

同益证券投资基金

2012 年年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2013 年 3 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国工商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。

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（特殊普通合伙）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。

1.2	目录	
§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
1.2	目录	2
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
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	14
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§ 5	托管人报告	18
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
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	18
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	18
§ 6	审计报告	19
6.1	审计报告基本信息	19

6.2 审计报告的基本内容 .....	19
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表 .....	20
7.2 利润表 .....	21
7.3 所有者权益(基金净值)变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	23
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	45
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49
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 ..	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 .....	50
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 ..	50
8.9 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>52</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	52
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产，基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.7.1 基金租用证券公司交易进行单元股票交易及佣金支付的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	55

§ 11 备查文件目录.....	56
11.1 备查文件目录.....	56
11.2 存放地点.....	56
11.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	同益证券投资基金
基金简称	长盛同益封闭
基金主代码	184690
交易代码	184690
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年4月8日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,000,000,000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4月21日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	始终如一地奉行“价值投资”的基本原则，并在不同的市场环境以及市场发展变化的不同阶段，灵活运用适合自身运作特点的投资原则、投资理念和投资技巧。在战略资产配置层，寻求现金、债券、股票资产的动态收益、风险最优配置；在战术资产配置层，寻求成长型股票和价值型股票的动态收益、风险最优配置。
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	叶金松	赵会军
	联系电话	010-82019988	010-66105799
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666	95588
		010-62350088	
传真		010-82255988	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		凤良志	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场 东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	中国深圳市深南中路 1093 号中信大厦 21 层

## § 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	2010年
本期已实现收益	-337,849,306.04	-47,488,817.36	184,200,003.54
本期利润	809,516.51	-532,513,479.27	-98,749,668.06
加权平均基金份额本期利润	0.0004	-0.2663	-0.0494
本期加权平均净值利润率	0.05%	-25.62%	-4.00%
本期基金份额净值增长率	0.05%	-23.67%	-2.74%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配利润	-376,798,522.97	-285,186,854.06	228,539,600.43
期末可供分配基金份额利润	-0.1884	-0.1426	0.1143
期末基金资产净值	1,715,622,662.45	1,714,813,145.94	2,467,326,625.21
期末基金份额净值	0.8578	0.8574	1.2337
3.1.3 累计期末指标	2012年末	2011年末	2010年末
基金份额累计净值增长率	449.23%	443.48%	611.97%

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
过去三个月	1.43%	2.30%
过去六个月	-3.47%	2.18%
过去一年	0.05%	2.10%
过去三年	-25.72%	2.13%
过去五年	-35.15%	2.89%
自基金合同生效起至今	449.23%	2.62%

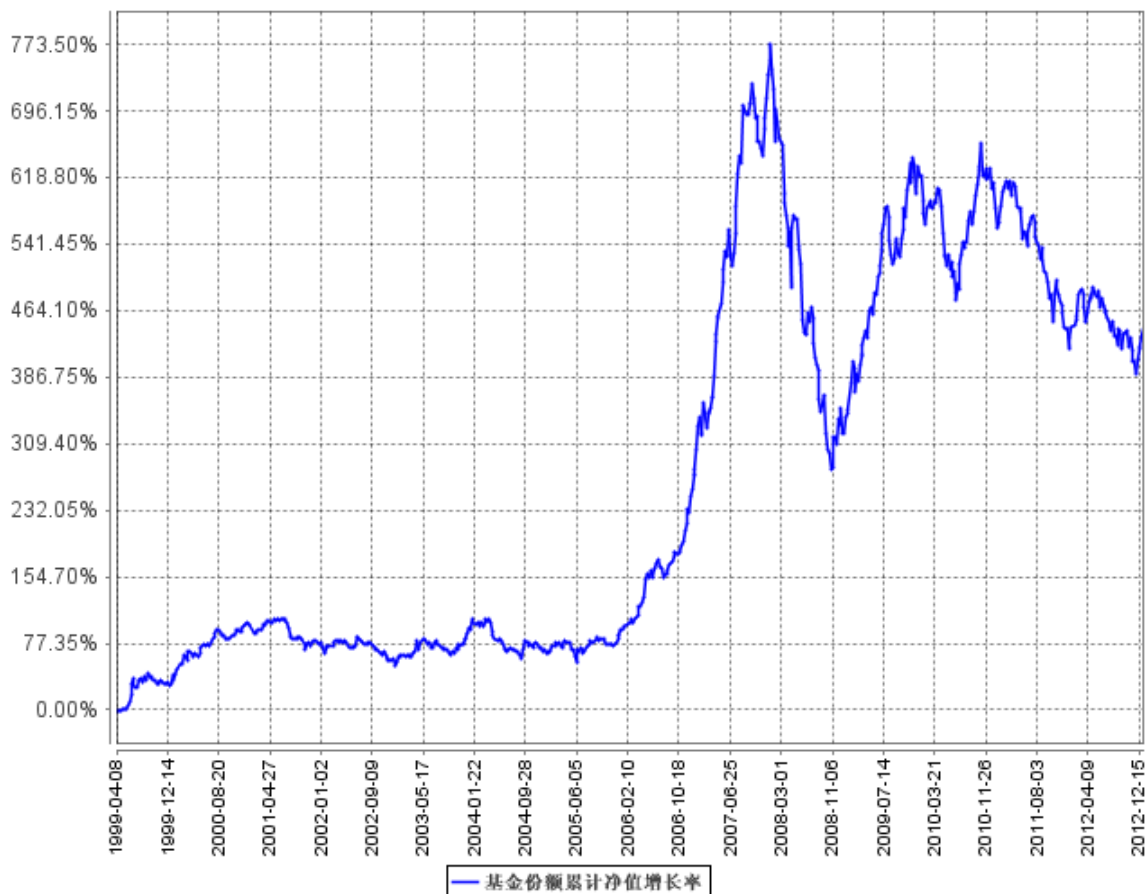
注：本基金无业绩比较基准收益率，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。



