

同盛证券投资基金

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
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	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	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	44
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 ..	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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 投资明细	48
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	48
8.9 投资组合报告附注	48
§ 9 基金份额持有人信息	50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
9.2 期末上市基金前十名持有人	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51

10.8 其他重大事件	53
§ 11 备查文件目录	55
11.1 备查文件目录.....	55
11.2 存放地点	55
11.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	同盛证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	3,000,000,000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11月26日

2.2 基金产品说明

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

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	叶金松	唐州徽
	联系电话	010-82019988	010-66594855
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666	95566
		010-62350088	
传真		010-82255988	010-66594942
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1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1号
邮政编码		100088	100818
法定代表人		凤良志	肖钢

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住所

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	135,225,080.63	420,699,405.33	78,374,835.48
本期利润	-725,603,011.83	328,849,161.19	1,476,618,063.72
加权平均基金份额本期利润	-0.2419	0.1096	0.4922
本期加权平均净值利润率	-19.95%	9.21%	47.98%
本期基金份额净值增长率	-19.52%	8.89%	66.44%
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	32,253,097.60	284,241,550.27	-136,457,855.06
期末可供分配基金份额利润	0.0108	0.0947	-0.0455
期末基金资产净值	3,032,253,097.60	4,027,856,109.43	3,699,006,948.24
期末基金份额净值	1.0108	1.3426	1.2330
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	263.72%	351.96%	315.07%

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	-7.93%	2.65%
过去六个月	-18.68%	2.11%
过去一年	-19.52%	2.16%
过去三年	45.85%	2.60%
过去五年	59.42%	3.28%
自基金合同生效起至今	263.72%	2.61%

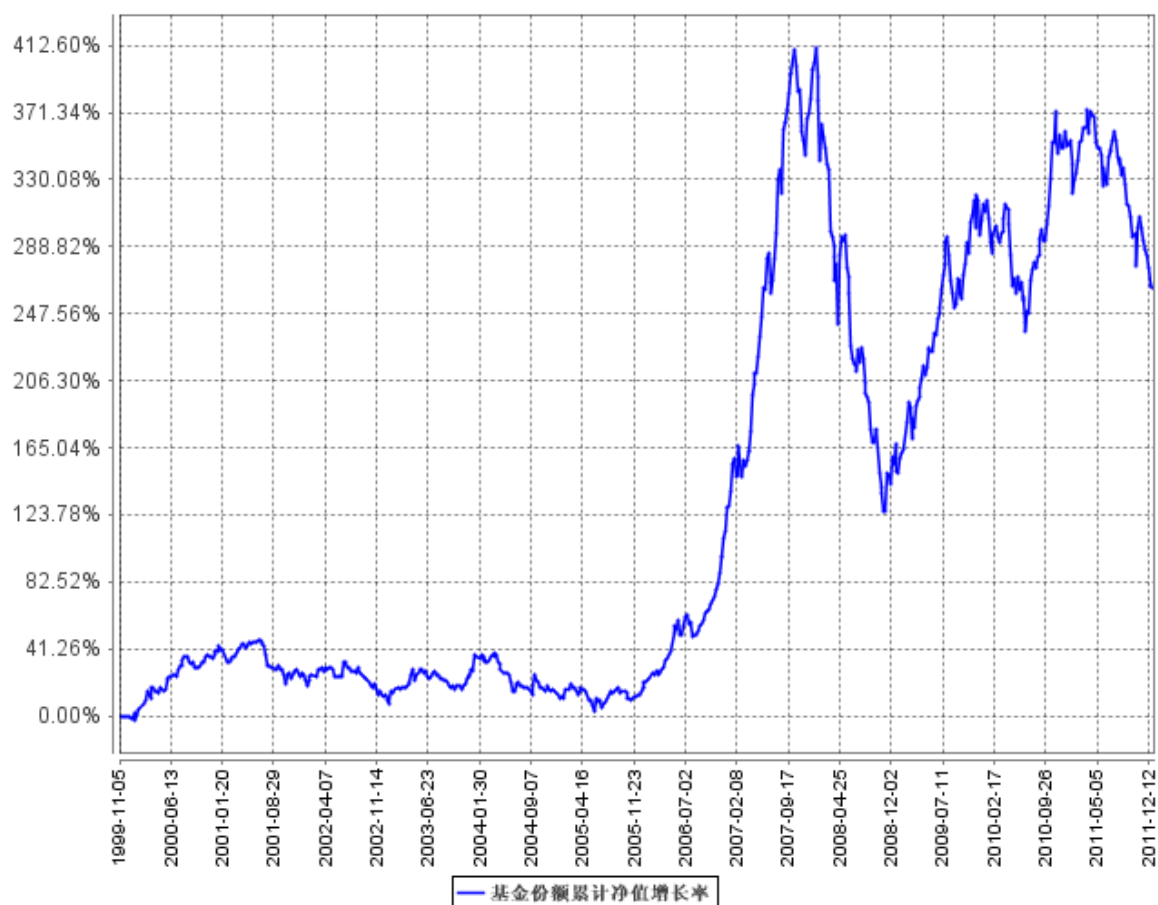
注：本基金无业绩比较基准收益率，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

