

同盛证券投资基金  
2010 年年度报告摘要

2010 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：2011 年 3 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 2011 年 3 月 30 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，安永华明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 2010 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	长盛同盛封闭
基金主代码	184699
交易代码	184699
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年11月5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	3,000,000,000份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1999年11月26日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属于成长价值复合型基金，主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和市场价值被低估的价值型上市公司，利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好的分散和控制风险，实现基金资产的稳定增长。
投资策略	本基金将根据市场发展情况，确定在一段时间内市场发展的总体趋势，并在此基础上确定股票和国债的配置比例以及股票投资中成长型投资和价值型投资的配置比例。并分别选取成长型特征最明显的股票和价值型特征最明显的股票进行组合投资。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

### 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
	联系电话	010-82255818
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666	95566
	010-62350088	
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	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## § 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	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	420,699,405.33	78,374,835.48	-636,593,234.17
本期利润	328,849,161.19	1,476,618,063.72	-3,377,962,433.34
加权平均基金份额本期利润	0.1096	0.4922	-1.1260
本期基金份额净值增长率	8.89%	66.44%	-49.85%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	0.0947	-0.0455	-0.2592
期末基金资产净值	4,027,856,109.43	3,699,006,948.24	2,222,388,884.52
期末基金份额净值	1.3426	1.2330	0.7408

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

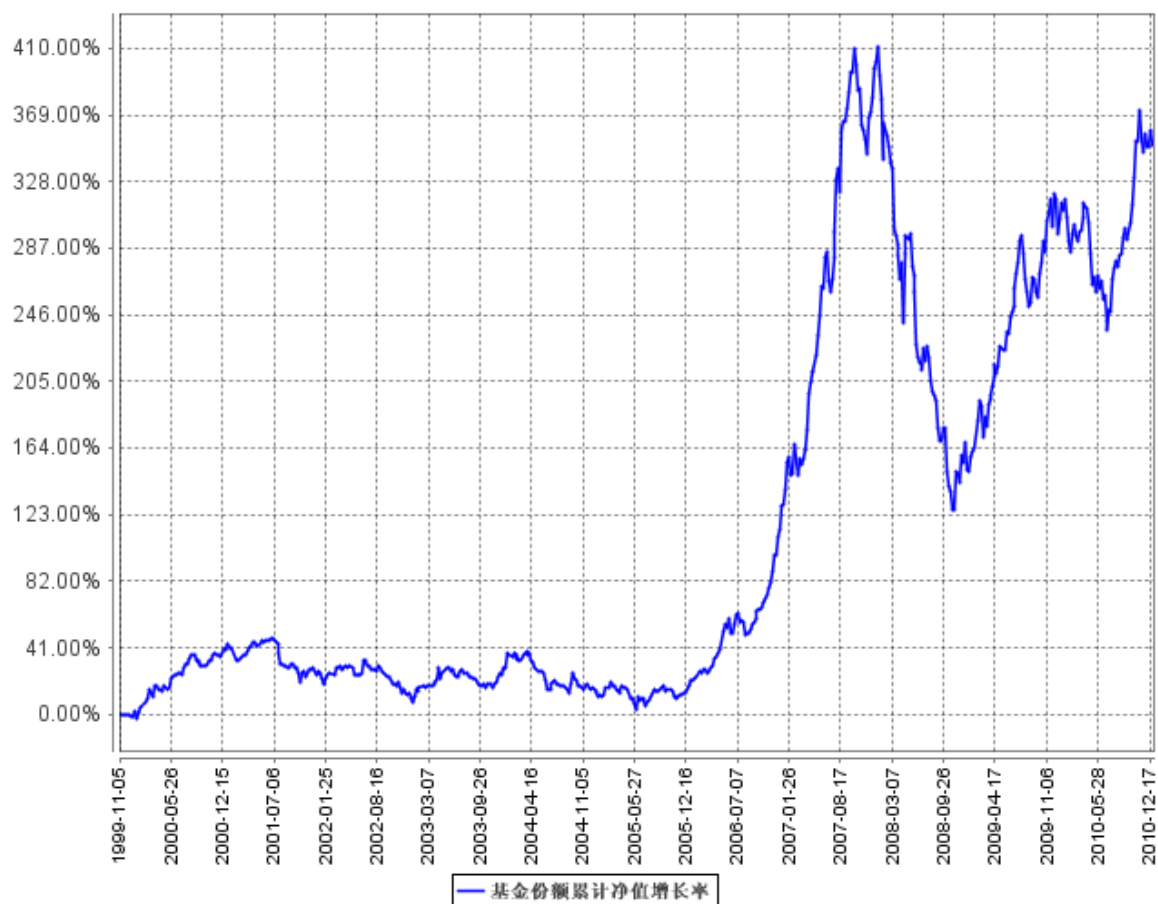
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②
过去三个月	12.22%	2.76%
过去六个月	32.20%	2.39%
过去一年	8.89%	2.53%
过去三年	-9.12%	3.40%
过去五年	284.70%	3.30%
自基金合同生效起至今	351.96%	2.64%