### 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4月8日至2012年12月31日)

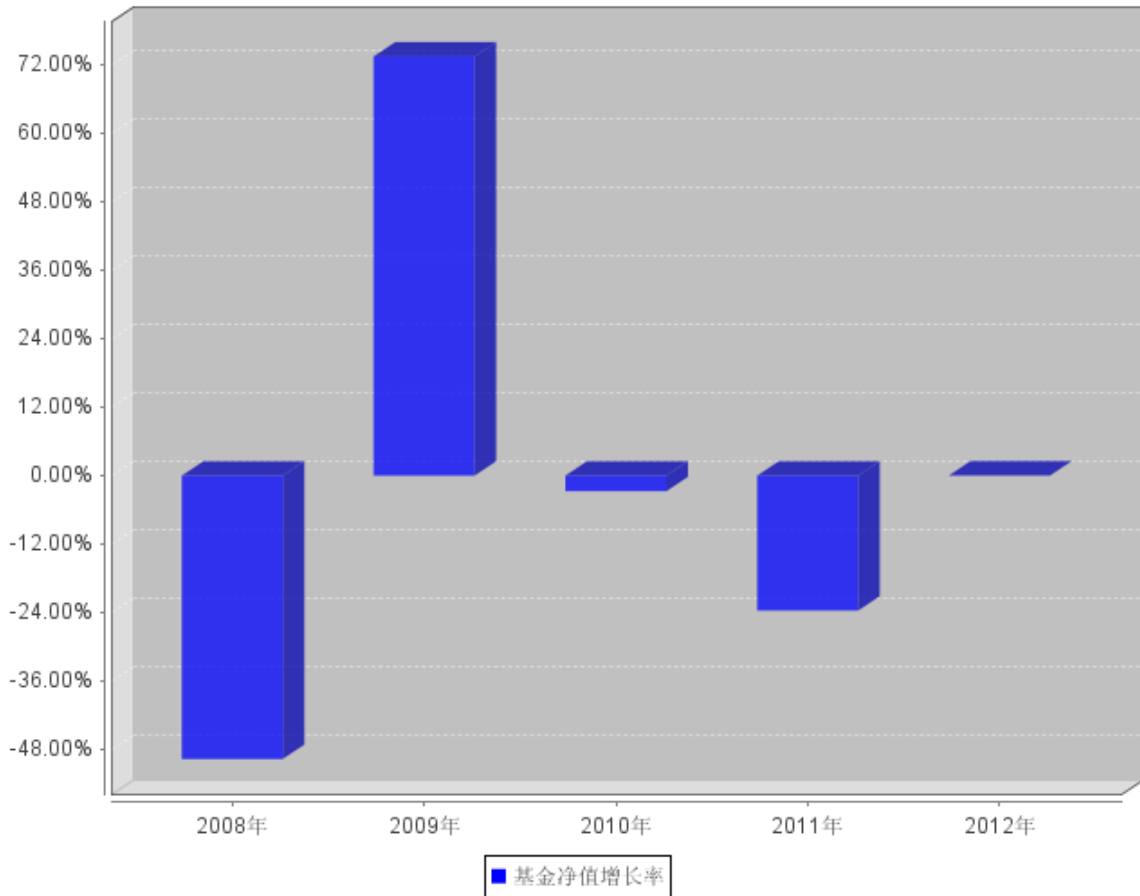
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

### 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
2012 年	-	-	-	-	2012 年度未分配收益
2011 年	1.100	220,000,000.00	-	220,000,000.00	除息日：2011 年 3 月 25 日
2010 年	3.000	600,000,000.00	-	600,000,000.00	除息日：2010 年 3 月 31 日
合计	4.100	820,000,000.00	-	820,000,000.00	

## § 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张锦灿	本基金基金经理	2012年11月20日	—	7年	男，1982年1月出生。北京大学光华管理学院金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、研究主管、基金经理助理。2012年9月加入长盛基金管理有限公司，现任同益证券投资基金（本基金）基金经理。
王克玉	本基金基金经理，长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理。	2010年7月13日	—	9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，曾任同盛证券投资基金基金经理助理，高级行业研究员。现任同益证券投资基金（本基金）基金经理，长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理。

注：1、报经中国证券投资基金业协会同意，目前王克玉同志已不再担任同益证券投资基金基金经理，该基金由张锦灿同志继续负责管理。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；

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、《同益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内的公平交易程序，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内的公平交易程序，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内的公平交易程序，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1季度，A股在投资人的一片绝望之中，受地产销售数据回暖及“金改”预期影响，迎来了一波小幅反弹，涨幅居前的行业主要是有色金属、房地产和家电等早

