

同益证券投资基金  
2011 年半年度报告  
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

送出日期：2011 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称：中国工商银行）根据本基金合同规定，于2011年8月26日复核了本报告中的财务指标、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至6月30日止。

1.2	目录	
§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
1.2	目录	2
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5	对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14

6.2	利润表	16
6.3	所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4	报表附注	18
<b>§ 7</b>	<b>投资组合报告</b>	<b>32</b>
7.1	期末基金资产组合情况	32
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	32
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	33
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	35
7.6	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	35
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	36
7.8	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	36
7.9	投资组合报告附注	36
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>37</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	37
8.2	期末上市基金前十名持有人	37
<b>§ 9</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>38</b>
9.1	基金份额持有人大会决议	38
9.2	本报告期内基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动	38
9.3	涉及基金管理人，基金财产，基金托管业务的诉讼	38
9.4	基金投资策略的改变	38
9.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	38
9.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	38
9.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	39
9.8	其他重大事件	40

§ 10 备查文件目录 .....	41
10.1 备查文件目录 .....	41
10.2 存放地点和查阅方式 .....	41
10.3 查阅方式 .....	41

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	同益证券投资基金
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
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	2,000,000,000.00份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1999年4月21日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		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 负责人	姓名	叶金松	赵会军
	联系电话	010-82019988	010-66105799
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95588
传真		010-82255988	010-66105798
注册地址		深圳市福田区福中三路 1006 号 诺德中心八楼 GH 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号 城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		凤良志	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	中国深圳市深南中路 1093 号中信大厦 21 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011年1月1日-2011年6月30日）
本期已实现收益	95,178,214.94
本期利润	-153,934,776.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0770
本期加权平均净值利润率	-6.81%
本期基金份额净值增长率	-6.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011年6月30日）
期末可供分配利润	93,391,848.98
期末可供分配基金份额利润	0.0467
期末基金资产净值	2,093,391,848.98
期末基金份额净值	1.0467
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2011年6月30日）
基金份额累计净值增长率	563.47%

注：1、所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数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

### 3.2 基金净值表现

#### 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	净值增长率①	净值增长率 标准差②
过去一个月	1.69%	1.66%
过去三个月	-5.04%	1.85%
过去六个月	-6.81%	1.84%
过去一年	13.50%	2.09%
过去三年	23.46%	2.85%
自基金合同生效起至今	563.47%	2.67%

