长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）

【2012】第三季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月25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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月24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7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛沪深300指数(LOF)
基金主代码	160807
交易代码	160807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年8月4日
报告期末基金份额总额	222,249,585.57份
投资目标	本基金采取指数化投资，跟踪沪深300指数，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%，且年化跟踪误差小于4%，以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金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自由流通市值规模、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均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%，且年化跟踪误差小于4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×沪深300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	本基金是股票指数型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	招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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,531,863.74
2.本期利润	-11,530,496.72
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0518
4.期末基金资产净值	170,515,681.53
5.期末基金份额净值	0.767

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9月30日。

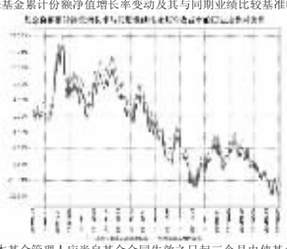
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-6.35%	1.12%	-6.46%	1.13%	0.11%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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:按照本基金合同规定，本基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十三条（二）投资范围、（七）投资限制的有关约定。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
冯雨生	本基金基金经理，长盛中证100指数证券投资基金基金经理。	2011年12月20日	-	5年	男，1983年11月出生。北京大学金融学硕士。2007年7月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员。现任长盛中证100指数证券投资基金基金经理，长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)，(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、《长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）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。

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。

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12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业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度全球经济复苏势头减弱，欧美经济增长率过低且失业率无显著改善，新兴市场增长持续放缓。为整顿财政和挽救脆弱的金融体系，欧洲央行推出了直接货币交易计划，美联储也如期推出新一轮资产购买计划。通过贸易和金融渠道，中国也受累其中，PMI创出年内新低，原材料库存、采购量和价格均处于低位，各项数据显示经济底部扑朔迷离。A股市场持续震荡，其中纺织服装、机械设备和房地产跌幅居前，医药生物和采掘有色跌幅较少。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为0.767元，本报告期份额净值增长率为-6.35%，同期业绩比较基准增长率为-6.46%。本报告期内日均跟踪误差为0.0544%，年度化跟踪误差为0.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一个季度，国内外宏观经济仍不乐观，欧美财政状况和金融体系仍面临挑战，国内经济增速将维持在低位。之前的各大儆局亦然存在，市场总体可能将保持震荡行情。

作为指数基金，我们将继续秉承指数化投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，控制基金的跟踪误差，在此基础上本基金将积极采用数量化投资策略增强指数，力争获取超额收益。

§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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	160,859,729.94	93.38
	其中:股票	160,859,729.94	93.38
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	11,039,174.08	6.41
6	其他资产	368,158.84	0.21
7	合计	172,267,062.86	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	995,524.99	0.58
B	采掘业	17,918,682.81	10.51
C	制造业	57,671,274.67	33.82
C0	食品、饮料	12,747,634.55	7.48
C1	纺织、服装、皮毛	573,281.92	0.34
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,613,619.15	2.12
C5	电子	2,412,079.41	1.41
C6	金属、非金属	13,319,052.64	7.81
C7	机械、设备、仪表	16,473,588.99	9.66
C8	医药、生物制品	8,494,929.21	4.98
C99	其他制造业	37,088.80	0.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,058,713.53	2.38
E	建筑业	5,131,607.06	3.01
F	交通运输、仓储业	3,757,269.03	2.20
G	信息技术业	4,726,592.25	2.77
H	批发和零售贸易	4,400,814.70	2.58
I	金融、保险业	48,749,445.59	28.59
J	房地产业	8,823,535.97	5.17
K	社会服务业	1,512,659.08	0.89
L	传播与文化产业	536,891.10	0.31
M	综合类	2,576,719.16	1.51
	合计	160,859,729.94	94.34

5.2.2 报告期末积极投资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	-	-
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	-	-

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

5.3.1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	118,865	4,985,198.10	2.92
2	600000	浦发银行	586,269	4,326,665.22	2.54
3	601166	兴业银行	358,396	4,304,335.96	2.52
4	600016	民生银行	667,720	3,772,618.00	2.21
5	601328	交通银行	868,383	3,699,311.58	2.17
6	600519	贵州茅台	15,001	3,687,245.80	2.16
7	600030	中信证券	282,628	3,332,184.12	1.95
8	000002	万 科A	340,537	2,870,726.91	1.68
9	600837	海通证券	299,159	2,865,943.22	1.68
10	601088	中国神华	118,053	2,716,399.53	1.59

5.3.2报告期末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。

5.4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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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	-
3	应收股利	38,061.93
4	应收利息	2,187.15
5	应收申购款	77,909.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	368,158.84

5.8.4 报告期末基金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处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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
本报告期期初基金份额总额	223,313,663.92
本报告期基金总申购份额	6,077,373.65
减:本报告期基金总赎回份额	7,141,452.00
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	222,249,585.57

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛沪深300指数证券投资基金（LOF)的批复;

2、《长盛沪深300指数证券投资基金（LOF)基金合同》;

3、《长盛沪深300指数证券投资基金（LOF)托管协议》;

