

长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

2011 年年度报告

2011 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

送出日期：2012 年 3 月 28 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 3 月 27 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。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 12 月 31 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	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4	管理人报告	11
4.1	基金管理人及基金经理情况	11
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
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	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
§ 5	托管人报告	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6	审计报告	18
6.1	审计报告基本信息	18

6.2 审计报告的基本内容 .....	18
§ 7 年度财务报表 .....	19
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	20
7.3 所有者权益(基金净值)变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	22
§ 8 投资组合报告 .....	45
8.1 期末基金资产组合情况 .....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	45
8.3 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 .....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49
8.6 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投资明细 ..	49
8.7 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投资明 细 .....	49
8.8 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 ..	49
8.9 投资组合报告附注 .....	49
§ 9 基金份额持有人信息 .....	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	51
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 .....	51
§ 10 开放式基金份额变动 .....	52
§ 11 重大事件揭示 .....	53
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
11.2 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 .....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
11.4 基金投资策略的改变 .....	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所的情况 .....	53
11.6 基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	53

11.7 基金租用证券公司专用交易单元的有关情况 .....	54
11.8 其他重大事件 .....	56
§ 12 备查文件目录 .....	57
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	长盛同智优势混合（LOF）
基金主代码	160805
交易代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1月5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	2,556,640,149.91份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007年2月16日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司，所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	本基金为混合型基金，根据对宏观经济、行业状况、公司成长性及资本市场的判断，综合评价各类资产的风险收益水平，对各类资产采取适度灵活的资产配置。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益—较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。

### 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 负责人	姓名	叶金松	唐州徽
	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址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
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东城区东长安街 1 号东方广场 安永大楼（东三办公楼）16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-78,150,361.01	271,375,789.46	52,619,618.90
本期利润	-649,866,410.07	2,474,894.15	1,467,411,081.35
加权平均基金份额本期利润	-0.2444	0.0008	0.3860
本期加权平均净值利润率	-27.02%	0.08%	44.40%
本期基金份额净值增长率	-24.81%	0.47%	57.15%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-634,093,654.55	14,883,996.44	78,464,304.73
期末可供分配基金份额利润	-0.2480	0.0053	0.0235
期末基金资产净值	1,922,546,495.36	2,837,661,250.01	3,421,194,737.65
期末基金份额净值	0.7520	1.0053	1.0235
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	36.86%	82.01%	81.15%

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 12 月 31 日。

4、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 日。

### 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
过去三个月	-7.70%	1.17%	-5.51%	0.91%	-2.19%	0.26%
过去六个月	-18.32%	1.10%	-14.72%	0.88%	-3.60%	0.22%
过去一年	-24.81%	1.05%	-15.53%	0.84%	-9.28%	0.21%
过去三年	18.72%	1.30%	24.32%	1.09%	-5.60%	0.21%
自基金转型日起至今	36.86%	1.65%	22.75%	1.40%	14.11%	0.25%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益



率×30%+一年定期存款利率×5%。

基准指数的构建考虑了三个原则：

1、公允性。选择市场认同度比较高的沪深 300 指数和上证国债指数作为计算的基础指数。

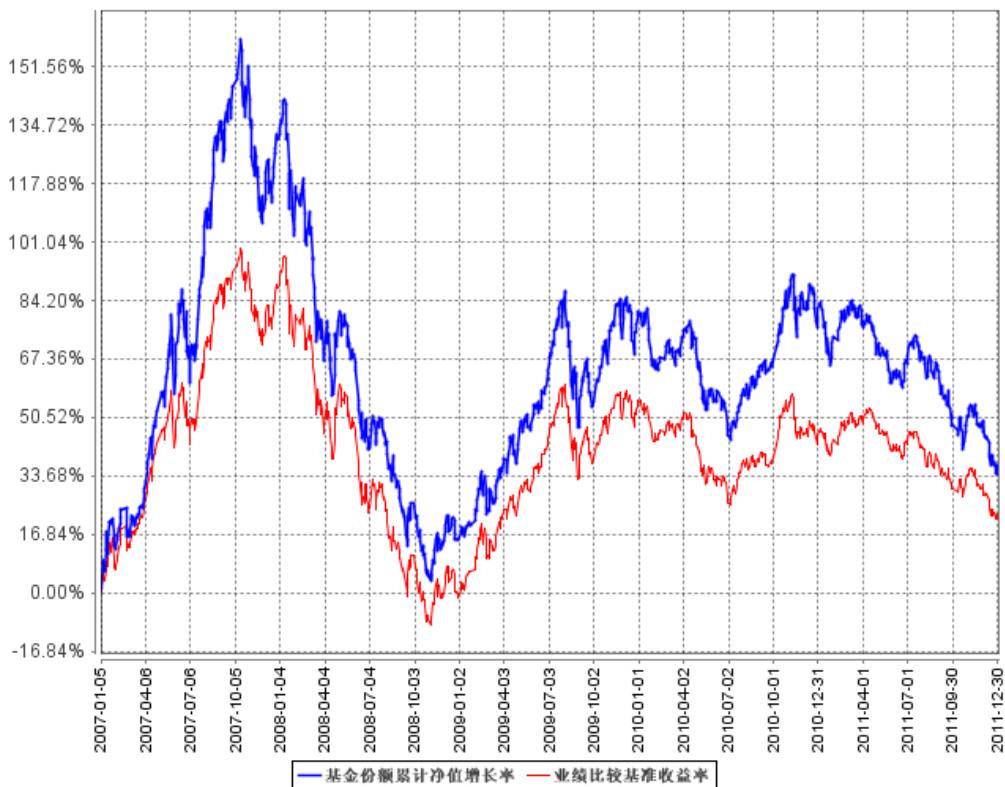
2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金持有的股票投资占基金资产的比例范围为 30%—95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0—3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0—65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。

