

---

长盛量化红利策略股票型证券投资基金

2012 年年度报告

2012 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：2013 年 3 月 26 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 25 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 2012 年 1 月 1 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	5
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	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	13
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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	年度财务会计报表.....	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.....	23
§ 8	投资组合报告.....	43
8.1	期末基金资产组合情况.....	43
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
8.9	投资组合报告附注.....	48
§ 9	基金份额持有人信息.....	50
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
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.....	50
§ 10	开放式基金份额变动.....	50
§ 11	重大事件揭示.....	51
11.1	基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
11.4	基金投资策略的改变.....	51
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51

---

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
11.8 其他重大事件.....	53
§ 12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛量化红利策略股票型证券投资基金
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	260,692,402.98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 负责人	姓名	叶金松
	联系电话	010-82019988
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666	95588
	010-62350088	
传真	010-82255988	010-66105798
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 55 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 55 号
邮政编码	100088	100140
法定代表人	凤良志	姜建清

### 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

## § 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	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-30,079,758.79	12,308,335.02	-362,415.89
本期利润	5,803,066.67	-49,983,565.30	26,558,228.91
加权平均基金份额本期利润	0.0211	-0.1578	0.0305
本期加权平均净值利润率	2.47%	-16.46%	3.22%
本期基金份额净值增长率	2.42%	-17.82%	4.17%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	-40,004,516.17	-50,199,761.72	18,606,440.78
期末可供分配基金份额利润	-0.1535	-0.1725	0.0477
期末基金资产净值	220,687,886.81	240,768,904.61	408,497,887.88
期末基金份额净值	0.847	0.827	1.048
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	-11.80%	-13.88%	4.80%

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。

### 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	3.17%	0.82%	9.86%	0.94%	-6.69%	-0.12%
过去六个月	-1.85%	0.82%	4.91%	0.90%	-6.76%	-0.08%
过去一年	2.42%	0.94%	6.57%	0.91%	-4.15%	0.03%
过去三年	-12.32%	1.11%	-19.58%	1.00%	7.26%	0.11%
自基金合同生效起至今	-11.80%	1.09%	-18.19%	1.03%	6.39%	0.06%

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



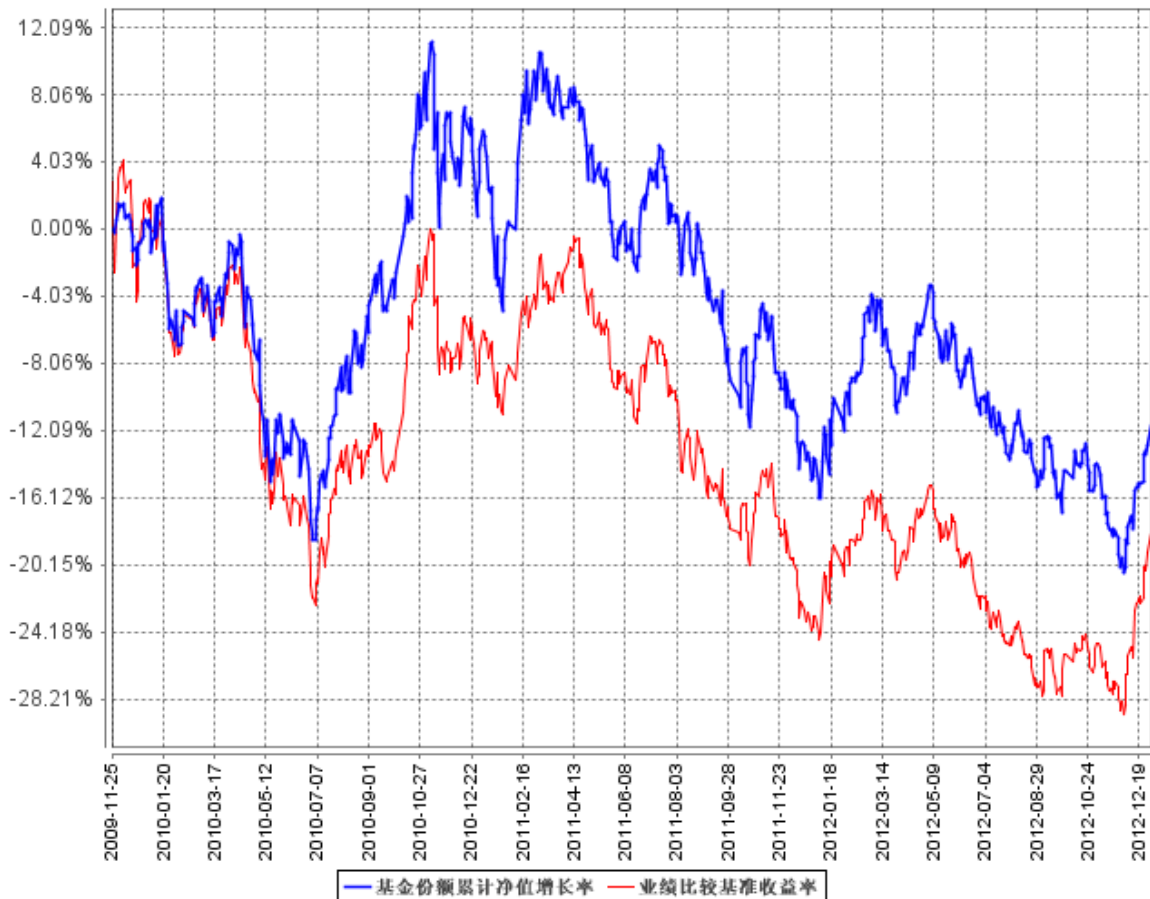
高红利股票的整体状况和走势。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，作为衡量本基金业绩的基准，较为合适。