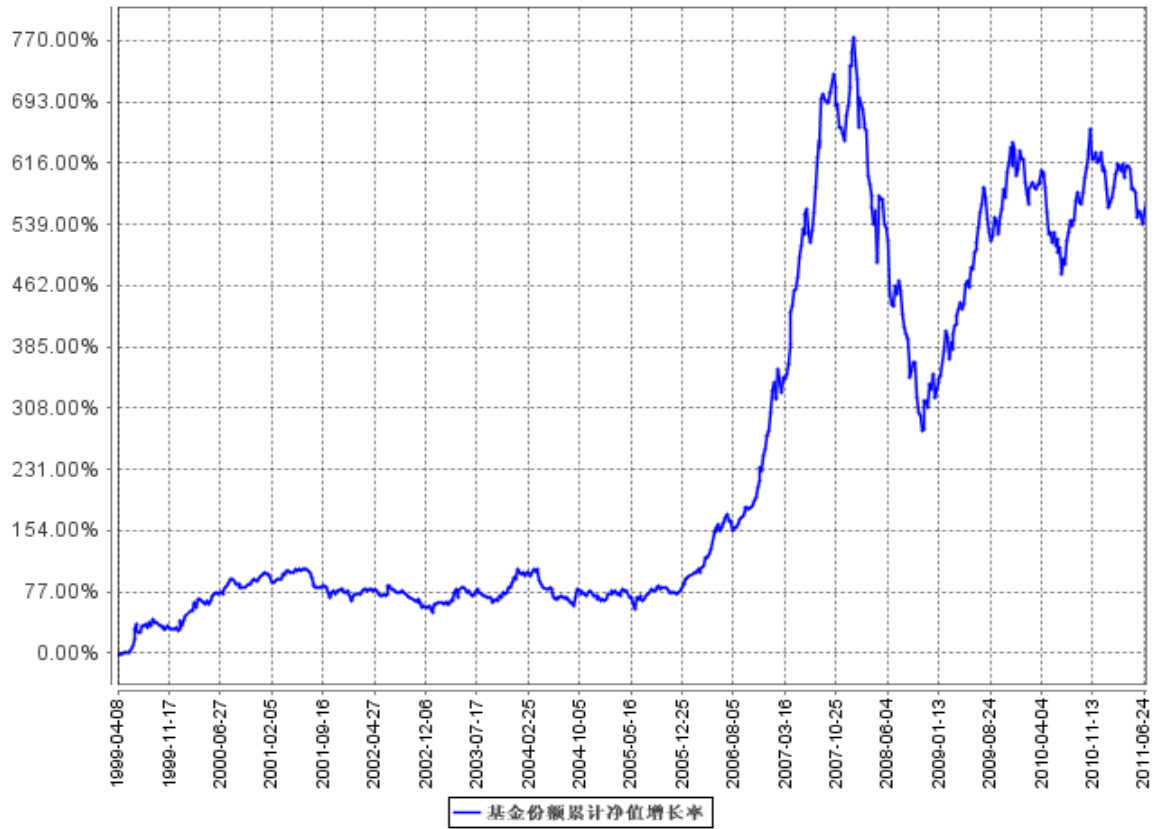
注：本基金无业绩比较基准收益率，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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：本基金无同期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。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6号文件批准，于1999年3月成立，注册资本为人民币15000万元。目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的41%；新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的33%；安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截止2011年6月30日，基金管理人共管理两支封闭式基金、十四支开放式基金（包括一支QDII基金），并于2002年12月，首批取得了全国社保基金管理资格。基金管理人于2007年9月，取得合格境内机构投资者资格，并于2008年2月，取得从事特定客户资产管理业务资格。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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，在认真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 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2011年上半年A股市场走势表现出明显的阶段性和分化行情。1季度低估值的金融、房地产和钢铁等2010年落后市场的板块开始走强，而医药、电子等在2010年贡献超额收益的品种出现大幅的调整；但是在2季度受到愈加严重的通胀形势的影响，市场出现普遍的调整，投资机会向高端白酒、稀土等集中。同时市场的结构分化仍然非常明显，上半年上证指数和HS300指数走势基本持平，而中小板指数和创业板指数跌幅分别达到了13%和24%。

1季度组合增持的主要是低估值的建材、房地产、银行等，减持的包括部分估值较高、业绩增速下调的公司，在2季度考虑到国内紧缩政策和国外流动性充裕的影响，企业盈利会继续向上游行业集中，因此期间增持的主要是上游资源品、房地产，减持了建材和银行。期间组合净值表现较差，主要是由于对中高端白酒、品牌医药等股票的配置较低，同时组合中的部分大盘股出现一定下跌。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截止报告期末，本基金份额净值为1.0467元，本报告期份额净值增长率为

-6.81%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

### 4.5.1 对宏观经济和证券市场展望

从2010年11月份开始国内通过提高利率和存款准备金率等相对紧缩的货币政策来应对结构性成本上涨压力，市场的实际利率水平不断提高。但是由于受到海外市场流动性的影响，主要原材料价格不断上涨；而国内的劳动力和农产品供给频繁出现的区域性和阶段性受限的影响，形成持续性的上涨预期。下半年随着紧缩政策效果的体现，预计国内的通胀形势将有所改善。

