

## 长盛成长价值证券投资基金

## [2012] 第二季度报告

## § 1 重要提示

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，并对内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

本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7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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	长盛成长价值混合
交易代码	080001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年9月18日
报告期末基金份额总额	1,014,160,484.93份

本基金为平衡型基金，通过管理人的积极管理，在控制风险的前提下力争增值，分享成长资产的长期稳定增值。

本基金投资策略为灵活配置投资，在风险资产、战术性资产、股票和债券资产之间灵活配置，力争取得超过股票基准的业绩回报。

在资产配置方面，股票资产比例为55%~75%，债券资产比例为

20%~60%，现金资产比例不超过5%。

业绩比较基准 中信标普A股综合指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%

风险收益特征 本基金属平衡型基金，在承担适度风险的前提下，获得长期稳定的收益。

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

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 -36,309,198.14

2.本期利润 15,707,758.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.0154

4.期末基金资产净值 818,884,544.27

5.期末基金份额净值 0.807

注：1.所列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以所列数字为准。

2.所列数据截至到2012年6月30日。

3.本期利润是根据基金本期利润收入、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，本期利润不同时期可实现收益加上本期公允价值变动收益。

4.基金净值增长率=基金本期利润/基金资产净值。

5.报告期基金份额净值

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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.2 本基金合同生效以来基金份额累计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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.3 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.4 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.5 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.6 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.7 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.8 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.9 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.10 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.11 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.12 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.13 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.14 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.15 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.16 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.17 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.18 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.19 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.20 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.21 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.22 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.23 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.24 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.25 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.26 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.27 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(③) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 1.89% 0.70% 1.15% 0.38% 0.74% -0.19%

3.28 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