长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金

2012 年度报告摘要

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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2013年3月26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。

基金托管人中国建设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2012年9月13日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛同辉深100等权重分级		
基金主代码	160809		
交易代码	160809		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年9月13日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	257,341,420.13份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012年9月26日		
下属三级基金的基金简称	长盛同辉深100等权重A	长盛同辉深100等权重B	长盛同辉深100等权重分级
下属三级基金的交易代码	150108	150109	160809
报告期末下属三级基金的份额总额	111,748,685.00份	111,748,686.00份	33,844,049.13份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现对深证100等权重指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金采用完全复制法,按照成份股在深证100等权重指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪深证100等权重指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 当预期成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪深证100等权重指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。		
业绩比较基准	95%×深证100等权重指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)		
风险收益特征	从基金资产整体运作来看,本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 从投资者具体持有的基金份额来看,在分级运作期内,由于基金收益分配的安排,长盛同辉深100等权重A份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额;长盛同辉深100等权重B份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。		
下属分级基金的风险收益特征	长盛同辉深100等权重A:低风险、收益相对稳定	长盛同辉深100等权重B:高风险、高预期收益	长盛同辉深100等权重分级:较高风险、较高预期收益

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	010-67595096
传真		010-82255988	010-66275853

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

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9月13日(基金合同生效日)—2012年12月31日
本期已实现收益	3,026,241.08
本期利润	22,077,455.82
加权平均基金份额本期利润	0.0512
本期基金份额净值增长率	7.10%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0063
期末基金资产净值	275,573,151.45
期末基金份额净值	1.071

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。表中的"期末"均指本报告期最后一日,即12月31日。

4、本基金基金合同生效日为2012年9月13日,截至本报告期末本基金成立未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.21%	1.39%	4.10%	1.38%	1.11%	0.01%
自基金合同生效起至今	7.10%	1.28%	1.14%	1.45%	5.96%	-0.17%

注:本基金业绩比较基准=95%×深证100等权重指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)。

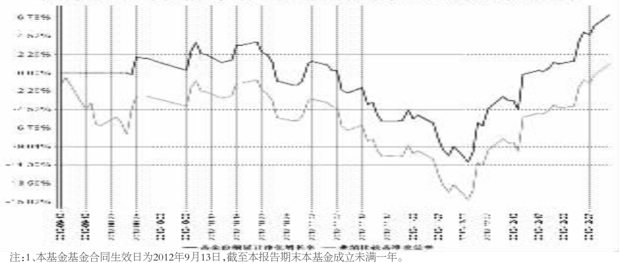
基准指数:深证100等权重指数

本基金的业绩比较基准深证100等权重指数由深圳证券交易所和深圳证券信息有限公司构建和发布。具体的编制规则和再平衡过程请参见深证100等权重指数编制细则。(网址为:

http://www.cnindex.com.cn/zstx/szxl/clzs/201206/t20120619_319746.htm)

再平衡:由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,业绩比较基准中深证100等权重指数、一年期银行定期存款每日按照95%、5%的比例采取再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

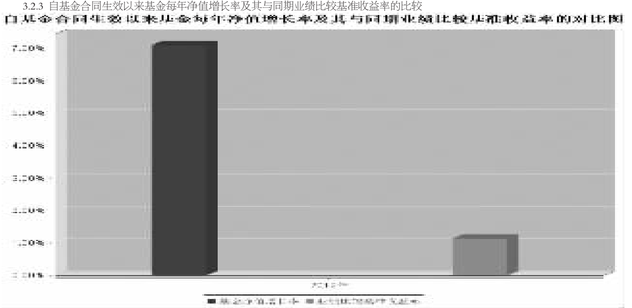
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同生效日为2012年9月13日,截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,报告期末已完成建仓,但报告期末距建仓结束不满一年。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十六条(二)投资范围、(八)投资限制的有关约定。截止报告日,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



