
长盛同鑫保本混合型证券投资基金

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（以下简称：中国银行）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，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2011 年 5 月 24 日(基金合同生效日)起至 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	自基金合同生效以来基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6	审计报告	16

6.1	审计报告基本信息.....	16
6.2	审计报告的基本内容.....	16
§ 7	年度财务报表.....	17
7.1	资产负债表.....	17
7.2	利润表.....	18
7.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	19
7.4	报表附注.....	19
§ 8	投资组合报告.....	39
8.1	期末基金资产组合情况.....	39
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
8.9	投资组合报告附注.....	41
§ 9	基金份额持有人信息.....	43
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	43
§ 10	开放式基金份额变动.....	43
§ 11	重大事件揭示.....	44
11.1	基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
11.4	基金投资策略的改变.....	44
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	44

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票和债券交易的情况.....	44
11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行债券回购交易的情况.....	45
11.8 其他重大事件.....	46
§ 12 备查文件目录.....	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同鑫保本混合型证券投资基金
基金简称	长盛同鑫保本混合
基金主代码	080007
交易代码	080007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月24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	2,093,050,351.04份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	依据本基金的保证合同，本基金通过运用投资组合保险策略，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，力争在本基金保本周期结束时，实现基金资产的收益增长。
投资策略	本基金投资策略突出强调配置的科学与纪律性，通过严格金融工程手段有效控制风险，保证实现投资期中的稳定收益，并通过有效地资产配置和保本投资策略以保障基金资产本金的安全。 本基金将按照恒定比例组合保险机制（CPPI）将资产配置于安全资产与风险资产，用投资于固定收益类证券的现金净流入来冲抵风险资产组合潜在的最大亏损，并通过投资股票等风险资产来获得资本利得。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种。未持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额，不享受保本担保。

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	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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
基金保证人	安徽省信用担保集团有限公司	合肥市长江西路200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5月24日（基金合同生效日）-2011年12月31日
本期已实现收益	51,919,639.35
本期利润	57,151,664.22
加权平均基金份额本期利润	0.0218
本期加权平均净值利润率	2.16%
本期基金份额净值增长率	2.30%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末
期末可供分配利润	42,121,489.20
期末可供分配基金份额利润	0.0201
期末基金资产净值	2,140,442,718.63
期末基金份额净值	1.023
3.1.3 累计期末指标	2011年末
基金份额累计净值增长率	2.30%

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、本基金基金合同于2011年5月24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

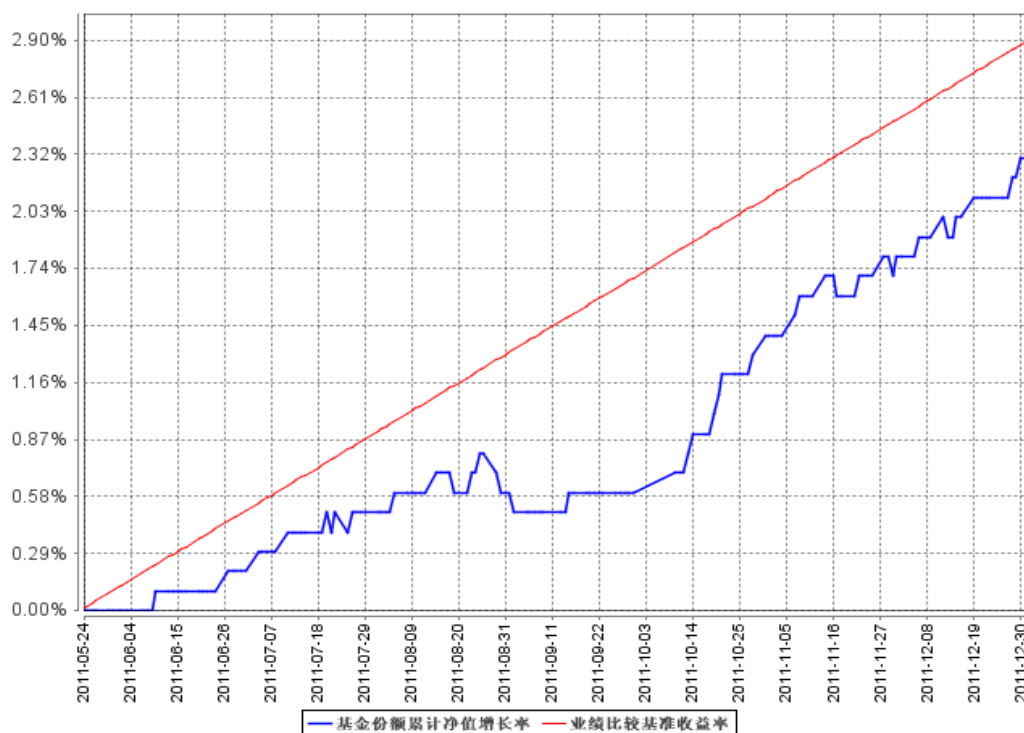
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.69%	0.05%	1.18%	0.02%	0.51%	0.03%
过去六个月	2.10%	0.05%	2.38%	0.01%	-0.28%	0.04%
自基金合同生效起至今	2.30%	0.05%	2.89%	0.01%	-0.59%	0.04%

