

---

长盛量化红利策略股票型证券投资基金

2011 年年度报告摘要

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2012 年 3 月 28 日

---

## § 1 重要提示

### 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称：中国工商银行）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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金简称       | 长盛量化红利股票        |
| 基金主代码      | 080005          |
| 交易代码       | 080005          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2009年11月25日     |
| 基金管理人      | 长盛基金管理有限公司      |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司    |
| 报告期末基金份额总额 | 290,968,666.33份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标，并追求风险调整后的收益最大化，满足投资人长期稳健的投资收益需求。   |
| 投资策略   | 本基金通过严格的数量化股票选择方法生成红利风格股票池，在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合，从而形成基于核心-卫星投资策略的股票资产组合。其中，大类资产配置策略综合考虑宏观经济、政策导向和市场环境（市场估值水平、资金供求）等因素，股票投资中将以红利股票投资为主导，以价值型企业及分红能力作为选择投资对象的核心标准。 |
| 业绩比较基准 | 中证红利指数×75%+中证综合债指数×25%  |
| 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，属于较高风险，较高回报的基金产品  |

### 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   | 中国工商银行股份有限公司        |                     |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名           | 叶金松                 | 赵会军                 |
|             | 联系电话         | 010-82019988        | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱         | yejs@csfunds.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      | 400-888-2666 | 95588               |                     |
|             | 010-62350088 |                     |                     |
| 传真          | 010-82255988 | 010-66105798        |                     |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 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          | 基金管理人和基金托管人的办公地址  |

### § 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 11 月 25 日(基金合同生效日) - 2009 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------|----------------|--|
| 本期已实现收益       | 12,308,335.02  | -362,415.89    | 2,170,376.41                                 |
| 本期利润          | -49,983,565.30 | 26,558,228.91  | 7,585,788.27                                 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1578        | 0.0305         | 0.0061                                       |
| 本期基金份额净值增长率   | -17.82%        | 4.17%          | 0.60%  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2011 年末        | 2010 年末        | 2009 年末                                      |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.1725        | 0.0477         | 0.0017                                       |
| 期末基金资产净值      | 240,768,904.61 | 408,497,887.88 | 1,229,896,661.13                             |
| 期末基金份额净值      | 0.827          | 1.048          | 1.006  |

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、长盛量化红利策略股票型证券投资基金合同于 2009 年 11 月 25 日生效，合同生效当期不是完整报告期。

#### 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      | -5.27%   | 1.10%       | -5.81%     | 0.96%         | 0.54%  | 0.14% |
| 过去六个月      | -15.61%  | 1.03%       | -15.94%    | 0.96%         | 0.33%  | 0.07% |
| 过去一年       | -17.82%  | 1.06%       | -16.84%    | 0.94%         | -0.98% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | -13.88%  | 1.16%       | -23.12%    | 1.08%         | 9.24%  | 0.08% |