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

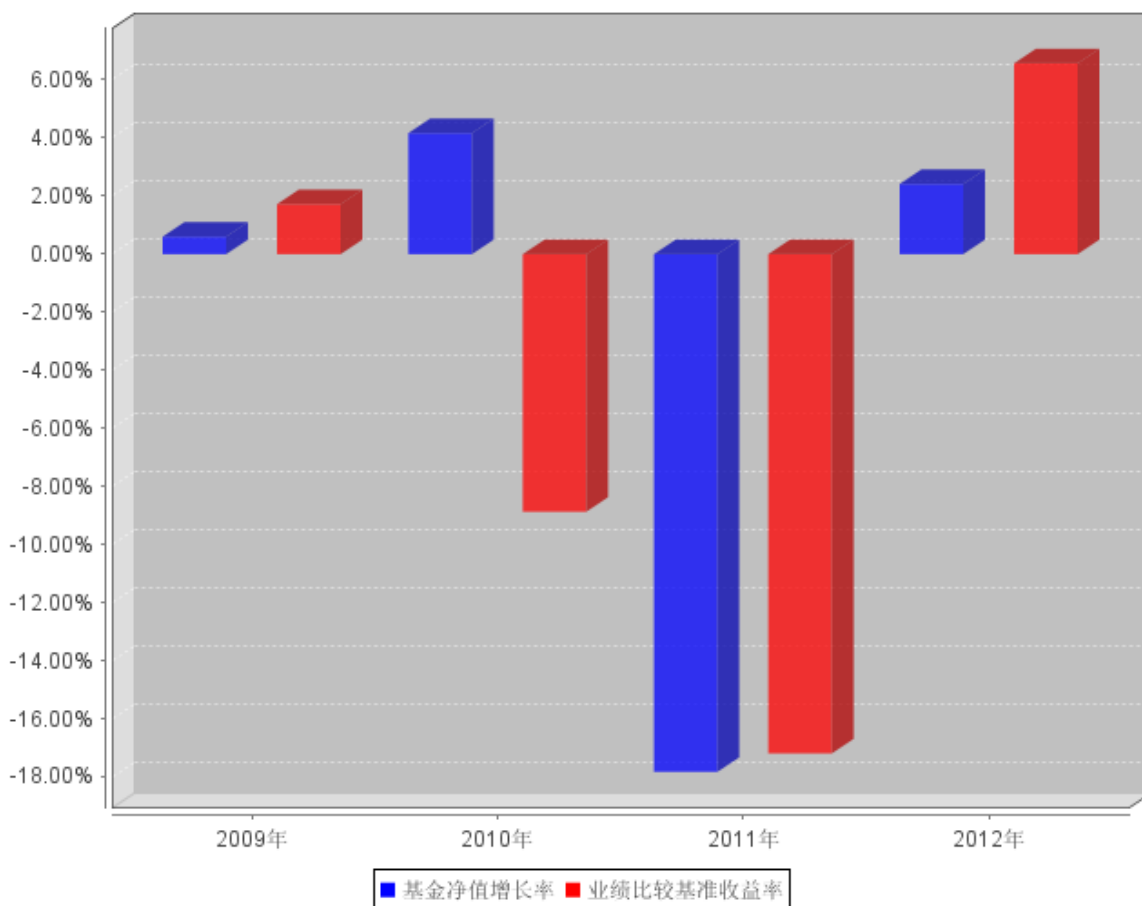
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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
2012年	-	-	-	-	2012年度未分配收益
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
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%；安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。截止2012年12月31日，基金管理人共管理两支封闭式基金、二十三支开放式基金，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，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理，金融工程与量化投资部执行总监。	2009年11月25日	-	6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执行总监，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略股票型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛同辉深证100等权重指数分级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，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，为保证公司管理的所有投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，公司重新修订了《公司公平交易细则》。报告期内，公司根据该细则实际执行情况，对其进行了完善。该细则从研究、投资授权、投资决策、交易执行、投资组合信息隔离、行为监控评估与分析、报告与信息披露等环节对公平交易的管理提出明确要求。

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制。投资组合经理在投资决策委员会授权范围内自主进行投资决策，超越授权范围的投资行为，需依照公司相关制度规定履行审批程序。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，对交易所公开竞价交易，公司开启恒生交易系统中的公平交易程序，对符合公平交易条件的投资指令强制执行公平交易，具体如下：

一、限价指令的执行原则：对于不同限价的同向指令，按照“价格优先、时间优先、同时均分”的原则执行；对于相同限价的同向交易指令，强制执行恒生交易系统中的公平交易程序，按照各投资组合委托数量设置委托比例，按比例具体执行。