注:本基金基金合同生效日为2012年9月13日,合同生效当年按实际存续期计算,未按整个自然年度折算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	-	-	-	-	2012年度未分配收益
合计	-	-	-	-	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6号文件批准,于1999年3月成立,注册资本为人民币15000万元。目前,本公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司(以下简称"国元证券")占注册资本的41%;新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%;安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%;安徽省投资集团控股有限公司(原"安徽省投资集团有限责任公司")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,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,金融工程与量化投资部执行总监。	2012年9月13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基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金(本基金)基金经理。

注:1、报经中国证券投资基金业协会同意,目前王超同志担任长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理,与刘斌同志共同管理。该事项公司已于2013年1月8日进行公告。

2、上表基金经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;

3、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛同辉深证100等权重指数分级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

自本基金2012年9月13日成立至报告期末,深证100EW指数经历了先小幅下跌,后大幅反弹的"V"型走势,在基金成立初期,考虑到2012年全年指数震荡下行,当时指数较年初反弹高点已经下跌15%,此时投资者参与指数分级基金更多是为了博取指数反弹收益,对于指数分级基金能否准确复制指数更加在意,因此,本基金在成立之初,即采取快速建仓策略,使基金能够准确跟踪指数表现,并且在12月份的指数大幅反弹过程中能够准确把握反弹收益。报告期内,我们运用数量化投资手段精细化执行完全复制指数策略,尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响,将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

以报告期末收盘价计算,本基金的两类分级份额,长盛同辉深证100等权A和长盛同辉深证100等权B的二级市场折溢价率分别为4.80%和-5.35%,整体折溢价率为-0.51%,与市场上同类型指数份基金的二级市场交易情况比较接近,长盛同辉深证100等权B作为高BETA型的交易品种,满足了投资者的需求,填补了市场空白。

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1.071元,本报告期份额净值增长率为7.10%,同期业绩比较基准收益率为1.14%。

本基金在建仓期内采取快速建仓策略,尽快使基金业绩表现能够复制基准指数,在建仓期结束后,我们通过数量化手段对基金进行精细管理,降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响。在剔除建仓期数据后,报告期内本基金年化跟踪误差控制为1.65%,控制在4%之内,日均跟踪偏离度绝对值为0.08%,控制在0.35%之内。

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4季度发生的事情是价格回落后,供需在较低的位置企稳,但是随着产量回升,价格又现回落迹象,说明投资回升不足以将经济维持在现有增速,经济内生需求依然偏弱,如果没有更大力度的放松或更多的货币供给,经济将下滑到更低的位置寻求新的平衡,这一过程表现为PPI掉头向下,大概率发生在13年上半年。从投资时钟周期来看,当前宏观经济处于价格回落,产出回升的复苏早期阶段,该阶段历史表现较好的行业有采掘、有色、房地产、金融等板块。

尽管对于未来经济增长预期并不乐观,但是在改革和城镇化等乐观政策预期下,使得市场在4季度出现了大幅反弹,当前单纯政策预期推动的行情在2013年1季度,两会召开前有望继续维持。在这一过程中,除了受益于政策相关的主题性行业之外,盈利能够维持增长的行业也将会有良好表现,而且在整个2013年都有望维持强势。

深证100等权重指数中,金融、房地产、有色金属、采掘这四个受益于复苏早期阶段的行业权重超过34%,在未来市场继续反弹的过程中有望继续保持高弹性。而且考虑到2013年中小企业板和创业板数额巨大的减持压力,小市值股票当前的高估值水平将难以为继,相反,大中盘股票当前的低估值水平有望回升,与国际市场接轨,而深证100等权重指数作为大市值、高BETA的指数,也将从中受益。

