长盛积极配置债券型证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	738,785,859.25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(2012年4月1日—2012年6月30日)
1.本期已实现收益	2,382,998.76
2.本期利润	8,535,657.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0109
4.期末基金资产净值	800,289,337.85
5.期末基金份额净值	1.0832

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	0.85%	0.28%	2.24%	0.11%	-1.39%	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		
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;新加坡毕盛离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

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 报告期内基金投资策略和业绩表现说明

4.4.1 宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内,本基金管理人秉承谨慎原则,在做好组合流动性管理的前提下,通过对于经济走势和政策动向的深入分析,灵活进行资产配置,并通过对个券个股的甄别分析,提高本基金在风险可控前提下的持续获利的能力。

§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	136,155,452.98	9.91
	其中:股票	136,155,452.98	9.91
2	固定收益投资	1,155,657,002.35	84.13
	其中:债券	1,155,657,002.35	84.13
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	9,000,000.00	0.66
	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	51,297,301.24	3.73
6	其他资产	21,614,634.24	1.57
7	合计	1,373,724,390.81	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	12,502,500.00	1.56
C	制造业	34,968,744.37	4.37
C0	食品、饮料	11,899,467.24	1.49
C1	纺织、服装、皮毛	834,000.00	0.10
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,227,121.45	0.78
C5	电子	1,710,838.22	0.21
C6	金属、非金属	2,365,810.72	0.30
C7	机械、设备、仪表	9,196,000.00	1.15
C8	医药、生物制品	2,735,506.74	0.34
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	1,048,707.28	0.13
G	信息技术业	4,208,500.00	0.53
H	批发和零售贸易	2,099,300.00	0.26
I	金融、保险业	76,698,130.13	9.58
J	房地产业	4,629,571.20	0.58
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	136,155,452.98	17.01

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	601166	兴业银行	1,373,693	17,830,535.14	2.23
2	600000	浦发银行	2,100,500	17,077,065.00	2.13
3	601328	交通银行	3,515,800	15,961,732.00	1.99
4	000001	深发展A	1,020,977	15,478,011.32	1.93
5	600028	中国石化	1,500,000	9,450,000.00	1.18
6	600519	贵州茅台	30,000	7,174,500.00	0.90
7	600837	海通证券	599,969	5,777,701.47	0.72
8	601318	中国平安	99,980	4,573,085.20	0.57
9	000002	万 科A	500,000	4,455,000.00	0.56
10	600309	烟台万华	299,947	4,004,292.45	0.50

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	28,879,200.00	3.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	143,083,000.00	17.88
	其中:政策性金融债	143,083,000.00	17.88
4	企业债券	575,004,990.95	71.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	408,689,811.40	51.07
8	其他	-	-
9	合计	1,155,657,002.35	144.40

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	2,358,360	235,623,747.60	29.44
2	113002	工行转债	1,273,600	138,809,664.00	17.34
3	115003	中兴债1	688,231	67,686,830.62	8.46
4	126013	08青啤债	683,200	64,548,736.00	8.07
5	110314	11进出14	500,000	51,980,000.00	6.50

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查或处罚。

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	7,121,399.80
3	应收股利	-
4	应收利息	13,897,848.49
5	应收申购款	95,385.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,614,634.24

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	235,623,747.60	29.44
2	113002	工行转债	138,809,664.00	17.34
3	113001	中行转债	29,136,000.00	3.64
4	110011	歌华转债	1,144,055.80	0.14

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	835,869,874.41
报告期期间基金总申购份额	5,532,155.20
减:报告期期间基金总赎回份额	102,616,170.36
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	738,785,859.25

§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。

长盛同庆中证800指数分级证券投资基金

(原长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型)

【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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司(以下简称:中国建设银行)根据《盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金合同》("本基金合同")、《盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》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。

2012年4月10日,本基金管理人就长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金("长盛同庆封闭")转型事宜召开了基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型有关事项的议案》,对长盛同庆封闭实施转型,上述决议已获中国证监会核准。

2012年5月8日,本基金管理人发布《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金之同庆A、同庆B基金份额终止上市的公告》,自封闭期到期日次日即2012年5月12日起,长盛同庆封闭基金转型为长盛同庆中证800指数分级证券投资基金,基础份额基金代码不变,仍为"160806";由《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金合同》生效,基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金合同》为准。相关公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、深圳证券交易所网站(http://www.szse.cn)及本公司网站。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2012年5月12日(基金合同生效日)起至2012年6月30日止(注:长盛同庆封闭报告期为自2012年4月1日起至2012年5月11日(基金合同失效前日)止)。