二、市价指令的执行原则：对于市价同向交易指令，按照“时间优先”的原则执行交易指令，后到达指令后按照先到指令剩余数量和新到指令数量采用公平委托系统执行；对于同时同向交易指令，强制执行恒生交易系统中的公平交易程序，按照各投资组合委托数量设置委托比例，按比例具体执行。

三、部分限价指令与部分市价指令的执行原则：对于不同投资经理下达的不同类型的同向交易指令，按照“价格优先”的原则执行交易指令，在未满足限价执行条件时，先执行市价指令，后执行限价指令。

---

对债券一级市场申购、非公开发行股票等以公司名义进行的交易，公司依照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

对于银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价的交易，则按照“时间优先、价格优先、同时申报时要求价格差异趋于零且申购量等比分配”的原则进行。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。风险管理部每日通过系统监控不同组合的反向交易等，监控分析发现异常情况时，要求相关人员作出合理性解释备查，每月度出具上月度公平交易监控分析报告，每季度和每年度分别出具公平交易专项分析报告；公司通过系统记录场内异常交易情况，监察稽核部定期对其进行分析评估，每月度出具异常交易总结报告；针对场外交易，监察稽核部每月度对公司旗下所有投资组合场外交易进行专项检查，检查范围包括但不限于：银行间市场、交易所大宗交易等，每月度出具检查报告；监察稽核部对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案、分配过程进行监督，确保分配结果符合公平交易原则。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》各项规定，保证公平对待旗下的每一个投资组合。各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；交易环节中，严格执行集中交易制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；事后监控分析环节中，公司定期对投资组合公平交易情况和异常交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；同时，公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

报告期内，公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》中的规定对公司所有投资组合同向交易价差进行分析，取最近4个季度交易记录，分别以1、3、5日为时间片段分析不同基金间以及公募基金、社保组合、专户组合等大类资产间的同向交易情况。对于同向交易次数足够进行T检验的情况，以95%置信水平对其进行假设检验排查；对于同向交易次数较少的情况考察交易价差对基金净值带来的累计贡献。分析结果显示本投资组合与公司其它组合间同向交易价

---

差未见异常。

本报告期内，公司严格执行了公平交易制度的相关规定。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 37 次，其中 24 次为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易；13 次为长盛同庆封闭式基金转型为指数型基金前的反向交易。

本报告期一季度内，长盛同庆报经公司投资决策委员会批准，打开交易所公开竞价同日反向交易控制，因此而产生 13 笔交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易。具体原因如下：

长盛同庆于 2012 年 5 月 11 日结束三年封闭期，转型为开放式证券投资基金（以下简称“开放式基金”）。为确保转型后的开放式基金保持充裕流动性，以保障基金份额持有人利益，该基金一季度制定了数量化组合投资交易策略，并申请打开与公司旗下其他投资组合交易所市场的反向交易控制。上述申请已报经公司投资决策委员会批准。打开反向交易控制期间，长盛同庆严格执行既定数量化组合投资交易策略，批量下达投资指令。公司交易部对上述指令进行严格审核，在指令分发后，通过恒生交易系统自动委托交易程序执行指令，以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平，杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

本报告期内，未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2012 年中国经济显现触底回升态势，其中第四季度 GDP 升 7.9%，扭转了 GDP 增速连续 6 个季度逐季回落的局面。在改革和城镇化等乐观政策预期下，市场在年末出现大幅反弹。行业表现持续呈高度分化，房地产、金融服务、家用电器、有色金属、建筑建材等早周期行业涨幅较大，信息服务、商业贸易、机械设备、纺织服装、信息设备等行业表现较弱。从风格角度看，价值、低换手风格表现相对较好。

##### **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 0.847 元，本报告期份额净值增长率为 2.42%，同期业绩比较基准增长率为 6.57%。

---

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中观数据显示未来一个季度经济回稳延续，有助于投资者风险偏好的提升。随着政策预期的逐步消化以及情绪的迅速修复，一季度市场大概率将呈现明显的结构分化行情，市场后续的表现取决于经济复苏的力度。我们将密切关注经济数据和市场情绪，及时调整资产、风格和行业配置。

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，保障资产委托人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时敦促有关部门改进、完善，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

1、强调合规培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训等多种方式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，强化员工合规理念，深化员工合规意识，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、强调制度/流程建设，扎实公司内控制度建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，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，保证公司制度/流程的合法合规、全面、适时、有效。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，确保制度/流程严肃性与执行力。报告期内，监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核工作，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、登记注册、产品开发等等；并根据业务发展需要，以及日常监督中发现问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，以保障公司制度/流程的严肃性与执行力。

5、加强员工行为合规的检查监督。报告期内，监察稽核部借助信息技术系统，

---

通过完善员工投资报备系统、建设员工合规档案系统等，提高员工行为合规管理水平，督促员工自觉合规。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，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、受托资产合规运作。

#### **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总经理（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、权益投资部、金融工程与量化投资部、研究部、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十五条中对基金利润分配原则的约定，2012年度未实施利润分配。

