长盛同德主题增长股票型证券投资基金

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	长盛同德主题股票
基金主代码	519039
交易代码	519039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月25日
报告期末基金份额总额	7,632,543,690.10份
投资目标	本基金为股票型证券投资基金,投资目标是在确定促进中国经济持续增长的主题背景下,挖掘中国经济持续增长的动力之所在,选取具有高成长性和具备持续增长潜力的上市公司,分享中国经济高速增长的成果;在严格控制投资风险的前提下,努力保持基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将沿着全球化、城镇化、消费升级、制度变革四大主题进行大类资产配置;根据企业获利能力、增长能力、资产回报率、资产管理能力等定量指标,结合公司治理结构状况等定性指标对行业内上市公司进行综合评价,动态的寻找行业与个股的最佳结合点。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准:沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金。风险高于混合型基金、债券基金,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	-414,349,686.55
2.本期利润	-556,667,308.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0726
4.期末基金资产净值	5,717,806,538.90
5.期末基金份额净值	0.7491

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。

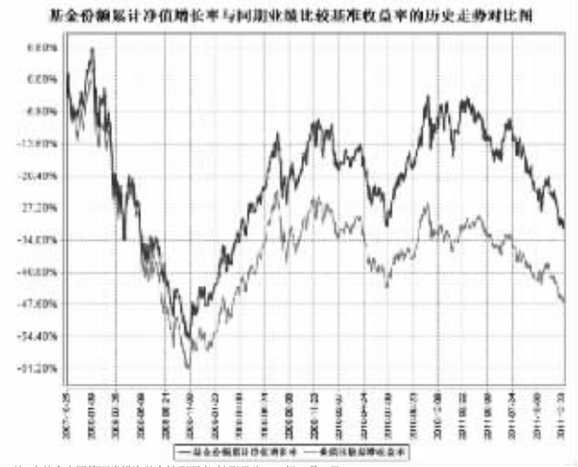
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-8.87%	1.25%	-7.05%	1.12%	-1.82%	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



注:本基金由同德证券投资基金转型而来,转型日为2007年10月25日。

§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		
邓永明	本基金基金经理,长盛动态精选证券投资基金基金经理,投资管理部副总监。	2010年8月12日	—	12年	男,1971年7月出生,中国国籍,毕业于山西农业大学,获学士学位。曾任大成基金管理有限公司研究员、交易员和基金经理助理。2005年7月底加入长盛基金管理有限公司投资管理部,曾任基金同益基金经理助理,同德证券投资基金基金经理、长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理、长盛同德主题成长股票型证券投资基金基金经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任投资管理部副总监,长盛动态精选证券投资基金基金经理、长盛同德主题增长股票型证券投资基金(本基金)基金经理。
王雪松	本基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理,社保组合组合经理。	2009年8月24日	—	9年	男,1968年10月出生,中国国籍。北京大学硕士。历任巨田证券有限公司研究员、新世纪基金管理公司研究员。2007年8月加入长盛基金管理有限公司,曾任长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理助理,行业研究员,现任社保组合组合经理、长盛同德主题增长股票型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛成长价值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、《长盛同德主题增长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 报告期内的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 宏观经济运行分析

2011年是欧债剧期高峰年,预计欧洲全年会执行宽货币政策;美国经济则缓慢复苏,美元回流带动美元走强,使得我国输入性通胀压力逐得缓和。我们判断我国上半年货币政策层面仍会以结构性定向宽松为主,下半年则会视经济情况可能会变得积极。相对2011年的流动性紧张,今年的压力会得到缓和。

下一个阶段,考虑到经济的下行风险,我们重点关注业绩确定性强的低估值品种,积极布局以下投资主题:①受益于政府及财政政策支持的行业,包括环保、信息服务、新材料、电子等。②经济复苏主题,包括早周期的汽车、工程机械、建材、家电等品种。③科技创新主题,包括具有优秀管理团队、技术领先优势或独特商业模式的科技、医药和化工行业中能够持续成长的企业。④通胀变化主题,关注成本下降毛利率扩张、需求较为稳定、对利率敏感的低估值品种,包括能够持续增长的大众品牌消费品。