在这种宏观格局下，企业盈利的分化还在继续。大多数中游制造业面临着持续的成本上涨压力，而由于大多数企业缺乏经营模式上的创新，企业盈利将经受一定程度的考验；而上游资源品行业和优势品牌公司可以通过产品价格和规模的扩张实现快速的盈利增长。另外较为紧张的经济环境也为资金充沛的上市公司提供了收购兼并的良好机遇。

### 4.5.2 本基金下阶段投资策略

3季度后随着通胀形势的改善，以及企业盈利增速下降的兑现，投资思路上会逐渐偏向积极。后续会对以下几个领域进行重点关注和研究：（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）针对能源领域产业链进行深入研究，跟踪相关公司在高盈利的配件领域的突破带来的机会；（3）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。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司副总经理（担任估值小组组长）、督察

长（担任估值小组组长）及投资管理部、金融工程及量化投资部、研究发展部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本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责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，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。

本基金未签约与任何估值相关的定价服务。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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十七条中对基金利润分配原则的约定，本基金于 2011 年 3 月 25 日对 2010 年收益进行了分配，分配金额为 220,000,000.00 元。

本基金截至 2011 年 6 月 30 日，期末可供分配收益为 93,391,848.98 元，其中：未分配收益已实现部分为 103,717,815.37 元，未分配收益未实现部分为 -10,325,966.39 元。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011年上半年，本基金托管人在对同益证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011年上半年，同益证券投资基金的管理人——长盛基金管理有限公司在同益证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，同益证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为220,000,000.00元。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的同益证券投资基金2011年半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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：同益证券投资基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	49,127,431.53	188,977,076.50
结算备付金		3,286,521.64	5,325,910.29
存出保证金		1,076,552.54	742,586.90
交易性金融资产	6.4.7.2	1,899,939,437.65	2,269,865,179.09
其中：股票投资		1,414,755,036.16	1,726,510,859.29
基金投资		-	-
债券投资		485,184,401.49	543,354,319.80
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	80,000,000.00	-
应收证券清算款		68,032,147.74	-
应收利息	6.4.7.5	6,036,901.41	9,863,132.91
应收股利		1,572,690.74	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>2,109,071,683.25</b>	<b>2,474,773,885.69</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年6月30日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,173,727.81	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,531,215.85	3,169,772.74
应付托管费		421,869.31	528,295.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,026,568.84	2,338,492.63
应交税费		815,699.68	815,699.68
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	710,752.78	595,000.00
<b>负债合计</b>		<b>15,679,834.27</b>	<b>7,447,260.48</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	6.4.7.10	93,391,848.98	467,326,625.21
<b>所有者权益合计</b>		<b>2,093,391,848.98</b>	<b>2,467,326,625.21</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>2,109,071,683.25</b>	<b>2,474,773,885.69</b>

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0467 元，基金份额总额 2,000,000,000.00 份。



## 6.2 利润表

会计主体：同益证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日 至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日 至2010年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>-127,883,853.74</b>	<b>-511,186,880.04</b>
1. 利息收入		10,679,138.72	7,034,127.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	650,131.86	674,478.63
债券利息收入		9,203,332.47	6,359,649.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		825,674.39	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		110,549,998.71	28,858,916.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	105,464,120.47	22,277,847.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,653,618.28	1,025,985.13
资产支持证券投资		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	7,739,496.52	5,555,083.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	6.4.7.16	-249,112,991.17	-547,081,402.08
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	6.4.7.17	-	1,478.09
<b>减：二、费用</b>		<b>26,050,922.49</b>	<b>29,107,151.82</b>
1. 管理人报酬		16,857,762.45	19,445,343.33
2. 托管费		2,809,627.08	3,240,890.51
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	5,514,205.51	4,406,101.47
5. 利息支出		-	14,466.65
其中：卖出回购金融资产支出		-	14,466.65
6. 其他费用	6.4.7.19	869,327.45	2,000,349.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-153,934,776.23</b>	<b>-540,294,031.86</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-153,934,776.23</b>	<b>-540,294,031.86</b>