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为基金合同成立日所在年度的中国人民银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益率。本基金是保本型基金产品，保本周期为3年。以3年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量比较本基金保本保证的有效性。

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

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

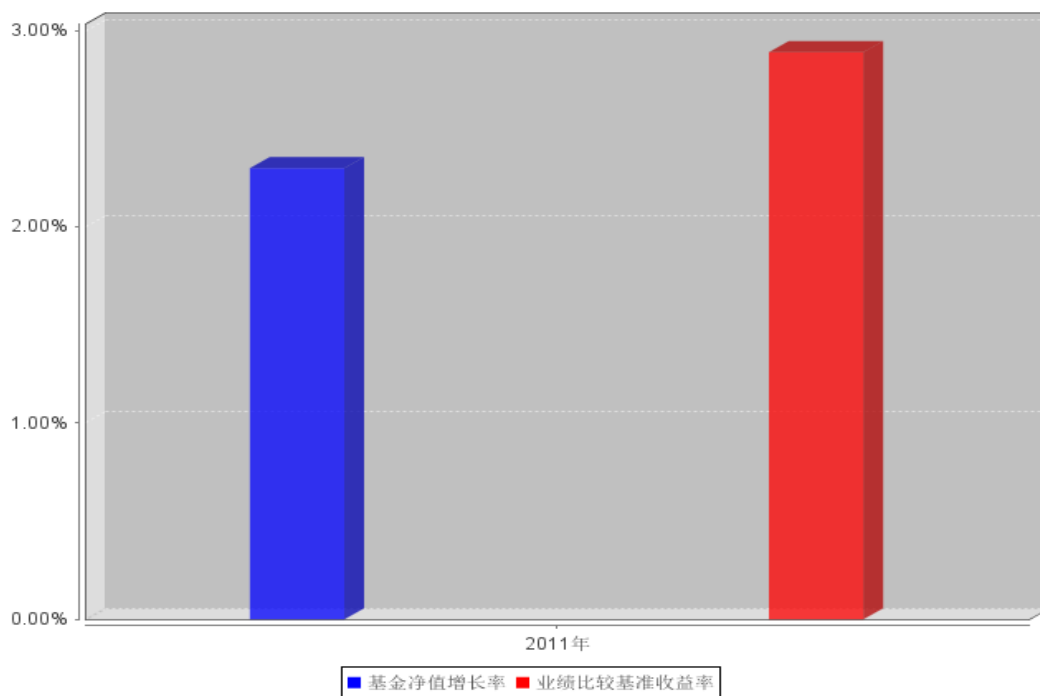


注：1、本基金合同生效日为2011年5月24日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

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。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十六条（二）投资范围、（七）投资禁止行为与限制的有关约定。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 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：本基金基金合同于2011年5月24日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 自基金合同生效以来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	-	-	-	-	2011年度未分配收益
合计	-	-	-	-	

§ 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		
蔡宾	本基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，固定收益部副总监。	2011年5月24日	—	7年	男，1978年11月出生，中国国籍。毕业于中央财经大学，获硕士学位，CFA（美国特许金融分析师）。2004年6月至2006年2月就职于宝盈基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理，投资经理等。现任固定收益部副总监，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛同鑫保本混合型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛同禧信用增利债券型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

盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在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

2011年，通货膨胀居高不下，经济下滑势头逐渐明显，滞胀的经济环境对资本市场产生严重的负面影响。年内出现了平台贷款的信用事件、通胀接连创出近3年的高位、房地产行业受到严格的调控、高铁安全事件影响到一系列的投资、贷款紧缩影响到相当大比例企业的资金状况，负面信息接踵而至，股票市场和债券市场均受到冲击。这种对于债券投资者和股票投资者均不利的局面是多年来很罕见的。

2011年，债券市场在通胀高企、货币紧缩的冲击下，利率产品收益率一度接近数年前的高点，信用产品收益率在经济下滑的担忧下创出了多年来的新高，而货币市场利率也在年中创出新高。在四季度随着通胀回落，债券市场出现一轮反弹行情。可转换债券在供给冲击和股票市场下跌的共同作用下，也出现剧烈的调整。2011年沪深300指数下跌25%，而由于估值过高和攻击冲击，中小板指数和创业板指数分别下跌37%和35.8%。

长盛同鑫保本基金2011年5月末成立，恰逢通胀持续上扬，债券市场收益率快速上行、股票市场快速下跌之际，我们有效的控制了债券组合的久期水平和权益资产

的配置比例，实现了基金净值在面值以上稳步上升。

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 1.023 元，本报告期份额净值增长率为 2.30%，同期业绩比较基准增长率为 2.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年的经济形势至少比 2011 年会有所改善。一方面，通胀压力得到有效缓解，另一方面，政策微调对于稳定预期有着重要意义。总体上，滞胀的经济环境在 2012 年将会出现变化。债券市场收益率曲线有望在通胀回落的大背景下进一步陡峭化下移。

2011 年由于信贷政策的紧缩，相当比例的企业在资金上遇到了很大困难，企业的经营环境较为恶劣，2012 年如果得到更多的信贷支持，企业的经营状况将有明显改善，从而提高企业的信用水平和偿付能力。当前的信用利差仍然维持在多年来的历史高位，信用债券在 2012 年的表现较为乐观。与此同时，出于对政策放松条件下企业经营的宽松环境和股票资产较低的估值水平，可转换债券和部分股票资产可能会有较好的投资机会。

吸取教训，我们将更加重视每一类资产获取绝对收益的能力。特别是权益资产，虽然当前估值并不昂贵，但是我们仍然希望寻找能够持续提高内在价值的好公司，并结合价格的合理评估，来增加基金整体的长期价值。

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收益分配原则的约定，本基金的基金管理人于2012年1月16日宣告2011年度第1次分红，向截至2012年1月18日止在本基金注册登记人长盛基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利0.030元，分配金额为6,153,528.41元。

本基金截至2011年12月31日，期末可供分配收益为42,121,489.20元，其中：未分配收益已实现部分为42,121,489.20元，未分配收益未实现部分为5,270,878.39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”）在对长盛同鑫保本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	普华永道中天审字(2012)第 20380 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	长盛同鑫保本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鑫保本混合型证券投资基金的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间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	<p>编制和公允列报财务报表是长盛同鑫保本混合型证券投资基金的基金管理人长盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；</p> <p>(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导致的重大错报。</p>	
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管理层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，上述长盛同鑫保本混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的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，公允反映了长盛同鑫保本混合型证券投资基金2011年12月31日的财务状况以及2011年5月24日(基金合同生效日)至2011年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汪棣	张鸿
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	
会计师事务所的地址	中国·上海市	
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：长盛同鑫保本混合型证券投资基金

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
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	615,242,800.00
结算备付金		7,843,482.71
存出保证金		500,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,211,137,325.96
其中：股票投资		1,850,000.00
基金投资		-
债券投资		1,209,287,325.96
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	638,551,677.83
应收证券清算款		18,352,478.81
应收利息	7.4.7.5	17,562,880.73
应收股利		-
应收申购款		9,813.65
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		2,509,200,459.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日
负 债：		
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		346,692,853.80
应付证券清算款		14,643,001.87
应付赎回款		3,998,537.75
应付管理人报酬		2,255,902.46
应付托管费		375,983.72
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	13,534.41
应交税费		4,009.60

