

同益证券投资基金

2011 年年度报告

2011 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2012 年 3 月 28 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根据本基金合同规定，于2012年3月27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。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2011年1月1日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
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	12
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6	审计报告	16
6.1	审计报告基本信息	16

6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表（经审计）	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注（经审计）	20
§ 8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	42
8.3 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	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
8.6 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 ..	46
8.7 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	46
8.8 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 ..	46
8.9 投资组合报告附注	46
§ 9 基金份额持有人信息	48
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
9.2 期末上市基金前十名持有人	48
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产，基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	51
§ 11 备查文件目录	53

11.1 备查文件目录.....	53
11.2 存放地点.....	53
11.3 查阅方式.....	53

§ 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

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	95588
		010-62350088	
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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所有限公司	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城东三办公楼16层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-47,488,817.36	184,200,003.54	254,695,296.14
本期利润	-532,513,479.27	-98,749,668.06	1,341,081,072.80
加权平均基金份额本期利润	-0.2663	-0.0494	0.6705
本期加权平均净值利润率	-25.62%	-4.00%	51.59%
本期基金份额净值增长率	-23.67%	-2.74%	73.48%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配利润	-285,186,854.06	228,539,600.43	644,339,596.89
期末可供分配基金份额利润	-0.1426	0.1143	0.3222
期末基金资产净值	1,714,813,145.94	2,467,326,625.21	3,166,076,293.27
期末基金份额净值	0.8574	1.2337	1.5830
3.1.3 累计期末指标	2011年末	2010年末	2009年末
基金份额累计净值增长率	443.48%	611.97%	639.38%

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12月31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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②
过去三个月	-6.02%	2.68%
过去六个月	-18.09%	2.12%
过去一年	-23.67%	1.98%
过去三年	28.80%	2.42%
过去五年	45.52%	3.18%
自基金合同生效起至今	443.48%	2.66%

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

(1999年4月8日至2011年12月31日)

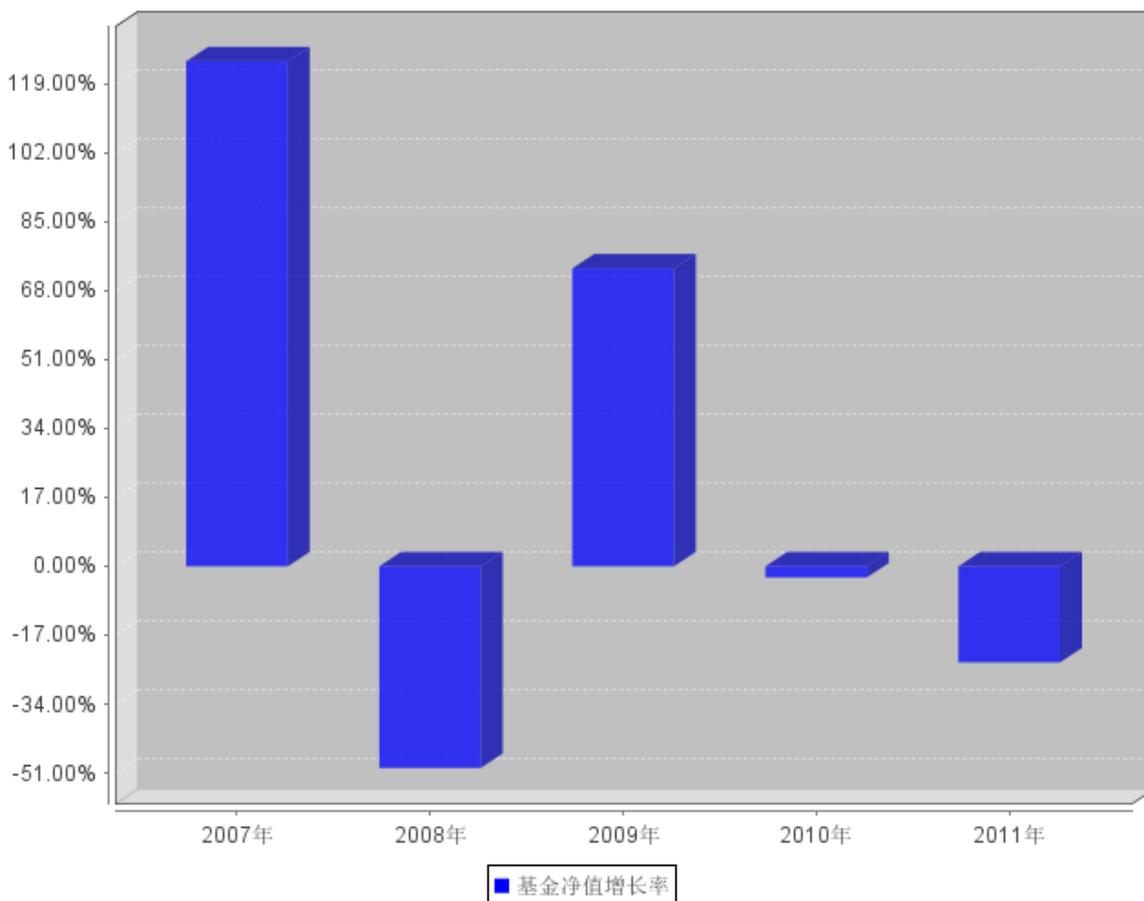
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2011 年	1.100	220,000,000.00	-	220,000,000.00	除息日：2011 年 3 月 25 日
2010 年	3.000	600,000,000.00	-	600,000,000.00	除息日：2010 年 3 月 31 日
2009 年	-	-	-	-	-
合计	4.100	820,000,000.00	-	820,000,000.00	

