

长盛电子信息产业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	长盛电子信息产业股票
基金主代码	080012
交易代码	080012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月27日
报告期末基金份额总额	228,478,280.85份
投资目标	本基金主要投资于电子信息产业上市公司股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	(1) 分析宏观经济运行状况、市场估值水平等因素,动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。(2) 发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,判断公司的核心价值与成长能力,选择具有竞争优势且估值具有吸引力的公司作为投资标的,根据市场波动情况精选个股,构建股票投资组合。
业绩比较基准	80%*中证信息技术指数收益率 + 20%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金产品,风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金,属于高风险、高预期收益的基金产品。
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(2012年4月1日-2012年6月30日)
1. 本期已实现收益	136,601.94
2. 本期利润	-2,692,194.92
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0078
4. 期末基金资产净值	225,949,908.39
5. 期末基金份额净值	0.989

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。

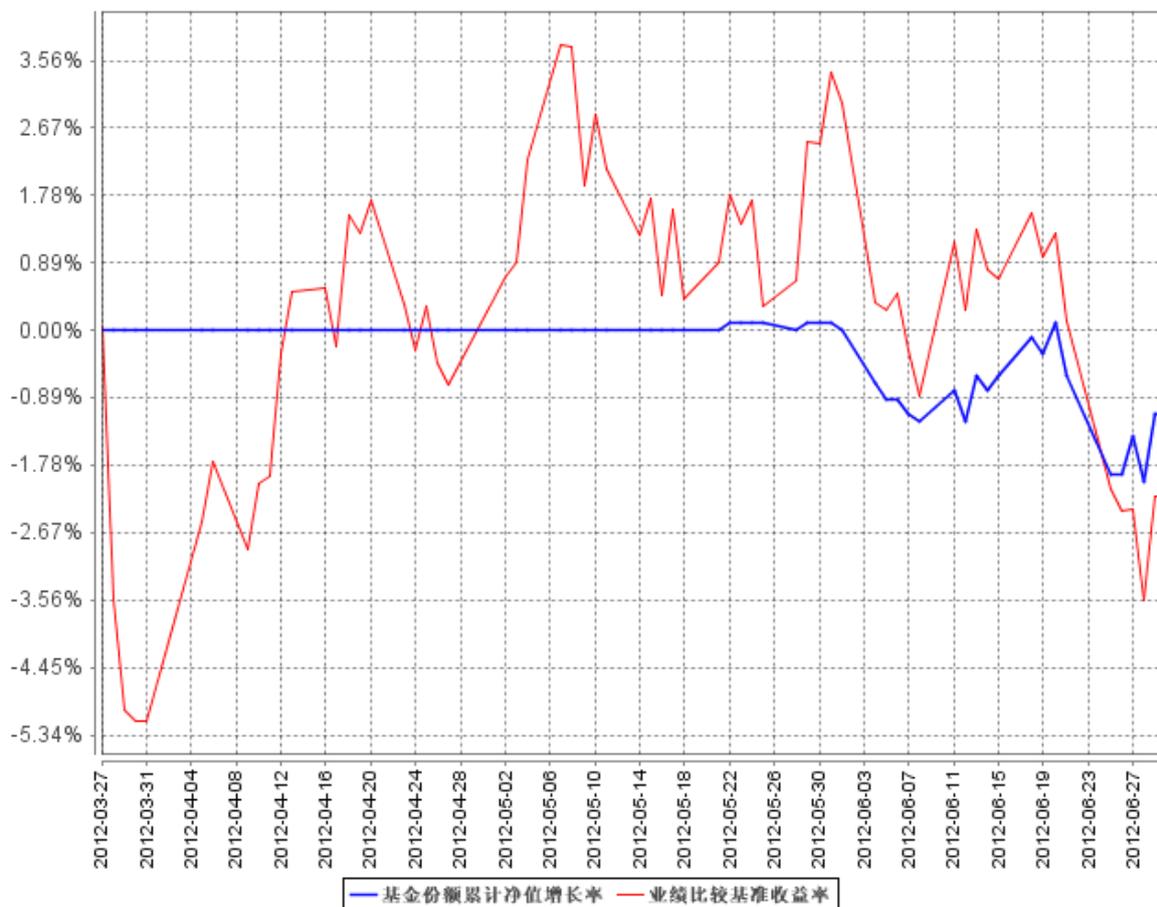
3.2 基金净值表现

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	-1.10%	0.31%	3.12%	1.08%	-4.22%	-0.77%

