

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:2011年3月31日

## § 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,并对基金的真性、准确性、完整性和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基金合同规定的程序,于2011年3月30日复核了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、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。

基金净值是指基金份额的原值,即基金资产总值扣除总费用后每份基金份额的净值。

基金管理人未对本年度报告基金财务状况进行审计,华安基金管理有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告自2010年1月1日起至2012月31日止。

## § 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 长盛益封封闭

基金主代码 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 基金产品说明书

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的不同的阶段,灵活运用组合自身运作特点的投资策略,投资理念和投资技巧。在战略资产配置层,寻求现金流、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,寻求成长股和价值股的动态收益、风险最优配置。

业绩比较基准 无

风险特征特征 无

2.3 基金管理人和基金托管人

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

姓名 叶金松 赵会军

信息披露义务人电话 010-82255818 010-66105799

电子邮件 yes@csfunds.com.cn custody@icbc.com.cn

客户服务电话 400-888-2666 95588

传真 010-82255988 010-66105798

2.4 信函披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址 <http://www.csfunds.com>

基金年度报告备置地点 基金管理人和基金托管人的办公地址

3. 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1 期间数据和指标 2010年 2009年 2008年

本期已实现收益 184,200,003.54 254,695,296.14 104,786,640.60

本期利润 -98,749,668.00 1,341,081,072.80 -2,386,617,875.58

加权平均基金份额本期利润 -0.0494 0.6705 -1.1933

本期基金份额净值 73.48% -49.67%

3.1.2 期末数据和指标 2010年末 2009年末 2008年末

期末可供基金份额利润 0.1143 0.3222 -0.0875

期末基金份额净值 2,467,326,625.21 3,166,293,272.1 1,824,995,220.47

注:1. 所述基金业绩指标不包括任何认购或交易基金的费用,计入费用后实际收益水平要低于所列示的业绩指标。

2. 本期已实现收益指基金本期利润收入,投资收益,其收入(不含公允价值变动收益)加本期相关费用,本期利润为本期实现收入加上本期公允价值变动收益。

3. 期末可供基金份额净值指基金资产净值与基金份额的分配利润之和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2012月31日。

4.2 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

注:本基金无同期业绩比较基准收益,无进行同期业绩比较基准收益率的比较。

3.2.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.2 基金合同生效以来基金份额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

4.999年4月8日至2010年12月31日

基金资产净值增长率

同期业绩比较基准增长率

份额净值增长率(%)

份额净值增长率标准差(%)

过去三个月 4.68% 2.40%

过去一年 21.80% 2.23%

过去一年 -2.74% 2.30%

过去一年 -15.08% 3.35%

过去一年 281.70% 3.24%

自基金合同生效起至今 61.97% 2.70%

3.2.3 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

注:本基金无同期业绩比较基准收益,无进行同期业绩比较基准收益率的比较。

3.2.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.2 基金合同生效以来基金份额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

4.999年4月8日至2010年12月31日

基金资产净值增长率

同期业绩比较基准增长率

份额净值增长率(%)

份额净值增长率标准差(%)

过去三个月 4.68% 2.40%

过去一年 21.80% 2.23%

过去一年 -2.74% 2.30%

过去一年 -15.08% 3.35%

过去一年 281.70% 3.24%

自基金合同生效起至今 61.97% 2.70%

3.2.3 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

注:本基金无同期业绩比较基准收益,无进行同期业绩比较基准收益率的比较。

3.2.3 过去五年基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.2 基金合同生效以来基金份额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

4.999年4月8日至2010年12月31日

基金资产净值增长率

同期业绩比较基准增长率

份额净值增长率(%)

份额净值增长率标准差(%)

过去三个月 4.68% 2.40%

过去一年 21.80% 2.23%

过去一年 -2.74% 2.30%

过去一年 -15.08% 3.35%

过去一年 281.70% 3.24%

自基金合同生效起至今 61.97% 2.70%

3.2.3 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

注:本基金无同期业绩比较基准收益,无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

4.1 管理人报告

4.1.1 基金管理人及基金经理的简介

本基金基金管理人中国证监会证监基金字[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%;新嘉坡盈泰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26%。本公司股东及其出资比例未变。本公司股东国元证券于2002年12月,首次取得了全国社保基金理事会投资基金资格,并获得社保基金理事会基金托管权,于2008年2月,取得从特定客户资产管理业务资格。

4.1.2 基金经理的简介

基金管理人对基金经理的经管经验

4.1.3 公司对基金经理的经管经验的说明

本基金基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金从业人员的基金从业资格进行年检,对不符合基金从业资格的基金从业人员,将根据基金法及其实施细则的规定,取消其基金从业资格。

4.2 管理人对报告期内本基金运作情况的专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

本公司内,基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金从业人员的基金从业资格进行年检,对不符合基金从业资格的基金从业人员,将根据基金法及其实施细则的规定,取消其基金从业资格。

4.2.2 管理人对报告期内本基金运作的监督情况

本公司内,基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金从业人员的基金从业资格进行年检,对不符合基金从业资格的基金从业人员,将根据基金法及其实施细则的规定,取消其基金从业资格。

4.2.3 管理人对报告期内本基金投资组合的跟踪情况

本公司内,基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金从业人员的基金从业资格进行年检,对不符合基金从业资格的基金从业人员,将根据基金法及其实施细则的规定,取消其基金从业资格。

4.2.4 管理人对报告期内本基金投资策略的说明

本公司内,基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金从业人员的基金从业资格进行年检,对不符合基金从业资格的基金从业人员,将根据基金法及其实施细则的规定,取消其基金从业资格。

4.2.5 管理人对报告期内本基金投资组合的跟踪情况

本公司内,基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金从业人员的基金从业资格进行年检,对不符合基金从业资格的基金从业人员,将根据基金法及其实施细则的规定,取消其基金从业资格。

4.2.6 管理人对报告期内本基金投资策略的说明

本公司内,基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金从业人员的基金从业资格进行年检,对不符合基金从业资格的基金从业人员,将根据基金法及其实施细则的规定,取消其基金从业资格。

4.2.7 管理人对报告期内本基金投资组合的跟踪情况

本公司内,基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金从业人员的基金从业资格进行年检,对不符合基金从业资格的基金从业人员,将根据基金法及其实施细则的规定,取消其基金从业资格。

4.2.8 管理人对报告期内本基金投资策略的说明

本公司内,基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金从业人员的基金从业资格进行年检,对不符合基金从业资格的基金从业人员,将根据基金法及其实施细则的规定,取消其基金从业资格。

4.2.9 管理人对报告期内本基金投资组合的跟踪情况

本公司内,基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金从业人员的基金从业资格进行年检,对不符合基金从业资格的基金从业人员,将根据基金法及其实施细则的规定,取消其基金从业资格。

4.2.10 管理人对报告期内本基金投资策略的说明

本公司内,基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金从业人员的基金从业资格进行年检,对不符合基金从业资格的基金从业人员,将根据基金法及其实施细则的规定,取消其基金从业资格。

4.2.11 管理人对报告期内本基金投资组合的跟踪情况

本公司内,基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金从业人员的基金从业资格进行年检,对不符合基金从业资格的基金从业人员,将根据基金法及其实施细则的规定,取消其基金从业资格。

4.2.12 管理人对报告期内本基金投资策略的说明

本公司内,基金管理人严格按照证券投资基金法及其各项实施细则,对基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金代销机构、基金评价机构、基金投资人教育机构、基金行业协会等基金市场相关机构的基金从业人员实行基金从业资格管理,并定期对基金