长盛同鑫保本混合型证券投资基金

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	长盛同鑫保本混合
基金主代码	080007
交易代码	080007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月24日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,210,328,332.60份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	依据本基金的保证合同，本基金通过运用投资组合保险策略，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，力争在本基金保本周期结束时，实现基金资产的收益增长。
投资策略	本基金投资策略突出强调配置的科学性与纪律性，通过严格金融工程手段有效控制风险，保证实现投资期中的稳定收益，并通过有效地资产配置和保本投资策略以保障基金资产本金的安全。 本基金将按照恒定比例组合保险机制（CPPI）将资产配置于安全资产与风险资产，用投资于固定收益类证券的现金净流入来冲抵风险资产组合潜在的最大亏损，并通过投资股票等风险资产来获得资本利得。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种。未持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额，不享受保本担保。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	唐州徽
	联系电话	010-82019988	010-66594855
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

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5月24日（基金合同生效日）-2011年12月31日
本期已实现收益	38,023,102.63	51,919,639.35
本期利润	50,697,991.74	57,151,664.22
加权平均基金份额本期利润	0.0320	0.0218
本期基金份额净值增长率	2.89%	2.30%
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	0.0127	0.0201
期末基金资产净值	1,235,922,270.29	2,140,442,718.63
期末基金份额净值	1.021	1.023

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

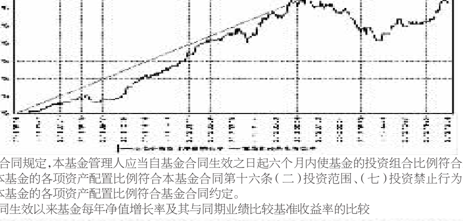
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.69%	0.09%	1.12%	0.01%	0.57%	0.08%
过去六个月	0.53%	0.09%	2.27%	0.01%	-1.74%	0.08%
过去一年	2.89%	0.10%	4.63%	0.01%	-1.74%	0.09%
自基金合同生效起至今	5.26%	0.08%	7.65%	0.01%	-2.39%	0.07%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

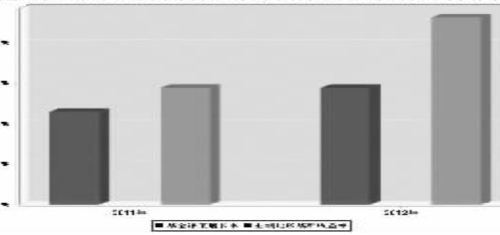
本基金业绩比较基准为基金合同成立日所在年度的中国人民银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益率。本基金是保本型基金产品，保本周期为3年。以3年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量比较本基金保本保证的有效性。

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：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十六条（二）投资范围、（七）投资禁止行为与限制的有关约定。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



注：本基金基金合同于2011年5月24日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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	0.030	6,153,528.41	-	6,153,528.41	除息日：2012年1月18日
	0.280	37,407,421.63	-	37,407,421.63	除息日：2012年9月28日
2011年	-	-	-	-	2011年度未分配收益
合计	0.310	43,560,950.04	-	43,560,950.04	

§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		
蔡宾	本基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理。社保组合组合经理，固定收益部总监。	2011年5月24日	—	8年	男，1978年11月出生，中国国籍。毕业于中央财经大学，获硕士学位，CFA（美国特许金融分析师）。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理，投资经理等。现任固定收益部总监，社保组合组合经理，长盛同鑫保本混合型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理。

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、《长盛同鑫保本混合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年债券市场以5月为分水岭，上半段延续2011年年底的走势呈品种轮动态势，信用债有所下行，利率品收益则明显反弹。4月份经济数据出台后，悲观的预期以及较大的货币政策放松幅度使得债券市场整体大幅下行，直至6月底，在流动性限制的情况下开始了延续至3季末的弱势。4季度，央行以公开市场操作调控市场流动性的"量化"方式得到确认，回购利率回落至相对较低水平，并且相对于过往更为稳定，在理财类配置资金的驱动下，信用债市场收益重新开始下行，而经济的弱势企稳使得利率维持品窄幅波动态势。

