

长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

2008 年年度报告

二 八年十二月三十一日

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

送出日期：二 九年三月三十日

## 重要提示及目录

### 一、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 2009 年 3 月 27 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 2008 年 6 月 4 日起至 12 月 31 日止。

## 二、目录

第一章 基金简介 .....	1
第二章 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	3
第三章 管理人报告 .....	6
第四章 托管人报告 .....	13
第五章 审计报告 .....	14
第六章 年度财务报表 .....	16
第七章 投资组合报告 .....	36
第八章 基金份额持有人信息 .....	42
第九章 开放式基金份额变动 .....	42
第十章 重大事件揭示 .....	43
第十一章 备查文件目录 .....	48

## 第一章 基金简介

### 一、基金基本情况

基金名称	长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长盛创新先锋混合基金
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
报告期末基金份额总额	440,690,225.95份

### 二、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。

### 三、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	宁敏
	联系电话	010-82255818	010-66594977
	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
注册地址		深圳市福田区福中三路 1006	北京市西城区复兴门内大街 1

	号诺德中心八楼 GH 单元	号
办公地址	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100088	100818
法定代表人	陈平	肖钢

#### 四、信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址和基金托管人的住所

#### 五、其他相关资料

项目	会计师事务所	注册登记机构
名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	长盛基金管理有限公司
办公地址	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层

## 第二章 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 一、主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

期间数据和指标	2008年6月4日-2008年12月31日
本期已实现收益	-52,278,200.38
本期利润	-67,611,630.56
加权平均基金份额本期利润	-0.1268
本期加权平均净值利润率	-13.42%
本期基金份额净值增长率	-13.56%
期末数据和指标	2008年
期末可供分配利润	-59,757,992.53
期末可供分配基金份额利润	-0.1356
期末基金资产净值	380,932,233.42
期末基金份额净值	0.8644
累计期末指标	2008年
基金份额累计净值增长率	-13.56%

注：1、长盛创新先锋混合基金基金合同于2008年6月4日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、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。

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、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。

### 二、基金净值表现

#### （一）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	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	-9.20%	1.25%	-10.90%	1.97%	1.70%	-0.72%
过去六个月	-13.59%	1.00%	-21.51%	1.95%	7.92%	-0.95%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-

自基金合同生效起至今	-13.56%	0.98%	-33.46%	2.10%	19.90%	-1.12%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

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。

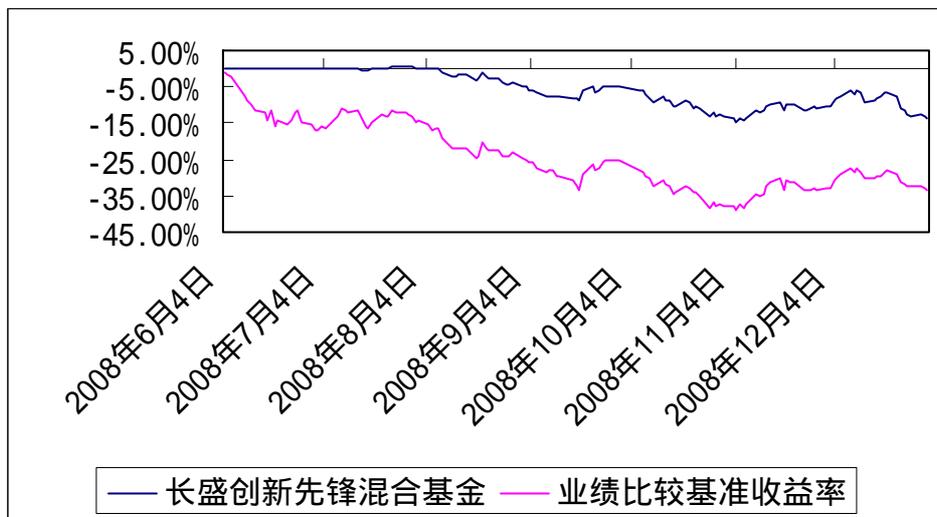
沪深 300 指数是沪深证券交易所联合发布的反映 A 股市场整体走势的成份股指数，由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成，样本覆盖了沪深市场约六成的市值，具有良好的市场代表性。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准，较为合适。

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。

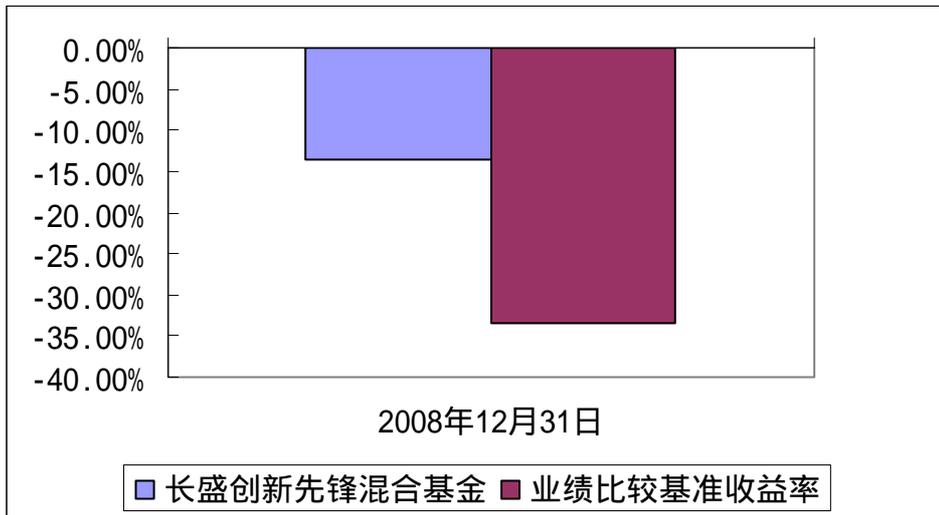
(二) 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(2008 年 6 月 4 日至 2008 年 12 月 31 日)



