

### 基金管理人:长盛基金管理有限公司 送出日期:2013年3月26日

#### § 1 重要提示

81 聖要提示
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
若整性类和个别及连带的注除责任。本年就程告已经三分之二以上独立董事等字程度。并由董事长客境
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 日夏 核 了本报告中的财务指标。净值表
海阔分能请应、财务会计附告,投资组合报告等内容、保证复核内容不存在虚假过载,误导性陈述或者重大遗漏。
基金管型人系诺以减空信用,勤勉尽册的原则管理和运用基金资产但不保证基金一定盈利。
基金管过入证据并不代表其未来表现,投资有风险人投资在成出投资决策前应任知阅读本基金的招募说明书及其更新。
本年度报告期务资料已经时计,需导本资金的国际,但不管证法会企业,在定任法检查的服务资料已经时,需导本资金的报募说明书及其更新。
本年度报告期务资料已经时计,需导本资金的现实是实验,是是是一个企业,是是一个企业。
第2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金简称	长盛中证 100 指数
基金主代码	519100
交易代码	519100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月22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	1,189,939,370.40 份
基金合同存续期	不定期
2.2 基金产品说明	·

2.2 基金产品况明	
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段。力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年限综误差在4%以下,以实现对基准指数的有效提踪。
投资策略	本基金为完全被对式指数基金。原则上采用复制指数投资策略,按照个股在基准指数中的基 准权重构建股票组合,并根据基准指数或份极及其权重的变动而进行相应调整,以复制和距 部基准指数。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率 (税后 )×5%
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金。风险中等,将获得证券市场平均收益率。其风险因素主要来自 于市场风险和锻器误差的风险。由于采用被动投资策略、在投资管理上将最大限度的分散付 系统性风险。对于服器误差的风险。本起邻通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理 手段、力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。
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
姓名		叶金松	李芳菲
贝贝八	联系电话	010-82019988	010-63201510
	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

§ 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

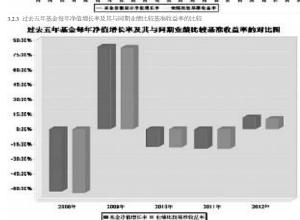
2011年 -30,431,094.97 -192,029,421.92	2010年 -47,938,010.43 -232,752,469.01
-192,029,421.92	
	-232,752,469.01
-0.1599	-0.1769
-19.50%	-17.70%
2011年末	2010年末
-0.3222	-0.1580
829,839,293.90	1,033,119,969.50
0.6778	0.8420
	-0.3222 829,839,293.90

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 期已实现收益加上本期公价值变动收益。 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

3.2.1 基金份额净值增						
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	11.91%	1.23%	11.96%	1.20%	-0.05%	0.03%
过去六个月	5.36%	1.15%	4.79%	1.14%	0.57%	0.01%
过去一年	11.98%	1.16%	10.48%	1.16%	1.50%	0.00%
过去三年	-25.81%	1.30%	-27.46%	1.29%	1.65%	0.01%
过去五年	-49.33%	1.85%	-52.82%	1.86%	3.49%	-0.01%
自基金合同生效起至 今	19.51%	1.88%	42.35%	1.92%	-22.84%	-0.04%
注, 太其全其准指数, 由	证 100 指数					

本基金的业绩比较基准中证 100 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 100





3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每10份基金份	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
1 22	额分红数	76367074920076104	172000000000000000000000000000000000000	1 (00,13113) 3 110 [17]	111 1-12
2012年	-	-	-	-	2012年度未分配 收益
2011年	-	-	-	-	2011年度未分配 收益
2010年	0.500	32,296,068.57	32,167,345.96	64,463,414.53	除息日:2010年 1月20日
合计	0.500	32,296,068.57	32,167,345.96	64,463,414.53	

4.1 基金管理人及基金经理情况 4.1.1 基金管理人及 肯德理 基金的经验 本基金管理人经中国证监会证监基字[19996 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 可股东发赴出资比例为国元证券股份有限公司以下简称。图元证券"为注册资本的 41%新加坡星展银行有限公司占注册资 本的 33%尖流管信用担保集团有限公司占注册资本的 13%。按着投除集团起来程限之间原 安徽者投资集团股租票 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 引,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,取得人