注：本基金业绩比较基准：中证红利指数×75%+中证综合债指数×25%

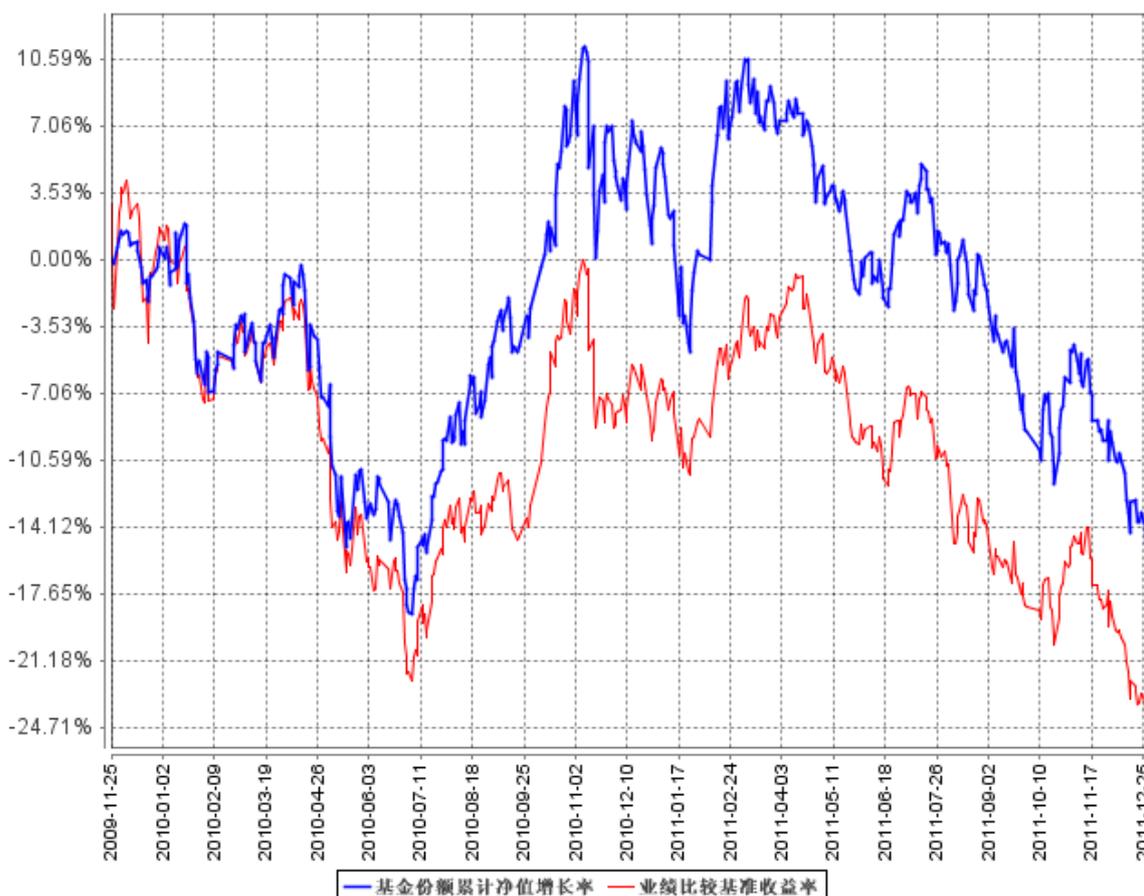
其中，中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的 100 只股票作为样本，以反映 A 股市场高红利股票的整体状况和走势。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，作为衡量本基金业绩的基准，较为合适。

中证综合债指数是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债和企业债，以更加全面地反映中国债券市场整体价格变动趋势。

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 75%、25%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

