

长盛电子信息产业股票型证券投资基金

2012 年半年度报告

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

送出日期：2012 年 8 月 25 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本半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 2012 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 3 月 27 日(基金合同生效日)起至 6 月 30 日止。

1.2	目录	
§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
1.2	目录	2
§ 2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人	4
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	6
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2	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	14
5.3	托管人对本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	14
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4	报表附注	19
§ 7	投资组合报告	35
7.1	期末基金资产组合情况	35
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3	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	36
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	37
§ 8	基金份额持有人信息	39

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	39
§ 9 开放式基金份额变动.....	39
§ 10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
10.2 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.....	40
10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况.....	40
10.2.2 基金经理变动情况.....	40
10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票和债券交易的情况.....	40
10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行债券回购交易的情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	42
§ 11 备查文件目录.....	43
11.1 备查文件目录.....	43
11.2 存放地点.....	43
11.3 查阅方式.....	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛电子信息产业股票型证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	228,478,280.85份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

2.3 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	姓名	叶金松	唐州徽

负责人	联系电话	010-82019988	010-66594855
	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 号诺德中心八楼 GH 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 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		凤良志	肖钢

2.4 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012年3月27日-2012年6月30日)
本期已实现收益	83,428.46
本期利润	-2,745,368.40
加权平均基金份额本期利润	-0.0078
本期加权平均净值利润率	-0.78%
本期基金份额净值增长率	-1.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	-2,528,372.46
期末可供分配基金份额利润	-0.0111
期末基金资产净值	225,949,908.39
期末基金份额净值	0.989
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.10%

注：1、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。

2、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、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（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

4、本基金基金合同于2012年3月27日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-1.20%	0.52%	-5.41%	1.09%	4.21%	-0.57%
过去三个月	-1.10%	0.31%	3.12%	1.08%	-4.22%	-0.77%

自基金合同生效起至今	-1.10%	0.29%	-2.19%	1.15%	1.09%	-0.86%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准：80%*中证信息技术指数收益率 + 20%*中证综合债指数收益率

基准指数的构建考虑了三个原则：

1、公允性。本基金为行业主题股票型基金，在综合比较目前市场上各主要行业指数的编制特点后，本基金选择以中证信息技术指数作为股票投资的业绩比较基准。中证信息技术指数是中证指数公司为反映 A 股中信息技术行业公司股票的整体表现，将中证 800 成分股中信息技术行业中的全部股票作为样本所编制的行业指数。本基金主要投资于电子信息产业上市公司股票，从而中证信息技术指数适合作为本基金的业绩比较基准。

