

同益证券投资基金
2011年第2季度报告
2011年6月30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

报告送出日期：2011年7月19日

§ 1 重要提示

基金管理人长盛基金管理有限公司的董事会及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责任。

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 2011 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 4 月 1 日起至 2011 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 长盛同益封闭 |
| 基金主代码 | 184690 |
| 交易代码 | 184690 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 1999 年 4 月 8 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,000,000,000.00 份 |
| 投资目标 | 本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。 |
| 投资策略 | 始终如一地奉行“价值投资”的基本原则，并在不同的市场环境以及市场发展变化的不同阶段，灵活运用适合自身运作特点的投资原则、投资理念和投资技巧。在战略资产配置层，寻求现金、债券、股票资产的动态收益、风险最优配置；在战术资产配置层，寻求成长型股票和价值型股票的动态收益、风险最优配置。 |
| 业绩比较基准 | 无 |
| 风险收益特征 | 无 |
| 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 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2011年4月1日-2011年6月30日) |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 24,394,914.28 |
| 2. 本期利润 | -110,935,682.53 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0555 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,093,391,848.98 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0467 |

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到2011年6月30日。

3、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。

3.2 基金净值表现

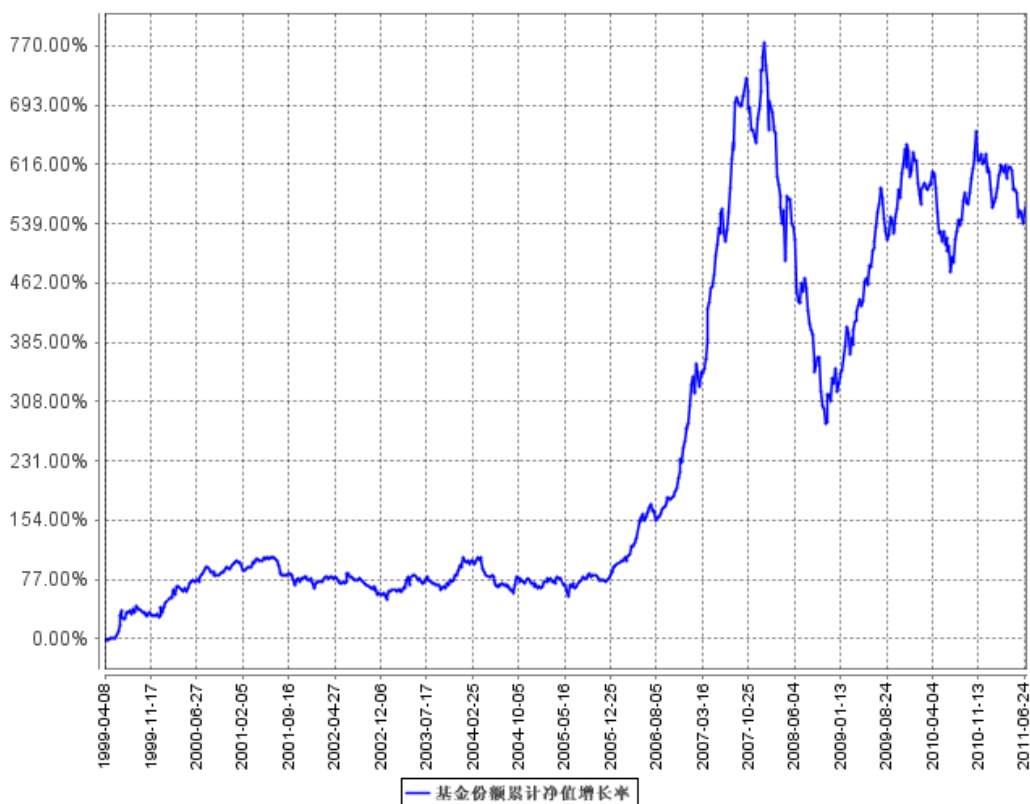
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|---------------|----------------|-------------------|-----|-----|
| 过去三个月 | -5.04% | 1.85% | - | - | - | - |

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累计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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金未规定业绩比较基准，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理小组简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王克玉 | 本基金基金经理 | 2010年7月13日 | — | 8年 | 男，1979年12月出生，中国国籍。上海交通大学硕士。历任元大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，曾任同盛证券投资基金基金经理助理，高级行业研究员。现任同益证券投资基金（本基金）基金经理。 |

注：1、上表基金经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、《同益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，在严格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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年2季度市场行情的热点集中在食品饮料、稀土等少数行业中，而其他的大多数股票出现持续下跌，尤其是有色金属、机械设备、信息设备等行业受到宏观紧缩、下游投资规模下降超预期等因素的影响，行业指数下跌幅度达到12%。从市场整体看，2季度上证指数和HS300指数的跌幅分别为6.55%和6.51%。

期初对市场的判断是在国内紧缩政策和国外充裕流动性的双重影响下，企业盈利会继续向上游资源行业集中，而通胀压力会影响下游消费的增长，期间组合增持的主要是上游资源品（包括煤炭和有色金属）、房地产、公用事业，减持的主要是建材、银行等。从效果上看增持的有色金属对组合造成一定的负面影响，而考虑到通胀压力的影响对消费品行业的配置比例较低，错过了2季度白酒等消费

品行业的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0467 元，本报告期份额净值增长率为 -5.04%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

