

长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

2009 年第 2 季度报告

2009 年 06 月 30 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

报告送出日期：2009 年 07 月 21 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 2009 年 7 月 17 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 4 月 1 日起至 2009 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	长盛创新先锋混合
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06月04日
报告期末基金份额总额	196,708,764.58份
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。
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

## § 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(2009年04月01日-2009年06月30日)
1. 本期已实现收益	38,280,077.90
2. 本期利润	37,603,848.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1685
4. 期末基金资产净值	214,394,951.92
5. 期末基金份额净值	1.0899

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2009年6月30日。

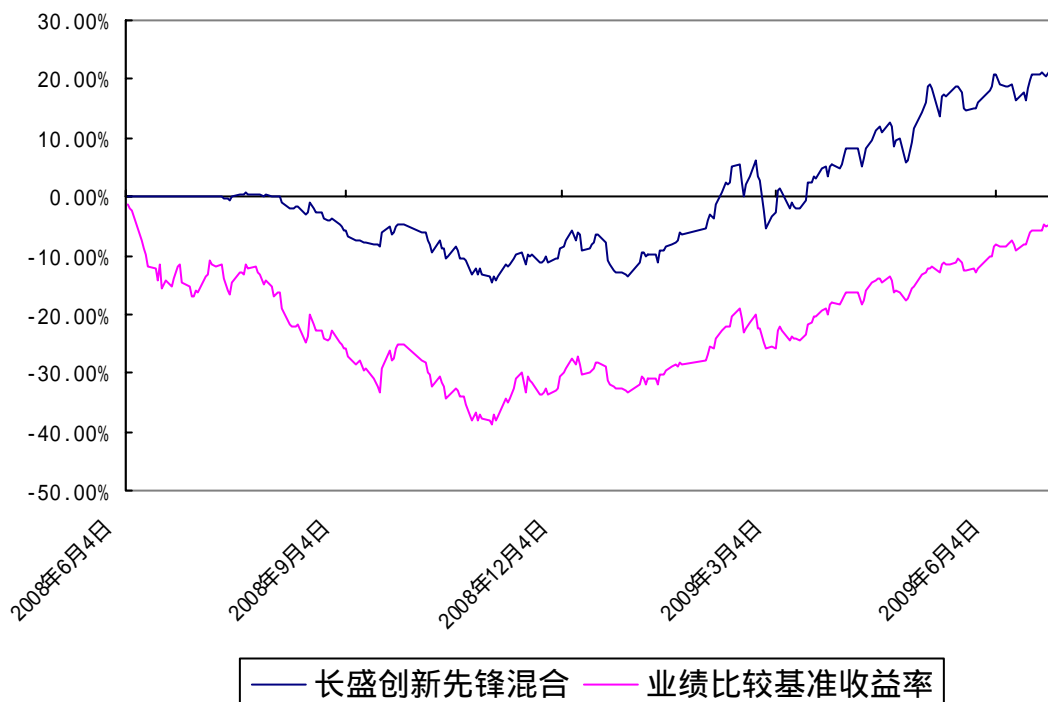
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 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	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	15.77%	1.41%	16.70%	1.01%	-0.93%	0.40%

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。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十四条（二）投资范围、（七）投资禁止行为与限制的有关约定。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		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。	2008年6月4日	-	16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，历任同盛证券投资基金基金经理助理、同益证券投资基金基金经理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、同智证券投资基金基金经理，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等职务。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。
邓永明	本基金基金经理，长盛动态精选证券投资基金基金经理。	2008年6月4日	-	10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，曾任同益证券投资基金基金经理助理，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。

#### **4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明**

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 公平交易专项说明**

##### **4.3.1 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。

##### **4.3.2 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。

##### **4.3.3 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。

#### **4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

##### **4.4.1 行情回顾及运作分析**

2009年2季度，在流动性充裕和对未来经济前景预期良好的共振下，市场延续了上升态势，大盘股票交易活跃，涨幅超过小盘股票。

##### **4.4.2 本基金业绩表现**

截至报告期末，本基金份额净值为1.0899元，本报告期份额净值增长率为15.77%，同期业绩比较基准增长率为16.70%。

##### **4.4.3 市场展望和投资策略**

去年全球金融、经济危机迫使各国央行实行定量宽松政策以挽救经济。目前对经济最乐观的预期也只是“初步企稳”，各国央行们还没有理由改变政策方向，因为未雨绸缪的行动可能是功亏一篑的结果。因此在政策没有根本改变方向的时候，我们相信市场的流动性还会推动股市保持既定的趋势。

