（上接B162版）

报告截止日：2012年5月11日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

资产	本期末 2012年5月11日 （基金合同失效前日）	上年度末 2011年12月31日
资产：		
银行存款	12,815,591,683.55	1,317,365,083.78
结算备付金	109,411,764.71	10,979,311.55
存出保证金	3,851,025.44	8,440,908.16
交易性金融资产	5,861,400.96	8,280,594,406.28
其中：股票投资	5,861,400.96	8,280,594,406.28
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	12,800,000,000.00	2,557,755,036.63
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,153,172.17	4,198,253.83
应收股利	587,015.05	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	25,736,456,061.88	12,179,333,000.23

负债和所有者权益	本期末 2012年5月11日 （基金合同失效前日）	上年度末 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	12,791,421,883.57	287,371,260.96
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	5,832,845.46	15,576,296.71
应付托管费	972,140.90	2,596,049.44
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	10,821,607.65	10,579,332.70
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,179,177.28	2,430,000.00
负债合计	12,811,227,654.86	318,552,939.81
所有者权益：		
实收基金	14,686,733,239.06	14,686,733,239.06
未分配利润	-1,761,504,832.04	-2,825,953,178.64
所有者权益合计	12,925,228,407.02	11,860,780,060.42
负债和所有者权益总计	25,736,456,061.88	12,179,333,000.23

注：报告截止日2012年5月11日（基金合同失效前日），基金份额净值0.880元，基金份额总额14,686,733,239.06份，其中A类基金份额总额5,874,693,295.62份；B类基金份额总额8,812,039,943.44份。

8.2 利润表

会计主体：长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年5月11日 （基金合同失效前日）	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
一、收入	1,177,798,284.31	-3,420,648,896.57
1.利息收入	36,602,508.96	102,091,953.73
其中：存款利息收入	2,613,809.73	19,501,109.82
债券利息收入	-	10,168.99
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	33,988,699.23	82,580,674.92
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”号填列）	304,589,001.44	-2,020,895,858.91
其中：股票投资收益	299,327,595.28	-2,089,217,189.06
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	5,323,033.41
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	5,261,406.16	62,998,296.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	836,606,773.91	-1,501,844,991.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	113,349,937.71	349,639,255.00
1.管理人报酬	67,733,436.13	218,305,225.25
2.托管费	11,288,906.02	36,384,204.19
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	34,114,096.57	94,403,572.68
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	213,498.99	546,252.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,064,448,346.60	-3,770,288,151.57
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,064,448,346.60	-3,770,288,151.57

8.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）		
	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）	14,686,733,239.06	-2,825,953,178.64	11,860,780,060.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,064,448,346.60	1,064,448,346.60
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	14,686,733,239.06	-1,761,504,832.04	12,925,228,407.02

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）	14,686,733,239.06	944,334,972.93	15,631,068,211.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,770,288,151.57	-3,770,288,151.57
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	14,686,733,239.06	-2,825,953,178.64	11,860,780,060.42

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告8.1至8.4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

8.4 报表附注

8.4.1 基金基本情况

长盛同庆可分离交易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]第209号《关于核准长盛同庆可分离交易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公募证券投资基金法》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金，封闭期为三年（含三年），封闭期届满后转为上市开放式基金（LOF），首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币14,685,567,143.82元（其中场内募集人民币4,853,047,143.82元，场外募集人民币9,832,520,000.00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093号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》于2009年5月12日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为14,686,733,239.06份，其中认购资金利息折合1,166,095.24份，按照基金合同约定的4:6比例份额分离为同庆A基金份额5,874,693,295.62份和同庆B基金份额8,812,039,943.44份。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金基金合同生效后，在封闭期内，基金份额持有人的总认购份额自动按4:6的比例分离成预期收益与风险不同的两个份额类别，即稳健收益类基金份额（基金份额简称“同庆A基金份额”）和积极收益类基金份额（基金份额简称“同庆B基金份额”），两类基金份额的基金资产合并运作。在封闭期末，本基金净资产优先分配同庆A基金份额的本金及约定应得收益；在优先分配同庆A基金份额的本金及约定应得收益后本基金的剩余净资产分配予同庆B基金份额。

深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2009]第2009号文审核同意，本基金13,216,295,898.00份基金份额于2009年5月26日在深交所挂牌交易（其中同庆A基金份额为5,285,105,718.00份，同庆B基金份额为7,931,190,180.00份）。在封闭期内，同庆A与同庆B两类基金份额同时在深交所分别上市和交易。初始基金份额持有人或二级市场投资者可以在市场内单独交易同庆A或者同庆B份额。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据本基金份额持有人大会于2012年4月10日决议通过的《关于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型有关事项的议案》以及中国证监会证监许可字[2012]549号《关于核准长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于2012年4月26日发布了《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议公告》，并向深圳证券交易所申请终止同庆A、同庆B基金份额的上市交易，并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2012]116号）的同意。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、中国证监会《关于核准长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》等的有关规定，长盛同庆基金于2012年5月11日进行终止上市权利登记，2012年5月12日终止上市。《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》自终止上市日起失效，《长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金合同》于同一日起生效，同时本基金更名为长盛同庆中证800指数分级证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同庆可分离交易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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金类别资产配置比例为：封闭期内股票投资占基金资产的比例为60%-100%，债券投资占基金资产的0%—40%；封闭期后股票投资占基金资产的比例为60%-95%，债券投资占基金资产的5%—40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中，权证投资比例占基金资产净值的比例不高于3%。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中证全债指数收益率×30%。

