

长盛同样泛资源主题股票型证券投资基金

2012 年 度 报 告 摘 要

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	2012年1月1日至2012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)	228,410,363.09	-649,682.06	227,760,681.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,271,207.15	4,271,207.15
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)	-172,407,352.97	-4,225,411.87	-176,632,764.84
其中:1.基金申购款	36,687,492.79	-344,789.03	36,342,703.76
2.基金赎回款	-209,094,845.76	-3,880,622.84	-212,975,468.60
四、本期基金份额持有人的基金份额净值的变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	56,003,010.12	-603,886.78	55,399,123.34

项目	上年度可比期间 2011年10月26日(基金合同生效日)至2011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)	941,658,939.32	-	941,658,939.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	754,097.59	754,097.59
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)	-713,248,576.23	-1,403,779.65	-714,652,355.88
其中:1.基金申购款	562,642.11	-54.21	562,587.90
2.基金赎回款	-713,811,218.34	-1,403,725.44	-715,214,943.78
四、本期基金份额持有人的基金份额净值的变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	228,410,363.09	-649,682.06	227,760,681.03

本报告7.1.4附表报表由下列负责人签署:
 周兵 杨思乐
 戴君楠
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人
 7.4 报表附注
 7.4.1 基金基本情况
 长盛同样泛资源主题股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2011]1219号《关于核准长盛同样泛资源主题股票型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同样泛资源主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购费在内的净认购金额为人民币194,564,638.02元,经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字[2011]第411号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,长盛同样泛资源主题股票型证券投资基金于2011年10月26日正式生效,基金合同生效日基金份额总额为941,658,939.32份基金份额,其中认购资金利息折为994,301.30份基金份额。本基金的基金管理人 为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。
 根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同样泛资源主题股票型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、包括权证及经中国证监会核准上市交易的权证、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中对股票投资占基金资产的比例为60%-95%,其中投资于具有投资来源的上市公司股票不低于股票资产的80%;债券投资占基金资产的40%-40%;权证投资占基金资产净值的比例不超过3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的投资比较基准为:70%×沪深300指数+30%×中证综合债指数。
 本基金的投资由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于2013年2月10日批准披露。
 7.4.2 会计报表的编制基础
 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、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(以下合称“企业会计准则”)编制,中国注册会计师的 审计意见为无保留意见。
 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
 本基金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
 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
 本基金本期及上年度可比期间未发生会计政策变更。
 7.4.5.2 会计估计变更的说明
 本基金本期及上年度可比期间未发生会计估计变更。
 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政策的通知》、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》及其他相关财政法规和实务操作,主要税项列示如下:
 (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)基金管理人运用基金买卖股票收入,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。
 (3)对基金取得的国债利息收入,由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金取得的股票股息红利收入,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,按规定征收20%的个人所得税。
 (4)基金卖出股票按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
 1.与本基金的关系

长盛基金管理有限公司(“长盛基金”)	与本基金的关系	
	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构	基金托管人、基金会计核算机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金会计核算机构	基金管理人、基金会计核算机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人、基金会计核算机构	基金管理人、基金会计核算机构
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人、基金会计核算机构	基金管理人、基金会计核算机构
安徽省委投资控股集团(有限合伙企业)	基金管理人、基金会计核算机构	基金管理人、基金会计核算机构

项目	2012年1月1日至2012年12月31日		
	本期	上年度可比期间 2011年10月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日	上年度可比期间 2011年10月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,147,846.23	1,832,518.57	1,832,518.57
其中:支付销售机构的客户维护费	707,244.95	939,208.10	939,208.10
注:支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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: 日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。 7.4.8.2.2 基金管理费			

项目	2012年1月1日至2012年12月31日		
	本期	上年度可比期间 2011年10月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日	上年度可比期间 2011年10月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	191,307.75	305,419.78	305,419.78
注:支付基金管理人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值的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 本基金本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。 7.4.8.4.2 报告期内除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况 除基金管理人以外的其他关联方本期及上年度可比期间未投资本基金。 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入			

关联方名称	2012年1月1日至2012年12月31日		
	本期	上年度可比期间 2011年10月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日	上年度可比期间 2011年10月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日
中国建设银行	18,463,662.68	126,483.79	91,409,377.81
中国建设银行的关联方	18,463,662.68	126,483.79	91,409,377.81
7.4.8.6 本基金在承销期内参与与关联方承销证券的情况 本基金本期及上年度可比期间未在本承销期内参与关联方承销证券。 7.4.8.7 其他关联方事项的说明 本基金本报告期无应披露的其他关联方事项。 7.4.9 期末、2012年12月31日本基金持有的流通受限证券 7.4.9.1 因认购新发证券而导致期末持有的流通受限证券 本基金本期未因认购新发证券而导致持有的流通受限证券。 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票			

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	复牌日期	停牌期间	数量(股)	期末成本总额	期末公允价值
300006	康美药业	2011-11-22	停牌原因	1825	2011-11-31	20,08	1,372,096.06	1,459,306.50
合计						1,372,096.06	1,459,306.50	

注:本基金截至2012年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票处于停牌期间,且未发生买入或卖出行为。
 7.4.9.3 期末未停牌期间交易中被停牌的其他事项
 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
 本基金本报告期无银行间市场债券正回购,因此没有在进行债券正回购交易中作为抵押的债券。
 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
 本基金本报告期无交易所市场债券正回购,因此没有在进行交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

将相关负债和资产的公允价值归入第一层级;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关资产和负债公允价值所属第二、三级估值层级。	
2)公允价值估值技术和本期变动	
于本期,本基金未持有公允价值归入第三级估值层的金融工具。2012年12月31日,同,本基金本期清算/转入转入第三级估值层的金额为人民币0元;计入损益的第三层级估值工具公允价值变动为人民币0元(无);涉及人民币公允价值变动损益科目发生的股票。	
2)除公允价值外,集团资产负债表日基金无需要说明的其他重要事项。	
§ 8 投资组合报告	
1. 期末基金资产组合情况	金额单位:人民币元