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：同益证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年6月30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)	2,000,000,000.00	467,326,625.21	2,467,326,625.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-153,934,776.23	-153,934,776.23
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)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-220,000,000.00	-220,000,000.00
<b>五、期末所有者权益(基金净值)</b>	<b>2,000,000,000.00</b>	<b>93,391,848.98</b>	<b>2,093,391,848.98</b>
项 目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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)	2,000,000,000.00	1,166,076,293.27	3,166,076,293.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-540,294,031.86	-540,294,031.86
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)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-600,000,000.00	-600,000,000.00
<b>五、期末所有者权益(基金净值)</b>	<b>2,000,000,000.00</b>	<b>25,782,261.41</b>	<b>2,025,782,261.41</b>

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵

杨思乐

戴君棉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

同益证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[1999]第8号文《关于同意同益证券投资基金设立的批复》的核准,由长盛基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于1999年4月8日正式生效,首次设立募集规模为20亿份基金份额。本基金为契约型封闭式,存续期限为15年。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《同益证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,其中主要投资于国内依法公开发行、上市的股票、债券。本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%,本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%。本基金并未就业绩比较基准作出相关规定。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模版第3号〈年度报告和半年度报告〉》等问题的通知及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2011年6月30日的财务状况以及2011年1月1日至2011年6月30日期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 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。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

**6.4.5.1 会计政策变更的说明：**本报告期不存在会计政策变更。

**6.4.5.2 会计估计变更的说明：**本报告期不存在会计估计变更。

**6.4.5.3 差错更正的说明：**本报告期不存在差错更正。

#### **6.4.6 税项**

##### **1、印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税；

##### **2、营业税、企业所得税**

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，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；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

##### **3、个人所得税**

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入，由上市公司、债券发行企业在向基金派发时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自2005年6月13日起，对证券投资基金从上市公司分配

取得的股息红利所得，按照财税[2005]102号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	49,127,431.53
定期存款	-
其他存款	-
<b>合计</b>	<b>49,127,431.53</b>

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,422,850,106.53	1,414,755,036.16	-8,095,070.37	
债券	交易所市场	165,987,577.51	164,649,501.49	-1,338,076.02
	银行间市场	321,427,720.00	320,534,900.00	-892,820.00
	合计	487,415,297.51	485,184,401.49	-2,230,896.02
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
<b>合计</b>	<b>1,910,265,404.04</b>	<b>1,899,939,437.65</b>	<b>-10,325,966.39</b>	

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	80,000,000.00	-
银行间买入返售证券	-	-
<b>合计</b>	<b>80,000,000.00</b>	<b>-</b>

##### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日

应收活期存款利息	23,449.91
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,331.01
应收债券利息	5,980,080.44
应收买入返售证券利息	32,000.00
应收申购款利息	-
其他	40.05
<b>合计</b>	<b>6,036,901.41</b>

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,023,780.44
银行间市场应付交易费用	2,788.40
<b>合计</b>	<b>4,026,568.84</b>

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
预提审计费	47,108.87
信息披露费	133,891.13
上市年费	29,752.78
<b>合计</b>	<b>710,752.78</b>

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	228,539,600.43	238,787,024.78	467,326,625.21
本期利润	95,178,214.94	-249,112,991.17	-153,934,776.23
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-

其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-220,000,000.00	-	-220,000,000.00
本期末	103,717,815.37	-10,325,966.39	93,391,848.98

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	615,199.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	34,196.43
其他	735.44
合计	650,131.86

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	1,860,318,532.33
减：卖出股票成本总额	1,754,854,411.86
买卖股票差价收入	105,464,120.47

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	430,303,259.00
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	416,929,880.00
减：应收利息总额	16,026,997.28
债券投资收益	-2,653,618.28

#### 6.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末取得衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,739,496.52
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,739,496.52