	T.1.2 金並に注(34金に注:/ 150/24金に注:// 150/24金に注:// 150/24金に注:/ 150/24金に						
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		
l			任职日期	离任日期	PDR		
	冯雨生	本基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金 (LOF)基金经理。	2011年7月11日	_	5年	男,1983年 11 月出生。北京大学金融学硕士。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。现任长盛中证 100 指数证券投资基金 4.60 产基金经理。	
Ī	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。						

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 征券投资基金法》及其各项实施准则、长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》 和其他有关注申注题、监管部门的相关规定在限域实信用、勤勉尽劳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。

他上,为基金份例明行利人除水販不利益公司相應查案以同时行利人村益时引1/9。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3 公平交易制度用控制方法
依据 征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
权益公司重新能订了《司公平交易规则》,报告期内公司根据资和则实际执行情况对其进行了完善。该规则从研究、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。各投资组合经理查守投资信息隔离清制度。 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制定、和大量长空易、交易制度、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、对待合公平交易条件的投资指令强制执行公 表的 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。 - 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"的原则执行交易持令。在末端尾眼份执行条件时,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

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

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、同时申根时要求价格差异趋于 要且申助量率比分配"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、监察僭核部 依照 《公司公平交易细则"的规定,持续、动态监督公司技 资管理在过程,并进行分析评估。这时间公司管理是指告发现问题、保障公司旗下所有投资组合均域公平对待。风险管理部是 由超近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答备。每月更出具上月度公 平交贴监控分析报告,每率度前每年度分别出具《平交易专项分析报告。公司通过系统汇录场内导常交易情况、监察僭核部定 期对其进行分析评估。每月度出具异常交易总结报告,并对场外交易,监察储核部每月度对公司旗下两柱资组合场外交易, 行专项施金、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。监察储模据对非公开发行股票申购以公司这个股份债券一级市场中购的申购方案、分配过程进行监督。确保分配结果符合公平交易原则。 430、平安息制度的执行情告况

购,以公司名义进行的债券一级市场中购的申购方案、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 征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 18. 项规定、保证公平对待旗
形态一个投资组合。 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。投资建议有实施投资决策方面享有
公平的组会交易标节中一层格疗策中交易制度。确保各及资理总产享入分等的表现,但公司公平交易制度的遗产和相
投资盈合公平交易情况和异常交易情况进行分析,并出具公平交易标行情况分析报告。同时,公司对公平交易制度的遗产和相
关业务准稳的执行情况是否许更和不定期的检查。并对发现的问题进行及时报告。
报告期内、公司按照 征券投资基金管理公司公平交易制度指导意见,和 公司公平交易规则中的规定对公司所有投资组
合简向交易价差进行分析,政能定 4 个季度交易记录、分别以 1.3.5 日为时间下段分析不同基金间以及公募基金 法保保经 专户组合等大类资产间的间面交易情况。对于间向交易次发生影使行、往途的情况、9 分乘宣信光学对其定的经验指套。 对于间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资能。分析结果显示本投资组合与公司其它组合间间向
交易价差对量全。

先期内,公司严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.3 开帝之的[7]的19 9999] 米雅告期内未必司献下所有报货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 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

# 长盛中证100指数证券投资基金

## **2012** 年度 报告摘要

易所公开竟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大证券投资基金以下简称 开放大基金",为确保转型后的开 放式基金牌特充裕流边性以原陽基金份鄉特有人利益。该基金一乘度朝定了数量化组合足按交易策略,非申请打开与公司族 下其他投资组合交易所市场的反向交易旋割。上述申请已报经公司投资决策委员会批准。打开反向交易控制制制。长盛同庆 严格技术就定数量化组合投资交易策略,批准下达投资指令。公司交易部对上述指令进行严格审核。在指令分发后,通过阻生 交易系统自动委托交易程序执行指令以确保公司施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 生的利益能分行为。 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投资策略和业绩表现的说明 4.4.1 程告期内基金投资策略有业绩表现的说明 14.1 程告期内基金投资策略有企作分析 回顾 2012年《支现经济受效债危股影响巨大、欧英经济增长率过低且失业率无显著改善,新兴市场增长持续放缓。为整顿 财政市级被撤离的金融体系,预加快与信抽口宣复货币交易计划,赛时能抽出资产购买计划。通过贸易和金融保留。中国也受 累其中,出口和总体经济增速回落。政府出台了一系列积极政策刺激经济。包括降息、降准、战绩尽管经济发展和加快项目审批。 A 度前站在经济回落和政策宽松的博弈下宽幅健荡。行业上、房地产、金融和家电池标案,经济从和电力设备涨幅都