§2 基金产品概况(长盛同庆中证800分级)

基金简称	长盛同庆中证800分级
基金主代码	160806
交易代码	160806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月12日
报告期末基金份额总额	5,241,812,646.61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800指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑标的指数样本中个股的日由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性,通过抽样方式构建基金股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于4%的投资目标。 当预期成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回而导致基金跟踪中证800指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金将在基金合同生效3个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。
业绩比较基准	95%×中证800指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为抽样复制指数的股票型基金,具有高风险、高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

下属二级基金的基金简称	长盛同庆800A	长盛同庆800B	长盛同庆中证800分级
下属二级基金的交易代码	150098	150099	160806
报告期末下属二级基金的份额总额	1,337,546,640.00份	2,006,319,961.00份	1,897,946,045.61份
下属二级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	获取杠杆收益,风险和预期收益均高于长盛同庆中证800分级份额。	高风险、高预期收益。

§3 基金产品概况(长盛同庆封闭)

基金简称	长盛同庆封闭
基金主代码	160806
交易代码	160806
基金运作方式	契约型,自2009年5月12日起,进入为期三年的封闭期。2012年5月11日,封闭期届满,并于次日转型为长盛同庆中证800指数分级证券投资基金。
基金合同生效日	2009年5月12日
报告期末基金份额总额	14,686,733,239.06份
投资目标	长盛同庆封闭投资于具有稳健成长和业绩优良的上市公司股票,力求在有效控制风险的前提下实现基金资产的稳健、持续增值。
投资策略	长盛同庆封闭在股票投资上,通过优选业绩优良、成长性稳定,在行业内具有核心竞争优势的上市公司股票进行投资,以谋求基金资产的长期稳定增长。在对市场趋势的有效判断的前提下,进行稳健的战略资产配置和积极的行业配置,同时根据对上市公司充分的基本面分析,控制行业中的价值个股。 长盛同庆封闭的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,根据债券市场的长期稳定收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%
风险收益特征	从基金资产整体运作来看,长盛同庆封闭为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称	长盛同庆封闭A	长盛同庆封闭B
下属两级基金的交易代码	150006	150007
报告期末下属两级基金的份额总额	5,874,693,295.62份	8,812,039,943.44份
下属两级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、收益相对较高。

§4 主要财务指标和基金净值表现

4.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	长盛同庆中证800分级 报告期(2012年5月12日-2012年6月30日)	长盛同庆封闭 报告期(2012年4月1日-2012年5月11日)
1.本期已实现收益	26,533,618.78	491,635,483.50
2.本期利润	-197,475,616.65	731,779,887.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0298	0.0498
4.期末基金资产净值	5,035,603,209.33	12,925,228,407.02
5.期末基金份额净值	0.961	0.880

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、长盛同庆中证800分级所列数据截止到2012年6月30日;长盛同庆封闭所列数据截止到2012年5月11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。

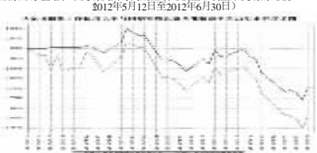
4.2 基金净值表现(长盛同庆中证800分级)

4.2.1 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
2012年5月12日至2012年6月30日	-3.66%	0.78%	-6.28%	1.06%	2.62%	-0.28%

4.2.2 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

2012年5月12日至2012年6月30日)



1、本基金由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型而来,基金转型日(即基金合同生效日)为2012年5月12日,截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为: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800指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种,其中权证资产占基金资产净值的比例为0-3%,现金或者剩期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

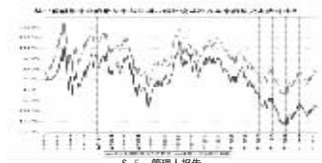
4.3 基金净值表现(长盛同庆封闭)

4.3.1 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
2012年4月1日至2012年5月11日	6.02%	0.69%	5.33%	0.77%	0.69%	-0.08%

4.3.2 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

2009年5月12日至2012年5月11日)



§5 管理人报告

5.1 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		
王宁	本基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理,投资管理部总监。	2012年5月12日	—	14年	男,1971年10月出生,中国国籍。毕业于北京大学光华管理学院,EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理,兴业基金经理等职务。2005年4月加盟长盛基金管理有限公司,曾任投资管理部基金经理助理,长盛动态精选基金基金经理等职务,现任投资管理部总监,长盛成长价值证券投资基金基金经理,长盛同庆中证800指数分级证券投资基金(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。