§ 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2011年12月31日，基金管理人共管理两支封闭式基金、十七支开放式基金，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

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、上表基金经理及基金经理助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

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 年对 A 股投资人来说是比较艰难的一年，全年看上证指数和沪深 300 指数分别下跌了 20.3%和 23.4%，而中小板和创业板指数分别下跌了 35.7%和 34.7%。除了在 1 季度有比较持续性的上涨行情外，其他大多数时间处于震荡下跌的状态，特别是中小盘公司在新股发行速度加快和业绩低于预期的双重影响下，年内出现了持续的大幅下跌。从行业分类看，表现相对较好的行业主要是食品饮料和金融，而电子、有色金属和机械设备行业的跌幅达到 37%-40%。

在 2011 年的投资过程中，本基金基本保持相对稳定的股票仓位。从行业角度看，1 季度组合增持的主要是低估值的建材、房地产、银行，减持了部分估值较高、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，因此主要增持上游资源品、房地产。下半年在小盘股供给压力放大和 3 季度业绩增速放缓的情况下，提高了对组合中的小市值公司的评估标准，根据流动性的情况择机进行减持。

从全年的投资运作看，还是留下很多值得反思的方面：（1）没有灵活的利用资产配置来降低组合的下行风险，在 4 月份之后社会上资金流动性趋近、实际资金成本快速提高已经开始在股票市场得到体现，但是没有抓住时机降低股票仓位；（2）要注重

改善组合的平衡性，权衡企业盈利和估值对股价的综合影响，2011 年上半年对宏观经济的判断是中性偏紧的货币政策下，企业盈利会向上游资源企业集中，同时中游的部分行业供给结构持续优化会改善企业的盈利能力，因此增加了对煤炭、有色金属等行业的配置，但是在市场流动性持续偏紧的情况下，周期股的估值波动区间快速扩大，导致相关股票持续大幅下跌。

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 0.8574 元，本报告期份额净值增长率为 -23.67%。

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

目前对宏观经济的运行已经形成部分的共识，过去多年形成的以产品制造出口和房地产两方面作为经济增长驱动力的发展模式已经面临越来越明显的限制，调整和转型成为社会发展的必需选择，内需型、服务型的社会是我们发展的长期方向，而在这个过程中，包括企业在内的各个阶层对经济的新的增长源泉和发展模式还处于探索之中，今后几年我们需要以更加积极和紧密的态度参与到社会发展实践中去。

