

长盛动态精选证券投资基金

[2012] 第一季度报告

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4月21日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人会议的基金份额持有人对本基金所报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4月20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，保证复核后不存在虚假记载、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未来表现。投资者投资，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。

本报告期基金财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§2 基金产品概况

长盛动态精选混合型基金

基金简称:长盛动态精选混合

基金主代码:510081

交易代码:前端:510081 后端:511081

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2004年5月21日

报告期末基金份额总额:1,311,527,736.40份

本基金通过积极投资能够充分分享中国经济长期增长的各行业在行业中将要取得领先地位的50家上市公司股票，在把握风险的前提下，追求长期收益。

本基金的投资策略上偏重选股能力的发挥，时机的选择放在首位。

业绩比较基准:中证行业A股综合指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%

风险收益特征:本基金属于股票型基金中的适度风险品种，在承担适度风险的前提下，获取长期稳定的收益。

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1月1日—2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -49,857,247.91

2.本期利润 -23,728,505.71

3.加权平均基金份额本期利润 0.153,037,795.58

4.期末基金资产净值 1,153,037,795.58

5.期末基金份额净值 0.8792

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将低于所列数据。

2. 本期数据截止到2012年3月31日。

3. 本期利润反映报告期内基金利息收入、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, 本期利润即为本基金报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 净值增长率、净值增长率标准差及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率 (%) 标准差 (%) 业绩比较基准收益率 (%) 收益率标准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.03% 1.56% -4.35% -1.56% -6.38% -0.20%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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

基金业绩指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日—2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -49,857,247.91

2.本期利润 -23,728,505.71

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0180

4.期末基金资产净值 1,153,037,795.58

5.期末基金份额净值 0.8792

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将低于所列数据。

2. 本期数据截止到2012年3月31日。

3. 本期利润反映报告期内基金利息收入、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, 本期利润即为本基金报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.3 净值增长率、净值增长率标准差及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率 (%) 标准差 (%) 业绩比较基准收益率 (%) 收益率标准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.03% 1.56% -4.35% -1.56% -6.38% -0.20%

3.2.3 本基金合同生效以来基金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

基金业绩指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日—2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -49,857,247.91

2.本期利润 -23,728,505.71

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0180

4.期末基金资产净值 1,153,037,795.58

5.期末基金份额净值 0.8792

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将低于所列数据。

2. 本期数据截止到2012年3月31日。

3. 本期利润反映报告期内基金利息收入、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, 本期利润即为本基金报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.4 净值增长率、净值增长率标准差及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率 (%) 标准差 (%) 业绩比较基准收益率 (%) 收益率标准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.03% 1.56% -4.35% -1.56% -6.38% -0.20%

3.2.4 本基金合同生效以来基金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

基金业绩指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日—2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -49,857,247.91

2.本期利润 -23,728,505.71

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0180

4.期末基金资产净值 1,153,037,795.58

5.期末基金份额净值 0.8792

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将低于所列数据。

2. 本期数据截止到2012年3月31日。

3. 本期利润反映报告期内基金利息收入、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, 本期利润即为本基金报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.5 净值增长率、净值增长率标准差及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率 (%) 标准差 (%) 业绩比较基准收益率 (%) 收益率标准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.03% 1.56% -4.35% -1.56% -6.38% -0.20%

3.2.5 本基金合同生效以来基金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

基金业绩指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日—2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -49,857,247.91

2.本期利润 -23,728,505.71

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0180

4.期末基金资产净值 1,153,037,795.58

5.期末基金份额净值 0.8792

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将低于所列数据。

2. 本期数据截止到2012年3月31日。

3. 本期利润反映报告期内基金利息收入、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, 本期利润即为本基金报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.6 净值增长率、净值增长率标准差及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率 (%) 标准差 (%) 业绩比较基准收益率 (%) 收益率标准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.03% 1.56% -4.35% -1.56% -6.38% -0.20%

3.2.6 本基金合同生效以来基金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

基金业绩指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日—2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -49,857,247.91

2.本期利润 -23,728,505.71

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0180

4.期末基金资产净值 1,153,037,795.58

5.期末基金份额净值 0.8792

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将低于所列数据。

2. 本期数据截止到2012年3月31日。

3. 本期利润反映报告期内基金利息收入、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, 本期利润即为本基金报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.7 净值增长率、净值增长率标准差及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率 (%) 标准差 (%) 业绩比较基准收益率 (%) 收益率标准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.03% 1.56% -4.35% -1.56% -6.38% -0.20%

3.2.7 本基金合同生效以来基金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

基金业绩指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日—2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -49,857,247.91

2.本期利润 -23,728,505.71

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0180

4.期末基金资产净值 1,153,037,795.58

5.期末基金份额净值 0.8792

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将低于所列数据。

2. 本期数据截止到2012年3月31日。

3. 本期利润反映报告期内基金利息收入、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, 本期利润即为本基金报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.8 净值增长率、净值增长率标准差及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率 (%) 标准差 (%) 业绩比较基准收益率 (%) 收益率标准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.03% 1.56% -4.35% -1.56% -6.38% -0.20%

3.2.8 本基金合同生效以来基金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

基金业绩指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日—2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -49,857,247.91

2.本期利润 -23,728,505.71

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0180

4.期末基金资产净值 1,153,037,795.58

5.期末基金份额净值 0.8792

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将低于所列数据。

2. 本期数据截止到2012年3月31日。

3. 本期利润反映报告期内基金利息收入、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, 本期利润即为本基金报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.9 净值增长率、净值增长率标准差及其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率 (%) 标准差 (%) 业绩比较基准收益率 (%) 收益率标准差 (%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.03% 1.56% -4.35% -1.56% -6.38% -0.20%

3.2.9 本基金合同生效以来基金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

基金业绩指标 单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日—2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -49,857,247.91

2.本期利润 -23,728,505.71

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0180

4.期末基金资产净值 1,153,037,795.58

5.期末基金份额净值 0.8792

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将低于所列数据。

2. 本期数据截止到2012年3月31日。

3. 本期利润反映报告期内基金利息收入、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, 本期利润即为本基金报告期内实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2.10 净值增长率、净值增长率标准差及其同期业绩比较基准收益率的比较