长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

2012 年度报告摘要

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
送出日期:2013年3月26日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2013年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛创新先锋混合
基金主代码	080002
交易代码	080002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月4日
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
报告期末基金份额总额	186,707,578.58份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	选择具有创新能力和行业领先的上市公司,分享企业高速增长成果,在承担适度风险的基础上,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金为混合型证券投资基金,在资产配置上会考虑宏观经济因素、政策因素及市场估值水平。在个股选择上将根据不同行业景气度、“长盛创新选股体系”和“长盛优势选股体系”的股票筛选原则和方法优化个股投资比重。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金强调精选投资价值较大的创新领先企业,突出资产配置的灵活性和主动性,风险收益略低于股票型基金,高于债券型基金和平衡型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	唐州徽
	联系电话	010-82019988	010-66594855
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2012 年	2011 年	2010年
本期已实现收益	-14,009,105.45	-2,854,165.89	6,164,848.24
本期利润	5,736,018.97	-17,750,171.54	13,234,141.32
加权平均基金份额本期利润	0.0319	-0.1278	0.0869
本期基金份额净值增长率	3.03%	-11.62%	10.57%
3.1.2期末数据和指标	2012 年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0275	-0.0173	0.0675
期末基金资产净值	189,040,984.35	172,724,397.80	158,706,995.99
期末基金份额净值	1.0125	0.9827	1.1119

注:1、所述基金业绩指标不包括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、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、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日,即12月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	3.67%	0.95%	6.80%	0.83%	-3.13%	0.12%
过去六个月	0.89%	0.90%	2.38%	0.80%	-1.49%	0.10%
过去一年	3.03%	0.95%	6.54%	0.83%	-3.51%	0.12%
过去三年	0.68%	0.98%	-15.96%	0.90%	16.64%	0.08%
自基金合同生效起至今	39.14%	1.13%	-11.85%	1.20%	50.99%	-0.07%

注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

业绩比较基准=沪深300指数×65%+上证国债指数×35%

本基金为混合型基金,在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后,选定沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准;债券组合的业绩基准则采用上证国债指数。

沪深300指数是沪深证券交易所联合发布的反映A股市场整体走势的成份股指数,由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成,样本覆盖了沪深市场约六成的市值,具有良好的市场代表性。比较起来,该指数具有较好的权威性、市场代表性,用为衡量本基金业绩的基准,较为合适。

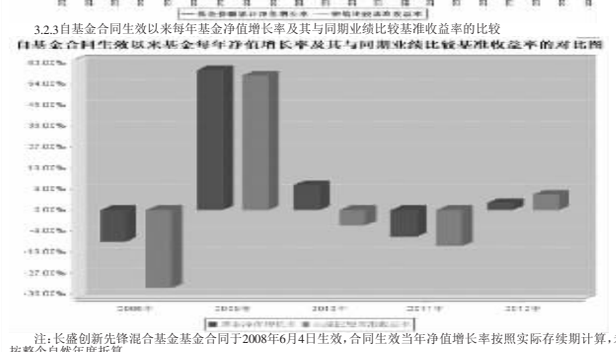
本基金的股票资产占基金资产的30%-80%。在正常的市场情况下,基金的平均股票仓位约为65%,所以,业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照65%、35%的比例采取再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

2008年6月4日至2012年12月31日)

3.2.3自基金合同生效以来每年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:长盛创新先锋混合基金基金合同于2008年6月4日生效,合同生效当年净值增长率按照实际存续期计算,未按整个自然年度折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	-	-	-	-	2012 年度未分配利润
2011年	-	-	-	-	2011 年度未分配利润
2010年	1.50	22,622,385.32	3,501,416.61	26,123,801.93	2010 年 12 月 22 日收益分配
合计	1.50	22,622,385.32	3,501,416.61	26,123,801.93	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基字〔1999〕6号文件批准,于1999年3月成立,注册资本为人民币15000万元。目前,本公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司(以下简称“国元证券”)占注册资本的41%;新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%;安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%;安徽省投资集团控股有限公司(原“安徽省投资集团有限责任公司”)占注册资本的13%。截止2012年12月31日,基金管理人共管理两支封闭式基金、二十三支开放式基金,并于2002年12月,首批取得了全国社保基金管理资格。基金管理人于2007年9月,取得合格境内机构投资者资格,并于2008年2月,取得从事特定客户资产管理业务资格。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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		
李庆林	本基金基金经理,长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理。	2010年3月3日	—	9年	男,1974年10月出生,中国国籍。中国人民大学硕士。曾先后在长城证券有限公司、国元证券有限公司和建信基金管理有限公司担任研究员等职务。2009年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究发展部副总监,现任长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理。

