

同益证券投资基金

2012 年半年度报告

2012 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：2012 年 8 月 25 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 2012 年 8 月 24 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 2012 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
4.5 管理人对宏观经济、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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17

6.3 所有者权益(基金净值)变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	18
§ 7 投资组合报告 .....	33
7.1 期末基金资产组合情况 .....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	33
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 .	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	36
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 .....	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 投资明细 .....	37
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 .....	37
7.9 投资组合报告附注 .....	37
§ 8 基金份额持有人信息 .....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	39
§ 9 重大事件揭示 .....	40
9.1 基金份额持有人大会决议 .....	40
9.2 基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动 .....	40
9.3 涉及基金管理人，基金财产，基金托管业务的诉讼 .....	40
9.4 基金投资策略的改变 .....	40
9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	40
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 .....	40
9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	41
9.8 其他重大事件 .....	42
§ 10 备查文件目录 .....	43
10.1 备查文件目录 .....	43

10.2 存放地点 .....	43
10.3 查阅方式 .....	43

## § 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

基金资产	本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保
投资目标	的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
市场环境以	始终如一地奉行“价值投资”的基本原则，并在不同的市
的投资原	及市场发展变化的不同阶段，灵活运用适合自身运作特点
投资策略	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
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		
姓名	叶金松	赵会军
信息披露		
联系电话	010-82019988	010-66105799
负责人		
电子邮箱		yejs@csfunds.com.cn
custody@icbc.com.cn		
	400-888-2666	

客户服务电话	010-62350088	95588
传真	010-82255988	010-66105798
兴门内大街 55 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 北京市海淀区北太平庄路 18 号	北京市西城区复 号 北京市西城区复
兴门内大街 55 办公地址	城建大厦 A 座 20-22 层	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

券  
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 <http://www.csfunds.com.cn>  
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
1093 号 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 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（2012年1月1日-2012年6月30日）

本期已实现收益 -  
120,388,340.00

本期 期 利 润  
62,476,263.82

加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润  
0.0312

本 期 加 权 平 均 净 值 利 润 率  
3.48%

本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率  
3.64%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末（2012年6月30日）

期末可供分配利润 -  
222,710,590.24

期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利 润  
-0.1114

期 末 基 金 资 产 净 值  
1,777,289,409.76

期 末 基 金 份 额 净 值  
0.8886

3.1.3 累计期末指标 报告期末（2012年6月30日）

基 金 份 额 累 计 净 值 增 长 率  
468.95%

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

净值增

长率

阶段

净值增长率①

	标准
差②	
过去一个月 1.83%	-2.91%
过去三个月 1.67%	2.23%
过去六个月 2.06%	3.64%
过去一年 2.11%	-15.10%
过去三年 2.24%	-8.67%
自基金合同生效起至今 2.64%	468.95%

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

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%；新加坡星展银行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2012年6月30日，基金管理人共管理两支封闭式基金、十八支开放式基金，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

##### 任本基金的基金经理

姓名	职务	（助理）期限	证券从业 年限	说明
		任职日期 离任日期		
王克玉	本基金经理，长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理，高基金助理，现任同益证券业股票型证券投资基金经理。	2010年7月13日 -	9年	男，1979年12月出生，中国国籍。上海交通大学硕士。历任元大京华证券研究员，天相投资分析师，国都证券分析师。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。现任同益证券投资基

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合规守信情况的说明

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

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 14 次，其中 1 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，其余 13 次交易为长盛同庆基金转型期间和其他组合发生的反向交易。具体原因如下：

长盛同庆于 2012 年 5 月 11 日结束三年封闭期，转型为开放式证券投资基金（以下简称“开放式基金”）。为确保转型后的开放式基金保持充裕流动性，以

保障基金份额持有人利益，该基金制定了数量化组合投资交易策略，并报经公司投资决策委员会批准，打开交易所公开竞价同日反向交易控制，因此而产生 13 笔交易所公开竞价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 5% 的交易。

在此期间内，长盛同庆严格执行既定数量化组合投资交易策略，批量下达投资指令。公司交易部对上述指令进行严格审核，在指令分发后，通过恒生交易系统自动委托交易程序执行指令，以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平，杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 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

2012 年上半年 A 股市场呈现宽幅震荡的行情。尽管上半年上证指数和沪深 300 指数的涨幅分别只有 1.18% 和 4.94%，但是在 3 月中旬和 5 月上旬市场高点时，上证指数的涨幅达到 11.6%。上半年整体看，房地产、食品饮料、有色金属、医药、家电等行业表现领先，特别是房地产、食品饮料在 2 季度延续了前期的强劲走势，1 季度表现优异的券商、家电在 6 月份之后出现明显的下跌。