在操作中,我们严格遵守基金合同,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少

在操作中我们严格遵守基金合同。在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少 跟瓷误差。
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0.7590元本报告期份额净值增长率为11.98%。同期业绩比较基准增长率为10.48%。本 报告期内日均跟踪误差为0.347%。年度代别紧误差为0.5491%。
4.5 管理人对宏观经济。证券市场及行业生势的高要展望 展望未来经济全能信何小明确各项政策也需率很多不确定性。行业政策、现于证券的高级联策、企业报时中位。CPI 可能量和上行行业表现格进步分化符合政策方面和少多模式领光的行业可能获得资金首除。 作为指数基金、现计解经策采针指数化性分算能系积极可求的极限的基金中间规则是可显求计指数跟踪效果带来的冲击。 控制基金的钢影误是差。在建基础上本基金将根接平用数量化投资策略增强指数力争获取超额收益。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 根据中国证金和长规定发本基金合同形定。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与信值程序。这立基金估值小 组参考行业场会的情况更加速度可关键的现在。在基金管理人制订了证券投资基金估值政策与信值程序。这立基金估值小 组参考行业场会信值宽见和建立第三方积估值数据,原体是一个格按照 像业金计准则入中国证监金相关规定更和基金合同 关于估值的约定对基金的特别交易和进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与信值程序。这立基金估值小 组参考行业场会估值宽见和建立第三方积的信值数据,原体是一个各理、企业。 本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序和设定了由公司总经理但在任何中,组建投入员由 总等优生和等特定的关键的是一个是一个企业,是一个企业的企业和各级。 次组任估值小组制组长,权益投资部。金融工程与提供投资部、研究部、监察解除部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值, 组等经过程序的,从当是设置,是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业的企业的企业。 基金经理参与估值规则和方法的计论。但不参与估值规则和方法的最终实现,会计例中系列,对位是要 要这法律合规等额级的专业处任能力, 基金经理参与估值规则和方法的技术基金任证,并是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业。 基金经理参与估值规则和方法的注意,不是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业。 是全型参与估值规则和方法的论是一个企业,一个企业的企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业。 基金经理与自然是是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业。 基金经理与由级行业企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业。 是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业。 是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业。 是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业。 是一个企业的企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业。 是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业和企业的企业。 是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业。 是一个企业的企业的企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业。 是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业。 是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业。 是一个企业的企业的企业的企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业的企业。 是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业的企业的企业。 是一个企业的企业的企业的企业。是一个企业的企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业的企业。 是一个企业的企业的企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业的企业。是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业的企业。是一个企业的企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业。是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业。 是一个企业的企业的企业,是一个企业,是一个企业,是一个企业的企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业。是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业,是一个企

根据《征券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十八条中对基金利润分配原则的约定,2012年度未实 用好配。 本基金截至 2012 年 12 月 31 日,期末可供分配利润为–286,751,304.74 元,其中:未分配利润已实现部分为 256,676,226.81

元,未分配利润未实现部分为-543,427,531.55 元。

元,未分配利润未实现部分为-543,427,531.55 元。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在午管长盛中证 100 指数证券投资基金的过程中。本基金托管人一中国农业银行股份有限公司严格遵守 征券投资基金 法跨相关法律法规的规定以及 张盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》、张盛中证 100 指数证券投资基金托管协议 100 约定对长盛中证 100 指数证券投资基金管理有限公司 2012 年 1月 1日至 2012 年 12 月 31 日基金的投资运作进行了认真,独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为

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 本任管人认为、长盛基金管理有限公司在长盛中证100 指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申 联联回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上、不存在损害基金份额持有人利益的行为。在报告期内,严格遵守了征 券投资基金法上滑有关法律法规。在各重要方面的运行严格按照基金台的均规定进行。 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 本托管人认为、长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规