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 65%、30%、5%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 自基金转型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

(2007 年 1 月 5 日至 2011 年 12 月 31 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

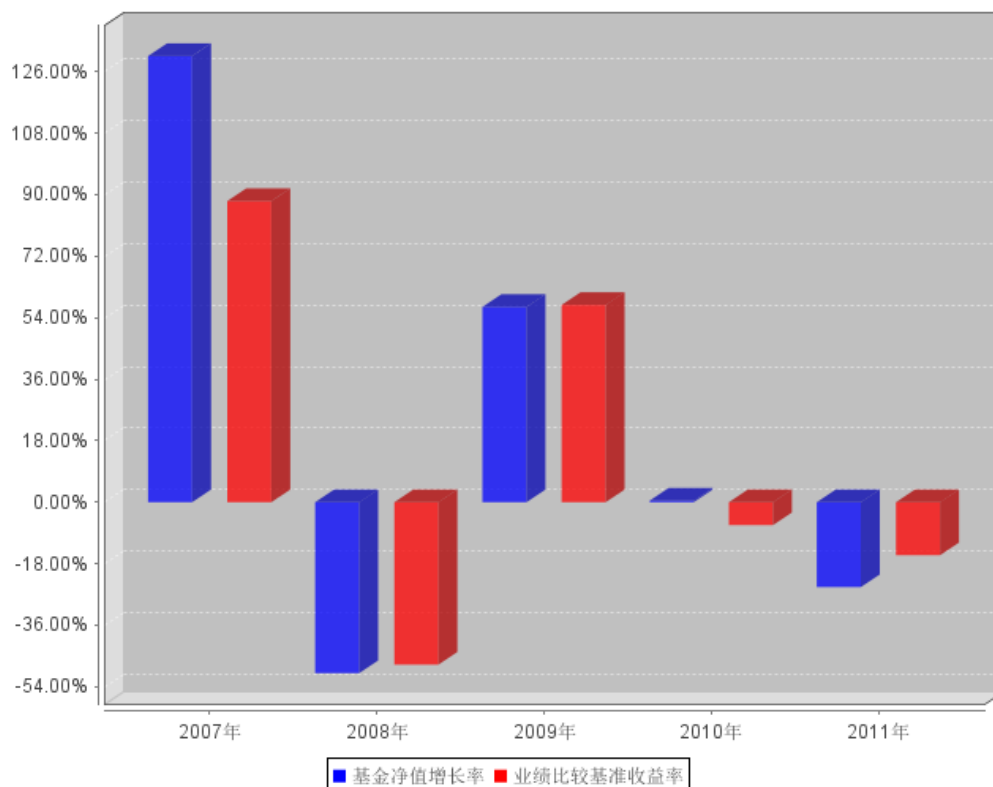


注：1、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 日。

2、按基金合同规定，本基金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。截至报告日，长盛同智优势混合（LOF）的各项投资比例已达到本基金合同第十五条（二）投资范围、（六）投资限制的有关约定。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2007 年 1 月 5 日转型，转型当年按实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011 年	0.050	7,415,122.41	6,634,918.83	14,050,041.24	场外除息日： 2011-1-17 场内除息日： 2011-1-18
2010 年	0.230	40,020,612.68	35,696,146.06	75,716,758.74	场外除息日： 2010-1-20 场内除息日： 2010-1-21
2009 年	-	-	-	-	2009 年度未分配收益
合计	0.280	47,435,735.09	42,331,064.89	89,766,799.98	

注：本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 日。

## § 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2011年12月31日，基金管理人共管理两支封闭式基金、十七支开放式基金，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 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁骏	本基金基金经理，同盛证券投资基金基金经理。	2007年2月27日	—	10年	男，1974年11月出生，中国国籍。中国社会科学院经济学博士。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师；国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理；2003年6月加入长盛基金管理有限公司，先后担任行业研究员、组合经理助理。现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金（本基金）基金经理，同盛证券投资基金基金经理。

注：1、上表基金经理及基金经理助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

盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）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，在认真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**

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 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 报告期内基金投资策略和运作分析**

整个 2011 年 A 股市场表现不佳。年初到 4 月份反弹相对较强，随后就一路下跌。中间只有 6 月和 10 月两次弱反弹，回头看都是卖出的机会。从行业表现看，食品饮料等防御性行业走势较好，其中中高端白酒行业在靓丽业绩的支撑下表现最好。煤炭行业在前三季度一直也处在龙头地位，然而到第 4 季度，市场出于对煤价的担心和落袋为安的心态，煤炭行业股价短时间内下跌了将近 50%，对周期类投资类股票的杀伤力极大。另外值得一提的是，中小板创业板股票大幅挤压泡沫。在新股发行制度改革启动的信号下，年末最后一个半月小盘股开始大幅杀跌，力度也是历史少见。

我们根据一贯的投资理念和市场判断对基金投资组合进行了结构性调整：第一、经济结构转型已经正式进入启动阶段，传统人力密集型和资源消耗型的行业和企业将难以为继，保持我国宏观经济健康发展的希望在于技术含量较高的高端装备、与国际技术水平基本处于同一起跑线的新能源及提高装备现代化背景下的军工行业等；第二、结构升级需要相应的配套政策支持，管理层结合政经大环境逐步推出相应的产业指导政策和行业支持政策，也是指明部分投资机会的方向。例如，资源类上市公司的