本基金截至2012年12月31日，期末可供分配利润为-40,004,516.17元，其中：



---

未分配利润已实现部分为-12,935,543.95 元，未分配利润未实现部分为-27,068,972.22 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

2012 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

2012 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。

### 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 2012 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

### 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(2013)第 21292 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	长盛量化红利策略股票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量化红利策略股票型证券投资基金的财务报表,包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 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	<p>编制和公允列报财务报表是长盛量化红利策略股票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,上述长盛量化红利策略股票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,公允反映了长盛量化红利策略股票型证券投资基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	汪棣	张晓艺
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	2013 年 3 月 20 日	

## § 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：2012年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	64,377,430.98	82,703,708.45
结算备付金		92,918.45	193,565.21
存出保证金		500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	178,434,744.23	172,934,304.82
其中：股票投资		178,434,744.23	172,934,304.82
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	15,336.97	16,616.98
应收股利		-	-
应收申购款		12,346.17	3,159.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>243,432,776.80</b>	<b>256,351,354.59</b>
<b>负债和所有者权益</b>			
	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
<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		21,418,744.73	14,220,177.86
应付赎回款		51,526.56	24,747.16
应付管理人报酬		266,334.47	312,587.18
应付托管费		44,389.08	52,097.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	143,829.77	132,746.69
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	820,065.38	840,093.21
<b>负债合计</b>		<b>22,744,889.99</b>	<b>15,582,449.98</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	260,692,402.98	290,968,666.33
未分配利润	7.4.7.10	-40,004,516.17	-50,199,761.72
<b>所有者权益合计</b>		<b>220,687,886.81</b>	<b>240,768,904.61</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>243,432,776.80</b>	<b>256,351,354.59</b>

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值：0.847 元，基金份额总额：260,692,402.98 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>11,316,904.20</b>	<b>-42,474,671.88</b>
1. 利息收入		478,672.83	566,469.66
其中：存款利息收入	7.4.7.11	478,409.65	560,717.12
债券利息收入		263.18	5,752.54
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）		-25,056,397.86	19,151,639.96
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-28,389,477.30	16,570,842.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	96,117.02	473,606.11
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	3,236,962.42	2,107,191.43
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	7.4.7.16	35,882,825.46	-62,291,900.32
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	7.4.7.17	11,803.77	99,118.82
<b>减：二、费用</b>		<b>5,513,837.53</b>	<b>7,508,893.42</b>
1. 管理人报酬		3,527,063.26	4,577,905.93
2. 托管费		587,843.92	762,984.29
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,077,412.21	1,808,361.46
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	321, 518. 14	359, 641. 74
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>5, 803, 066. 67</b>	<b>-49, 983, 565. 30</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>5, 803, 066. 67</b>	<b>-49, 983, 565. 30</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：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	290, 968, 666. 33	-50, 199, 761. 72	240, 768, 904. 61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5, 803, 066. 67	5, 803, 066. 67
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)	-30, 276, 263. 35	4, 392, 178. 88	-25, 884, 084. 47
其中：1. 基金申购款	11, 556, 941. 67	-1, 468, 954. 04	10, 087, 987. 63
2. 基金赎回款	-41, 833, 205. 02	5, 861, 132. 92	-35, 972, 072. 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)	-	-	-
<b>五、期末所有者权益(基金净值)</b>	<b>260, 692, 402. 98</b>	<b>-40, 004, 516. 17</b>	<b>220, 687, 886. 81</b>
项目	上年度可比期间 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>

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 2013 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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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 2012 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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度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。

##### **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**

###### **7.4.4.3.1 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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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，包括银行存款和其他各类应收款项等。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。

###### **7.4.4.3.2 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其他各类应付款项等。

###### **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，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的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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金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；或者(3)该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### **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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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或者发行价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则按直线法计算。

#### 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为正数，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，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，即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，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本期及上年度可比期间无其他重要的会计政策和会计估计。

### **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、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[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) 对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) 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 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	64,377,430.98	82,703,708.45
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	64,377,430.98	82,703,708.45

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		172,507,762.43	178,434,744.23	5,926,981.80
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		172,507,762.43	178,434,744.23	5,926,981.80
项目		上年度末 2011年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		202,890,148.48	172,934,304.82	-29,955,843.66
债券	-	-	-	-
	-	-	-	-
	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		202,890,148.48	172,934,304.82	-29,955,843.66

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本期末及上年度末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 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应收活期存款利息	15,295.17	16,529.88
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	41.80	87.10
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-

合计	15,336.97	16,616.98
----	-----------	-----------

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
交易所市场应付交易费用	143,829.77	132,746.69
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	143,829.77	132,746.69

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	65.38	93.21
预提费用	320,000.00	340,000.00
合计	820,065.38	840,093.21

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	290,968,666.33	290,968,666.33
本期申购	11,556,941.67	11,556,941.67
本期赎回(以“-”号填列)	-41,833,205.02	-41,833,205.02
本期末	260,692,402.98	260,692,402.98

