

同盛证券投资基金  
2012 年第 4 季度报告  
2012 年 12 月 31 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：2013 年 1 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 2013 年 1 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 2012 年 10 月 1 日起至 2012 年 12 月 31 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(2012年10月1日—2012年12月31日)
1. 本期已实现收益	-123,811,018.50
2. 本期利润	60,159,672.00
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0201
4. 期末基金资产净值	3,105,963,642.67
5. 期末基金份额净值	1.0353

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2012年12月31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

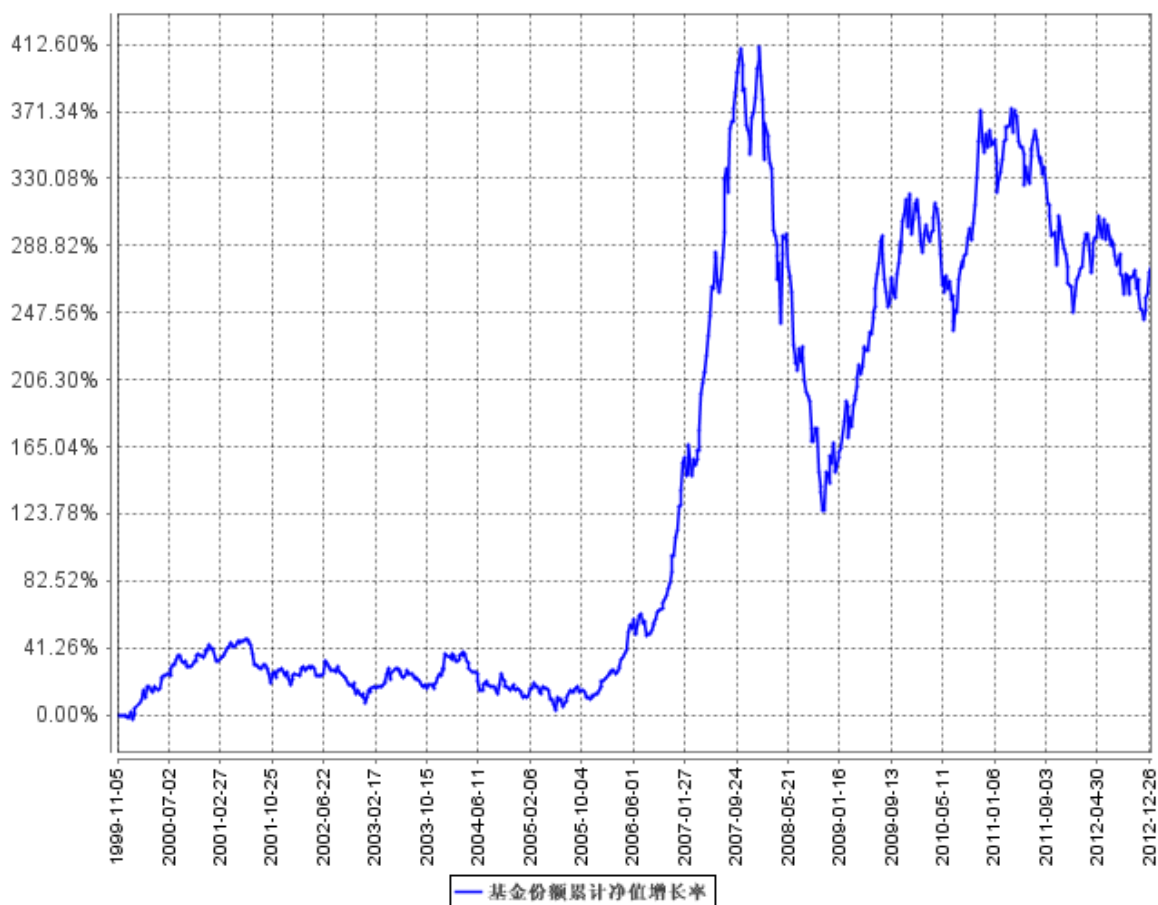
#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②
过去三个月	1.97%	2.09%

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，公司总经理助理，研究部总监。	2008年8月11日	-	11	男，1974年5月出生，中国国籍。清华大学博士。历任国泰君安证券研究所研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司，公司总经理助理，研究部总监，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