应付利息		23,227.38
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	750,690.07
负债合计		368,757,741.06
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	2,093,050,351.04
未分配利润	7.4.7.10	47,392,367.59
所有者权益合计		2,140,442,718.63
负债和所有者权益总计		2,509,200,459.69

注：1、报告截止日2011年12月31日，基金份额净值：1.023元，基金份额总额：2,093,050,351.04份。

2、本财务报表的实际编制期间为2011年5月24日(基金合同生效日)至2011年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体：长盛同鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2011年5月24日(基金合同生效日)至 2011年12月31日
一、收入		81,257,374.14
1. 利息收入		70,539,005.41
其中：存款利息收入	7.4.7.11	12,605,873.88
债券利息收入		14,819,093.74
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		43,114,037.79
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		1,763,914.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	31,500.00
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	1,732,414.11
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	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	5,232,024.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,722,429.75
减：二、费用		24,105,709.92
1. 管理人报酬		19,201,342.69

2. 托管费		3,200,223.78
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	22,735.71
5. 利息支出		1,395,435.18
其中：卖出回购金融资产支出		1,395,435.18
6. 其他费用	7.4.7.19	285,972.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		57,151,664.22
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		57,151,664.22

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛同鑫保本混合型证券投资基金

本报告期：2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年5月24日（基金合同生效日）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）	3,032,111,617.30	-	3,032,111,617.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	57,151,664.22	57,151,664.22
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）	-939,061,266.26	-9,759,296.63	-948,820,562.89
其中：1. 基金申购款	10,980,171.60	75,614.75	11,055,786.35
2. 基金赎回款	-950,041,437.86	-9,834,911.38	-959,876,349.24
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）	2,093,050,351.04	47,392,367.59	2,140,442,718.63

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

长盛同鑫保本混合型证券投资基金(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”)证监基金字[2011]第519号《关于核准长盛同鑫保本混合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《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同鑫保本混合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人民币 3,031,349,989.30 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(2011)第 190 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 5 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,032,111,617.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 761,628.00 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。本基金的担保人为安徽省信用担保集团有限公司，为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证担保。

根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的保本期一般每三年为一个周期；在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本期默认选择转入当期保本期的基金份额持有人持有本基金至当期保本期到期的，如可赎回金额加上保本期内的累计分红金额高于或等于其投资净额，本基金的基金管理人将按可赎回金额支付给基金份额持有人；如可赎回金额加上保本期内的累计分红金额低于其投资净额，本基金的担保人将保证向符合上述条件的本基金份额持有人承担上述差额部分的偿付并及时清偿，担保额度为人民币 51 亿元。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回的，赎回部分不适用保本条款；基金份额持有人在保本期申购的基金份额也不适用保本条款。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金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)、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。本基金投资组合中投资于股票资产占基金资产的比例不高于 30%；投资于债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不得低于 70%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：3 年期银行定期存款税后收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2012 年 3 月 20 日批准报出。

7.4.2 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》、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2011 年 5 月 24 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

本基金目前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。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。

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

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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；于处置时，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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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：本基金本期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明：本基金本期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明：本基金本期无会计差错。

7.4.6 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。

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
活期存款	5,242,800.00
定期存款	610,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	610,000,000.00
存款期限3个月-1年	-
其他存款	-
合计	615,242,800.00

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	1,901,331.00	1,850,000.00	-51,331.00
债券	交易所市场	769,376,325.96	4,170,830.81
	银行间市场	439,911,000.00	1,112,525.06
	合计	1,209,287,325.96	5,283,355.87
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,205,905,301.09	1,211,137,325.96	5,232,024.87

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2011年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	638,551,677.83	-
合计	638,551,677.83	-

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
应收活期存款利息	3,504.35
应收定期存款利息	986,302.86
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,529.50
应收债券利息	15,146,627.68
应收买入返售证券利息	1,422,915.58
应收申购款利息	0.76
其他	-
合计	17,562,880.73

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

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
交易所市场应付交易费用	1,803.22
银行间市场应付交易费用	11,731.19
合计	13,534.41

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
应付券商交易单元保证金	500,000.00

预提费用	220,000.00
应付赎回费	30,690.07
合计	750,690.07

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	3,032,111,617.30	3,032,111,617.30
本期申购	10,980,171.60	10,980,171.60
本期赎回（以“-”号填列）	-950,041,437.86	-950,041,437.86
本期末	2,093,050,351.04	2,093,050,351.04