4、《长盛沪深300指数证券投资基金（LOF)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。

长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

【2012】第三季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2012年10月25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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月24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7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛环球行业股票(QDII)
基金主代码	080006
交易代码	080006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月26日
报告期末基金份额总额	60,498,523.50份
投资目标	本基金主要投资于全球证券市场，把握全球经济趋势，精选景气投资行业，并在此基础上投资于其中的优势公司，实现充分分享全球经济增长收益的目标;同时在投资国家或地区配置上，有效实现全球分散化投资，力争充分分散风险，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法，运用Black-Litterman资产配置模型实现行业层面的风险最优配置，在行业内部，运用全球量化选股模型精选个股，投资管理人将两者进行有机结合，构建最优化的投资组合。
业绩比较基准	摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index)
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金。同时，本基金为全球股票型证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。此外，由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的股票型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
境外投资顾问	英文名称:GOLDMAN SACHS ASSET MANAGEMENT, L.P.
	中文名称:高盛资产管理有限责任合伙
境外资产托管人	英文名称:BANK OF CHINA (HONG KONG)
	中文名称:中国银行(香港)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07月01日-2012年09月30日)
1.本期已实现收益	-1,364,661.51
2.本期利润	2,297,368.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0376
4.期末基金资产净值	52,944,536.56
5.期末基金份额净值	0.875

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9月30日。

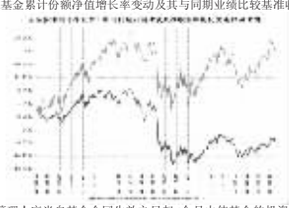
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	4.54%	0.58%	6.08%	0.81%	-1.54%	-0.23%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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:按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（二）投资范围、（九）投资限制的有关约定。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吴达	本基金基金经理、长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理、国际业务部总监。	2010年5月26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(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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Len Ioffe	高盛全球量化股票团队的高级投资组合经理，全球量化股票投资政策委员会成员。	19年	俄罗斯圣彼得堡理工大学颁发的计算机科学硕士，纽约大学斯特恩商学院工商管理硕士，曾供职于史密斯·巴尼·希尔森公司。1994年加入高盛资产管理，曾负责美国国内及国际投资组合的建立及风险分析，并实施不同的交易策略。

4.3 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、《长盛环球景气行业大盘精选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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为0.875元，本报告期份额净值增长率为4.54%，同期业绩比较基准增长率为6.08%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2012年最后三个月的全球市场，美、欧、日三大央行的量化宽松政策已经兑现，防御和确定性可能继续成为市场的主基调。11月即将来临的美国总统大选将成为影响市场波动的主要因素，无论结果如何都将启动政府债务上限的讨论，在此期间由于政策的不确定性会使经济活动减弱。

欧洲债务危机已经度过了2012年最艰难的希腊债务置换，并用货币宽松的方式锁定了西班牙和意大利的问题，欧盟稳定机制ESM也已正式启动。但用货币的方法仍然不能解决长期问题，经济表现比较好的德国也在财政压力共担的机制上越陷越深，欧洲经济的基本面仍害在短期内难以复原，市场下半年将继续围绕几次欧盟峰会振荡。

中国国内经济出现了一些环比改善的情况，但仍然没有反转的迹象。从国庆前后旺季数据来看，投资和消费的意愿仍然不强，经济很难在短期内走出弱势盘整的格局。年末各个市场的行情可能会比较平淡，组合将继续关注基本面良好的基础消费、科技、医疗保健、以及部分主题板块。

§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	36,319,670.76	68.01
	其中:普通股	35,009,975.26	65.55
	存托凭证	1,309,695.50	2.45
2	基金投资	-	-
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	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,026,676.41	31.88
8	其他资产	59,972.89	0.11
9	合计	53,406,320.06	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票投资及存托凭证分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	24,725,391.57	46.70
香港	10,928,754.40	20.64
加拿大	665,524.79	1.26

5.3 报告期末按行业分类的股票投资及存托凭证组合

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	8,539,652.99	16.13
金融	7,718,003.25	14.58
工业	4,828,910.14	9.12
医疗	4,556,670.14	8.61
能源	3,415,819.40	6.45
必需消费品	2,897,674.57	5.47
材料	2,340,958.56	4.42
非必需消费品	2,021,981.71	3.82
合计	36,319,670.76	68.60

注:本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准（GICS)进行行业分类

5.4 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及存托凭证

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	-	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	500	2,115,547.83	4.00
2	CHEVRON CORP	-	CVX US	纽约证券交易所	美国	1,950	1,441,258.57	2.72
3	IND & COMM BK OF CHI	工商银行	1398 HK	香港证券交易所	中国香港	350,000	1,310,965.46	2.48
4	PRICELINE.COM	-	PCLN US	纳斯达克证券交易所	美国	300	1,177,010.08	2.22
5	MICROSOFT CORP	-	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	6,000	1,133,009.88	2.14
6	ZHAOJIN MINING INDUS	招金矿业股份	1818 HK	香港证券交易所	中国香港	94,000	1,082,401.13	2.04
7	CHINA RES LAND	华润置地	1109 HK	香港证券交易所	中国香港	76,000	1,061,595.79	2.01
8	DANAHER CORP	-	DHR US	纽约证券交易所	美国	3,000	1,049,118.45	1.98
9	VISA INC-CLASS A SHA	-	V US	纽约证券交易所	美国	1,200	1,021,763.38	1.93
10	CHINA TAIPING INSURA	中国太平	966 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	996,104.76	1.88

5.5报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10投资组合报告附注

5.10.1 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记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 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。

5.10.3 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	应收股利	27,648.98
4	应收利息	1,008.40
5	应收申购款	31,315.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,972.89

5.10.4 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。

5.10.5 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。

5.10.6 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
本报告期期初基金份额总额	61,833,537.87
本报告期期间基金总申购份额	1,367,283.69
减:本报告期期间基金总赎回份额	2,702,298.06
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	60,498,523.50

§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、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛环球景气行业大盘精选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和/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。

长盛货币市场基金

【2012】第三季度报告

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10月25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10月24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7月1日起至2012年9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	1,105,684,467.05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7月1日-2012年9月30日)
1. 本期已实现收益	9,137,535.58
2.本期利润	9,137,535.58
3.期末基金资产净值	1,105,684,467.05

注:1、所列数据截止到2012年9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