行业整合政策对资源价格、行业结构产生了极其显著的影响。第三、继续综合考虑上市公司业绩预期（宏观经济转型及波动背景下未来业绩的确定性）和考虑资金松紧水平及变化趋势背景下的相对估值水平等方面。

2011年初的两个事件对我们的操作形成较大的负面影响：原铁道部长刘志军的落马和日本大地震海啸并导致的核电站事故。这两个事件分别导致了市场对以高铁概念股和核电概念股为代表的机械股的抛售。我们理解市场的逻辑，但是我们认为高铁是我国在“市场换技术”的策略下，引入技术加以消化吸收并进一步自主创新的成功案例，对比汽车和飞机等行业，这是我们能够自主生产并有望走出国门走入发达市场的一个先进技术产业。令人遗憾的是随后再次发生温州动车组追尾事故，导致了重大的生命财产损失。当时，在事故责任结论落实之前，市场出于对铁路运营效率的失望和高铁建设进度推迟的担心，再次对高铁股进行了抛售。铁路运营是复杂的系统工程，我们企望铁路部门能够从这次代价高昂的血的教训中吸取经验教训，切实提高高速列车运行的安全性和稳定性。

总结起来看，由于自身机械的理解价值投资理念，以及对行业政策精神的把握发生偏差，组合未能及时灵活的根据市场实际情况调整减持高铁和核电股，对组合净值造成了较大的不利影响，也影响了组合的全年业绩表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 0.7520 元，本报告期份额净值增长率为 -24.81%，同期业绩比较基准增长率为 -15.53%。

#### 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

在 2011 年 3 季度展望中，我们指出“国际经济表现出的“二次探底”迹象恶化了投资人对未来的预期，对国内市场也产生了直接和间接的影响。虽然通胀形势并不好，但是货币当局从经济情况整体考虑出发，不愿采取货币价格手段，名义利率一直维持在不算高的位置。相应的，货币数量手段层出不穷。这里就有一个政策效果的结构性承受问题。资金资源减少，大型国企（包括部分垄断型资源型企业）的获取资金能力和优势凸显出来，被市场寄予厚望的、被市场认为活力最强的中小民营企业压力剧增，一方面外部需求持续萎靡，另一方面内部资金紧缺、成本上升。经济调整的板子更多的打在了中小民营企业的身上，……我们认为类似于前次“4 万亿”的刺激政策将不可能重现，那么，新的局部范围的政策将是在目前经济筑底阶段指引市场投资方向的重要参考”。

在 2011 年 4 季度展望中，我们的观点是“目前市场的焦点在于经济中期增长率的下滑、经济推动因素的缺失和股市超跌的矛盾。我们希望在股市极度恐慌的时候，政府能够给予信心上的支持。股市的反弹就有较大的希望，但是，在 1-2 季度内，上市公司业绩乏力的情况会随着年报和季报的披露而显现出来。市场恐怕还是会在震荡中前进。”

我们判断市场 2012 年上半年仍然保持震荡筑底盘升的局面。一方面我们要尽力把握波段性投资机会，另一方面也要选择配置素质优秀的个股坚决持有。我们将通过对组合的动态调整来获取超额收益。近期本组合关注的要点是紧密跟踪周期行业的产品价格走势、产能利用率变化等，关注已经下降幅度较大、时间较长的部分估值趋于合理的中小盘成长股。在整个 2012 年，我们要继续紧密跟踪及预判通胀形势的变化，控制仓位，关注具备长期投资价值价值股和进入合理估值区间的成长股，从风格主题上看，包括但不限于：经济结构转型带来的产业升级概念股、科技创新类股票的投资机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作，保障基金持有人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

1、继续加大合规培训力度，采取多样化的方式对员工进行合规培训，特别加强了对投资、研究及销售人员的合规培训，深化员工合规意识。

2、结合新法规、新监管要求，以及公司新业务的发展，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，以保证公司内控制度的合法合规、全面、适时、有效。

3、紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司制度规定，全面掌控基金投资运作风险点，以前述风险点为依据，时时检查、监督各基金投资运作，加强对基金投资交易的风险控制及合规检查。

4、采用定期与不定期相结合的稽核、检查方式，推进公司内部控制制度的落实。报告期内，公司监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核工作，内容涵盖基金投资、研究、交易、销售、基金估值、登记注册、公司财务、产品开发等等；此外，公

司监察稽核部根据业务发展需要，以及日常监督、检查中发现问题，随时增加了多项的检查、稽核项目。针对发现问题，监察稽核部要求相关业务部门限期改进，并就改进情况进行检查验收。

5、继续加强对员工个人行为合规性的检查监督。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障基金份额持有人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、基金合规运作。

#### 4.7 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副总经理（担任估值小组组长）、督察长（担任估值小组组长）及投资管理部、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。

#### 4.8 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二十条中对基



金利润分配原则的约定，本基金于 2011 年 1 月 17 日对 2010 年度收益进行了利润分配，分配金额为 14,050,041.24 元。

本基金截至 2011 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为-634,093,654.55 元，其中，未分配利润已实现部分为 469,085,002.07 元，未分配利润未实现部分为 -1,103,178,656.62 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”）在对长盛同智优势成长混合型证券投资基金（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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明 (2012) 审字第 60468688_A04 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	长盛同智优势成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的长盛同智优势成长混合型证券投资基金财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表和 2011 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人长盛基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长盛同智优势成长混合型证券投资基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	李慧民	王珊珊
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所	
会计师事务所的地址	中国 · 北京	
审计报告日期	2012 年 3 月 20 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2011年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	464,985,011.25	620,363,130.07
结算备付金		2,035,504.58	4,245,960.73
存出保证金		1,388,549.12	1,638,549.12
交易性金融资产	7.4.7.2	1,464,978,787.23	2,218,778,576.05
其中：股票投资		1,464,978,787.23	2,210,999,057.05
债券投资		-	7,779,519.00
基金投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,335,880.78	9,625,531.70
应收利息	7.4.7.5	99,408.20	137,127.09
应收股利		-	-
应收申购款		1,383.40	82,354.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,935,824,524.56</b>	<b>2,854,871,228.98</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年12月31日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,284,942.72	-
应付赎回款		396,236.80	6,741,902.07
应付管理人报酬		2,530,150.46	3,689,997.13
应付托管费		421,691.75	614,999.53
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,290,223.25	3,805,380.18
应付税费		305,932.19	305,932.19