§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	4,781,068,962.31	83.19
	其中:股票	4,781,068,962.31	83.19
2	固定收益投资	148,111,300.00	2.58
	其中:债券	148,111,300.00	2.58
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	297,000,565.50	5.17
	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	486,335,416.67	8.46
6	其他资产	34,660,324.97	0.60
7	合计	5,747,176,569.45	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	743,441,842.28	13.00
C	制造业	2,291,002,312.39	40.07
C0	食品、饮料	706,744,345.88	12.36
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	334,972,240.60	5.86
C5	电子	86,115,886.26	1.51
C6	金属、非金属	138,662,555.54	2.43
C7	机械、设备、仪表	553,025,879.60	9.67
C8	医药、生物制品	471,481,404.51	8.25
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	46,490,540.63	0.81
E	建筑业	147,865,273.94	2.59
F	交通运输、仓储业	52,547,953.60	0.92
G	信息技术业	120,607,669.20	2.11
H	批发和零售贸易	127,688,526.60	2.23
I	金融、保险业	994,487,569.44	17.39
J	房地产业	195,104,591.27	3.41
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	61,832,682.96	1.08
M	综合类	-	-
	合计	4,781,068,962.31	83.62

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	000581	威孚高科	8,605,148	308,838,761.72	5.40
2	600036	招商银行	22,043,539	261,656,807.93	4.58
3	600267	海正药业	7,206,345	228,945,580.65	4.00
4	601088	中国神华	7,800,729	197,592,465.57	3.46
5	000937	冀中能源	11,002,648	185,504,645.28	3.24
6	600123	兰花科创	4,378,996	170,255,364.48	2.98
7	000858	五粮液	5,007,914	164,259,579.20	2.87
8	600582	天地科技	8,503,391	157,312,733.50	2.75
9	600309	烟台万华	12,000,152	154,801,960.80	2.71
10	600000	浦发银行	17,710,208	150,359,665.92	2.63

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	148,111,300.00	2.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	148,111,300.00	2.59

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	088039	08兵器装备债	800,000	80,632,000.00	1.41
2	115003	中兴债1	700,000	67,479,300.00	1.18

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。

根据宜宾五粮液股份有限公司2011年5月27日公告的《关于收到中国证监会行政处罚决定书的公告》显示,公司因违规披露、信息披露不及时、不完整等事项受到中国证监会行政处罚,公司表示接受证监会的行政处罚,吸取教训,不断完善公司治理和合规经营。本基金做出如下说明:

1、对于白酒行业及五粮液,本公司研究员自二季度以来一直看好和积极推荐,并有相关的研究报告。

2、基于相关研究,本基金判断,随着我国国民收入的提高、城镇化的快速推进,我国白酒行业将继续维持高速增长,作为国内最大的白酒生产企业,高端白酒中的代表性企业之一,五粮液公司的投资价值会得到提升,对于该公司被监管部门处罚的事件,本基金经过认真研究,做出如下判断:公司自2009年底以来,对公司治理、信息披露、关联交易进行了很大改进,并使得公司业绩保持了良好的发展势头,公司也在2011年5月27日的公告中,对公司整改情况进行了披露。因此,我们审慎地将五粮液在配置上作为组合的阶段性重要投资品种。

3、今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述情况外,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股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,543,016.22
2	应收证券清算款	30,120,387.72
3	应收股利	-
4	应收利息	1,709,921.01
5	应收申购款	257,000.02
6	其他应收款	30,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,660,324.97

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	7,701,130,301.39
报告期期间基金总申购份额	16,810,249.93
减:报告期期间基金总赎回份额	85,396,861.22
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	7,632,543,690.10

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会关于核准同德证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复;

2、《长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛同德主题增长股票型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛同德主题增长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

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	910,119,615.60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。
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(2011年10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-1,179,701.46
2.本期利润	22,656,121.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0238
4.期末基金资产净值	972,633,837.69
5.期末基金份额净值	1.0687

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	2.16%	0.35%	3.08%	0.18%	-0.92%	0.17%

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		
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,固定收益部副总监。	2008年12月19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(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。
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	—	9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;新加坡华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 报告期内的投资策略和业绩表现说明

4.4.1宏观经济运行分析

四季度经济短周期进入衰退中后期,经济持续回落,通胀拐头向下,资本市场进入最后恐慌性的宣泄阶段。从行业角度看,金融服务、信息服务、公用事业、食品饮料等防御性板块跌幅较少,而有色金属、化工、采掘、轻工制造、黑色金属、电子、机械设备、建筑建材等板块大幅下跌超过15%。从风格角度看,价值因子持续获取较多超额收益,风格估值差异持续缩小。