注:1、报经中国证券投资基金业协会同意,目前李庆林已不再担任长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理,该基金改由王克玉同志负责管理。该事项公司已于2013年1月8日进行公告。

2、上表基金经理及基金经理助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;

3、“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》及其各项实施细则、《长盛创新先锋灵活配置混合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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,为保证公司管理的所有投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,公司重新修订了《公司公平交易细则》。报告期内,公司根据该细则实际执行情况,对其进行了完善。该细则从研究、投资授权、投资决策、交易执行、投资组合信息隔离、行为监控评估与分析、报告与信息披露等环节对公平交易的管理提出明确要求。

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。投资组合经理在投资决策委员会授权范围内自主进行投资决策,超越授权范围的投资行为,需依照公司相关制度规定履行审批程序。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,对交易所公开竞价交易,公司开启恒生交易系统中的公平交易程序,对符合公平交易条件的投资指令强制执行公平交易,具体如下:

一、限价指令的执行原则:对于不同限价的同向指令,按照“价格优先、时间优先、同时均分”的原则执行;对于相同限价的同向交易指令,强制执行恒生交易系统中的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托比例,按比例具体执行。

二、市价指令的执行原则:对于市价同向交易指令,按照“时间优先”的原则执行交易指令,后到达指令后按照先到指令剩余数量和新到指令数量采用公平委托系统执行;对于同时同向交易指令,强制执行恒生交易系统中的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托比例,按比例具体执行。

三、部分限价指令与部分市价指令的执行原则:对于不同投资经理下达的不同类型的同向交易指令,按照“价格优先”的原则执行交易指令,在未满足限价执行条件时,先执行市价指令,后执行限价指令。

对债券一级市场申购、非公开发行股票等以公司名义进行的交易,公司依照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

对于银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价的交易,则按照“时间优先、价格优先、同时申报时要求价格差异趋于零且申购量等比分配”的原则进行。

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。风险管理部每日通过系统监控不同组合的反向交易等,监控分析发现异常情况时,要求相关人员作出合理性解释备查,每月度出具上月度公平交易监控分析报告,每季度和每年度分别出具公平交易专项分析报告;公司通过系统记录场内异常交易情况,监察稽核部定期对其进行分析评估,每月度出具异常交易总结报告;针对场外交易,监察稽核部每月度对公司旗下所有投资组合场外交易进行专项检查,检查范围包括但不限于:银行间市场、交易所大宗交易等,每月度出具检查报告;监察稽核部对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案、分配过程进行监督,确保分配结果符合公平交易原则。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》各项规定,保证公平对待旗下的每一个投资组合。各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;交易环节中,严格执行集中交易制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;事后监控分析环节中,公司定期对投资组合公平交易情况和异常交易情况进行分析,并出具公平交易执行情况分析报告;同时,公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查,并对发现的问题进行及时报告。

报告期内,公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》中的规定对公司所有投资组合同向交易价差进行分析,取最近4个季度交易记录,分别以1、3、5日为时间片段分析不同基金间以及公募基金、社保组合、专户组合等大类资产间的同向交易情况。对于同向交易次数足够进行T检验的情况,以95%置信水平对其进行假设检验排查;对于同向交易次数较少的情况考察交易价差对基金净值带来的累计贡献。分析结果显示本投资组合与公司其它组合间同向交易价差未见异常。

本报告期内,公司严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.3 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37次,其中24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;13次为长盛同庆封闭式基金转型为指数型基金前的反向交易。