我们预计前期过分紧张的货币供应态势将在 3 季度初期有所缓解，然而由于结构性成本上涨引起的通胀压力以及过去两年大幅增加贷款的影响，是否会如过去般重新进入相对宽松的环境还有待观察。在下游消费的拉动下，预计国内经济会保持比较高的增速，同时国内中西部区域基建和工业的发展使得国内经济发展更加均衡。

3 季度之后工业企业特别是中游制造业的盈利能力将有机会逐渐恢复，保障房建设等相关领域的投资会实现较高的增长，在投资思路上会逐渐偏向积极。关注的主要方向是：(1)医药、零售行业在短期政策和成本压力下出现一定幅度的调整，从 3 季度开始盈利增速将逐渐转向乐观，而估值已经具有明显的吸引力；(2)保障房进入规模建设阶段对相关房地产公司和上游投资品的拉动；(3)针对能源领域产业链进行深入研究，从中挖掘具有较强竞争力的企业。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,414,755,036.16 | 67.08 |
| | 其中：股票 | 1,414,755,036.16 | 67.08 |
| 2 | 固定收益投资 | 485,184,401.49 | 23.00 |
| | 其中：债券 | 485,184,401.49 | 23.00 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 80,000,000.00 | 3.79 |
| | 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 | 52,413,953.17 | 2.49 |
| 6 | 其他资产 | 76,718,292.43 | 3.64 |
| 7 | 合计 | 2,109,071,683.25 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|-----|----------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 16,299,206.00 | 0.78 |
| B | 采掘业 | 147,663,947.73 | 7.05 |
| C | 制造业 | 488,475,614.14 | 23.33 |
| C0 | 食品、饮料 | - | - |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 113,883,787.85 | 5.44 |
| C5 | 电子 | - | - |
| C6 | 金属、非金属 | 82,267,927.78 | 3.93 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 260,652,538.51 | 12.45 |
| C8 | 医药、生物制品 | 31,671,360.00 | 1.51 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 124,327,391.34 | 5.94 |
| E | 建筑业 | 57,979,525.01 | 2.77 |
| F | 交通运输、仓储业 | 91,768,893.99 | 4.38 |
| G | 信息技术业 | 273,279,057.81 | 13.05 |
| H | 批发和零售贸易 | 43,793,332.00 | 2.09 |
| I | 金融、保险业 | - | - |
| J | 房地产业 | 114,465,252.47 | 5.47 |

| | | | |
|---|---------|------------------|-------|
| K | 社会服务业 | 21,147,109.00 | 1.01 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 35,555,706.67 | 1.70 |
| | 合计 | 1,414,755,036.16 | 67.58 |

5.3 报告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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1 | 000063 | 中兴通讯 | 3,899,954 | 110,290,699.12 | 5.27 |
| 2 | 600050 | 中国联通 | 14,710,133 | 77,228,198.25 | 3.69 |
| 3 | 600582 | 天地科技 | 2,953,952 | 65,400,497.28 | 3.12 |
| 4 | 600123 | 兰花科创 | 1,321,630 | 55,217,701.40 | 2.64 |
| 5 | 600765 | 中航重机 | 3,650,361 | 54,755,415.00 | 2.62 |
| 6 | 000402 | 金融街 | 5,600,000 | 41,832,000.00 | 2.00 |
| 7 | 601006 | 大秦铁路 | 4,992,669 | 40,889,959.11 | 1.95 |
| 8 | 002122 | 天马股份 | 3,050,998 | 39,052,774.40 | 1.87 |
| 9 | 601618 | 中国中冶 | 9,520,069 | 37,509,071.86 | 1.79 |
| 10 | 600096 | 云天化 | 1,822,294 | 36,245,427.66 | 1.73 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 164,546,097.00 | 7.86 |
| 2 | 央行票据 | 148,870,000.00 | 7.11 |
| 3 | 金融债券 | 171,664,900.00 | 8.20 |
| | 其中:政策性金融债 | 171,664,900.00 | 8.20 |
| 4 | 企业债 | 103,404.49 | 0.00 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 485,184,401.49 | 23.18 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资

明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|-----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 010110 | 21 国债(00) | 1,118,780 | 111,676,619.60 | 5.33 |
| 2 | 010112 | 21 国债(12) | 530,000 | 52,867,500.00 | 2.53 |
| 3 | 030224 | 03 国开 24 | 500,000 | 50,245,000.00 | 2.40 |
| 4 | 070409 | 07 农发 09 | 500,000 | 49,935,000.00 | 2.39 |
| 5 | 1101021 | 11 央票 21 | 500,000 | 49,625,000.00 | 2.37 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持

证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 声明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。

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

基金的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,076,552.54 |
| 2 | 应收证券清算款 | 68,032,147.74 |
| 3 | 应收股利 | 1,572,690.74 |
| 4 | 应收利息 | 6,036,901.41 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 76,718,292.43 |

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

份额单位：份

| | |
|----------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的封闭式基金份额 | 28,000,079.00 |
| 报告期期间买入总份额 | - |
| 报告期期间卖出总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的封闭式基金份额 | 28,000,079.00 |
| 报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%) | 1.40 |

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《同益证券投资基金基金合同》；
- 3、《同益证券投资基金基金托管协议》；
- 4、《同益证券投资基金基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

7.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复印件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。