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-249,112,991.17
——股票投资	-249,330,034.86
——债券投资	217,043.69
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-249,112,991.17

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期未取得其他收入。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	5,512,580.51
银行间市场交易费用	1,625.00
合计	5,514,205.51

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2011年1月1日至2011年6月30日
银行费用	3,974.67
审计费用	47,108.87
信息披露费	133,891.13
账户维护费	4,500.00
上市年费	29,752.78
分红手续费	650,100.00
合计	869,327.45

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方



关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
国元证券	基金发起人、基金管理人股东
中国工商银行	基金托管人

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
国元证券	672,436,187.71	18.93%	988,795,406.76	36.92%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交 总额的比例	成交金额	占当期债券成交 总额的比例
国元证券	20,008,000.00	28.60%	-	-

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	成交金额	占当年回购成交 总额的比例	成交金额	占当年回购成交 总额的比例
国元证券	220,000,000.00	9.02%	-	-

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末佣金余额	占期末应付佣金余 额的比例
国元证券	563,188.05	18.90%	563,188.05	14.00%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末佣金余额	占期末应付佣金余 额的比例

国元证券	803,402.11	35.88%	1,146,777.57	24.84%
------	------------	--------	--------------	--------

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管费、经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日 至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日 至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,857,762.45	19,445,343.33
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提，基金成立三个月后，如果现金持有比例超过基金资产净值的20%，超出部分不计提基金管理费。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值（扣除超过规定比例现金后的资产净值）

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日 至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日 至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,809,627.08	3,240,890.51

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易：

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011年1月1日 至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日 至2010年6月30日
基金合同生效日(1999年4月8日)持有的基金份额	20,000,000.00	20,000,000.00
期初持有的基金份额	28,000,079.00	28,000,079.00
期间申购/买入总份额	-	-
本期因拆分变动的份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	28,000,079.00	28,000,079.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.40%	1.40%

##### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
基金发起人-长江证券有限责任公司	6,000,000.00	0.30%	6,000,000.00	0.30%
基金发起人-天津北方国际信托投资股份有限公司	4,000,000.00	0.20%	4,000,000.00	0.20%
基金发起人-中信证券股份有限公司	6,000,000.00	0.30%	6,000,000.00	0.30%
基金发起人、基金管理人股东-国元证券股份有限公司	4,000,000.00	0.20%	4,000,000.00	0.20%

##### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	49,127,431.53	615,199.99	227,410,012.92	658,982.44

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计算。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期间及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明：无。

#### 6.4.11 利润分配情况

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2011-03-24	2011-03-25	1.100	220,000,000.00	-	220,000,000.00	
合计				220,000,000.00	-	220,000,000.00	

#### 6.4.12 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与金融工程部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管

理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，并且本基金资产不存在流通暂时受限制不能自由转让的情况，因此均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险和外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