对 2012 年来说，经济增速的适当放慢和通胀压力的缓解已经成为市场共识。在国内房地产相关投资确定性减速的情况下，外需还面临着很大的不确定性，特别是过去几年中快速增长的对发展中国家的出口将面临很大的压力。在这种情况下，企业在 2012 年面对的经营环境将发生很大的变化，来自资金和劳动力成本的压力将有所缓解，而如何开拓客户将成为企业面对的主要挑战。

4.5.2 本基金下阶段投资策略

经过 2011 年长时间的持续下跌，A 股市场的风险已经得到比较充分的释放，宏观经济政策和流动性的状况在 2012 年将出现一定程度的改善，对资本市场形成一定程度的支持，企业盈利下调的风险也在 2011 年 4 季度和 2012 年 1 季度得到比较集中的体现，为长期投资者提供了很好的投资时机。但从全年看市场仍然要面对股票供给增加、外部不确定因素较多的影响，从而增加投资运作的难度。

在宏观经济和政策的过渡阶段，我们会更重视自下而上的公司和行业研究，从中寻找具备长期发展空间和可持续竞争力的企业作为我们的投资标的。此外也会通过更加积极的资产配置来改善组合的业绩，为基金持有人谋求长期稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作，保障基金持有人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

继续加大合规培训力度，采取多样化的方式对员工进行合规培训，特别加强了对投资、研究及销售人员的合规培训，深化员工合规意识。

结合新法规、新监管要求，以及公司新业务的发展，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，以保证公司内控制度的合法合规、全面、适时、有效。

3、紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司制度规定，全面掌控基金投资运作风险点，以前述风险点为依据，时时检查、监督各基金投资运作，加强对基金投资交易的风险控制及合规检查。

4、采用定期与不定期相结合的稽核、检查方式，推进公司内部控制制度的落实。报告期内，公司监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核工作，内容涵盖基金投资、研究、交易、销售、基金估值、登记注册、公司财务、产品开发等等；此外，公司监察稽核部根据业务发展需要，以及日常监督、检查中发现问题，随时增加了多项的检查、稽核项目。针对发现问题，监察稽核部要求相关业务部门限期改进，并就改进情况进行检查验收。

5、继续加强对员工个人行为合规性的检查监督。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障基金份额持有人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、基金合规运作。

4.7 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。

4.8 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 年度收益进行了分配，分配金额为 220,000,000.00 元。

本基金截至 2011 年 12 月 31 日，期末可供分配收益为-285,186,854.06 元，其中：未分配收益已实现部分为-38,949,216.93 元，未分配收益未实现部分为-246,237,637.13 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，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，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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2012)审字第 60468688_A03 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	同益证券投资基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的同益证券投资基金财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表和 2011 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是基金管理人长盛基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了同益证券投资基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。	
注册会计师的姓名	李慧民	王珊珊
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2012 年 3 月 20 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：同益证券投资基金

报告截止日：2011年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	45,698,358.10	188,977,076.50
结算备付金		3,206,599.49	5,325,910.29
存出保证金		782,136.99	742,586.90
交易性金融资产	7.4.7.2	1,679,036,298.09	2,269,865,179.09
其中：股票投资		1,244,036,667.79	1,726,510,859.29
基金投资		-	-
债券投资		434,999,630.30	543,354,319.80
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	5,335,937.81	9,863,132.91
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,734,059,330.48	2,474,773,885.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		13,612,316.71	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,217,460.84	3,169,772.74
应付托管费		369,576.79	528,295.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,116,130.52	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	7.4.7.8	1,115,000.00	595,000.00
负债合计		19,246,184.54	7,447,260.48
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	-285,186,854.06	467,326,625.21
所有者权益合计		1,714,813,145.94	2,467,326,625.21
负债和所有者权益总计		1,734,059,330.48	2,474,773,885.69