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11月5日至2011年12月31日)

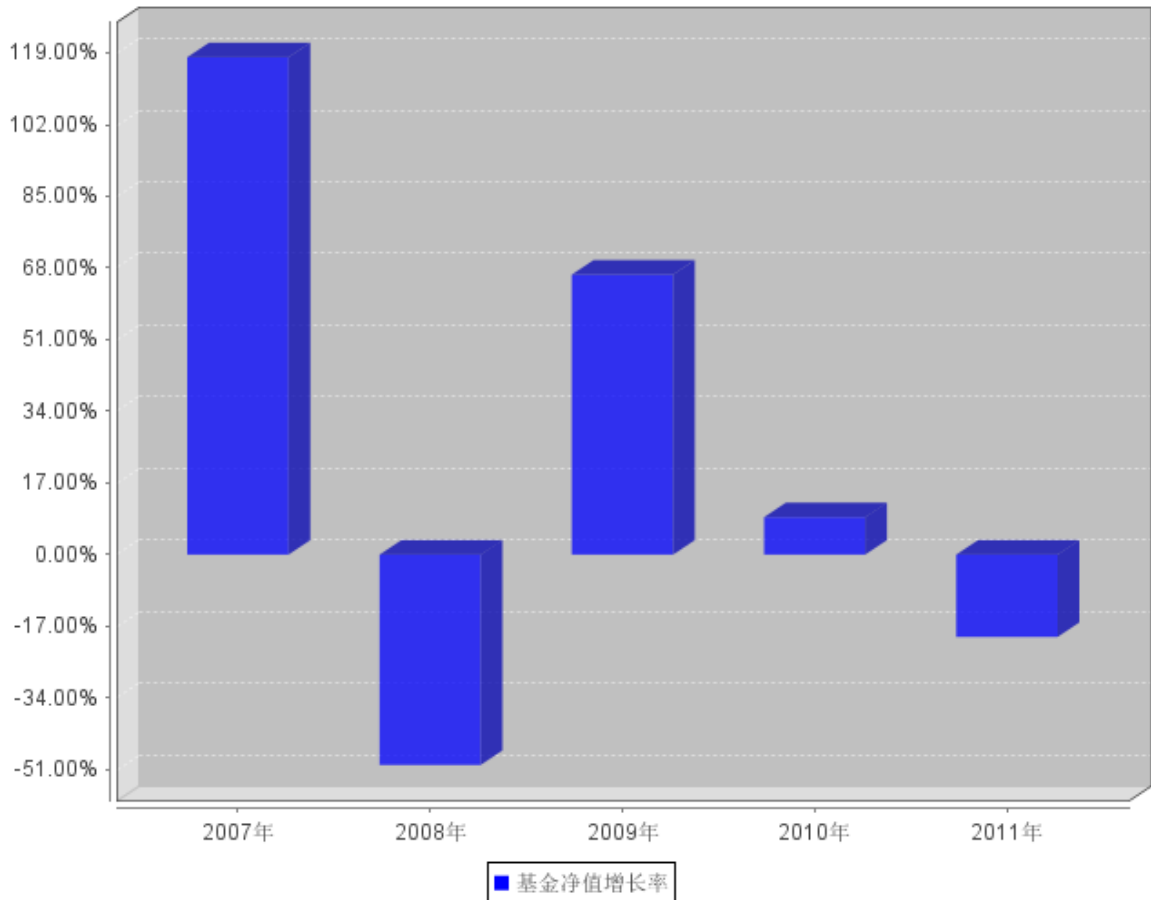
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按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。