本基金的表现 2 季度要弱于 1 季度。在 1 季度对组合进行了积极的调整，适当调整了组合的分散度，增持了券商、电力等基本面出现拐点的行业，减持了建材、房地产等强周期行业，在 1-2 月份组合表现尚可，但是由于组合仍然具有很高的波动性，导致在 3 月下旬的下跌中资产净值出现比较快速的下跌。在 2 季度对组合进行适当的行业集中，增持了家电、电力、食品饮料等行业，减持了采掘、房地产等行业，从结果上看，在 2 季度减持房地产对组合造成了很大的负面影响。而由于组合中对食品饮料、医药等行业的配置要低于同业平均水平，导致 2 季度的业绩出现明显的下滑。

##### 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 0.8886 元，本报告期份额净值增长率为 3.64%。

#### 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

综合考虑经济发展的状况和社会运行的态势，2012 年仍处于明显的过渡阶段，出口和房地产为主的基建投资作为过去拉动中国经济增长的主要驱动力的影响将逐渐减弱，调整和转型成为社会发展的必然选择。

随着 5 月到 6 月各项经济数据的公布，经济增速的下滑已经从预期转为现实，这里既有中国经济过去高速增长过程中积累的长期矛盾，也有外部需求不足和政策不明确带来的短期影响。从我们投资者的角度看，要适当降低对经济增速的预期，通过更加细致的研究分析企业模式和经营能力的差异。

#### 4.5.2 本基金下阶段投资策略

随着经济基本面和政策预期不确定性的消除，预计下半年市场会表现出一定的机会，而 3 季度会对上市公司中期业绩做集中的反应。然而考虑到经济结构调整和改善的长期性，行业和企业之间的差异将会体现的更加明显，在这种情况下，我们会重点关注基本面发生重大变化的行业，通过相对集中的行业配置来获取一定的收益。同时经过过去持续的下跌，我们看到部分有竞争力的成长型企业的估值已经处于合理的范围内，我们也会有针对性的增加对成长型企业的投资。

#### 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总经理（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、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，本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至 2012 年 6 月 30 日，期末可供分配收益为-222,710,590.24 元，其中：未分配收益已实现部分为-159,337,556.93 元，未分配收益未实现部分为-63,373,033.31 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

2012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

2012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。

### 5.3 托管人对本半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2012年上半年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：2012年6月30日

单位：人民币元

上年度末	资 产	附注号	本 期 末
2011 年 12 月 31 日			2012 年 6 月 30 日
资 产：			
银行存款		6. 4. 7. 1	40,602,275.21
45,698,358.10			
结算备付金			7,748,721.55
3,206,599.49			
存出保证金			750,000.00
782,136.99			
交易性金融资产		6. 4. 7. 2	1,706,961,106.46
1,679,036,298.09			
其中：股票投资			1,260,597,370.76
1,244,036,667.79			
基金投资			--
-			
债券投资			446,363,735.70
434,999,630.30			
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	40,000,000.00
-			
应收证券清算款			213,338.77
-			
应收利息		6. 4. 7. 5	6,051,161.40
5,335,937.81			
应收股利			22,500.00
-			
应收申购款			-
-			
递延所得税资产			-
-			
其他资产		6. 4. 7. 6	-
-			

资产总计					1,802,349,103.39
1,734,059,330.48					
			本	期	末
上年度末					
负债和所有者权益	附注号				
			2012	年	6月30日
2011年12月31日					
负 债：					
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					19,483,745.90
13,612,316.71					
应付赎回款					-
-					
应付管理人报酬					2,224,947.69
2,217,460.84					
应付托管费					370,824.65
369,576.79					
应付销售服务费					-
-					
应付交易费用	6.4.7.7				1,203,139.13
1,116,130.52					
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		961,336.58
1,115,000.00			
负债合计			25,059,693.63
19,246,184.54			
所有者权益：			
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	-222,710,590.24	-
285,186,854.06			
所有者权益合计			1,777,289,409.76
1,714,813,145.94			
负债和所有者权益总计			1,802,349,103.39
1,734,059,330.48			

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8886 元，基金份额总额 2,000,000,000 份。