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,567,276.31	-67,767,038.03	-50,199,761.72
本期利润	-30,079,758.79	35,882,825.46	5,803,066.67
本期基金份额交易产生的变动数	-423,061.47	4,815,240.35	4,392,178.88
其中：基金申购款	315,540.94	-1,784,494.98	-1,468,954.04
基金赎回款	-738,602.41	6,599,735.33	5,861,132.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,935,543.95	-27,068,972.22	-40,004,516.17

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
活期存款利息收入	474,112.06	552,903.82
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	4,295.44	7,807.69
其他	2.15	5.61
合计	478,409.65	560,717.12

#### 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 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
卖出股票成交总额	353,737,048.22	633,632,129.92
减：卖出股票成本总额	382,126,525.52	617,061,287.50
买卖股票差价收入	-28,389,477.30	16,570,842.42

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,697,380.20	5,219,397.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,601,000.00	4,729,000.00
减：应收利息总额	263.18	16,791.19
债券投资收益	96,117.02	473,606.11



#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间未取得衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,236,962.42	2,107,191.43
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,236,962.42	2,107,191.43

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
1. 交易性金融资产	35,882,825.46	-62,291,900.32
——股票投资	35,882,825.46	-61,825,620.92
——债券投资	-	-466,279.40
——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	35,882,825.46	-62,291,900.32

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
基金赎回费收入	11,399.99	99,118.82
基金转换费收入	403.78	-
合计	11,803.77	99,118.82

注：1. 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。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至	上年度可比期间 2011年1月1日至
----	------------------	-----------------------

	2012年12月31日	2011年12月31日
交易所市场交易费用	1,077,412.21	1,808,361.46
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,077,412.21	1,808,361.46

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
审计费用	30,000.00	70,000.00
信息披露费	270,000.00	270,000.00
银行划款手续费	3,518.14	6,141.74
债券托管账户维护费	18,000.00	13,500.00
合计	321,518.14	359,641.74

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局、中国证监会于2012年11月16日联合发布财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（以下简称“通知”），要求个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照本通知的规定计征个人所得税。通知自2013年1月1日起施行。

#### 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
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司 (原“安徽省投资集团有限责任公司”)	基金管理人的股东

注：1. 根据长盛基金公司2012年8月29日《关于公司股东名称变更及公司章程

修改的公告》，长盛基金公司的股东安徽省投资集团有限责任公司更名为安徽省投资集团控股有限公司，相关工商变更登记手续已办理完毕。

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

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	181,610,399.75	25.77%	451,361,277.57	39.62%

##### 7.4.10.1.2 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。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

##### 7.4.10.1.4 应支付关联方佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012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	151,407.05	24.93%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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。

## 7.4.10.2 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 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,527,063.26	4,577,905.93
其中：支付销售机构的客户维护费	778,230.05	1,048,824.19

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%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年 12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	587,843.92	762,984.29

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×0.25%/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

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。

### 7.4.10.4 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011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	11.51%	10.31%

#### 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 2012年12月31日		上年度末 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	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
安徽省投资集团控股有限公司	27,999,980.00	10.74%	27,999,980.00	9.62%
国元证券	9,000,000.00	3.45%	10,000,000.00	3.44%

#### 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 2012年1月1日至 2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至 2011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	64,377,430.98	474,112.06	82,703,708.45	552,903.82

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2012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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	12/12/26	重大事项	10.12	13/01/21	11.13	383,882	3,423,852.57	3,884,885.84	-
合计								3,423,852.57	3,884,885.84	

注：本基金截至 2012 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 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中作为抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 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

本基金是一支进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、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风险管理部负责，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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，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。

于2012年12月31日，本基金未持有信用类债券(2011年12月31日：本基金未持有信用类债券)。

#### **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的发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此均能以合理的价格适时变现。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。

于 2012 年 12 月 31 日，本基金所承担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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、应收申购款等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 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	64,377,430.98	-	-	-	64,377,430.98
结算备付金	92,918.45	-	-	-	92,918.45
存出保证金	-	-	-	500,000.00	500,000.00



交易性金融资产	-	-	-	178,434,744.23	178,434,744.23
应收利息	-	-	-	15,336.97	15,336.97
应收申购款	-	-	-	12,346.17	12,346.17
<b>资产总计</b>	<b>64,470,349.43</b>	-	-	<b>178,962,427.37</b>	<b>243,432,776.80</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	21,418,744.73	21,418,744.73
应付赎回款	-	-	-	51,526.56	51,526.56
应付管理人报酬	-	-	-	266,334.47	266,334.47
应付托管费	-	-	-	44,389.08	44,389.08
应付交易费用	-	-	-	143,829.77	143,829.77
其他负债	-	-	-	820,065.38	820,065.38
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>22,744,889.99</b>	<b>22,744,889.99</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>64,470,349.43</b>	-	-	<b>156,217,537.38</b>	<b>220,687,886.81</b>
上年度末 2011年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	82,703,708.45	-	-	-	82,703,708.45
结算备付金	193,565.21	-	-	-	193,565.21
存出保证金	-	-	-	500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	-	-	-	172,934,304.82	172,934,304.82
应收利息	-	-	-	16,616.98	16,616.98
应收申购款	-	-	-	3,159.13	3,159.13
<b>资产总计</b>	<b>82,897,273.66</b>	-	-	<b>173,454,080.93</b>	<b>256,351,354.59</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	14,220,177.86	14,220,177.86
应付赎回款	-	-	-	24,747.16	24,747.16
应付管理人报酬	-	-	-	312,587.18	312,587.18
应付托管费	-	-	-	52,097.88	52,097.88
应付交易费用	-	-	-	132,746.69	132,746.69
其他负债	-	-	-	840,093.21	840,093.21
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>15,582,449.98</b>	<b>15,582,449.98</b>
<b>利率风险敞口</b>	<b>82,897,273.66</b>	-	-	<b>157,871,630.95</b>	<b>240,768,904.61</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