7.1 资产负债表 会计主体:长盛中证 100 指数证券投资基金 报告截止日:2012 年 12 月 31 日

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	48,986,415.99	42,637,178.0
吉算备付金	300,000.00	565,720.1
字出保证金	1,050,000.00	1,050,000.0
<b></b> 交易性金融资产	852,498,704.76	788,768,193.3
其中:股票投资	852,498,704.76	788,023,083.6
<b>售金投资</b>	-	
责券投资	-	745,109.7
<b>资产支持证券投资</b>	-	
行生金融资产	-	
买人返售金融资产	-	
立收证券清算款	2,725,282.22	
立收利息	21,280.64	27,154.1
立收股利	_	
立收申购款	154,321.70	4,733.9
<b>递延所得税资产</b>	_	
其他资产	_	
<b>资产总计</b>	905,736,005.31	833,052,979.6
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
五 债:		
豆期借款	-	
交易性金融负债	_	
汀生金融负债	_	
卖出回购金融资产款	_	
立付证券清算款	_	
立付赎回款	771,312.25	213,104.
立付管理人报酬	531,312.31	543,966.
立付托管费	106,262.47	108,793.2
立付销售服务费	_	
立付交易费用	27,763.94	1,237,587.6
立交税费	_	
立付利息	_	
立付利润	_	
<b>並</b> 延所得税负债	_	
其他负债	1,111,288.68	1,110,234.
负债合计	2,547,939.65	3,213,685.
所有者权益:		·
<b></b> 上 收基金	1,189,939,370.40	1,224,322,489.
<b></b> 未分配利润	-286,751,304.74	-394,483,195.
所有者权益合计	903,188,065.66	829,839,293.
	905,736,005.31	833,052,979.6

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日 2012年1月1日至

	2012年12月31日	2011年12月31日
一、收入	109,824,250.67	-181,574,513.03
1.利息收入	800,983.08	686,939.96
其中:存款利息收入	800,547.23	685,281.46
债券利息收入	435.85	1,658.50
资产支持证券利息收入	_	-
买人返售金融资产收人	_	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益 假失以""号填列)	-25,594,500.81	-20,812,437.89
其中:股票投资收益	-42,954,029.92	-34,505,785.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	178,122.80	319,047.85
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	17,181,406.31	13,374,299.80
3.公允价值变动收益(损失以""号填列)	134,508,877.35	-161,598,326.95
4.汇兑收益 假失以""号填列)	-	_
5.其他收入 假失以 ""号填列)	108,891.05	149,311.85
减;二、费用	8,312,108.88	10,454,908.89
1.管理人报酬	6,296,409.48	7,280,639.16
2.托管费	1,259,281.89	1,456,127.75
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	377,594.15	1,339,667.98
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	_
6.其他费用	378,823.36	378,474.00
三、利润总额 传损总额以""号填列)	101,512,141.79	-192,029,421.92
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以""号填列)	101,512,141.79	-192,029,421.92

7.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计丰体:长盛中证 100 指数证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月:	31 ⊟		单位:人民币:	
	2012/2	本期 - 1 月 1 日至 2012 年 12 月	,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	
项 目	2012年 实收基金	- 1 万 1 口至 2012 年 12 万 未分配利润	31 口 所有者权益合计	
一、期初所有者权益 既金净值)	1,224,322,489.30	-394,483,195.40	829,839,293.90	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	101,512,141.79	101,512,141.79	
三、本期基金份额交易产生的基金净值变 动数 (争值减少以""号填列)	-34,383,118.90	6,219,748.87	-28,163,370.03	
其中:1.基金申购款	174,573,602.09	-51,058,540.69	123,515,061.40	
2.基金赎回款	-208,956,720.99	57,278,289.56	-151,678,431.43	
四、本期向基金份额持有人分配利润产生 的基金净值变动(争值减少以""号填列)	-	-	-	
五、期末所有者权益 偡金净值)	1,189,939,370.40	-286,751,304.74	903,188,065.66	
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 偡金净值)	1,226,954,396.65	-193,834,427.15	1,033,119,969.50	
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-192,029,421.92	-192,029,421.92	
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(争值减少以""号填列)	-2,631,907.35	-8,619,346.33	-11,251,253.68	
其中:1.基金申购款	246,682,691.09	-48,425,314.23	198,257,376.86	
2.基金赎回款	-249,314,598.44	39,805,967.90	-209,508,630.54	
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 偡金净值)	1,224,322,489.30	-394,483,195.40	829,839,293.90	

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: 图 兵 杨 思 乐 基金管理公司负责人 主管会计工作负责人