注：1、长盛创新先锋混合基金基金合同于 2008 年 6 月 4 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、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，长盛创新先锋混合基金的各项投资比例已达到本基金基金合同第十四条（二）投资范围、（七）投资禁止行为与限制的有关约定。（三）自基金合同生效以来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。

### 三、自基金合同生效以来利润分配情况

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
2008年	-	-	-	-	2008年度未分配收益
合计	-	-	-	-	

注：长盛创新先锋混合基金基金合同于2008年6月4日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。自基金合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

## 第三章 管理人报告

### 第一节 基金管理人及基金经理情况

#### 一、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%；新加坡星展资产管理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%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截止2008年12月31日，基金管理人共管理两支封闭式基金、九支开放式基金，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。

#### 二、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		
肖强	本基金基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理，投资管理部副总监。	2008年6月4日	—	15年	男，1967年12月出生，中国国籍。毕业于中国人民公安大学，获学士学位。历任中信证券股份有限公司北太平庄营业部总经理助理；中信证券股份有限公司研究咨询部副总经理、高级分析师；中信证券股份有限公司交易部高级交易员。2002年6月加入长盛基金管理有限公司，历任基金同盛基金经理助理、基金同益基金经理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、基金同智基金经理，现任长盛基金管理有限公司投资管理部副总监，长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理，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。
邓永明	本基金基金经理，长盛动态精选证券投资	2008年6月4日	—	9年	男，1971年7月出生，中国国籍。毕业于山西农业大学，获学士学位。1999年4月到2005年7月就职于大成基金

	资基金基 金经理。			管理有限公司，曾任职研究员、交易员和基金经理助理。2005年7月底加入长盛基金管理有限公司投资管理部，曾任基金同益基金经理助理，同德证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。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，长盛动态精选证券投资基金基金经理。
--	--------------	--	--	---

注：1、任职日期、离任日期均指公司作出决定之日。

2、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。

## 第二节 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《基金法》及其各项实施准则、《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。

## 第三节 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 一、公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

### 二、本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

### 三、异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生异常交易情况。

## 第四节 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 一、报告期内行情回顾和本基金投资策略分析

本基金于2008年6月4日正式成立并开始运作，在4季度，基金继续稳步建仓，我们坚持结构重于仓位的思路，依据本基金合同，注重目标公司的创新度、领先度、

绝对价值和相对价值的挖掘。主要重仓股的持仓比较稳定。

## 二、本基金业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8644 元，本报告期份额净值增长率为 -13.56%，同期业绩比较基准增长率为-33.46%。

### 第五节 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

2009 年 A 股市场是一个充满矛盾的市场。在糟糕的基本面和充裕的资金面交叉作用下，市场将一改 2008 年的单边走势，不断演绎跌宕起伏的轮回。机会与陷阱相伴；光明与黑暗同行；希望和失望交错。你是信仰，还是怀疑？你是参与，还是远离？你是把握，还是放弃？作为职业投资者——基金经理注定只能在爱与痛的边缘游走。

可以肯定，世界经济仍将在危机中继续调整，在全球经济一体化的今天，中国也无法置身事外。因此，总体判断：在乐观预期下，中国经济在 2009 年见底结束调整；在悲观预期下，中国经济在 2010 年才能结束调整。

令人欣慰的是，根据国家统计局最新公布的 2008 年 4 季度经济数据看，宏观经济有初步起稳迹象。如 12 月份的工业增加值扭转了下降趋势，比 11 月份加快了 0.3 个百分点，而其中 39 个大行业中有 16 个行业的增加值增速比 11 月份有所加快；当月工业产销率 98.7%，比 11 月份产销率提高了 1.7 个百分点。这背后积极的变化正表明前期企业正在痛苦经历的去存货化过程已接近尾声，企业生产将逐渐恢复。在物价方面，虽然通缩阴影还在，但极具破坏力的恶性通缩循环已被初步止住，如钢材、煤炭、有色金属和化工类产品价格不仅开始稳住，而且开始有些回升。2009 年 1 月上旬和 2008 年 12 月份中旬相比，普通大型钢材价格上涨 2.8%、普通中型钢材价格上涨 5.1%、普通小型钢材价格上涨 3%。在价格启稳预期下，部分商品销售有所回升，包括汽车、服装、化妆品等。

可以预见，随着 09 年 1 季度经济刺激计划的加速实施，如政府要求绝大部分的投资必须于 2009 年春季全国两会举行之前投入到项目建设中，由此有望带动近万亿投资，这将进一步帮助企业消化库存，恢复正常生产。与经济刺激进程同步地是大规模的信贷扩张，可以预计 09 年 1 季度信贷增加将迎来历史性的高峰，资金面的宽松加上政府表态还将在今年两会前出台一系列经济刺激措施，今年 1 季度经济增长扭转下降趋势，出现开门红的概率极大。

A 股市场的预期正在改变。

回顾造成 2008 年 A 股市场持续一年下跌的原因，主要是宏观微观经济的阶段性见顶回落，美国次级债发酵引发全球的金融危机和经济危机，大小非减持等。这些因素真正发生是在 2008 年。但上证指数则是在 2007 年 10 月即见顶 6124 点后开始回落的，而当时的经济基本面非常好。为什么会这样？就是预期，资本市场会超前于实体经济反应。A 股历史上 96-97 年牛市，我国 GDP 增长其实是同比下滑的，直至亚洲金融风暴爆发，牛市走完，而同样在 GDP 高速增长的 03-05 年，A 股却经历了上次熊市期间最大的跌幅阶段，直到沪指出现“998”低点。因此，影响左右市场发展趋势的不是已经发生的事情，而是即将发生的事情。从国外成熟市场的经验看，资本市场也是一般领先宏观经济 3 - 6 个月。