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。

4.7 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二十条中对基金的收益与分配的约定,在分级运作期内,本基金(包括长盛同辉深100等权重A份额、长盛同辉深100等权重B份额和长盛同辉深100等权重份额)不进行收益分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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、张晓艺2013年3月20日对本基金2012年12月31日的资产负债表、2012年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注出具了普华永道中天审字(2013)第21413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 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日
资 产:	
银行存款	20,979,255.87
结算备付金	153,878.53
存出保证金	500,000.00
交易性金融资产	257,421,969.35
其中:股票投资	257,421,969.35
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	-
应收证券清算款	-
应收利息	3,715.95
应收股利	-
应收申购款	49,583.50
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	279,108,403.20
负债和所有者权益	本期末 2012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	-
应付赎回款	1,816,063.91
应付管理人报酬	235,548.51
应付托管费	51,820.67
应付销售服务费	-
应付交易费用	594,974.21
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	836,844.45
负债合计	3,535,251.75
所有者权益:	
实收基金	257,341,420.13
未分配利润	18,231,731.32
所有者权益合计	275,573,151.45
负债和所有者权益总计	279,108,403.20

注:1、报告截止日2012年12月31日,长盛同辉深100等权重分级份额净值1.071元,长盛同辉深100等权重A份额净值1.021元,长盛同辉深100等权重B份额净值1.121元;基金份额总额257,341,420.13份,其中长盛同辉深100等权重A份额111,748,685.00份,长盛同辉深100等权重B份额111,748,686.00份,长盛同辉深100等权重分级份额33,844,049.13份。

2、本财务报表的实际编制期间为2012年9月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体:长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金

本报告期:2012年9月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年9月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	25,393,723.59
1.利息收入	718,427.38
其中:存款利息收入	271,404.41
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	447,022.97
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"号填列)	4,780,134.77
其中:股票投资收益	4,695,945.62
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	84,189.15
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	19,051,214.74
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	843,946.70
减;二、费用	3,316,267.77
1.管理人报酬	1,300,958.93
2.托管费	286,210.96
3.销售服务费	-
4.交易费用	1,593,261.66
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	135,836.22
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	22,077,455.82
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	22,077,455.82

注:本基金基金合同于2012年9月13日生效,无上年度可比期间。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金

本报告期:2012年9月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年9月13日(基金合同生效日)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)	844,062,743.33	-	844,062,743.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,077,455.82	22,077,455.82
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)	-586,721,323.20	-3,845,724.50	-590,567,047.70
其中:1.基金申购款	84,597,587.30	-1,095,645.83	83,501,941.47
2.基金赎回款	-671,318,910.50	-2,750,078.67	-674,068,989.17
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)	257,341,420.13	18,231,731.32	275,573,151.45

注:1、本基金基金合同于2012年9月13日生效,无上年度可比期间。

2、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

长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金(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[2012]827号《关于核准长盛同辉深证100等权重指数分级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《长盛同辉深证100等权重指数分级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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集844,010,148.73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(2012)第356号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金合同》于2012年9月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为844,062,743.33份基金份额,其中认购资金利息折合52,594.60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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定,本基金的基金份额包括长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金之基础份额(以下简称"同辉深证100等权重份额")、长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称"长盛同辉深证100等权重A份额")及长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金之积极收益类份额(以下简称"长盛同辉深证100等权重B份额份额")。本基金一份长盛同辉深证100等权重A份额与一份长盛同辉深证100等权重B份额份额构成一对份额组合,一对长盛同辉深证100等权重A份额与长盛同辉深证100等权重B份额份额的份额组合的净值之和将等于两份同辉深证100等权重指数份额的净值。在任一运作周年内,长盛同辉深100等权重A份额和长盛同辉深100等权重B份额按照本合同规定的参考净值计算规则进行计算;对于长盛同辉深100等权重A份额的约定应得收益,即定期折算基准日长盛同辉深100等权重A份额参考净值超出1.000元部分,将折算为场内长盛同辉深100等权重份额分配给长盛同辉深100等权重A份额持有人;同辉B份额的参考净值和份额数不进行折算;长盛同辉深100等权重份额持有人持有的每份长盛同辉深100等权重份额将按持有0.5份长盛同辉深100等权重A份额获得新增长盛同辉深100等权重份额的分配,场外长盛同辉深100等权重份额的持有人将按前述折算方式获得新增场外长盛同辉深100等权重份额的分配,场内长盛同辉深100等权重份额的持有人将按前述折算方式获得新增场内长盛同辉深100等权重份额的分配。当长盛同辉深100等权重份额净值达到2.000元后(含2.000元)和当长盛同辉深100等权重B份额的基金份额参考净值跌至0.250元以下后(不含0.250元),本基金将进行不定期份额折算。折算后本基金将确保长盛同辉深100等权重A份额和长盛同辉深100等权重B份额的比例为1:1,份额折算后长盛同辉深100等权重份额净值以及长盛同辉深100等权重A份额、长盛同辉深100等权重B份额参考净值均调整为1.000元。

