长盛同鑫保本混合型证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2012年1月20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1月19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2011年10月1日起至2011年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同鑫保本混合
基金主代码	080007
交易代码	080007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月24日
报告期末基金份额总额	2,093,050,351.04份
投资目标	依据本基金的保证合同,本基金通过运用投资组合保险策略,在严格控制风险和保证本金安全的基础上,力争在本基金保本周期结束时,实现基金资产的收益增长。
投资策略	本基金投资策略突出强调配置的科学性与纪律性,通过严格金融工程手段有效控制风险,保证实现投资期中的稳定收益,并通过有效地资产配置和保本投资策略以保障基金资产本金的安全。 本基金将按照恒定比例组合保险机制(CPPI)将资产配置于安全资产与风险资产,用投资于固定收益类证券的现金净流入来冲抵风险资产组合潜在的最大亏损,并通过投资股票等风险资产来获得资本利得。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种。未持有到期而赎回或转换出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或转换转入的基金份额,不享受保本担保。
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
基金保证人	安徽省信用担保集团有限公司

§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(2011年10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	23,126,575.28
2.本期利润	38,773,306.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0166
4.期末基金资产净值	2,140,442,718.63
5.期末基金份额净值	1.023

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2011年12月31日。

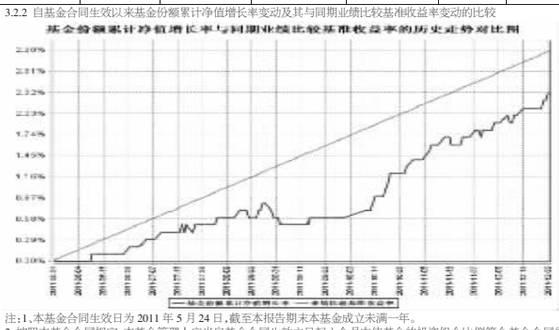
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	1.69%	0.05%	1.18%	0.02%	0.51%	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:1、本基金合同生效日为2011年5月24日,截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十六条(二)投资范围、(七)投资禁止行为与限制的有关约定。本报告期内,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
蔡宾	本基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛同福信用增利债券型证券投资基金基金经理,固定收益部副总监。	2011年5月24日	-	7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。现任固定收益部副总监,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛同福信用增利债券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、《长盛同鑫保本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

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送,保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合,暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发生异常交易情况。

4.4 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

四季度,随着CPI数据的逐月回落,投资者对通胀预期出现明显的转低预期,1年期和3年期央票的一级市场发行利率均出现了近年来的首次下降,央行也降低了准备金率。四季度,货币市场利率呈现回落,债券市场出现了一轮较显著的上涨行情,以国债和政策性金融债为代表的利率产品表现最为出色,高等级信用债也有所表现,出于对经济前景悲观的预期,中低等级信用债的相对表现较弱。而权益市场在10月上旬出现一波小幅反弹之后,又呈现剧烈的调整走势,沪深300指数下跌9.13%,深成指下跌13.34%。可转债在四季度显示出现一轮较明显的上涨,随着股指回落又进行了调整,但总体表现强于股票市场。

长盛同鑫保本基金在本季度逐步提高了债券仓位,在可转债调整过程中适度提高了转债的仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.023元,本报告期份额净值增长率为1.69%,同期业绩比较基准增长率为1.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年的经济形势至少比2011年会有所改善。一方面,通胀压力得到有效缓解,另一方面,政策微调对于稳定预期有着重要意义。总体上,滞胀的经济环境在2012年将会出现变化。债券市场收益率曲线有望在通胀回落的大背景下进一步陡峭化下移。

2011年由于信贷政策的紧缩,相当比例的企业在资金上遇到了很大困难,企业的经营环境较为恶劣,2012年如果得到更多的信贷支持,企业的经营状况将有明显改善,从而提高企业的信用水平和偿付能力。当前的信用利差仍然维持在多年来的历史高位,信用债券在2012年的表现较为乐观。与此同时,出于对政策放松条件下企业经营的宽松环境和股票资产较低的估值水平,可转换债券和部分股票资产可能会有较好的投资机会。