于2012年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2011年12月31日：同)。

#### 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资产净值的 60%-95%，债券、现金及其它短期金融工具为 0%-40%，权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%。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 2012年12月31日		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值的比例 (%)	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	178,434,744.23	80.85	172,934,304.82	71.83
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	178,434,744.23	80.85	172,934,304.82	71.83

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
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 (2012年12月31日)	上年度末 (2011年12月31日)
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加 11,034,394.34	增加 13,341,092.70
业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少 11,034,394.34	减少 13,341,092.70	

#### 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

##### (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) 各层级金融工具公允价值

于2012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174,549,858.39元，第二层级余额为3,884,885.84元，无属于第三层级的余额(2011年12月31日：第一层级172,934,304.82元，无属于第二、三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(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	178,434,744.23	73.30
	其中：股票	178,434,744.23	73.30
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	64,470,349.43	26.48
6	其他资产	527,683.14	0.22
7	<b>资产合计</b>	<b>243,432,776.80</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	1,310,848.00	0.59
B	采掘业	10,193,794.79	4.62
C	制造业	91,183,713.32	41.32
C0	食品、饮料	13,512,481.20	6.12
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	10,454,154.46	4.74
C5	电子	2,216,913.20	1.00
C6	金属、非金属	7,363,876.75	3.34
C7	机械、设备、仪表	44,097,354.18	19.98
C8	医药、生物制品	11,294,963.03	5.12

C99	其他制造业	2,243,970.50	1.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,494,791.40	2.94
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	10,592,970.39	4.80
G	信息技术业	6,641,523.59	3.01
H	批发和零售贸易	8,899,191.18	4.03
I	金融、保险业	29,428,279.53	13.33
J	房地产业	8,679,729.04	3.93
K	社会服务业	1,962,220.60	0.89
L	传播与文化产业	2,938,190.49	1.33
M	综合类	109,491.90	0.05
	合计	178,434,744.23	80.85

### 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	600016	民生银行	1,213,457	9,537,772.02	4.32%
2	600000	浦发银行	728,334	7,225,073.28	3.27%
3	601318	中国平安	136,487	6,181,496.23	2.80%
4	601088	中国神华	238,397	6,043,363.95	2.74%
5	601006	大秦铁路	729,695	4,932,738.20	2.24%
6	600048	保利地产	352,562	4,794,843.20	2.17%
7	000858	五粮液	156,814	4,426,859.22	2.01%
8	002275	桂林三金	282,293	3,904,112.19	1.77%
9	000002	万科A	383,882	3,884,885.84	1.76%
10	600582	天地科技	336,921	3,824,053.35	1.73%
11	600900	长江电力	538,880	3,702,105.60	1.68%
12	600030	中信证券	246,625	3,294,910.00	1.49%
13	601628	中国人寿	149,020	3,189,028.00	1.45%
14	000895	双汇发展	51,571	2,985,960.90	1.35%
15	600104	上海汽车	151,707	2,676,111.48	1.21%
16	600741	华域汽车	231,171	2,584,491.78	1.17%
17	002277	家润多	277,653	2,509,983.12	1.14%
18	600309	烟台万华	159,853	2,495,305.33	1.13%
19	000581	威孚高科	75,289	2,401,719.10	1.09%
20	600426	华鲁恒升	307,496	2,383,094.00	1.08%
21	601299	中国北车	516,325	2,328,625.75	1.06%
22	600718	东软集团	294,434	2,264,197.46	1.03%
23	300240	飞力达	208,794	2,194,424.94	0.99%
24	600897	厦门空港	164,270	2,156,865.10	0.98%
25	601369	陕鼓动力	216,951	1,956,898.02	0.89%
26	601717	郑煤机	186,012	1,919,643.84	0.87%
27	002385	大北农	86,035	1,858,356.00	0.84%
28	000012	南玻A	224,765	1,854,311.25	0.84%