应付利息		-	-
应付利润		428,798.09	428,798.09
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,620,053.94	1,622,969.78
<b>负债合计</b>		<b>13,278,029.20</b>	<b>17,209,978.97</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	2,556,640,149.91	2,822,777,253.57
未分配利润	7.4.7.10	-634,093,654.55	14,883,996.44
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,922,546,495.36</b>	<b>2,837,661,250.01</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,935,824,524.56</b>	<b>2,854,871,228.98</b>

注：报告截止日2011年12月31日，基金份额净值：0.7520元，基金份额总额2,556,640,149.91份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>-600,614,508.47</b>	<b>70,188,054.50</b>
1. 利息收入		4,955,111.71	6,353,563.13
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,481,872.37	6,098,462.40
债券利息收入		1,731.94	8,876.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		471,507.40	246,224.51
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-33,899,543.01	332,630,515.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-49,265,125.64	320,256,234.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,036,037.94	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	14,329,544.69	12,374,281.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	7.4.7.16	-571,716,049.06	-268,900,895.31
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	7.4.7.17	45,971.89	104,870.74
<b>减：二、费用</b>		<b>49,251,901.60</b>	<b>67,713,160.35</b>
1. 管理人报酬		36,179,988.61	44,277,128.64

2. 托管费		6,029,998.12	7,379,521.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	6,576,370.71	15,596,573.99
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	465,544.16	459,936.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-649,866,410.07</b>	<b>2,474,894.15</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-649,866,410.07</b>	<b>2,474,894.15</b>

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年12月31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）	2,822,777,253.57	14,883,996.44	2,837,661,250.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-649,866,410.07	-649,866,410.07
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）	-266,137,103.66	14,938,800.32	-251,198,303.34
其中：1. 基金申购款	34,695,446.12	-2,920,604.45	31,774,841.67
2. 基金赎回款	-300,832,549.78	17,859,404.77	-282,973,145.01
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）	-	-14,050,041.24	-14,050,041.24
<b>五、期末所有者权益（基金净值）</b>	<b>2,556,640,149.91</b>	<b>-634,093,654.55</b>	<b>1,922,546,495.36</b>
项 目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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）	3,342,730,432.92	78,464,304.73	3,421,194,737.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,474,894.15	2,474,894.15
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）	-519,953,179.35	9,661,556.30	-510,291,623.05
其中：1. 基金申购款	87,249,924.62	-4,035,737.57	83,214,187.05

2. 基金赎回款	-607,203,103.97	13,697,293.87	-593,505,810.10
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）	-	-75,716,758.74	-75,716,758.74
<b>五、期末所有者权益（基金净值）</b>	<b>2,822,777,253.57</b>	<b>14,883,996.44</b>	<b>2,837,661,250.01</b>

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

周 兵

杨 思 乐

戴 君 棉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛同智优势成长混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2006]260号文《关于核准同智证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》的核准，由封闭式基金同智证券投资基金转型而成，自2007年1月5日起，《长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金于2007年1月22日（“转换基准日”）的基金净值为人民币955,116,003.53元，于2007年1月23日（“转换日”）折合基金份额955,116,000.00份。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券，权证以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资占基金资产的比例范围为30%-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%；债券投资占基金资产的比例范围为0-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在5%以上。本基金将不低于80%的股票资产投资于具有较大成长潜力的上市公司的股票。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准是：沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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于 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

##### 1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括



股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

## 2、金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

## 1、股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

## 2、债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

## 3、权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

## 4、分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述 2、3 中相关原则进行计算；

## 5、回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如

下：

## 1、股票投资

### (1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

### (2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

### C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的首次取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的首次取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

## 2、债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价

不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的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，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

### 3、权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

### 4、分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2、3 中的相关原则进行估值；

### 5、其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

3、资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

4、买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利

率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

5、股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

6、债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

7、衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

9、公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

10、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

1、基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

3、卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以使用合同利率）在实际持有期间内逐日计提；

4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式。场外基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；场内基金份额的分红方式为现金红利；

2、每一基金份额享有同等分配权；

3、基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值；

5、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

6、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 4 次；

7、全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的 50%。基金合同生效不满三个月，收益可不分配；

8、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

##### 2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

### 3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	464,985,011.25	620,363,130.07
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	464,985,011.25	620,363,130.07



#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,664,691,324.17	1,464,978,787.23	-199,712,536.94
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		1,664,691,324.17	1,464,978,787.23	-199,712,536.94
项目		上年度末 2010年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,840,190,063.93	2,210,999,057.05	370,808,993.12
债券	交易所市场	6,585,000.00	7,779,519.00	1,194,519.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	6,585,000.00	7,779,519.00	1,194,519.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,846,775,063.93	2,218,778,576.05	372,003,512.12

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	98,429.44	126,716.36
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	916.00	1,486.10
应收债券利息	-	8,876.22
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.46	0.01