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	0.900	270,000,000.00	-	270,000,000.00	除息日：2011年3月25日
2010年	-	-	-	-	2010年度未分配收益
2009年	-	-	-	-	2009年度未分配收益
合计	0.900	270,000,000.00	-	270,000,000.00	

§ 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金字[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		
侯继雄	本基金基金经理，研究发展部总监。	2008年8月11日	-	10年	男，1974年5月出生，中国国籍。清华大学博士。2001年4月至2007年2月在国泰君安证券研究所任研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司，现任研究发展部总监，同盛证券投资基金（本基金）基金经理。
丁骏	本基金基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理。	2008年4月25日	-	10年	男，1974年11月出生，中国国籍。中国社会科学院经济学博士。历任中国建设银行浙江省分行国际业务部本外币交易员、经济师；国泰君安证券股份有限公司企业融资部业务经理、高级经理；2003年6月加入长盛基金管理有限公司，先后担任行业研究员、组合经理助理。现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理，同盛证券投资基金（本基金）基金经理。

注：1、上表基金经理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年中国经济呈现出滞胀到衰退的发展路径。全年通胀持续超出预期，宏观调控不断收紧，加之欧债危机的发酵，经济逐季下滑。货币利率持续攀升并高位运行，M2、工业增加值、企业利润依次回落，回落幅度还超出年初预期。新股融资不断、产业资本快速变现，使得市场无论从基本面和信心上都受到了严重的冲击。回望2011，同盛对经济的预测偏乐观，对市场基本面和信心面的恶化估计不足，纠结于股票低估值而使得调仓和减仓不够坚决，最终遭受了较

大的损失。从市场表现看，2011年投资者对中国经济增长模式的担忧和对大转型的期盼达到了新高潮，使得A股的下跌不仅反映了业绩增速低于预期，更反映了因对前景担忧而导致的估值下降。但实际上2011年中国经济的总体运行状况仍然良好，并没有明显低于投资者的年初预期。因此，2011年市场过度悲观为2012年的估值修复提供的一定空间。

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1.0108元，本报告期份额净值增长率为-19.52%。

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

2012年，经济的筑底的迹象已经较为明显，虽然市场情绪依然悲观，但乐观的迹象已经开始逐步显现。首先是经济已进入逐季寻底期，普遍市场预期将在12Q1或Q2环比见底。但对环比见底后经济能否反弹或反弹多高，市场则依然持有谨慎态度。其次是政策从紧缩趋向缓和，货币市场利率和民间借贷利率已经开始高位回落，通胀的下滑也进一步释放了货币政策的运作空间。财政政策方面，政府仍有能力加大投入以推动经济增长。鉴于中国经济在多年高速增长之后已进入了潜在经济增长中枢下降阶段和经济转型期，且新的经济增长动力方向不明，因此，政策抉择将是防御性的，即政策的优先考虑是维持经济增长的平稳、防止经济增速快速下滑及其引发的连带负面效应。最后，就中国经济的中长期增长前景而言，经济增长的空间仍然巨大。目前需要通过制度改革进一步释放经济增长的动能。

同盛认为对2012年已无需继续恐慌。未来政策面的乐观迹象将越来越多，若市场利率能持续下滑，将会为股市反弹提供充沛的资金储备。经济筑底后，市场的恐慌心态也将逐步消退，资金重配置和企业增长将会促成市场见底反弹。短期的风险来自于企业利润的惯性下滑，高估值行业和公司仍将面临较大的业绩风险和估值风险。未来同盛将优先关注估值较低、有核心竞争力、增长稳定的大盘蓝筹、周期类成长股、稳定消费股等的机会。

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 270,000,000.00 元；2012 年 3 月 29 日对 2011 年度收益进行分配，分配金额为 30,000,000.00 元。

本基金截至 2011 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 32,253,097.60 元，其中：未分配收益已实现部分为 149,466,630.90 元，未分配收益未实现部分为 -117,213,533.30 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对同盛证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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_A02 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	同盛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盛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	<p>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：</p> <p>（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；</p> <p>（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。</p>	
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，公允反映了同盛证券投资基金 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：同盛证券投资基金

