基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2013年3月26日

长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31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一以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业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,投资者在作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1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛同瑞中证200分级		
基金主代码	160808		
交易代码	160808		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年12月6日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	50,882,891.16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1月12日		
下属三级基金的基金简称	长盛同瑞A	长盛同瑞B	长盛同瑞中证200分级
下属三级基金的交易代码	150064	150065	160808
报告期末下属三级基金的份额总额	4,245,164.00份	6,367,746.00份	40,269,981.16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,以实现对中证200指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用完全复制法,按照成份股在中证200指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证200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。 本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于中证200指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%,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占基金资产比例为5%-10%(其中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5%)。基金管理人将综合考虑市场情况,基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。
业绩比较基准	中证200指数收益率×95%+一年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为完全复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
下属分级基金的风险收益特征	长盛同瑞A:低风险、收益相对稳定 长盛同瑞B:高风险、高预期收益 长盛同瑞中证200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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	李芳菲
	联系电话	010-82019988	010-66060069
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95599
传真		010-82255988	010-63201816

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、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12月6日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	9,136,298.92	1,075,537.59
本期利润	10,609,734.72	1,075,537.59
加权平均基金份额本期利润	0.1099	0.0017
本期基金份额净值增长率	0.38%	0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.0064	0.0017
期末基金资产净值	51,083,147.16	624,271,806.22
期末基金份额净值	1.004	1.002

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。

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	5.02%	1.25%	4.93%	1.27%	0.09%	-0.02%
过去六个月	-3.28%	1.25%	-1.96%	1.29%	-1.32%	-0.04%
过去一年	0.38%	1.23%	1.62%	1.39%	-1.24%	-0.16%
自基金合同生效起至今	0.58%	1.18%	-8.28%	1.38%	8.86%	-0.20%

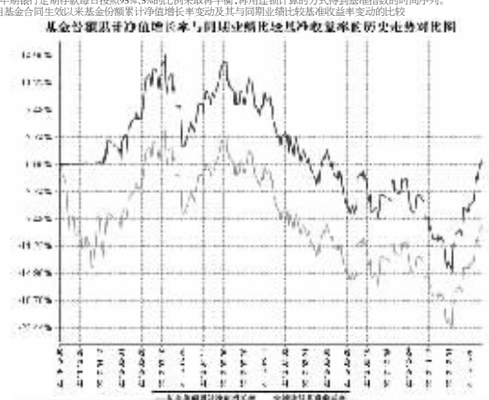
注:本基金业绩比较基准=95%×中证200 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)。

基准指数:中证200指数

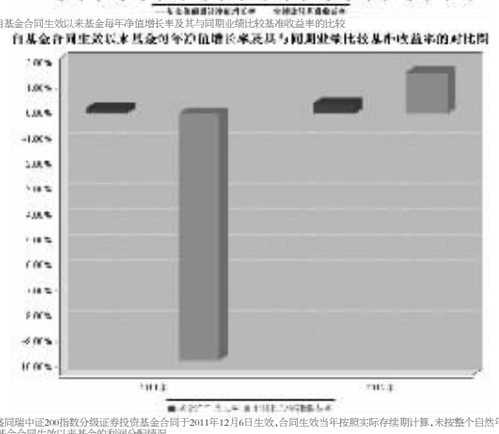
本基金的业绩比较基准中证200指数由中证指数有限公司构建和发布。具体的编制规则和再平衡过程请参见中证200指数指数编制细则。(网址为:http://www.csindex.com.cn/sseportal/csiportal/indexquery.do)

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,业绩比较基准中中证200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,再用连续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



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:长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金合同于2011年12月6日生效,合同生效当年按照实际存续期计算,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

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	-	-	-	-	2011年度未分配收益
合计	-	-	-	-	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6号文件批准,于1999年3月成立,注册资本为人民币15000万元。目前,本公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司(以下简称“国元证券”)占注册资本的41%;新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%;安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%;安徽省投资集团控股有限公司(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		
王超	本基金基金经理、长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理。	2011年12月6日	—	5年	男,1981年9月出生,中国国籍。中央财经大学硕士,中国科学技术大学金融工程专业在读博士。金融风险管理师(FRM)。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员,从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金(本基金)基金经理。

注:1.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;

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛同瑞中证200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 公平交易制度和执行情况

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、行为监控纪行与分析、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且主进行投资决策,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以公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,对交易所公平竞价交易,公司开启组长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,后到达指令比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、债券回购、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报量等比分配”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同向交易等,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;公司通过系统记录所有投资组合的交易信息,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,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》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日为时间层分析不同交易品种、交易品种、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同向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松阀。上述申请已报经公司投资决策委员会批准,打开反向交易控制阀后,长盛同庆产品线开展了数量化组合投资交易策略,公司交易部对上述指令进行严格审核,在指令发出,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,未发现本公司旗下所有投资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