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

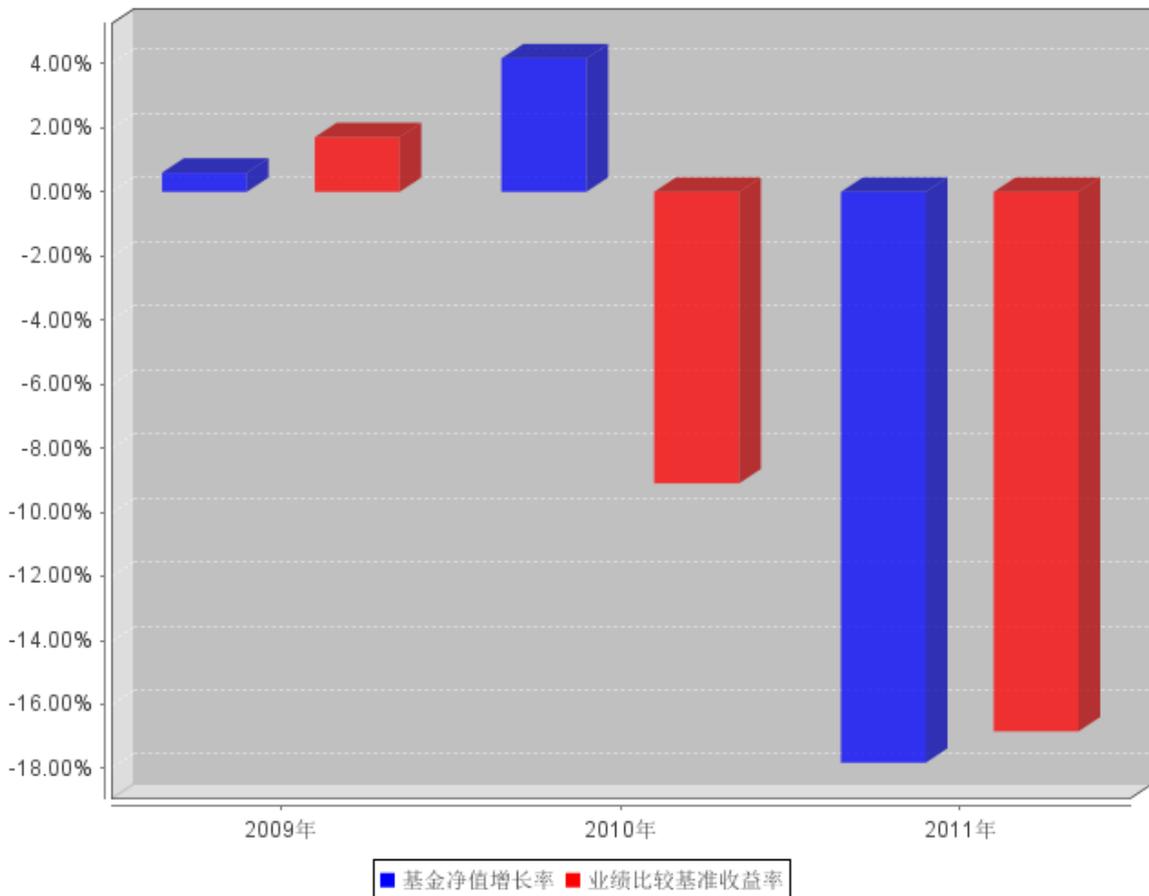


注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自本基金成立六个月内，使基

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十一部分投资范围、投资限制的有关约定。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：长盛量化红利策略股票型证券投资基金合同于 2009 年 11 月 25 日生效，合同生效当年净值增长率按照实际存续期计算，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 | 0.400         | 10,416,098.35 | 4,877,419.18 | 15,293,517.53 | 除息日：2011 年 1 月 17 日 |
| 2010 年 | -             | -             | -            | -             | 2010 年度未分配收益        |

|        |       |               |              |               |                      |
|--------|-------|---------------|--------------|---------------|----------------------|
| 2009 年 | -     | -             | -            | -             | 2009 年<br>度未分<br>配收益 |
| 合计     | 0.400 | 10,416,098.35 | 4,877,419.18 | 15,293,517.53 |                      |

## § 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 |        |  |
| 刘斌 | 本基金基金经理，金融工程与量化投资部副总监。 | 2009年11月25日     | -    | 5年     | 男，1979年6月出生，中国国籍。清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司，在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理、长盛沪深300指数证券投资基金基金经理等职务，现任金融工程与量化投资部副总监，长盛量化红利策略股票型证券投资基金（本基金）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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛量化红利策略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**

2010年下半年经济出现的反弹，随着高通胀、紧货币，在2011年上半年出现再次回落，即短周期步入滞胀阶段，资本市场下行幅度大幅超出市场预期。从行业角度看，食品饮料、金融服务、房地产、公用事业等价值性板块跌幅较少，而有色金属、电子、机械设备、信息设备、交运设备、商业贸易、建筑建材等板块大幅下跌超过30%。从风格角度看，价值因子持续获取较多超额收益，风格估值差异持续缩小。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至报告期末，本基金份额净值为0.827元，本报告期份额净值增长率为-17.82%，同期业绩比较基准增长率为-16.84%。