A 股市场从 6124 点一路跌了一年到 1664 点，下跌幅度达 72.83%，基本面的因素也在悄然变化。比如：6000 点的时候，整个市场的流通市值是 9 万亿，而现在不到 5 万亿；6000 点的时候央行在升息，M1 已经见顶回落，而现在在央行持续降息，M1 见底拐点已现；还有 6000 点的时候居民存款是 17 万亿，而现在是接近 20 万亿。个人认为，至少在可预见的 2009 年 1 季度，强力的货币政策加财政政策不可能不对经济和流动性产生强烈影响，节后有关数据的反弹，将逐步校正市场一直看空的预期。

当然，2009 年经济依然处于大的周期调整中，在各项经济数据可能呈现季度性波动，且喜忧参半的状态下，市场的系统性行情很难出现，机会依然是围绕预期展开的主题性科目。

#### 第六节 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作，保障基金持有人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

##### 一、进一步完善了公司内部控制制度

完善、适用、适时的内部控制制度，是公司各项业务规范、有序运转的基本前提。报告期内，根据法律法规的新要求及业务发展的需要，公司对内部控制制度进行了完善与更新。

##### 二、跟踪与投资运作有关的法律、法规及公司规定的变化，及时、全面掌控基金运作风险点

全面、清晰掌控公司及基金投资运作的风险点,是保证基金规范运作的基本前提。为此,公司监察稽核部全面梳理与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司规定,分别从法规限制、合同限制、公司制度限制三个层面整理、归纳出各基金的风险点,通过明确风险点并标识各风险点所采用的控制工具与控制方法,使得对各风险点的监控真正落到实处。

报告期内,公司监察稽核部紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规及公司规定的变化,对基金风险点进行了及时更新。

### 三、强化系统风险监控功能,提升风险监控的准确性及效率

公司监察稽核部通过系统,实现对各基金投资运作合法合规的及时监控。通过定期、不定期检查各基金风险点在系统中设置的正确性与及时性,提升风险监控的准确性及效率。

四、采用定期与不定期相结合的专项稽核方式,检查制度执行情况,规范业务运转工作流程

公司内部控制制度的切实执行,是公司各项业务规范、有序运转的重要保证。

报告期内,公司监察稽核部采用定期与不定期相结合的专项稽核方式,对公司内控制度执行情况进行了检查,范围涵盖投资研究交易、后台运营、基金销售与宣传等业务内容与业务环节。

五、制定《年度合规培训计划》,对公司员工有针对性、有步骤地进行法律法规培训,增强员工合规意识。

通过以上工作的展开,在本报告期内,本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规,保障了基金份额持有人的利益。在今后的工作中,我们将继续以保障基金份额持有人的利益为宗旨、以风险控制为中心、以防范不当利益输送为目标,不断提高内部监察工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,保障基金合规运作。

### 第七节 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行企业会计准则有关衔接事宜的通知》(证监会计字[2007]15号)、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(证监会计字[2007]21号)与《关于进一步规范证券投资基金估值业务

的指导意见》(证监会公告[2008]38号)等文件,本公司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、参考独立第三方机构估值数据等多种方式的有效结合,减少或避免估值偏差的发生。

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。

基金管理人设立基金估值小组时充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性,人员构成如下:

人员	职务	职责
杨思乐	长盛基金管理有限公司副总经理	长盛基金估值小组组长;领导、统筹估值小组工作,完成基金资产估值。
叶金松	长盛基金管理有限公司督察长	长盛基金估值小组组长;领导、统筹估值小组工作,完成基金资产估值。
白仲光	金融工程部总监	出具估值时所采用的估值模型、假设、参数。
侯继雄	研究发展部副总监,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理,基金同盛证券投资基金基金经理	出具估值时所采用的假设、判定依据。
詹凌蔚	总经理助理和投资管理部总监,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理	判定估值价格合理性。
郝善勇	信息技术部总监	建立辅助估值系统,提供估值价格。
张利宁	监察稽核部总监	审查监督估值制度、程序执行过程的合规性。
戴君棉	业务运营部副总监	采用调整后价格进行基金资产估值。
龚珉	业务运营部副总监	采用调整后价格进行基金资产估值。

参与估值流程各方之间均为基金管理人各部门人员,均具有基金执业证书,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。

#### 第八节 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据中国证监会基金部通知[2008]12号《关于2007年证券投资基金年度报告编制及披露相关问题的通知》、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《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(试行)》等问题的通知中对基金期末可分配利润计算方法的规定,以及《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》第十九条中对基金利润分配原则的约定,本基金截至2008年12月31日期末可供分配利润为-59,757,992.53元,其中:未分配利润已实现部分为-46,574,400.47元,未分配利润未实现部分为-13,183,592.06元。按照上述通知及

基金合同的规定，2008 年度不进行分配（详见第二章表三和第六章第二节附注七（十））。

## 第四章 托管人报告

### 一、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”）在长盛创新先锋灵活配置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。

### 二、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。

### 三、托管人对本年度报告/半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。

## 第五章 审计报告

普华永道中天审字(2009)第 20168 号

长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“长盛创新先锋混合基金”)的财务报表,包括 2008 年 12 月 31 日的资产负债表、2008 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2008 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

### 一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是长盛创新先锋混合基金的基金管理人长盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(一)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(二)选择和运用恰当的会计政策；

(三)作出合理的会计估计。

### 二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

### 三、审计意见

我们认为,上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许

的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制,在所有重大方面公允反映了长盛创新先锋混合基金 2008 年 12 月 31 日的财务状况以及 2008 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2008 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
会计师事务所有限公司  
中国·上海市