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8574 元，基金份额总额 2,000,000,000 份。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
一、收入		-485,642,142.32	-42,187,132.60
1. 利息收入		19,506,741.71	15,371,797.87
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,121,999.81	1,213,261.43
债券利息收入		17,148,468.14	14,020,127.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,236,273.76	138,409.13
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-20,124,222.12	225,389,263.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-32,030,712.64	212,119,876.22
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-3,353,353.73	907,425.13
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	15,259,844.25	12,361,961.69
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	7.4.7.17	-485,024,661.91	-282,949,671.60
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	7.4.7.18	-	1,478.09
减：二、费用		46,871,336.95	56,562,535.46

1. 管理人报酬		31,267,617.20	37,218,907.97
2. 托管费		5,211,269.53	6,203,151.24
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	9,293,026.19	10,899,456.31
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	7.4.7.20	1,099,424.03	2,226,553.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-532,513,479.27	-98,749,668.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-532,513,479.27	-98,749,668.06

7.3 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12月31日。

单位：人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年12月31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）	-	-532,513,479.27	-532,513,479.27
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）	-	-220,000,000.00	-220,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	-285,186,854.06	1,714,813,145.94
项 目	上年度可比期间金额 2010年1月1日至2010年12月31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）	-	-98,749,668.06	-98,749,668.06
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	-	-600,000,000.00	-600,000,000.00

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	467,326,625.21	2,467,326,625.21

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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]8号文《关于同意同益证券投资基金设立的批复》的核准，由中信证券股份有限公司、长江证券有限责任公司、天津北方国际信托投资股份有限公司、国元证券股份有限公司和长盛基金管理有限公司五家发起人共同发起并向社会公开发行募集，基金合同于1999年4月2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，存续期为15年。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，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。

7.4.2 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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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》、《证券投资基金信息

披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

2、金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

1、股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

2、债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

3、权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

4、分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

5、回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1、股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

（2）未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的首次取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的首次取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2、债券投资

（1）证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

（2）证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3、权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4、分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述2)、3)中的相关原则进行估值；

5、其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

每份基金面值为人民币 1.00 元。实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的

金额。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

3、资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

4、买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

5、股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

6、债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

7、衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

8、股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

9、公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

10、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

1、基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；

2、基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提；

3、卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

- 1、基金收益分配比例不低于基金净收益的 90%；
- 2、基金收益分配采取现金方式，每年分配一次，分配在基金会计年度结束后的四个月内完成；
- 3、基金当年收益先弥补上一年度亏损后才可进行当年收益分配；
- 4、基金投资当年亏损则不进行收益分配；
- 5、每一基金单位享有同等分配权。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明：本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明：本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
活期存款	45,698,358.10	188,977,076.50
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月-1年	-	-
其他存款	-	-
合计	45,698,358.10	188,977,076.50

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,490,095,112.17	1,244,036,667.79	-246,058,444.38
债券	交易所市场	14,517,853.05	14,596,130.30	78,277.25
	银行间市场	420,660,970.00	420,403,500.00	-257,470.00
	合计	435,178,823.05	434,999,630.30	-179,192.75
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,925,273,935.22	1,679,036,298.09	-246,237,637.13
项目		上年度末 2010年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,485,275,894.80	1,726,510,859.29	241,234,964.49
债券	交易所市场	102,196,449.51	101,899,119.80	-297,329.71
	银行间市场	443,605,810.00	441,455,200.00	-2,150,610.00
	合计	545,802,259.51	543,354,319.80	-2,447,939.71
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,031,078,154.31	2,269,865,179.09	238,787,024.78

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2011年12月31日	2010年12月31日
应收活期存款利息	8,444.05	24,707.10
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	1,443.00	1,864.00
应收债券利息	5,326,006.26	9,836,527.21
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收权证保证金利息	44.50	34.60

合计	5,335,937.81	9,863,132.91
----	--------------	--------------

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,115,030.52	2,337,842.63
银行间市场应付交易费用	1,100.00	650.00
合计	1,116,130.52	2,338,492.63

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	750,000.00	500,000.00
应付赎回费	-	-
预提审计费	95,000.00	95,000.00
预提信息披露费用	270,000.00	-
合计	1,115,000.00	595,000.00

7.4.7.9 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12月31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

