长盛货币市场基金

【2012】第二季度报告

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7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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7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2012年4月1日起至2012年6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	1,086,622,054.66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4月1日-2012年6月30日)
1. 本期已实现收益	8,584,718.49
2.本期利润	8,584,718.49
3.期末基金资产净值	1,086,622,054.66

注:1、所列数据截止到2012年6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。

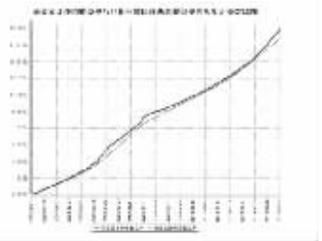
3.2 基金净值表现

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	1.0508%	0.0051%	0. 8568%	0.0003%	0.1940%	0.0048%

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、社保组合组合经理、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1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 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行情回顾及运作分析

1、报告期内行情回顾

2012年2季度,国内宏观经济继续下行,通胀大幅回落,信贷增速低于预期,央行降准、降息陆续进行,货币政策逐渐转向适度宽松。

货币市场上,2季度整体利率水平呈下行趋势,公开市场操作总体平衡,央票继续停发。央行5月份降准后利率水平明显下行,银行间市场7天回购利率的中枢水平降至2.5%附近,各期限SHIBOR利率呈现明显的陡峭化下行,仅在季度末出现了明显的上行。短券方面,央票、短融在2季度收益率都大幅下行,1年期央票收益率下行80BP左右,高评级短融收益率大幅下行了100 BP,而AA、AA-等中低评级短融收益率平均大幅下行了150BP左右。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内,综合考虑收益性和流动性要求,以及未来市场利率的变动趋势,本基金主要以银行存款、短期融资券、央票配置为主,适当进行逆回购操作。

4.4.2本基金业绩表现

2012年2季度,长盛货币净值收益率为1.0508%,同期业绩比较基准收益率0.8568%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1、2012年3季度宏观经济和货币市场展望

展望3季度,国内需求依然没有明显起色,物价虽已大幅下行但趋势依然向下,消费增速提升和基建投资扩张的空间相当有限。微观层面上,物价下行伴随着企业收入和利润的明显下行,经济中各类企业为应对经济调整而采取压缩长期资本开支、降低经营成本等自我调整,使得经济实际上已经处于向下自我加强的收缩阶段。

宏观政策方面,鉴于实体经济进一步衰退的状况得到确认,预计未来几个月主要央行还会继续采取宽松政策,放松货币条件,促进银行对实体经济的信贷支持,降准、降息政策有望继续出台,资金面将呈现适度宽松格局,货币市场利率有望在低位维持或继续下行。

2、本基金2012年3季度投资策略

基于上述判断,我们认为,由于利率水平已经明显下降,3季度货币基金运作空间较2季度减小,但风险依然不大;短券收益率未来收益率水平仍有下降的空间,但空间已缩小。信用产品方面,由于企业盈利处于下降趋势中,在获取票息收益的同时我们将高度重视信用风险的防范。此外,滚动配置银行存款到期期限。同时,我们须防范年末资金面紧张对于市场的冲击。基金将根据市场变化适时调整组合中类属资产的配置比例,适当缩短组合的平均剩余期限,努力做到组合资产流动性与收益性的良好匹配。

§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	固定收益投资	472,071,885.06	39.23
	其中:债券	472,071,885.06	39.23
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	144,900,417.35	12.04
	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	480,951,421.35	39.97
4	其他资产	105,352,701.41	8.76
5	合计	1,203,276,425.17	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		2.01
	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	114,799,507.80	10.56
	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	146
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	169
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	112

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	17.47	10.56
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	9.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.78	-
3	60天(含)-90天	9.25	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.65	-
4	90天(含)-180天	37.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	26.85	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		101.04	10.56

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	59,241,208.66	5.45
3	金融债券	90,724,944.13	8.35
	其中:政策性金融债	90,724,944.13	8.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	322,105,732.27	29.64
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	472,071,885.06	43.44
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	80,722,720.76	7.43