其他	62.30	48.40
合计	99,408.20	137,127.09

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,290,028.25	3,805,380.18
银行间市场应付交易费用	195.00	-
合计	1,290,223.25	3,805,380.18

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	1,250,000.00	1,500,000.00
应付赎回费	53.94	22,421.82
预提审计费	100,000.00	100,547.96
预提信息披露费	270,000.00	-
合计	1,620,053.94	1,622,969.78

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,822,777,253.57	2,822,777,253.57
本期申购	34,695,446.12	34,695,446.12
本期赎回（以“-”号填列）	-300,832,549.78	-300,832,549.78
本期末	2,556,640,149.91	2,556,640,149.91

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	622,700,375.38	-607,816,378.94	14,883,996.44
本期利润	-78,150,361.01	-571,716,049.06	-649,866,410.07
本期基金份额交易产生的变动数	-61,414,971.06	76,353,771.38	14,938,800.32

其中:基金申购款	7,903,314.87	-10,823,919.32	-2,920,604.45
基金赎回款	-69,318,285.93	87,177,690.70	17,859,404.77
本期已分配利润	-14,050,041.24	-	-14,050,041.24
本期末	469,085,002.07	-1,103,178,656.62	-634,093,654.55

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
活期存款利息收入	4,444,787.64	6,033,790.07
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	34,891.53	62,887.43
其他	2,193.20	1,784.90
合计	4,481,872.37	6,098,462.40

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
卖出股票成交总额	2,243,091,984.42	5,396,993,098.31
减:卖出股票成本总额	2,292,357,110.06	5,076,736,863.37
买卖股票差价收入	-49,265,125.64	320,256,234.94

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖基金差价收入。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	7,631,646.10	-
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	6,585,000.00	-
减:应收利息总额	10,608.16	-
债券投资收益	1,036,037.94	-

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖衍生工具差价收入。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	14,329,544.69	12,374,281.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	14,329,544.69	12,374,281.00

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
1. 交易性金融资产	-571,716,049.06	-268,900,895.31
——股票投资	-570,521,530.06	-270,095,414.31
——债券投资	-1,194,519.00	1,194,519.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
合计	-571,716,049.06	-268,900,895.31

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
基金赎回费收入	45,971.89	103,992.14
印花税手续费返还	-	878.60
合计	45,971.89	104,870.74

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
交易所市场交易费用	6,576,370.71	15,596,573.99
银行间市场交易费用	-	-
合计	6,576,370.71	15,596,573.99

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
审计费用	99,452.04	100,000.00
信息披露费	270,000.00	270,000.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
汇划手续费	18,092.12	11,936.39
其他	-	-
合计	465,544.16	459,936.39

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、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（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人的股东

##### 7.4.9.2 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	基金管理人、基金销售机构
中国银行	基金托管人、基金代销机构
国元证券	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国元证券	145,365,437.52	3.40%	3,963,019,045.45	39.72%

###### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.3 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金总额的比例
国元证券	118,110.06	3.30%	118,110.06	9.16%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金总额的比例
国元证券	3,346,040.89	40.10%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	36,179,988.61	44,277,128.64
其中：支付销售机构的客户维护费	5,828,589.49	7,029,642.74

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金托管人于次月首日起十个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,029,998.12	7,379,521.33

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,基金托管人于次月首日起十个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易：

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方进行银行间同业市场的债券交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至 2011年12月31日	2010年1月1日至 2010年12月31日
期初持有基金份额	62,276,368.00	62,276,368.00
期间申购/买入总份额(注)	-	-
期间因拆分变动的份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有基金份额	62,276,368.00	62,276,368.00
期末持有的基金份额占基金总份 额比例	2.44%	2.21%

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

##### 7.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

##### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年12月31日		2010年1月1日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	464,985,011.25	4,444,787.64	620,363,130.07	6,033,790.07

##### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登 记日	除息日		每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备 注
		场内	场外					
1	2011/1/17	2011/1/18	2011/1/17	0.050	7,415,122.41	6,634,918.83	14,050,041.24	-
合计				0.050	7,415,122.41	6,634,918.83	14,050,041.24	-

##### 7.4.12 期末(2011年12月31日)本基金持有的流通受限证券

###### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券



本基金本期末未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

#### **7.4.12.2 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等流通受限股票。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人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。

#### **7.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.3 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。

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，并且本基金资产不存在流通暂时受限制不能自由转让的情况，因此均能及时变现。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

过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出权证保证金及债券投资等。

下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年12月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	464,985,011.25	-	-	-	-	-	464,985,011.25
结算备付金	2,035,504.58	-	-	-	-	-	2,035,504.58
存出保证金	138,549.12	-	-	-	-	1,250,000.00	1,388,549.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,464,978,787.23	1,464,978,787.23
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,335,880.78	2,335,880.78
应收利息	-	-	-	-	-	99,408.20	99,408.20
应收申购款	-	-	-	-	-	1,383.40	1,383.40
<b>资产总计</b>	<b>467,159,064.95</b>	-	-	-	-	<b>1,468,665,459.61</b>	<b>1,935,824,524.56</b>
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6,284,942.72	6,284,942.72
应付赎回款	-	-	-	-	-	396,236.80	396,236.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,530,150.46	2,530,150.46
应付托管费	-	-	-	-	-	421,691.75	421,691.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,290,223.25	1,290,223.25
应交税费	-	-	-	-	-	305,932.19	305,932.19