## 6.2 利润表

会计主体：同益证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

上年度可比期间	项 目	附注号	本 期
2011年1月1日			2012年1月1日
2011年6月30日			至 2012年6月30日 至
一、收入			82,414,552.75
-127,883,853.74			
1. 利息收入			9,164,906.33
10,679,138.72			
其中：存款利息收入	6.4.7.11		357,828.65
650,131.86			
债券利息收入			7,812,724.67
9,203,332.47			
资产支持证券利息收入			-
-			
买入返售金融资产收入			994,353.01
825,674.39			
其他利息收入			-
-			
2. 投资收益（损失以“-”填列）			-109,633,060.09
110,549,998.71			
其中：股票投资收益	6.4.7.12		-123,155,216.37
105,464,120.47			
基金投资收益			-
-			
债券投资收益	6.4.7.13		1,764,526.06
-2,653,618.28			
资产支持证券投资收益			-
-			
衍生工具收益	6.4.7.14		-
-			
股利收益	6.4.7.15		11,757,630.22
7,739,496.52			
3. 公允价值变动收益（损失以			
“-”号填列）	6.4.7.16		182,864,603.82
-249,112,991.17			
4. 汇兑收益（损失以“-”号填			

-		-
列)		
5. 其他收入 (损失以“-”号填		
	6. 4. 7. 17	18, 102. 69
-		
列)		
减: 二、费用		19, 938, 288. 93
26, 050, 922. 49		
1. 管理人报酬		13, 345, 479. 92
16, 857, 762. 45		
2. 托管费		2, 224, 246. 68
2, 809, 627. 08		
3. 销售服务费		-
-		
4. 交易费用	6. 4. 7. 18	4, 146, 433. 64
5, 514, 205. 51		
5. 利息支出		-
-		
其中: 卖出回购金融资产支出		-
-		
6. 其他费用	6. 4. 7. 19	222, 128. 69
869, 327. 45		
三、利润总额 (亏损总额以“-”		
		62, 476, 263. 82
-153, 934, 776. 23		
号填列)		
减: 所得税费用		-
-		
四、净利润 (净亏损以“-”号		
		62, 476, 263. 82
-153, 934, 776. 23		
填列)		

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：2012年1月1日至2012年6月30日

单

位：人民币元

项 目	本期		所
	2012年1月1日至2012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	-285,186,854.06	
1,714,813,145.94			
二、本期经营活动产生的基金净			
值变动数（本期利润）	-	62,476,263.82	
62,476,263.82			
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	-	-	
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值			
减少以“-”号填列）	-	-	
五、期末所有者权益（基金净			
值）	2,000,000,000.00	-222,710,590.24	
1,777,289,409.76			

项 目	上年度可比期间		所
	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）	-	-	



-			
号填列)			
其中：1. 基金申购款	-		-
-			
2. 基金赎回款		-	-
-			
四、本期向基金份额持有人分配 利润产生的基金净值变动（净值 220,000,000.00 减少以“-”号填列)	-	-220,000,000.00	-
五、期末所有者权益（基金净 值）	2,000,000,000.00		93,391,848.98
2,093,391,848.98			

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		
_____	_____	_____
_____		
基金管理公司负责人	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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 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  
本基金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:本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明:本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明：本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 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；

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。

##### 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、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 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		本期末	
		2012年6月30	
项目	日期	存款	款
活期		40,602,275.21	
定期			
-			
其他			
-			
	合		计
		40,602,275.21	

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

		单	
位：人民币元		本期末	
		2012年6月30日	
项目	成本	公允价值	公
允价值变动			
股票	1,326,203,753.33	1,260,597,370.76	-
65,606,382.57			
交易所市场	20,407,516.44	21,062,835.70	
655,319.26			
债券 银行间市场	423,722,870.00	425,300,900.00	
1,578,030.00			
合计	444,130,386.44	446,363,735.70	
2,233,349.26			
资产支持证券	-	-	-
-			
基金	-	-	-
-			
其他	-	-	-
-			
合计	1,770,334,139.77	1,706,961,106.46	-

63,373,033.31

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	
	2012年6月30日	其中：买断式逆
回购		
交易所买入返售证券		40,000,000.00
-		
银行间买入返售证券		-
-		
合计		40,000,000.00
-		

6.4.7.5 应收利息

单位:

人民币元

项目		本期末					
		2012年6月30日					
应	收	活	期	存	款	利	息
9,626.25							
应	收	定	期	存	款	利	息
-							
应	收	其	他	存	款	利	息
-							
应	收	结	算	备	付	金	利
3,138.30							
应	收	债		券		利	息
6,017,809.33							
应	收	买	入	返	售	证	券
20,587.52							
应	收	申	购	款		利	息
-							
其							他
-							
		合					计
6,051,161.40							