周期和强周期的板块，而医药、信息服务等行业小幅下跌。2季度，市场受内外部不利因素影响冲高回落，医药生物、食品饮料和电力等景气回升板块表现较好，上游和后周期行业出现明显的下跌。3季度，在业绩和政策负面因素影响下各板块轮番下跌，纺织服装、房地产跌幅最大，医药受销售回暖影响跌幅较小。4季度，受盈利下滑、改革预期降温、食品安全及钓鱼岛等问题影响指数一路下跌，创出2008年以来新低，然后在外围市场、改革希望重启等积极因素影响下，增量资金的刺激下，迅猛反弹，房地产、银行、建材等行业表现最好。

本基金在1季度适当调整了组合的分散度，增持了券商、电力等基本面出现拐点的行业，减持了建材、房地产等强周期行业，前半期获得了较好效果。2季度，适当提高了行业的集中度，增持了家电、电力、食品饮料等行业，减持了采掘、房地产等行业，但是由于组合中食品饮料、医药等行业的配置偏低，导致业绩出现明显的下滑。3季度，保持相对稳定的股票仓位，增持了医药、农化、家电、电力设备，卖出了通信设备、建材等行业，还在8月份买入了业绩增速快的中小盘公司。4季度，前半期保持了一个弹性相对较大的组合，在“维稳”行情落空后，对仓位进行了一定下调，但在随后的反弹中较早提高了高贝塔行业建材、保险等的配置，并适时增加了仓位。

#### 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0.8578元，本报告期份额净值增长率为0.05%。

#### 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

##### 4.5.1 对宏观经济和证券市场展望

当前，市场在政治信心恢复影响下，仍处于估值修复阶段；全年看经济、企业盈利见底弱复苏，市场机会大小取决于通胀、信心和流动性状况。2013年，经济本身处于长周期结构调整与短周期弱复苏共振时期，如果没有内外部政策因素干扰，经济将在重新库存的影响下经历一个相对较弱的需求恢复，中游行业盈利改善相对明显。地产景气加速、地方投资冲动、输入型流动性、通胀等可能改变既有复苏节奏，加速物价上涨步伐，增加投资产业链和上游行业的投资机会。不过，国内的金融系统风险、地产价格上涨带来的政策风险会否释放，趋于高涨的改革预期能否兑现，则会加剧市场的波动。而市场整体的流动性状况又取决于金融改革的影响、物价预期、热钱压力、央行和中央的政策导向等因素，尚不明确。但整体看，2013年的机会多于2012年，需要保持一个相对积极的态度。

#### 4.5.2 本基金下阶段投资策略

1 季度，经济的主线是制造业重新库存、基建和地产销售，政策的关注点是改革、房价、金融风险、输入型流动性，早周期行业销售数据预计会有回暖迹象、上游价格有所反弹，我们更倾向于关注房地产、家电、建材、汽车、焦煤、农业等中上游行业的投资机会，不过，这些行业的业绩恢复可能偏弱。同时，还要紧盯政策改革导向发掘投资机会，或规避风险。在仓位、配置上，前期保持相对高仓位，结构偏周期，后期择机增加自下到上型消费类个股配置，降低组合的仓位和波动性。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作，保障资产委托人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时敦促有关部门改进、完善，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

1、强调合规培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训等多种方式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，强化员工合规理念，深化员工合规意识，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、强调制度/流程建设，扎实公司内控制度建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，保证公司制度/流程的合法合规、全面、适时、有效。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，确保制度/流程严肃性与执行力。报告期内，监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核工作，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、登记注册、产品开发等等；并根据业务发展需要，以及日常监督中发现问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，以保障公司制度/流程的严肃性与执行力。

5、加强员工行为合规的检查监督。报告期内，监察稽核部借助信息技术系统，



通过完善员工投资报备系统、建设员工合规档案系统等，提高员工行为合规管理水平，督促员工自觉合规。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至 2012 年 12 月 31 日，期末可供分配收益为-376,798,522.97 元，其中：

未分配收益已实现部分为-376,798,522.97 元，未分配收益未实现部分为92,421,185.42 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

2012年，本基金托管人在对同益证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

2012年，同益证券投资基金的管理人——长盛基金管理有限公司在同益证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的同益证券投资基金2012年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2013)审字第 60468688_A02 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	同益证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的同益证券投资基金财务报表,包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表和 2012 年度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。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人长盛基金管理有限公司的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为,上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了同益证券投资基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	李慧民	王珊珊
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2013 年 3 月 13 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：同益证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	100,952,012.88	45,698,358.10
结算备付金		4,650,381.52	3,206,599.49
存出保证金		861,191.88	782,136.99
交易性金融资产	7.4.7.2	1,630,460,937.06	1,679,036,298.09
其中：股票投资		1,229,274,637.03	1,244,036,667.79
基金投资		-	-
债券投资		401,186,300.03	434,999,630.30
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	5,785,394.50	5,335,937.81
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,742,709,917.84</b>	<b>1,734,059,330.48</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年12月31日</b>	<b>上年度末 2011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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		20,336,449.59	13,612,316.71
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,059,854.64	2,217,460.84
应付托管费		343,309.13	369,576.79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,416,942.35	1,116,130.52