7.4.7.10 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	-47,488,817.36	-485,024,661.91	-532,513,479.27
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	-38,949,216.93	-246,237,637.13	-285,186,854.06

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
活期存款利息收入	1,052,885.47	1,171,935.68
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	67,560.99	40,063.83
权证保证金利息收入	1,553.35	1,261.92
合计	1,121,999.81	1,213,261.43

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
卖出股票成交总额	3,025,064,039.13	3,826,198,672.03
减：卖出股票成本总额	3,057,094,751.77	3,614,078,795.81
买卖股票差价收入	-32,030,712.64	212,119,876.22

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖基金差价收入。

7.4.7.14 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期 兑付）成交总额	854,475,031.30	839,305,223.01
减：卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成本总额	835,040,853.51	831,444,346.67
减：应收利息总额	22,787,531.52	6,953,451.21
债券投资收益	-3,353,353.73	907,425.13

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖衍生工具差价收入。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	15,259,844.25	12,361,961.69

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	15,259,844.25	12,361,961.69

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
1. 交易性金融资产	-485,024,661.91	-282,949,671.60
——股票投资	-487,293,408.87	-277,483,728.59
——债券投资	2,268,746.96	-5,465,943.01
——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	-485,024,661.91	-282,949,671.60

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
基金赎回费收入	-	-
转换费收入	-	-
印花税手续费返还	-	1,478.09
其他	-	-
合计	-	1,478.09

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
交易所市场交易费用	9,289,626.19	10,895,006.31
银行间市场交易费用	3,400.00	4,450.00
合计	9,293,026.19	10,899,456.31

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
银行费用	6,324.03	6,053.29
审计费用	95,000.00	95,000.00

信息披露费	270,000.00	270,000.00
账户维护费	18,000.00	22,500.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
分红手续费	650,100.00	1,773,000.00
合计	1,099,424.03	2,226,553.29

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金发起人
天津北方国际信托投资股份有限公司（“天津北方国际信托”）	基金发起人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金发起人
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
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人股东
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

7.4.9.2 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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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	
	2011年1月1日至2011年12月31日		2010年1月1日至2010年12月31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	1, 297, 201, 734. 44	21. 32%	1, 078, 795, 423. 43	15. 64%
------	----------------------	---------	----------------------	---------

7. 4. 10. 1. 2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7. 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12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	22. 54%	-	-

7. 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12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购总额的比例	成交金额	占当期债券回购总额的比例
国元证券	220, 000, 000. 00	5. 88%	-	-

7. 4. 10. 1. 5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	1, 070, 813. 18	20. 99%	143, 373. 34	12. 86%
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	876, 527. 65	15. 17%	-	-

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和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。

7. 4. 10. 2 关联方报酬

7. 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	31,267,617.20	37,218,907.97
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%，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

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人于次月首日起两个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人在收到计算结果当日完成复核，并于当日从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,211,269.53	6,203,151.24

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，基金管理人应于次月首日起两个工作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并作出划付指令，基金托管人复核后于当日从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易：

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2011年1月1日至 2011年12月31日	2010年1月1日至 2010年12月31日
期初持有的基金份额	28,000,079	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	28,000,079
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	1.40%	1.40%

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.10.4.2 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		上年度末	
	2011年12月31日		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
长江证券	6,000,000	0.30%	6,000,000	0.30%
天津北方国际信托	4,000,000	0.20%	4,000,000	0.20%
中信证券	6,000,000	0.30%	6,000,000	0.30%
国元证券	4,000,000	0.20%	4,000,000	0.20%

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年12月31日		2010年1月1日至2010年12月31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	45,698,358.10	1,052,885.47	188,977,076.50	1,171,935.68

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金	现金形式	再投资形式	本期利润分配合	备
----	-------	-----	--------	------	-------	---------	---

			份额分红数	发放总额	发放总额	计	注
1	2011年3月24日	2011年3月25日	1.100	220,000,000.00	-	220,000,000.00	
合计			1.100	220,000,000.00	-	220,000,000.00	