今年5月我国金融机构外汇占款增量显著回升，达到今年以来最高水平。金融机构外汇占款余额为176,587.51亿元，其中5月份金融机构新增外汇占款为2,425.65亿元，这也是外汇占款连续两个月出现增长。央行此前公布的数据显示，今年以来，金融机构单月新增外汇占款均在1,500亿元左右波动。去年金融危机的时候，我国资本外流增加，而资本流入速度是下降的。而现在，在看好中国经济率先复苏和美元长期贬值的预期下，我国未来可能再次面临大量资本流入的压力。这可能会对A股市场的流动性起到推波助澜的作用。

未来一个季度，我们将保持较高仓位，减少时机选择。坚持超配与经济复苏密切相关的大金融行业（包括银行、保险和证券）、地产（重点是行业龙头和土地、物业储备多的资产型公司）。择机介入经济复苏初期毛利可能扩张的中游行业。



## § 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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	166,552,051.80	74.89
	其中:股票	166,552,051.80	74.89
2	固定收益投资	34,515,400.00	15.52
	其中:债券	34,515,400.00	15.52
	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	12,546,786.51	5.64
6	其他资产	8,791,829.71	3.95
7	合计	222,406,068.02	100.00

### 5.2 报告期末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	-	0.00
B	采掘业	13,416,005.00	6.26
C	制造业	47,182,336.00	22.01
C0	食品、饮料	-	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	5,516,000.00	2.57
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	4,326,000.00	2.02
C4	石油、化学、塑胶、塑料	13,173,636.00	6.14
C5	电子	-	0.00
C6	金属、非金属	4,997,800.00	2.33
C7	机械、设备、仪表	18,902,500.00	8.82
C8	医药、生物制品	266,400.00	0.12
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	164,900.00	0.08
E	建筑业	3,404,000.00	1.59
F	交通运输、仓储业	-	0.00
G	信息技术业	5,617,471.00	2.62
H	批发和零售贸易	5,412,000.00	2.52
I	金融、保险业	61,020,980.00	28.46
J	房地产业	27,794,359.80	12.96

K	社会服务业	2,540,000.00	1.18
L	传播与文化产业	-	0.00
M	综合类	-	0.00
	合计	166,552,051.80	77.68

### 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

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	000002	万科A	1,200,000	15,300,000.00	7.14
2	600036	招商银行	630,000	14,118,300.00	6.59
3	000983	西山煤电	229,950	6,875,505.00	3.21
4	002092	中泰化学	534,800	6,856,136.00	3.20
5	601939	建设银行	1,100,000	6,633,000.00	3.09
6	600016	民生银行	830,000	6,573,600.00	3.07
7	600166	福田汽车	480,000	6,360,000.00	2.97
8	600141	兴发集团	475,000	6,317,500.00	2.95
9	601328	交通银行	700,000	6,307,000.00	2.94
10	002128	露天煤业	230,000	6,145,600.00	2.87

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	13,539,400.00	6.32
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	20,976,000.00	9.78
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	34,515,400.00	16.10

### 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	088050	08 渝城投债	200,000	20,976,000.00	9.78
2	010004	20 国债(4)	133,000	13,539,400.00	6.32

注：本基金本报告期末仅持有上述两支债券。

### 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 申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 申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股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,379,368.13
2	应收证券清算款	6,605,264.46
3	应收股利	82,863.00
4	应收利息	628,918.47
5	应收申购款	95,415.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,791,829.71

5.8.4 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处于转股期的可转换债券。

5.8.5 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不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	287,824,138.97
报告期期间基金总申购份额	8,837,453.33
报告期期间基金总赎回份额	99,952,827.72
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	196,708,764.58

## §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创新先锋灵活配置混合型证券投资基金的批复

2、长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3、长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金托管协议

4、报告期内披露的各项公告原件

5、长盛基金管理有限公司营业执照和公司章程

### 7.2 存放地点

以上相关备查文件，置备于基金管理人的办公场所。本季度报告分别置备于基金管理人和基金托管人的办公场所。本季度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。

### 7.3 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。