5.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

2012年4月1日至2012年5月11日,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、《长盛同庆可分离交易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。

2012年5月12日长盛同庆封闭基金转型为长盛同庆中证800指数分级证券投资基金,即日起至报告期末,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、《长盛同庆中证800指数分级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。

5.3 公平交易专项说明

5.3.1 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。

5.3.2 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。

5.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

5.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年2季度,国际市场方面,欧洲危机持续升温,全球资本市场呈现不断下跌状态。

国内市场,虽然宏观预期经济政策有所放松和金融市场资本升温,但是实际宏观经济和上市公司业绩不断低于预期,打击国内市场不断下跌。

2012年2季度,同庆基金顺利完成由主动基金向被动指数基金转型,在转型过程中本基金股票比例为适应转型方案,进行大规模调整。

在转型过程中,本基金继续利用市场资金阶段性紧张的机会,积极参与逆回购等交易提高组合资金利用效率。

5.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日,长盛同庆中证800分级份额净值为0.961元,本报告期2012年5月12日至2012年6月30日)份额净值增长率为-3.66%,同期业绩比较基准增长率为-6.28%。

截至2012年5月11日,长盛同庆封闭份额净值为0.880元,本报告期2012年4月1日至2012年5月11日)份额净值增长率为6.02%,同期业绩比较基准增长率为5.33%。

5.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2季度,国内外市场在不断预期放松和救助的过程中,逐渐下跌,完全低于市场的想象。

由于欧洲危机属于格局性全面危机,可以预见短期之内难以出现实质性解决方案和完全好转迹象,市场仍然处在危机和拯救的不断反复过程中。

国内市场由于上市公司业绩整体低于预期,政策放松力度可能低于预期,行业和股票之间的差异会越来越大。

同庆基金由主动型基金转为指数基金,顺利完成转型,基金未来操作跟踪中证800指数,属于被准型指数基金,本基金将按照基金合同规定为基金持有人提供优良的指数投资工具。

§6 投资组合报告(长盛同庆中证800分级)

报告期为2012年5月12日至2012年6月30日)

6.1 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	4,181,962,362.76	81.06
	其中:股票	4,181,962,362.76	81.06
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	965,701,005.56	18.72
6	其他资产	11,563,641.11	0.22
7	合计	5,159,227,009.43	100.00

6.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

6.2.1 指数投资部分

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	36,805,925.42	0.73
B	采掘业	376,159,459.29	7.47
C	制造业	1,602,824,519.72	31.83
C0	食品、饮料	315,207,707.91	6.26
C1	纺织、服装、皮毛	36,227,444.59	0.72
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	123,397,722.06	2.45
C5	电子	86,075,867.47	1.71
C6	金属、非金属	331,008,836.57	6.57
C7	机械、设备、仪表	478,416,817.52	9.50
C8	医药、生物制品	220,941,140.57	4.39
C99	其他制造业	11,548,983.03	0.23
D	电力、煤气及水的生产和供应业	102,517,826.76	2.04
E	建筑业	77,030,588.12	1.53
F	交通运输、仓储业	142,841,941.94	2.84
G	信息技术业	150,086,553.30	2.98
H	批发和零售贸易	143,301,977.30	2.85
I	金融、保险业	1,110,674,743.34	22.06
J	房地产业	282,723,944.83	5.61
K	社会服务业	46,730,584.30	0.93
L	传播与文化产业	32,596,967.45	0.65
M	综合类	77,667,330.99	1.54
	合计	4,181,962,362.76	83.05

6.22 积极投资部分

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	-	-
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	-	-
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	-	-

6.3 报告期末指数投资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	601318	中国平安	2,463,148	112,664,389.52	2.24
2	000002	万科 A	11,425,267	101,799,128.97	2.02
3	600016	民生银行	16,604,411	99,460,421.89	1.98
4	600036	招商银行	9,091,647	99,280,785.24	1.97
5	601398	工商银行	19,358,548	76,466,264.60	1.52
6	601328	交通银行	16,834,309	76,427,762.86	1.52
7	600030	中信证券	5,810,258	73,383,558.54	1.46
8	600519	贵州茅台	305,220	72,993,363.00	1.45
9	601166	兴业银行	5,550,735	72,048,540.30	1.43
10	600000	浦发银行	8,226,617	66,882,396.21	1.33

积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

6.4 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。

6.5 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。

6.6 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