

长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

2009 年第 4 季度报告

2009 年 12 月 31 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：2010 年 1 月 20 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 2010 年 1 月 19 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 10 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 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 | 156,785,782.84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10月01日-2009年12月31日) |
|-----------------|------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 35,253,888.21                |
| 2. 本期利润         | 40,130,662.77                |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1765                       |
| 4. 期末基金资产净值     | 178,722,308.27               |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1399                       |

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12月31日。

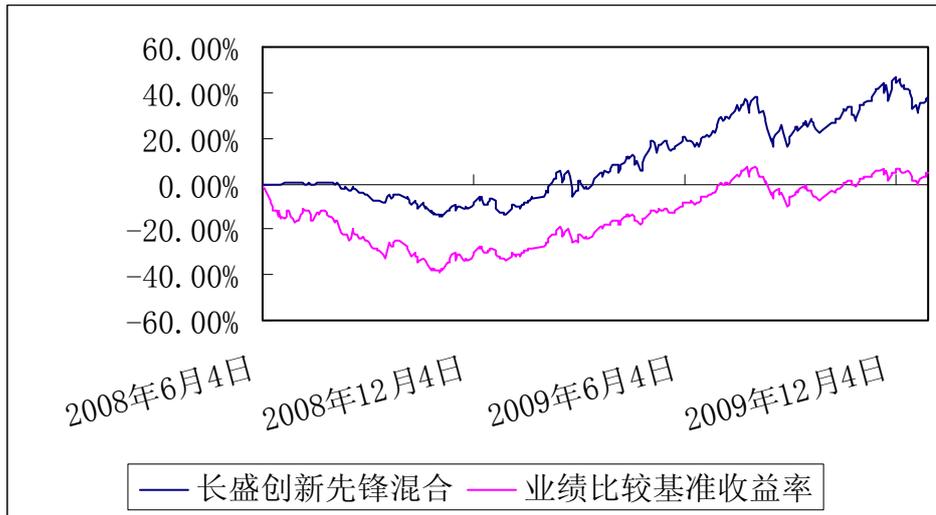
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

### 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<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基准<br>收益率③ | 业绩比较基准收<br>益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|------------|---------------|----------------|-------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 12.21%     | 1.54%         | 12.42%         | 1.14%             | -0.21% | 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，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。

## 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4季度，由于大多数投资者担心中央银行将开始侧重预防通胀的收紧政策，市场进入震荡调整阶段。

### 4.4.2 本基金业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.1399元，本报告期份额净值增长率为12.21%，同期业绩比较基准增长率为12.42%。

### 4.4.3 市场展望和投资策略

2010年上半年A股市场主要表现为震荡市，先抑后扬的可能性在增大。因为2010年各种基本面因素相对更加平衡，股市将随盈利呈现震荡向上趋势。市场未来的分歧将主要集中于对经济从复苏走向增长后，是快速进入较高通胀阶段，还是能保持较长时间低通胀、高增长时期。则投资主题会趋向上、中、下游不同方向，加上市场资金从2009年上半年的充裕转向略微偏紧，目前政策调整和融资压力带来的震荡走势有望

持续进入2010年1季度，市场进一步更明确的上扬趋势需要经济和盈利的超预期表现。

因此，我们未来的策略是：

保持较低仓位，回避市场系统风险，着力捕捉个股机会。

## § 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              | 138,927,076.15 | 76.33        |
|    | 其中：股票             | 138,927,076.15 | 76.33        |
| 2  | 固定收益投资            | 27,518,969.00  | 15.12        |
|    | 其中：债券             | 27,518,969.00  | 15.12        |
|    | 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      | 13,572,751.20  | 7.46         |
| 6  | 其他资产              | 1,998,303.14   | 1.10         |
| 7  | 合计                | 182,017,099.49 | 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            | -             | 0.00         |
| C   | 制造业            | 30,259,711.48 | 16.93        |
| C0  | 食品、饮料          | 5,486,400.00  | 3.07         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | -             | 0.00         |
| C2  | 木材、家具          | -             | 0.00         |
| C3  | 造纸、印刷          | -             | 0.00         |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 19,721,211.48 | 11.03        |
| C5  | 电子             | -             | 0.00         |
| C6  | 金属、非金属         | 142,000.00    | 0.08         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 4,910,100.00  | 2.75         |
| C8  | 医药、生物制品        | -             | 0.00         |
| C99 | 其他制造业          | -             | 0.00         |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 3,941,802.90  | 2.21         |
| E   | 建筑业            | -             | 0.00         |
| F   | 交通运输、仓储业       | -             | 0.00         |
| G   | 信息技术业          | 8,974,000.00  | 5.02         |
| H   | 批发和零售贸易        | -             | 0.00         |
| I   | 金融、保险业         | 64,967,047.90 | 36.35        |
| J   | 房地产业           | 19,396,513.87 | 10.85        |

|   |         |                |       |
|---|---------|----------------|-------|
| K | 社会服务业   | 7,140,000.00   | 4.00  |
| L | 传播与文化产业 | -              | 0.00  |
| M | 综合类     | 4,248,000.00   | 2.38  |
|   | 合计      | 138,927,076.15 | 77.73 |

### 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  | 601166 | 兴业银行 | 350,000 | 14,108,500.00 | 7.89         |
| 2  | 600000 | 浦发银行 | 599,910 | 13,012,047.90 | 7.28         |
| 3  | 002019 | 鑫富药业 | 689,912 | 11,238,666.48 | 6.29         |
| 4  | 601628 | 中国人寿 | 300,000 | 9,507,000.00  | 5.32         |
| 5  | 000063 | 中兴通讯 | 200,000 | 8,974,000.00  | 5.02         |
| 6  | 600036 | 招商银行 | 480,000 | 8,664,000.00  | 4.85         |
| 7  | 601318 | 中国平安 | 150,000 | 8,263,500.00  | 4.62         |
| 8  | 000565 | 渝三峡A | 449,950 | 7,694,145.00  | 4.31         |
| 9  | 000014 | 沙河股份 | 470,000 | 7,285,000.00  | 4.08         |
| 10 | 000024 | 招商地产 | 260,000 | 6,923,800.00  | 3.87         |

### 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      | 27,518,969.00 | 15.40        |
| 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      | -             | 0.00         |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | 0.00         |
| 6  | 可转债       | -             | 0.00         |
| 7  | 其他        | -             | 0.00         |
| 8  | 合计        | 27,518,969.00 | 15.40        |

### 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  | 010301 | 03 国债（1）  | 229,260 | 23,075,019.00 | 12.91        |
| 2  | 010004 | 20 国债（4）  | 39,000  | 3,931,200.00  | 2.20         |
| 3  | 010112 | 21 国债（12） | 5,000   | 512,750.00    | 0.29         |

注：本基金本报告期末仅持有上述三支债券。

### 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   | 1,393,238.50 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 602,203.11   |
| 5  | 应收申购款   | 2,861.53     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,998,303.14 |

#### **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。

#### **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

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 281,321,074.11 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 8,295,673.92   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 132,830,965.19 |
| 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               | 156,785,782.84 |

## § 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。