在报告期内,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。

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1.004元,本报告期份额净值增长率为0.38%,同期业绩比较基准收益率为1.62%,报告期内,跟踪基金期数据,本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.07%,控制在0.35%之内;年化跟踪误差为1.91%,控制在4%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推持在现有幅度,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,当前单纯政策预期拖动的行情在2013年一季度,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。

中证200指数中,金融、房地产、有色金属、其他证券四个受益于复苏早期阶段的行业权重超过35%,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扩大的减持压力,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,而中证200指数作为中盘市值、基金重仓持股集中的指数,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。本基金管理人组门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。

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;且为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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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,并于期末金额转入未分配利润/(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则按直线法计算。

7.4.4.11基金的收益分配政策

根据《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,在存续期内,本基金(包括同瑞基金份额、同瑞A份额和同瑞B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按露分部信息。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,不需要按露分部信息。

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、市盈率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

本基金本报告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

本基金在本报告期间及上年度可比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,依照现行税法规定则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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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不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

本基金本年度内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年12月6日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	769,503.32	320,373.25
其中:支付销售机构的客户维护费	173,440.13	124,323.97

注:支付基金管理人长盛基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%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×0.75%/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1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年12月6日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	153,900.64	64,074.66

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%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×0.15%/当年天数。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本期及上年度可比期间未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

长盛同瑞A

关联方名称	本期 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
国元证券	-	-	4,000,333.00	9.67%

长盛同瑞B

关联方名称	本期 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
国元证券	-	-	6,000,500.00	9.67%

注:对于分级基金,比例的分母采用各日级别的份额。

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1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年12月6日(基金合同生效日)至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	7,184,997.17	274,129.69	32,060,251.41	91,233.96

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无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因认购新股/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期未无因认购新股/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

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
600100	同方股份	2012-12-27	重大事项停牌	7.48	2013-1-10	7.90	47,613	438,150.40	356,145.24	

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

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1.公允价值

(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46,541,919.33元,属于第二层级的余额为356,145.24元,无属于第三层级的余额(2011年12月31日:未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中)。

③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(包括流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

于本期末,本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2011年12月31日:同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元,涉及内蒙古伊利实业集团股份有限公司(“伊利股份”)发行的股票。(2011年度:净转入/(转出)第三层级的金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元)。

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	46,898,064.57	86.20
	其中:股票	46,898,064.57	86.20
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	7,255,890.36	13.34
6	其他各项资产	255,072.25	0.47
7	合计	54,409,027.18	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	501,559.44	0.98
B	采掘业	3,916,032.27	7.67
C	制造业	21,919,942.35	42.91
C0	食品、饮料	2,619,339.57	5.13
C1	纺织、服装、皮毛	430,726.45	0.84
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,937,680.30	3.79
C5	电子	1,185,277.96	2.32
C6	金属、非金属	5,386,022.01	10.54
C7	机械、设备、仪表	4,647,559.41	9.10
C8	医药、生物制品	5,713,336.65	11.18
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	923,101.34	1.81
E	建筑业	1,707,018.99	3.34
F	交通运输、仓储业	1,230,893.80	2.41
G	信息技术业	1,327,358.05	2.60
H	批发和零售贸易	2,885,402.16	5.65
I	金融、保险业	3,428,876.02	6.71
J	房地产业	3,285,824.53	6.43
K	社会服务业	666,916.72	1.31
L	传播与文化产业	287,297.70	0.56
M	综合类	2,197,261.20	4.30
	合计	44,277,484.57	86.68

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	179,731.00	0.35
C	制造业	890,825.50	1.74
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	698,366.00	1.37
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	192,459.50	0.38
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	572,625.50	1.12
E	建筑业	172,120.00	0.34
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	271,347.00	0.53
J	房地产业	287,946.00	0.56
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	245,985.00	0.48
M	综合类	-	-
	合计	2,620,580.00	5.13

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	600276	恒瑞医药	36,898	1,110,629.80	2.17
2	600887	伊利股份	47,521	1,044,511.58	2.04
3	600383	金地集团	132,405	929,483.10	1.82
4	000783	长江证券	85,483	803,540.20	1.57
5	000060	中金岭南	81,748	739,819.40	1.45
6	600690	青岛海尔	45,700	612,380.00	1.20
7	000423	东阿阿胶	14,786	597,502.26	1.17
8	600518	康美药业	44,815	588,869.10	1.15
9	000024	招商地产	19,661	587,667.29	1.15
10	600739	辽宁成大	38,705	580,187.95