下表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
银行存款	49,127,431.53	-	-	-	-	-	49,127,431.53
结算备付金	3,286,521.64	-	-	-	-	-	3,286,521.64
存出保证金	98,780.49	-	-	-	-	977,772.05	1,076,552.54
交易性金融资产	229,021,000.00	152,945,519.60	103,114,477.40	103,404.49	-	-1,414,755,036.16	1,899,939,437.65
买入返售金融资产	80,000,000.00	-	-	-	-	-	80,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	68,032,147.74	68,032,147.74
应收利息	-	-	-	-	-	6,036,901.41	6,036,901.41
应收股利	-	-	-	-	-	1,572,690.74	1,572,690.74
<b>资产总计</b>	<b>361,533,733.66</b>	<b>152,945,519.60</b>	<b>103,114,477.40</b>	<b>103,404.49</b>	<b>-</b>	<b>-1,491,374,548.10</b>	<b>2,109,071,683.25</b>
<b>负债</b>							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,173,727.81	7,173,727.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,531,215.85	2,531,215.85
应付托管费	-	-	-	-	-	421,869.31	421,869.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,026,568.84	4,026,568.84
应交税费	-	-	-	-	-	815,699.68	815,699.68
其他负债	-	-	-	-	-	710,752.78	710,752.78
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>15,679,834.27</b>	<b>15,679,834.27</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>361,533,733.66</b>	<b>152,945,519.60</b>	<b>103,114,477.40</b>	<b>103,404.49</b>	<b>-</b>	<b>-1,475,694,713.83</b>	<b>2,093,391,848.98</b>
<b>上年度末</b>							
2010年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
银行存款	188,977,076.50	-	-	-	-	-	188,977,076.50
结算备付金	5,325,910.29	-	-	-	-	-	5,325,910.29
存出保证金	98,780.49	-	-	-	-	643,806.41	742,586.90
交易性金融资产	30,390,000.00	158,688,000.00	354,168,755.20	107,564.60	-	-1,726,510,859.29	2,269,865,179.09
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	9,863,132.91	9,863,132.91
<b>资产总计</b>	<b>224,791,767.28</b>	<b>158,688,000.00</b>	<b>354,168,755.20</b>	<b>107,564.60</b>	<b>-</b>	<b>-1,737,017,798.61</b>	<b>2,474,773,885.69</b>
<b>负债</b>							
卖出回购金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,169,772.74	3,169,772.74
应付托管费	-	-	-	-	-	528,295.43	528,295.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,338,492.63	2,338,492.63
应交税费	-	-	-	-	-	815,699.68	815,699.68
其他负债	-	-	-	-	-	595,000.00	595,000.00
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>7,447,260.48</b>	<b>7,447,260.48</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>224,791,767.28</b>	<b>158,688,000.00</b>	<b>354,168,755.20</b>	<b>107,564.60</b>	<b>-</b>	<b>-1,729,570,538.13</b>	<b>2,467,326,625.21</b>

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、

可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对基金资产净值产生的影响。

假设	1、该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况； 2、假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变； 3、此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	+0.25%	下降约 1,098,818.02	下降约 460,492.79
-0.25%	增加约 1,098,818.02	增加约 460,492.79	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的重大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%。于 2011 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		上年度末 2010年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,414,755,036.16	67.58	1,726,510,859.29	69.97
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,414,755,036.16	67.58	1,726,510,859.29	69.97

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

假设	1、假定上证指数变化 5%，其他变量不变； 2、用期末时点上上证指数浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险； 3、Beta 系数是根据组合在过去一年的净值数据和上证指数数据回归得出，反映了基金和上证指数的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	+5%	增加约 97,503,413.12	增加约 86,083,792.29
-5%	降低约 97,503,413.12	减少约 86,083,792.29	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。



## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	76,718,292.43	3.64
7	合计	2,109,071,683.25	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	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
--	----	------------------	-------