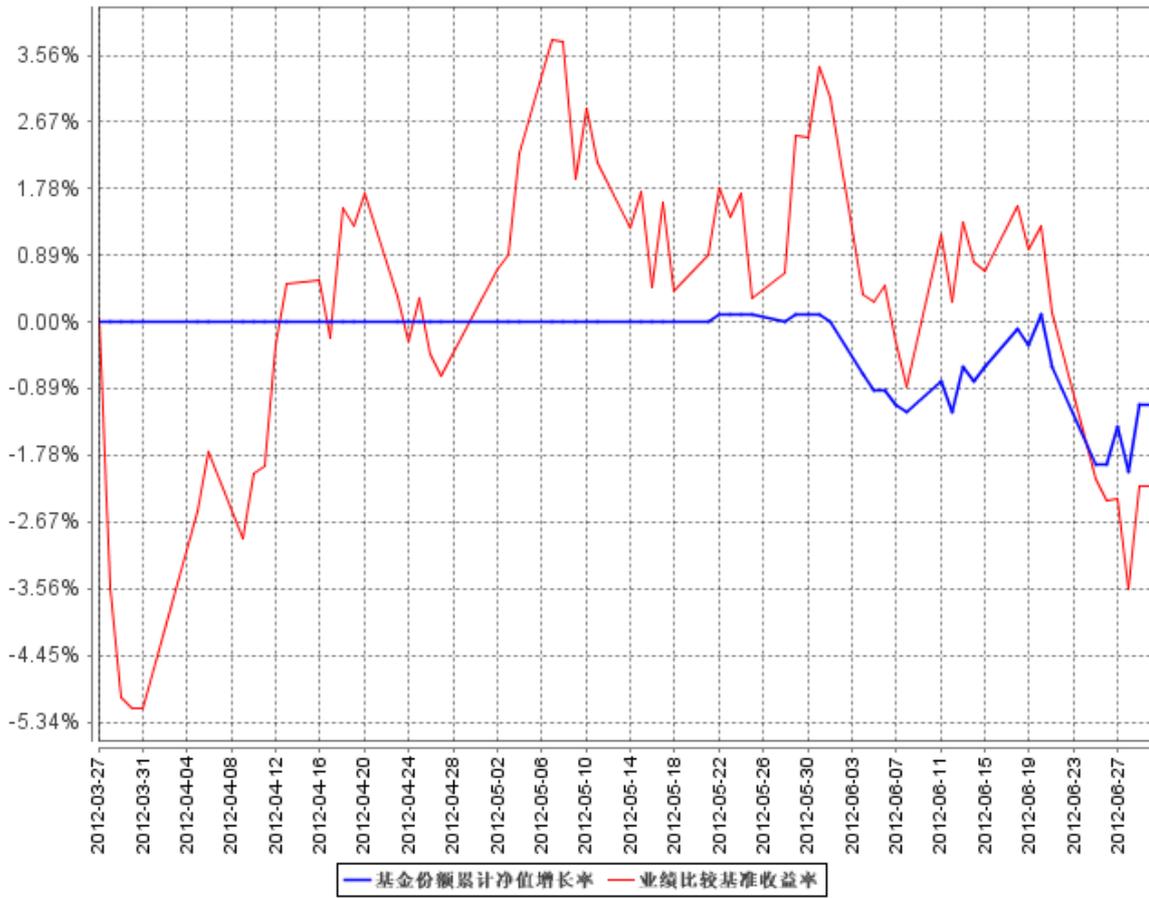
2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于电子信息产业的上市公司股票不低于股票类资产的 80%；债券投资占基金资产的 0%-40%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。

3、再平衡。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 80%、20%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。

3.2.2 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

(2012 年 3 月 27 日至 2012 年 6 月 30 日)

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 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%；新加坡星展银行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2012年6月30日，基金管理人共管理两支封闭式基金、十八支开放式基金，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。

4.1.2 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		
王克玉	本基金基金经理，同益证券投资基金基金经理。	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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 14 次，其中 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，其余 13 次交易为长盛同庆基金转型期间和其他组合发生的反向交易。具体原因如下：

长盛同庆于 2012 年 5 月 11 日结束三年封闭期，转型为开放式证券投资基金（以下简称“开放式基金”）。为确保转型后的开放式基金保持充裕流动性，以保障基金

份额持有人利益，该基金制定了数量化组合投资交易策略，并报经公司投资决策委员会批准，打开交易所公开竞价同日反向交易控制，因此而产生 13 笔交易所公开竞价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 5%的交易。

在此期间内，长盛同庆严格执行既定数量化组合投资交易策略，批量下达投资指令。公司交易部对上述指令进行严格审核，在指令分发后，通过恒生交易系统自动委托交易程序执行指令，以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平，杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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 报告期内行情回顾和本基金投资策略分析

2012 年上半年 A 股市场呈现宽幅震荡的行情。尽管上半年上证指数和沪深 300 指数的涨幅分别只有 1.18%和 4.94%，但是在三月中旬和 5 月上旬市场高点时，上证指数的涨幅达到 11.6%。上半年整体看，房地产、食品饮料、有色金属、医药、家电等行业表现领先，特别是房地产、食品饮料在二季度延续了前期的强劲走势，一季度表现优异的券商、家电在 6 月份之后出现明显的下跌。

本基金在一季度末成立后，主要从二季度开始正式运作。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

截至报告期末，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 -2.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

4.5.1 管理人对宏观经济和证券市场的展望

综合考虑经济发展的状况和社会运行的态势，2012 年仍处于明显的过渡阶段，出口和房地产为主的基建投资作为过去拉动中国经济增长的主要驱动力的影响将逐渐减弱，调整和转型成为社会发展的必然选择。