7.4.12 年末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 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管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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011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
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
上年度末							
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
资产							
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
应收利息	-	-	-	-	-	9,863,132.91	9,863,132.91
资产总计	224,791,767.28	158,688,000.00	354,168,755.20	107,564.60	-	-1,737,017,798.61	2,474,773,885.69
负债							
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
负债总计	-	-	-	-	-	7,447,260.48	7,447,260.48
利率敏感度缺口	224,791,767.28	158,688,000.00	354,168,755.20	107,564.60	-	-1,729,570,538.13	2,467,326,625.21

7.4.13.4.1.2 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可能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12月31日	上年度末 2010年12月31日
	+25 个基点	-1,057,375.35	-460,492.79
-25 个基点	1,057,375.35	460,492.79	

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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 2011 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项 目	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值的比例	公允价值	占基金资产 净值的比例
交易性金融资产—股票投资	1,244,036,667.79	72.55%	1,726,510,859.29	69.97%
交易性金融资产—债券投资	434,999,630.30	25.37%	543,354,319.80	22.02%
合计	1,679,036,298.09	97.91%	2,269,865,179.09	92.00%

7.4.13.4.3.2 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。下表为其他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。		
	分析	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 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	+5%	60,895,917.73	86,083,792.29
	-5%	-60,895,917.73	-86,083,792.29

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2012 年 3 月 20 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产比例 (%)
1	权益投资	1,244,036,667.79	71.74
	其中：股票	1,244,036,667.79	71.74
2	固定收益投资	434,999,630.30	25.09
	其中：债券	434,999,630.30	25.09
	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	48,904,957.59	2.82
6	其他资产	6,118,074.80	0.35
7	合计	1,734,059,330.48	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	123,538,090.29	7.20
C	制造业	513,016,678.26	29.92
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	82,186,153.44	4.79
C5	电子	20,446,102.56	1.19
C6	金属、非金属	97,738,670.02	5.70
C7	机械、设备、仪表	281,584,425.15	16.42
C8	医药、生物制品	31,061,327.09	1.81
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	25,009,001.74	1.46
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	57,144,312.72	3.33
G	信息技术业	118,130,573.08	6.89
H	批发和零售贸易	58,056,298.74	3.39
I	金融、保险业	127,208,779.04	7.42
J	房地产业	167,548,540.98	9.77

K	社会服务业	15,486,403.00	0.90
L	传播与文化产业	9,588,000.00	0.56
M	综合类	29,309,989.94	1.71
	合计	1,244,036,667.79	72.55

8.3 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	600582	天地科技	5,401,777	99,932,874.50	5.83
2	000063	中兴通讯	4,511,364	76,242,051.60	4.45
3	600009	上海机场	4,668,653	57,144,312.72	3.33
4	601166	兴业银行	4,029,309	50,446,948.68	2.94
5	600266	北京城建	4,067,575	50,397,254.25	2.94
6	600123	兰花科创	1,259,747	48,978,963.36	2.86
7	600309	烟台万华	3,659,494	47,207,472.60	2.75
8	600720	祁连山	5,113,195	46,478,942.55	2.71
9	601601	中国太保	1,941,774	37,301,478.54	2.18
10	000581	威孚高科	1,036,677	37,206,337.53	2.17
11	600690	青岛海尔	4,058,229	36,239,984.97	2.11
12	601898	中煤能源	3,999,785	36,038,062.85	2.10
13	000402	金融街	5,200,000	31,460,000.00	1.83
14	600557	康缘药业	2,111,579	31,061,327.09	1.81
15	600015	华夏银行	2,605,634	29,261,269.82	1.71
16	000963	华东医药	1,029,543	27,406,434.66	1.60
17	002335	科华恒盛	1,649,783	26,957,454.22	1.57
18	600376	首开股份	2,706,600	25,956,294.00	1.51
19	601088	中国神华	910,402	23,060,482.66	1.34
20	600048	保利地产	2,264,982	22,649,820.00	1.32
21	600823	世茂股份	2,032,261	21,237,127.45	1.24
22	002484	江海股份	1,211,262	20,446,102.56	1.19
23	000709	河北钢铁	7,060,171	20,192,089.06	1.18
24	000012	南玻A	2,190,987	19,850,342.22	1.16
25	000987	广州友谊	1,224,316	19,319,706.48	1.13
26	002122	天马股份	2,943,847	19,076,128.56	1.11
27	600765	中航重机	2,105,175	18,841,316.25	1.10
28	600486	扬农化工	1,233,749	18,012,735.40	1.05
29	600886	国投电力	2,893,523	17,245,397.08	1.01
30	002518	科士达	852,954	17,229,670.80	1.00
31	600718	东软集团	2,086,182	16,981,521.48	0.99
32	600570	恒生电子	1,300,000	15,912,000.00	0.93
33	002285	世联地产	1,400,004	15,848,045.28	0.92
34	601007	金陵饭店	2,301,100	15,486,403.00	0.90