应付利润	-	-	-	-	-	428,798.09	428,798.09
其他负债	-	-	-	-	-	1,620,053.94	1,620,053.94
<b>负债总计</b>	-	-	-	-	-	<b>13,278,029.20</b>	<b>13,278,029.20</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>467,159,064.95</b>	-	-	-	-	<b>1,455,387,430.41</b>	<b>1,922,546,495.36</b>
<b>上年度末 2010年12月31日</b>	<b>1个月以内</b>	<b>1-3个月</b>	<b>3个月-1年</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产							
银行存款	620,363,130.07	-	-	-	-	-	620,363,130.07
结算备付金	4,245,960.73	-	-	-	-	-	4,245,960.73
存出保证金	138,549.12	-	-	-	-	1,500,000.00	1,638,549.12
交易性金融资产	-	-7,779,519.00	-	-	-	2,210,999,057.05	2,218,778,576.05
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,625,531.70	9,625,531.70
应收利息	-	-	-	-	-	137,127.09	137,127.09
应收申购款	-	-	-	-	-	82,354.22	82,354.22
<b>资产总计</b>	<b>624,747,639.92</b>	<b>-7,779,519.00</b>	-	-	-	<b>2,222,344,070.06</b>	<b>2,854,871,228.98</b>
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,741,902.07	6,741,902.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,689,997.13	3,689,997.13
应付托管费	-	-	-	-	-	614,999.53	614,999.53
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,805,380.18	3,805,380.18
应交税费	-	-	-	-	-	305,932.19	305,932.19
应付利润	-	-	-	-	-	428,798.09	428,798.09
其他负债	-	-	-	-	-	1,622,969.78	1,622,969.78
<b>负债总计</b>	-	-	-	-	-	<b>17,209,978.97</b>	<b>17,209,978.97</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>624,747,639.92</b>	<b>-7,779,519.00</b>	-	-	-	<b>2,205,134,091.09</b>	<b>2,837,661,250.01</b>

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2011年12月31日，本基金未持有固定收益类资产，2010年12月31日，本基金持有的固定收益类资产全部为可转换债券，因此在利率发生的合理、可能的变动幅度为25个基点而其他变量保持不变时，则本基金资产净值在2011年12月31日和2010年12月31日均不会发生重大变动。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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，所面临的重大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合

的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中，股票投资占基金资产的比例范围为 30%-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。于 2011 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,464,978,787.23	76.20	2,210,999,057.05	77.92
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,464,978,787.23	76.20	2,210,999,057.05	77.92

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

假设	(1) 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	(2) 用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
(3) Beta 系数是根据组合在过去一年的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	+5%	81,411,152.63	139,885,348.98
	-5%	-81,411,152.63	-139,885,348.98

#### **7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### **7.4.14.1 承诺事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### **7.4.14.2 其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### **7.4.14.3 财务报表的批准**

本财务报表已于2012年3月20日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	1,464,978,787.23	75.68
	其中：股票	1,464,978,787.23	75.68
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	467,020,515.83	24.13
6	其他资产	3,825,221.50	0.20
7	合计	1,935,824,524.56	100.00

### 8.2 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	41,445,182.25	2.16
B	采掘业	87,100,346.90	4.53
C	制造业	809,433,934.21	42.10
C0	食品、饮料	192,652,474.70	10.02
C1	纺织、服装、皮毛	20,837,442.32	1.08
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	114,871,852.39	5.97
C5	电子	7,274,672.32	0.38
C6	金属、非金属	24,408,179.26	1.27
C7	机械、设备、仪表	373,308,976.12	19.42
C8	医药、生物制品	76,080,337.10	3.96
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,156,864.04	0.58
E	建筑业	35,214,938.38	1.83
F	交通运输、仓储业	84,487,074.48	4.39
G	信息技术业	10,124,034.85	0.53
H	批发和零售贸易	56,267,828.05	2.93
I	金融、保险业	194,307,388.90	10.11
J	房地产业	106,190,412.73	5.52

K	社会服务业	29,250,782.44	1.52
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,464,978,787.23	76.20

### 8.3 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	600036	招商银行	13,942,167	165,493,522.29	8.61
2	600518	康美药业	6,559,055	73,592,597.10	3.83
3	600009	上海机场	5,068,647	62,040,239.28	3.23
4	600519	贵州茅台	318,974	61,657,674.20	3.21
5	000858	五粮液	1,749,942	57,398,097.60	2.99
6	601766	中国南车	13,217,611	57,232,255.63	2.98
7	000895	双汇发展	737,716	51,603,234.20	2.68
8	000581	威孚高科	1,369,927	49,166,680.03	2.56
9	600582	天地科技	2,285,698	42,285,413.00	2.20
10	601699	潞安环能	1,829,349	38,709,024.84	2.01
11	600256	广汇股份	1,484,712	30,555,372.96	1.59
12	000792	盐湖股份	915,773	29,277,262.81	1.52
13	601601	中国太保	1,499,941	28,813,866.61	1.50
14	600031	三一重工	2,277,132	28,555,235.28	1.49
15	600858	银座股份	1,387,379	27,220,375.98	1.42
16	000937	冀中能源	1,557,207	26,254,510.02	1.37
17	600048	保利地产	2,610,000	26,100,000.00	1.36
18	600354	敦煌种业	1,230,003	25,743,962.79	1.34
19	600859	王府井	787,747	25,294,556.17	1.32
20	600141	兴发集团	1,440,328	24,615,205.52	1.28
21	600309	烟台万华	1,897,429	24,476,834.10	1.27
22	600125	铁龙物流	2,418,840	22,446,835.20	1.17
23	300070	碧水源	530,930	22,022,976.40	1.15
24	000651	格力电器	1,100,000	19,019,000.00	0.99
25	000550	江铃汽车	938,361	18,757,836.39	0.98
26	002011	盾安环境	2,050,026	18,224,731.14	0.95
27	300145	南方泵业	986,543	17,747,908.57	0.92
28	000400	许继电气	913,329	17,672,916.15	0.92
29	600208	新潮中宝	5,120,964	17,513,696.88	0.91
30	300143	星河生物	1,216,206	15,701,219.46	0.82
31	002325	洪涛股份	787,329	15,589,114.20	0.81
32	601717	郑煤机	589,947	14,671,981.89	0.76
33	600683	京投银泰	3,127,781	14,669,292.89	0.76