注：本基金无业绩比较基准收益率，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

### 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

(1999年11月5日至2010年12月31日)

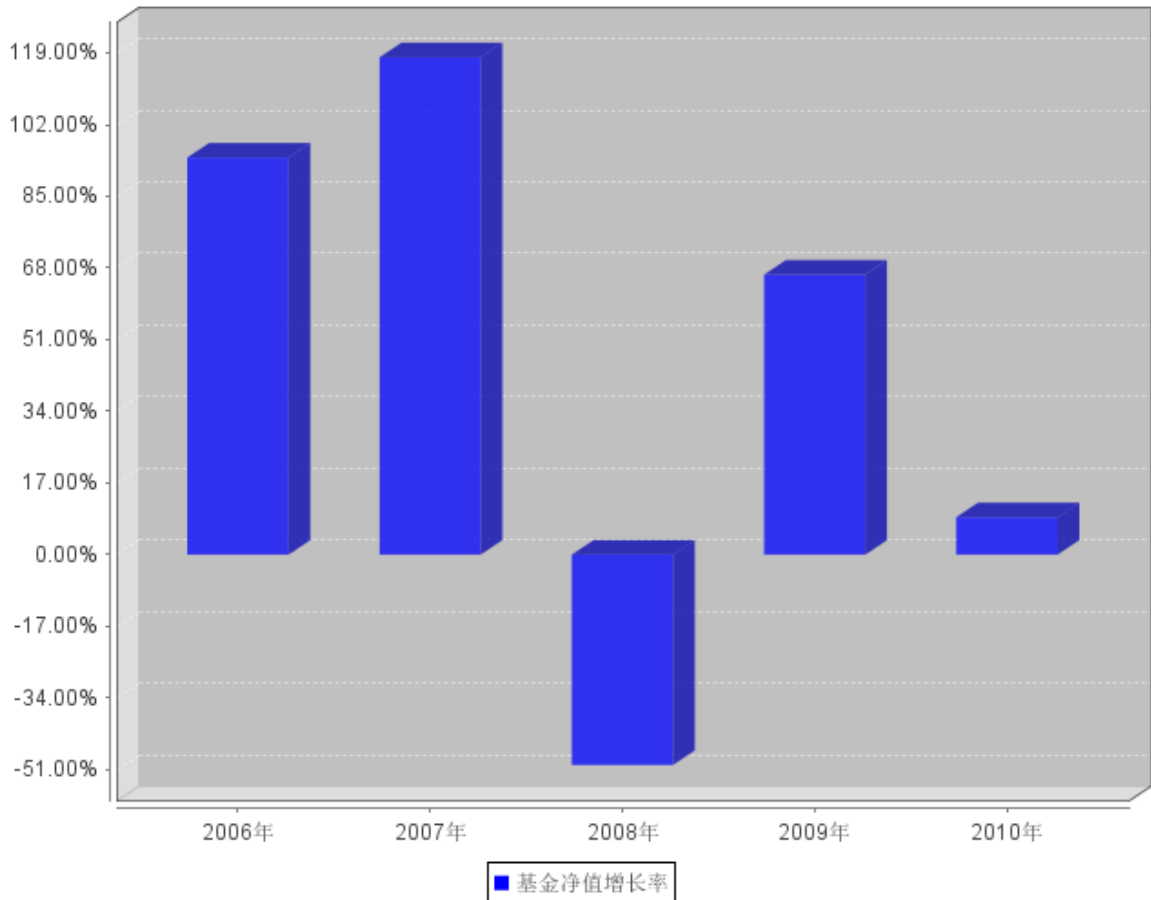
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按本基金无同期业绩比较基准收益率，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