35	600497	驰宏锌锗	1,182,906	15,460,581.42	0.90
36	600881	亚泰集团	3,248,389	15,397,363.86	0.90
37	600790	轻纺城	2,449,406	13,912,626.08	0.81
38	600336	澳柯玛	3,157,121	13,544,049.09	0.79
39	002391	长青股份	896,974	12,127,088.48	0.71
40	600858	银座股份	577,480	11,330,157.60	0.66
41	000630	铜陵有色	667,299	11,217,296.19	0.65
42	601788	光大证券	999,910	10,199,082.00	0.59
43	600037	歌华有线	1,200,000	9,588,000.00	0.56
44	002368	太极股份	500,000	8,995,000.00	0.52
45	600795	国电电力	2,782,654	7,763,604.66	0.45
46	002242	九阳股份	809,196	6,303,636.84	0.37
47	601633	长城汽车	522,387	6,252,972.39	0.36
48	600096	云天化	325,192	4,838,856.96	0.28

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600050	中国联通	106,063,673.94	4.30
2	600720	祁连山	94,355,652.05	3.82
3	600123	兰花科创	82,446,036.50	3.34
4	600009	上海机场	76,302,813.86	3.09
5	600266	北京城建	75,813,776.81	3.07
6	600582	天地科技	64,233,261.59	2.60
7	600497	驰宏锌锗	58,332,113.69	2.36
8	600881	亚泰集团	53,260,343.26	2.16
9	000822	山东海化	52,818,166.57	2.14
10	601166	兴业银行	51,960,429.59	2.11
11	601601	中国太保	49,851,435.73	2.02
12	601088	中国神华	48,866,803.86	1.98
13	002335	科华恒盛	47,885,737.18	1.94
14	600886	国投电力	47,325,683.63	1.92
15	600570	恒生电子	45,923,756.92	1.86
16	601006	大秦铁路	44,619,319.20	1.81
17	600500	中化国际	44,128,527.40	1.79
18	600690	青岛海尔	43,308,918.00	1.76
19	600428	中远航运	42,918,155.77	1.74
20	600309	烟台万华	42,412,832.95	1.72

8.4.2 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	601318	中国平安	127,130,523.65	5.15
2	600720	祁连山	96,950,427.02	3.93
3	600050	中国联通	95,143,023.45	3.86
4	600089	特变电工	94,483,395.72	3.83
5	000568	泸州老窖	84,296,169.83	3.42
6	600739	辽宁成大	82,612,110.64	3.35
7	600096	云天化	82,207,757.88	3.33
8	600271	航天信息	79,084,094.47	3.21
9	601111	中国国航	58,596,376.47	2.37
10	600875	东方电气	58,555,102.87	2.37
11	000822	山东海化	53,176,909.09	2.16
12	600395	盘江股份	53,067,438.34	2.15
13	600693	东百集团	52,603,215.72	2.13
14	000858	五粮液	45,371,263.44	1.84
15	002115	三维通信	42,935,606.79	1.74
16	600016	民生银行	42,361,934.06	1.72
17	002281	光迅科技	40,961,219.98	1.66
18	600500	中化国际	40,198,005.94	1.63
19	601006	大秦铁路	40,039,413.04	1.62
20	600360	华微电子	39,569,835.06	1.60