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								
		2012年6月30日								
交	易	所	市	场	应	付	交	易	费	用
1,202,589.13										
银	行	间	市	场	应	付	交	易	费	用
550.00										
		合								计
1,203,139.13										

6.4.7.8 其他负债

单位:

人民币元

项目		本期末								
		2012年6月30日								
应	付	券	商	交	易	单	元	保	证	金

750,000.00						
预	提		审		计	费
47,239.92						
预	提	信	息	披	露	费
134,261.40						
预	提		上	市	年	费
29,835.26						
		合				计
961,336.58						
6.4.7.9 实收基金						

金额单位:

人民币元

项目	本期	
	2012年1月1日至2012年6月30日 基金份额(份)	账面金额
上年度末		2,000,000,000
2,000,000,000.00		
本期申购		-
-		
本期赎回(以“-”号填列)		-
-		
本期末		2,000,000,000
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	-38,949,216.93	-246,237,637.13	-
285,186,854.06			

本期利润	-120,388,340.00	182,864,603.82
62,476,263.82		
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	-	-
-		
本期末	-159,337,556.93	-63,373,033.31
222,710,590.24		
6.4.7.11 存款利息收入		

单位：

人民币元

项目	本期	
	2012年1月1日至2012年	
6月30日		
活期存款利息收入		
315,318.36		
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		
42,234.74		
权证保证金利息收入		
275.55		
合计		
357,828.65		
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	
	2012年1月1日至2012年6	
月30日		
卖出股票成交总额		
1,368,996,567.17		
减：卖出股票成本总额		
1,492,151,783.54		



买卖股票差价收入

-

123,155,216.37

6.4.7.13 债券投资收益

单位:

人民币元

本期

项目

2012年1月1日至2012年6

月30日

卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额  
291,127,705.13

减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本

286,385,362.30

总额

减:应 收 利 息 总 额

2,977,816.77

债 券 投 资 收 益

1,764,526.06

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期未取得衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位:

人民币元

本期

项目

2012年1月1日至2012年

6月30日

股 票 投 资 产 生 的 股 利 收 益

11,757,630.22

基 金 投 资 产 生 的 股 利 收 益

-

合

计

11,757,630.22

6.4.7.16 公允价值变动收益

单

位：人民币元

本期

项目名称		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
1.	交易性金融资产	182,864,603.82	
—	— 股票投资	180,452,061.81	
—	— 债券投资	2,412,542.01	
—	— 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	182,864,603.82	
	6.4.7.17 其他收入		

单

位：人民币元

本期

项目		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
—	基金赎回费用收入	—	
—	— 转换费收入	—	
—	— 印花税手续费返还	18,102.69	
—	— 其他	—	
	合计	18,102.69	
	6.4.7.18 交易费用		

单

位：人民币元

		本期	
项目		2012年1月1日至2012年	
6月30日			
交易所	市场交易费用		
4,145,058.64			
银行	间市场交易费用		
1,375.00			
	合计		
4,146,433.64			
6.4.7.19	其他费用		

单

位：人民币元

		本期	
项目		2012年1月1日至2012	
年6月30日			
银行	行费用		
1,792.11			
审计	计费用		
47,239.92			
信息	息披露费用		
134,261.40			
账	户维护费用		
9,000.00			
上市	市年费用		
29,835.26			
	合计		
222,128.69			

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

本基金无须作披露的重大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
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	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
股票	占当期股票	占当期
	成交金额	成交金额
	成交总额的比例	成交总额
的比例		
国元证券	-	672,436,187.71
18.93%		

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	上年度可比期间
	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011年6月30日
债券	占当期债券	占当期
	成交金额	成交金额
	成交总额的比例	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

本期 上年度可比期间

2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日      2011 年 1 月 1 日至 2011  
 年 6 月 30 日  
 关联方名称

回购	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期成交总额的比例
国元证券	-	-	-	220,000,000.00

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		占期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	占当期佣金总量	
未应付佣金	当期佣金	期末应付佣金余额	占期
额的比例	的比例		总

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

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

	本期	上
年度可比期间		
项目	2012年1月1日	
2011年1月1日		
	至2012年6月30日	至
2011年6月30日		
当期发生的基金应支付的管理费	13,345,479.92	
16,857,762.45		
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