### 3.2.3 过去五年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

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金无同期业绩比较基准收益率。

### 3.3 过去三年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
2010 年	-	-	-	-	2010 年度未分配收益
2009 年	-	-	-	-	2009 年度未分配收益
2008 年	11.000	3,300,000,000.00	-	3,300,000,000.00	除息日：2008 年 4 月 15 日
合计	11.000	3,300,000,000.00	-	3,300,000,000.00	

## § 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%；新加坡星展资产管理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%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截止2010年12月31日，基金管理人共管理两支封闭式基金、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		
侯继雄	本基金基金经理。	2008年8月11日	-	9年	男，1974年5月出生，中国国籍。清华大学博士。2001年4月至2007年2月在国泰君安证券研究所任研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司，现任同盛证券投资基金（本基金）基金经理。
丁骏	本基金基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理。	2008年4月25日	-	9年	男，1974年11月出生，中国国籍。中国社会科学院经济学博士。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师；国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理；2003年6月加入长盛基金管理有限公司，先后担任行业研究员、组合经理助理。现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理，同盛证券投资基金（本基金）基金经理。

王克玉	本基金基金经理助理	2010年1月12日	2010年7月12日	7年	男, 1979年12月出生, 中国国籍。上海交通大学硕士。历任元大京华证券上海代表处研究员, 天相投资顾问有限公司分析师, 国都证券有限公司分析师。2006年7月加入长盛基金管理有限公司, 曾任行业研究员, 本基金基金经理助理, 目前已离任。
-----	-----------	------------	------------	----	---

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;

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、《同盛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, 在认真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 公平交易制度的执行情况

本报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定, 从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关, 通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行, 确保公平对待不同投资组合, 切实防范利益输送, 保护投资者的合法权益。

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合, 暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本基金未发生异常交易情况。

#### 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

2010 年的股票市场展示了“幡动、风动、心动”的投资故事。投资者情绪的波动率远大于经济基本面本身的波动率。年初投资者的情绪是很乐观的，“经济复苏已确认、将迎来繁荣”，但很快对经济繁荣的预期因信贷紧缩、房地产调控而转变为中长期熊市论，在 7 月份市场的下跌幅度远远超过了左侧操作型价值型投资者的预期。在三季度，在汇率调整、PMI 回升、海外市场明确货币宽松的因素下，投资者悲观预期慢慢被修正。四季度则在美元二次量化宽松、日本减息等二次放松货币刺激经济的背景下，投资者情绪进而向乐观转移，一度在 11 月份形成冲击 09 年高点的市场预期。但此后在通胀持续超预期、政策趋紧态势明朗之际，市场又再次回调。回顾全年，显然在经济增长、流动性紧缩方面，经济的起落仍然是有序的，经济基本面好时是有瑕疵的好，落时是有预判的落，经济仍然在稳定、可控的区间内波动，而股市大波动更多源于投资者的心动。本基金在上半年轻视了政策调整的影响、对市场的趋势下跌重视不够，左侧交易反而带来了更大的损失。但在下半年市场预期修正之后，组合表现较为优异，使得前期损失得以弥补。

#### 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 1.3426 元，本报告期份额净值增长率为 8.89%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

2011 年，宏观经济的波动率较 10 年可能进一步缩小，预期 GDP 增速在 9.5% 上下、CPI 在 4% 上下；政策转变的基调也基本为市场所接受和认可，包括“积极财政、稳健货币”、约 50~75bp 的加息、1000 万套保障性住房建设、战略性新兴产业规划、收入分配机制改革、资源价格改革等。总体上，2011 年宏观层面对市场的冲击力度会减小，而且对宏观经济的中长期忧虑也在大盘蓝筹股票中得到了充分体现，因此要更多的关注中观和微观层面，即从行业配置和个股选择上寻找盈利来源。目前看，大盘蓝筹、周期类成长股、稳定消费股在估价合理的前提下大都具备运作空间，而战略性新兴产业仍然会是市场的热点，但会进行分化，真正具有核心优势并能转化为业绩的，才望有持续的优良表现。2011 年，本基金将根据估值和成长相匹配的原则，优先在受益通胀、产业升级、