2012年偏权益资产时间表现为"两头强，中间弱"格局。出于对经济企稳的预期，1季度与年末权益资产走势较强，但有所差异：4月经济数据揭晓后，在悲观预期的推动下年初行情迅速转向，而年末随着十八大会议结束，部分政策有向好预期，且经济数据呈企稳态势，低迷已久的股市迎来较为强劲的反弹。转债市场与之走势类似，但有所分化，债性偏强的转债上升与下跌幅度远弱于股性偏强的转债。

在报告期内，本基金主要通过一级市场进行了债券资产配置，并适当参与了权益类市场投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为1.021元，本报告期份额净值增长率为2.89%，同期业绩比较基准增长率为4.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济增长已出现趋稳状况，但短期内难以看到迅速回升的可能，由于翘尾较低，明年上半年排除季节性因素外，通胀出现迅速反弹的可能性较小，但下半年翘尾因素较高，CPI有可能加速上升，而债市收益率水平随着4季度的调整再次回到中性位置，意味着明年年初债市仍然具备一定的配置和交易性机会，但随时间的推移投资价值将明显减弱，下半年随着收益再次走高则有可能重新出现配置性机会。短期的债券市场风险仍然在于弱势经济格局及地方债务清理的过程中出现的信用事件冲击，将有可能造成信用债收益变化超预期。

因此，在明年1季度，我们的投资策略主要以与组合期限匹配的高收益信用债配置为主，兼以中短久期品种套利策略为辅，考虑到有可能出现信用事件冲击，提升组合中短久期配置比例以保证流动性。同时，由于经济企稳格局渐显，风险偏好有所回升，偏权益资产方面有可能具备延续上升势头，但随着4季末的上涨，A股市场存在回调的压力，我们将关注偏权益资产方面的有效配置，获取更多增强组合收益的投资机会。

无论市场如何发展变化，在操作方面，我们都将继续秉承谨慎原则，在组合流动性得到保证的前提下，通过灵活的资产配置和深入的个券个股甄别分析，做好组合配置，力求确保基金资产在维持价值底线基础上实现持续的稳定增值。

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收益分配原则的约定，本基金分别于2012年1月18日、2012年9月28日对2011年度、2012年度收益进行了利润分配，分配总金额为43,560,950.04元。

本基金截至2012年12月31日，期末可供分配收益为15,355,220.76元。其中：未分配利润已实现部分为15,355,220.76元，未分配利润未实现部分为10,238,716.93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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对长盛同鑫保本混合型证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司注册会计师汪棣、张晓艺于2013年3月20日对本基金2012年12月31日的资产负债表、2012年1月1日至2012年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2013)第21328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：长盛同鑫保本混合型证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产：		
银行存款	505,995,391.12	615,242,800.00
结算备付金	59,276,049.21	7,843,482.71
存出保证金	250,000.00	500,000.00
交易性金融资产	1,378,312,518.17	1,211,137,325.96
其中：股票投资	16,843,300.00	1,850,000.00
基金投资	-	-
债券投资	1,361,469,218.17	1,209,287,325.96
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	638,551,677.83
应收证券清算款	21,605,698.28	18,352,478.81
应收利息	20,242,532.50	17,562,880.73
应收股利	-	-
应收申购款	72,326.77	9,813.65
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,985,754,516.05	2,509,200,459.69
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31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	725,799,750.00	346,692,853.80
应付证券清算款	19,695,773.24	14,643,001.87
应付赎回款	1,646,246.15	3,998,537.75
应付管理人报酬	1,269,674.92	2,255,902.46
应付托管费	211,612.44	375,983.72
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	33,523.14	13,534.41
应交税费	530,972.00	4,009.60
应付利息	12,185.20	23,227.38
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	632,508.67	750,690.07
负债合计	749,832,245.76	368,757,741.06
所有者权益：		
实收基金	1,210,328,332.60	2,093,050,351.04
未分配利润	25,593,937.69	47,392,367.59
所有者权益合计	1,235,922,270.29	2,140,442,718.63
负债和所有者权益总计	1,985,754,516.05	2,509,200,459.69