随着 5 月到 6 月各项经济数据的公布，经济增速的下滑已经从预期转为现实，这里既有中国经济过去高速增长过程中积累的长期矛盾，也有外部需求不足和政策不明

确带来的短期影响。从我们投资者的角度看，要适当降低对经济增速的预期，通过更加细致的研究分析企业模式和经营能力的差异。

4.5.2 本基金下阶段投资策略

随着经济基本面和政策预期不确定性的消除，预计下半年市场会表现出一定的机会。作为一支专注于投资电子信息产业上市公司的行业型基金，寻找成长型公司是我们投资的主要方向。电子信息行业作为经济转型的主要方向和重要工具，具有广阔的发展前景，具有核心产品能力和经营能力的公司将充分受益于这一过程。

初步判断下半年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。另外劳动力成本的集中上涨过程已经步入尾声，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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人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和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本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。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、投资管理部、金融工程及量化投资部、研究发展部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用

的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十九条中对基金利润分配原则的约定，2012 年上半年度未实施利润分配。

本基金截至 2012 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-2,528,372.46 元，未分配利润已实现部分为 52,118.70 元，未分配利润未实现部分为-2,580,491.16 元。

§ 5 托管人报告

5.1 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”）在长盛电子信息产业股票型证券投资基金（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。

5.2 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。

5.3 托管人对本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）、投资组合报告中的数据核对无误。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛电子信息产业股票型证券投资基金

报告截止日：2012年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年6月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	43,236,455.02
结算备付金		9,187,007.25
存出保证金		250,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	124,552,578.37
其中：股票投资		124,552,578.37
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	50,000,000.00
应收证券清算款		13,333.32
应收利息	6.4.7.5	30,246.90
应收股利		-
应收申购款		12,222.86
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		227,281,843.72
负 债 和 所 有 者 权 益		
	附注号	本期末 2012年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		539,035.64
应付管理人报酬		295,019.35
应付托管费		49,169.91

应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	107,536.23
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	341,174.20
负债合计		1,331,935.33
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	228,478,280.85
未分配利润	6.4.7.10	-2,528,372.46
所有者权益合计		225,949,908.39
负债和所有者权益总计		227,281,843.72

注：1、报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值：0.989 元，基金份额总额 228,478,280.85 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2012 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日，无上年度可比期间数据。

6.2 利润表

会计主体：长盛电子信息产业股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2012 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		-899,100.59
1. 利息收入		1,524,867.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	393,403.64
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,131,464.07
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		144,097.92
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	144,097.92

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,828,796.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	260,730.64
减：二、费用		1,846,267.81
1. 管理人报酬		1,390,166.27
2. 托管费		231,694.41
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	128,611.03
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	95,796.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,745,368.40
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,745,368.40

注：本财务报表的实际编制期间为 2012 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日止，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛电子信息产业股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 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）	436,879,183.47	-	436,879,183.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,745,368.40	-2,745,368.40
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）	-208,400,902.62	216,995.94	-208,183,906.68
其中：1. 基金申购款	402,085.27	-3,587.33	398,497.94
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-208,802,987.89	220,583.27	-208,582,404.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	228,478,280.85	-2,528,372.46	225,949,908.39

注：本财务报表的实际编制期间为 2012 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日止，无上年度可比期间数据。

后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。
本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周 兵

杨思乐

戴君棉

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛电子信息产业股票型证券投资基金(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[2012]第 194 号《关于同意长盛电子信息产业股票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《长盛电子信息产业股票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 436,781,526.34 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(2012)第 071 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 436,879,183.47 份基金份额,其中认购资金利息折合 97,657.13 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《长盛电子信息产业股票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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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%。本基金的业绩比较基准为:80%×中证信息技术指数收益率+20%×中证综合债指数收益率。

根据《长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资组合应在基金成立 6 个月内达到基金合同规定的比例限制。截至 2012 年 6 月 30 日止,本基金尚处于建仓期。

6.4.2 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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〉》、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》、《长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券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、买入返售金融资产和各类应收款项等。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包括卖出回购金融资产款和各类应付

款项等。

6.4.4.4 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；对于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，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。

对于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；对于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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。

6.4.4.8 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计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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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：

(a) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金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》，根据具体情况采用《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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明：本报告期不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明：本报告期不存在会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明：本报告期不存在差错更正。

6.4.6 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》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、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。

2、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。

3、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。

4、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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
活期存款	43,236,455.02
定期存款	-
其他存款	-
合计	43,236,455.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	127,381,375.23	124,552,578.37	-2,828,796.86
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	127,381,375.23	124,552,578.37	-2,828,796.86

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	50,000,000.00	-
银行间买入返售证券	-	-
合计	50,000,000.00	-