#### **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，经济将进入2009年经济筑底回升、2010和2011年高位回落后的底部阶段，未来将会呈现L形走势。中长期看，经济进入以8-9%为增长中枢的窄幅波动区域，不会有明显的新周期启动，但也不会很快出现大幅调整。受前期需求回落、政策放松等因素的影响，流动性偏紧局面将会逐步改善。本基金将在战略资产、战术资产配置模型指导下，逐步提升股票资产配置比例，由积极防御转向进攻状态。

本基金采用数量化策略进行股票投资，按照红利价值型策略在价值层面深度挖

---

掘，保持投资风格的长期稳定。

#### 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。

#### 4.7 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十五条中对基金利润分配原则的约定，本基金于 2011 年 1 月 17 日进行了利润分配，分配金额为 15,293,517.53 元。

本基金截至 2011 年 12 月 31 日，期末可供分配收益为-50,199,761.72 元，其中：未分配收益已实现部分为 17,567,276.31 元，未分配收益未实现部分为 -67,767,038.03 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

2011 年，本基金托管人在对长盛量化红利策略股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

2011 年，长盛量化红利策略股票型证券投资基金的管理人——长盛基金管理有限公司在长盛量化红利策略股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，长盛量化红利策略股票型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 15,293,517.53 元。

### 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

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的长盛量化红利策略股票型证券投资基金 2011 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

---

## § 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司注册会计师汪棣、张鸿于 2012 年 3 月 20 日对本基金 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、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出具了普华永道中天审字（2012）第 20365 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

## § 7 年度财务会计报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛量化红利策略股票型证券投资基金

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<br>2011年12月31日    | 上年度末<br>2010年12月31日   |
|-----------------|---------|-----------------------|-----------------------|
| <b>资 产：</b>     |         |                       |                       |
| 银行存款            | 7.4.7.1 | 82,703,708.45         | 78,564,768.95         |
| 结算备付金           |         | 193,565.21            | 546,716.01            |
| 存出保证金           |         | 500,000.00            | 500,000.00            |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2 | 172,934,304.82        | 351,520,378.93        |
| 其中：股票投资         |         | 172,934,304.82        | 346,325,099.53        |
| 基金投资            |         | -                     | -                     |
| 债券投资            |         | -                     | 5,195,279.40          |
| 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         |         | -                     | -                     |
| 应收利息            | 7.4.7.5 | 16,616.98             | 26,133.58             |
| 应收股利            |         | -                     | -                     |
| 应收申购款           |         | 3,159.13              | 9,483.25              |
| 递延所得税资产         |         | -                     | -                     |
| 其他资产            | 7.4.7.6 | -                     | -                     |
| <b>资产总计</b>     |         | <b>256,351,354.59</b> | <b>431,167,480.72</b> |
| <b>负债和所有者权益</b> |         |                       |                       |
| 负 债：            | 附注号     | 本期末<br>2011年12月31日    | 上年度末<br>2010年12月31日   |
| 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         |         | 14,220,177.86         | -                     |
| 应付赎回款           |         | 24,747.16             | 20,655,230.54         |
| 应付管理人报酬         |         | 312,587.18            | 567,835.56            |
| 应付托管费           |         | 52,097.88             | 94,639.26             |
| 应付销售服务费         |         | -                     | -                     |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7 | 132,746.69            | 713,055.59            |
| 应交税费            |         | -                     | -                     |
| 应付利息            |         | -                     | -                     |

|                   |          |                       |                       |
|-------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 应付利润              |          | -                     | -                     |
| 递延所得税负债           |          | -                     | -                     |
| 其他负债              | 7.4.7.8  | 840,093.21            | 638,831.89            |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>15,582,449.98</b>  | <b>22,669,592.84</b>  |
| <b>所有者权益：</b>     |          |                       |                       |
| 实收基金              | 7.4.7.9  | 290,968,666.33        | 389,891,447.10        |
| 未分配利润             | 7.4.7.10 | -50,199,761.72        | 18,606,440.78         |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>240,768,904.61</b> | <b>408,497,887.88</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>256,351,354.59</b> | <b>431,167,480.72</b> |