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。

8.4.2 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》、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注8.4.4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。

根据《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金存续期至2012年5月11日终止。经中国证监会批准并经深交所同意，本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司已于本基金合同失效日将本基金转型为长盛同庆中证800指数分级证券投资基金，并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

8.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）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2012年5月11日（基金合同失效前日）的财务状况以及2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

8.4.4 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。

8.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

8.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期及上年度可比期间不存在会计政策变更。

8.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期及上年度可比期间不存在会计估计变更。

8.4.5.3 差错更正的说明

本报告期及上年度可比期间不存在差错更正。

8.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局[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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

（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。

8.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构
国元证券	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团有限责任公司（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。

8.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

8.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

8.4.8.1.1 股票交易

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）		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	415,586,340.92	2.19%	18,905,523,365.87	31.10%

8.4.8.1.2 债券交易

长盛同庆封闭本报告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。

8.4.8.1.3 权证交易

长盛同庆封闭本报告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。

8.4.8.1.4 应支付关联方佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）			
	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	353,247.48	2.21%	-	-

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	16,069,635.20	31.53%	3,805,033.05	36.12%

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。

8.4.8.2 关联方报酬

8.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年5月11日 （基金合同失效前日）	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	67,733,436.13	218,305,225.25
其中：支付给销售机构的客户维护费	269,822.69	882,812.71

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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×1.50%/当年天数。

8.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）	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	11,288,906.02	36,384,204.19

注：支付基金托管人中国建设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。

8.4.8.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）					
	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
中国建设银行	-	-	-	-	-	-

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日					
	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
中国建设银行	-	-	5,068,455,000.00	3,137,486.58	-	-

8.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

8.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资长盛同庆封闭份额。

8.4.8.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方本报告期及上年度可比期间未投资长盛同庆封闭份额。

8.4.8.5 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 2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日）		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
中国建设银行	12,815,591,683.55	2,380,201.97	1,317,365,083.78	18,125,368.66

注：长盛同庆封闭的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

8.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

长盛同庆封闭本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

8.4.8.7 其他关联交易事项的说明

长盛同庆封闭本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

8.4.9 期末（2012年5月11日（基金合同失效前日））长盛同庆封闭持有的流通受限证券

8.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

长盛同庆封闭本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

8.4.9.2 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	
600096	云天化	12/02/10	重大事宜	16.04	12/06/06	17.64	365,424	5,086,275.83	5,861,400.96	

注：长盛同庆封闭截至2012年5月11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。

8.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

8.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

长盛同庆封闭本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

8.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

长盛同庆封闭本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

8.4.10 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

（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）各层级金融工具公允价值

于2012年5月11日（基金合同失效前日），长盛同庆封闭持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为5,861,400.96元，无属于第一、三层级的余额（2011年12月31日：第一层级8,280,594,406.28元，无属于第二、三层级的余额）。

（c）公允价值所属层级间的重大变动

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，长盛同庆封闭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。

（d）第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2、除公允价值外，截至资产负债表日长盛同庆封闭无需要说明的其他重要事项。

§9 投资组合报告（长盛同庆中证800分级）

（报告期为2012年5月12日（基金合同生效日）至2012年12月31日）

9.1 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	4,403,403,737.07	93.69
	其中：股票	4,403,403,737.07	93.69
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	226,619,173.55	4.82
6	其他各项资产	69,966,542.87	1.49
7	合计	4,699,989,453.49	100.00

9.2 期末按行业分类的股票投资组合

9.2.1 期末指数投资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	33,162,843.77	0.71
B	采掘业	362,462,591.72	7.81
C	制造业	1,674,778,337.30	36.09
C0	食品、饮料	239,511,803.29	5.16
C1	纺织、服装、皮毛	47,074,497.16	1.01
C2	木材、家具	4,546,271.88	0.10
C3	造纸、印刷	16,085,067.99	0.35
C4	石油、化学、塑胶、塑料	162,802,440.20	3.51
C5	电子	102,852,998.59	2.22
C6	金属、非金属	316,700,349.12	6.82
C7	机械、设备、仪表	506,843,621.22	10.92
C8	医药、生物制品	262,588,405.91	5.66
C99	其他制造业	15,772,881.94	0.34
D	电力、煤气及水的生产和供应业	112,183,351.29	2.42
E	建筑业	96,528,873.56	2.08
F	交通运输、仓储业	118,193,335.83	2.55
G	信息技术业	140,200,751.28	3.02
H	批发和零售贸易	131,383,555.39	2.83
I	金融、保险业	1,173,425,329.03	25.28
J	房地产业	301,613,840.94	6.50
K	社会服务业	62,526,772.15	1.35
L	传播与文化产业	32,304,136.84	0.70
M	综合类	89,463,412.40	1.93
	合计	4,328,227,131.50	93.26