本报告期一季度内,长盛同庆报经公司投资决策委员会批准,打开交易所公开竞价同日反向交易控制,因此而产生13笔交易所公开竞价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5%的交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称“开放式基金”)。为确保转型后的开放式基金保持充裕流动性,以保障基金份额持有人利益,该基金一季度制定了数量化组合投资交易策略,并申请打开与公司旗下其他投资组合交易所市场的反向交易控制。上述申请已报经公司投资决策委员会批准。打开反向交易控制期间,长盛同庆严格执行既定数量化组合投资交易策略,批量下达投资指令。公司交易部对上述指令进行严格审核,在指令分发后,通过恒生交易系统自动委托交易程序执行指令,以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平,杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

本报告期内,未发现本组合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报告期内基金投资策略和运作分析

2012年的A股市场投资是“低市盈率+盈利超预期增长”取胜的一年。全年看HS300指数和上证50指数上涨幅度分别达到10%和14.8%,而中小板指数出现小幅的下跌,创业板指数的涨幅也只有3.5%。

除了在一季度出现比较全面的上涨行情外,从二季度开始企业盈利增速对股价的影响逐渐增强,市场关注的重点越来越集中到盈利超预期增长的主流行业中的少数公司,食品饮料中的中高端白酒、家电、医药、乘用车、电子、品牌营销等子行业中的公司给投资者留下深刻的印象。四季度开始房地产行业强劲的基本面和不断超出预期的销售传递到A股市场,房地产行业指数在四季度达到了22%;而年末的银行股的上涨也给耐心坚守的价值投资者提供丰厚的回报。

2012年基金的投资过程中配置的重点是医药和食品饮料,其中医药公司的配置对公司贡献较大,而重仓的普通消费品公司在年内表现一般,影响了组合的业绩。

4.4.2 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1.0125元,本报告期份额净值增长率为3.03%,同期业绩比较基准增长率为6.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.5.1对宏观经济和证券市场展望

宏观经济在2013年上半年将会延续目前的回升的态势。实体经济从2012年10月份开始已经开始低位企稳,PMI数据重新回到50以上,月度发电量数据的同比增幅恢复到5%以上。经济增速的恢复一方面是受到重大投资项目在经过一年多的整顿之后的恢复,另外中上游的众多行业已经经过了接近两年的库存调整,社会库存相对健康,产业链中一个环节的价格上涨可以有效的拉动需求。

从海外的状况看,2007年之后拖累美国经济的房地产市场已经出现非常明显的恢复,同时继续加强了其在科技等优势领域的领先地位。外部环境的变数来自于日本在金融系统的调整是否能够顺利进行。

4.5.2 本基金下阶段投资策略

目前投资者已经接受GDP增速从8%以上的平台向下调整到7%左右的增速,短期内宏观经济的企稳回升和资金价格的回落将有利于权益市场的表现。前期低市盈率的大盘蓝筹股的上涨为股市带来赚钱效应,对改善股市资金的供给有很大的正面影响。当然目前的市场结构跟过去也发生了很大的差异,投资者更加多元化,这导致在经济转型期间企业盈利没有持续性高速增长的情况下,股票市场指数也不会形成趋势性的上涨。

在今后的投资过程中会保持组合目前在医药、食品饮料行业的基本配置,这些公司相对稳定的业绩增长和合理的估值使得其仍然具有较强的吸引力。同时会寻找时机增加对中游制造业中有创新能力和突出竞争优势的公司的投资,中国制造业快速发展的过程中,这些行业的盈利和市值规模都经历了快速扩张的阶段,但是在过去两年中受到市场需求和成本两方面的挤压,企业的市值在盈利和估值水平双杀下已经大幅萎缩,作为中国仍然具有比较优势的行业蕴含着比较明显的投资机会。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定,本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值小组,参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据,确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理(担任估值小组组长)、公司副总经理和督察长(担任估值小组副组长)、权益投资部、金融工程与量化投资部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组,负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验,具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金未签约与任何估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十九条中对基金利润分配原则的约定,2012年度未实施利润分配。