应交税费		815,699.68	815,699.68
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,115,000.00	1,115,000.00
<b>负债合计</b>		<b>27,087,255.39</b>	<b>19,246,184.54</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	-284,377,337.55	-285,186,854.06
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,715,622,662.45</b>	<b>1,714,813,145.94</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,742,709,917.84</b>	<b>1,734,059,330.48</b>

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8578 元，基金份额总额 2,000,000,000 份。

## 7.2 利润表

会计主体：同益证券投资基金

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	附注号	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
<b>一、收入</b>		<b>41,799,598.31</b>	<b>-485,642,142.32</b>
1. 利息收入		18,158,844.42	19,506,741.71
其中：存款利息收入	7.4.7.11	661,290.73	1,121,999.81
债券利息收入		15,805,845.73	17,148,468.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,691,707.96	1,236,273.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-315,036,171.35	-20,124,222.12
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-334,237,286.31	-32,030,712.64
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	3,330,128.10	-3,353,353.73
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	15,870,986.86	15,259,844.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	7.4.7.17	338,658,822.55	-485,024,661.91
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	7.4.7.18	18,102.69	-
<b>减：二、费用</b>		<b>40,990,081.80</b>	<b>46,871,336.95</b>

1. 管理人报酬		25,984,610.01	31,267,617.20
2. 托管费		4,330,768.36	5,211,269.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	10,232,946.18	9,293,026.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	441,757.25	1,099,424.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>809,516.51</b>	<b>-532,513,479.27</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>809,516.51</b>	<b>-532,513,479.27</b>

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：同益证券投资基金

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）	2,000,000,000.00	-285,186,854.06	1,714,813,145.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	809,516.51	809,516.51
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>2,000,000,000.00</b>	<b>-284,377,337.55</b>	<b>1,715,622,662.45</b>
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（基金净值）	2,000,000,000.00	467,326,625.21	2,467,326,625.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-532,513,479.27	-532,513,479.27
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)		-220,000,000.00	-220,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	-285,186,854.06	1,714,813,145.94

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
基金管理人负责人	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

同益证券投资基金（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]8 号文《关于同意同益证券投资基金设立的批复》的核准，由中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、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，基金合同于 1999 年 4 月 2 日正式生效，首次设立募集规模为 20 亿份基金份额。本基金为契约型封闭式，存续期为 15 年。本基金经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[1999]21 号文审核同意，于 1999 年 4 月 21 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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金只投资于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（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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》、《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。

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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 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**

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### **1、金融资产分类**

金融资产应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项以及可供出售金融资产。金融资产分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）于初始确认时划分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。

本基金将持有的其他金融资产划分为贷款和应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。

## 2、金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### 1、股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣

除交易费用入账；

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

## 2、债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限计算应收利息，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，出售债券的成本按移动加权平均法于成交日结转。

## 3、权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该类权证初始成本为零；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

## 4、分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

## 5、回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

## 1、股票投资

### (1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

### (2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

### C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的首次取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的首次

取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

## 2、债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的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，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

## 3、权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

#### 4、分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值；

#### 5、其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额，每份基金面值为人民币 1.00 元。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

3、资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

4、买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

5、股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

6、债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

7、衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

9、公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

10、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.9 费用的确认和计量**

1、基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

3、卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.10 基金的收益分配政策**

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、基金收益分配采取现金方式；

3、基金当期收益在弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，年度收益分配比例不低于基金可分配收益的90%；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

#### **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：本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明：本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明：本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 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；

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。

##### 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、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	100,952,012.88	45,698,358.10
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月-1 年	-	-
其他存款	-	-
合计	100,952,012.88	45,698,358.10

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,135,319,381.64	1,229,274,637.03	93,955,255.39	
债券	交易所市场	101,700.00	102,300.03	600.03
	银行间市场	402,618,670.00	401,084,000.00	-1,534,670.00
	合计	402,720,370.00	401,186,300.03	-1,534,069.97
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,538,039,751.64	1,630,460,937.06	92,421,185.42	
项目	上年度末 2011 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,490,095,112.17	1,244,036,667.79	-246,058,444.38	

债券	交易所市场	14,517,853.05	14,596,130.30	78,277.25
	银行间市场	420,660,970.00	420,403,500.00	-257,470.00
	合计	435,178,823.05	434,999,630.30	-179,192.75
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,925,273,935.22	1,679,036,298.09	-246,237,637.13

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应收活期存款利息	12,519.30	8,444.05
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,092.70	1,443.00
应收债券利息	5,770,782.50	5,326,006.26
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收权证保证金利息	-	44.50
合计	5,785,394.50	5,335,937.81

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,416,517.35	1,115,030.52
银行间市场应付交易费用	425.00	1,100.00
合计	2,416,942.35	1,116,130.52

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	750,000.00	750,000.00
应付赎回费	-	-

预提审计费	95,000.00	95,000.00
预提信息披露费用	270,000.00	270,000.00
合计	1,115,000.00	1,115,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,000,000,000	2,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,000,000,000	2,000,000,000.00

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-38,949,216.93	-246,237,637.13	-285,186,854.06
本期利润	-337,849,306.04	338,658,822.55	809,516.51
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-376,798,522.97	92,421,185.42	-284,377,337.55

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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1月1日至 2011年12月31日
活期存款利息收入	578,670.11	1,052,885.47
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	82,345.07	67,560.99
权证保证金利息收入	275.55	1,553.35
合计	661,290.73	1,121,999.81

