

同盛证券投资基金
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	长盛同盛封闭
基金主代码	184699
交易代码	184699
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999 年 11 月 5 日
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00 份
投资目标	本基金属于成长价值复合型基金，主要投资于业绩能够持续高速成长的成长型上市公司和市场价值被低估的价值型上市公司，利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好的分散和控制风险，实现基金资产的稳定增长。
投资策略	本基金将根据市场发展情况，确定在一段时间内市场发展的总体趋势，并在此基础上确定股票和国债的配置比例以及股票投资中成长型投资和价值型投资的配置比例。并分别选取成长型特征最明显的股票和价值型特征最明显的股票进行组合投资。
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	77,654,111.67
2. 本期利润	-94,167,612.35
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0314
4. 期末基金资产净值	3,729,000,796.30
5. 期末基金份额净值	1.2430

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

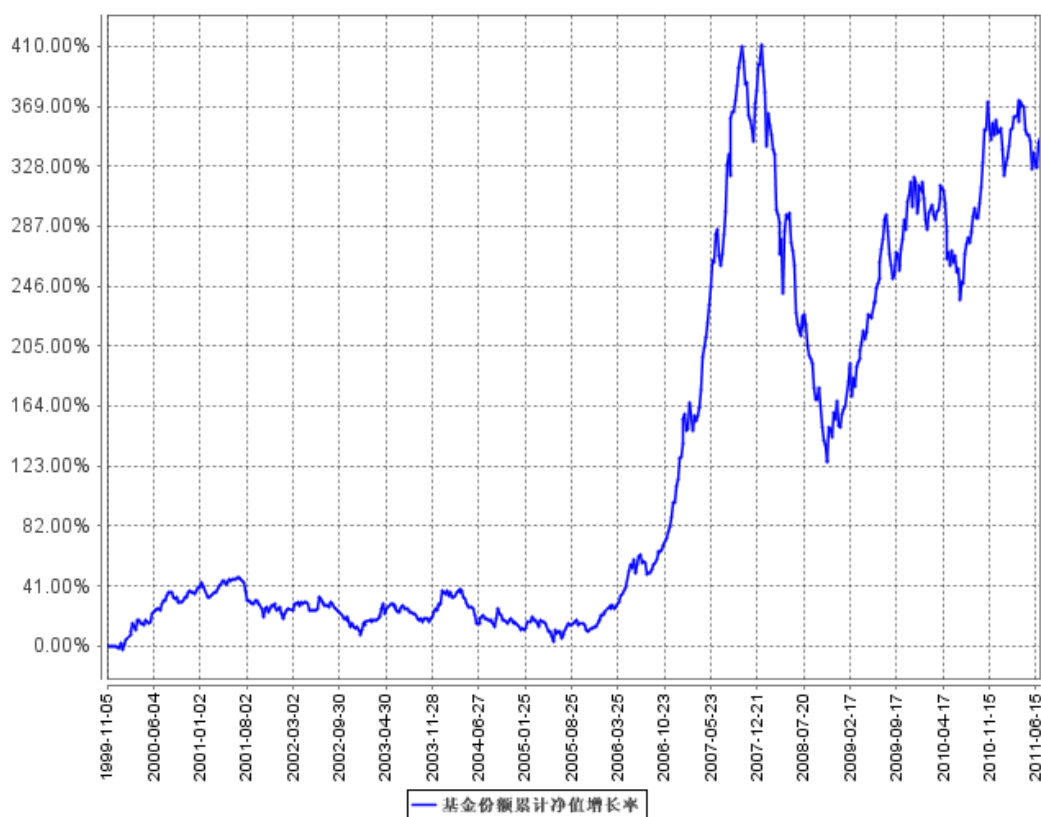
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.46%	2.13%	-	-	-	-

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：1、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。

2、本基金基金合同未规定建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达基金合同投资组合中规定的各项比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
侯继雄	本基金基金经理，研究发展部总监。	2008年8月11日	—	10年	男，1974年5月出生，中国国籍。清华大学博士。2001年4月至2007年2月在国泰君安证券研究所任研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司，现任研究发展部总监，同盛证券投资基金（本基金）基金经理。
丁骏	本基金基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理。	2008年4月25日	—	10年	男，1974年11月出生，中国国籍。中国社会科学院经济学博士。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师；国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理；2003年6月加入长盛基金管理有限公司，先后担任行业研究员、组合经理助理。现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理，同盛证券投资基金（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、《同盛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，通胀的严峻性超出了市场的预期，使得货币政策和信贷政策更趋严厉；加之前期的房地产限购政策和汽车消费补贴政策退出的影响也不断显现，使得2季度经济下滑之势更加明显。乐观的投资者纠结于经济下滑和估值很低的矛盾中，悲观的投资者则纠结于硬着陆与软着陆的困惑中。最终在股市中显现为逐渐下跌之势。总体看，“通胀升、政策紧、市场跌”“通胀降、政策松、市场涨”的逻辑仍是成立的。

