

# 同盛证券投资基金 2013 年第 2 季度报告

2013 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：2013 年 7 月 18 日

## § 1 重要提示

基金管理人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 7 月 17 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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	长盛同盛封闭（场内简称：基金同盛）
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（2013 年 4 月 1 日 — 2013 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	119,155,932.31
2. 本期利润	-26,179,298.77
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0087
4. 期末基金资产净值	3,117,945,045.20
5. 期末基金份额净值	1.0393

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 2013 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

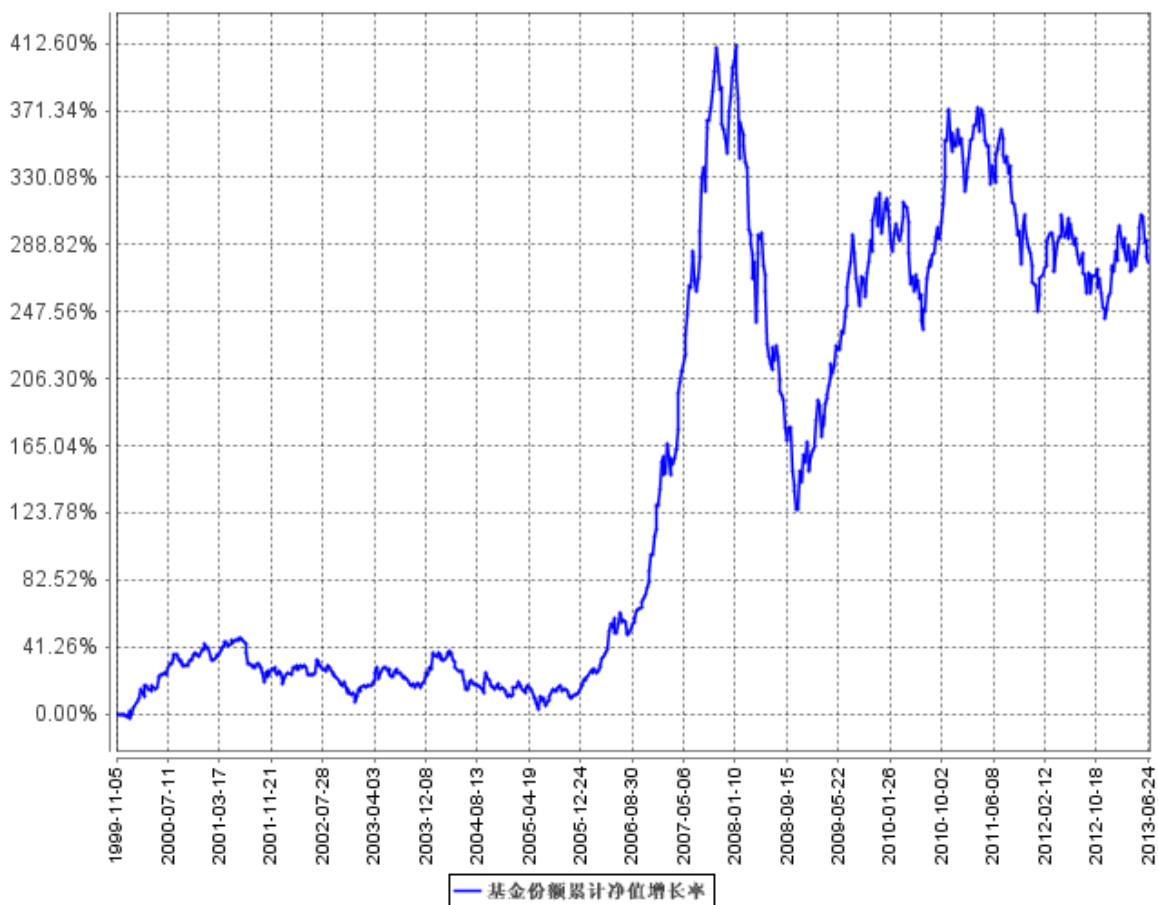
##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②
过去三个月	-0.83%	2.11%

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：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	-	12	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，现任公司总经理助理，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，未发现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。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年二季度以来，经济受房地产投资和基建投资偏弱的双重作用，外加消费和出口低迷因素，经济表现出缓慢下滑的走势。流动性方面，由于美国经济复苏、QE 退出带来的资本流出，以及央行对金融部门的主动去杠杆，二季度流动性环比一季度有所收紧。海外经济中，美国持续复苏，欧洲企稳，新型经济体国家的资本快速外流。政策上，央行对货币的态度说明管理层在试探性向转型方向。受流动性过剩和经济预期悲观的双重作用，二季度的 A 股市场表现出成长股和题材板块的极度演绎，同时周期蓝筹股的非理性下跌，创业板成长股与周期蓝筹股的估值差距极度分化。基金同盛在二季度重点加仓了传媒、TMT、环保、白酒、地产、汽车等，一定程度上分享了成长股上涨的盛宴，但由于地产、汽车、白酒等低估值行业布局过早，在调整中受到损失。二季度整体表现不佳。我们判断，三季度市场将在调整中出现成长股集中和周期蓝筹股修复的局面。