29	600859	王府井	76,966	1,844,105.36	0.84%
30	601989	中国重工	369,100	1,760,607.00	0.80%
31	600521	华海药业	151,735	1,729,779.00	0.78%
32	300214	日科化学	135,422	1,713,088.30	0.78%
33	000999	三九医药	71,149	1,686,231.30	0.76%
34	000568	泸州老窖	45,622	1,615,018.80	0.73%
35	600386	北巴传媒	230,751	1,594,489.41	0.72%
36	002247	帝龙新材	113,987	1,538,824.50	0.70%
37	000768	西飞国际	181,000	1,505,920.00	0.68%
38	600038	哈飞股份	79,200	1,490,544.00	0.68%
39	600893	航空动力	117,564	1,484,833.32	0.67%
40	600055	万东医疗	172,101	1,481,789.61	0.67%
41	600519	贵州茅台	7,038	1,471,082.76	0.67%
42	600511	国药股份	99,910	1,455,688.70	0.66%
43	000410	沈阳机床	233,300	1,444,127.00	0.65%
44	600529	山东药玻	162,255	1,444,069.50	0.65%
45	300020	银江股份	112,408	1,436,574.24	0.65%
46	600329	中新药业	135,275	1,433,915.00	0.65%
47	600388	龙净环保	65,100	1,425,690.00	0.65%
48	600123	兰花科创	70,080	1,421,923.20	0.64%
49	000837	秦川发展	259,274	1,415,636.04	0.64%
50	600008	首创股份	322,100	1,407,577.00	0.64%
51	000880	潍柴重机	169,564	1,405,685.56	0.64%
52	002350	北京科锐	134,010	1,400,404.50	0.63%
53	600323	南海发展	212,440	1,385,108.80	0.63%
54	000598	蓝星清洗	187,300	1,384,147.00	0.63%
55	600475	华光股份	135,169	1,359,800.14	0.62%
56	601928	凤凰传媒	198,186	1,343,701.08	0.61%
57	000157	中联重科	145,658	1,341,510.18	0.61%
58	600195	中牧股份	104,537	1,319,256.94	0.60%
59	000713	丰乐种业	121,600	1,310,848.00	0.59%
60	300145	南方泵业	66,947	1,269,315.12	0.58%
61	600062	双鹤药业	53,818	1,221,668.60	0.55%
62	002570	贝因美	52,319	1,155,203.52	0.52%
63	600271	航天信息	58,627	868,852.14	0.39%
64	002179	中航光电	59,482	808,955.20	0.37%
65	000861	海印股份	56,700	799,470.00	0.36%
66	002322	理工监测	50,200	793,160.00	0.36%
67	300019	硅宝科技	66,600	785,880.00	0.36%
68	300180	华峰超纤	70,844	780,700.88	0.35%
69	002255	海陆重工	56,500	772,920.00	0.35%
70	002226	江南化工	63,435	772,003.95	0.35%
71	300225	金力泰	75,700	767,598.00	0.35%
72	300048	合康变频	102,239	764,747.72	0.35%

73	601311	骆驼股份	87,393	764,688.75	0.35%
74	002091	江苏国泰	90,200	763,994.00	0.35%
75	600785	新华百货	52,500	763,875.00	0.35%
76	002534	杭锅股份	55,640	763,380.80	0.35%
77	600628	新世界	112,900	762,075.00	0.35%
78	300222	科大智能	58,140	759,889.80	0.34%
79	002025	航天电器	66,900	758,646.00	0.34%
80	300079	数码视讯	46,000	757,160.00	0.34%
81	601058	赛轮股份	99,800	756,484.00	0.34%
82	002638	勤上光电	71,101	753,670.60	0.34%
83	002527	新时达	61,918	753,542.06	0.34%
84	002335	科华恒盛	83,600	750,728.00	0.34%
85	002629	仁智油服	47,800	744,246.00	0.34%
86	600835	上海机电	92,211	743,220.66	0.34%
87	000778	新兴铸管	112,358	725,832.68	0.33%
88	002003	伟星股份	73,300	705,146.00	0.32%
89	000629	攀钢钢钒	164,900	679,388.00	0.31%
90	000708	大冶特钢	91,800	678,402.00	0.31%
91	002065	东华软件	48,085	676,075.10	0.31%
92	002492	恒基达鑫	53,908	673,850.00	0.31%
93	000983	西山煤电	48,100	669,071.00	0.30%
94	000401	冀东水泥	48,200	665,160.00	0.30%
95	000877	天山股份	70,046	659,833.32	0.30%
96	600188	兖州煤业	36,110	658,285.30	0.30%
97	601666	平煤股份	76,921	656,905.34	0.30%
98	002233	塔牌集团	78,200	656,880.00	0.30%
99	600839	四川长虹	315,200	649,312.00	0.29%
100	300047	天源迪科	54,821	638,664.65	0.29%
101	000089	深圳机场	164,959	635,092.15	0.29%
102	000888	峨眉山A	29,952	578,073.60	0.26%
103	600805	悦达投资	9,201	109,491.90	0.05%

#### 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	601318	中国平安	10,944,084.23	4.55
2	600028	中国石化	9,190,647.00	3.82
3	600000	浦发银行	9,105,206.00	3.78
4	002275	桂林三金	8,904,803.21	3.70
5	601088	中国神华	8,418,199.66	3.50
6	601898	中煤能源	7,032,957.72	2.92
7	002385	大北农	5,765,961.81	2.39
8	000858	五粮液	5,330,616.00	2.21