	本期	上
年度可比期间		
项目	2012年1月1日	

2011 年 1 月 1 日

至 2012 年 6 月 30 日

至

2011 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的托管费  
2,809,627.08

2,224,246.68

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2012年1月1日至 2012年6月30日	上 年度可比期间 2011年1月1日至 2011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	20,000,000
期初持有的基金份额		28,000,079
期间申购/买入总份额		-
期间因拆分变动的份额		-
减：期间赎回/卖出总份额		-
期末持有的基金份额		28,000,079
期末持有的基金份额占基金总份额比例		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 2012年6月30日	上年 度末 2011年 12月31日
持有的基金份额	持有的基金份额	持有的基金份额
占基金总份额的比例	占基金总份额的比例	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	0.30%	6,000,000
基金发起人-北方国 际信托投资股份有 限公司	4,000,000	0.20%	4,000,000
基金发起人-中信证 券股份有限公司	6,000,000	0.30%	6,000,000
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	0.20%	4,000,000

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

	本期	上年度可比
期间		
关联方名称	2012年1月1日至2012年6月30日	2011年1月1日至2011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	40,602,275.21	315,318.36		49,127,431.53
				615,199.99

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

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2012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

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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经理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，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。

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.4 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、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 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、存出权证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

5年	本	期			末
		1 个月以内 不计息	1-3 个月 合计	3 个月-1 年	
年	年	6	月	30	日
以上 资产					
银行存款		40,602,275.21		-	-
-	-	-	40,602,275.21		
结算备付金		7,748,721.55		-	-
-	-	-	7,748,721.55		
存出保证金			-	-	-
-	-	750,000.00	750,000.00		
交易性金融资产		80,392,000.00		52,740,900.00	110,527,000.00
202,703,835.70		- 1,260,597,370.76	1,706,961,106.46		
买入返售金融资产		40,000,000.00		-	-
-	-	-	40,000,000.00		
应收证券清算款			-	-	-
-	-	213,338.77	213,338.77		
应收利息			-	-	-
-	-	6,051,161.40	6,051,161.40		
应收股利			-	-	-
-	-	22,500.00	22,500.00		
资产总计			168,742,996.76	52,740,900.00	110,527,000.00
202,703,835.70		- 1,267,634,370.93	1,802,349,103.39		
负债					
应付证券清算款			-	-	-
-	-	19,483,745.90	19,483,745.90		
应付管理人报酬			-	-	-
-	-	2,224,947.69	2,224,947.69		
应付托管费			-	-	-
-	-	370,824.65	370,824.65		
应付交易费用			-	-	-
-	-	1,203,139.13	1,203,139.13		
应交税费			-	-	-
-	-	815,699.68	815,699.68		
其他负债			-	-	-
-	-	961,336.58	961,336.58		
负债总计			-	-	-
-	-	25,059,693.63	25,059,693.63		
利率敏感度缺口			168,742,996.76	52,740,900.00	110,527,000.00

202, 703, 835. 70	- 1, 242, 574, 677. 30	1, 777, 289, 409. 76		
上	年	度		末
5 年				
2011 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	
1-5 年 以上	不计息	合计		
资产				
银行存款	45, 698, 358. 10	-	-	
- -	- 45, 698, 358. 10			
结算备付金	3, 206, 599. 49	-	-	
- -	- 3, 206, 599. 49			
存出保证金	98, 780. 49	-	-	
- -	683, 356. 50	782, 136. 99		
交易性金融资产	129, 356, 000. 00	144, 000, 715. 40	161, 540, 503. 00	
102, 411. 90	- 1, 244, 036, 667. 79	1, 679, 036, 298. 09		
应收利息	-	-	-	
- -	5, 335, 937. 81	5, 335, 937. 81		
资产总计	178, 359, 738. 08	144, 000, 715. 40	161, 540, 503. 00	
102, 411. 90	- 1, 250, 055, 962. 10	1, 734, 059, 330. 48		
负债				
应付证券清算款	-	-	-	
- -	13, 612, 316. 71	13, 612, 316. 71		
应付管理人报酬	-	-	-	
- -	2, 217, 460. 84	2, 217, 460. 84		
应付托管费	-	-	-	
- -	369, 576. 79	369, 576. 79		
应付交易费用	-	-	-	
- -	1, 116, 130. 52	1, 116, 130. 52		
应交税费	-	-	-	
- -	815, 699. 68	815, 699. 68		
其他负债	-	-	-	
- -	1, 115, 000. 00	1, 115, 000. 00		
负债总计	-	-	-	
- -	19, 246, 184. 54	19, 246, 184. 54		
利率敏感度缺口	178, 359, 738. 08	144, 000, 715. 40	161, 540, 503. 00	
102, 411. 90	- 1, 230, 809, 777. 56	1, 714, 813, 145. 94		