7.4.1 基金基本情况 长盛中世100 指数证券投资基金似下简称"本基金"整中国证券监督管理委员会似下简称"中国证监金"12006第172号 关于国营长梁中证100 指数证券投资基金募集给批复 源准由北底基金管理有限公司依照 化华人民共和国证券投资基金法判 长盛中证100 指数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和包未募集人民币4.029.660,276.84元,建经营华永道中天全计咖啡多所有限公司营华永道中天全产2006第179号验资报告予以验证。然向中国证监金备案、张盛中证100 指数证券投资基金基金合同户 2006年11月22日正式生发基金合同性文和的基金份额总为4031442983.24 仍基金份额,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农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》的有关规定。本基金投资于具有良 根据 中华人民共和国证券投资基金法》 (報告中证 100 指数证券投资基金基金合同的有关规定: 未益处资于具有复杂流地的金融工具包括中亚 100 指数或形像 A 各建的性。 新股位一级市场对次发行或健康等。以及注律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于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%,并且可以依据法律法规或监查机构的规定运用金融行生产品进行风险管理。本基金力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年期据误差在 44以下。本基金的业绩比较基地与中证 100 指数收益率59%4—年期银行储蓄存款利率(税后)之5%。本基金标的指数使用费由基金管理人长盛基金管理有限公司承担不计人本基金费用。本约各根表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司承担不计人本基金费用。本约各根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日指报出。本基金的助务报表规则数部于2006年2月15日颁布的 企业会计准则为138项具体会计准则,其后颁布6企业会计准则应用指摘。企业全计准则解析以及其他标其地定以下合称。企业全计特别"1、中国证监会颁布的 征券投资基金合信息披露 XBRL 模板第 3号《年度报告和学年度报告》》、中国证券投资基金业协会颁布的 征券投资基金会计核频业多指号1》、依盛中证 100 指数证券投资基金金合同》和在财务报表附往 7.44 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提作编制。

F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 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价值变效用亿等有余信息。 7.4.4 本程告期所采用的会计改策。会计估计与最近一期年度报告相一致的谈明 本报告期所采用的会计改策。会计估计会是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 会计按重更的说明 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 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 模项

(Ad.) 16-04 根限財政部、財稅(2002)[128 号 侯于开放式证券投资基金有关稅收问题的通知)、財稅(2005)[102 号 侯于股息红利个人所 得稅有美政策的通知)、財稅(2005)[107 号 侯于股息红利有关个人所得稅政策的补充通知)、財稅(2008)[1 号 侯于企业所得稅 若干优惠政策的通知)及其他相关財稅法期所主義權主要稅項列示如下: (1)以沒行基金方式募集资金不属于营业稅征收范围、不征收营业稅。

(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,

/代顯个人所得稅。 (4)基金卖出股票按 0.1%的稅率缴纳股票交易印花稅,买人股票不征收股票交易印花稅。

7.4.7 关联万关糸	
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. 根据长感基金公司 2012 年 8 月 29 日 傑干公司	司股东名称变更及公司音程修改的公告》长成基金公司的股东安

				亚洲牛瓜:八民川
关联方		<期 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	
名称	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	228,433,011.30	96.82%	686,744,217.81	79.03%
7.4.8.1.2 权证交易 本共会本期及 F-6		方交易单元发生权证交易		

7.4.8.1.3 债券交易	,			金额单位:人民币元
关联方		×期 至2012年12月31日		可比期间 2011年12月31日
名称	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
国元证券	2,971,598.70	100.00%	4,350,666,30	100.00%

7.4.8.1.4 应支付分	大味力1用室			金额单位:人民币:
关联方		本 2012年1月1日至	期 2012年12月31日	
名称	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	197,067.50	96.65%	20,925.63	75.37%
关联方		上年度 2011年 1 月 1 日至	可比期间 2011年12月31日	
名称	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	579,570.94	79.16%	66,331.36	5.36%

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。 7.48.2. 关联方报酬 7.48.2.1 基金管理费

		单位:人民币:
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	6,296,409.48	7,280,639.16
其中:支付销售机构的客户维护费	1,468,453.45	1,740,191.28
注支付基金管理人长盛基金管理有限公司的管理, 用底,按月支付。其计算公式为:		.75%的年费率计提,逐日累计至每

7.4.8.2.2 基金托管费

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	1,259,281.89	1,456,127.75
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 其计算公式为:	十提,逐日累计至每月月底,按月支付
日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数		

日托管费-前一日基金资产净值。0.158/当年天数。
7.4.8.3 与关联方进行银行同同业市场的债券(合回购)交易。
本基金本期及上年度可比期间无与关联方进市省银行间同业市场的债券(含回购)交易。
7.4.8.4 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的情况
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投资本基金。
7.4.8.1 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
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