消费升级主题下优选行业和个股。

#### 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副总经理（担任估值小组组长）、督察长（担任估值小组组长）及投资管理部、金融工程及量化投资部、研究发展部、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十七条中对基金利润分配原则的约定，本基金于 2011 年 3 月 25 日对 2010 年度收益进行了分配，分配金额为 270,000,000.00 元。

本基金截至 2010 年 12 月 31 日期末可供分配利润为 284,241,550.27 元。未分配收益已实现部分为 284,241,550.27 元，未分配收益未实现部分为 743,614,559.16 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”）在对同盛证券投资基金（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

安永华明会计师事务所有限公司注册会计师杨勃、王珊珊 2011 年 3 月 17 日对本基金 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 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安永华明(2011)审字第 60468688\_A04 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（经审计）

会计主体：同盛证券投资基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	127,966,145.60	18,139,363.46
结算备付金	3,812,267.29	1,939,761.48
存出保证金	1,009,265.43	905,029.66
交易性金融资产	3,895,502,661.83	3,682,706,248.54
其中：股票投资	3,022,017,574.53	2,926,160,751.14
基金投资	-	-
债券投资	873,485,087.30	756,545,497.40
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	11,043,514.75	4,553,062.78
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>4,039,333,854.90</b>	<b>3,708,243,465.92</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2010年12月31日</b>	<b>上年度末 2009年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
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	-	-
应付管理人报酬	5,133,795.47	4,665,466.06
应付托管费	855,632.59	777,577.68
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,069,425.75	1,374,582.28
应交税费	1,823,891.66	1,823,891.66

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	595,000.00	595,000.00
<b>负债合计</b>	<b>11,477,745.47</b>	<b>9,236,517.68</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	1,027,856,109.43	699,006,948.24
<b>所有者权益合计</b>	<b>4,027,856,109.43</b>	<b>3,699,006,948.24</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>4,039,333,854.90</b>	<b>3,708,243,465.92</b>

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3426 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：同盛证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
<b>一、收入</b>	<b>400,364,581.01</b>	<b>1,539,634,149.46</b>
1. 利息收入	19,521,887.36	21,142,638.63
其中：存款利息收入	1,142,169.40	1,034,984.58
债券利息收入	18,353,356.86	20,107,654.05
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	26,361.10	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	472,671,935.19	120,242,435.85
其中：股票投资收益	456,030,255.37	98,773,127.62
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,380,652.40	641,845.75
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	19,022,332.22	20,827,462.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-91,850,244.14	1,398,243,228.24
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	21,002.60	5,846.74
<b>减：二、费用</b>	<b>71,515,419.82</b>	<b>63,016,085.74</b>

1. 管理人报酬	53,532,567.37	45,726,549.86
2. 托管费	8,922,094.52	7,621,091.71
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	8,516,636.60	8,677,339.52
5. 利息支出	88,976.93	543,659.28
其中：卖出回购金融资产支出	88,976.93	543,659.28
6. 其他费用	455,144.40	447,445.37
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>328,849,161.19</b>	<b>1,476,618,063.72</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>328,849,161.19</b>	<b>1,476,618,063.72</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：同盛证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日。

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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）	3,000,000,000.00	699,006,948.24	3,699,006,948.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	328,849,161.19	328,849,161.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
<b>五、期末所有者权益（基金净值）</b>	<b>3,000,000,000.00</b>	<b>1,027,856,109.43</b>	<b>4,027,856,109.43</b>
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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）	3,000,000,000.00	-777,611,115.48	2,222,388,884.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,476,618,063.72	1,476,618,063.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-

五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	699,006,948.24	3,699,006,948.24
-----------------	------------------	----------------	------------------