注册会计师：薛 竞

注册会计师：陈 宇

2009 年 3 月 25 日

## 第六章 年度财务报表

### 第一节 基金财务报表（经审计）

#### 一、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：2008年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2008年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	七（一）	59,439,200.00
结算备付金		863,506.03
存出保证金		750,000.00
交易性金融资产	七（二）	320,432,148.77
其中：股票投资		232,068,148.77
基金投资		-
债券投资		88,364,000.00
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	七（三）	-
买入返售金融资产	七（四）	-
应收证券清算款		551,380.87
应收利息	七（五）	2,070,178.76
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	七（六）	-
<b>资产总计</b>	<b>附注号</b>	<b>384,106,414.43</b>
<b>负债和所有者权益</b>		
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	七（三）	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		1,656,602.47
应付赎回款		9,483.09
应付管理人报酬		526,970.07
应付托管费		87,828.36
应付销售服务费		-

应付交易费用	七(七)	393,261.29
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	七(八)	500,035.73
<b>负债合计</b>		<b>3,174,181.01</b>
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	七(九)	440,690,225.95
未分配利润	七(十)	-59,757,992.53
<b>所有者权益合计</b>		<b>380,932,233.42</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>384,106,414.43</b>

注:1、报告截止日2008年12月31日,基金份额净值:0.8644元,基金份额总额440,690,225.95份。后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

2、本基金基金合同于2008年6月4日生效,截至本期末本基金合同生效未满一年,故无上年度比较数据。

## 二、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:2008年6月4日(基金合同生效日)至2008年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期
		2008年6月4日(基金合同生效日) 至2008年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>-60,496,472.54</b>
1. 利息收入		4,438,058.78
其中:存款利息收入	七(十一)	1,228,314.30
债券利息收入		3,037,744.57
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		171,999.91
其他利息收入		-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-50,105,066.89
其中:股票投资收益	七(十二)	-51,541,739.30
基金投资收益		-
债券投资收益	七(十三)	759,046.73
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	七(十四)	493,800.13
股利收益	七(十五)	183,825.55
3. 公允价值变动收益(损失以“-”填列)	七(十六)	-15,333,430.18

4. 汇兑收益 (损失以“-”填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”填列)	七(十七)	503,965.75
<b>二、费用 (以“-”号填列)</b>		<b>-7,115,158.02</b>
1. 管理人报酬		-4,628,598.87
2. 托管费		-771,433.20
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	七(十八)	-1,445,672.81
5. 利息支出		-61,249.97
其中：卖出回购金融资产支出		-61,249.97
6. 其他费用	七(十九)	-208,203.17
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-67,611,630.56</b>
所得税费用 (以“-”号填列)		-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-67,611,630.56</b>

注：后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

### 三、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：2008年6月4日（基金合同生效日）至2008年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2008年6月4日(基金合同生效日)至2008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)	848,262,882.92	-	848,262,882.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-67,611,630.56	-67,611,630.56
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)	-407,572,656.97	7,853,638.03	-399,719,018.94
其中：1. 基金申购款	3,591,304.37	-137,756.46	3,453,547.91
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-411,163,961.34	7,991,394.49	-403,172,566.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
<b>五、期末所有者权益(基金净值)</b>	<b>440,690,225.95</b>	<b>-59,757,992.53</b>	<b>380,932,233.42</b>

注：后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

## 第二节 报表附注(经审计)

### 一、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]第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(以下简称“中国银行”)。

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2009年3月25日批准报出。

## 二、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”)、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《证券投资基金信息披露XBRL模版第3号<年度报告和半年度报告>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《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》和中国证监会允许的如报表附注四所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

## 三、遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2008年6月4日(基金合同生效日)至2008年12月31日止期间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2008年12月31日的财务状况以及2008年6月4日(基金合同生效日)至2008年12月31日止期间的经营成果和

基金净值变动情况等有关信息。

#### 四、重要会计政策和会计估计

(一) 会计年度：本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2008年6月4日(基金合同生效日)至2008年12月31日。

(二) 记账本位币：本基金的记账本位币为人民币。

#### (三) 金融资产和金融负债的分类

##### 1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债主要为各类应付款项等。

#### (四) 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### （五）金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### （六）金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### （七）实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### （八）损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累

未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### (九) 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### (十) 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### (十一) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### (十二) 其他重要的会计政策和会计估计

##### 1、 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

##### 2、 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，2008年9月16日之前按停牌前最后交易日的收盘价估值；根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金自2008年9月16日起采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

#### 五、会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

（一）会计政策变更的说明：无。

（二）会计估计变更的说明：无。

（三）差错更正的说明：无。

#### 六、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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（一）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。

（二）基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

（三）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派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。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，暂不征收企业所得税。

（四）基金买卖股票于2008年9月18日之前按0.1%的税率缴纳。自2008年9月19日起基金卖出股票按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。

#### 七、重要财务报表项目的说明

(一) 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2008年12月31日
活期存款	59,439,200.00
定期存款	-
其他存款	-
合计	59,439,200.00

(二) 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2008年12月31日			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	248,505,098.95	232,068,148.77	-16,436,950.18	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	87,260,480.00	88,364,000.00	1,103,520.00
	合计	87,260,480.00	88,364,000.00	1,103,520.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	335,765,578.95	320,432,148.77	-15,333,430.18	

于2008年12月31日，股票投资余额中包括按照指数收益法估值的特殊事项停牌股票11,501,938.80元；采用该估值技术的股票投资于本会计期间利润表中确认的公允价值变动损失为901,404.25元。

债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本会计期间利润表中确认的公允价值变动收益为1,103,520.00元。

(三) 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末（2008年12月31日）未持有衍生金融资产/负债。

(四) 买入返售金融资产

本基金本报告期末（2008年12月31日）买入返售金融资产项目余额为零。

(五) 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
	2008年12月31日
应收活期存款利息	12,535.35

