956,787.81	1.54
12	600519	贵州茅台	12,719,711.39	1.31
13	601601	中国太保	10,375,469.98	1.07
14	600694	大商股份	10,324,434.61	1.06
15	600028	中国石化	9,061,054.46	0.93
16	601555	东吴证券	8,170,114.71	0.84
17	600309	烟台万华	7,879,875.19	0.81
18	601628	中国人寿	7,008,287.68	0.72
19	600837	海通证券	6,774,289.78	0.70
20	600559	老白干酒	6,411,008.36	0.66

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	508,319,002.60
卖出股票收入(成交)总额	481,588,872.35

注:本项中8.4.1、8.4.2、8.4.3表中的"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,995,000.00	14.97
	其中:政策性金融债	90,995,000.00	14.97
4	企业债券	425,505,331.50	69.98
5	企业短期融资券	10,032,000.00	1.65
6	中期票据	-	-
7	可转债	170,703,498.00	28.07
8	其他	-	-
9	合计	697,235,829.50	114.67

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	803,000	82,636,730.00	13.59
2	113002	工行转债	750,000	82,185,000.00	13.52
3	126013	08青啤债	613,200	58,315,320.00	9.59
4	126017	08葛洲债	541,470	51,006,474.00	8.39
5	110314	11进出14	500,000	50,975,000.00	8.38

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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的股票。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	2,075,396.69
3	应收股利	-
4	应收利息	8,407,688.06
5	应收申购款	49,007.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,032,092.34

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	82,636,730.00	13.59
2	113002	工行转债	82,185,000.00	13.52
3	110011	歌华转债	1,102,321.90	0.18
4	113003	重工转债	504,570.60	0.08

8.9.5 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

8.9.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
15,165	37,819.76	51,098,654.71	8.91%	522,437,937.23	91.09%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	113,286.17	0.02%

注:1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0万份。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0万份。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2008年10月8日)基金份额总额	1,362,144,547.24
本报告期期初基金份额总额	910,119,615.60
本报告期基金总申购份额	18,415,194.84
减:本报告期基金总赎回份额	354,998,218.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	573,536,591.94

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本基金管理人于2012年8月6日发布关于公司高级管理人员变动的公告,朱剑彪因个人原因辞职,经董事会决议解聘其公司副总经理职务,并已按规定向中国证监会和北京证监会报告。

11.2.2 基金经理变动情况

本基金管理人于2012年3月20日发布关于调整基金经理的公告,因蔡宾工作调整的原因,决定解聘其本基金经理的职务,吴达继续担任本基金经理。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动。

本报告期本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

2012年11月15日,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理,其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可[2012]961号)。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理,其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可[2012]1036号)。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司,本报告期内本基金未更换会计师事务所,本报告期内应支付给该会计师事务所的报酬80,000.00元,已连续为本基金提供审计服务5年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
红塔证券	1	630,768,849.81	67.49%	550,330.22	68.32%
海通证券	1	238,956,987.06	25.57%	197,703.10	24.55%
东方证券	1	64,900,921.72	6.94%	57,431.70	7.13%

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行债券投资及债券回购交易的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易	
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交总额	占当期债券回购成交总额的比例
红塔证券	1	1,045,178,984.35	79.10%	62,511,700,000.00	81.69%
海通证券	1	268,212,354.30	20.30%	12,140,306,000.00	15.86%
东方证券	1	7,919,444.93	0.60%	1,870,848,000.00	2.44%

注:1、本公司选择证券经营机构的标准

(1)研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时为本公司提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告。

(2)资力雄厚,信誉良好。

(3)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4)经营行为规范,最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

(6)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要,并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1)研究机构提出服务意向,并提供相关研究报告;

(2)研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定;

(3)研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后,按照研究服务评价规定,对研究机构进行综合评价;

(4)试用期满后,评价结果符合条件,双方认为有必要继续合作,经公司领导审批后,我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》,并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用;

(5)本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价,若本公司认为签约机构的服务不能满足要求,或签约机构违规受到国家有关部门的处罚,本公司有权终止签署的协议,并撤销租用的交易单元;

(6)交易单元租用协议期限为一年,到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

(1)本基金报告期内新增租用交易单元:

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	东方证券	深圳	1

(2)本基金报告期内停止租用交易单元:无。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2012年1月16日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告,自2012年1月16日起,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

2、2012年11月15日,根据工作需要,中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。