34	600884	杉杉股份	1,169,918	14,366,593.04	0.75
35	600263	路桥建设	933,141	13,978,452.18	0.73
36	000893	东凌粮油	1,047,840	13,548,571.20	0.70
37	600967	北方创业	798,471	13,406,328.09	0.70
38	002584	西陇化工	1,262,000	13,011,220.00	0.68
39	600585	海螺水泥	794,258	12,430,137.70	0.65
40	002438	江苏神通	513,981	11,667,368.70	0.61
41	600578	京能热电	1,562,586	11,156,864.04	0.58
42	600486	扬农化工	728,926	10,642,319.60	0.55
43	600495	晋西车轴	919,950	10,229,844.00	0.53
44	002073	软控股份	665,924	10,075,430.12	0.52
45	000527	美的电器	790,000	9,669,600.00	0.50
46	000887	中鼎股份	848,112	9,566,703.36	0.50
47	002385	大北农	259,843	8,444,897.50	0.44
48	002155	辰州矿业	409,514	8,218,945.98	0.43
49	600823	世茂股份	755,240	7,892,258.00	0.41
50	002484	江海股份	430,964	7,274,672.32	0.38
51	600138	中青旅	479,934	7,227,806.04	0.38
52	000002	万科A	953,200	7,120,404.00	0.37
53	002013	中航精机	465,000	6,933,150.00	0.36
54	000528	柳工	578,593	6,752,180.31	0.35
55	002340	格林美	341,490	6,659,055.00	0.35
56	600177	雅戈尔	689,856	6,470,849.28	0.34
57	600362	江西铜业	290,000	6,359,700.00	0.33
58	300217	东方电热	209,950	5,895,396.00	0.31
59	002482	广田股份	239,600	5,647,372.00	0.29
60	000012	南玻A	620,126	5,618,341.56	0.29
61	002065	东华软件	247,498	5,459,805.88	0.28
62	300024	机器人	279,960	4,963,690.80	0.26
63	600395	盘江股份	235,277	4,858,470.05	0.25
64	300159	新研股份	161,481	4,666,800.90	0.24
65	002308	威创股份	449,781	4,664,228.97	0.24
66	600893	航空动力	299,910	4,075,776.90	0.21
67	600827	友谊股份	330,070	3,752,895.90	0.20
68	600458	时代新材	297,850	3,282,307.00	0.17
69	000999	华润三九	143,800	2,487,740.00	0.13
70	601168	西部矿业	256,173	2,400,341.01	0.12
71	000024	招商地产	129,966	2,339,388.00	0.12
72	002508	老板电器	102,274	1,639,452.22	0.09

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值的比例(%)
1	601766	中国南车	100,299,861.79	3.53
2	600036	招商银行	79,507,192.00	2.80
3	600284	浦东建设	62,326,777.87	2.20
4	600256	广汇股份	60,782,045.08	2.14
5	000792	盐湖股份	56,898,432.18	2.01
6	600585	海螺水泥	51,798,888.15	1.83
7	601699	潞安环能	48,554,659.17	1.71
8	000581	威孚高科	47,665,785.79	1.68
9	600582	天地科技	46,432,233.31	1.64
10	601106	中国一重	44,506,289.20	1.57
11	600518	康美药业	40,916,063.65	1.44
12	600125	铁龙物流	38,520,087.49	1.36
13	600683	京投银泰	36,754,936.75	1.30
14	600009	上海机场	34,506,971.11	1.22
15	600827	友谊股份	34,405,316.00	1.21
16	600100	同方股份	33,396,570.60	1.18
17	600859	王府井	31,112,111.39	1.10
18	601268	二重重装	29,813,021.98	1.05
19	600858	银座股份	29,608,824.61	1.04
20	600486	扬农化工	29,108,780.14	1.03

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值的比例(%)
1	601318	中国平安	90,488,288.06	3.19
2	600089	特变电工	64,676,426.65	2.28
3	002073	软控股份	63,094,086.56	2.22
4	600284	浦东建设	59,578,069.09	2.10
5	601808	中海油服	57,489,701.04	2.03
6	000050	深天马A	53,314,127.07	1.88
7	000012	南玻A	50,778,539.22	1.79
8	601989	中国重工	47,389,494.02	1.67
9	000680	山推股份	46,392,627.27	1.63
10	600694	大商股份	45,745,896.75	1.61
11	601766	中国南车	45,170,247.44	1.59
12	002123	荣信股份	43,869,216.30	1.55
13	600812	华北制药	42,255,625.67	1.49
14	000401	冀东水泥	41,288,321.00	1.46
15	000423	东阿阿胶	40,311,413.41	1.42

16	000999	华润三九	37,618,585.88	1.33
17	600585	海螺水泥	36,782,838.29	1.30
18	000969	安泰科技	36,048,514.87	1.27
19	600518	康美药业	35,297,748.87	1.24
20	600123	兰花科创	32,885,141.13	1.16

#### 8.4.3 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	2,116,858,370.30
卖出股票收入（成交）总额	2,243,091,984.42

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 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投资明细

本基金期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 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