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

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1月1日至 2011年12月31日
卖出股票成交总额	3,367,683,056.36	3,025,064,039.13
减：卖出股票成本总额	3,701,920,342.67	3,057,094,751.77

买卖股票差价收入	-334,237,286.31	-32,030,712.64
----------	-----------------	----------------

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖基金差价收入。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

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1月1日至 2011年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期 兑付）成交总额	530,494,434.26	854,475,031.30
减：卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成本总额	520,142,969.86	835,040,853.51
减：应收利息总额	7,021,336.30	22,787,531.52
债券投资收益	3,330,128.10	-3,353,353.73

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖衍生工具差价收入。

#### 7.4.7.16 股利收益

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1月1日至 2011年12月31日
股票投资产生的股利收益	15,870,986.86	15,259,844.25
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	15,870,986.86	15,259,844.25

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
1. 交易性金融资产	338,658,822.55	-485,024,661.91
——股票投资	340,013,699.77	-487,293,408.87
——债券投资	-1,354,877.22	2,268,746.96
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	338,658,822.55	-485,024,661.91

#### 7.4.7.18 其他收入

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1月1日至 2011年12月31日
基金赎回费收入	-	-
转换费收入	-	-
印花税手续费返还	18,102.69	-
其他	-	-
合计	18,102.69	-

#### 7.4.7.19 交易费用

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1月1日至 2011年12月31日
交易所市场交易费用	10,231,021.18	9,289,626.19
银行间市场交易费用	1,925.00	3,400.00
合计	10,232,946.18	9,293,026.19

#### 7.4.7.20 其他费用

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1月1日至 2011年12月31日
银行费用	3,257.25	6,324.03
审计费用	95,000.00	95,000.00
信息披露费	270,000.00	270,000.00
账户维护费	13,500.00	18,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
分红手续费	-	650,100.00
合计	441,757.25	1,099,424.03

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

#### 7.4.9.1 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（“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 （“天津北方国际信托”）	基金发起人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金发起人
长盛基金管理有限公司	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
新加坡星展银行有限公司	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
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

注：根据中国证监会 2012 年 7 月 10 日发布的证监许可[2012]917 号《关于核准长盛基金管理有限公司修改章程的批复》，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后仍为长盛基金管理有限公司的股东。

#### 7.4.9.2 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
长盛基金管理有限公司	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
中国工商银行	基金托管人

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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 1 月 1 日至 2011 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
国元证券	1,171,304,482.55	17.46%	1,297,201,734.44	21.32%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：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 1 月 1 日至 2011 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
国元证券	74,861,431.00	23.51%	20,008,000.00	22.54%

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：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1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期债券 回购总额的比例	成交金额	占当期债券 回购总额的比例
国元证券	-	-	220,000,000.00	5.88%

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
	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	1,053,991.54	18.05%	1,044,025.21	43.20%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	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	1,070,813.18	20.99%	143,373.34	12.86%

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和经手费后的净额列示。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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 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	25,984,610.01	31,267,617.20
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。基金成立三个月后，如果现金持有比例超过基金资产净值的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为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值（扣除超过规定比例现金后的资产净值）

基金管理人的管理费每日计算，管理费计算逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款通知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。

#### 7.4.10.2.2 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	4,330,768.36	5,211,269.53

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的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为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计算，基金托管费计算逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的划款通知于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易：

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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1月1日至 2011年12月31日
期初持有的基金份额	28,000,079	28,000,079
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动的份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	28,000,079	28,000,079
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.40%	1.40%

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。



#### 7.4.10.4.2 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
长江证券	6,000,000	0.30%	6,000,000	0.30%
天津北方国际信托	4,000,000	0.20%	4,000,000	0.20%
中信证券	6,000,000	0.30%	6,000,000	0.30%
国元证券	4,000,000	0.20%	4,000,000	0.20%

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

#### 7.4.10.5 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1月1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
中国工商银行	100,952,012.88	578,670.11	45,698,358.10	1,052,885.47

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000527	美的电器	2012/8/27	重大资产重组停牌	9.69	尚未公告	未知	4,481,077	55,589,188.68	43,421,636.13	

