

长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金

2012年第2季度报告

2012年6月30日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2012年7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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年7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及更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至2012年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛同祥泛资源股票
基金主代码	080008
交易代码	080008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月26日
报告期末基金份额总额	53,724,513.47份
投资目标	将灵活投资于具有泛资源禀赋的上市公司股票，分享中国泛资源经济发展的长期效益，力争为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，运用科学严谨、规范化的资产配置方法，灵活配置国内具有泛资源禀赋的上市公司股票，谋求基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	沪深300指数×70%+中证综合债券指数×30%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于证券投资基金中的高风险品种，预期风险和收益高于混合型基金，债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 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(2012年4月1日-2012年6月30日)
1. 本期已实现收益	2,382,121.67
2. 本期利润	3,994,483.90
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0645
4. 期末基金资产净值	55,807,319.90
5. 期末基金份额净值	1.039

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2012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。

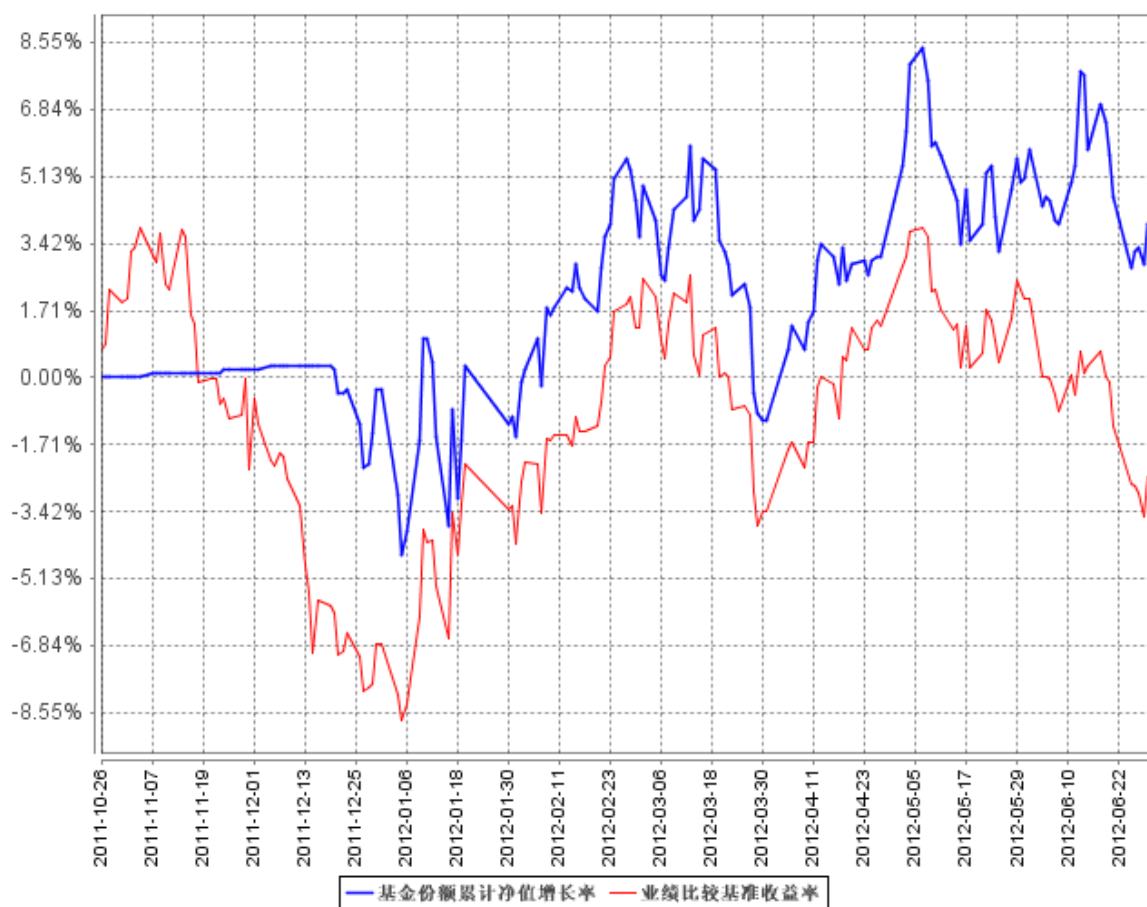
3.2 基金净值表现

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①	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	5.06%	0.94%	0.93%	0.78%	4.13%	0.16%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2011 年 10 月 26 日，截至本报告期末本基金成立未
满一年。