本基金报告期末未持有权证。

#### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

根据宜宾五粮液股份有限公司 2011 年 5 月 27 日公告的《关于收到中国证监会行政处罚决定书的公告》显示，公司因违规披露、信息披露不及时、不完整等事项受到中国证监会行政处罚，公司表示接受证监会的行政处罚，吸取教训，不断完善公司治理和合规经营。本基金做出如下说明：

1、对于白酒行业及五粮液，本公司研究员自 2 季度以来一直看好和积极推荐，并有相关的研究报告。

2、基于相关研究，本基金判断，随着我国国民收入的提高、城镇化的快速推进，

我国白酒行业将继续维持高速增长，作为国内最大的白酒生产企业，高端白酒中的代表性企业之一，五粮液公司的投资价值会得到提升，对于该公司被监管部门处罚的事件，本基金经过认真研究，做出如下判断：公司自 2009 年底以来，对公司治理、信息披露、关联交易进行了很大改进，并使得公司业绩保持了良好的发展势头。公司也在 2011 年 5 月 27 日的公告中，对公司整改情况进行了披露。因此，我们审慎地将五粮液在配置上作为组合的阶段性重要投资品种。

3、今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，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，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

#### 8.9.2 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。

#### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,388,549.12
2	应收证券清算款	2,335,880.78
3	应收股利	-
4	应收利息	99,408.20
5	应收申购款	1,383.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,825,221.50

#### 8.9.4 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可转换债券。

#### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.9.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
115,850	220,68.54	74,124,113.74	2.90%	2,482,516,036.17	97.10%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	长盛基金管理有限公司	62,276,368.00	91.75%
2	天津开创投资有限责任公司	1,986,564.00	2.93%
3	黄晓峰	709,737.00	1.05%
4	高兆明	577,298.00	0.85%
5	黄带顺	540,000.00	0.80%
6	王明瑞	486,832.00	0.72%
7	陈国光	405,636.00	0.60%
8	陈克明	387,000.00	0.57%
9	李萍	255,750.00	0.38%
10	王远芳	251,326.00	0.37%

注：持有人为场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	7,676.65	0.00%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年1月5日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,822,777,253.57
本报告期期间基金总申购份额	34,695,446.12
减：本报告期期间基金总赎回份额	300,832,549.78
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,556,640,149.91

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

#### 11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本基金管理人于 2011 年 5 月 14 日发布公告，经长盛基金管理有限公司第五届董事会第十五次会议审议通过，并报中国证监会审核批准，聘任公司副总经理周兵先生担任公司总经理，陈礼华先生不再担任公司总经理。

#### 11.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动，董杰先生不再担任中国银行及投资者服务部总经理，刘惠军女士不再担任中国银行及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略不曾改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所的情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所。本报告期内本基金未更换会计师事务所，报告期内共支付该会计师事务所审计费用 100,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 11 年。

### 11.6 基金管理人、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。

## 11.7 基金租用证券公司专用交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		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	佣金	占当期佣金总量的比例
招商证券	1	-	-	-	-
长江证券	1	115,477,261.55	2.70%	98,156.06	2.75%
中信证券	1	170,850,726.02	3.99%	138,817.61	3.88%
华福证券	1	-	-	-	-
国元证券	2	145,365,437.52	3.40%	118,110.06	3.30%
东北证券	1	462,027,455.70	10.80%	392,722.91	10.99%
高华证券	1	-	-	-	-
广发证券	1	327,707,645.31	7.66%	278,549.19	7.79%
中信建投	2	323,283,422.03	7.55%	274,790.51	7.69%
申银万国	1	-	-	-	-
国信证券	1	234,121,701.22	5.47%	190,225.07	5.32%
联合证券	1	275,179,124.29	6.43%	223,583.87	6.26%
中金公司	1	1,343,727,502.29	31.40%	1,142,161.67	31.96%
国泰君安	1	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-
安信证券	1	882,254,816.87	20.61%	716,839.57	20.06%

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易	
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交总额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	1	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	650,000,000.00	39.39%
高华证券	1	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-
中金公司	1	7,631,646.10	100.00%	1,000,000,000.00	60.61%

国泰君安	1	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-
安信证券	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位的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元：无。



(2) 本基金报告期内撤销租用交易单元:

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	国元证券股份有限公司	深圳	1

### 11.8 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	公告名称/事项	法定披露方式	披露日期
1	关于网上直销开通一户多卡、赎回转认/申购、定期转换、定期赎回等业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2011-10-28
2	长盛基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	同上	2011-09-02
3	长盛同智优势成长混合型证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2011-08-09
4	长盛基金管理有限公司关于设立成都分公司的公告	同上	2011-07-28
5	长盛基金管理有限公司关于电话总机变更的公告	同上	2011-07-06
6	关于旗下部分基金参加中信银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2011-07-04
7	关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2011-06-30
8	长盛基金管理有限公司总经理变更公告	同上	2011-05-14
9	长盛基金管理有限公司关于开通旗下开放式基金在中信证券定期定额投资业务的公告	同上	2011-05-13
10	关于旗下部分基金参与银河证券基金申购业务费率优惠活动的公告	同上	2011-04-12
11	关于开通汇付天下“天天盈”网上直销业务的公告	同上	2011-04-01
12	长盛基金管理有限公司关于由周兵先生代为履行公司总经理职务的公告	同上	2011-03-30
13	关于增加中信证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	同上	2011-03-28
14	长盛基金管理有限公司关于旗下基金持有的“双汇发展”估值方法调整的公告	同上	2011-03-22
15	长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)招募说明书更新	同上	2011-02-19
16	长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)收益分配公告	同上	2011-01-13

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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同智优势成长混合型证券投资基金的批复；

- 2、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同智优势成长混合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。

### 12.2 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。

### 12.3 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>。