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场

风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金

流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出权证保证金及债券投资等。

下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
银行存款	100,952,012.88	-	-	-	-	-	100,952,012.88
结算备付金	4,650,381.52	-	-	-	-	-	4,650,381.52
存出保证金	-	-	-	-	-	861,191.88	861,191.88
交易性金融资产	-	70,290,000.00	50,317,300.03	280,579,000.00	-	1,229,274,637.03	1,630,460,937.06
应收利息	-	-	-	-	-	5,785,394.50	5,785,394.50
<b>资产总计</b>	<b>105,602,394.40</b>	<b>70,290,000.00</b>	<b>50,317,300.03</b>	<b>280,579,000.00</b>	<b>-</b>	<b>1,235,921,223.41</b>	<b>1,742,709,917.84</b>
<b>负债</b>							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	20,336,449.59	20,336,449.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,059,854.64	2,059,854.64
应付托管费	-	-	-	-	-	343,309.13	343,309.13
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,416,942.35	2,416,942.35
应交税费	-	-	-	-	-	815,699.68	815,699.68
其他负债	-	-	-	-	-	1,115,000.00	1,115,000.00
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>27,087,255.39</b>	<b>27,087,255.39</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>105,602,394.40</b>	<b>70,290,000.00</b>	<b>50,317,300.03</b>	<b>280,579,000.00</b>	<b>-</b>	<b>1,208,833,968.02</b>	<b>1,715,622,662.45</b>
<b>上年度末 2011年12月31日</b>	<b>1个月以内</b>	<b>1-3个月</b>	<b>3个月-1年</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>							
银行存款	45,698,358.10	-	-	-	-	-	45,698,358.10
结算备付金	3,206,599.49	-	-	-	-	-	3,206,599.49
存出保证金	98,780.49	-	-	-	-	683,356.50	782,136.99
交易性金融资产	129,356,000.00	144,000,715.40	161,540,503.00	102,411.90	-	1,244,036,667.79	1,679,036,298.09
应收利息	-	-	-	-	-	5,335,937.81	5,335,937.81
<b>资产总计</b>	<b>178,359,738.08</b>	<b>144,000,715.40</b>	<b>161,540,503.00</b>	<b>102,411.90</b>	<b>-</b>	<b>1,250,055,962.10</b>	<b>1,734,059,330.48</b>
<b>负债</b>							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	13,612,316.71	13,612,316.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,217,460.84	2,217,460.84
应付托管费	-	-	-	-	-	369,576.79	369,576.79

应付交易费用	-	-	-	-	-	1,116,130.52	1,116,130.52
应交税费	-	-	-	-	-	815,699.68	815,699.68
其他负债	-	-	-	-	-	1,115,000.00	1,115,000.00
<b>负债总计</b>	-	-	-	-	-	<b>19,246,184.54</b>	<b>19,246,184.54</b>
利率敏感度缺口	178,359,738.08	144,000,715.40	161,540,503.00	102,411.90	-	-1,230,809,777.56	1,714,813,145.94

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金资产净值产生的影响。

假设	(1) 该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况； (2) 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变； (3) 此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	+25 个基点	-1,703,095.40	-1,057,375.35
-25 个基点	1,703,095.40	1,057,375.35	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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%。于 2012 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项 目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
-----	-------------------------	--------------------------

	公允价值	占基金资产 净值的比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值的比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,229,274,637.03	71.65	1,244,036,667.79	72.55
交易性金融资产—债券投资	401,186,300.03	23.38	434,999,630.30	25.37
合计	1,630,460,937.06	95.04	1,679,036,298.09	97.91

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

假设	(1) 假定上证指数变化 5%，其他变量不变； (2) 用期末时点上证指数浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险； (3) Beta 系数是根据组合在过去一年的净值数据和上证指数数据回归得出，反映了基金和上证指数的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
分析		本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	+5%	74,107,842.12	60,895,917.73
	-5%	-74,107,842.12	-60,895,917.73

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2013 年 3 月 13 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	1,229,274,637.03	70.54
	其中：股票	1,229,274,637.03	70.54
2	固定收益投资	401,186,300.03	23.02
	其中：债券	401,186,300.03	23.02
	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	105,602,394.40	6.06
6	其他资产	6,646,586.38	0.38
7	合计	1,742,709,917.84	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

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	52,073,016.43	3.04
B	采掘业	7,101,500.00	0.41
C	制造业	670,511,074.02	39.08
C0	食品、饮料	151,903,531.52	8.85
C1	纺织、服装、皮毛	29,159,603.10	1.70
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	72,498,204.42	4.23
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	171,493,511.28	10.00
C7	机械、设备、仪表	206,883,692.95	12.06
C8	医药、生物制品	38,572,530.75	2.25
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	5,910,000.00	0.34
E	建筑业	45,322,891.92	2.64
F	交通运输、仓储业	7,189,396.04	0.42
G	信息技术业	67,206,909.30	3.92
H	批发和零售贸易	55,561,436.35	3.24
I	金融、保险业	200,574,722.02	11.69
J	房地产业	78,148,944.87	4.56

K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	39,674,746.08	2.31
M	综合类	-	-
	合计	1,229,274,637.03	71.65

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	4,099,822	63,998,221.42	3.73
2	000581	威孚高科	1,733,064	55,284,741.60	3.22
3	601318	中国平安	1,145,000	51,857,050.00	3.02
4	601601	中国太保	2,200,000	49,500,000.00	2.89
5	000527	美的电器	4,481,077	43,421,636.13	2.53
6	000401	冀东水泥	3,117,562	43,022,355.60	2.51
7	002146	荣盛发展	3,000,033	41,970,461.67	2.45
8	601336	新华保险	1,399,821	40,342,841.22	2.35
9	600637	百视通	2,499,984	39,674,746.08	2.31
10	600585	海螺水泥	2,100,000	38,745,000.00	2.26
11	600801	华新水泥	2,399,854	36,405,785.18	2.12
12	601788	光大证券	2,399,988	33,839,830.80	1.97
13	600108	亚盛集团	4,499,841	30,733,914.03	1.79
14	002230	科大讯飞	969,931	29,388,909.30	1.71
15	002285	世联地产	2,100,000	29,379,000.00	1.71
16	000982	中银绒业	3,599,951	29,159,603.10	1.70
17	002465	海格通信	1,000,000	28,850,000.00	1.68
18	600690	青岛海尔	2,151,290	28,827,286.00	1.68
19	600720	祁连山	2,700,000	28,620,000.00	1.67
20	002140	东华科技	1,299,884	28,571,450.32	1.67
21	601933	永辉超市	1,010,057	25,463,536.97	1.48
22	002216	三全食品	1,093,944	25,193,530.32	1.47
23	601166	兴业银行	1,500,000	25,035,000.00	1.46
24	000789	江西水泥	2,000,030	24,700,370.50	1.44
25	002419	天虹商场	2,200,000	24,508,000.00	1.43
26	600887	伊利股份	1,100,004	24,178,087.92	1.41
27	002038	双鹭药业	599,937	23,733,507.72	1.38
28	600031	三一重工	1,999,967	21,179,650.53	1.23
29	000848	承德露露	1,500,050	20,565,685.50	1.20
30	000338	潍柴动力	800,005	20,248,126.55	1.18
31	002385	大北农	900,000	19,440,000.00	1.13
32	600597	光明乳业	1,766,516	17,364,852.28	1.01
33	002663	普邦园林	599,980	16,751,441.60	0.98
34	002311	海大集团	899,905	15,388,375.50	0.90