同辉深证100等权重份额接受场外与场内申购和赎回,长盛同辉深证100等权重A份额、长盛同辉深证100等权重B份额份额只上市交易但不接受申购和赎回,并可与同辉深证100等权重指数份额相互间进行配对转换。经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上[2012]319号文核准,长盛同辉深证100等权重A份额、长盛同辉深证100等权重B份额份额于2012年9月26日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资的标的指数为深证100指数,股票投资占基金资产的比例为90%-95%,原则上投资于深证100指数成份股票、备选成份股票的资产占基金资产的比例不低于90%;其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种,其中权证资产占基金资产净值的比例为0-3%,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%。本基金通过被动的指数化投资管理,实现对深证100指数的有效跟踪,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。本基金的业绩比较基准为:95%×深证100指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)。

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》、《长盛同辉深证100等权重指数分级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9月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2012年12月31日的财务状况以及2012年9月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2012年9月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类其他应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类其他应付款项等。

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已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

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和衍生工具(主要为权证投资)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和债券利息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

在分级运作期内,本基金(包括长盛同辉深100等权重A份额、长盛同辉深100等权重B份额和长盛同辉深100等权重份额)不进行收益分配。

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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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。

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("长盛基金公司")	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金未开立关联方交易单元。

7.4.8.2 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 2012年9月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,300,958.93
其中:支付销售机构的客户维护费	22,244.32

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1.00%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×1.00%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年9月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	286,210.96

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0.22%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×0.22%/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

本基金本报告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

基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

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

本基金本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。

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 2012年9月13日(基金合同生效日)至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	20,979,255.87	259,891.00

注:本基金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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2012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

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000826	桑德环境	12/12/31	13/01/09	配股	12.71	22.99	31,451	399,742.21	723,058.49	

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

7.4.9.2 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	备注
000002	万科A	12/12/26	重大事项	10.12	13/01/21	11.13	313,514	2,554,868.11	3,172,761.68	-

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。

7.4.9.3 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

本基金本报告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

本基金本报告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

(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

①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)。

②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且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为254,249,207.67元,属于第二层级的余额为3,172,761.68元,无属于第三层级的余额。

③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,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。

④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,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	257,421,969.35	92.23
	其中:股票	257,421,969.35	92.23
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	21,133,134.40	7.57
6	其他各项资产	553,299.45	0.20
7	合计	279,108,403.20	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	5,358,240.00	1.94
B	采掘业	21,734,903.49	7.89
C	制造业	131,298,975.32	47.65
C0	食品、饮料	18,355,579.13	6.66
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	9,990,606.53	3.63
C5	电子	13,165,374.82	4.78
C6	金属、非金属	35,050,855.63	12.72
C7	机械、设备、仪表	41,756,498.64	15.15
C8	医药、生物制品	12,980,060.57	4.71
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,407,977.80	1.24
E	建筑业	3,120,093.58	1.13
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	4,818,895.98	1.75
H	批发和零售贸易	7,006,808.33	2.54
I	金融、保险业	23,116,853.20	8.39
J	房地产业	19,544,687.08	7.09
K	社会服务业	5,832,190.13	2.12
L	传播与文化产业	2,434,973.10	0.88
M	综合类	7,904,617.08	2.87
	合计	235,579,215.09	85.49