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	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
11	600570	恒生电子	2,432,146	36,093,046.64	1.72
12	600497	驰宏锌锗	1,562,096	34,444,216.80	1.65
13	600795	国电电力	11,466,181	33,939,895.76	1.62
14	600403	大有能源	1,061,637	33,250,470.84	1.59
15	600720	祁连山	1,791,212	32,671,706.88	1.56
16	600011	华能国际	6,152,962	32,487,639.36	1.55
17	601607	上海医药	1,885,200	31,671,360.00	1.51
18	600823	世茂股份	2,057,452	30,100,522.76	1.44
19	000830	鲁西化工	4,272,040	29,904,280.00	1.43
20	600739	辽宁成大	1,048,569	29,150,218.20	1.39
21	000983	西山煤电	1,099,901	26,617,604.20	1.27
22	600009	上海机场	2,060,430	26,373,504.00	1.26
23	600428	中远航运	3,394,104	24,505,430.88	1.17
24	601088	中国神华	799,920	24,109,588.80	1.15
25	000822	山东海化	2,203,639	23,358,573.40	1.12
26	600336	澳柯玛	3,026,754	22,397,979.60	1.07
27	600790	轻纺城	2,692,446	21,620,341.38	1.03
28	600376	首开股份	1,635,258	21,601,758.18	1.03
29	000709	河北钢铁	4,705,970	21,270,984.40	1.02
30	601007	金陵饭店	2,301,100	21,147,109.00	1.01
31	600886	国投电力	2,912,634	21,116,596.50	1.01
32	002242	九阳股份	1,687,795	21,097,437.50	1.01
33	600048	保利地产	1,904,547	20,930,971.53	1.00
34	000012	南玻A	1,256,881	20,738,536.50	0.99
35	600266	北京城建	1,360,163	20,470,453.15	0.98
36	000539	粤电力A	3,722,723	20,102,704.20	0.96
37	600517	置信电气	1,599,351	19,304,166.57	0.92
38	000600	建投能源	3,257,921	16,680,555.52	0.80
39	600271	航天信息	635,319	16,416,642.96	0.78
40	600598	北大荒	1,164,229	16,299,206.00	0.78
41	002518	科士达	548,547	15,315,432.24	0.73

42	600858	银座股份	716,395	14,643,113.80	0.70
43	600881	亚泰集团	1,672,913	13,935,365.29	0.67
44	600309	烟台万华	717,553	13,425,416.63	0.64
45	002335	科华恒盛	658,535	12,874,359.25	0.62
46	600486	扬农化工	503,684	10,950,090.16	0.52
47	000530	大冷股份	940,997	10,454,476.67	0.50
48	600331	宏达股份	570,000	7,586,700.00	0.36
49	000933	神火股份	478,293	7,274,836.53	0.35

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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的比例 (%)
1	600050	中国联通	106,063,673.94	4.30
2	600123	兰花科创	53,244,696.32	2.16
3	600497	驰宏锌锗	48,231,677.29	1.95
4	601006	大秦铁路	44,619,319.20	1.81
5	600500	中化国际	44,128,527.40	1.79
6	600428	中远航运	42,918,155.77	1.74
7	600266	北京城建	42,494,128.05	1.72
8	600570	恒生电子	42,231,440.12	1.71
9	601618	中国中冶	40,290,362.83	1.63
10	600016	民生银行	40,039,567.82	1.62
11	000422	湖北宣化	38,301,282.79	1.55
12	600886	国投电力	37,594,706.64	1.52
13	600011	华能国际	36,995,268.40	1.50
14	600720	祁连山	36,766,349.23	1.49
15	000822	山东海化	36,627,549.99	1.48
16	600403	大有能源	36,168,066.08	1.47
17	600795	国电电力	36,081,658.18	1.46
18	000060	中金岭南	34,937,532.35	1.42
19	600000	浦发银行	33,742,429.62	1.37
20	600881	亚泰集团	33,272,426.27	1.35

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值的比例 (%)
1	601318	中国平安	127,130,523.65	5.15
2	000568	泸州老窖	84,296,169.83	3.42
3	600089	特变电工	80,740,551.25	3.27
4	600720	祁连山	80,040,341.61	3.24
5	600271	航天信息	62,776,965.03	2.54
6	601111	中国国航	58,596,376.47	2.37
7	600875	东方电气	58,555,102.87	2.37

8	600739	辽宁成大	56,742,862.34	2.30
9	600395	盘江股份	53,067,438.34	2.15
10	600693	东百集团	52,603,215.72	2.13
11	000858	五粮液	45,371,263.44	1.84
12	002115	三维通信	42,935,606.79	1.74
13	600016	民生银行	42,361,934.06	1.72
14	002281	光迅科技	40,961,219.98	1.66
15	600500	中化国际	40,198,005.94	1.63
16	600360	华微电子	39,569,835.06	1.60
17	000422	湖北宜化	39,309,227.82	1.59
18	601678	滨化股份	37,195,534.02	1.51
19	600096	云天化	35,362,558.56	1.43
20	600298	安琪酵母	34,667,645.06	1.41

