

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

1.1 重要提示
基金管理人、董事、监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,基金的投资净值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。

本年度报告财务数据已经审计,普华永道中天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2012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	
基金名称	长盛量化红利股票
基金代码	080005
交易代码	080005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年11月25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	290,968,666.33份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金业绩说明
本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标,并追求风险调整后的收益最大化,满足投资者长期稳健的投资收益需求。

本基金通过严格的数量化股票选择方法生成红利风格股票池,在此基础上构建股票、股票组合和卫星股票组合,从而形成基于核心-卫星投资策略的股票投资组合。其中:大量资产配置策略考虑宏观环境、政策导向和市场环境(市场估值水平、资金供求)等因素,股票投资中以红利股票投资为主导,以价值型资金及分红能力作为选择投资对象的核心标准。

业绩比较基准
中证红利指数75%+中证综合指数25%

风险收益特征
本基金为股票型基金产品,风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金,属于风险较高的基金产品

2.3 基金管理人		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	
信息披 露人	姓名 联系电话 电子邮箱	叶松松 010-82019988 yeys@csfund.com.cn	赵会军 010-66105799 custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-888-2666	95588	
传真	010-82255888	010-66105798	

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.csfund.com.cn
基金年度报告备置地点
基金管理人及基金托管人的办公地址

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-30,079,758.79	12,308,335.02	-362,415.89
加权平均基金份额本期利润	5,803,066.67	-49,983,565.30	26,558,228.91
本期基金份额净值增长率	0.0211	-0.1578	4.17%
3.1.2期末数据指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1535	-0.1725	0.0477
期末基金份额净值	220,687,886.81	240,768,904.61	408,497,887.88
期末基金份额净值	0.847	0.827	1.048

注:1.上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,本期利润为基金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值(期末余额,不超过期末未分配利润)中的较低者。表中的“期末”均指本报告期末后一日,即12月31日。
3.2 基金净值增长
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

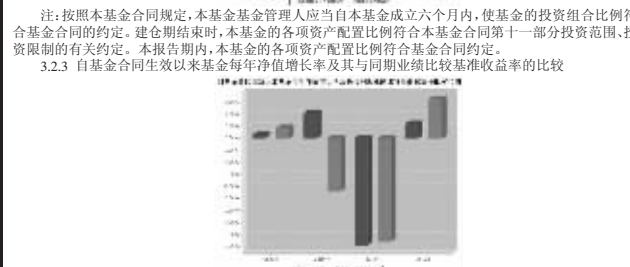
阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率标准差③	①-③	②-③
过去三个月	3.17%	0.82%	0.96%	0.94%	-0.69%
过去六个月	-1.85%	0.82%	0.91%	0.90%	-0.76%
过去一年	2.42%	0.94%	0.65%	0.91%	-0.45%
过去三年	-12.32%	1.11%	-19.58%	1.00%	7.26%
自基金合同生效起至今	-11.80%	1.09%	-18.19%	1.03%	6.39%

注:本基金业绩比较基准:中证红利指数75%+中证综合指数25%
其中,中证红利指数精选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市,且股息率高、分红比较稳定,具有一定规模及流动性的100只股票作为样本,以反映A股市场高红利股票的整体状况和走势。比较起来,该指数具有较好的权威性和市场代表性,作为衡量本基金业绩的基准,较为合适。

本基金业绩比较基准的组成,增加了行业权重,增加了行业权重,短期融资券及一年期以下的国债、金融债和企业债,以更好地反映中国债券市场整体价格变动趋势。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同约定要求,基金净值每只按照75%、25%的比例重新再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自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



注:按照基金合同约定,本基金基金管理人应当自基金成立六个月内,使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,达到规定目标时,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十四部分投资范围、投资策略的有关约定。本报告期,本基金的各项资产配置比例符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