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值：0.827 元，基金份额总额：290,968,666.33 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛量化红利策略股票型证券投资基金

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<br>2011 年 1 月 1 日至<br>2011 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2010 年 1 月 1 日至<br>2010 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|----------|---|--|
| <b>一、收入</b>           |          | <b>-42,474,671.88</b>                     | <b>46,779,668.52</b>                           |
| 1. 利息收入               |          | 566,469.66                                | 1,544,509.74                                   |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11 | 560,717.12                                | 1,533,329.26                                   |
| 债券利息收入                |          | 5,752.54                                  | 11,180.48                                      |
| 资产支持证券利息收入            |          | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入            |          | -   | -  |
| 其他利息收入                |          | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）     |          | 19,151,639.96                             | 17,268,366.85                                  |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12 | 16,570,842.42                             | 11,149,587.07                                  |
| 基金投资收益                |          | -   | -  |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13 | 473,606.11                                | 245,756.17                                     |
| 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 | 2,107,191.43                              | 5,873,023.61                                   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列） | 7.4.7.16 | -62,291,900.32                            | 26,920,644.80                                  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”填列）     |          | -   | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”填列）     | 7.4.7.17 | 99,118.82                                 | 1,046,147.13                                   |
| <b>减：二、费用</b>         |          | <b>7,508,893.42</b>                       | <b>20,221,439.61</b>                           |
| 1. 管理人报酬              |          | 4,577,905.93                              | 12,480,288.25                                  |
| 2. 托管费                |          | 762,984.29                                | 2,080,048.11                                   |
| 3. 销售服务费              |          | -   | -  |
| 4. 交易费用               | 7.4.7.18 | 1,808,361.46                              | 5,259,661.04                                   |
| 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 | 359, 641. 74             | 401, 442. 21            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |             | <b>-49, 983, 565. 30</b> | <b>26, 558, 228. 91</b> |
| 减：所得税费用                    |             | -                        | -                       |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |             | <b>-49, 983, 565. 30</b> | <b>26, 558, 228. 91</b> |

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛量化红利策略股票型证券投资基金

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<br>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)                        | 389, 891, 447. 10           | 18, 606, 440. 78         | 408, 497, 887. 88        |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                           | -49, 983, 565. 30        | -49, 983, 565. 30        |
| 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)      | -98, 922, 780. 77           | -3, 529, 119. 67         | -102, 451, 900. 44       |
| 其中：1. 基金申购款                            | 36, 144, 196. 58            | -1, 359, 920. 30         | 34, 784, 276. 28         |
| 2. 基金赎回款                               | -135, 066, 977. 35          | -2, 169, 199. 37         | -137, 236, 176. 72       |
| 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) | -                           | -15, 293, 517. 53        | -15, 293, 517. 53        |
| <b>五、期末所有者权益(基金净值)</b>                 | <b>290, 968, 666. 33</b>    | <b>-50, 199, 761. 72</b> | <b>240, 768, 904. 61</b> |
| 项目                                     | 本期<br>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)                        | 1, 222, 148, 662. 23        | 7, 747, 998. 90          | 1, 229, 896, 661. 13     |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                           | 26, 558, 228. 91         | 26, 558, 228. 91         |
| 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)      | -832, 257, 215. 13          | -15, 699, 787. 03        | -847, 957, 002. 16       |
| 其中：1. 基金申购款                            | 24, 419, 079. 86            | -30, 064. 30             | 24, 389, 015. 56         |
| 2. 基金赎回款                               | -856, 676, 294. 99          | -15, 669, 722. 73        | -872, 346, 017. 72       |
| 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) | -                           | -                        | -                        |
| <b>五、期末所有者权益(基金净值)</b>                 | <b>389, 891, 447. 10</b>    | <b>18, 606, 440. 78</b>  | <b>408, 497, 887. 88</b> |

