

长盛量化红利策略股票型证券投资基金

2010 年 度 报 告 摘 要

全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

2.2 报告期内本基金投资运作管理情况 净值计算、利润分配等情况的说明

2010年,长盛量化红利策略股票型证券投资基金管理人——长盛基金管理有限公司在长盛量化红利策略股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金申购赎回申购价格计算、基金费用开支等方面,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各项业务运作中严格执行法律法规及基金合同的有关规定。本报告期间内,长盛量化红利策略股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等情况的真实、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的长盛量化红利策略股票型证券投资基金2010年度报告中的财务信息、净值表现、利润分配情况、基金资产净值等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司注册会计师:张璐2011年3月29日对本基金2010年12月31日的资产负债表、2010年度和2009年11月25日止基金合同生效日至2009年12月31日止期间的利润表和所有者权益变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字2011第020561号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应查阅基金年度报告正文。

§ 7 年度财务会计报表

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	
银行存款	78,564,768.95	645,390,187.85	
结算备付金	546,716.01	2,315,256.51	
存出保证金	500,000.00	-	
交易性金融资产	351,520,978.93	772,456,704.53	
其中:股票投资	346,325,099.43	772,456,704.53	
基金投资	5,195,279.50	-	
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	26,133.58	157,741.57	
应收股利	-	-	
应收申购款	9,483.25	253,345.07	
递延所得税资产	-	-	
其他资产	-	-	
资产总计	431,167,480.72	1,420,573,235.53	
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	20,655,230.54	7,553,941.77	
应付管理人报酬	567,835.56	1,593,821.46	
应付托管费	94,639.26	265,636.90	
应付销售服务费	-	-	
应付交易费用	713,055.59	1,069,846.12	
应交税费	-	-	
应付利息	-	-	
应付股利	-	-	
递延所得税负债	-	-	
其他负债	638,831.89	528,469.70	
负债合计	22,669,592.84	109,676,574.40	
所有者权益:			
实收基金	389,891,447.10	1,222,148,662.23	
未分配利润	18,606,440.78	7,747,998.90	
所有者权益合计	408,497,887.88	1,229,896,661.13	
负债和所有者权益总计	431,167,480.72	1,420,573,235.53	

注:1、报告截止日2010年12月31日,基金份额净值:1.048元,基金份额总额:389,891,447.10份。报告截止日2009年12月31日,基金份额净值:1.006元,基金份额总额:1,222,148,662.23份。

2、本财务报表的实际编制期间为2010年度和2009年11月25日止(基金合同生效日至2009年12月31日止)。

2.1 资产负债表

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11月25日(基金合同生效日)至2009年12月31日	
一、收入	46,779,668.52	11,328,923.36	
1.利息收入	1,544,509.74	715,947.26	
其中:存款利息收入	1,533,329.26	715,947.26	
债券利息收入	11,180.48	-	
资产支持证券利息收入	-	-	
买入返售金融资产收入	-	-	
其他收入	-	-	
2.投资收益(损失以“-”填列)	17,268,366.85	5,159,815.30	
其中:股票投资收益	11,149,587.07	5,159,815.30	
基金投资收益	-	-	
债券投资收益	245,756.17	-	
资产支持证券投资	-	-	
衍生工具收益	-	-	
利息收入	5,873,023.61	-	
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	26,920,644.80	5,415,411.86	
4.汇兑收益(损失以“-”填列)	-	-	
5.其他收入(损失以“-”填列)	1,046,147.61	37,748.94	
减:二、费用	20,221,439.61	3,743,135.09	
1.管理人报酬	12,480,288.25	1,850,698.16	
2.托管费	2,080,048.11	308,449.68	
3.销售服务费	-	-	
4.交易费用	5,259,661.04	1,583,419.25	
5.利息支出	-	-	
6.卖出回购金融资产支出	-	-	
7.其他费用	401,442.21	568.00	
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	26,558,228.91	7,585,788.27	
减:所得税费用	-	-	
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	26,558,228.91	7,585,788.27	