年度	每100基金份额净值增长率	基金形式发生总额	再投资形式发生总额	年度利润分配情况	备注
2012年	-	-	-	-	2012年度未分配
2011年	0.40%	10,416,098.35	4,877,419.18	15,293,517.53	2011年度未分配
2010年	-	-	-	-	2010年度未分配
合计	0.40%	10,416,098.35	4,877,419.18	15,293,517.53	2010年度未分配

注:长盛量化红利策略股票型证券投资基金于2009年11月25日生效,合同生效当年净值增长率按照实际存续期计算,本按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

项目	本期	上期	上期度可比期间
一、收入	11,316,904.20	-42,474,671.88	-
1.利息收入	478,672.83	566,469.66	-
其中:存款利息收入	478,409.65	560,717.12	-
债券利息收入	263.18	5,752.54	-
买入返售金融资产收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-25,056,397.86	19,151,639.96	-
其中:股票投资收益	-28,389,477.30	16,370,842.42	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	96,117.02	473,606.11	-
衍生工具收益	-	-	-
股利收益	3,356,962.42	2,107,191.32	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)	33,982,825.46	-62,291,900.33	-
4.汇兑收益(损失以“-”填列)	-	-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)	11,803.77	99,118.82	-
减:费用	5,513,837.53	7,508,893.42	-
1.管理人报酬	3,527,063.26	4,577,905.93	-
2.托管费	887,943.92	762,984.29	-
3.销售服务费	-	-	-
4.交易费用	1,077,412.21	1,808,361.46	-
5.利息支出	-	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-	-
6.其他费用	321,518.14	359,614.74	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	5,803,066.67	-49,983,565.30	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	5,803,066.67	-49,983,565.30	-

注:1.上表基金经理及基金助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》及其他各项实施准则、长盛量化红利策略股票型证券投资基金合同和有关法律法规、监管部门的有关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在认真执行投资决策程序、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的利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1公平交易制度的制定情况
依据《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》,为保证公司所有的投资组合得到公平对待,保障投资者合法权益,公司重新修订了《公司公平交易细则》。报告期内,公司根据该细则严格执行,并对其进行了完善,该细则从研究、投资授权、投资决策、交易执行、投资组合监控、事后评估与反馈、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支持上拥有同等权利,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,投资组合经理按照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履行审批程序,各投资组合经理遵守信息披露相关规定。

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公司集中交易执行,交易委托、交易依据《公司公平交易细则》的规定,对交易所公开竞价交易,公司并开恒生交易系统下的公平交易程序,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:

1.限价指令的公平交易:对于不同限价指令的执行,按照“价格优先、时间优先、时间均分”的原则执行;对于相同限价指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照先成交委托委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

3.部分限价指令的公平交易:对于部分限价指令的执行,按照“价格优先、时间均分”的原则执行;对于部分限价指令,按照“价格优先、时间均分”的原则执行,对于部分限价指令,按照“价格优先、时间均分”的原则执行。

4.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交易,则按照“时间优先、价格优先、时间均分”的原则,按照价格优先原则进行分配。

4.3.2公平交易制度的执行情况
报告期内,公司严格执行《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》相关规定,保证公平交易制度的每一个投资组合,在投资组合的构建和交易策略制定、并在投资决策委员会、投资组合经理、交易执行等环节享有公平的竞争环境,严格执行集中交易制度,确保各投资组合享有公平的交易平台,并严格执行公平交易程序,公司定期对公平交易制度的遵守和执行情况定期进行分析和评估,并出具公平交易执行分析报告,同时,公司对公平交易制度的遵守和执行情况定期进行分析和评估,并出具公平交易执行分析报告,同时,公司对公平交易制度的遵守和执行情况定期进行分析和评估,并出具公平交易执行分析报告。

4.3.3异常交易的专项说明
2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

2.市价指令的公平交易:对于市价指令交易指令,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数量和先到指令数量采用公平委托系统执行,对于同时向交易指令,强制执行恒生交易系统下的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托执行比例,按比例执行。