#### 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。
- 对资产负债表日基金资产净值的  
影响金额（单位：人民币元）

末 分析 月 31 日	相关风险变量的变动	本期末	上年度
		2012 年 6 月 30 日	2011 年 12 月 31 日
	+0.25%	-1,714,304.27	-
1,057,375.35			
	-0.25%		1,714,304.27
1,057,375.35			

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，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，所面临的最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 2012 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

项目	金 额 单 位：人民币元	
	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
金 资产净	占基金资产净	占基
	公允价值	公允价值
例 (%)	值比例 (%)	值比
交易性金融资产-股票投资	1,260,597,370.76	70.93 1,244,036,667.79
72.55		
交易性金融资产-债券投资	446,363,735.70	25.11 434,999,630.30
25.37		

合计	1,706,961,106.46	96.04	1,679,036,298.09
----	------------------	-------	------------------

97.91

#### 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。

对资产负债表日基金资产净值的  
影响金额（单位：人民币元）

分析	相关风险变量的变动	本期末	上年度末
		2012 年 6 月 30 日	2011 年 12 月
31 日			
	+5%		74,447,987.44
60,895,917.73			
	-5%	-74,447,987.44	-
60,895,917.73			

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

净值比例	项目	金额	占基金总资产
代码	行业类别	公允价值	(%)
人民币元			
1	权益投资	1,260,597,370.76	69.94
	其中：股票	1,260,597,370.76	69.94
2	固定收益投资	446,363,735.70	24.77
	其中：债券	446,363,735.70	24.77
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	40,000,000.00	2.22
	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	48,350,996.76	2.68
6	其他各项资产	7,037,000.17	0.39
7	合计	1,802,349,103.39	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

净值比例	行业类别	公允价值	占基金资产
代码	行业类别	公允价值	(%)
人民币元			
A	农、林、牧、渔业	28,832,347.44	1.62
B	采掘业	33,909,052.80	1.91
C	制造业	589,357,895.20	32.71

33.16		
C0	食品、饮料	92,799,776.41
5.22		
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	46,660,988.85
2.63		
C5	电子	33,701,207.55
1.90		
C6	金属、非金属	34,356,414.35
1.93		
C7	机械、设备、仪表	330,703,629.47
18.61		
C8	医药、生物制品	51,135,878.57
2.88		
C99	其他制造业	-
-		
D	电力、煤气及水的生产和供应业	55,184,869.80
3.11		
E	建筑业	-
-		
F	交通运输、仓储业	38,218,407.50
2.15		
G	信息技术业	148,294,676.39
8.34		
H	批发和零售贸易	72,442,382.20
4.08		
I	金融、保险业	239,845,374.68
13.50		
J	房地产业	32,358,400.00
1.82		
K	社会服务业	22,153,964.75
1.25		
L	传播与文化产业	-
-		
M	综合类	-
-		

合计

1,260,597,370.76

70.93

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

占基金资

产净值比例

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	
(%)					
1	601601	中国太保	3,699,735	82,060,122.30	4.62
2	600582	天地科技	3,999,594	57,794,133.30	3.25
3	000063	中兴通讯	3,900,000	54,444,000.00	3.06
4	600690	青岛海尔	3,999,000	46,868,280.00	2.64
5	601788	光大证券	3,099,892	40,825,577.64	2.30
6	601688	华泰证券	3,703,719	38,889,049.50	2.19
7	000651	格力电器	1,847,366	38,517,581.10	2.17
8	600600	青岛啤酒	1,007,174	38,463,975.06	2.16
9	601628	中国人寿	2,091,622	38,276,682.60	2.15
10	600009	上海机场	2,999,875	38,218,407.50	2.15
11	000527	美的电器	3,381,077	37,360,900.85	2.10
12	000729	燕京啤酒	4,799,026	35,032,889.80	1.97
13	000860	顺鑫农业	1,799,772	28,832,347.44	1.62
14	600309	烟台万华	2,000,000	26,700,000.00	1.50
15	600886	国投电力	5,999,970	26,039,869.80	1.47
16	600795	国电电力	9,600,000	25,920,000.00	1.46
17	000418	小天鹅A	2,909,400	24,700,806.00	1.39