##### 4.4.2 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 1.0393 元，本报告期份额净值增长率为-0.83%。

## § 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	2,034,114,498.49	64.81
	其中：股票	2,034,114,498.49	64.81
2	固定收益投资	687,449,300.00	21.90
	其中：债券	687,449,300.00	21.90
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	149,000,193.50	4.75
	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	255,505,609.62	8.14
6	其他资产	12,270,946.67	0.39
7	合计	3,138,340,548.28	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	采矿业	13,200,000.00	0.42
C	制造业	1,363,122,142.14	43.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,828,077.28	1.25
E	建筑业	116,171,346.57	3.73
F	批发和零售业	34,060,598.20	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,467,946.19	3.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	163,358,054.07	5.24
L	租赁和商务服务业	64,274,515.80	2.06
M	科学研究和技术服务业	27,748,557.00	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	62,637,916.80	2.01
S	综合	48,245,344.44	1.55



合计	2,034,114,498.49	65.24
----	------------------	-------

### 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	万华化学	11,099,973	177,821,567.46	5.70
2	002038	双鹭药业	2,120,331	124,251,396.60	3.99
3	600519	贵州茅台	407,800	78,448,486.00	2.52
4	000581	威孚高科	2,103,856	70,247,751.84	2.25
5	600276	恒瑞医药	2,640,000	69,590,400.00	2.23
6	000895	双汇发展	1,725,200	66,316,688.00	2.13
7	002508	老板电器	2,025,469	66,070,798.78	2.12
8	000661	长春高新	666,496	65,256,623.36	2.09
9	002570	贝因美	2,314,757	64,697,458.15	2.08
10	000002	万科A	6,499,963	64,024,635.55	2.05

### 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	28,671,300.00	0.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	658,778,000.00	21.13
	其中：政策性金融债	658,778,000.00	21.13
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	687,449,300.00	22.05

### 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	149,895,000.00	4.81
2	120318	12 进出 18	1,400,000	139,384,000.00	4.47
3	120245	12 国开 45	1,000,000	99,470,000.00	3.19
4	110203	11 国开 03	700,000	69,762,000.00	2.24
5	090411	09 农发 11	600,000	60,510,000.00	1.94

### 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金报告期内未进行股指期货投资，报告期末无股指期货持仓。

### 5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金基金合同中未约定本基金投资股指期货的投资政策。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1

根据贵州茅台酒股份有限公司 2013 年 2 月 23 日的公告显示，公司于 2013 年 2 月 22 日收到贵州物价局《行政处罚决定书》，该决定书认为：贵州茅台酒销售有限公司对全国经销商向第三人销售茅台酒的最低价格进行限定，违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定。为此，根据《中华人民共和国反垄断法》第四十六条、《中华人民共和国行政处罚法》第二十七条的规定给予处罚，限贵州茅台酒销售有限公司自收到该决定书之日起十五日内将罚款二亿四千七百万元人民币上交国库。对此，本基金做出如下说明：

1、对于白酒行业及贵州茅台，本公司研究员自 2012 年三季度以来一直给予风险提示，建议中短期（1 年-2 年）回避行业周期风险和政策风险，并有相关的研究报告。但基于更长期（2 年以上），我们认为白酒板块和贵州茅台仍有投资价值。

2、基于相关研究，本基金判断，尽管在短期我国白酒行业面临较多风险因素，但随着我国国民收入的提高、城镇化的快速推进，从更长期来看（2 年以上）白酒行业仍将继续维持快速增长，作为国内白酒行业的龙头公司，高端白酒中的代表性企业之一，贵州茅台公司的长期投资价值会得到提升，对于该公司被物价部门处罚的事件，本基金经过认真研究，做出如下判断：公司对前期的违法违规行为进行了深刻反思，并完全接受物价部门的处罚，并表示在未来的经营中，严格守法经营，保持稳健发展。因此，我们审慎地将贵州茅台在配置上作为组合的长期性重要投资品种。

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法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。

**5.9.2** 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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	740,324.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,215,916.40
4	应收利息	10,314,706.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,270,946.67

### 5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 5.9.6 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。

## § 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>。

长盛基金管理有限公司  
2013 年 7 月 18 日