注：后附附注为本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：

陈礼华	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（经审计）

### 7.4.1 基金基本情况

同盛证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[1999]30号文《关于同意同盛证券投资基金设立的批复》批准，由中信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、天津北方国际信托投资股份有限公司、国元证券股份有限公司和长盛基金管理有限公司五家发起人共同发起并向社会募集设立。本基金为契约型封闭式，存续期为15年，发行规模为30亿份基金份额。本基金经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[1999]109号文审核同意，于1999年11月26日在深交所挂牌交易。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《同盛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，其中主要投资于国内依法公开发行、上市的股票、债券。本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%。本基金并未就业绩比较基准作出相关规定。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息



披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》和《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〉》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本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于2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

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：**本年度不存在会计政策变更。

**7.4.5.2 会计估计变更的说明：**本年度不存在会计估计变更。

**7.4.5.3 差错更正的说明：**本年度不存在差错更正。

#### **7.4.6 税项**

##### **1、印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3%调整为1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

##### **2、营业税、企业所得税**

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

### 3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金发起人
天津北方国际信托投资股份有限公司	基金发起人
中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）	基金发起人
长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”）	基金发起人、基金管理人
国元证券	基金发起人、基金管理人股东
新加坡星展资产管理有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人股东
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人

#### 1、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

截至资产负债表日，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 2、本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长江证券	基金发起人
中信证券	基金发起人
长盛基金	基金发起人、基金管理人
国元证券	基金发起人、基金管理人股东
中国银行	基金托管人

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券	82,159,796.66	1.50%	2,597,426,972.15	46.04%
中信证券	124,322,185.45	2.26%	1,047,572,813.89	18.57%
国元证券	1,324,337,057.08	24.12%	571,325,128.44	10.13%
合计	1,530,819,039.19	27.88%	4,216,324,914.48	74.74%

##### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	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
长江证券	-	-	115,023,145.33	64.30%
中信证券	-	-	13,056,798.39	7.30%
国元证券	21,504,949.24	13.92%	40,094,784.40	22.41%
合计	21,504,949.24	13.92%	168,174,728.12	94.01%

##### 7.4.8.1.3 权证交易

于2010年度及2009年度，本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例
长江证券	-	-	882,800,000.00	100.00%
国元证券	100,000,000.00	50.00%	-	0.00%
合计	100,000,000.00	50.00%	882,800,000.00	100.00%

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当年佣金	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
长江证券	69,835.87	1.52%	338,788.37	11.04%
中信证券	101,012.87	2.20%	101,012.87	3.29%
国元证券	1,106,927.68	24.14%	347,472.63	11.32%
合计	1,277,776.42	27.86%	787,273.87	25.66%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日			
	当年佣金	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
长江证券	2,207,804.92	46.72%	268,952.50	19.61%
中信证券	851,157.86	18.01%	-	-
国元证券	480,720.88	10.17%	469,960.06	34.27%
合计	3,539,683.66	74.90%	738,912.56	53.88%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

#### 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 2010年1月1日至2010年12 月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	53,532,567.37
其中：支付销售机构的客户维护	-	-

费		
---	--	--

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值的20%，超出部分不计提基金管理费。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值（扣除本基金持有现金比例超过20%部分的基金资产净值）

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
当年发生的基金应支付的托管费	8,922,094.52	7,621,091.71

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2010年1月1日至2010年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出	
中国银行	79,708,909.59	-	-	-	345,600,000.00	60,219.62
长江证券	-	-	-	-	-	-

合计	79,708,909.59	-	-	-	345,600,000.00	60,219.62
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
	中国银行	316,522,318.38	284,462,288.76	-	-	150,000,000.00
长江证券	99,670,000.00	-	-	-	-	-
合计	416,192,318.38	284,462,288.76	-	-	150,000,000.00	41,671.23

#### 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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
基金合同生效日（1999年11月5日）持有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
期初持有的基金份额	6,000,000.00	6,000,000.00
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	6,000,000.00	6,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.20%	0.20%

##### 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 2010年12月31日		上年度末 2009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
基金发起人、基金管理人股东-国元证券股份有限公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
基金发起人-天津北方国际信托	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
基金发起人-长江证券	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
基金发起人-中信证券	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%

##### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当年产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	127,966,145.60	1,110,460.84	18,139,363.46	1,000,511.79