35	002557	洽洽食品	800,000	14,896,000.00	0.87
36	600600	青岛啤酒	450,000	14,877,000.00	0.87
37	002603	以岭药业	637,689	14,839,023.03	0.86
38	000157	中联重科	1,099,931	10,130,364.51	0.59
39	000528	柳工	999,953	10,009,529.53	0.58
40	002041	登海种业	400,000	9,440,000.00	0.55
41	600570	恒生电子	800,000	8,968,000.00	0.52
42	002632	道明光学	499,999	8,499,983.00	0.50
43	600598	北大荒	1,000,000	8,160,000.00	0.48
44	600125	铁龙物流	999,916	7,189,396.04	0.42
45	600123	兰花科创	350,000	7,101,500.00	0.41
46	600048	保利地产	499,962	6,799,483.20	0.40
47	600027	华电国际	1,500,000	5,910,000.00	0.34
48	002640	百圆裤业	499,991	5,589,899.38	0.33
49	002028	思源电气	400,000	5,580,000.00	0.33
50	000425	徐工机械	400,000	4,612,000.00	0.27
51	000559	万向钱潮	999,990	4,489,955.10	0.26
52	002477	雏鹰农牧	199,952	3,739,102.40	0.22
53	002223	鱼跃医疗	200,026	3,100,403.00	0.18

#### 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比例(%)
1	601601	中国太保	135,692,669.14	7.91
2	600395	盘江股份	81,895,405.19	4.78
3	600309	烟台万华	63,515,999.74	3.70
4	002028	思源电气	63,090,485.13	3.68
5	002419	天虹商场	60,991,590.93	3.56
6	601688	华泰证券	59,653,044.01	3.48
7	600720	祁连山	56,585,432.68	3.30
8	000527	美的电器	55,589,188.68	3.24
9	601628	中国人寿	54,827,420.30	3.20
10	601788	光大证券	54,499,277.99	3.18
11	600600	青岛啤酒	53,407,931.59	3.11
12	000729	燕京啤酒	53,305,162.45	3.11
13	000401	冀东水泥	50,863,063.98	2.97
14	600795	国电电力	48,377,982.01	2.82
15	601318	中国平安	45,738,500.20	2.67
16	600486	扬农化工	44,971,249.97	2.62
17	600059	古越龙山	44,682,594.90	2.61



18	000848	承德露露	43,719,575.51	2.55
19	600690	青岛海尔	42,372,240.88	2.47
20	000581	威孚高科	41,404,407.29	2.41
21	000651	格力电器	40,377,591.08	2.35
22	000418	小天鹅A	40,320,640.02	2.35
23	600582	天地科技	40,009,514.16	2.33
24	601607	上海医药	39,545,503.35	2.31
25	002391	长青股份	39,165,757.19	2.28
26	002465	海格通信	39,071,141.79	2.28
27	600585	海螺水泥	38,943,785.95	2.27
28	600886	国投电力	38,490,689.91	2.24
29	600637	百视通	38,048,941.64	2.22
30	002146	荣盛发展	37,856,269.37	2.21
31	601166	兴业银行	37,150,793.60	2.17
32	600563	法拉电子	35,822,137.35	2.09
33	600801	华新水泥	35,666,750.04	2.08
34	002400	省广股份	34,960,126.34	2.04

#### 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比例(%)
1	601601	中国太保	139,117,121.40	8.11
2	600582	天地科技	113,032,403.89	6.59
3	600720	祁连山	91,699,318.44	5.35
4	000063	中兴通讯	79,679,241.88	4.65
5	600395	盘江股份	78,114,792.27	4.56
6	600123	兰花科创	74,819,527.99	4.36
7	601166	兴业银行	69,660,718.05	4.06
8	600009	上海机场	68,964,018.80	4.02
9	600486	扬农化工	68,251,808.25	3.98
10	600690	青岛海尔	63,487,747.39	3.70
11	600886	国投电力	61,064,027.51	3.56
12	601688	华泰证券	59,942,318.12	3.50
13	002028	思源电气	58,294,699.71	3.40
14	601628	中国人寿	56,541,668.27	3.30
15	600376	首开股份	54,680,764.40	3.19
16	600795	国电电力	54,344,809.09	3.17
17	600309	烟台万华	52,274,771.24	3.05
18	601898	中煤能源	51,814,824.66	3.02
19	600266	北京城建	50,845,528.53	2.97
20	000402	金融街	47,974,995.09	2.80