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2012年3月27日，截止本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为60%–95%，其中投资于电子信息产业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的比例不高于3%；现金或者到期日在一年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		
王克玉	本基金基金经理，同益证券投资基金基	2012年3月27日	—	9年	男，1979年12月出生，中国国籍。上海交通大学硕士。历任元大京华证券上海代表处研究员，天相

	金经理。			投资顾问有限公司分析师，国都证券有限公司分析师。2006年7月加入长盛基金管理有限公司，曾任同盛证券投资基金基金经理助理，高级行业研究员。现任同益证券投资基金基金经理，长盛电子信息产业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》及其各项实施准则、《长盛电子信息产业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 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

2012 年第二季度的 A 股市场走势波荡起伏。期初到期末上证指数和沪深 300 指数变动分别为-1.65%和 0.27%，在过程之中 4 月份上证指数曾出现过 5.9%的上涨，但是从 5 月份以来，受到国际市场上欧洲债务、发展中国家通胀和货币贬值等外部因素以及国内经济基本面下滑的影响，市场出现了持续的回调。

从全市场的情况看，二季度涨幅居前的行业主要是医药生物、食品饮料和房地产，而周期性强的采掘、中游制造业出现非常明显的下跌。从本基金投资范围的情况看，申万电子、信息设备和信息服务的涨幅分别为 3.13%、-2.53%和-3.87%。

二季度是本基金成立后正式运作的第一个季度，考虑到基金的流动性和 4 月份上市公司业绩压力的影响，在建仓初期采取了相对谨慎的态度，导致错失了 4 月份市场整体的上涨行情。此后在市场的调整过程中通过自下而上的方式逐步增持了看好的个股，目前持仓行业主要是电子和信息服务。

4.4.2 本基金业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 0.989 元，本报告期份额净值增长率为-1.10%，同期业绩比较基准增长率为 3.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金是专注于投资电子信息产业上市公司的行业型基金，经过过去多年的快速增长，电子信息产业已经成为国内的支柱型产业，国内企业的综合竞争力得到大幅增强，大量处于成长期的中小型企业上市，为我们的投资提供了很好的标的。同时我们

也要看到行业内的技术发展很快，企业经营更容易受到技术进步、运营能力的影响。

初步判断三季度行业的经营状况将出现一定的好转。一方面受到下半年新产品推出的拉动，电子行业的出货量将有明显的回升，产品价格的下降趋势将得到一定的缓解，从而改善行业的盈利能力。另外随着国家相关政策的推出，信息服务行业的公司的收入和盈利增长会体现出很强的稳定性，在三季度仍然主要通过自下而上的方式选择有竞争力的成长型企业作为组合的主要投资标的。

§ 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	124,552,578.37	54.80
	其中：股票	124,552,578.37	54.80
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	50,000,000.00	22.00
	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	52,423,462.27	23.07
6	其他各项资产	305,803.08	0.13
7	合计	227,281,843.72	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	-	-
C	制造业	52,447,796.69	23.21
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	47,935,359.79	21.22
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	4,512,436.90	2.00
C8	医药、生物制品	-	-

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	66,609,172.13	29.48
H	批发和零售贸易		
I	金融、保险业		
J	房地产业		
K	社会服务业	5,495,609.55	2.43
L	传播与文化产业		
M	综合类	-	-
	合计	124,552,578.37	55.12

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	600271	航天信息	500,000	9,455,000.00	4.18
2	002138	顺络电子	587,359	6,701,766.19	2.97
3	600718	东软集团	732,523	6,307,023.03	2.79
4	002465	海格通信	272,890	6,167,314.00	2.73
5	300182	捷成股份	261,401	6,142,923.50	2.72
6	002368	太极股份	364,097	6,120,470.57	2.71
7	002185	华天科技	712,604	6,114,142.32	2.71
8	300302	同有科技	204,527	5,904,694.49	2.61
9	002439	启明星辰	395,306	5,850,528.80	2.59
10	002179	中航光电	419,293	5,752,699.96	2.55

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	30,246.90
5	应收申购款	12,222.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	13,333.32
9	合计	305,803.08

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	436,879,183.47
报告期期间基金总申购份额	402,085.27
减：报告期期间基金总赎回份额	208,802,987.89
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	228,478,280.85

§ 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、《长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛电子信息产业股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛电子信息产业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>。