8.2.2 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	13,027,003.37	4.73
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	7,705,201.99	2.80
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	5,321,801.38	1.93
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,799,568.50	1.02
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	6,016,182.39	2.18
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	21,842,754.26	7.93

8.3 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

8.3.1 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	000562	宏源证券	243,989	4,599,192.65	1.67
2	000783	长江证券	453,566	4,263,520.40	1.55
3	000046	泛海建设	696,984	3,763,713.60	1.37
4	000024	招商地产	125,103	3,739,328.67	1.36
5	000069	华侨城A	456,265	3,421,987.50	1.24
6	002146	荣盛发展	241,595	3,379,914.05	1.23
7	000581	威孚高科	102,907	3,282,733.30	1.19
8	000625	长安汽车	479,848	3,190,989.20	1.16
9	000002	万 科A	313,514	3,172,761.68	1.15
10	002081	金 螳 螂	70,879	3,120,093.58	1.13

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。

8.3.2 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

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	002038	双鹭药业	71,440	2,826,166.40	1.03
2	300070	碧 水 源	70,415	2,823,641.50	1.02
3	002230	科大讯飞	92,395	2,799,568.50	1.02
4	002236	大华股份	58,504	2,711,660.40	0.98
5	002415	海康威视	81,154	2,524,700.94	0.92