注：1、本基金自2011年4月20日至2011年5月20日止期间公开发售，共募集有效净认购资金3,031,349,989.30元。根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入761,628.00元在本基金成立后，折算为761,628.00份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年7月7日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购和赎回业务自2011年7月8日起开始办理。

7.4.7.10 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	51,919,639.35	5,232,024.87	57,151,664.22
本期基金份额交易产生的变动数	-9,798,150.15	38,853.52	-9,759,296.63
其中：基金申购款	100,058.83	-24,444.08	75,614.75
基金赎回款	-9,898,208.98	63,297.60	-9,834,911.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,121,489.20	5,270,878.39	47,392,367.59

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年5月24日（基金合同生效日）至 2011年12月31日
活期存款利息收入	748,490.33
定期存款利息收入	11,688,069.80
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	169,312.15
其他	1.60

合计	12,605,873.88
----	---------------

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年5月24日(基金合同生效日)至2011 年12月31日
卖出股票成交总额	225,900.00
减：卖出股票成本总额	194,400.00
买卖股票差价收入	31,500.00

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年5月24日(基金合同生效日)至 2011年12月31日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	539,767,216.00
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	529,856,120.85
减：应收利息总额	8,178,681.04
债券投资收益	1,732,414.11

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期间未取得衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金本期间未取得股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年5月24日(基金合同生效日)至2011年12月31日
1. 交易性金融资产	5,232,024.87
——股票投资	-51,331.00
——债券投资	5,283,355.87
——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	5,232,024.87

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年5月24日(基金合同生效日)至2011年12月31日
基金赎回费收入	3,722,429.75
合计	3,722,429.75

注：本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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日
交易所市场交易费用	13,910.71
银行间市场交易费用	8,825.00
合计	22,735.71

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日
信息披露费	120,000.00
审计费用	100,000.00
银行划款费用	59,072.56
债券托管账户维护费	6,000.00
其他费用	900.00
合计	285,972.56

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于2012年1月16日宣告2011年度第1次分红，向截至2012年1月18日止在本基金注册登记人长盛基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利0.030元。

7.4.9 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、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（“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（自2011年9月2日起）
新加坡星展资产管理有限公司	基金管理人的股东（2011年9月2日前）
安徽省信用担保集团有限公司（“安徽信用担保”）	基金管理人的股东、基金担保人
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人的股东

注：1、根据本基金的基金管理人2011年9月2日发布的公告，经中国证监会证监许可[2011]1315号文核准，本基金的基金管理人原股东新加坡星展资产管理有限公司将其持有的本基金的基金管理人33%股权全部转让给新加坡星展银行有限公司。此次

变更后本基金的基金管理人的股东及持股比例为：国元证券股份有限公司41%，新加坡星展银行有限公司33%，安徽省信用担保集团有限公司13%，安徽省投资集团有限责任公司13%。

2、下述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

本基金未开立关联方交易单元。

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5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	19,201,342.69
其中：支付销售机构的客户维护费	9,242,939.06

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值

1.20%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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,200,223.78

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

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：

单位：人民币元

本期						
2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	499,800,000.00	811,955.72	-	-

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

项目	本期
	2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日
基金合同生效日（2011年5月24日）持有的基金份额	19,999,000.00
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	19,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.96%

注：基金管理人长盛基金管理有限公司在本会计期间认购本基金的交易委托国元证券办理，适用费率为1,000元/笔。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
国元证券	69,999,000.00	3.34%

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 2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	5,242,800.00	748,490.33

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明：

本基金由安徽信用担保作为担保人，为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证担保。保证担保的范围为：在本保本期到期时，基金份额持有人持有到期的基金份额的可赎回金额加上本保本期内本基金的累计分红金额，低于投资净额时的差额部分，担保额度为人民币51亿元。基金份额持有人指在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人。持有到期指在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人在本保本期内一直持有其在本基金的募集期内认购的基金份额。本基金的担保费由本基金的