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	388.60
应收债券利息	2,057,254.79
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.02
其他	-
<b>合计</b>	<b>2,070,178.76</b>

(六) 其他资产

本基金本报告期末(2008年12月31日)其他资产项目余额为零。

(七) 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2008年12月31日
应付交易所市场交易费用	392,461.29
应付银行间同业市场市场交易费用	800.00
<b>合计</b>	<b>393,261.29</b>

(八) 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2008年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	35.73
<b>合计</b>	<b>500,035.73</b>

(九) 实收基金

金额单位：人民币元

项目	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间	
	基金份额(份)	账面金额
2008年6月4日(基金合同生效日)	848,262,882.92	848,262,882.92
本期申购	3,591,304.37	3,591,304.37
本期赎回	-411,163,961.34	-411,163,961.34
<b>本期末</b>	<b>440,690,225.95</b>	<b>440,690,225.95</b>

1、本基金自2008年4月16日至2008年5月30日止期间公开发售，共募集有效净认购资金848,057,772.27元。根据《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入205,110.65元在本基金成立后，折算为205,110.65份基金份额，划入基金份额持有者账户。

2、根据《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2008年6月4日(基金合同生效日)至2008年7月6日止期间暂不向投资人开放基金交易。日常申购及赎回业务自2008年7月7日起办理。

(十) 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-52,278,200.38	-15,333,430.18	-67,611,630.56
本期基金份额交易产生的变动数	5,703,799.91	2,149,838.12	7,853,638.03
- 本期申购	-98,027.90	-39,728.56	-137,756.46
- 本期赎回	5,801,827.81	2,189,566.68	7,991,394.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-46,574,400.47	-13,183,592.06	-59,757,992.53

(十一) 存款利息收入

单位：人民币元

项目	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间
活期存款利息收入	1,219,716.72
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,593.83
存出保证金利息收入	-
其他	3.75
合计	1,228,314.30

(十二) 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间
卖出股票成交总额	298,055,770.95
减：卖出股票成本总额	-349,597,510.25
买卖股票差价收入	-51,541,739.30

(十三) 债券投资收益

单位：人民币元

项目	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间
卖出债券、债券到期兑付成交金额	91,535,373.81
卖出债券、债券到期兑付成本总额	-88,824,512.90
应收利息总额	-1,951,814.18

债券投资收益	759,046.73
--------	------------

(十四) 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间
卖出权证成交金额	990,874.24
卖出权证成本总额	-497,074.11
买卖权证差价收入	493,800.13

(十五) 股利收益

单位：人民币元

项目	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间
股票投资产生的股利收益	183,825.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	183,825.55

(十六) 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间
1. 交易性金融资产	-15,333,430.18
——股票投资	-16,436,950.18
——债券投资	1,103,520.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-15,333,430.18

(十七) 其他收入

单位：人民币元

项目	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间
基金赎回费收入	503,965.75
合计	503,965.75

注 2008 会计期间本基金的其他收入均为赎回费收入。赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

(十八) 交易费用

单位：人民币元

项目	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间
交易所市场交易费用	1,444,347.81
银行间市场交易费用	1,325.00
<b>合计</b>	<b>1,445,672.81</b>

(十九) 其他费用

单位：人民币元

项目	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间
信息披露费	135,000.00
审计费用	65,000.00
债券托管账户维护费	4,500.00
银行手续费	2,803.17
开户费	900.00
<b>合计</b>	<b>208,203.17</b>

八、或有事项、资产负债表日后事项的说明

(一) 或有事项：无。

(二) 资产负债表日后事项：无。

九、关联方关系

(一) 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

截至资产负债表日，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

(二) 本报告期本基金的各项关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展资产管理有限公司	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
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人的股东

根据长盛基金管理有限公司于2008年11月5日发布的公告，公司股东国元证券有限责任公司更名为国元证券股份有限公司、安徽省创新投资有限公司更名为安徽省信用担保集团有限公司。

十、关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(一) 通过关联方交易单元进行的交易

本基金未开立关联方交易单元。

(二) 关联方报酬

1、基金管理费

单位：人民币元

项目	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间
当期应支付的管理费	4,628,598.87
其中：当期已支付	4,101,628.80
期末未支付	526,970.07

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

2、基金托管费

单位：人民币元

项目	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间
当期应支付的托管费	771,433.20
其中：当期已支付	683,604.84
期末未支付	87,828.36

注：支付基金托管人中国银行的基金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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

(三) 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易：

本基金在本报告期内与基金托管人中国银行通过银行间同业市场进行的债券(含回购)交易如下：

单位：人民币元

2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	29,791,232.88	-	-	-	-

(四) 各关联方投资本基金的情况

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	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间
期初持有的基金份额	-
期间认购总份额	45,021,400.00
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分增加的份额	-
期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	45,021,400.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例(%)	10.22

注：基金管理人长盛基金管理有限公司在本报告期内认购本基金的交易委托国元证券办理，认购费为2,000.00元，适用单笔交易手续费1,000.00元。

2、报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2008年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份 额的比例(%)
安徽省投资集团有限责任公司	28,001,520.00	6.35

注：安徽省投资集团有限责任公司在本会计期间认购本基金的交易委托国元证券办理，认购费为1,000.00元，适用单笔交易手续费1,000.00元。

(五) 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	2008年6月4日(基金合同生效日)至 2008年12月31日止期间	
	期末金额	当期利息收入
中国银行	59,439,200.00	1,219,716.72

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

(六) 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间及比较期间内未参与关联方承销证券交易。

十一、利润分配情况

本基金本会计期内未进行利润分配。

十二、期末(2008年12月31日)本基金持有的流通受限证券

(一) 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

(二) 期末持有的暂时停牌股票

本基金截至 2008 年 12 月 31 日止持有以下因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在消除所公布事项的重大影响后，经交易所批准复牌：