2012年,吸取教训,我们将更加重视资产的绝对收益,保持持续获利的能力。

§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	1,850,000.00	0.07
	其中:股票	1,850,000.00	0.07
2	固定收益投资	1,209,287,325.96	48.19
	其中:债券	1,209,287,325.96	48.19
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	638,551,677.83	25.45
	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	623,086,282.71	24.83
6	其他资产	36,425,173.19	1.45
7	合计	2,509,200,459.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	1,850,000.00	0.09
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	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	1,850,000.00	0.09
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	-	-
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	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,850,000.00	0.09

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	600582	天地科技	100,000	1,850,000.00	0.09

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	33,850,700.00	1.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	78,656,000.00	3.67
	其中:政策性金融债	78,656,000.00	3.67
4	企业债券	610,746,481.36	28.53
5	企业短期融资券	361,255,000.00	16.88
6	中期票据	-	-
7	可转债	124,779,144.60	5.83
8	其他	-	-
9	合计	1,209,287,325.96	56.50

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	110015	石化转债	1,241,460	124,779,144.60	5.83
2	110245	11国开45	800,000	78,656,000.00	3.67
3	115003	中兴债1	704,874	67,949,148.73	3.17
4	041153002	11华能CP002	600,000	60,606,000.00	2.83
5	126011	08石化债	586,670	54,167,241.10	2.53

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	18,352,478.81
3	应收股利	-
4	应收利息	17,562,880.73
5	应收申购款	9,813.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,425,173.19

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	124,779,144.60	5.83

5.8.5 报告期末前十名股票中在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	2,536,858,232.30
本报告期期基金总申购份额	3,988,122.60
减:本报告期期基金总赎回份额	447,796,003.86
本报告期期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,093,050,351.04

§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、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛同鑫保本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:400-888-2666,010-62350088。

网址:http:/www.csfunds.com.cn。

长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

2011 第四季度 报告

2011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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2012年1月20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1月19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2011年10月1日起至2011年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同智优势混合(LOF)
基金主代码	160805
交易代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1月5日
报告期末基金份额总额	2,556,640,149.91份
投资目标	主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司,所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下,谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	本基金为主动管理的混合型基金,对各类资产采取适度灵活的资产配置。主要选股思路是采用自上而下的路径,投资策略上偏重选股能力的发挥。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益-较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。
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(2011年10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-127,854,349.77
2.本期利润	-160,546,322.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0624
4.期末基金资产净值	1,922,546,495.36
5.期末基金份额净值	0.7520

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、所列数据截止到2011年12月31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	-7.70%	1.17%	-5.51%	0.91%	-2.19%	0.26%

3.2.2 自基金转型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、本基金由同智证券投资基金转型而来,转型日为2007年1月5日。

2、按基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十五条(二)投资范围、(六)投资限制的有关约定。本报告期内,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
丁骏	本基金基金经理,同盛证券投资基金基金经理。	2007年2月27日	—	10年	男,1974年11月出生,中国国籍。中国社会科学院经济学博士。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师;国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理,2003年6月加入长盛基金管理有限公司,先后担任行业研究员、组合经理助理。现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金(本基金)基金经理,同盛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、《长盛同智优势成长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

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送,保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合,暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发生异常交易情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

4季度A股行情前高后低,尤其在12月后期,中小盘股票出现大幅度杀跌,基金蓝筹股也是损失惨重。整个市场缩量严重,较少的卖单都能导致股价较大的跌幅,充分反映了市场恐慌的心态。在这种情况下,本组合逐步增加了仓位,主要配置在地产保险和超跌股上。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.7520元,本报告期份额净值增长率为-7.70%,同期本基金业绩比较基准收益率为-5.51%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前市场的焦点在于经济中期增长率的下滑、经济推动因素的缺失和股市超跌的矛盾。我们希望在股市极度恐慌的时候,政府能够给予信心上的支持。股市的反弹就有较大的希望,但是,在1-2季度内,上市公司业绩乏力的情况会随着年报和季报的披露而显现出来。市场恐怕还是会在震荡中前进。

§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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,464,978,787.23	75.68
	其中:股票	1,464,978,787.23	75.68
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	467,020,515.83	24.13
6	其他资产	3,825,221.50	0.20
7	合计	1,935,824,524.56	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	41,445,182.25	2.16
B	采掘业	87,100,346.90	4.53
C	制造业	809,433,934.21	42.10
C0	食品、饮料	192,652,474.70	10.02
C1	纺织、服装、皮毛	20,837,442.32	1.08
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	114,871,852.39	5.97
C5	电子	7,274,672.32	0.38
C6	金属、非金属	24,408,179.26	1.27
C7	机械、设备、仪表	373,308,976.12	19.42
C8	医药、生物制品	76,080,337.10	3.96
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,156,864.04	0.58
E	建筑业	35,214,938.38	1.83
F	交通运输、仓储业	84,487,074.48	4.39
G	信息技术业	10,124,034.85	0.53
H	批发和零售贸易	56,267,828.05	2.93
I	金融、保险业	194,307,388.90	10.11
J	房地产业	106,190,412.73	5.52
K	社会服务业	29,250,782.44	1.52
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,464,978,787.23	76.20