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

---

基金管理公司负责人

---

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

长盛量化红利策略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[2009]927号《关于核准长盛量化红利策略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《长盛量化红利策略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 1,251,673,981.96 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(2009)第 248 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 11 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,251,832,665.50 份基金份额,其中认购资金利息折合 158,683.54 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《长盛量化红利策略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,主要包括国内依法发行、上市的股票、债券、短期金融工具、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。股票投资占基金资产净值的比例为 60%-95%,其中投资于红利股票的比例不低于股票类资产的 80%。债券投资占基金资产净值的比例为 0%-40%,权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。本基金的业绩比较基准为:中证红利指数×75%+中证综合债指数×25%。

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》、《长盛量化红利策略股

---

票型证券投资基金基金合同》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 年度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 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **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**

本基金本期及上年度可比期间未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本期及上年度可比期间未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本期及上年度可比期间无会计差错。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、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 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   |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 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(2011年9月2日起)  |
| 新加坡星展资产管理有限公司          | 基金管理人的原股东(2011年9月2日前) |
| 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              |

注：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%。

#### 7.4.8 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。

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2011年1月1日至2011年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>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  | 451,361,277.57              | 39.62%       | 939,248,339.43                   | 28.50%       |

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

##### 7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2011年1月1日至2011年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年12月31日 |              |
|-------|-----------------------------|--------------|----------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                        | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                             | 占当期债券成交总额的比例 |
| 国元证券  | -                           | -            | 892,998.00                       | 100.00%      |

##### 7.4.8.1.4 应支付关联方佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>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   | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 国元证券  | 366,733.96                       | 38.55%     | 46,147.75  | 34.76%       |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>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   | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 国元证券  | 763,146.05                       | 27.72%     | 189,252.49 | 26.54%       |

注：1、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。债券及权证交易不计佣金。

2、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等。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2011年1月1日至<br>2011年12月31日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至<br>2010年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,577,905.93                    | 12,480,288.25                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,048,824.19                    | 2,990,467.64                         |

注：支付基金管理人长盛基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2011年1月1日至2011年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至2010年<br>12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 762,984.29                      | 2,080,048.11                         |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的费率计提，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 × 0.25% / 当年天数。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 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<br>2011年1月1日至<br>2011年12月31日 | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至<br>2010年12月31日 |
|-----------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金合同生效日(2009年11月25日)持有的基金份额 | -                               | -                                    |
| 期初持有的基金份额                   | 30,000,050.00                   | 30,000,050.00                        |
| 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         | 30,000,050.00 | 30,000,050.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 10.31%        | 7.69%         |

#### 7.4.8.4.2 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<br>2011年12月31日 |                      | 上年度末<br>2010年12月31日 |                      |
|---------------|--------------------|----------------------|---------------------|----------------------|
|               | 持有的<br>基金份额        | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 |
| 安徽省投资集团有限责任公司 | 27,999,980.00      | 9.62%                | 27,999,980.00       | 7.18%                |
| 国元证券          | 10,000,000.00      | 3.44%                | 10,000,000.00       | 2.56%                |

#### 7.4.8.5 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<br>2011年1月1日至<br>2011年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>2010年1月1日至<br>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       |
| 中国工商银行 | 82,703,708.45                   | 552,903.82 | 78,564,768.95                        | 1,512,458.89 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 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。

###### 7.4.9.3.2 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。

---

#### 7.4.10 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172,934,304.82元，无属于第二、三层级的余额(2010年12月31日：第一层级341,147,996.88元，第二层级10,372,382.05元，无第三层级)。