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值：1.021元，基金份额总额：1,210,328,332.60份。

7.2 利润表

会计主体：长盛同鑫保本混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日
一、收入	90,889,189.25	81,257,374.14
1.利息收入	73,454,736.32	70,539,005.41
其中：存款利息收入	26,788,410.83	12,605,873.88
债券利息收入	37,907,917.40	14,819,093.74
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	8,758,408.09	43,114,037.79
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	2,406,351.83	1,763,914.11
其中：股票投资收益	-19,373,169.95	31,500.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	20,033,361.67	1,732,414.11
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,746,160.11	-
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	12,674,889.11	5,232,024.87
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	2,353,211.99	3,722,429.75
减：二、费用	40,191,197.51	24,105,709.92
1.管理人报酬	19,738,372.74	19,201,342.69
2.托管费	3,289,728.77	3,200,223.78
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	733,919.19	22,735.71
5.利息支出	15,959,769.95	1,395,435.18
其中：卖出回购金融资产支出	15,959,769.95	1,395,435.18
6.其他费用	469,406.86	285,972.56
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	50,697,991.74	57,151,664.22
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	50,697,991.74	57,151,664.22

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛同鑫保本混合型证券投资基金

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）	2,093,050,351.04	47,392,367.59	2,140,442,718.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	50,697,991.74	50,697,991.74
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）	-882,722,018.44	-28,935,471.60	-911,657,490.04
其中：1.基金申购款	9,904,156.70	325,900.00	10,230,056.70
2.基金赎回款	-892,626,175.14	-29,261,371.60	-921,887,546.74
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）	-	-43,560,950.04	-43,560,950.04
五、期末所有者权益（基金净值）	1,210,328,332.60	25,593,937.69	1,235,922,270.29
项目	上年度可比期间 2011年5月24日（基金合同生效日）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）	3,032,111,617.30	-	3,032,111,617.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	57,151,664.22	57,151,664.22
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）	-939,061,266.26	-9,759,296.63	-948,820,562.89
其中：1.基金申购款	10,980,171.60	75,614.75	11,055,786.35
2.基金赎回款	-950,041,437.86	-9,834,911.38	-959,876,349.24
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）	2,093,050,351.04	47,392,367.59	2,140,442,718.63

注：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

长盛同鑫保本混合型证券投资基金(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")证监基金字[2011]第519号《关于核准长盛同鑫保本混合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《长盛同鑫保本混合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人民币3,031,349,989.30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(2011)第190号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于2011年5月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,032,111,617.30份基金份额，其中认购资金利息折合761,628.00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，基金托管人为中国银行股份有限公司。本基金的担保人为安徽省信用担保集团有限公司，为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证担保。

根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的保本期一般每三年为一个周期；在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本期默认选择转入当期保本期的基金份额持有人持有本基金至当期保本期到期的，如可赎回金额加上保本期内的累计分红金额高于或等于其投资净额，本基金的基金管理人将按可赎回金额支付给基金份额持有人；如可赎回金额加上保本期内的累计分红金额低于其投资净额，本基金的担保人将保证向符合上述条件的本基金份额持有人承担上述差额部分的偿付并及时清偿，担保额度为人民币51亿元。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回的，赎回部分不适用保本条款；基金份额持有人在保本期申购的基金份额也不适用保本条款。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同鑫保本混合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，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中本基金投资于股票投资占基金资产的比例不高于30%；投资于债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不得低于70%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：3年期银行定期存款税后收益率。

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》、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明：

本基金本期及上年度可比期间未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明：

本基金本期及上年度可比期间未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明：

本基金本期及上年度可比期间无会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（"中国银行"）	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（"安徽信用担保"）	基金管理人的股东、基金担保人
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1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年5月24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	19,738,372.74	19,201,342.69
其中：支付销售机构的客户维护费	9,177,570.70	9,242,939.06

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1.20%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×1.20%/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5月24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	3,289,728.77	3,200,223.78

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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×0.20%/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：