9.2.2 期末积极投资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	41,988,126.95	0.90
C0	食品、饮料	4,608,826.44	0.10
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	1,012,179.00	0.02
C5	电子	10,636,486.95	0.23
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	6,580,276.00	0.14
C8	医药、生物制品	19,150,358.56	0.41
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	10,513,783.80	0.23
E	建筑业	9,638,889.60	0.21
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	4,671,080.43	0.10
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	3,939,635.00	0.08
K	社会服务业	4,425,089.79	0.10
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	75,176,605.57	1.62

9.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

9.3.1 期末指数投资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	600036	招商银行	9,223,047	126,816,896.25	2.73
2	600016	民生银行	14,926,142	117,319,476.12	2.53
3	000002	万 科A	11,121,320	112,547,758.40	2.43
4	601318	中国平安	2,179,817	98,723,911.93	2.13
5	601166	兴业银行	5,023,448	83,841,347.12	1.81
6	600000	浦发银行	7,420,717	73,613,512.64	1.59
7	601398	工商银行	17,364,248	72,061,629.20	1.55
8	601328	交通银行	12,968,229	64,063,051.26	1.38
9	600030	中信证券	4,537,958	60,627,118.88	1.31
10	600519	贵州茅台	274,320	57,338,366.40	1.24

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。

9.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002236	大华股份	197,417	9,150,277.95	0.20
2	600582	天地科技	579,760	6,580,276.00	0.14
3	600422	昆明制药	300,898	5,858,484.06	0.13
4	002375	亚厦股份	209,770	5,554,709.60	0.12
5	600027	华电国际	1,348,110	5,311,553.40	0.11

9.4 报告期内股票投资组合的重大变动

9.4.1 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	601398	工商银行	207,662,112.48	4.47
2	601328	交通银行	205,492,731.46	4.43
3	600016	民生银行	205,155,361.12	4.42
4	600036	招商银行	205,005,081.79	4.42
5	000002	万 科A	169,845,416.38	3.66
6	601318	中国平安	163,466,158.37	3.52
7	601166	兴业银行	150,230,376.69	3.24
8	600000	浦发银行	142,693,715.99	3.07
9	601288	农业银行	125,291,707.39	2.70
10	600519	贵州茅台	120,632,375.59	2.60
11	600030	中信证券	117,856,150.81	2.54
12	601088	中国神华	114,591,033.93	2.47
13	600837	海通证券	97,074,930.63	2.09
14	000858	五 粮 液	96,898,437.72	2.09
15	600111	包钢稀土	93,023,733.29	2.00
16	601601	中国太保	74,700,883.09	1.61
17	600048	保利地产	74,681,054.58	1.61
18	000157	中联重科	71,089,784.92	1.53
19	000651	格力电器	63,379,734.38	1.37
20	600031	三一重工	60,724,365.58	1.31

9.4.2 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	601328	交通银行	152,954,821.61	3.30
2	601398	工商银行	137,829,388.03	2.97
3	600016	民生银行	112,776,665.60	2.43
4	600036	招商银行	98,354,734.49	2.12
5	601166	兴业银行	85,673,943.58	1.85
6	601288	农业银行	83,280,266.50	1.79
7	600000	浦发银行	78,282,637.86	1.69
8	601318	中国平安	73,602,085.32	1.59
9	000002	万 科A	71,051,815.88	1.53
10	600519	贵州茅台	59,700,387.50	1.29
11	600030	中信证券	55,913,365.57	1.20
12	000858	五 粮 液	55,832,086.75	1.20
13	601088	中国神华	55,115,536.38	1.19
14	600111	包钢稀土	51,631,807.53	1.11
15	600837	海通证券	43,205,495.19	0.93
16	000024	招商地产	43,051,501.38	0.93
17	000157	中联重科	41,367,703.07	0.89
18	600048	保利地产	40,955,264.61	0.88
19	000100	TCL集团	38,739,284.14	0.83
20	600199	金种子酒	36,114,440.21	0.78

9.4.3 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	11,473,990,265.41
卖出股票收入（成交）总额	6,819,967,571.97

注：本项中9.4.1、9.4.2、9.4.3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。

9.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

9.6 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

本基金报告期末未持有债券。

9.7 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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

9.8 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。

9.9 投资组合报告附注

9.9.1 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，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

9.9.2 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。

9.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,750,000.00
2	应收证券清算款	68,167,190.91
3	应收股利	-
4	应收利息	49,351.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,966,542.87

9.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

9.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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	112,547,758.40	2.43	重大事项停牌

9.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

9.9.6 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。

§10 投资组合报告（长盛同庆封闭）

（报告期为2012年1月1日至2012年5月11日（基金合同失效前日））

10.1 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	5,861,400.96	0.02
	其中：股票	5,861,400.96	0.02
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	12,800,000,000.00	49.73
	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