##### (iii) 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。

##### (iv) 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 | 资产项目              | 金额                    | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-----------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 172,934,304.82        | 67.46         |
|    | 其中：股票             | 172,934,304.82        | 67.46         |
| 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      | 82,897,273.66         | 32.34         |
| 6  | 其他资产              | 519,776.11            | 0.20          |
| 7  | <b>资产合计</b>       | <b>256,351,354.59</b> | <b>100.00</b> |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 序号  | 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            | 4,084,490.40  | 1.70          |
| C   | 制造业            | 85,968,875.06 | 35.71         |
| C0  | 食品、饮料          | 3,641,857.60  | 1.51          |
| 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    | 8,810,514.25  | 3.66          |
| C5  | 电子             | 5,696,246.40  | 2.37          |
| C6  | 金属、非金属         | 14,599,412.32 | 6.06          |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 43,359,251.75 | 18.01         |
| C8  | 医药、生物制品        | 9,861,592.74  | 4.10          |
| C99 | 其他制造业          | -             | -             |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 1,795,346.80  | 0.75          |
| E   | 建筑业            | 3,067,500.00  | 1.27          |
| F   | 交通运输、仓储业       | 10,599,967.12 | 4.40          |
| G   | 信息技术业          | -             | -             |
| H   | 批发和零售贸易        | 8,295,844.11  | 3.45          |
| I   | 金融、保险业         | 43,953,396.91 | 18.26         |
| J   | 房地产业           | 12,325,480.00 | 5.12          |
| K   | 社会服务业          | 750,026.94    | 0.31          |
| L   | 传播与文化产业        | 1,100,992.66  | 0.46          |

|   |     |                |       |
|---|-----|----------------|-------|
| M | 综合类 | 992,384.82     | 0.41  |
|   | 合计  | 172,934,304.82 | 71.83 |

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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  | 600016 | 民生银行 | 1,808,005 | 10,649,149.45 | 4.42         |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 804,856   | 9,553,640.72  | 3.97         |
| 3  | 600000 | 浦发银行 | 942,020   | 7,997,749.80  | 3.32         |
| 4  | 000024 | 招商地产 | 343,200   | 6,177,600.00  | 2.57         |
| 5  | 600048 | 保利地产 | 614,788   | 6,147,880.00  | 2.55         |
| 6  | 000581 | 威孚高科 | 155,368   | 5,576,157.52  | 2.32         |
| 7  | 600104 | 上海汽车 | 373,500   | 5,281,290.00  | 2.19         |
| 8  | 601006 | 大秦铁路 | 625,572   | 4,666,767.12  | 1.94         |
| 9  | 601989 | 中国重工 | 909,175   | 4,645,884.25  | 1.93         |
| 10 | 600582 | 天地科技 | 244,600   | 4,525,100.00  | 1.88         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.csfunds.com.cn> 网站的年度报告正文。

### 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比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 601766 | 中国南车 | 15,651,702.19 | 3.83           |
| 2  | 600048 | 保利地产 | 12,996,753.67 | 3.18           |
| 3  | 601006 | 大秦铁路 | 10,012,894.03 | 2.45           |
| 4  | 601299 | 中国北车 | 10,005,260.76 | 2.45           |
| 5  | 600585 | 海螺水泥 | 8,931,182.99  | 2.19           |
| 6  | 600000 | 浦发银行 | 8,650,412.62  | 2.12           |
| 7  | 600123 | 兰花科创 | 7,875,494.43  | 1.93           |
| 8  | 600309 | 烟台万华 | 7,807,860.80  | 1.91           |
| 9  | 600362 | 江西铜业 | 7,471,970.22  | 1.83           |
| 10 | 000024 | 招商地产 | 7,186,909.14  | 1.76           |
| 11 | 600104 | 上海汽车 | 7,067,867.80  | 1.73           |
| 12 | 601168 | 西部矿业 | 7,048,858.00  | 1.73           |
| 13 | 601288 | 农业银行 | 6,925,000.00  | 1.70           |
| 14 | 600521 | 华海药业 | 6,775,907.92  | 1.66           |
| 15 | 601727 | 上海电气 | 6,626,352.22  | 1.62           |
| 16 | 000898 | 鞍钢股份 | 6,592,000.00  | 1.61           |
| 17 | 600239 | 云南城投 | 6,552,939.66  | 1.60           |
| 18 | 600067 | 冠城大通 | 6,424,248.00  | 1.57           |
| 19 | 600765 | 中航重机 | 6,315,090.48  | 1.55           |
| 20 | 601106 | 中国一重 | 6,289,862.24  | 1.54           |