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有11次，为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4 季度，伴随着十八大的召开，政策在稳增长和结构转型之间寻求平衡，国内宏观经济出现短暂企稳。但经济长期前景受制于体制困境，中期前景受制于加杠杆能力的不足，复苏的基础仍不牢固。随着经济企稳，4 季度上市公司业绩将环比改善。虽然没有降息降准，但是央行通过逆回购和加大社会融资总量的投放力度等操作，年末流动性呈现宽松态势。外围经济中，美国经济受“财政悬崖”影响而呈现弱复苏态势，欧洲经济正滑入衰退，但短期欧债危机有所缓和。市场表现为十八大之前政策预期下的短暂反弹，之后随着十八大的闭幕开始下跌，消费和电子成为重灾区；年末收官之际，在改革红利预期、城镇化主题催化下，周期板块带领市场急转而上，A 股大幅反弹。

#### 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 1.0353 元，本报告期份额净值增长率为 1.97%。

#### 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 2013 年 1 季度，国内经济在城镇化改革和政府基建投资的带动下会呈现阶段性企稳态势，但受地方债及房地产继续调控的影响，这种短期企稳较为脆弱。未来的政策导向对经济走势是一个很大的变量，长期前景将取决于体制改革、财税改革、收入分配改革等。上市公司的盈利能力仍面临一定压力，但有望于 12Q4~13Q1 见到业绩环比低点。外围经济预计 2013 年下半年将环比改善，但力度较弱。股票市场难以出现系统性的投资机会，而一些供需关系转好的细分领域，以及具备管理、资金、品牌等优势龙头企业值得重点研究。随着 1 季报的披露，一些投资品行业的泡沫褪去，可布局食品饮料、医药、旅游等涉及民生的稳健成长类公司，并阶段性配置拉动经济核心动力的投资品行业。



## § 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	2,348,990,991.39	74.61
	其中：股票	2,348,990,991.39	74.61
2	固定收益投资	674,259,449.50	21.42
	其中：债券	674,259,449.50	21.42
	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	112,457,133.87	3.57
6	其他资产	12,752,412.55	0.41
7	合计	3,148,459,987.31	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	62,354,408.30	2.01
C	制造业	1,293,157,985.22	41.63
C0	食品、饮料	352,094,418.96	11.34
C1	纺织、服装、皮毛	47,973,249.28	1.54
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	255,398,036.96	8.22
C5	电子	2,406,024.00	0.08
C6	金属、非金属	103,545,807.45	3.33
C7	机械、设备、仪表	180,267,445.86	5.80
C8	医药、生物制品	304,291,581.91	9.80
C99	其他制造业	47,181,420.80	1.52
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	33,327,088.00	1.07
G	信息技术业	19,419,896.98	0.63
H	批发和零售贸易	112,052,639.58	3.61
I	金融、保险业	436,830,526.92	14.06
J	房地产业	349,245,533.26	11.24

K	社会服务业	6,535,068.91	0.21
L	传播与文化产业	36,067,844.22	1.16
M	综合类	-	-
	合计	2,348,990,991.39	75.63

### 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	14,375,712	224,404,864.32	7.22
2	601166	兴业银行	9,207,912	153,680,051.28	4.95
3	600519	贵州茅台	635,396	132,810,471.92	4.28
4	601318	中国平安	2,890,756	130,922,339.24	4.22
5	600383	金地集团	15,247,415	107,036,853.30	3.45
6	600266	北京城建	5,995,967	89,279,948.63	2.87
7	600276	恒瑞医药	2,888,779	86,952,247.90	2.80
8	000028	国药一致	2,149,293	75,870,042.90	2.44
9	601818	光大银行	20,107,772	61,328,704.60	1.97
10	000926	福星股份	6,476,869	61,206,412.05	1.97

### 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	33,674,449.50	1.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	640,585,000.00	20.62
	其中：政策性金融债	640,585,000.00	20.62
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	674,259,449.50	21.71

### 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	150,075,000.00	4.83
2	080411	08 农发 11	1,000,000	100,070,000.00	3.22
3	110203	11 国开 03	700,000	70,140,000.00	2.26
4	030203	03 国开 03	500,000	50,060,000.00	1.61
5	070228	07 国开 28	500,000	49,995,000.00	1.61

## 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。

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	500,000.00
2	应收证券清算款	4,280,411.45
3	应收股利	-
4	应收利息	7,972,001.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,752,412.55

### 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
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
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>。