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	600036	招商银行	13,942,167	165,493,522.29	8.61
2	600518	康美药业	6,559,055	73,592,597.10	3.83
3	600009	上海机场	5,068,647	62,040,239.28	3.23
4	600519	贵州茅台	318,974	61,657,674.20	3.21
5	000858	五粮液	1,749,942	57,398,097.60	2.99
6	601766	中国南车	13,217,611	57,232,255.63	2.98
7	000895	双汇发展	737,716	51,603,234.20	2.68
8	000581	威孚高科	1,369,927	49,166,680.03	2.56
9	600582	天地科技	2,285,698	42,285,413.00	2.20
10	601699	潞安环能	1,829,349	38,709,024.84	2.01

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,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

除上述事项外,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,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	1,388,549.12
2	应收证券清算款	2,335,880.78
3	应收股利	-
4	应收利息	99,408.20
5	应收申购款	1,383.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,825,221.50

5.8.4 报告期末基金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

本报告期期初基金份额总额	2,589,695,384.52
本报告期期间基金总申购份额	4,160,415.47
减:本报告期期间基金总赎回份额	37,215,650.08
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	2,556,640,149.91

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛同智优势成长混合型证券投资基金的批复;

2、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛同智优势成长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。

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

2011 第四季度 报告

2011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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2012年1月20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1月19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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2011年10月1日起至2011年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛全债指数增强债券	
基金主代码	510080	
交易代码	前端:510080	后端:511080
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年10月25日	
报告期末基金份额总额	338,512,828.46份	
投资目标	本基金为开放式债券型基金,将运用增强的指数化投资策略,在力求本金安全的基础上,追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳增值	
投资策略	本基金采用"自上而下"的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值,同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益	
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率×92%+中信标普A股综合指数收益率×8%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金	
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(2011年10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-9,890,021.37
2.本期利润	4,829,237.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0140
4.期末基金资产净值	380,310,189.13
5.期末基金份额净值	1.1235

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2011年12月31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	1.23%	0.27%	1.51%	0.14%	-0.28%	0.13%

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

§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,长盛货币市场基金基金经理。	2011年2月15日	—	11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。现任长盛中信全债指数增强型债券投资基金(本基金)基金经理,长盛货币市场基金基金经理。

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、《长盛中信全债指数增强型债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

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送,保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合,暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发生异常交易情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

一、报告期内行情回顾

4季度,国内宏观经济继续下行,通胀逐渐回落,而政策面转向缓慢放松的基调,在此背景下,债券市场走出了一波牛市,长端率先下移40BP左右,短端由于实质放松政策未出台仍维持在相对较高水平,但货币市场回购利率整体下降。权益市场在一小波反弹后受基本面影响再度大幅回落。国际上,欧债问题持续折腾,对国内市场也产生了一定的影响。

二、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金在债券资产配置策略上采取了相对积极的投资策略,增加仓位并适度拉长久期,获取了一定的价差收益,但配置力度仍显不足。权益类资产部分而言,报告期内基本保持相对谨慎的仓位,但总体来说,由于市场整体下跌幅度较大,对组合收益还是产生了明显的负贡献。另外,在报告期内转债市场受股票市场下跌以及供给因素影响整体反弹回落,该部分资产配置也为组合带来一定的损失。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.1235元,本报告期份额净值增长率为1.23%,同期业绩比较基准增长率为1.51%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2012年,国内外经济形势复杂多变,不确定性非常大。国际上,欧元区债务危机将难以明显缓解,风险可能向银行体系扩散,美国、日本等发达经济体也存在严重的债务问题,全球去杠杆化远未结束。新兴和发展中经济体则面临资本流出的风险和潜在的通胀压力,经济增速将持续回落。全球贸易保护主义程度加深,世界经济复苏动力明显减弱。国内方面,房地产