

同盛证券投资基金
2011 年第 3 季度报告
2011 年 9 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 10 月 26 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 10 月 25 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 7 月 1 日起至 2011 年 9 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增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7月1日—2011年9月30日)
1. 本期已实现收益	48,338,134.08
2. 本期利润	-435,435,660.39
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1451
4. 期末基金资产净值	3,293,565,135.91
5. 期末基金份额净值	1.0979

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9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

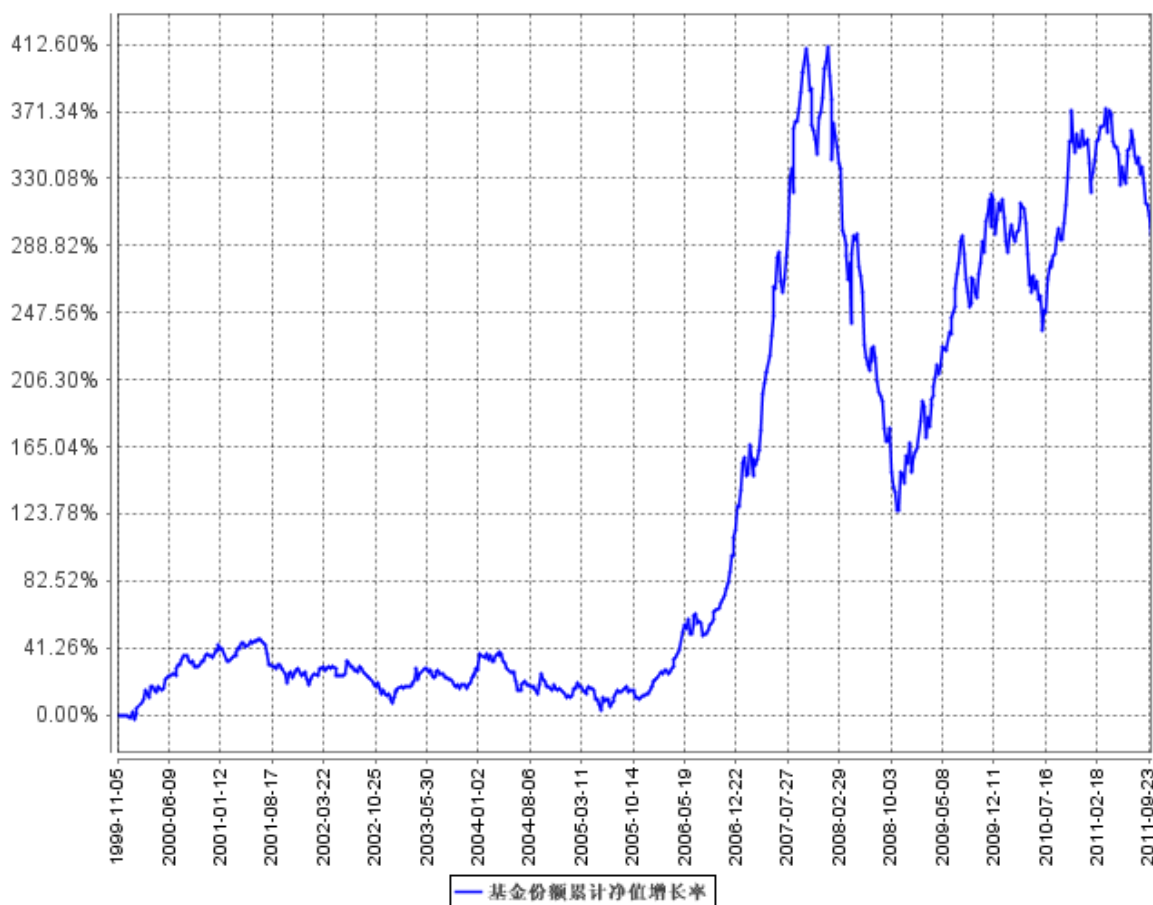
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②
过去三个月	-11.67%	1.56%

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3季度，上证综指一路下跌约15%，回头看，每次短暂的反弹都成为减仓良机。3季度内外忧困。国内通胀的严峻性持续超出市场预期，持续维持在6%高位之上。经济下滑之事态明显，工业增加值屡创新低；民间利率持续攀升，政府却受制于通胀，仍维持观望之姿态。欧债问题持续发酵，海外市场跌幅一片。唯一支持市场信心的低估值在利空持续超预期的情况下也无能为力。市场的困境还需要时间消化，并等待政策的转向。同盛期初未能认识到风险暴露后的严峻性，操作较为滞后、幅度不足，3季度的损失较大。

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1.0979元，本报告期份额净值增长率为-11.67%。