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	137,285,717.73	127,966,145.60
结算备付金		1,168,707.01	3,812,267.29
存出保证金		638,549.12	1,009,265.43
交易性金融资产	7.4.7.2	2,899,148,610.92	3,895,502,661.83
其中：股票投资		2,207,149,141.22	3,022,017,574.53
基金投资		-	-
债券投资		691,999,469.70	873,485,087.30
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		868,092.45	-
应收利息	7.4.7.5	9,146,601.55	11,043,514.75
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		3,048,256,278.78	4,039,333,854.90
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		6,703,686.97	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,931,284.75	5,133,795.47
应付托管费		655,214.12	855,632.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,024,103.68	3,069,425.75
应交税费		1,823,891.66	1,823,891.66

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	865,000.00	595,000.00
负债合计		16,003,181.18	11,477,745.47
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	32,253,097.60	1,027,856,109.43
所有者权益合计		3,032,253,097.60	4,027,856,109.43
负债和所有者权益总计		3,048,256,278.78	4,039,333,854.90

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0108 元，基金份额总额 3,000,000,000 份。

7.2 利润表

会计主体：同盛证券投资基金

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		-653,502,866.39	400,364,581.01
1. 利息收入		32,264,798.86	19,521,887.36
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,093,153.85	1,142,169.40
债券利息收入		31,000,166.16	18,353,356.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		171,478.85	26,361.10
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		175,060,427.21	472,671,935.19
其中：股票投资收益	7.4.7.12	157,090,571.78	456,030,255.37
基金投资收益	7.4.7.13		-
债券投资收益	7.4.7.14	-3,004,915.71	-2,380,652.40
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	20,974,771.14	19,022,332.22
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	7.4.7.17	-860,828,092.46	-91,850,244.14
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	7.4.7.18	-	21,002.60
减：二、费用		72,100,145.44	71,515,419.82

1. 管理人报酬		54,614,447.35	53,532,567.37
2. 托管费		9,102,407.84	8,922,094.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	6,375,178.14	8,516,636.60
5. 利息支出		741,474.80	88,976.93
其中：卖出回购金融资产支出		741,474.80	88,976.93
6. 其他费用	7.4.7.20	1,266,637.31	455,144.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-725,603,011.83	328,849,161.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-725,603,011.83	328,849,161.19

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：同盛证券投资基金

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）	3,000,000,000.00	1,027,856,109.43	4,027,856,109.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-725,603,011.83	-725,603,011.83
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）	-	-270,000,000.00	-270,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	32,253,097.60	3,032,253,097.60
项目	上年度可比期间		
	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）	3,000,000,000.00	699,006,948.24	3,699,006,948.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	328,849,161.19	328,849,161.19
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）	3,000,000,000.00	1,027,856,109.43	4,027,856,109.43

注：后附附注为本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

同盛证券投资基金（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]30 号文《关于同意同盛证券投资基金设立的批复》批准，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募集设立。本基金为契约型封闭式，存续期为 15 年，发行规模为 30 亿份基金份额。本基金经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上字[1999]109 号文审核同意，于 1999 年 11 月 26 日在深交所挂牌交易。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《同盛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

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

卖出股票于交易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交易日结转；

2、债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全

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初始取得成本时，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初始取得成本时，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	137,285,717.73	127,966,145.60
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	137,285,717.73	127,966,145.60

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		2,321,847,577.92	2,207,149,141.22	-114,698,436.70
债券	交易所市场	33,969,256.30	33,627,469.70	-341,786.60
	银行间市场	660,545,310.00	658,372,000.00	-2,173,310.00
	合计	694,514,566.30	691,999,469.70	-2,515,096.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,016,362,144.22	2,899,148,610.92	-117,213,533.30
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		2,274,081,354.13	3,022,017,574.53	747,936,220.40
债券	交易所市场	94,958,868.54	93,952,087.30	-1,006,781.24
	银行间市场	782,847,880.00	779,533,000.00	-3,314,880.00
	合计	877,806,748.54	873,485,087.30	-4,321,661.24
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,151,888,102.67	3,895,502,661.83	743,614,559.16

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 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	27,069.88	20,859.30
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	525.90	1,334.20
应收债券利息	9,118,943.47	11,021,272.85
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	62.30	48.40
合计	9,146,601.55	11,043,514.75

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	2,023,778.68	3,068,475.75
银行间市场应付交易费用	325.00	950.00
合计	2,024,103.68	3,069,425.75

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	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	-	-
预提信息披露费用	270,000.00	-
预提审计费	95,000.00	95,000.00
合计	865,000.00	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	3,000,000,000	3,000,000,000.00
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,000,000,000	3,000,000,000.00