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于2010年度及2009年度均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

无。

#### 7.4.9 期末（2010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

本基金本年末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 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

证券代码	证券名称	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
600664	哈药股份	2010-12-29	重大事项	22.57	2011-02-16	24.83	1,500,000.00	23,975,624.16	33,855,000.00

##### 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

本基金本年末持有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

本基金本年末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## § 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	资产项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,022,017,574.53	74.81
	其中：股票	3,022,017,574.53	74.81
2	固定收益投资	873,485,087.30	21.62
	其中：债券	873,485,087.30	21.62
	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	131,778,412.89	3.26
6	其他各项资产	12,052,780.18	0.30
7	合计	4,039,333,854.90	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	-	-
B	采掘业	429,165,500.00	10.65
C	制造业	1,502,622,314.91	37.31
C0	食品、饮料	308,201,965.93	7.65
C1	纺织、服装、皮毛	37,380,894.32	0.93
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	247,861,272.90	6.15
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	28,850,096.54	0.72
C7	机械、设备、仪表	598,323,245.62	14.85
C8	医药、生物制品	282,004,839.60	7.00
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	124,663,306.35	3.10
F	交通运输、仓储业	8,959,955.20	0.22
G	信息技术业	158,774,249.55	3.94
H	批发和零售贸易	330,902,825.78	8.22
I	金融、保险业	263,172,000.00	6.53
J	房地产业	67,400,000.00	1.67
K	社会服务业	35,154,000.00	0.87
L	传播与文化产业	-	-



M	综合类	101,203,422.74	2.51
	合计	3,022,017,574.53	75.03

### 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	600309	烟台万华	10,499,910	201,493,272.90	5.00
2	601318	中国平安	3,500,000	196,560,000.00	4.88
3	600031	三一重工	6,500,000	140,595,000.00	3.49
4	000937	冀中能源	3,250,000	130,162,500.00	3.23
5	600266	北京城建	10,209,935	124,663,306.35	3.10
6	000338	潍柴动力	2,200,000	115,214,000.00	2.86
7	600739	辽宁成大	3,581,529	107,875,653.48	2.68
8	600655	豫园商城	7,661,454	103,046,556.30	2.56
9	600519	贵州茅台	550,000	101,156,000.00	2.51
10	000423	东阿阿胶	1,537,400	78,561,140.00	1.95

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	600309	烟台万华	122,813,025.47	3.32
2	000937	冀中能源	101,845,915.80	2.75
3	600266	北京城建	98,292,649.06	2.66
4	601088	中国神华	80,776,405.57	2.18
5	600031	三一重工	78,681,068.68	2.13
6	601699	潞安环能	65,361,219.96	1.77
7	600739	辽宁成大	57,037,422.61	1.54
8	000028	一致药业	55,899,592.62	1.51
9	600252	中恒集团	49,453,574.35	1.34
10	600195	中牧股份	49,238,640.36	1.33
11	600600	青岛啤酒	48,238,058.58	1.30
12	000729	燕京啤酒	48,219,863.92	1.30
13	600089	特变电工	47,746,406.56	1.29
14	600582	天地科技	47,145,645.63	1.27
15	600267	海正药业	45,112,556.82	1.22
16	000983	西山煤电	44,382,248.16	1.20

17	600100	同方股份	43,578,887.84	1.18
18	002153	石基信息	43,444,495.48	1.17
19	600271	航天信息	42,743,611.02	1.16
20	600519	贵州茅台	42,519,939.76	1.15

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名股票明细

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	000338	潍柴动力	138,921,860.36	3.76
2	600031	三一重工	132,638,434.22	3.59
3	600016	民生银行	126,335,341.42	3.42
4	600479	千金药业	78,425,544.44	2.12
5	600000	浦发银行	73,128,682.70	1.98
6	000667	名流置业	70,386,851.57	1.90
7	000401	冀东水泥	64,783,103.21	1.75
8	600166	福田汽车	61,231,579.04	1.66
9	600322	天房发展	61,145,551.94	1.65
10	601939	建设银行	58,896,851.31	1.59
11	601601	中国太保	55,274,680.06	1.49
12	000063	中兴通讯	54,276,223.91	1.47
13	600123	兰花科创	53,887,864.55	1.46
14	000960	锡业股份	53,351,305.87	1.44
15	601001	大同煤业	51,015,569.93	1.38
16	601618	中国中冶	48,809,411.73	1.32
17	000425	徐工机械	45,214,172.57	1.22
18	000983	西山煤电	45,069,866.20	1.22
19	600332	广州药业	42,351,141.06	1.14
20	600528	中铁二局	39,670,045.68	1.07