基金管理人按基金资产净值 0.20% 的年费率从基金管理费收入中列支。

7.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配事项。

注：本基金的基金管理人于资产负债表日后，报告批准报出日前宣告的利润分配情况，请参见附注 7.4.8.2 资产负债表日后事项。

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额
122111	11 永泰债	2011/12/16	2012/01/09	新债网下申购	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00
112054	11 鄂能债	2011/12/21	2012/01/19	新债网下申购	100.00	100.00	400,000	40,000,000.00	40,000,000.00
合计								60,000,000.00	60,000,000.00

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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因暂时停牌而持有流通受限证券。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 346,692,853.80 元，于 2012 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金是一只进行灵活配置的保本型证券投资基金。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，通过运用投资组合保险策略，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，力争在本基金保本周期结束时，实现基金资产的收益增长。

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。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行活期存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的银行定期存款存放在具有托管资格上海银行股份有限公司，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，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2011年12月31日
A-1	361,255,000.00
A-1 以下	-
未评级	112,506,700.00
合计	473,761,700.00

注：未评级债券为国债及政策性金融债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011年12月31日
AAA	301,054,965.93
AAA 以下	434,470,660.03
未评级	-
合计	735,525,625.96

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。本基金投资于一家公司发行的股票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

发行的证券不得超过该证券的 10%。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，因此均能以合理价格适时变现。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。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	615,242,800.00	-	-	-	615,242,800.00
结算备付金	7,843,482.71	-	-	-	7,843,482.71
存出保证金	-	-	-	500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	579,539,569.93	504,968,611.43	124,779,144.60	1,850,000.00	1,211,137,325.96
买入返售金融资产	638,551,677.83	-	-	-	638,551,677.83
应收证券清算款	-	-	-	18,352,478.81	18,352,478.81
应收利息	-	-	-	17,562,880.73	17,562,880.73
应收申购款	1,988.07	-	-	7,825.58	9,813.65
资产总计	1,841,179,518.54	504,968,611.43	124,779,144.60	38,273,185.12	2,509,200,459.69
负债					
卖出回购金融资产款	346,692,853.80	-	-	-	346,692,853.80

应付证券清算款	-	-	-	14,643,001.87	14,643,001.87
应付赎回款	-	-	-	3,998,537.75	3,998,537.75
应付管理人报酬	-	-	-	2,255,902.46	2,255,902.46
应付托管费	-	-	-	375,983.72	375,983.72
应付交易费用	-	-	-	13,534.41	13,534.41
应付利息	-	-	-	23,227.38	23,227.38
应交税费	-	-	-	4,009.60	4,009.60
其他负债	-	-	-	750,690.07	750,690.07
负债总计	346,692,853.80	-	-	22,064,887.26	368,757,741.06
利率敏感度缺口	1,494,486,664.74	504,968,611.43	124,779,144.60	16,208,297.86	2,140,442,718.63

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	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)
分析		本期末 2011年12月31日
	市场利率下降25个基点	增加4,721,057.72
	市场利率上升25个基点	下降4,721,057.72

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的0-30%，债券、现金及其它短期金融工具为70-100%。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。

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	
	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	1,850,000.00	0.09
交易性金融资产—基金投资	-	-
其他	-	-
合计	1,850,000.00	0.09

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.09%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.14 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

(1) 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。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(a) 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)。

(b) 各层次金融工具公允价值

于2011年12月31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771,226,325.96元，属于第二层级的余额为439,911,000.00元，无属于第三层级的余额。

(c) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(d) 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。

§ 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	1,850,000.00	0.07
	其中：股票	1,850,000.00	0.07
2	固定收益投资	1,209,287,325.96	48.19
	其中：债券	1,209,287,325.96	48.19
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	638,551,677.83	25.45
	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	623,086,282.71	24.83
6	其他各项资产	36,425,173.19	1.45
7	合计	2,509,200,459.69	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,850,000.00	0.09
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	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	1,850,000.00	0.09
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	-	-
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	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,850,000.00	0.09

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	600582	天地科技	100,000	1,850,000.00	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	600582	天地科技	1,901,331.00	0.09
2	601336	新华保险	69,750.00	0.00
3	002638	勤上光电	24,000.00	0.00
4	300263	隆华传热	16,500.00	0.00
5	300266	兴源过滤	13,000.00	0.00
6	601555	东吴证券	13,000.00	0.00
7	002635	安洁科技	11,500.00	0.00
8	300259	新天科技	10,950.00	0.00
9	002630	华西能源	8,500.00	0.00
10	002644	佛慈制药	8,000.00	0.00
11	002646	青青稞酒	8,000.00	0.00
12	002624	金磊股份	5,600.00	0.00
13	002636	金安国纪	5,600.00	0.00