4.4.2本基金业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.827元,本报告期份额净值增长率为-5.27%,同期业绩比较基准增长率为-5.81%。

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

2012年,经济将进入2009年经济筑底回升、2010和2011年高位回落后的底部阶段,未来将会呈现L形走势。中长期看,经济进入以8-9%为增长中枢的窄幅波动区域,不会有明显的新周期启动,但也不会很快出现大幅调整。受前期需求回落,政策放松等因素的影响,流动性偏紧局面将会逐步改善。本基金将在战略资产、战术资产配置模型指导下,逐步提升股票资产配置比例,由积极防御转向进攻状态。

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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	109,739,200.34	9.07
	其中:股票	109,739,200.34	9.07
2	固定收益投资	1,017,068,035.77	84.03
	其中:债券	1,017,068,035.77	84.03
	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	46,554,515.94	3.85
6	其他资产	36,949,860.05	3.05
7	合计	1,210,311,612.10	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	32,132,789.24	3.30
C0	食品、饮料	4,962,289.24	0.51
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	3,225,000.00	0.33
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	19,180,000.00	1.97
C8	医药、生物制品	4,765,500.00	0.49
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	35,152,220.75	3.61
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	21,315,000.00	2.19
H	批发和零售贸易	11,148,999.68	1.15
I	金融、保险业	6,655,219.47	0.68
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	3,334,971.20	0.34
M	综合类	-	-
	合计	109,739,200.34	11.28

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	601669	中国水电	8,594,675	35,152,220.75	3.61
2	300270	中威电子	500,000	21,315,000.00	2.19
3	300283	温州宏丰	700,000	14,000,000.00	1.44
4	600694	大商股份	335,006	11,148,999.68	1.15
5	601555	东吴证券	1,012,971	6,655,219.47	0.68
6	600582	天地科技	280,000	5,180,000.00	0.53
7	600559	老白干酒	238,228	4,962,289.24	0.51
8	600267	海正药业	150,000	4,765,500.00	0.49
9	601928	凤凰传媒	398,920	3,334,971.20	0.34
10	600309	烟台万华	250,000	3,225,000.00	0.33

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	20,680,975.00	2.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,101,000.00	8.24
	其中:政策性金融债	80,101,000.00	8.24
4	企业债券	579,203,616.27	59.55
5	企业短期融资券	49,933,000.00	5.13
6	中期票据	-	-
7	可转债	287,149,444.50	29.52
8	其他	-	-
9	合计	1,017,068,035.77	104.57

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	1,104,670	111,030,381.70	11.42
2	113001	中行转债	950,000	89,851,000.00	9.24
3	113002	工行转债	800,000	85,168,000.00	8.76
4	115003	中兴债1	688,231	66,344,780.17	6.82
5	126013	08青啤债	683,200	62,840,736.00	6.46

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。

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	250,000.00
2	应收证券清算款	26,980,676.17
3	应收股利	-
4	应收利息	9,716,750.30
5	应收申购款	2,433.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,949,860.05

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	111,030,381.70	11.42
2	113001	中行转债	89,851,000.00	9.24
3	113002	工行转债	85,168,000.00	8.76
4	110011	歌华转债	1,100,062.80	0.11

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(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601669	中国水电	35,152,220.75	3.61	新股流通受限
2	300270	中威电子	21,315,000.00	2.19	新股流通受限
3	300283	温州宏丰	14,000,000.00	1.44	新股流通受限
4	601555	东吴证券	6,655,219.47	0.68	新股流通受限
5	601928	凤凰传媒	3,334,971.20	0.34	新股流通受限

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	988,350,164.34
报告期期间基金总申购份额	4,223,722.14
减:报告期期间基金总赎回份额	82,454,270.88
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	910,119,615.60

§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、《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛积极配置债券型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛积极配置债券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。

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1月20日

长盛量化红利策略股票型证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011年12月31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	290,968,666.33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(2011年10月1日-2011年12月31日)
1.本期已实现收益	-4,735,670.80
2.本期利润	-13,391,376.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0459
4.期末基金资产净值	240,768,904.61
5.期末基金份额净值	0.827

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(