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	12,922.23
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	3,720.78
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	13,603.83
应收申购款利息	0.06
其他	-
合计	30,246.90

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	107,536.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	107,536.23

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	2,031.48
预提费用	89,142.72

合计	341,174.20
----	------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年3月27日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	436,879,183.47	436,879,183.47
本期申购	402,085.27	402,085.27
本期赎回（以“-”号填列）	-208,802,987.89	-208,802,987.89
本期末	228,478,280.85	228,478,280.85

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	83,428.46	-2,828,796.86	-2,745,368.40
本期基金份额交易产生的变动数	-31,309.76	248,305.70	216,995.94
其中：基金申购款	214.51	-3,801.84	-3,587.33
基金赎回款	-31,524.27	252,107.54	220,583.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,118.70	-2,580,491.16	-2,528,372.46

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月27日（基金合同生效日）至2012年6月30日
	活期存款利息收入
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	22,663.91
其他	78.83
合计	393,403.64

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本期未取得股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本期未取得债券投资收益。

6.4.2.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本期未取得衍生工具收益。

6.4.2.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年3月27日（基金合同生效日）至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	144,097.92
基金投资产生的股利收益	-
合计	144,097.92

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012年3月27日（基金合同生效日）至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,828,796.86
—股票投资	-2,828,796.86
—债券投资	-
—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	-2,828,796.86

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012年3月27日（基金合同生效日）至2012年6月30日
基金赎回费收入	257,855.39
基金转换费收入	2,875.25
印花税返还收入	-
其他	-
合计	260,730.64

注：基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年3月27日（基金合同生效日）至2012年6月30日
交易所市场交易费用	128,611.03
银行间市场交易费用	-
合计	128,611.03

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年3月27日（基金合同生效日）至2012年6月30日
审计费用	17,142.72
信息披露费	72,000.00
银行手续费	5,753.38
其他费用	900.00
合计	95,796.10

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

本报告期内，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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金”）	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
国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金无关联方交易单元，未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2012年3月27日（基金合同生效日）至 2012年6月30日
当期应支付的管理费	1,390,166.27
其中：支付销售机构的客户维护费	590,558.21

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2012年3月27日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
当期应支付的托管费	231,694.41	

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易：

本基金本期无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本期未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方本期未投资本基金。

6.4.10.5 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	本期	
	2012年3月27日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	期末金额	当期利息收入
中国银行	43,236,455.02	370,660.90

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有“暂时停牌而于期末持有的流通受限证券”。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资等。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“风险和收益相匹配”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。

6.4.13.2 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%。

6.4.13.3 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 6.4.12 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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

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 2012年6月30日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	43,236,455.02	-	-	-	43,236,455.02
结算备付金	9,187,007.25	-	-	-	9,187,007.25
存出保证金	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	-	-	-	124,552,578.37	124,552,578.37
买入返售金融资产	50,000,000.00			-	50,000,000.00
应收利息	-	-	-	30,246.90	30,246.90
应收申购款	-	-	-	12,222.86	12,222.86
应收证券清算款				13,333.32	13,333.32
资产总计	102,423,462.27	-	-	124,858,381.45	227,281,843.72

负债				-	
应付赎回款	-	-	-	539,035.64	539,035.64
应付管理人报酬	-	-	-	295,019.35	295,019.35
应付托管费	-	-	-	49,169.91	49,169.91
应付交易费用	-	-	-	107,536.23	107,536.23
其他负债	-	-	-	341,174.20	341,174.20
负债总计	-	-	-	1,331,935.33	1,331,935.33
利率敏感度缺口	102,423,462.27	-	-	123,526,446.12	225,949,908.39

注：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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2012年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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%。于 2012 年 6 月 30 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 2012 年 6 月 30 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	124, 552, 578. 37	55. 12
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	124, 552, 578. 37	55. 12

6. 4. 8. 4. 3. 2 其他价格风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日，本基金运营不满一年，无足够历史数据分析其他价格风险敏感性。

6. 4. 14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 124, 552, 578. 37 元，无属于第二、第三层级的余额。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额
无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	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

7.2 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	-	-
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