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000783	长江证券	8,848,947.13	3.21
2	000539	粤电力A	7,446,191.18	2.70
3	000826	桑德环境	7,442,039.81	2.70
4	000686	东北证券	7,391,754.91	2.68
5	000776	广发证券	7,365,430.76	2.67
6	000338	潍柴动力	7,345,340.59	2.67
7	002155	辰州矿业	7,326,733.42	2.66
8	000680	山推股份	7,313,736.71	2.65
9	000937	冀中能源	7,311,942.21	2.65
10	000550	江铃汽车	7,307,090.36	2.65
11	002146	荣盛发展	7,301,845.29	2.65
12	000877	天山股份	7,293,178.76	2.65
13	000780	平庄能源	7,288,187.42	2.64
14	002122	天马股份	7,284,493.95	2.64
15	000002	万 科A	7,276,424.27	2.64
16	000983	西山煤电	7,268,718.88	2.64
17	000718	苏宁环球	7,266,091.14	2.64
18	000652	泰达股份	7,264,217.78	2.64
19	002128	露天煤业	7,262,421.66	2.64
20	000623	吉林敖东	7,255,673.36	2.63
21	000012	南 玻A	7,244,704.10	2.63
22	000039	中集集团	7,243,432.82	2.63
23	002024	苏宁电器	7,239,787.69	2.63
24	000528	柳 工	7,234,137.14	2.63
25	002092	中泰化学	7,234,101.91	2.63
26	002233	塔牌集团	7,232,823.62	2.62
27	000968	煤 气 化	7,232,590.06	2.62
28	000060	中金岭南	7,228,256.86	2.62
29	000425	徐工机械	7,221,821.95	2.62
30	002073	软控股份	7,220,666.14	2.62
31	002241	歌尔声学	7,215,701.96	2.62
32	000157	中联重科	7,213,825.08	2.62
33	002202	金风科技	7,210,340.86	2.62
34	000651	格力电器	7,208,929.57	2.62
35	000630	铜陵有色	7,205,381.09	2.61
36	000009	中国宝安	7,205,084.05	2.61
37	000612	焦作万方	7,204,596.34	2.61
38	000024	招商地产	7,203,631.25	2.61
39	000402	金 融 街	7,203,559.96	2.61
40	000933	神火股份	7,201,475.18	2.61
41	000758	中色股份	7,198,925.47	2.61
42	000021	长城开发	7,197,841.79	2.61
43	000800	一汽轿车	7,196,937.72	2.61
44	000001	平安银行	7,196,050.77	2.61
45	000825	太钢不锈	7,195,047.78	2.61
46	000031	中粮地产	7,192,976.02	2.61
47	000839	中信国安	7,188,687.53	2.61
48	000629	攀钢钒钛	7,187,326.62	2.61
49	000401	冀东水泥	7,186,524.69	2.61
50	000596	古井贡酒	7,184,886.48	2.61
51	002142	宁波银行	7,184,655.00	2.61
52	000898	鞍钢股份	7,183,838.12	2.61
53	002041	登海种业	7,182,017.05	2.61
54	000100	TCL 集团	7,174,336.00	2.60
55	000960	锡业股份	7,169,003.88	2.60
56	000927	一汽夏利	7,168,143.52	2.60
57	000540	中天城投	7,162,602.40	2.60
58	000061	农 产 品	7,159,604.43	2.60
59	000778	新兴铸管	7,159,531.19	2.60
60	000709	河北钢铁	7,158,911.74	2.60
61	002001	新 和 成	7,157,942.63	2.60
62	000970	中科三环	7,156,264.61	2.60
63	000762	西藏矿业	7,153,893.54	2.60
64	000581	威孚高科	7,146,768.00	2.59
65	000059	辽通化工	7,144,013.07	2.59
66	000559	万向钱潮	7,141,496.00	2.59
67	000895	双汇发展	7,133,642.52	2.59
68	000729	燕京啤酒	7,131,719.75	2.59
69	002304	洋河股份	7,130,649.27	2.59
70	002007	华兰生物	7,130,289.62	2.59
71	000538	云南白药	7,126,981.42	2.59
72	002056	横店东磁	7,125,545.91	2.59
73	000869	张 裕A	7,122,672.06	2.58
74	000063	中兴通讯	7,121,760.40	2.58
75	000858	五 粮 液	7,117,897.70	2.58
76	000878	云南铜业	7,116,555.93	2.58
77	000625	长安汽车	7,116,198.37	2.58
78	000969	安泰科技	7,115,727.63	2.58
79	002081	金 螳 螂	7,112,719.60	2.58
80	002106	莱宝高科	7,109,675.34	2.58
81	000069	华侨城A	7,104,903.79	2.58
82	000046	泛海建设	7,104,379.02	2.58
83	000422	湖北宜化	7,095,362.01	2.57
84	002069	獐 子 岛	7,086,943.27	2.57
85	000768	中航飞机	7,085,221.78	2.57
86	002008	大族激光	7,084,891.55	2.57
87	000792	盐湖股份	7,084,564.02	2.57
88	000568	泸州老窖	7,080,863.64	2.57
89	000876	新 希 望	7,057,818.89	2.56
90	000423	东阿阿胶	7,055,519.85	2.56
91	002269	美邦服饰	7,028,714.09	2.55

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000898	鞍钢股份	7,573,098.06	2.75
2	000652	泰达股份	7,446,169.00	2.70
3	000031	中粮地产	7,384,633.96	2.68
4	002233	塔牌集团	7,311,621.04	2.65
5	000680	山推股份	7,293,740.70	2.65
6	000612	焦作万方	7,146,556.27	2.59
7	002146	荣盛发展	6,008,776.31	2.18
8	000550	江铃汽车	5,991,754.30	2.17
9	000338	潍柴动力	5,898,060.06	2.14
10	000800	一汽轿车	5,890,625.19	2.14
11	000718	苏宁环球	5,845,734.80	2.12
12	000927	一汽夏利	5,674,617.43	2.06
13	000528	柳 工	5,665,956.23	2.06
14	000869	张 裕A	5,486,898.06	1.99
15	000937	冀中能源	5,086,780.79	1.85
16	000024	招商地产	5,072,597.09	1.84
17	000581	威孚高科	5,036,153.90	1.83
18	000539	粤电力A	5,028,804.35	1.82
19	002024	苏宁电器	5,026,275.79	1.82
20	000059	辽通化工	4,933,827.62	1.79

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	686,999,085.85
卖出股票收入(成交)总额	453,324,276.86

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本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。