9	600329	中新药业	4,850,106.45	2.01
10	601628	中国人寿	4,726,581.75	1.96
11	601006	大秦铁路	4,563,000.00	1.90
12	600582	天地科技	4,384,295.94	1.82
13	600795	国电电力	3,949,036.00	1.64
14	000598	蓝星清洗	3,945,941.20	1.64
15	600271	航天信息	3,944,798.37	1.64
16	002629	仁智油服	3,883,603.50	1.61
17	000568	泸州老窖	3,837,077.01	1.59
18	002073	青岛软控	3,822,894.72	1.59
19	002065	东华软件	3,812,825.89	1.58
20	600195	中牧股份	3,798,899.02	1.58

#### 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	600000	浦发银行	10,832,700.59	4.50
2	600036	招商银行	9,786,719.85	4.06
3	600028	中国石化	8,669,164.14	3.60
4	000024	招商地产	8,257,746.91	3.43
5	601328	交通银行	6,831,413.32	2.84
6	601601	中国太保	6,357,890.02	2.64
7	600060	海信电器	5,961,930.21	2.48
8	600585	海螺水泥	5,798,801.22	2.41
9	601898	中煤能源	5,625,622.59	2.34
10	601318	中国平安	5,283,139.88	2.19
11	000527	美的电器	5,101,352.09	2.12
12	600016	民生银行	4,991,724.96	2.07
13	002275	桂林三金	4,704,829.50	1.95
14	000028	一致药业	4,632,669.84	1.92
15	601006	大秦铁路	4,541,957.56	1.89
16	000039	中集集团	4,403,538.67	1.83
17	601788	光大证券	4,385,879.91	1.82
18	600048	保利地产	4,324,032.30	1.80
19	600362	江西铜业	4,148,833.15	1.72
20	002385	大北农	3,871,106.35	1.61

#### 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	351,744,139.47
卖出股票收入（成交）总额	353,737,048.22

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。

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	15,336.97
5	应收申购款	12,346.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	527,683.14

## 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	3,884,885.84	1.76	重大事项停牌

---

#### 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
8,715	29,913.07	69,235,405.88	26.56%	191,456,997.10	73.44%

### 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	122,280.16	0.05%

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

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份(含)。

## § 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	290,968,666.33
本报告期基金总申购份额	11,556,941.67
减：本报告期基金总赎回份额	41,833,205.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	260,692,402.98

## § 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 2012 年 8 月 16 日发布关于公司高级管理人员变动的公告，朱剑彪因个人原因辞职，经董事会决议解聘其公司副总经理职务，并已按规定向中国证监会和北京证监局报告。

#### 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 50,000.00 元，已连续为本基金提供审计服务 3 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	-	-	-	-	-	-
国元证券	1	181,610,399.75	25.77%	-	-	151,407.05	24.93%
光大证券	1	376,186,650.88	53.37%	1,697,380.20	100.00%	327,518.35	53.92%
招商证券	1	147,013,967.54	20.86%	-	-	128,502.30	21.16%

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：无

(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	关于旗下部分基金参加中国工商银行定投申购优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2012-12-28
2	长盛量化红利策略股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2012-12-26
3	关于旗下部分基金参加中国银行网银、手机银行基金申购及基金定投业务费率优惠活动的公告	同上	2012-12-01
4	关于增加山西证券为旗下开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务的公告	同上	2012-11-16
5	关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2012-10-08
6	关于增加华融证券为旗下开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2012-09-25
7	关于旗下部分基金参加兴业银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	同上	2012-09-07
8	关于公司股东名称变更及公司章程修改的公告	同上	2012-08-29
9	长盛基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2012-08-16
10	关于增加华鑫证券为旗下开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务的公告	同上	2012-08-15
11	关于增加江海证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出网上交易申购费率优惠及定期定额投资业务的公告	同上	2012-07-23
12	关于新增好买基金为旗下部分开放式基金代销机构的公告	同上	2012-07-13
13	关于旗下部分基金参加中国银行手机银行基金申购费率优惠活动的公告、关于旗下部分基金参加中信银行股份有限公司网上银行与移动银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2012-07-02
14	关于增加华龙证券为旗下开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务的公告	同上	2012-06-29
15	关于增加国金证券为旗下开放式基金代销机构的公告	同上	2012-06-29
16	关于增加中国国际金融有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	同上	2012-06-29
17	长盛基金管理有限公司关于增加众禄基金为旗下部分基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2012-06-13
18	长盛量化红利策略股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2012-06-12
19	长盛基金管理有限公司关于增加诺亚正行为旗下部分基金代销机构并推出定期定额投资业务的公告	同上	2012-06-11
20	关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行基金申	同上	2012-04-28

	购费率优惠活动的公告		
21	关于旗下部分开放式基金参与申银万国证券申购费率优惠及定期定额投资业务的公告	同上	2012-04-20
22	长盛基金管理有限公司上海分公司注册地址及负责人变更的公告	同上	2012-04-17
23	关于在部分代销机构开通旗下基金转换业务的公告	同上	2012-03-15
24	关于增加五矿证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出网上申购费率优惠活动的公告	同上	2012-02-01
25	关于增加民生证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务的公告	同上	2012-02-01
26	长盛基金管理有限公司关于开通旗下部分基金转换业务的公告	同上	2012-01-16

---

## § 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、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 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和/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>。