

长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011年 12 月 31 日

在中国经济持续快速增长、通货膨胀率上升、政府推行扩大内需刺激经济增长的政策和高度货币升值条件将成为2012年的主题,亚洲和欧洲商务机会将超过以往两难竞争的关口,部分本币加权的全球市场(欧洲、亚太等)会有机会进行估值修复,近期的行业机会在于下降的必需消费品、医药保健、低估值板块等方面。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

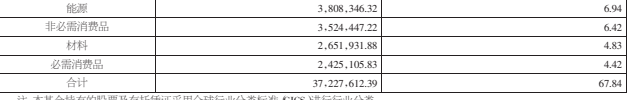
序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	37,227,612.39	67.29
	其中:普通股	36,049,577.22	65.19

	内地+信托凭证	1,178,035.17	2.13
2	基金投资	1,536,574.30	2.78
3	固定收益投资	--	--
	其中：债券	--	--
	资产支持证券	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
	其中：远期	--	--
	期货	--	--
	权证	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
	其中：买入返售的买入返售金融资产	--	--
6	货币市场工具	16,287,068.93	29.62
7	银行承兑票据及备付金合计	171,062.12	0.31
8	其他各项资产	--	--
	合计	\$5,324,317.74	100.00

国家/地区	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
美国	24,323,351.67	44.33
香港	9,489,235.40	17.30
德国	987,074.80	1.80
英国	862,390.08	1.57
澳大利亚	829,570.12	1.51
瑞士	828,263.44	1.51
法国	817,302.75	1.49
加拿大	626,874.43	1.14

5.1 报告期内无跨境行业分类的股票投资及存托凭证持仓

行业类别	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
信息技术	10,736,582.16	19.57
金融	5,438,420.56	9.91
医疗	4,445,904.48	8.10
工业	4,196,873.94	7.65



序号	公司名称 （英文）	公司全称 （中文）	证券 代码	所在证券市场	所属国家/地区	数量	公允价值 （美元）	占基金资产净值 比例（%）
1	APPLE INC.	-	AAPL US	纳斯达克证交所上市	美国	700	1,786,305.15	3.26
2	CHEYRON CORP.	-	CVX US	纽约证交所上市	美国	2,150	1,441,393.88	2.65
3	SIMON PROPERTY -	-	SPG US	纽约证交所上市	美国	1,450	1,174,033.57	2.15
4	MICROSOFT CORP.	-	MSFT US	纳斯达克证交所上市	美国	7,000	1,148,955.55	2.09
5	KUNLEIN ENERGY CO.	昆仑能源有限公司	135 HK	香港交易所上市	中国香港	120,000	1,075,961.04	1.96
6	GOOGLE INC.	-	GOOGL US	纳斯达克证交所上市	美国	250	1,017,437.83	1.85
7	SHANGHAI ELECTRIC GROUP CO.	上海电气集团	2727 HK	香港交易所上市	中国香港	320,000	931,332.16	1.70
8	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP	中国平安财产保险股份有限公司	2601 HK	香港交易所上市	中国香港	50,000	895,823.50	1.63
9	DANABORG GROUP	-	DHR US	纽约证交所上市	美国	3,000	889,183.08	1.62
10	PREFECTURE.COM INC.	-	PCPL US	纳斯达克证交所上市	美国	3,000	884,030.11	1.61

5.报告期内被投上市公司前十大重仓持股情况表

本基金本报告期末持有以下股票：

5.1 报告期末被投上市公司公允价值占基金资产净值的比例大于10%的前十名重仓持股投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.2 报告期末被投上市公司公允价值占基金资产净值的比例大于10%的前十名重仓支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有支持证券投资。

5.3 报告期末被投上市公司公允价值占基金资产净值的比例大于10%的前十名重仓货币项目投资明细

本基金本报告期末未持有货币项目资产。

5.4 报告期末被投上市公司公允价值占基金资产净值的比例大于10%的前十名重仓衍生品项目投资明细

本基金本报告期末未持有衍生品项目资产。

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	LYXOR ETF EURO STOXX 50 DAILY 90RUS	指数	ETF基金	LYXOR INTERNATIONAL ASSET MANAGEMENT	549,499.00	1.00
2	DB X-TRACKERS S&P 500 INVERSE DAILY ETF	指数	ETF基金	DB PLATINUM ADVISOR SA	521,747.00	0.95
3	DB X-TRACKERS EURO STOXX 50 SHORT DAILY ETF	指数	ETF基金	DB PLATINUM ADVISOR SA	465,327.80	0.85