2、本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 60%–95%，其中投资
于具有泛资源禀赋的上市公司股票不低于股票类资产的 80%；债券投资占基金资产的
0%–40%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；现金或者到期日在一年以内的政
府债券不低于基金资产净值的 5%。

§ 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		
李庆林	本基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2011年10月26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基金经理，长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金（本基金）基金经理。

注：1、上表基金经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；

2、“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、《长盛同祥泛资源主题股票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

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下：

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，各投

投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。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，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

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。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 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，同日反向交易成本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 1 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。

本报告期内，未发现本基金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 行情回顾及运作分析

2 季度, 整体市场跌幅较少, 但是分化较为严重, 以煤炭、水泥、工程机械等周期性股票跌幅较大, 几乎把一季度的涨幅抹平, 而以地产、白酒、医药等有代表性的消费类行业涨幅较大, 尤其是酿酒行业, 已经超过历史高点。市场在陷入宏观经济非常担忧的同时, 已经在追逐确定性增长的行业和个股, 对一些达不到增长预期的个股则大幅度杀跌。

2 季度, 本基金业绩表现同一季度相比有较大的改善, 主要是组合中重仓配置的医药行业股票表现较好。不过, 整体业绩并不理想, 主要是本基金重仓配置的其他消费股票二级市场表现较差, 而且本基金几乎没有配置地产股票。

4.4.2 本基金业绩表现

截至报告期末, 本基金份额净值为 1.039 元, 本报告期份额净值增长率为 5.06%, 同期业绩比较基准增长率为 0.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一个季度，宏观经济形势仍然难以看好。中国的发电量数据表明，宏观经济可能远远没有国家公布的数据那么好看。货币政策实质上转向宽松，但是在没有政府债务迅速扩张的情况下，仅靠居民债务在房地产上面的扩张，很难短期内扭转经济下滑的态势。政府的万能在消费领域往往是失灵的。更令人失望的是，政府的扩张性货币政策和财政政策也存在了天花板：外汇盈余逐渐接近平衡点，再也没有过去十年一样廉价的货币供政府使用。未来几个季度，经济仍将在寻底的过程中，在没有看到价格要素充分调整的迹象时，也许很难知道何处是底。

目前证券市场上，蓝筹股票的估值尚可接受，但是中小市值上市公司的股票估值仍然处于回归过程中。市场仍将处于混沌之中。

本基金下阶段将继续围绕经济结构转型这个大主题，在大消费类行业中挖掘增长较为明确，相对估值较低的个股，力求获得较好的收益。

§ 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	44,833,572.82	79.49
	其中：股票	44,833,572.82	79.49
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	11,172,659.16	19.81
6	其他资产	394,195.74	0.70
7	合计	56,400,427.72	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	-	-
B	采掘业	1,798,017.84	3.22
C	制造业	33,564,242.78	60.14
C0	食品、饮料	13,608,411.88	24.38
C1	纺织、服装、皮毛	3,196,200.00	5.73
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	1,181,911.64	2.12
C7	机械、设备、仪表	5,283,893.59	9.47
C8	医药、生物制品	10,293,825.67	18.45
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	3,211,124.20	5.75
I	金融、保险业	6,260,188.00	11.22
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-

L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	44,833,572.82	80.34

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	000895	双汇发展	75,000	4,641,000.00	8.32
2	600887	伊利股份	219,986	4,527,311.88	8.11
3	600521	华海药业	279,908	4,229,409.88	7.58
4	600809	山西汾酒	70,000	2,638,300.00	4.73
5	600267	海正药业	139,875	2,445,015.00	4.38
6	000581	威孚高科	69,200	1,896,080.00	3.40
7	600030	中信证券	150,000	1,894,500.00	3.39
8	600079	人福医药	80,000	1,855,200.00	3.32
9	601318	中国平安	39,980	1,828,685.20	3.28
10	000963	华东医药	59,971	1,811,124.20	3.25

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 声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。

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。

5.8.2 声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的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,798.52
5	应收申购款	142,397.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	394,195.74

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中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	73,409,779.26
报告期期间基金总申购份额	3,530,591.03
减：报告期期间基金总赎回份额	23,215,856.82
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	53,724,513.47

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

7.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

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>。