单位：人民币元

本期 2012年1月1日至2012年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
中国银行	-	-	-	-	150,000,000.00	77,335.69
上年度可比期间 2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
中国银行	-	-	499,800,000.00	811,955.72	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年5月24日（基金合同生效日）至2011年12月31日
基金合同生效日（2011年5月24日）持有的基金份额	-	19,999,000.00
期初持有的基金份额	19,999,000.00	-
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	19,999,000.00	19,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.65%	0.96%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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	-	-	69,999,000.00	3.34%

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5月24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
中国银行	5,995,391.12	540,408.82	5,242,800.00	748,490.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率/约定利率计息。

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：

本基金由安徽信用担保作为担保人，为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证担保。保证担保的范围为：在本保本期到期时，基金份额持有人持有到期的基金份额的可赎回金额加上本保本期内本基金的累计分红金额，低于投资净额时的差额部分，担保额度为人民币51亿元。基金份额持有人指在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人。持有到期指在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人在本保本期内一直持有其在本基金的募集期内认购的基金份额。本基金的担保费由本基金的基金管理人按基金资产净值0.20%的年费率从基金管理费收入中列支。

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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：债券									
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：张）	期末成本总额	期末估值总额
127001	海直转债	2012/12/24	2013/01/07	新债网下申购	100.00	100.00	30,880	3,088,000.00	3,088,000.00
合计								3,088,000.00	3,088,000.00

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

本基金本期末及上年度末未持有因暂时停牌而持有流通受限证券。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额725,799,750.00元，于2012年1月4日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

（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1,106,055,518.17元，属于第二层级的余额为272,257,000.00元，无属于第三层级的余额(2011年12月31日：第一层级771,226,325.96元，第二层级439,911,000.00元，无属于第三层级的余额)。

（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，本基金不会分别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不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或还是第三层级。

（d）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(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)，涉及内蒙古伊利实业集团股份有限公司发行的股票。

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	16,843,300.00	0.85
	其中：股票	16,843,300.00	0.85
2	固定收益投资	1,361,469,218.17	68.56
	其中：债券	1,361,469,218.17	68.56
	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	565,271,440.33	28.47
6	其他各项资产	42,170,557.55	2.12
7	合计	1,985,754,516.05	100.00

8.2 期末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	546,400.00	0.04
B	采掘业	401,600.00	0.03
C	制造业	5,958,900.00	0.48
C0	食品、饮料	282,300.00	0.02
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	1,561,000.00	0.13
C5	电子	237,300.00	0.02
C6	金属、非金属	1,022,700.00	0.08
C7	机械、设备、仪表	1,480,400.00	0.12
C8	医药、生物制品	1,375,200.00	0.11
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	746,700.00	0.06
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	1,038,200.00	0.08
I	金融、保险业	6,694,400.00	0.54
J	房地产业	570,900.00	0.05
K	社会服务业	886,200.00	0.07
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	16,843,300.00	1.36

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	300,000	5,007,000.00	0.41
2	600309	烟台万华	100,000	1,561,000.00	0.13
3	601633	长城汽车	30,000	711,000.00	0.06
4	000538	云南白药	10,000	680,000.00	0.06
5	000963	华东医药	20,000	680,000.00	0.06
6	601117	中国化学	80,000	659,200.00	0.05
7	600585	海螺水泥	30,000	553,500.00	0.04
8	600108	亚盛集团	80,000	546,400.00	0.04
9	000783	长江证券	50,000	470,000.00	0.04
10	002428	云南锗业	20,000	469,200.00	0.04

