同盛证券投资基金

【2010】年度报告摘要

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	唐州徽
	联系电话	010-82255818	010-66594855
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666	95566
传真		010-82255988	010-66594942

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§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、所还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

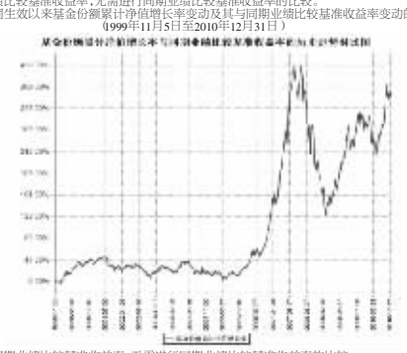
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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。

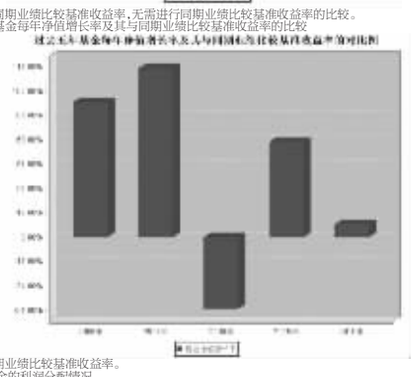
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

（1999年11月5日至2010年12月31日）



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



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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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。历任天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"暗动、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隐忧论，在7月份市场的下跌幅度远远超过了左侧操作型价值投资投资者的预期。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殷实的好，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。本基金在上半年低估了政策调整的影响，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、周期类或长期、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，才里有持续的优良表现。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、估值目、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（但任估值小组组长）、督察长（但任估值小组组长）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震、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
资产：		
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	-	-
资产总计	4,039,333,854.90	3,708,243,465.92
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
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
负债合计	11,477,745.47	9,236,517.68
所有者权益：		
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
所有者权益合计	4,027,856,109.43	3,699,006,948.24
负债和所有者权益总计	4,039,333,854.90	3,708,243,465.92

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
一、收入	400,364,581.01	1,539,634,149.46
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
减：二、费用	71,515,419.82	63,016,085.74
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
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	328,849,161.19	1,476,618,063.72
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	328,849,161.19	1,476,618,063.72

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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	1,027,856,109.43	4,027,856,109.43
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》估值业务及会计核算等有关事项的通知》、《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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	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
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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
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 成交金额	占当期回购成交总额的比例	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
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	45,726,549.86
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的基金资产净值的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×1.50%/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 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的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/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 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 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 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
中国银行	316,522,318.38	284,462,288.76	-	-	150,000,000.00	41,671.23
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 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	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
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 期末余额	当期利息收入	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
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