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	284,241,550.27	743,614,559.16	1,027,856,109.43
本期利润	135,225,080.63	-860,828,092.46	-725,603,011.83
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	-270,000,000.00	-	-270,000,000.00
本期末	149,466,630.90	-117,213,533.30	32,253,097.60

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	1,063,073.96	1,110,460.84
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	27,901.18	29,938.56
权证保证金利息收入	2,178.71	1,770.00
合计	1,093,153.85	1,142,169.40

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	2,127,797,131.21	2,902,942,032.68
减：卖出股票成本总额	1,970,706,559.43	2,446,911,777.31
买卖股票差价收入	157,090,571.78	456,030,255.37

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	上年度可比期间 2010年1月1日至
----	------------------	-----------------------

	2011年12月31日	2010年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,046,148,786.18	1,415,767,107.57
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,024,498,842.24	1,406,123,993.40
减：应收利息总额	24,654,859.65	12,023,766.57
债券投资收益	-3,004,915.71	-2,380,652.40

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	20,974,771.14	19,022,332.22
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	20,974,771.14	19,022,332.22

7.4.7.17 公允价值变动收益

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
1. 交易性金融资产	-860,828,092.46	-91,850,244.14
——股票投资	-862,634,657.10	-89,676,198.84
——债券投资	1,806,564.64	-2,174,045.30
——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	-860,828,092.46	-91,850,244.14

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	-	21,002.60

其他	-	-
合计	-	21,002.60

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	6,370,178.14	8,510,536.60
银行间市场交易费用	5,000.00	6,100.00
合计	6,375,178.14	8,516,636.60

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	17,687.31	12,144.40
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	18,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
其他手续费	805,950.00	-
合计	1,266,637.31	455,144.40

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
长江证券有限责任公司（“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

中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
长江证券	基金发起人
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
中国银行	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 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
长江证券	254,865,267.76	6.15%	82,159,796.66	1.50%
中信证券	195,187,895.12	4.71%	124,322,185.45	2.26%
国元证券	919,909,126.60	22.19%	1,324,337,057.08	24.12%

7.4.10.1.2 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	-	-	21,504,949.24	13.92%

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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	占当期回购成交 总额的比例	成交金额	占当期回购成交 总额的比例
国元证券	-	-	100,000,000.00	50.00%

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
长江证券	207,079.47	5.96%	20,346.18	1.01%
中信证券	158,591.96	4.56%	129,527.06	6.40%
国元证券	773,376.47	22.26%	405,119.61	20.02%
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
长江证券	69,835.87	1.52%	338,788.37	11.04%
中信证券	101,012.87	2.20%	101,012.87	3.29%
国元证券	1,106,927.68	24.14%	347,472.63	11.32%

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	54,614,447.35
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值的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

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	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
当期发生的基金应支付的托管费	9,102,407.84	8,922,094.52

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:

单位: 人民币元

银行间市场交易的 各关联方名称	本期					
	2011年1月1日至2011年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易 金额	利息 收入	交易金额	利息支出
中国银行	98,411,500.23	-	-	-	-	-
银行间市场交易的 各关联方名称	上年度可比期间					
	2010年1月1日至2010年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易 金额	利息 收入	交易金额	利息支出
中国银行	79,708,909.59	-	-	-	345,600,000.00	60,219.62

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	6,000,000	6,000,000
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	6,000,000	6,000,000
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.20%	0.20%

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
国元证券	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%
天津国际信托	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%
长江证券	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%
中信证券	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%

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
中国银行	137,285,717.73	1,063,073.96	127,966,145.60	1,110,460.84

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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注
1	2011-03-24	2011-03-25	0.900	270,000,000.00	-	270,000,000.00	
合计			0.900	270,000,000.00	-	270,000,000.00	

7.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002051	中工国际	2011-12-07	重大事项未公告	27.97	2012-03-19	30.00	600,000	7,913,037.08	16,782,000.00	