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

展望4季度，通胀将呈逐步回落之势，但其绝对水平仍然会维持在高位。欧债问题还在发酵期。加上政府换届因素，使得短期内难以形成政策转向的预期。近期房价已开始明显松动，民间也连续出现高利贷崩盘事件，这预示政府的宏观调控的效果已经逐步体现；大宗商品价格的大幅度回落、工业增加值的持续下滑，也使得未来通胀的压力将逐步释放。此时，政策反而会更加担忧过度紧缩下的经济衰退风险。目前，经济已处于较底部的位置，市场的预期则更为悲观，股市已进入寻底并等待转机的时期。同盛将优先关注估值较低、有核心竞争力、增长稳定的大盘蓝筹、周期类成长股、稳定消费股等的机会。

§ 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	2,363,175,900.51	69.80
	其中：股票	2,363,175,900.51	69.80
2	固定收益投资	814,917,443.00	24.07
	其中：债券	814,917,443.00	24.07
	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	2.36
	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	114,884,129.16	3.39
6	其他资产	12,620,513.35	0.37
7	合计	3,385,597,986.02	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	288,971,665.45	8.77
C	制造业	1,375,335,341.86	41.76
C0	食品、饮料	273,897,006.04	8.32
C1	纺织、服装、皮毛	58,163,608.46	1.77
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	280,485,679.63	8.52
C5	电子	22,485,000.00	0.68
C6	金属、非金属	123,742,008.76	3.76
C7	机械、设备、仪表	314,386,022.25	9.55
C8	医药、生物制品	302,176,016.72	9.17
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	32,771,808.00	1.00
G	信息技术业	111,417,324.88	3.38
H	批发和零售贸易	209,123,185.49	6.35
I	金融、保险业	191,402,000.00	5.81
J	房地产业	120,879,254.11	3.67
K	社会服务业	15,642,000.00	0.47

L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	17,633,320.72	0.54
	合计	2,363,175,900.51	71.75

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	14,028,923	223,200,164.93	6.78
2	600031	三一重工	8,400,000	121,044,000.00	3.68
3	601607	上海医药	7,572,306	109,949,883.12	3.34
4	600123	兰花科创	2,400,000	103,968,000.00	3.16
5	601318	中国平安	3,000,000	100,710,000.00	3.06
6	000937	冀中能源	4,000,000	94,440,000.00	2.87
7	600036	招商银行	8,200,000	90,692,000.00	2.75
8	000933	神火股份	6,319,865	90,563,665.45	2.75
9	600519	贵州茅台	450,000	85,765,500.00	2.60
10	000581	威孚高科	2,280,682	74,395,846.84	2.26

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	103,649,443.00	3.15
2	央行票据	175,241,000.00	5.32
3	金融债券	536,027,000.00	16.27
	其中:政策性金融债	536,027,000.00	16.27
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	814,917,443.00	24.74

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	148,755,000.00	4.52
2	080411	08农发11	1,000,000	99,210,000.00	3.01
3	1001100	10央票100	1,000,000	97,580,000.00	2.96
4	010112	21国债(12)	700,000	70,126,000.00	2.13
5	070228	07国开28	500,000	49,840,000.00	1.51

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。

根据河南神火煤电股份有限公司 2010 年 12 月 7 日公告的《河南神火煤电股份有限公司关于财政部驻河南省财政监察专员办事处对公司 2008 年度会计信息质量检查及公司整改情况的公告》显示，公司在会计信息质量方面存在问题，具体包括：1) 收入不实 222,182,577.84 元，2) 成本费用不实导致漏缴企业所得税，3) 涉税问题 1,616,524.98 元，4) 企业无真实交易利用银行承兑汇票违规融资。被监管部门要求进行整改，并出具了整改报告。本基金做出以下说明：

1、基于相关研究，本基金判断，随着经济的复苏，下游钢铁、化工、电力等行业的开工量逐渐加大，公司生产的无烟煤在未来会出现持续紧张的局面。并且随着公司矿井开采煤层的恢复正常、整合小矿的复产、电厂投产以及铝板块的减亏，公司的基本面改善明显且确定性大。作为煤炭和电解铝双主业的公司将具有更大的业绩弹性。结合目前的估值，及未来有可能的资源整合，公司无论从内生性还是外延式都具备投资价值。

2、对于该公司被监管部门要求整改的事件，本基金经过认真调研，做出如下判断：在接到《2008 年度会计信息质量检查情况的处理决定》后，公司相关人员已加强了新会计准则和税收政策的学习，并按《处理决定》的有关要求在 2009 年及时对账务进行了调整，及时缴纳了罚款、补缴了企业所得税、代扣的个人所得税，各项内控制度得到了全面加强和完善，符合财政部驻河南省财政监察专员办事处的要求。截至本公告披露之日，公司已经着手落实整改措施。因此，我们审慎地将神火股份在配置上作为组合的阶段性的投资品种。

3、今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外,本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	638,549.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,981,964.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,620,513.35

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>。