

基金投资组合前十名股票构成

均为基金合同规定备选股票库内的股票。

9.9.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,750,000.00
2	应收证券清算款	68,167,190.91
3	应收股利	-
4	应收利息	49,351.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,966,542.87

9.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

9.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000002	万科 A	112,547,758.40	2.43	重大事项停牌

9.9.5.2 期末公允价值投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末公允价值投资前五名股票中不存在流通受限情况。

9.9.6 投资组合报告附注的其他文本描述部分

由于四舍五入的原因,分母之和与合计项之间可能存在尾差。

§10 投资组合报告(长盛同庆封闭)

报告期为2012年1月1日至2012年5月11日(基金合同失效前日)

10.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,861,400.96	0.02
	其中:股票	5,861,400.96	0.02
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	12,800,000,000.00	49.73
	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	12,925,003,448.26	50.22
6	其他各项资产	5,591,212.66	0.02
7	合计	25,736,456,061.88	100.00

10.2 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	5,861,400.96	0.05
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	化学、石化、塑胶、塑料	5,861,400.96	0.05
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪器	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	5,861,400.96	0.05

10.3 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	600006	云天化	365,424	5,861,400.96	0.05

注:长盛同庆封闭报告期末仅持有一支股票。

10.4 报告期内股票投资组合的重大变动

10.4.1 累计买入金额占期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	601318	中国平安	160,792,525.74	1.36
2	601166	兴业银行	116,510,005.36	0.98
3	600188	中国神华	93,354,244.73	0.77
4	600519	贵州茅台	91,135,857.16	0.79
5	601601	中国太保	75,993,637.96	0.64
6	601398	工商银行	74,303,851.75	0.63
7	601006	大秦铁路	64,848,374.80	0.55
8	601288	农业银行	57,135,611.06	0.48
9	002024	苏宁电器	51,744,464.97	0.44
10	000651	格力电器	50,632,798.11	0.43
11	000157	中联重科	50,352,230.73	0.42
12	600048	保利地产	49,736,346.14	0.42
13	000001	深发展A	49,337,572.87	0.41
14	600031	三一重工	48,763,611.21	0.41
15	600111	包钢稀土	48,229,504.61	0.41
16	600858	五粮液	48,095,291.14	0.41
17	600015	华夏银行	47,428,661.37	0.40
18	601169	北京银行	45,990,793.63	0.39
19	600104	上汽集团	44,994,844.06	0.38
20	601818	光大银行	42,695,747.30	0.36

10.4.2 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

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	600016	民生银行	664,323,277.59	5.60
2	600036	招商银行	605,451,681.35	5.10
3	601628	中国人寿	548,911,793.63	4.63
4	600050	中国联通	462,769,864.51	3.90
5	600000	浦发银行	459,988,653.91	3.87
6	000002	万科 A	434,785,509.32	3.67
7	600030	中信证券	377,073,139.54	3.18
8	601989	中国重工	339,571,230.83	2.86
9	600085	同力水泥	290,866,142.83	2.45
10	600837	海通证券	285,160,252.99	2.40
11	601328	交通银行	267,076,388.67	2.25
12	600839	四川长虹	231,814,652.14	1.95
13	600010	包钢稀土	215,087,145.37	1.81
14	601186	中国铁建	214,163,906.48	1.81
15	601918	国投新集	204,835,467.18	1.73
16	600028	中国石化	197,447,334.22	1.66
17	601299	中国北车	191,460,299.09	1.61
18	600309	烟台万华	179,116,490.72	1.51
19	600582	天地科技	176,178,123.12	1.49
20	600600	海信电器	175,564,743.64	1.48

10.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交)总额	卖出股票收入(成交)总额
4,805,357,232.45	14,216,024,606.96

注:本期买入10.4.1、10.4.2、10.4.3所述的“买入金额”或“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按成交金额计算,不考虑相关交易费用。

10.5 期末按资产公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

长盛同庆封闭报告期末未持有债券。

10.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

长盛同庆封闭报告期末未持有资产支持证券。

10.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

长盛同庆封闭报告期末未持有权证。

10.8 投资组合报告附注

10.8.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.8.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

10.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

10.9.6 投资组合报告附注

10.9.6.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

10.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

10.9.6 投资组合报告附注

10.9.6.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

10.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

10.9.6 投资组合报告附注

10.9.6.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

10.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

10.9.6 投资组合报告附注

10.9.6.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

10.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

10.9.6 投资组合报告附注

10.9.6.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

10.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

10.9.6 投资组合报告附注

10.9.6.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

10.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

10.9.6 投资组合报告附注

10.9.6.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

10.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

10.9.6 投资组合报告附注

10.9.6.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

10.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

10.9.6 投资组合报告附注

10.9.6.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

10.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

10.9.6 投资组合报告附注

10.9.6.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

10.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

10.9.6 投资组合报告附注

10.9.6.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,591,212.66

10.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

长盛同庆封闭本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

10.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600096	云天化	5,861,400.96	0.05	重大资产重组

10.9.6 投资组合报告附注

10.9.6.1 报告期内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

本基金报告期内未对投资的前十名证券的发行主体立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

10.9.6.2 报告期内本基金投资的前十名证券是否超出基金合同规定的备选股票库

长盛同庆封闭投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

10.9.6.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,851,025.44
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	587,015.05
4	应收股利	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	