8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值的比例(%)
1	601336	新华保险	77,790.00	0.00
2	002638	勤上光电	24,100.00	0.00
3	300263	隆华传热	16,140.00	0.00
4	601555	东吴证券	15,780.00	0.00
5	300259	新天科技	15,050.00	0.00
6	300266	兴源过滤	14,665.00	0.00
7	002635	安洁科技	14,005.00	0.00
8	002630	华西能源	11,750.00	0.00
9	002624	金磊股份	11,340.00	0.00
10	002646	青青稞酒	10,070.00	0.00
11	002644	佛慈制药	8,610.00	0.00
12	002636	金安国纪	6,600.00	0.00

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	2,095,731.00
卖出股票收入（成交）总额	225,900.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	33,850,700.00	1.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	78,656,000.00	3.67
	其中：政策性金融债	78,656,000.00	3.67
4	企业债券	610,746,481.36	28.53
5	企业短期融资券	361,255,000.00	16.88
6	中期票据	-	-
7	可转债	124,779,144.60	5.83
8	其他	-	-
9	合计	1,209,287,325.96	56.50

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	1,241,460	124,779,144.60	5.83
2	110245	11 国开 45	800,000	78,656,000.00	3.67
3	115003	中兴债 1	704,874	67,949,148.73	3.17
4	041153002	11 华能 CP002	600,000	60,606,000.00	2.83
5	126011	08 石化债	586,670	54,167,241.10	2.53

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

本基金报告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。

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。

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	500,000.00
2	应收证券清算款	18,352,478.81
3	应收股利	-
4	应收利息	17,562,880.73
5	应收申购款	9,813.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,425,173.19

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	124,779,144.60	5.83

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
17,597	118,943.59	167,561,586.40	8.01%	1,925,488,764.64	91.99%

9.2 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	1,162,792.16	0.06%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年5月24日)基金份额总额	3,032,111,617.30
本报告期基金总申购份额	10,980,171.60
减：本报告期基金总赎回份额	950,041,437.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,093,050,351.04

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未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

本报告期基金管理人的高级管理人员没有发生变动。

11.2.2 基金经理的变动情况

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托管及投资者服务部总经理，刘慧军女士不再担任中国银行托管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

本报告期内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没有改变。

11.5 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，本报告期支付给该会计师事务所的报酬 100,000.00 元，已连续提供审计服务 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人托管业务部门及其相关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
光大证券	1	-	-	35,681,972.93	3.57%	-	-
华泰联合证券	1	1,994,901.00	93.78%	868,117,391.84	86.83%	1,695.68	94.04%
华创证券	1	132,330.00	6.22%	96,011,290.61	9.60%	107.54	5.96%

11.7.2 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
光大证券	1	3,652,056,000.00	12.51%
华泰联合证券	1	23,344,600,000.00	79.97%
华创证券	1	2,196,606,000.00	7.52%

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) 资历雄厚，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	光大证券	深圳	1
2	华泰联合证券	上海	1
3	华创证券	深圳	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无

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	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛同鑫保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2011-12-21
2	关于增加华夏银行为旗下部分基金代销机构、推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2011-11-09
3	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	同上	2011-10-28
4	关于长盛同鑫保本混合型证券投资基金参加中国工商银行网上银行交易申购费率优惠活动的公告	同上	2011-09-05
5	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
6	关于旗下部分开放式基金在长江证券开通定期定额投资业务的公告	同上	2011-08-05
7	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
8	关于长盛同鑫保本基金参与部分代销机构申购费率优惠及参与部分代销机构定期定额投资业务活动的公告	同上	2011-07-08
9	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
10	关于长盛同鑫保本混合型证券投资基金开通部分银行定投业务及参与部分银行网上银行交易申购费率优惠活动的公告	同上	2011-07-05
11	长盛同鑫保本混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	同上	2011-07-05
12	长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同生效公告	同上	2011-05-25

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同鑫保本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/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>。