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
600886	国投电力	08/12/09	资产重组	7.92	09/03/04	10.04	1,452,265	12,403,343.05	11,501,938.80

(三) 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金于期末无正回购余额。

### 十三、金融工具风险及管理

(一) 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与金融工程部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与金融工程部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投

资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

## （二）信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。

## （三）流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指

标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注十二中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### (四) 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 1、利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

单位：人民币元

本期末 2008年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	59,439,200.00	-	-	-	59,439,200.00
结算备付金	863,506.03	-	-	-	863,506.03
存出保证金	-	-	-	750,000.00	750,000.00
交易性金融资产	67,886,000.00	20,478,000.00	-	232,068,148.77	320,432,148.77
应收证券清算款	-	-	-	551,380.87	551,380.87

应收利息	-	-	-	2,070,178.76	2,070,178.76
<b>资产总计</b>	<b>128,188,706.03</b>	<b>20,478,000.00</b>	<b>-</b>	<b>235,439,708.40</b>	<b>384,106,414.43</b>
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,656,602.47	1,656,602.47
应付赎回款	-	-	-	9,483.09	9,483.09
应付管理人报酬	-	-	-	526,970.07	526,970.07
应付托管费	-	-	-	87,828.36	87,828.36
应付交易费用	-	-	-	393,261.29	393,261.29
其他负债	-	-	-	500,035.73	500,035.73
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,174,181.01</b>	<b>3,174,181.01</b>
<b>利率风险敞口</b>	<b>128,188,706.03</b>	<b>20,478,000.00</b>	<b>-</b>	<b>232,265,527.39</b>	<b>380,932,233.42</b>

### 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对期末基金资产净值的影响金额(万元)
	市场利率下降 25 个基点	增加约 91
	市场利率上升 25 个基点	下降约 91

## 2、外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

## 3、其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

(1) 其他价格风险

本基金类别资产配置比例为：股票投资占基金资产的 30%至 80%，债券投资占基金资产的 15%至 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%至 3%。于 2008 年 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项 目	本期末 2008 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值的比例 (%)
交易性金融资产 - 股票投资	232,068,148.77	60.92
合计	232,068,148.77	60.92

(2) 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注一)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对年末基金资产净值的影响金额(万元)
	业绩比较基准(附注一)上升 5%	增加约 701
	业绩比较基准(附注一)下降 5%	下降约 701

## 第七章 投资组合报告

### 一、期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	232,068,148.77	60.42
	其中：股票	232,068,148.77	60.42
2	固定收益投资	88,364,000.00	23.01
	其中：债券	88,364,000.00	23.01
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	60,302,706.03	15.70
6	其他资产	3,371,559.63	0.88
7	合计	384,106,414.43	100.00

### 二、期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	8,801,172.72	2.31
B	采掘业	-	0.00
C	制造业	85,096,999.30	22.34
C0	食品、饮料	117,600.00	0.03
C1	纺织、服装、皮毛	17,977,361.26	4.72
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	-	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,971,710.00	2.88
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	17,115,750.00	4.49
C7	机械、设备、仪表	33,030,578.04	8.67
C8	医药、生物制品	5,884,000.00	1.54
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	25,139,731.85	6.60
E	建筑业	100,400.00	0.03
F	交通运输、仓储业	18,917,267.00	4.97
G	信息技术业	2,515,000.00	0.66
H	批发和零售贸易	345,900.00	0.09
I	金融、保险业	51,808,000.00	13.60

J	房地产业	25,365,000.00	6.66
K	社会服务业	12,753,677.90	3.35
L	传播与文化产业	1,225,000.00	0.32
M	综合类	-	0.00
	<b>合计</b>	<b>232,068,148.77</b>	<b>60.92</b>

### 三、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000726	鲁泰A	2,927,909	17,977,361.26	4.72
2	600048	保利地产	1,000,000	14,400,000.00	3.78
3	600030	中信证券	800,000	14,376,000.00	3.77
4	600886	国投电力	1,452,265	11,501,938.80	3.02
5	600309	烟台万华	1,097,171	10,971,710.00	2.88
6	000002	万科A	1,700,000	10,965,000.00	2.88
7	600036	招商银行	850,000	10,336,000.00	2.71
8	600269	赣粤高速	1,294,265	10,095,267.00	2.65
9	601628	中国人寿	500,000	9,325,000.00	2.45
10	601318	中国平安	350,000	9,306,500.00	2.44
11	600879	火箭股份	1,050,000	9,103,500.00	2.39
12	601006	大秦铁路	1,100,000	8,822,000.00	2.32
13	000860	顺鑫农业	801,564	8,801,172.72	2.31
14	600660	福耀玻璃	2,200,000	8,558,000.00	2.25
15	601169	北京银行	950,000	8,464,500.00	2.22
16	000768	西飞国际	677,196	8,458,178.04	2.22
17	000012	南玻A	979,500	8,325,750.00	2.19
18	600089	特变电工	330,000	7,880,400.00	2.07
19	000027	深圳能源	887,875	7,218,423.75	1.89
20	000069	华侨城A	858,800	7,024,984.00	1.84
21	600795	国电电力	1,152,490	6,419,369.30	1.69
22	600350	山东高速	1,181,174	5,728,693.90	1.50
23	000528	柳工	400,000	3,784,000.00	0.99
24	600521	华海药业	300,000	3,648,000.00	0.96
25	000837	秦川发展	600,000	2,712,000.00	0.71
26	600050	中国联通	500,000	2,515,000.00	0.66
27	600664	哈药股份	200,000	2,236,000.00	0.59
28	002238	天威视讯	100,000	1,225,000.00	0.32
29	601766	中国南车	100,000	431,000.00	0.11
30	600835	上海机电	50,000	403,000.00	0.11
31	600019	宝钢股份	50,000	232,000.00	0.06
32	002264	新华都	10,000	181,300.00	0.05