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	50,516,211.19	4.65
2	1101094	11央行票据94	400,000	39,489,782.95	3.63
3	041262012	12湘投集CP001	200,000	20,245,109.62	1.86
4	041160013	11南航工CP001	200,000	20,190,221.94	1.86
5	041258010	12粤打捞局CP001	200,000	20,177,102.10	1.86
6	041259021	12杭钢商贸CP001	200,000	20,118,649.76	1.85
7	041252019	12裕廊化工CP001	200,000	20,110,158.74	1.85
8	110206	11国开06	200,000	20,074,116.10	1.85
9	041262020	12富通CP001	200,000	20,043,689.01	1.84
10	041262016	12赣长运CP001	200,000	20,000,943.65	1.84

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	33
报告期内偏离度的最高值	0.4227%
报告期内偏离度的最低值	0.1299%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2683%

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。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	7,619,888.50
4	应收申购款	97,705,456.16
5	其他应收款	27,356.75
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	105,352,701.41

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	652,611,388.26
本报告期基金总申购份额	2,227,130,319.88
减:本报告期基金总赎回份额	1,793,119,653.48
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	1,086,622,054.66

§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或/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。

长盛同德主题增长股票型证券投资基金

【2012】第二季度报告

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7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7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2012年4月1日起至2012年6月30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	7,455,453,890.29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(2012年4月1日-2012年6月30日)
1.本期已实现收益	-42,281,803.98
2.本期利润	65,774,348.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.0088
4.期末基金资产净值	5,596,239,674.74
5.期末基金份额净值	0.7506

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6月30日。

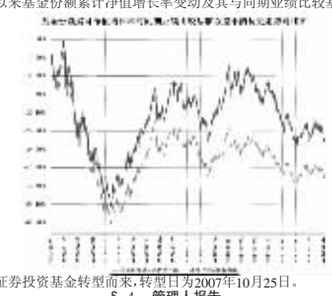
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	1.09%	1.11%	0.47%	0.90%	0.62%	0.21%

3.2.2 自基金转型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	—	13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。

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

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1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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2季度,海外经济不甚乐观。美国经济数据与去年4季度以来的境况相反,房地产数据逐步好转,但原已恢复的消费者信心和制造业数据出现了回调,实体经济仍呈现弱复苏状态;欧元区却危机有所扩大,西班牙、意大利危机加剧,全球避险情绪强烈。货币方面,美联储议息会议没有提及QE3,定量宽松预期再次落空,海外股票市场和大宗商品出现普遍下跌。国内经济则延续环比下滑的趋势,煤炭库存高企,发电量同比低增长偏弱,经济状况未如预期企稳,反而有所恶化。为了实现稳增长目标,政府投资项目快速放行,各项刺激政策也逐步推出,6月8日,央行降息,启动了降息周期。但经济数据大大低于预期,悲观情绪再次袭击A股市场,股指整体下滑,煤炭、水泥等强周期股大幅下挫。

本基金预期政策调控力度将逐步放松,存款准备金率和基准利率均将下调几次,投资上从预期政策放松的角度入手,配置上适度偏重于周期股。但是,出于对通胀的担忧,政府放松力度明显弱于预期,同时经济的快速下滑打击了投资者信心,周期股大幅回调,导致本基金损失明显,对此我们深表歉意。

4.5 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0.7506元,本报告期份额净值增长率为1.09%,同期业绩比较基准增长率为0.47%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一、对宏观经济和证券市场的展望

3季度,我们判断国内经济仍将处于探底企稳阶段,通胀水平继续回落,政策放松的空间打开,调控力度将加大,经济下滑趋势将逐步遏制。传统的经济增长模式已很难再重复,经济结构转型势在必行,我们认为国家会把有质量的GDP增长将作为下一个阶段经济增长的引擎,相关行业将受益于这方面政策的支持。流动性上,货币政策将继续宽松,存准率和基准利率仍有下调空间。