同盛认可投资者对经济的担忧，但也认为市场估值已有相当吸引力，因此并未对市场过分看空，也遭受了市场下跌的损失。总体上，2季度仓位略有下降，减持了部分周期股，增加了部分消费股；总体运作情况尚可。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为1.2430元，本报告期份额净值增长率为-2.46%。

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

下半年，通胀回落的势头将是明确的，但通胀的绝对水平仍然会维持在高位，这限制了政府再次宽松货币的空间和能力。就经济总量而言，保障房建设、高铁建设、水利建设、中西部发展和城市化仍能对推动经济增长贡献力量。但经济结构调整的压力也在不断加大。具体表现为投资占比持续增加，内需不振，贫富差距加大，政府和民间的经济能力相差太大，资源能源压力大，等等。因此，未来同盛的关注

点更要放在细分行业的发展和有特色竞争力的企业的发展之上。考虑到通胀的回落、经济环比底部临近等因素，同盛短期将继续对市场保持谨慎乐观的看法，重点考虑大盘蓝筹、周期类成长股、稳定消费股的机会。

§ 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	2,779,916,440.83	73.92
	其中：股票	2,779,916,440.83	73.92
2	固定收益投资	768,549,933.60	20.44
	其中：债券	768,549,933.60	20.44
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	202,760,240.45	5.39
6	其他资产	9,327,768.04	0.25
7	合计	3,760,554,382.92	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	-	-
B	采掘业	325,283,450.85	8.72
C	制造业	1,597,900,546.28	42.85
C0	食品、饮料	289,232,840.88	7.76
C1	纺织、服装、皮毛	36,213,763.00	0.97
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	331,529,272.04	8.89
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	185,492,231.21	4.97
C7	机械、设备、仪表	442,135,886.36	11.86
C8	医药、生物制品	313,296,552.79	8.40
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	105,350,000.00	2.83
F	交通运输、仓储业	27,727,788.80	0.74
G	信息技术业	114,376,616.32	3.07
H	批发和零售贸易	203,930,547.27	5.47
I	金融、保险业	259,323,000.00	6.95
J	房地产业	86,253,294.33	2.31
K	社会服务业	32,058,000.00	0.86

L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	27,713,196.98	0.74
	合计	2,779,916,440.83	74.55

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	600309	烟台万华	13,928,923	260,610,149.33	6.99
2	601318	中国平安	3,700,000	178,599,000.00	4.79
3	600031	三一重工	9,750,000	175,890,000.00	4.72
4	000937	冀中能源	4,700,000	119,145,000.00	3.20
5	600123	兰花科创	2,600,000	108,628,000.00	2.91
6	600519	贵州茅台	500,000	106,315,000.00	2.85
7	600266	北京城建	7,000,000	105,350,000.00	2.83
8	000581	威孚高科	2,280,682	87,920,291.10	2.36
9	000926	福星股份	7,205,789	86,253,294.33	2.31
10	601607	上海医药	5,072,357	85,215,597.60	2.29

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	102,871,933.60	2.76
2	央行票据	126,503,000.00	3.39
3	金融债券	539,175,000.00	14.46
	其中:政策性金融债	539,175,000.00	14.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	768,549,933.60	20.61

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	100209	10国开09	1,500,000	150,240,000.00	4.03
2	080411	08农发11	1,000,000	99,640,000.00	2.67
3	1001100	10央票100	1,000,000	97,250,000.00	2.61
4	010112	21国债(12)	700,000	69,825,000.00	1.87
5	100230	10国开30	500,000	49,975,000.00	1.34

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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,106,357.38
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,221,410.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,327,768.04

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中未存在流通受限情况。

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	6,000,000.00
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	6,000,000.00
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	0.20

§ 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、《同盛证券投资基金基金合同》；
- 3、《同盛证券投资基金基金托管协议》；
- 4、《同盛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制件或复印件。

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>。