#### 8.4.2 累计卖出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  | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|-------|---------------|-----------------|
| 1  | 600271 | 航天信息  | 14,265,265.84 | 3.49            |
| 2  | 600395 | 盘江股份  | 13,765,113.54 | 3.37            |
| 3  | 601766 | 中国南车  | 12,168,607.66 | 2.98            |
| 4  | 000527 | 美的电器  | 11,734,098.31 | 2.87            |
| 5  | 600362 | 江西铜业  | 11,705,349.58 | 2.87            |
| 6  | 000063 | 中兴通讯  | 11,062,691.27 | 2.71            |
| 7  | 000422 | 湖北宜化  | 10,996,753.24 | 2.69            |
| 8  | 000680 | 山推股份  | 10,219,605.44 | 2.50            |
| 9  | 000581 | 威孚高科  | 10,183,336.58 | 2.49            |
| 10 | 000759 | 武汉中百  | 10,169,814.78 | 2.49            |
| 11 | 000401 | 冀东水泥  | 10,161,024.10 | 2.49            |
| 12 | 000550 | 江铃汽车  | 10,096,173.98 | 2.47            |
| 13 | 600664 | 哈药股份  | 9,796,742.08  | 2.40            |
| 14 | 000528 | 柳 工   | 9,431,473.60  | 2.31            |
| 15 | 000860 | 顺鑫农业  | 9,067,812.62  | 2.22            |
| 16 | 600690 | 青岛海尔  | 8,940,399.23  | 2.19            |
| 17 | 000858 | 五 粮 液 | 8,692,953.40  | 2.13            |
| 18 | 000568 | 泸州老窖  | 8,357,091.29  | 2.05            |
| 19 | 002254 | 烟台氨纶  | 8,157,577.70  | 2.00            |
| 20 | 601111 | 中国国航  | 8,104,704.14  | 1.98            |

#### 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 | 505,496,113.71 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 633,632,129.92 |

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前十名资产支持证券投资 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。

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 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 16,616.98  |
| 5  | 应收申购款   | 3,159.13   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 519,776.11 |

### 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 |
| 9,348    | 31,126.30 | 70,787,704.32 | 24.33% | 220,180,962.01 | 75.67% |

### 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 | 121,889.50 | 0.04%    |

## § 10 开放式基金份额变动

份额单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2009年11月25日)基金份额总额 | 1,251,832,665.50 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 389,891,447.10   |
| 本报告期基金总申购份额                | 36,144,196.58    |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 135,066,977.35   |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 290,968,666.33   |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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 基金经理的变动情况

本报告期基金经理未发生变动。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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,本报告期共支付给该会计师事务所的报酬 70,000.00 元,已连续为本基金提供审计服务 2 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

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 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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 |
| 中信建投 | 1      | 500,358,031.86 | 43.92%       | 5,219,397.30 | 100.00%      | 425,303.38 | 44.71%     |
| 国元证券 | 1      | 451,361,277.57 | 39.62%       | -            | -            | 366,733.96 | 38.55%     |
| 光大证券 | 1      | 187,408,934.20 | 16.45%       | -            | -            | 159,297.18 | 16.74%     |
| 招商证券 | 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情况：

| 序号 | 证券公司名称 | 交易单元所属市场 | 数量 |
|----|--------|----------|----|
| 1  | 光大证券   | 上海       | 1  |

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无