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,692,428,623.59
卖出股票收入（成交）总额	1,860,318,532.33

注：本项中 7.4.1, 7.4.2, 7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	企业债券	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

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010110	21 国债(10)	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 央行票据 21	500,000	49,625,000.00	2.37

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

### 7.8 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。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 声明本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查记录，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。

#### 7.9.2 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。

#### 7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

#### 7.9.4 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。

#### 7.9.5 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不存在流通受限情况。

#### 7.9.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
24,981	80,060.85	1,328,502,182.00	66.43%	671,497,818.00	33.57%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

份额单位：份

序号	持有人名称	持有份额	占上市份额比例
1	中国人寿保险(集团)公司	197,111,229	9.86%
2	中国人寿保险股份有限公司	196,380,409	9.82%
3	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品	113,815,640	5.69%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	92,999,900	4.65%
5	阳光财产保险股份有限公司—自有资金	71,316,360	3.57%
6	中国太保集团股份有限公司—本级—集团自有资金—012G—ZY001 深	60,000,000	3.00%
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	53,442,500	2.67%
8	中国机械进出口(集团)有限公司	40,000,000	2.00%
9	宝钢集团有限公司	34,974,450	1.75%
10	兵器财务有限责任公司	34,233,820	1.71%

## § 9 重大事件揭示

### 9.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 9.2 本报告期内基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

#### 9.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本基金管理人于 2011 年 5 月 14 日发布公告，经长盛基金管理有限公司第五届董事会第十五次会议审议通过，并报中国证监会审核批准，聘任公司副总经理周兵先生担任公司总经理，陈礼华先生不再担任公司总经理。

#### 9.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 9.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

### 9.3 涉及基金管理人，基金财产，基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 9.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略不曾改变。

### 9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所，本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 9.6 管理人，托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 9.7.1 本期基金租用证券公司交易单元股票交易的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
招商证券	1	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-
国元证券	2	672,436,187.71	18.93%	563,188.05	18.90%
申银万国证券	2	288,608,442.96	8.12%	245,316.28	8.23%
中国银河证券	1	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-
平安证券	1	823,098,706.43	23.17%	668,772.23	22.44%
广发华福证券	1	-	-	-	-
信达证券	1	1,454,376,426.62	40.94%	1,236,215.58	41.48%
红塔证券	1	-	-	-	-
东方证券	1	314,227,392.20	8.84%	267,092.18	8.96%

### 9.7.2 本期基金租用证券公司交易单元债券及债券回购交易的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易	
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交总额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	1	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-
国元证券	2	20,008,000.00	28.60%	220,000,000.00	9.02%
申银万国证券	2	4,472,725.60	6.39%	-	-
中国银河证券	1	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-
广发华福证券	1	-	-	-	-
信达证券	1	45,477,661.40	65.01%	1,300,000,000.00	53.28%
红塔证券	1	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	920,000,000.00	37.70%

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资历雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。



(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

## 2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商席位租用协议》，并办理基金专用席位租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的席位；

(6) 席位租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

## 3、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	席位所属市场	数量
1	东方证券股份有限公司	上海	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

## 9.8 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事件如下：

序号	公告名称/事项	披露方式	披露日期
1	长盛基金管理有限公司总经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2011-05-14
2	长盛基金管理有限公司关于由周兵先生代为履行公司总经理职务的公告	同上	2011-03-30
3	同益证券投资基金 2010 年度收益分配公告	同上	2011-03-17

## § 10 备查文件目录

### 10.1 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、《同益证券投资基金托管协议》；
- 4、《同益证券投资基金招募说明书》；
- 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。

### 10.2 存放地点和查阅方式

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 10.3 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>。