21	002391	长青股份	44,887,001.67	2.62
22	000729	燕京啤酒	43,700,324.22	2.55
23	002368	太极股份	43,131,529.18	2.52
24	601788	光大证券	40,744,237.12	2.38
25	002400	省广股份	39,257,970.97	2.29
26	000651	格力电器	38,928,895.49	2.27
27	600059	古越龙山	37,162,008.24	2.17
28	600600	青岛啤酒	36,995,294.80	2.16
29	600557	康缘药业	36,905,555.33	2.15
30	002484	江海股份	36,350,851.36	2.12
31	002122	天马股份	36,270,621.63	2.12
32	601607	上海医药	35,796,751.28	2.09
33	600858	银座股份	35,663,227.13	2.08
34	000418	小天鹅A	34,987,843.69	2.04
35	601169	北京银行	34,705,807.75	2.02
36	000783	长江证券	34,523,776.20	2.01
37	000963	华东医药	34,303,495.38	2.00

#### 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	3,347,144,612.14
卖出股票收入（成交）总额	3,367,683,056.36

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	401,084,000.00	23.38
	其中：政策性金融债	401,084,000.00	23.38
4	企业债券	102,300.03	0.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	401,186,300.03	23.38

## 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	110224	11 国开 24	1,000,000	100,260,000.00	5.84
2	120246	12 国开 46	800,000	79,864,000.00	4.66
3	110257	11 国开 57	500,000	50,355,000.00	2.94
4	030224	03 国开 24	500,000	50,215,000.00	2.93
5	110203	11 国开 03	500,000	50,100,000.00	2.92

## 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

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，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	861,191.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,785,394.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,646,586.38

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000527	美的电器	43,421,636.13	2.53	重大资产重组停牌

#### 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
23,530	84,997.88	1,388,022,170	69.40%	611,977,830	30.60%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险(集团)公司	197,111,229	9.86%
2	中国人寿保险股份有限公司	196,380,409	9.82%
3	阳光人寿保险股份有限公司一分红保险产品	106,370,781	5.32%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司一分红-个人分红	81,722,451	4.09%
5	阳光财产保险股份有限公司一自有资金	70,416,277	3.52%
6	渤海证券股份有限公司	54,200,000	2.71%
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司一传统-普通保险产品	53,171,674	2.66%
8	泰康人寿保险股份有限公司一分红-个人分红-019L-FH002 深	52,514,685	2.63%
9	中国机械进出口(集团)有限公司	40,000,000	2.00%
10	宝钢集团有限公司	34,974,450	1.75%

## § 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 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。

#### 10.2.2 基金经理的变动情况

本基金管理人于 2012 年 11 月 22 日发布关于调整基金经理的公告，决定聘任张锦灿担任本基金经理，王克玉继续担任本基金经理。

#### 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不曾改变。

### 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（特殊普通合伙）（原“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。本报告期内应支付给该会计师事务所的报酬 95,000.00 元，已连续为本基金提供审计服务 14 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

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。

### 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进行单元股票交易及佣金支付的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		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

招商证券	1	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-
国元证券	2	1,171,304,482.55	17.46%	1,053,991.54	18.05%
申银万国证券	2	462,225,453.05	6.89%	405,412.49	6.94%
中国银河证券	1	515,665,888.33	7.69%	450,267.29	7.71%
长城证券	1	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-
华福证券	1	935,990,487.14	13.95%	795,596.20	13.62%
信达证券	1	-	-	-	-
红塔证券	1	1,488,169,873.44	22.18%	1,326,993.09	22.72%
东方证券	1	1,135,183,545.06	16.92%	988,897.24	16.93%
方正证券	1	999,714,851.29	14.90%	819,525.33	14.03%

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元债券及债券回购交易的有关情况

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
招商证券	1	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-
国元证券	2	74,861,431.00	23.51%	-	-
申银万国证券	2	-	-	-	-
中国银河证券	1	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-
华福证券	1	67,107,574.20	21.08%	1,285,000,000.00	21.82%
信达证券	1	-	-	-	-
红塔证券	1	91,273,537.80	28.67%	2,095,000,000.00	35.57%
东方证券	1	85,147,693.50	26.74%	2,510,000,000.00	42.61%
方正证券	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) 资金雄厚，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》、《券商席位租用协议》，并办理基金专用席位租用手续。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，并撤销租用的席位；

(6) 席位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席位的变更情况：

(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：无。

## 10.8 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事件如下：

序号	公告事项	法定披露方式	披露日期
1	长盛基金管理有限公司上海分公司注册地址及负责人变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2012-04-17
2	长盛基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2012-08-16
3	关于公司股东名称变更及公司章程修改的公告	同上	2012-08-29
4	长盛基金管理有限公司关于调整同益证券投资基金基金经理的公告	同上	2012-11-22



## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (二) 《同益证券投资基金基金合同》；
- (三) 《同益证券投资基金托管协议》；
- (四) 《同益证券投资基金招募说明书》；
- (五) 法律意见书；
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。