18	600271	航天信息	1,299,749	24,578,253.59
1.38				
19	600739	辽宁成大	1,520,796	23,724,417.60
1.33				
20	002400	省广股份	1,156,865	22,153,964.75
1.25				
21	002368	太极股份	1,300,000	21,853,000.00
1.23				
22	000783	长江证券	2,399,918	21,839,253.80
1.23				
23	600858	银座股份	1,699,660	20,021,994.80
1.13				
24	600486	扬农化工	1,099,779	19,960,988.85
1.12				
25	000960	锡业股份	999,970	19,699,409.00
1.11				
26	000848	承德露露	1,099,881	19,302,911.55
1.09				
27	601989	中国重工	3,600,000	18,684,000.00
1.05				
28	000963	华东医药	599,999	18,119,969.80
1.02				
29	601166	兴业银行	1,383,258	17,954,688.84
1.01				
30	600718	东软集团	2,000,000	17,220,000.00
0.97				
31	002465	海格通信	729,178	16,479,422.80
0.93				
32	000581	威孚高科	600,000	16,440,000.00
0.93				
33	600893	航空动力	1,199,722	15,608,383.22
0.88				
34	600563	法拉电子	981,739	14,981,337.14
0.84				
35	600557	康缘药业	999,916	14,778,758.48
0.83				
36	600720	祁连山	1,399,905	14,657,005.35
0.82				
37	002484	江海股份	1,300,000	14,157,000.00
0.80				
38	600267	海正药业	799,770	13,979,979.60
0.79				
39	600570	恒生电子	1,000,000	13,720,000.00
0.77				

40 0.76	600089	特变电工	1,999,962	13,539,742.74
41 0.76	000983	西山煤电	862,888	13,461,052.80

42	000402	金融街	2,000,000	13,060,000.00
0.73				
43	600161	天坛生物	899,691	12,838,590.57
0.72				
44	601898	中煤能源	1,600,000	12,384,000.00
0.70				
45	600765	中航重机	1,600,000	12,336,000.00
0.69				
46	601238	广汽集团	1,599,999	12,319,992.30
0.69				
47	600048	保利地产	960,000	10,886,400.00
0.61				
48	002335	科华恒盛	1,027,512	10,686,124.80
0.60				
49	002419	天虹商场	800,000	10,576,000.00
0.60				
50	600062	华润双鹤	499,924	9,538,549.92
0.54				
51	601369	陕鼓动力	999,966	9,259,685.16
0.52				
52	600395	盘江股份	300,000	8,064,000.00
0.45				
53	002028	思源电气	700,000	7,763,000.00
0.44				
54	600169	太原重工	1,500,000	5,265,000.00
0.30				
55	002138	顺络电子	399,901	4,562,870.41
0.26				
56	002285	世联地产	300,000	4,440,000.00
0.25				
57	600376	首开股份	300,000	3,972,000.00
0.22				
58	601633	长城汽车	200,000	3,560,000.00
0.20				
59	600011	华能国际	500,000	3,225,000.00
0.18				

#### 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比例 (%)
1	601601	中国太保		87,650,606.70

5.11

2	000729	燕京啤酒	46,671,192.85
2.72			
3	601688	华泰证券	46,536,716.40
2.71			
4	000527	美的电器	44,639,168.74
2.60			
5	000651	格力电器	40,377,591.08
2.35			
6	601788	光大证券	39,253,570.54
2.29			
7	600600	青岛啤酒	38,310,796.13
2.23			
8	601628	中国人寿	37,072,872.56
2.16			
9	000418	小天鹅 A	36,079,952.44
2.10			
10	601169	北京银行	33,422,934.50
1.95			
11	000783	长江证券	31,762,754.41
1.85			
12	000860	顺鑫农业	29,696,379.97
1.73			
13	600395	盘江股份	28,924,864.13
1.69			
14	000960	锡业股份	27,927,159.89
1.63			
15	600739	辽宁成大	26,985,323.93
1.57			
16	002419	天虹商场	26,556,336.98
1.55			
17	002400	省广股份	25,787,043.75
1.50			
18	600271	航天信息	25,691,720.82
1.50			
19	002368	太极股份	25,690,470.87
1.50			
20	000983	西山煤电	25,216,470.71
1.47			



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比例(%)
1	600720	祁连山		63,793,312.83
3.72				
2	600123	兰花科创		55,071,044.84
3.21				
3	601601	中国太保		53,854,019.34
3.14				
4	601166	兴业银行		52,486,618.15
3.06				
5	600266	北京城建		50,845,528.53
2.97				
6	600582	天地科技		46,242,131.36
2.70				
7	601898	中煤能源		39,496,411.91
2.30				
8	601169	北京银行		34,705,807.75
2.02				
9	600009	上海机场		31,380,396.69
1.83				
10	600309	烟台万华		30,260,649.71
1.76				
11	600015	华夏银行		29,961,390.67
1.75				
12	600376	首开股份		28,714,462.27
1.67				
13	600395	盘江股份		27,127,337.41
1.58				
14	000063	中兴通讯		26,458,906.45
1.54				
15	000987	广州友谊		26,237,124.45
1.53				
16	600823	世茂股份		25,926,482.80
1.51				
17	000709	河北钢铁		24,231,457.94
1.41				
18	600881	亚泰集团		23,452,078.50
1.37				
19	600486	扬农化工		22,697,216.91
1.32				
20	600690	青岛海尔		22,466,997.05