我们认为,随着原材料价格的回落和货币政策的逐步放松,企业的生产成本将下降,盈利能力有所提高,经济将逐步企稳,但要素成本的刚性上升制约着经济复苏的空间,经济总体呈"L"形复苏。在政府平衡增长与通胀中,证券市场单边上涨的机会较小,更多地将是结构性机会,自下而上选股更加重要。

二、本基金下阶段投资策略

未来一个季度,需要平衡经济探底过程中的不确定性与可能继续的宽松政策这一矛盾,期待"十八大"后更加明确的经济政策,除了重点关注业绩确定增长的必须消费品和成长股外,尽可能地平衡经济增速触底带来的盈利能力回升的时间节奏。未来将积极布局以下投资主题:①必需消费品主题,包括与大众消费密切相关的品牌消费品和人口老龄化受益的医药股;②金融改革与创新主题,包括金融创新过程中受益的保险、券商等;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TMT行业、新材料以及环保等行业中能够持续成长的企业;④流动性宽松推动的估值修复主题,包括与经济发展密切相关的银行和上游有定价能力的资源股。

§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	4,625,848,745.18	81.74
	其中:股票	4,625,848,745.18	81.74
2	固定收益投资	152,060,300.00	2.69
	其中:债券	152,060,300.00	2.69
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	400,000,000.00	7.07
	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	425,855,394.99	7.52
6	其他资产	55,730,769.71	0.98
7	合计	5,659,495,209.88	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	560,202,466.41	10.01
C	制造业	2,092,056,783.10	37.38
C0	食品、饮料	665,528,867.43	11.89
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	122,720,772.24	2.19
C5	电子	76,431,514.50	1.37
C6	金属、非金属	249,694,616.00	4.46
C7	机械、设备、仪表	748,731,889.61	13.38
C8	医药、生物制品	228,949,123.32	4.09
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	100,249,558.20	1.79
E	建筑业	110,852,818.75	1.98
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	102,818,485.46	1.84
H	批发和零售贸易	239,065,470.41	4.27
I	金融、保险业	965,428,755.00	17.25
J	房地产业	455,174,407.85	8.13
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	4,625,848,745.18	82.66

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	8,942,248	245,017,595.20	4.38
2	601628	中国人寿	12,012,673	219,831,915.90	3.93
3	601318	中国平安	4,505,388	206,076,447.12	3.68
4	600887	伊利股份	9,023,739	185,708,548.62	3.32
5	600036	招商银行	14,950,506	163,259,525.52	2.92
6	000895	双汇发展	2,599,237	160,840,785.56	2.87
7	000937	冀中能源	10,002,921	152,744,603.67	2.73
8	600519	贵州茅台	500,471	119,687,639.65	2.14
9	600837	海通证券	12,051,300	116,054,019.00	2.07
10	600030	中信证券	8,803,578	111,189,190.14	1.99

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	152,060,300.00	2.72
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	152,060,300.00	2.72

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	83,216,000.00	1.49
2	115003	中兴债1	700,000	68,844,300.00	1.23

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。

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	2,793,200.16
2	应收证券清算款	49,558,880.14
3	应收股利	-
4	应收利息	3,115,153.69
5	应收申购款	233,535.72
6	其他应收款	30,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,730,769.71

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	7,567,244,192.73
报告期期间基金总申购份额	7,526,780.58
减:报告期期间基金总赎回份额	119,317,083.02
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	7,455,453,890.29

§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。

长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金

【2012】第二季度报告

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7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7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其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至2012年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同瑞中证200分级
基金主代码	160808
交易代码	160808
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月6日
报告期末基金份额总额	53,515,354.88份
投资目标	本基金运用指数化投资方式,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现对中证200指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用完全复制法,按照成份股在中证200指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证200指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于中证200指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%-10%(其中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5%)。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。
业绩比较基准	中证200指数收益率×95%+一