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，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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	137,285,717.73	-	-	-	-	-	137,285,717.73
结算备付金	1,168,707.01	-	-	-	-	-	1,168,707.01
存出保证金	138,549.12	-	-	-	-	500,000.00	638,549.12
交易性金融资产	179,256,000.00	129,853,000.00	249,055,000.00	133,835,469.70	-	2,207,149,141.22	2,899,148,610.92
应收证券清算款	-	-	-	-	-	868,092.45	868,092.45
应收利息	-	-	-	-	-	9,146,601.55	9,146,601.55
资产总计	317,848,973.86	129,853,000.00	249,055,000.00	133,835,469.70	-	2,217,663,835.22	3,048,256,278.78
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6,703,686.97	6,703,686.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,931,284.75	3,931,284.75
应付托管费	-	-	-	-	-	655,214.12	655,214.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,024,103.68	2,024,103.68
应交税费	-	-	-	-	-	1,823,891.66	1,823,891.66
其他负债	-	-	-	-	-	865,000.00	865,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	16,003,181.18	16,003,181.18
利率敏感度缺口	317,848,973.86	129,853,000.00	249,055,000.00	133,835,469.70	-	2,201,660,654.04	3,032,253,097.60
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	127,966,145.60	-	-	-	-	-	127,966,145.60
结算备付金	3,812,267.29	-	-	-	-	-	3,812,267.29
存出保证金	138,549.12	-	-	-	-	870,716.31	1,009,265.43
交易性金融资产	280,145,000.00	340,578,000.00	159,752,000.00	93,010,087.30	-	3,022,017,574.53	3,895,502,661.83
应收利息	-	-	-	-	-	11,043,514.75	11,043,514.75
资产总计	412,061,962.01	340,578,000.00	159,752,000.00	93,010,087.30	-	3,033,931,805.59	4,039,333,854.90
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,133,795.47	5,133,795.47
应付托管费	-	-	-	-	-	855,632.59	855,632.59
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,069,425.75	3,069,425.75
应交税费	-	-	-	-	-	1,823,891.66	1,823,891.66
其他负债	-	-	-	-	-	595,000.00	595,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	11,477,745.47	11,477,745.47
利率敏感度缺口	412,061,962.01	340,578,000.00	159,752,000.00	93,010,087.30	-	3,022,454,060.12	4,027,856,109.43

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	-3, 289, 364. 81	-1, 129, 634. 59
	-25 个基点	3, 289, 364. 81	1, 129, 634. 59

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 净值比例	公允价值	占基金资产 净值比例
交易性金融资产	2, 207, 149, 141. 22	72. 79%	3, 022, 017, 574. 53	75. 03%

股票投资				
交易性金融资产- 债券投资	691,999,469.70	22.82%	873,485,087.30	21.69%
合计	2,899,148,610.92	95.61%	3,895,502,661.83	96.71%

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市场价格风险进行分析。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	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
	+5%	132,811,363.92	160,574,511.66
-5%	-132,811,363.92	-160,574,511.66	

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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,207,149,141.22	72.41
	其中：股票	2,207,149,141.22	72.41
2	固定收益投资	691,999,469.70	22.70
	其中：债券	691,999,469.70	22.70
	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	138,454,424.74	4.54
6	其他各项资产	10,653,243.12	0.35
7	合计	3,048,256,278.78	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

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	23,753,092.36	0.78
B	采掘业	228,291,360.12	7.53
C	制造业	1,244,141,672.98	41.03
C0	食品、饮料	259,012,860.47	8.54
C1	纺织、服装、皮毛	87,188,766.46	2.88
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	193,871,997.30	6.39
C5	电子	11,880,000.00	0.39
C6	金属、非金属	115,002,267.60	3.79
C7	机械、设备、仪表	277,208,748.73	9.14
C8	医药、生物制品	266,375,952.32	8.78
C99	其他制造业	33,601,080.10	1.11
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	56,611,060.48	1.87
G	信息技术业	70,222,611.36	2.32
H	批发和零售贸易	176,896,540.71	5.83
I	金融、保险业	222,852,632.07	7.35
J	房地产业	151,906,317.06	5.01

K	社会服务业	16,782,000.00	0.55
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	15,691,854.08	0.52
	合计	2,207,149,141.22	72.79