注:本基金本期和报告期内仅持有上述三支基金

5.105 报告期内基金投资的前十名证券中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

5.101 期间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

5.102 期间本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。

5.103 期间本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范围

基金投资的前十名股票,均符合基金合同规定的备选股票范围之相关规定

5.103 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	30,385.90
4	应收股利	2,760.19
5	应收申购款	179,914.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9.	合计		173,062.12
9.1	报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 及本报告期末持有的处于转股期可转换债券的说明		
9.1.1	报告期末前十名股票中有在流通受偿权中的公司		
9.1.2	本报告期末前十名股票中不存在流通受偿权的情况		
9.1.3	报告期末投资组合持有的其他上市公司名称或证券代码		
9.1.4	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		
56 开放式基金业绩变动			单位：元
报告期期初基金已申购金额		69,499,099.22	
报告期期间基金已申购金额		8,487,354.01	
减：报告期期间基金已赎回份额		-9,995,858.15	
报告期期间基金净申购份额（份额减少以“-”填列）		-	
报告期期末基金净值总额		67,990,591.98	
57 备查文件目录			
1. 基金文件目录			
1.1 中国证监会核准基金募集的文件；			
1.2 中国证监会核准《光大永年资产管理股份有限公司证券投资基金合同》；			
1.3 中国证监会核准《光大永年资产管理股份有限公司证券投资基金协议》；			
1.4 中国证监会核准《光大永年资产管理股份有限公司证券投资基金托管协议》；			
1.5 法律意见书；			
1.6 基金管理人业务资格批复、营业执照；			
1.7 基金托管人业务资格批复、营业执照；			
1.8 存款证明；			
1.9 报告期内按约定基金管理人向基金托管人的划款指令的付款回单。			
2. 网站公示			
投资者可通过登录基金管理人网站基金公司的公开信息和基金管理人网站公示费查询端查看信息。在支付工本费后，投资者可在合理时间内获得有关资料的复印件和原件。			
投资者若有任何疑问，请拨打客户服务热线或联系光大证券股份有限公司。			
客户服务热线：400-888-2666、010-62500888。			
网址： http://www.ebsfunds.com.cn			

序号	股票代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000235	090101G5	300,000	40,848,016.51	0.67
2	1101096	11央行票据096	300,000	29,038,245.40	0.43
3	41153006	11中化工2P02	200,000	20,459,853.36	0.63
4	1181135	11邯钢债02	200,000	20,062,046.95	0.44
5	1181174	11苏沪债01	200,000	20,001,293.88	0.44
6	1181237	11苏沪债01	200,000	19,973,804.28	0.44
7	1181360	11鄂州债01	200,000	19,876,048.00	0.44

2011 第四季度 报告

5.2 报告期债券回购融资情况	
序号	项目

0.28	0.44
0.08	0.44

9	1181217	11月资产端P01	200,000	19,923,154.03	0.64
9	1101086	11月资产端P06	200,000	19,436,278.07	0.62
10	1101094	11月资产端P04	200,000	19,171,493.45	0.62

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%以上-0.5%间的次数		1
报告期内偏离度的最高值		-0.0093%
报告期内偏离度的最低值		-0.0039%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的样本平均值		-0.0043%

5.7 报告期末公允价值、基金资产净值占前10大持仓的前10名资产持仓市值比例
本基金和报告期末资产净值无资产证券化。

5.8 投资组合报告

5.8.1 基金投资组合资产

报告期末的投资组合公允价值占基金资产净值比例,即组合资产净值及买入或卖出,按照票面利率或约定利率每日计提应收利息,并实际利率法在资产负债表日按公允价值进行公允价值估值。

报告期末,本基金资产净值占前10大持仓的前10名资产持仓市值比例,即按照票面利率或约定利率每日计提应收利息,并实际利率法在资产负债表日按公允价值进行公允价值估值。

本报告期末的公允价值超过其账面价值的20%的情况。

5.8.3 期末公允价值对当期损益的影响金额为本期末公允价值与净资产值的20%的差额。

5.8.4 中国证监会规定应予披露的发行主体本报告期出现以下情况之一时,或其在报告编制日以前一年内受到公开谴责、处罚,本报告期应披露该证券投资决策流程:

5.8.4.1 其他资产产生

序号	项目名称	金额(元)
1	有价证券名称	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	8,879,039.39
4	应收申购款	-
5	其他应收款	27,356.75

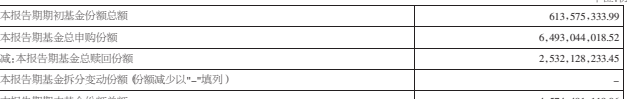
6	付摊费用		--
7	其他		--
8	合计		8,906,396.14

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



客户服务中心电话:400-888-2666,010-6250088,
网址:<http://www.csfund.com.cn>.