本基金本报告期间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。

本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	3,715.95
5	应收申购款	49,583.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	553,299.45

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处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万 科A	3,172,761.68	1.15	重大事项

8.9.5.2 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。

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

份额级别	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
长盛同辉深100等权重A	296	377,529.34	75,417,418.00	67.49%	36,331,267.00	32.51%
长盛同辉深100等权重B	771	144,939.93	43,836,345.00	39.23%	67,912,341.00	60.77%
长盛同辉深100等权重分级	151	224,132.78	16,500,292.00	48.75%	17,343,757.13	51.25%
合计	1,218	211,281.95	135,754,055.00	52.75%	121,587,365.13	47.25%

注:对于分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对于合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.2期末上市基金前十名持有人

9.2.1 期末上市基金前十名持有人—长盛同辉深100等权重A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	工银安盛人寿保险有限公司	33,276,502	29.78%
2	中国人寿保险股份有限公司	22,157,155	19.83%
3	嘉禾人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	10,000,583	8.95%
4	天平汽车保险股份有限公司	4,999,950	4.47%
5	华西证券有限责任公司	4,500,000	4.03%
6	丁金香	3,309,451	2.96%
7	中信证券股份有限公司	2,548,281	2.28%
8	刘文华	2,503,599	2.24%
9	华安证券有限责任公司	2,500,219	2.24%
10	招商证券股份有限公司	2,250,000	2.01%

9.2.2 期末上市基金前十名持有人—长盛同辉深100等权重B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	李玉朋	12,161,375	10.88%
2	福建道冲投资管理有限公司	9,060,908	8.11%
3	上海开志投资中心(有限合伙)	7,504,435	6.72%
4	中国对外经济贸易信托有限公司—伏牛1期(汇富130号)结构	5,877,360	5.26%
5	上海旭昂投资管理中心(有限合伙)	5,121,214	4.58%
6	陈建锋	5,035,788	4.51%
7	陈善宽	4,627,429	4.14%
8	中信证券股份有限公司	3,655,145	3.27%
9	中国对外经济贸易信托有限公司-伏牛1期	2,518,585	2.25%
10	华安证券有限责任公司	2,500,218	2.24%

注:1、以上信息中持有人为场内持有人,由中国证券登记结算有限责任公司提供;

2、对于长盛同辉深100等权重A份额、长盛同辉深100等权重B份额前十名持有人持有份额比例的分母采用各自级别的份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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基金	长盛同辉深100等权重A	-	-
	长盛同辉深100等权重B	-	-
	长盛同辉深100等权重分级	247,549.50	0.73%
	合计	247,549.50	0.10%

注:1、对于分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对于合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

2、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。

3、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0万份。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长盛同辉深100等权重A	长盛同辉深100等权重B	长盛同辉深100等权重分级
基金合同生效日(2012年9月13日)基金份额总额	295,025,570.00	295,025,571.00	254,011,602.33
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-	84,597,587.30
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-	671,318,910.50
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-183,276,885.00	-183,276,885.00	366,553,770.00
本报告期期末基金份额总额	111,748,685.00	111,748,686.00	33,844,049.13

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§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

本报告期本基金管理人的高级管理人员未曾变动。

11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2012年11月15日,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理,其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可〔2012〕961号)。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理,其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可〔2012〕1036号)。

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,本报告期内应支付给该会计师事务所的报酬为55,000.00元。

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		回购交易		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	占当期回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
国海证券	1	510,500,363.40	44.78%	800,000,000.00	100.00%	451,744.21	44.78%
华龙证券	1	467,563,373.67	41.02%	-	-	413,746.60	41.02%
浙商证券	1	161,859,883.43	14.20%	-	-	143,230.00	14.20%

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	国海证券	深圳	1
2	华龙证券	深圳	1
3	浙商证券	深圳	1

(2)本基金报告期内停止租用交易单元情况:无。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2012年1月16日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告,自2012年1月16日起,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

2、2012年11月15日,根据工作需要,中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。