33	600495	晋西车轴	10,000	175,700.00	0.05
34	002262	恩华药业	10,000	164,600.00	0.04
35	600195	中牧股份	10,000	117,600.00	0.03
36	601186	中国铁建	10,000	100,400.00	0.03
37	000527	美的电器	10,000	82,800.00	0.02

#### 四、报告期内股票投资组合的重大变动

##### (一) 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值的比例(%)
1	600036	招商银行	39,245,316.77	10.30
2	600030	中信证券	29,924,574.39	7.86
3	000726	鲁 泰 A	19,651,129.41	5.16
4	600000	浦发银行	18,136,864.97	4.76
5	600886	国投电力	17,640,395.92	4.63
6	600089	特变电工	17,251,085.19	4.53
7	600048	保利地产	15,989,125.72	4.20
8	600795	国电电力	14,822,577.90	3.89
9	601186	中国铁建	14,236,614.78	3.74
10	600195	中牧股份	12,903,757.86	3.39
11	600269	赣粤高速	12,767,064.23	3.35
12	601006	大秦铁路	12,669,175.00	3.33
13	601318	中国平安	12,421,415.12	3.26
14	600028	中国石化	12,239,640.90	3.21
15	600664	哈药股份	11,231,896.48	2.95
16	600309	烟台万华	11,152,699.86	2.93
17	000002	万 科 A	10,667,107.89	2.80
18	002078	太阳纸业	10,268,032.62	2.70
19	600660	福耀玻璃	9,882,640.78	2.59
20	601766	中国南车	9,789,361.84	2.57
21	601628	中国人寿	9,774,246.00	2.57
22	600050	中国联通	9,516,233.00	2.50
23	000860	顺鑫农业	9,396,187.70	2.47
24	600495	晋西车轴	9,234,060.79	2.42
25	600879	火箭股份	9,162,420.47	2.41
26	601169	北京银行	8,797,488.00	2.31
27	000768	西飞国际	8,695,031.80	2.28
28	002264	新 华 都	8,604,961.96	2.26
29	000012	南 玻 A	8,485,050.37	2.23
30	601919	中国远洋	8,450,368.78	2.22
31	002218	拓日新能	8,212,036.00	2.16

32	000027	深圳能源	8,027,752.41	2.11
33	000069	华侨城 A	8,006,857.08	2.10
34	002249	大洋电机	7,786,348.99	2.04
35	002238	天威视讯	7,739,366.38	2.03

(二) 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值的比例(%)
1	600036	招商银行	19,645,975.00	5.16
2	600000	浦发银行	15,595,277.27	4.09
3	600089	特变电工	13,219,567.40	3.47
4	600030	中信证券	12,137,601.00	3.19
5	601186	中国铁建	11,929,600.30	3.13
6	600495	晋西车轴	11,217,574.87	2.94
7	601766	中国南车	10,694,477.80	2.81
8	600664	哈药股份	9,980,461.02	2.62
9	600028	中国石化	9,674,795.37	2.54
10	600795	国电电力	8,308,870.00	2.18
11	601919	中国远洋	8,189,218.98	2.15
12	600195	中牧股份	7,884,743.79	2.07
13	002078	太阳纸业	6,818,676.05	1.79
14	600050	中国联通	6,743,033.00	1.77
15	601328	交通银行	6,649,230.29	1.75
16	600011	华能国际	6,553,710.36	1.72
17	600395	盘江股份	6,236,317.02	1.64
18	002218	拓日新能	6,194,958.02	1.63
19	002261	拓维信息	5,971,147.24	1.57
20	601601	中国太保	5,662,252.60	1.49

(三) 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本(成交)总额	598,102,609.20
卖出股票收入(成交)总额	298,055,770.95

注：本项中(一)(二)(三)表中的“买入金额”(或“买入股票成本”)“卖出金额”(或“卖出股票收入”)均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

## 五、期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	67,886,000.00	17.82
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	20,478,000.00	5.38
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	-	0.00
7	其他	-	0.00
	<b>合计</b>	<b>88,364,000.00</b>	<b>23.20</b>

## 六、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	0801046	08 央行票据 46	700,000	67,886,000.00	17.82
2	088050	08 渝城投债	200,000	20,478,000.00	5.38

七、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细  
本基金期末未持有资产支持证券。

八、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  
本基金报告期末未持有权证。

## 九、投资组合报告附注

(一) 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。

(二) 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。

(三) 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	551,380.87
3	应收股利	-
4	应收利息	2,070,178.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
	合计	3,371,559.63

(四) 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(五) 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值的比例 (%)	流通受限情况说明
1	600886	国投电力	11,501,938.80	3.02	资产重组

## 第八章 基金份额持有人信息

### 一、期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份额 比例(%)	持有 份额	占总份额 比例(%)
4,407	99,997.78	317,305,010.71	72.00	123,385,215.24	28.00

### 二、期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

份额单位：份

项目	持有份额总数	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员 持有本开放式基金	2,034,946.93	0.46

## 第九章 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年6月4日)基金份额总额	848,262,882.92
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,591,304.37
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	411,163,961.34
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	440,690,225.95

## 第十章 重大事件揭示

### 一、基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 二、基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (一) 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

基金管理人于 2008 年 3 月 17 日发布关于聘任公司副总经理的公告 经长盛基金管理有限公司第四届董事会第一次会议审议通过，并报中国证监会审核批准（证监许可【2008】358 号文），聘任杨思乐先生担任公司副总经理职务。

基金管理人于 2008 年 7 月 4 日发布关于变更公司高管的公告：经公司第四届董事会第十三次会议审议批准，同意宋炳山同志辞去公司副总经理等相关职务。

#### (二) 本基金的基金经理未变更。

#### (三) 本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

### 三、涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 四、基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略不曾改变。