8.4.3 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	3,061,913,969.14
卖出股票收入（成交）总额	3,025,064,039.13

注：本项中“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。

8.5 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	10,017,003.00	0.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	420,403,500.00	24.52
	其中：政策性金融债	420,403,500.00	24.52
4	企业债券	102,411.90	0.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债	4,476,715.40	0.26
8	其他	-	-
9	合计	434,999,630.30	25.37

8.6 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	090302	09 进出 02	1,000,000	99,560,000.00	5.81
2	030224	03 国开 24	500,000	50,520,000.00	2.95
3	070409	07 农发 09	500,000	50,130,000.00	2.92
4	020214	02 国开 14	500,000	50,020,000.00	2.92
5	110308	11 进出 08	500,000	49,980,000.00	2.91

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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

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。

8.9.2 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

基金的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.9.3 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	782,136.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,335,937.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,118,074.80

8.9.4 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	4,476,715.40	0.26

8.9.5 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。

8.9.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
24,856	80,463.47	1,316,108,996.00	65.81%	683,891,004.00	34.19%

9.2 期末上市基金前十名持有人

	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险(集团)公司	197,111,229.00	9.86%
2	中国人寿保险股份有限公司	196,380,409.00	9.82%
3	阳光人寿保险股份有限公司-分红保险产品	119,815,640.00	5.99%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	92,999,900.00	4.65%
5	阳光财产保险股份有限公司-自有资金	71,316,360.00	3.57%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	53,442,500.00	2.67%
7	中国机械进出口(集团)有限公司	40,000,000.00	2.00%
8	宝钢集团有限公司	34,974,450.00	1.75%
9	幸福人寿保险股份有限公司-分红	32,537,178.00	1.63%
10	中国太平洋财产保险-传统-普通保险产品-013C-CT001 深	31,835,733.00	1.59%

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 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。

10.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。本报告期支付给该会计师事务所的报酬 95,000.00 元，已连续提供审计服务 13 年。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易进行单元股票交易及佣金支付的有关情况

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	1,297,201,734.44	21.32%	1,070,813.18	20.99%
申银万国证券	2	459,560,036.12	7.55%	384,215.43	7.53%
中国银河证券	1	46,684,134.97	0.77%	37,932.24	0.74%
长城证券	1	-	-	-	-
平安证券	1	823,098,706.43	13.53%	668,772.23	13.11%
广发华福证券	1	222,913,802.64	3.66%	189,477.06	3.71%
信达证券	1	1,454,376,426.62	23.90%	1,236,215.58	24.23%
红塔证券	1	820,537,548.07	13.48%	697,456.94	13.67%
东方证券	1	957,011,826.96	15.73%	813,456.81	15.94%
方正证券	1	4,285,492.02	0.07%	3,481.99	0.07%

10.7.2 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	22.54%	220,000,000.00	5.88%
申银万国证券	2	4,472,725.60	5.04%	-	-
中国银河证券	1	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-
广发华福证券	1	9,971,000.00	11.23%	480,000,000.00	12.83%
信达证券	1	45,477,661.40	51.23%	1,300,000,000.00	34.76%
红塔证券	1	8,834,667.20	9.95%	660,000,000.00	17.65%
东方证券	1	-	-	1,080,000,000.00	28.88%
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) 财力雄厚，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	东方证券有限责任公司	上海	1
2	方正证券有限责任公司	深圳	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

10.8 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	公告事项	法定披露方式	披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2011-09-02
2	长盛基金管理有限公司关于设立成都分公司的公告	同上	2011-07-28
3	长盛基金管理有限公司关于电话总机变更的公告	同上	2011-07-06
4	长盛基金管理有限公司总经理变更公告	同上	2011-05-14
5	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

6	同益证券投资基金 2010 年度收益分配公告	同上	2011-03-17
---	------------------------	----	------------

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (二) 《同益证券投资基金基金合同》；
- (三) 《同益证券投资基金托管协议》；
- (四) 《同益证券投资基金招募说明书》；
- (五) 法律意见书；
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 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。

11.3 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>。