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	600309	烟台万华	15,028,837	193,871,997.30	6.39
2	601318	中国平安	3,299,906	113,648,762.64	3.75
3	600036	招商银行	9,199,989	109,203,869.43	3.60
4	600123	兰花科创	2,699,910	104,972,500.80	3.46
5	600031	三一重工	8,000,000	100,320,000.00	3.31
6	601607	上海医药	8,072,306	89,441,150.48	2.95
7	600519	贵州茅台	450,000	86,985,000.00	2.87
8	600266	北京城建	6,999,946	86,729,330.94	2.86
9	000581	威孚高科	2,249,907	80,749,162.23	2.66
10	000937	冀中能源	4,349,910	73,339,482.60	2.42
11	000423	东阿阿胶	1,537,400	66,031,330.00	2.18
12	000926	福星股份	9,205,789	65,176,986.12	2.15
13	600582	天地科技	3,265,996	60,420,926.00	1.99
14	600570	恒生电子	3,774,514	46,200,051.36	1.52
15	002029	七匹狼	1,292,326	45,619,107.80	1.50
16	000895	双汇发展	643,829	45,035,838.55	1.49
17	600276	恒瑞医药	1,500,000	44,160,000.00	1.46
18	000568	泸州老窖	1,157,373	43,170,012.90	1.42
19	002024	苏宁电器	5,063,723	42,737,822.12	1.41
20	000028	一致药业	1,975,521	42,177,373.35	1.39
21	600655	豫园商城	4,612,346	38,651,459.48	1.27
22	600252	中恒集团	3,396,782	36,073,824.84	1.19
23	600585	海螺水泥	2,299,944	35,994,123.60	1.19
24	600690	青岛海尔	3,999,850	35,718,660.50	1.18
25	002345	潮宏基	1,297,339	33,601,080.10	1.11
26	600125	铁龙物流	3,435,200	31,878,656.00	1.05
27	600809	山西汾酒	451,013	28,476,960.82	0.94
28	600693	东百集团	4,099,907	28,289,358.30	0.93
29	000933	神火股份	3,000,000	27,720,000.00	0.91
30	600702	沱牌舍得	1,600,000	26,608,000.00	0.88
31	600221	海南航空	5,520,626	24,732,404.48	0.82
32	002299	圣农发展	1,601,692	23,753,092.36	0.78
33	002612	朗姿股份	799,826	22,811,037.52	0.75

34	601918	国投新集	1,999,944	22,259,376.72	0.73
35	000786	北新建材	2,013,200	21,984,144.00	0.73
36	600600	青岛啤酒	600,000	20,088,000.00	0.66
37	000401	冀东水泥	1,200,000	20,004,000.00	0.66
38	000629	攀钢钒钛	3,000,000	18,840,000.00	0.62
39	600177	雅戈尔	1,999,853	18,758,621.14	0.62
40	600720	祁连山	2,000,000	18,180,000.00	0.60
41	000538	云南白药	338,899	17,961,647.00	0.59
42	002051	中工国际	600,000	16,782,000.00	0.55
43	600415	小商品城	2,001,512	15,691,854.08	0.52
44	002153	石基信息	552,000	14,092,560.00	0.46
45	000963	华东医药	478,983	12,750,527.46	0.42
46	600267	海正药业	400,000	12,708,000.00	0.42
47	600739	辽宁成大	1,000,000	12,290,000.00	0.41
48	600060	海信电器	1,000,000	11,880,000.00	0.39
49	600271	航天信息	500,000	9,930,000.00	0.33
50	000869	张裕A	80,158	8,649,048.20	0.29

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	601607	上海医药	166,867,857.88	4.14
2	000933	神火股份	90,889,096.12	2.26
3	600418	江淮汽车	71,780,467.35	1.78
4	600309	烟台万华	69,955,004.88	1.74
5	600720	祁连山	57,189,542.05	1.42
6	600585	海螺水泥	51,590,811.61	1.28
7	600123	兰花科创	50,822,618.46	1.26
8	000629	攀钢钒钛	50,642,916.65	1.26
9	600325	华发股份	49,182,796.59	1.22
10	600036	招商银行	48,620,050.23	1.21
11	600425	青松建化	46,132,210.17	1.15
12	600570	恒生电子	44,733,669.23	1.11
13	600690	青岛海尔	43,573,674.99	1.08
14	000926	福星股份	41,465,265.89	1.03
15	600693	东百集团	39,836,389.75	0.99
16	600125	铁龙物流	38,566,460.19	0.96
17	002345	潮宏基	37,275,019.15	0.93
18	600060	海信电器	36,159,190.61	0.90
19	002299	圣农发展	34,554,698.44	0.86