### 五、为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所 本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，报告年度应支付审计费 65,000.00 元。普华永道中天会计师事务所有限公司已为本基金提供审计服务 1 年。

### 六、管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 七、基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### (一) 本期基金租用证券公司交易单元股票交易的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)
国金证券股份有限公司	1	433,773,837.92	49.74	368,708.79	50.30

光大证券股份有限公司	1	163,752,908.36	18.78	133,049.93	18.15
华宝证券经纪有限责任公司	1	58,601,864.63	6.72	47,614.69	6.50
平安证券有限责任公司	1	215,972,797.99	24.76	183,575.52	25.05
东吴证券有限责任公司	1	-	0.00	-	0.00
第一创业证券有限责任公司	1	-	0.00	-	0.00
<b>合计</b>	<b>6</b>	<b>872,101,408.90</b>	<b>100.00</b>	<b>732,948.93</b>	<b>100.00</b>

(二) 本期基金租用证券公司交易单元债券交易的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易	
		成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交总额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	1	5,724,715.83	25.08	100,000,000.00	100.00
光大证券股份有限公司	1	5,129,500.00	22.47	-	0.00
华宝证券经纪有限责任公司	1	5,945,076.90	26.04	-	0.00
平安证券有限责任公司	1	6,028,792.71	26.41	-	0.00
东吴证券有限责任公司	1	-	0.00	-	0.00
第一创业证券有限责任公司	1	-	0.00	-	0.00
<b>合计</b>	<b>6</b>	<b>22,828,085.44</b>	<b>100.00</b>	<b>100,000,000.00</b>	<b>100.00</b>

(三) 本期基金租用证券公司交易单元权证交易的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	权证交易	
		成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	1	990,874.24	100.00
光大证券股份有限公司	1	-	0.00
华宝证券经纪有限责任公司	1	-	0.00
平安证券有限责任公司	1	-	0.00
东吴证券有限责任公司	1	-	0.00
第一创业证券有限责任公司	1	-	0.00
<b>合计</b>	<b>6</b>	<b>990,874.24</b>	<b>100.00</b>

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

## 2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

## 3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金于 2008 年 6 月 4 日成立，所有交易单元均为报告期内新增租用，无停止租用交易单元情况。

## 八、其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事件如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	本基金基金合同及其摘要、托管协议、招募说明书和发售公告	基金合同摘要、招募说明书、发售公告登载于《中国证券报》、《上海证券报》，基金合同及其摘要、托管协议、招募说明书、发售公告登载于本公司网站	2008-04-11
2	有关网上直销开通多家支付机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及本公司网站	2008-04-14
3	关于增加招商证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司为代销机构的公告	同上	2008-04-16
4	关于增加银河证券、长江证券为代销机构的公告	同上	2008-04-17
5	关于增加兴业银行、联合证券、中信金通为代销机构的公告	同上	2008-04-21
6	本基金延长募集期的公告	同上	2008-05-14
7	关于长盛基金客服中心延长工作时间的公告	同上	2008-05-23
8	关于增加国信证券、第一创业证券为创新先锋代销机构的公告	同上	2008-05-26
9	长盛基金公司查找地震灾区基金份额持有人的公告	同上	2008-06-02
10	本基金合同生效公告	同上	2008-06-05
11	关于本基金开放日常申购与赎回业务的公告	同上	2008-07-01
12	关于增加中国民生银行股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	同上	2008-07-02
13	关于本基金参与中国工商银行网上交易申购费率优惠活动的公告	同上	2008-07-03
14	关于旗下基金通过民生银行开展定期定额投资业务的公告	同上	2008-07-15
15	关于参与中国银行网上银行及定期定额申购费率优惠活动公告	同上	2008-08-05
16	关于通过中国银行开办长盛同德基金、长盛创新先锋基金定期定额投资业务的公告	同上	2008-08-05
17	关于增加定期定额投资业务代销机构的公告	同上	2008-08-06
18	关于调整长盛基金管理有限公司网上直销申购费率的公告	同上	2008-08-28
19	关于长盛基金管理有限公司变更短信	同上	2008-08-30

	通道号码的公告		
20	关于开通长盛网上直销基金定期定额申购业务的公告	同上	2008-09-03
21	关于调整本司旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	同上	2008-09-16
22	关于赎回旗下长盛动态精选基金的公告	同上	2008-09-23
23	关于增加浦发银行为旗下基金代销机构的公告	同上	2008-09-25
24	关于增加长城证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告	同上	2008-10-10
25	关于增加交通银行为代销机构并开通定期定额投资业务及同时参加定期定额申购费率优惠活动的公告	同上	2008-10-29
26	关于增加注册资本、变更注册地址和股东名称的公告	同上	2008-11-05
27	关于增加红塔证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	同上	2008-11-17
28	关于旗下基金停牌股票复牌后估值方法的公告	同上	2008-12-27
29	关于旗下基金通过建行开办定投及参加定投优惠活动的公告	同上	2008-12-31

## 第十一章 备查文件目录

### 一、备查文件目录

(一)关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金的批复

(二)长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(三)长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金托管协议

(四)报告期内披露的各项公告原件

(五)长盛基金管理有限公司营业执照和公司章程

### 二、存放地点和查阅方式

以上相关备查文件,置备于基金管理人的办公场所。本报告分别置备于基金管理人的办公场所和基金托管人的住所。本报告至少登载在一种由中国证监会指定的全国性报刊及本基金管理人的互联网网站上。上述备查文件可在长盛基金管理有限公司互联网站上查阅。

### 三、查阅方式

在办公时间内可查阅,也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

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>。

长盛基金管理有限公司

二 九年三月三十日