1.31

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	
1,328,260,424.70	
卖 出 股 票 收 入 ( 成 交 ) 总 额	
1,368,996,567.17	

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		-
2	央行票据		-
3	金融债券		425,300,900.00
	其中: 政策性金融债		425,300,900.00
4	企业债券		103,835.70
5	企业短期融资券		-
6	中期票据		-
7	可转债		20,959,000.00

8	其他	-
9	合计	446,363,735.70

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

占基金资产净值比

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值
1	110224	11 国开 24	1,000,000	101,120,000.00
2	110257	11 国开 57	500,000	51,030,000.00
3	030224	03 国开 24	500,000	50,680,000.00
4	110203	11 国开 03	500,000	50,450,000.00
5	020214	02 国开 14	500,000	50,135,000.00

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 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	750,000.00
2	应收证券清算款	213,338.77
3	应收股利	

22,500.00					
4		应	收	利	息
6,051,161.40					
5		应	收	申	购
-					款
6		其	他	应	收
-					款
7		待	摊	费	用
-					
8				其	他
-					
9					合 计
7,037,000.17					
7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细					
金 额					

单位：人民币元

序号 (%)	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例
1 0.63	110018	国电转债		11,247,000.00
2 0.55	113001	中行转债		9,712,000.00

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

额单位：份		份	
持有人户 数(户) 占总份额 比例	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者 持有份额 比	个人投资 占总份额 例
23,951 30.45%	83,503.82	1,391,032,013 69.55%	608,967,987

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

市总份额 序号	持有人名称	持有份额(份)	占上
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	105,339,381	
5.27%			
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红— 个人分红	82,679,457	
4.13%			
5	阳光财产保险股份有限公司—自有资金	68,816,360	
3.44%			
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统— 普通保险产品	65,273,715	
3.26%			
7	幸福人寿保险股份有限公司—分红	59,136,997	
2.96%			
8	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品	51,090,169	
2.55%			
9	-013C-CT001 深 泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分	49,696,385	

2.48%	红-019L-FH002 深	
10	中国机械进出口（集团）有限公司	40,000,000
2.00%		

## §9 重大事件揭示

### 9.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

### 9.2 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

本报告期本基金管理人的高级管理人员未曾变动。

#### 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

本报告期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

本报告期基金投资策略没有改变。

### 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

单位：人民币元		股票交易		金 额	
的佣金				应支付该券商	
券商名称	交易单	占当期股票成交		的	
占当期佣金	元数量	成交金额	总 额	佣 金 比 例	
总量的比例					
招商证券	1	-	-	-	-
-					
中信建投证券	1	-	-	-	-
-					
国元证券	2	-	-	-	-
-					
申银万国证券	2	-	-	-	-
-					
中国银河证券	1	-	-	-	-
-					
长城证券	1	-	-	-	-
-					
平安证券	1	-	-	-	-
-					
华福证券	1	935,990,487.14	34.70%	795,596.20	
35.06%					
信达证券	1	-	-	-	-
-					
红塔证券	1	460,860,926.44	17.09%	391,731.58	
17.26%					
东方证券	1	431,227,217.73	15.99%	373,097.89	
16.44%					
方正证券	1	869,178,360.56	32.22%	708,895.52	
31.24%					

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

单位：人民币元		债券交易		金 额	
券回购				债券回购交易	
券商名称	交易单	占当期债券成交		占当期债	
券回购	元数量	成交金额	成交总额		

的比例			总额的比例	成交总额
招商证券	1	-	-	-
-				
中信建投证券	1	-	-	-
-				
国元证券	2	-	-	-
-				
申银万国证券	2	-	-	-
-				
中国银河证券	1	-	-	-
-				
长城证券	1	-	-	-
-				
平安证券	1	-	-	-
-				
华福证券	1	67,107,574.20	39.01%	1,285,000,000.00
35.25%				
信达证券	1	-	-	-
-				
红塔证券	1	31,554,573.60	18.34%	1,060,000,000.00
29.08%				
东方证券	1	73,348,667.90	42.64%	1,300,000,000.00
35.67%				
方正证券	1	-	-	-
-				

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：无。

(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上海分公司注册地址及负责人变更的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2012-04-

## § 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

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>。