本基金截至2012年12月31日期末可供分配收益为-5,127,791.11元,未分配收益已实现部分为-5,127,791.11元,未分配收益未实现部分为7,461,196.88元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对长盛创新先锋混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况,财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司注册会计师汪棣、张晓艺2013年3月20日对本基金2012年12月31日的资产负债表、2012年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注出具了普华永道中天审字(2013)第21295号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	9,976,242.53	17,174,716.49
结算备付金		267,476.04	236,007.59
存出保证金		1,000,000.00	1,000,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	179,522,658.44	156,041,246.96
其中:股票投资		147,490,658.44	124,987,546.96
基金投资		-	-
债券投资		32,032,000.00	31,053,700.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	483,507.76	451,531.75
应收股利		-	-
应收申购款		46,854.86	5,140.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		191,296,739.63	174,908,643.16
负债和所有者权益		本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	586,595.73
应付赎回款		668,264.98	35,961.35
应付管理人报酬		225,542.49	191,793.06
应付托管费		37,590.42	31,965.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	251,880.37	267,794.85
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,072,477.02	1,070,134.88
负债合计		2,255,755.28	2,184,245.36
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	186,707,578.58	175,764,487.46
未分配利润	7.4.7.10	2,333,405.77	-3,040,089.66
所有者权益合计		189,040,984.35	172,724,397.80
负债和所有者权益总计		191,296,739.63	174,908,643.16

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.0125元,基金份额总额186,707,578.58份。

7.2 利润表

会计主体:长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入		10,300,550.54	-14,151,825.34
1.利息收入		1,107,302.95	913,134.34
其中:存款利息收入	7.4.7.11	146,189.54	102,715.69
债券利息收入		961,113.41	810,418.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-10,587,091.79	-226,114.79
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-11,800,322.19	-575,338.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,220.00	-533,744.80
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,214,450.40	882,968.06
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	7.4.7.16	19,745,124.42	-14,896,005.65
4.汇兑收益(损失以“-”填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	7.4.7.17	35,214.96	57,160.76
减:二、费用		4,564,531.57	3,598,346.20
1.管理人报酬		2,663,233.74	2,212,632.88
2.托管费		443,872.32	368,772.13
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	1,114,748.40	675,551.39
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	342,677.11	341,389.80
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		5,736,018.97	-17,750,171.54
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		5,736,018.97	-17,750,171.54

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	175,764,487.46	-3,040,089.66	172,724,397.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,736,018.97	5,736,018.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	10,943,091.12	-362,523.54	10,580,567.58
其中:1.基金申购款	47,555,402.88	-503,632.18	47,051,770.70
2.基金赎回款	-36,612,311.76	141,108.64	-36,471,203.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	186,707,578.58	2,333,405.77	189,040,984.35
项 目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	142,732,713.73	15,974,282.26	158,706,995.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,750,171.54	-17,750,171.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	33,031,773.73	-1,264,200.38	31,767,573.35
其中:1.基金申购款	84,950,767.90	3,619,129.78	88,569,897.68
2.基金赎回款	-51,918,994.17	-4,883,330.16	-56,802,324.33
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	175,764,487.46	-3,040,089.66	172,724,397.80

注:报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

周兵 杨思乐 戴君棉

基金管理公司负责人: 主管会计工作负责人: 会计机构负责人:

7.4报表附注

7.4.1基金基本情况

长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2008〕378号《关于核准长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集848,057,772.27元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第077号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2008年6月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为848,262,882.92份基金份额,其中认购资金利息折合205,110.65份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金类别资产配置比例为:股票投资占基金资产的30%-80%,债券投资占基金资产的15%-65%,现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不少于5%。其中,权证投资占基金资产净值的0%-3%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×65%+上证国债指数×35%。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于2013年3月20日批准报出。

7.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本期及上年度可比期间未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本期及上年度可比期间未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期及上年度可比期间无会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2005〕102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税〔2005〕107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

2、对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税。

4、基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金公司”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司(原“安徽省投资集团有限责任公司”)	基金管理人的股东

注:1、根据长盛基金公司2012年8月29日《关于公司股东名称变更及公司章程修改的公告》,长盛基金公司的股东安徽省投资集团有限责任公司更名为安徽省投资集团控股有限公司,相关工商变更登记手续已办理完毕。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本开立关联方交易单元。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,663,233.74	2,212,632.88
其中:支付销售机构的客户维护费	299,990.87	269,840.34

注:支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	443,872.32	368,772.13

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
期初持有的基金份额	45,021,400.00	45,021,400.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	45,021,400.00	45,021,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.11%	25.61%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其