2.2 利润表

2.3 所有者权益变动表

2.4 资产负债表附注

2.5 利润表附注

2.6 所有者权益变动表附注

2.7 资产负债表附注

2.8 利润表附注

2.9 所有者权益变动表附注

2.10 资产负债表附注

2.11 利润表附注

2.12 所有者权益变动表附注

2.13 资产负债表附注

2.14 利润表附注

2.15 所有者权益变动表附注

2.16 资产负债表附注

2.17 利润表附注

2.18 所有者权益变动表附注

2.19 资产负债表附注

2.20 利润表附注

2.21 所有者权益变动表附注

2.22 资产负债表附注

2.23 利润表附注

2.24 所有者权益变动表附注

2.25 资产负债表附注

2.26 利润表附注

2.27 所有者权益变动表附注

2.28 资产负债表附注

2.29 利润表附注

2.30 所有者权益变动表附注

2.31 资产负债表附注

2.32 利润表附注

2.33 所有者权益变动表附注

2.34 资产负债表附注

2.35 利润表附注

2.36 所有者权益变动表附注

2.37 资产负债表附注

2.38 利润表附注

2.39 所有者权益变动表附注

2.40 资产负债表附注

2.41 利润表附注

2.42 所有者权益变动表附注

2.43 资产负债表附注

2.44 利润表附注

2.45 所有者权益变动表附注

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	9,017,554.00	2.21
B	采矿业	17,628,052.40	4.32
C	制造业	214,633,685.93	52.54
C0	食品、饮料	27,046,856.96	6.62
C1	服装、鞋帽、皮革	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	27,230,372.49	6.67
C5	电子、通信、设备	7,273,000.00	1.78
C6	金属、非金属	35,475,430.00	8.69
C7	机械、设备、仪表	81,659,451.09	19.99
C8	医药、生物制品	35,945,570.39	8.80
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	7,900,000.00	1.93
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	9,575,274.96	2.34
G	信息技术业	31,178,395.94	7.63
H	批发和零售业	23,042,781.64	5.64
I	金融、保险业	29,795,820.16	7.29
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	3,553,534.50	0.87
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
合计		346,325,099.53	84.78

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

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	600016	民生银行	2,673,442	13,420,678.84	3.29
2	600271	航天信息	475,394	13,078,088.94	3.20
3	000257	美的电器	706,059	12,028,426.60	3.01
4	000581	威孚高科	323,578	12,020,922.70	2.94
5	600362	江西铜业	263,900	11,920,363.00	2.92
6	600858	五粮液	328,625	11,380,283.75	2.79
7	000063	中兴通讯	412,090	12,290,606.38	3.05
8	600095	盘江股份	337,208	10,976,120.00	2.69
9	600062	双鸭山	366,600	10,444,434.00	2.56
10	600664	哈药股份	459,565	10,372,382.05	2.54

注:投资者欲了解本报告期内本基金投资的所有股票明细,应查阅登载于http://www.csfund.com.cn网站的半年报告正文。

8.4 报告期内基金投资组合的重大变动

8.4.1 期末买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

6	601399	建设银行	28,132,759.62	2.29
6	600580	卧龙电气	22,990,696.38	1.87
7	000800	一汽轿车	22,855,116.39	1.86
8	601666	平煤股份	22,591,177.92	1.84
9	601808	中海油服	22,120,086.80	1.73
10	000012	南玻A	20,928,686.83	1.70
11	000002	万科A	20,049,827.84	1.63
12	601318	中国平安	19,730,799.44	1.60
13	600348	国阳新能	19,134,900.00	1.56
14	600026	中海发展	17,833,635.53	1.45
15	600271	航天信息	16,726,739.99	1.38
16	601699	潞安环能	16,856,295.14	1.37
17	600036	招商银行	16,642,818.15	1.35
18	600033	华发股份	16,631,434.24	1.35
19	600028	中国石化	16,556,725.08	1.35
20	000860	顺鑫农业	16,508,037.51	1.34

8.4.2 期末卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2	600050	中国联通	52,070,600.58	4.23
3	601808	中海油服	47,771,110.44	3.88
4	600016	民生银行	46,359,701.94	3.77
5	600580	卧龙电气	44,312,654.61	3.60
6	000089	深圳机场	42,627,696.64	3.47
7	601628	中国人寿	36,662,678.35	2.98
8	600195	中牧股份	32,404,710.30	2.63
9	000539	粤电力A	31,970,301.95	2.60
10	000778	新兴铸管	31,871,150.11	2.59
11	000562	宏源证券	29,179,838.47	2.37
12	601390	中国中铁	29,172,536.66	2.37
13	000401	冀东水泥	28,505,553.28	2.32
14	600028	中国石化	28,068,240.52	2.28
15	600141	兴发集团	27,133,424.44	2.21
16	000024	招商地产	26,868,195.34	2.18
17	600829	三精制药	25,128,130.12	2.04
18	600005	宝钢股份	24,495,988.62	1.99
19	000050	三花股份	24,020,574.31	1.95
20	600348	国阳新能	23,761,173.00	1.93

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

8.4.4 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.5 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.6 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.7 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.8 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.9 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.10 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.11 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.12 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.13 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.14 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.15 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.16 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.17 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.18 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.19 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.20 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.21 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.22 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.23 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.24 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.25 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.26 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.27 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.28 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.29 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.30 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.31 卖出股票的成本(或交易费用)

8.4.32 卖出股票的成本(或交易费用)