长盛量化红利策略股票型证券投资基金

2012年度报告摘要

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则-基本准则和38项具体会计准则(其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定)以及中国“企业会计准则”,中国注册会计师编制的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金合同》和财务报表附注7.4.4所引用的中国证监会发布的相关规定及允许的行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的事项。
本基金的2012年度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2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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的说明
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
7.4.5.2 会计估计变更的说明
7.4.5.3 差错更正的说明
本基金本期及上年度可比期间无会计差错。

7.4.6 关联方关系
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关问题的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关法规和实务操作,主要税列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
(2) 对基金从事证券买卖取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入、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) 对基金取得的基金投资收益收入,由发行债券的企业在向基金派发利息和代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系
长盛基金管理有限公司(以下简称“长盛基金”)与关联方关系如下:

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(以下简称“长盛基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司(以下简称“国元证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安信证券股份有限公司	基金管理人的股东
安信证券股份有限公司(以下简称“安信证券”)	基金管理人的股东

注:1.根据长盛基金公司2012年8月29日《关于公司股东名称变更及公司章程修改的公告》,长盛基金公司的控股股东安徽国元证券有限公司更名为安徽国元证券资产管理有限公司,相关工商变更登记手续已办理完毕。

2.关于关联方交易均在正常业务范围内在一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易发生债券交易。

7.4.8.1 关联交易方交易金额

参与估值流程各方是否包括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的职责；在存在异议时，托管人有责任要求基金托管人作出合理调整，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。	注：根据长盛基金管理有限公司2012年8月29日 获于公司更名及章程修改的公告，长盛基金公司的关联方安徽长盛投资管理有限公司已于2012年9月更名为安徽长盛投资集团有限公司，相关工商变更登记手续已办理完毕。
本基金未签约与任何估值相关的定价服务。	2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
4.7 管理人报告报告期内基金利润分配情况的说明	7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
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十五条中对基金利润分配原则的约定，2012年度未实施利润分配。	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

7.4.8.1.2 权证交易
本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易发生权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易
本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易发生债券交易。

7.4.8.1.4 支付关联方佣金

5.3 托管人对本年度报告中关联方信息内容的真实性、准确性和完整性发表意见
 本托管人依法对本盛基金管理有限责任公司编制和披露的长盛盛业利策略股票证券投资基金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。

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券登记费及手续费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。
2.该关联方佣金列示的范围不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等。

7.4.8.2 关联方报酬
7.4.8.2.1 基金管理费

7.1 资产负债表		注:1、上述佣金按市场佣金率计算,并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证券管和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。
会计主体:长盛量化红利策略股票型证券投资基金		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等。
报告截止日:2012年12月31日		7.4.8.2 关联方报酬
单位:人民币元		

注:支付给基金管理人的基金托管费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
基金托管费=前一日基金资产净值×1.5%÷当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

转支付金	92,918.45	193,565.21	2012年12月31日	2011年12月31日	
存出保证金	500,000.00	500,000.00	当期发生的基金应支付的管理费	3,527,063.26	4,577,905.93
交易性金融资产	178,434,744.23	172,934,304.82	其中：支付销售机构的客户维护费	778,230.05	1,048,824.19
其中：股票投资	178,434,744.23	172,934,304.82	注：支付基金管理人长盛基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：		
基金投资	-	-	日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数		

注:支付给基金管理人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

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
本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

应收股利				注: 付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提, 逐日累计至每月末, 按月支付。其计算公式为:
应收申购款	12,346.17		3,159.13	日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数
递延所得税资产				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
其他资产				本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券 含回购)交易。
资产总计	243,432,776.80		256,351,354.59	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
负债和所有者权益				
	本期末		上年末	
	2012年12月31日		2011年12月31日	
负 债:				

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

项目	本期	上期	上期度可比期间
2012年1月1日至2012年12月31日	2012年12月31日	2011年12月31日	2011年12月31日
基金合同生效日(2009年11月25日)持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	30,000,050.00	30,000,050.00	-
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	30,000,050.00	30,000,050.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.51%	10.31%	-

7.4.8.4.3 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资