7.3 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	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
11	600563	法拉电子	371,060	5,662,375.60	2.51
12	002400	省广股份	286,977	5,495,609.55	2.43
13	600460	士兰微	1,222,423	5,403,109.66	2.39
14	002583	海能达	300,340	5,279,977.20	2.34
15	002484	江海股份	440,620	4,798,351.80	2.12
16	300219	鸿利光电	465,908	4,565,898.40	2.02
17	002449	国星光电	431,166	3,582,989.46	1.59
18	300017	网宿科技	212,390	3,461,957.00	1.53
19	600570	恒生电子	248,156	3,404,700.32	1.51
20	002073	软控股份	399,892	3,351,094.96	1.48
21	300177	中海达	303,400	3,297,958.00	1.46
22	300223	北京君正	202,410	3,192,005.70	1.41
23	300188	美亚柏科	111,634	2,604,421.22	1.15
24	300136	信维通信	134,287	2,162,020.70	0.96
25	002396	星网锐捷	144,200	2,160,116.00	0.96
26	300207	欣旺达	82,599	1,161,341.94	0.51

27	002376	新北洋	23,400	452,088.00	0.20
----	--------	-----	--------	------------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600271	航天信息	9,686,859.10	4.29
2	002465	海格通信	6,710,577.46	2.97
3	002179	中航光电	6,364,181.65	2.82
4	600718	东软集团	6,337,890.05	2.80
5	002368	太极股份	6,311,054.82	2.79
6	600460	士兰微	6,190,631.53	2.74
7	002185	华天科技	6,111,446.87	2.70
8	600563	法拉电子	6,072,978.36	2.69
9	002138	顺络电子	5,890,707.84	2.61
10	002439	启明星辰	5,716,376.21	2.53
11	300182	捷成股份	5,710,174.09	2.53
12	002484	江海股份	5,435,811.09	2.41
13	300302	同有科技	5,425,781.27	2.40
14	002400	省广股份	4,972,323.14	2.20
15	002583	海能达	4,951,978.84	2.19
16	300219	鸿利光电	4,889,676.62	2.16
17	002073	软控股份	4,714,351.96	2.09
18	002449	国星光电	3,721,647.72	1.65
19	600570	恒生电子	3,506,617.04	1.55
20	300223	北京君正	3,249,059.10	1.44

7.4.2 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

本基金本报告期末未卖出股票。

7.4.3 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	127,381,375.23
卖出股票收入（成交）总额	-

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 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。

7.5 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。

7.6 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明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	13,333.32
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	-
9	合计	305,803.08

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
3,831	59,639.33	5,668,124.63	2.48%	222,810,156.22	97.52%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	-	-

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0 万份。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0 万份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年3月27日）基金份额总额	436,879,183.47
本报告期基金总申购份额	402,085.27
减：本报告期基金总赎回份额	208,802,987.89
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	228,478,280.85

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本报告期本基金管理人的高级管理人员未曾变动。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票和债券交易的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		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	成交金额	占当期债券成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
平安证券	1	95,586,399.15	75.04%	-	-	80,141.29	74.52%
国金证券	1	31,794,976.08	24.96%	-	-	27,394.94	25.48%

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行债券回购交易的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券回购交易
------	--------	--------

		成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国金证券	1	3,980,000,000.00	100.00%
平安证券	1	-	-

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

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
----	--------	----------	----

1	国金证券	上海	1
2	平安证券	深圳	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

10.8 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	关于增加中国国际金融有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2012-6-29
2	关于增加国金证券为旗下开放式基金代销机构的公告	同上	2012-6-29
3	关于增加华龙证券为旗下开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务的公告	同上	2012-6-29
4	长盛基金管理有限公司关于增加众禄基金为旗下部分基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2012-6-13
5	长盛基金管理有限公司关于增加诺亚正行为旗下部分基金代销机构并推出定期定额投资业务的公告	同上	2012-6-11
6	关于长盛电子信息产业股票型基金参加中国农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2012-5-22
7	关于长盛电子信息产业股票型基金开通部分银行定投业务及参与部分银行网上交易申购费率优惠活动的公告	同上	2012-5-18
8	关于长盛电子信息产业股票型基金参与部分代销机构申购费率优惠及定期定额投资业务活动的公告	同上	2012-5-18
9	长盛电子信息产业股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	同上	2012-5-15
10	关于增加红塔证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务的公告	同上	2012-4-20
11	长盛基金管理有限公司上海分公司注册地址及负责人变更的公告	同上	2012-4-17
12	长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同生效公告	同上	2012-3-28

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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>。