				単位:人民市
关联方 名称	本 2012年1月1日至2			可比期间 2011年12月31日
4010	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	48,986,415.99	785,250.18	42,637,178.03	668,197.39
注, 水基金的银行2	左対由其全科管 人由国 ない	1/银行保管 按银行同业系	1家计自	

注本基金的银行存款由基金托管人中国灾业银行保管获银行同业系 4.8.6 本基金在新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明同末在新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设明 本基金本期及上年度可比期间无须作设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 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 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 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

									金额单位:	人民币:
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 段)	期末 成本总額	期末 估值总额	备注
000002	万科A	2012/12/26	重大事项	10.12	2013/01/21	11.13	2,489,721.00	24,370,265.20	25,195,976.52	
000527	美的电器	2012/08/27	重大事项	9.69	未知	未知	526,955.00	7,432,158.48	5,106,193.95	
601618	中国中冶	2012/12/28	重大 事项	2.26	2013/01/04	2.33	1,254,484.00	4,957,290.45	2,835,133.84	
A 5.1										

(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: 第一层级直接比如取宜的格房应用按比如根据价格推算的接价。 第二层级直接比如取宜的格房应用按比如根据价格推算的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。 可观察到的,就等一层级中的市场报价以外的变量为基础确定的 (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的金融工具中属于第一层级的余额为819,361,400.45元。属于第二 的余额为33,137,304.31元、无属于第三层级的余额(2011年12月31日:第一层级788,768,193.34元、无属于第二三层级

協会物。 (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 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 2000年间,2 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人第一层级、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

(4)第三层级公允价值余额和本期变动金额

元。 3、除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说 § 8 投资组合报告

序号	项目	金額	占基金总资产的比例 %)
1	权益投资	852,498,704.76	94.12
	其中:股票	852,498,704.76	94.12
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	买人返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	_
5	银行存款和结算备付金合计	49,286,415.99	5.44
6	其他各项资产	3,950,884.56	0.44
7	合计	905,736,005.31	100.00

			32.19(+-1)1./\p\(\frac{1}{2}\)
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	1,131,069.76	0.13
В	采掘业	93,442,574.93	10.35
С	制造业	206,043,251.92	22.81
C0	食品、饮料	55,981,408.80	6.20
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	8,755,246.24	0.97
C5	电子	4,613,892.99	0.51
C6	金属、非金属	51,811,626.99	5.74
C7	机械、设备、仪表	79,588,328.35	8.81
C8	医药、生物制品	4,895,252.00	0.54
C99	其他制造业	397,496.55	0.04
-	The first territory of the first standard of		

	V7T	052 400 704 76	04.20
M	综合类	-	-
L	传播与文化产业	-	-
K	社会服务业	7,113,015.00	0.79
J	房地产业	48,840,002.98	5.41
I	金融、保险业	406,084,976.33	44.96
H	批发和零售贸易	7,025,558.75	0.78
G	信息技术业	11,747,396.00	1.30
F	交通运输、仓储业	19,809,938.80	2.19

					and the latter of the deliver
序号	股票代码	股票名称	数量 般)	公允价值	占基金资产净值比 例 %)
1	600036	招商银行	3,883,777	53,401,933.75	5.91
2	600016	民生银行	5,838,452	45,890,232.72	5.08
3	601318	中国平安	866,731	39,254,246.99	4.35
4	601166	兴业银行	1,948,959	32,528,125.71	3.60
5	601328	交通银行	5,883,848	29,066,209.12	3.22
6	600000	浦发银行	2,881,462	28,584,103.04	3.16
7	000002	万 科 A	2,489,721	25,195,976.52	2.79
8	600030	中信证券	1,762,529	23,547,387.44	2.61
9	601088	中国神华	873,701	22,148,320.35	2.45
10	600519	贵州茅台	105,077	21,963,194.54	2.43

注投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明知。应阅读登载于 http://www.cs.funds.com.en 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 本基金本报告期末未持有积极投资投票。