### 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	2,632,444,799.54
卖出股票收入（成交）总额	2,902,942,032.68

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	债券类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	93,952,087.30	2.33
2	央行票据	258,990,000.00	6.43
3	金融债券	520,543,000.00	12.92
	其中：政策性金融债	520,543,000.00	12.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	873,485,087.30	21.69

### 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	100209	10 国开 09	1,500,000	150,855,000.00	3.75
2	0801029	08 央行票据 29	1,000,000	100,240,000.00	2.49
3	060208	06 国开 08	1,000,000	100,030,000.00	2.48
4	100221	10 国开 21	1,000,000	98,900,000.00	2.46
5	010112	21 国债 (12)	600,000	60,432,000.00	1.50

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 声明本报告期内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	1,009,265.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,043,514.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,052,780.18

### 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

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
59,664	50,281.58	1,710,024,866	57.00%	1,289,975,134	43.00%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

份额单位：份

序号	持有人名称	持有份额	占上市份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	273,600,485	9.12%
2	中国人寿保险（集团）公司	243,802,765	8.13%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	156,998,508	5.23%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	94,099,219	3.14%
5	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品	85,551,880	2.85%
6	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红-019L-FH002 深	72,067,618	2.40%
7	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	59,799,975	1.99%
8	阳光财产保险股份有限公司—自有资金	54,311,006	1.81%
9	UBS AG	48,476,339	1.62%
10	泰康人寿保险股份有限公司—万能—个人分红—个人分红	46,227,940	1.54%

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

#### 10.2.1 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 2010 年 6 月 18 日发布公告，经长盛基金管理有限公司第五届董事会第一次会议审议通过，并报中国证监会审核批准（证监许可[2010]762 号），聘任公司董事凤良志先生担任公司董事长，陈平先生不再担任公司董事长一职。

本基金管理人于 2010 年 6 月 23 日发布公告，经长盛基金管理有限公司第五届董事会第二次会议审议通过，决定聘任朱剑彪先生担任公司副总经理职务。

#### 10.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金的基金经理未变更。

#### 10.2.3 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基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 10.5 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安永华明会计师事务所。本报告期内本基金未更换会计师事务所，报告期内共支付安永华明会计师事务所审计费用 95,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 12 年。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2010 年 9 月 6 日，本基金管理人因旗下长盛创新先锋基金所持债券投资比例连续 12 个交易日不符合基金合同的约定，以及长盛货币市场基金所持“10 柳化工 CP01”债券的数量超过该债券发行数量的 10% 的原因，受到北京证监局的行政监管措施。本基金管理人根据行政监管措施决定书的要求及时、认真地对公司投资管理制度流程、风险管理、监察稽核及执行等各方面进行了整改、

梳理和完善。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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
国泰君安	2	-	-	-	-
招商证券	1	1,014,325,733.37	18.47%	824,144.50	17.97%
中信证券	1	124,322,185.45	2.26%	101,012.87	2.20%
银河证券	2	215,728,979.87	3.93%	175,281.45	3.82%
国元证券	2	1,324,337,057.08	24.12%	1,106,927.68	24.14%
国信证券	1	2,406,425,312.46	43.82%	2,045,453.64	44.60%
海通证券	1	-	-	-	-
长江证券	2	82,159,796.66	1.50%	69,835.87	1.52%
东方证券	1	-	-	-	-
齐鲁证券	1	323,983,926.36	5.90%	263,238.65	5.74%

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
国泰君安	2	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-
国元证券	2	21,504,949.24	13.92%	100,000,000.00	50.00%
国信证券	1	132,961,225.00	86.08%	100,000,000.00	50.00%
海通证券	1	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-

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：  
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	方正证券（原泰阳证券）	上海	1