20	600221	海南航空	34,112,771.72	0.85
----	--------	------	---------------	------

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	000338	潍柴动力	118,363,170.79	2.94
2	601088	中国神华	79,673,953.47	1.98
3	600655	豫园商城	78,177,221.32	1.94
4	000937	冀中能源	75,197,772.50	1.87
5	600739	辽宁成大	74,466,712.69	1.85
6	600089	特变电工	68,372,378.15	1.70
7	600266	北京城建	67,309,044.54	1.67
8	601699	潞安环能	64,520,518.95	1.60
9	000933	神火股份	63,137,344.19	1.57
10	600765	中航重机	54,744,567.36	1.36
11	600309	烟台万华	52,363,175.96	1.30
12	600519	贵州茅台	48,788,769.52	1.21
13	600325	华发股份	46,824,633.46	1.16
14	000063	中兴通讯	45,855,007.17	1.14
15	000792	盐湖股份	44,704,014.53	1.11
16	000880	潍柴重机	44,630,641.38	1.11
17	600271	航天信息	43,560,597.65	1.08
18	000527	美的电器	42,906,398.72	1.07
19	600425	青松建化	41,460,171.47	1.03
20	600418	江淮汽车	40,140,441.69	1.00

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	2,018,472,783.22
卖出股票收入（成交）总额	2,127,797,131.21

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 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。

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	33,627,469.70	1.11
2	央行票据	48,370,000.00	1.60
3	金融债券	610,002,000.00	20.12

	其中：政策性金融债	610,002,000.00	20.12
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	691,999,469.70	22.82

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	100209	10 国开 09	1,500,000	149,190,000.00	4.92
2	080411	08 农发 11	1,000,000	100,460,000.00	3.31
3	110203	11 国开 03	700,000	70,154,000.00	2.31
4	070228	07 国开 28	500,000	50,225,000.00	1.66
5	080207	08 国开 07	500,000	50,150,000.00	1.65

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 声明本报告期内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记录，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	638,549.12

2	应收证券清算款	868,092.45
3	应收股利	-
4	应收利息	9,146,601.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,653,243.12

8.9.4 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。

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
55,280	54,269.18	1,792,295,274	59.74%	1,207,704,726	40.26%

9.2 期末上市基金前十名持有人

份额单位：份

序号	持有人名称	持有份额	占上市份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	298,836,834	9.96%
2	中国人寿保险（集团）公司	259,876,557	8.66%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	144,139,884	4.80%
4	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品	125,851,744	4.20%
5	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红-019L-FH002 深	110,207,522	3.67%
6	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品-013C-CT001 深	71,799,975	2.39%
7	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—银保分红	65,999,935	2.20%
8	阳光财产保险股份有限公司—自有资金	63,039,147	2.10%
9	泰康人寿保险股份有限公司—万能—个险万能	56,307,867	1.88%
10	UBS AG	48,476,339	1.62%

§ 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

本报告期本基金的基金经理未曾变更。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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没有改变。

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，报告期内共支付安永华明会计师事务所审计费用 95,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 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单元进行股票投资及佣金支付情况

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
国泰君安	2	605,999,159.01	14.62%	492,376.33	14.17%
招商证券	1	-	-	-	-
中信证券	1	195,187,895.12	4.71%	158,591.96	4.56%
银河证券	2	1,424,819,477.76	34.36%	1,211,091.50	34.86%
国元证券	2	919,909,126.60	22.19%	773,376.47	22.26%
国信证券	1	65,537,907.41	1.58%	55,707.22	1.60%
海通证券	1	-	-	-	-
长江证券	2	254,865,267.76	6.15%	207,079.47	5.96%
东方证券	1	633,689,853.72	15.28%	538,634.37	15.50%
齐鲁证券	1	46,261,227.05	1.12%	37,587.68	1.08%

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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
国泰君安	2	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
银河证券	2	19,171,099.20	65.78%	80,000,000.00	28.57%
国元证券	2	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-
东方证券	1	9,975,000.00	34.22%	200,000,000.00	71.43%
齐鲁证券	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) 资质雄厚，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》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。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，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元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交易单元的变更情况：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	法定披露日期
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	关于旗下基金持有“中恒集团”估值方法调整的公告	同上	2011-08-26
3	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
4	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
5	长盛基金管理有限公司总经理变更公告	同上	2011-05-14
6	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
7	长盛基金管理有限公司关于旗下基金持有的“双汇发展”估值方法调整的公告	同上	2011-03-22

8	同盛证券投资基金 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) 《同盛证券投资基金基金合同》；
- (三) 《同盛证券投资基金托管协议》；
- (四) 《同盛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印件或复印件。

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>。