				本 歌 中 世: 八 1 八 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1 1
序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期初基金资产净值的比例 %)
1	600011	华能国际	5,327,887.56	0.64
2	601669	中国水电	4,314,252.00	0.52
3	600036	招商银行	4,264,534.19	0.51
4	601318	中国平安	3,963,195.37	0.48
5	600016	民生银行	3,685,778.87	0.44
6	002415	海康威视	3,055,009.00	0.37
7	601088	中国神华	2,921,947.58	0.35
8	601328	交通银行	2,737,485.68	0.33
9	600519	贵州茅台	2,730,638.43	0.33
10	601166	兴业银行	2,586,211.01	0.31
11	000002	万 科 A	2,446,536.23	0.29
12	000869	张裕A	2,435,122.06	0.29
13	600000	浦发银行	2,394,130.71	0.29
14	600030	中信证券	2,258,853.25	0.27
15	601111	中国国航	2,206,490.00	0.27
16	600029	南方航空	2,144,599.00	0.26
17	600837	海通证券	1,911,299.77	0.23
18	601601	中国太保	1,882,220.31	0.23
19	000858	五粮液	1,872,793.01	0.23
20	601398	工商银行	1,660,098.00	0.20
8.4.2	累计卖出金额超出	期初基金资产净值	12%或前20名股票明细	A straight (), I have

累计卖出金额 占期初基金资产净值的比例	例 %)
6,269,755.11	
5,055,249.69	
4,512,162.77	
3,633,865.35	
3,496,373.21	
3,482,559.61	
3,153,161.87	
3,150,248.86	
3,129,346.77	
2,996,182.00	
2,952,696.84	
2,804,680.23	
2,743,657.56	
2,668,399.55	
2,489,510.09	
2,429,948.80	
2,399,486.11	
2,360,662.17	
2,336,005.71	
2,304,004.35	

104,794,236.91 卖出股票收入(战交)总额 注:本项中8.41.8.42和8.43表中的 实人金额"成 实人股票成本", 卖出金额"成 类出股票收入"卢按买卖成交 交单价乘以成交数值填列,不考虑相交交易费用。 8.5 期末按衡品种分类的债券投资组合

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

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

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 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

X2Hu。 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 2,725,282.2 154,321.7

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况 序号 股票代码 股票名称 **游涌受限情况说明** 

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

由于四舍五人的原因,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

64,853	18,348.25		103,771,014.77	8.72%	1	,086,168,355.63	91.28%		
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			787,489.13			0.07%			
			和研究部门负责人 总量的数量区间为 §10 开放			区间为 10 万份至	50万份。		

基金合同生效日 2006年11月22日)基金份额总额	4,031,424,938.24
本报告期期初基金份额总额	1,224,322,489.30
本报告期基金总申购份额	174,573,602.09
减:本报告期基金总赎回份额	208,956,720.99
本报告期基金拆分变动份额	=
本报告期期末基金份额总额	1,189,939,370.40

\$11 皇太爭忡悔办
11.1 基金价额持有人大会决议
本报告期未召开基金价额持有人大会。
11.2 基金管理人,基金社管人的专门基金社管部门的重大人事变动
11.21 本基金管理人,基金社管人等人,由变动情况
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。

和12.3 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

x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。 2报告期基金投资策略没有改变。

本报告刑法金於貨班時改有奴交。 11.5 为基金进行自计的多计师事务所情况 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,报告期内 共支付该会计师事务所有计费用 84,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为7年。 11.6 管理人, 托管人及其高级管理人员会管查收罚等情况 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

						金額	領单位:人民币5
	六日	股票交易		债券交易		应支付该券商的佣金	
育名称	交易 单元 数量	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
元证券	2	228,433,011.30	96.82%	2,971,598.70	100.00%	197,067.50	96.65%
联证券	1	7,511,303.35	3.18%	-	-	6,838.31	3.35%
信证券	1	-	-	-	-	-	-
银国际	1	-	-	-	-	-	-
金证券	1	_	_	_	_	_	_

(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)成分與平占高限好。 (到將者枕戌長片各项則多指称显示公司经常状况稳定。 (4)終营行为規定最近兩年未因重大违规行分而受到中国证监会和中国人民很行处罚。 (5)内部管理规定。严格具备能会的内控制度,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

2.本公司租用券除交易单元的程序 (1)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; (2)研究处规部,投资管理等部门试用研究机构的好报告后,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 经公司领申批信,没司与研究机构签定 研究服务协议)、 等商交易单产租用协议,3+协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。 (3)本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过行"光本公司认为签约机构的服务不能满足要求或签约机构结果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省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元。 (2)本基金报告期内停止租用交易单元元。