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于http://www.csfunds.com.cn网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例(%)
1	601328	交通银行	20,739,000.00	0.97
2	000001	平安银行	18,077,668.66	0.84
3	601166	兴业银行	17,602,831.10	0.82
4	600000	浦发银行	16,299,984.69	0.76
5	601318	中国平安	15,694,555.70	0.73
6	000858	五粮液	15,636,826.80	0.73
7	601601	中国太保	6,764,261.29	0.32
8	600309	烟台万华	6,337,797.19	0.30
9	600519	贵州茅台	5,597,046.66	0.26
10	000002	万科A	4,811,946.89	0.22
11	600031	三一重工	4,276,081.14	0.20
12	601088	中国神华	4,081,199.63	0.19
13	000937	冀中能源	4,037,658.46	0.19
14	600858	银座股份	3,859,952.46	0.18
15	601006	大秦铁路	3,746,000.00	0.18
16	601628	中国人寿	3,402,249.00	0.16
17	600123	兰花科创	3,336,298.12	0.16
18	000550	江铃汽车	3,174,803.00	0.15
19	600837	海通证券	2,873,255.72	0.13
20	002304	洋河股份	2,851,719.94	0.13

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的比例(%)
1	601328	交通银行	18,406,500.00	0.86
2	000001	平安银行	16,353,859.80	0.76
3	000858	五粮液	14,773,729.78	0.69
4	601318	中国平安	13,609,057.09	0.64
5	600000	浦发银行	13,360,000.00	0.62
6	601166	兴业银行	12,078,875.50	0.56
7	601601	中国太保	5,981,653.20	0.28
8	600519	贵州茅台	5,452,853.30	0.25
9	000002	万科A	5,358,500.00	0.25
10	600309	烟台万华	4,648,090.81	0.22
11	600031	三一重工	4,027,452.37	0.19
12	601088	中国神华	3,880,639.53	0.18
13	000937	冀中能源	3,665,587.59	0.17
14	600858	银座股份	3,638,041.29	0.17
15	601628	中国人寿	3,093,921.15	0.14
16	000550	江铃汽车	3,091,554.49	0.14
17	601006	大秦铁路	2,985,000.00	0.14
18	600123	兰花科创	2,796,003.38	0.13
19	002304	洋河股份	2,564,096.65	0.12
20	600837	海通证券	2,551,000.00	0.12

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	254,573,641.66
卖出股票收入（成交）总额	222,210,034.06

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,035,000.00	5.67
	其中：政策性金融债	70,035,000.00	5.67
4	企业债券	1,018,376,818.17	82.40
5	企业短期融资券	30,076,000.00	2.43
6	中期票据	111,780,000.00	9.04
7	可转债	131,201,400.00	10.62
8	其他	-	-
9	合计	1,361,469,218.17	110.16

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	126011	08石化债	1,280,000	122,880,000.00	9.94
2	110015	石化转债	1,000,000	102,910,000.00	8.33
3	126008	08上汽债	804,130	77,992,568.70	6.31
4	120405	12农发05	700,000	70,035,000.00	5.67
5	126006	07深高债	625,100	61,122,278.00	4.95

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	250,000.00
2	应收证券清算款	21,605,698.28
3	应收股利	-
4	应收利息	20,242,532.50
5	应收申购款	72,326.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,170,557.55

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	102,910,000.00	8.33
2	113002	工行转债	25,203,400.00	2.04

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
11,702	103,429.19	45,323,132.74	3.74%	1,165,005,199.86	96.26%

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	519,907.49	0.04%

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0份。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年5月24日）基金份额总额	3,032,111,617.30
本报告期期初基金份额总额	2,093,050,351.04
本报告期基金总申购份额	9,904,156.70
减：本报告期基金总赎回份额	892,626,175.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,210,328,332.60

§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

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2013年3月17日，根据国家金融工作需要，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于2013年3月17日公告上述事项。

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100,000.00元，已连续为本基金服务2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票交易的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		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	佣金	占当期佣金总量的比例
华泰联合证券	1	313,607,395.47	65.79%	272,491.03	66.51%
光大证券	1	102,240,107.26	21.45%	87,800.06	21.43%
华创证券	1	60,808,117.99	12.76%	49,407.24	12.06%

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行债券和债券回购交易的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易	
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交总额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰联合证券	1	1,486,963,280.46	75.79%	100,350,800,000.00	84.61%
光大证券	1	435,663,518.58	22.20%	11,003,674,000.00	9.28%
华创证券	1	39,445,123.42	2.01%	7,244,753,000.00	6.11%

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：无

（2）本基金报告期内停止租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	华创证券	深圳	1