

同盛证券投资基金  
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。

基金托管人中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录 .....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	4
2.1 基金基本情况 .....	4
2.2 基金产品说明 .....	4
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	4
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
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 .....	9
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 .....	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 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
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 .....	12
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 .	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13

6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	17
<b>§ 7 投资组合报告.....</b>	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	31
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 .....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	34
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 ...	35
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 .....	35
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 ...	35
7.9 投资组合报告附注 .....	35
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	37
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	37
<b>§ 9 重大事件揭示.....</b>	<b>38</b>
9.1 基金份额持有人大会决议 .....	38
9.2 本报告期内基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动 ...	38
9.3 涉及基金管理人，基金财产，基金托管业务的诉讼 .....	38
9.4 基金投资策略的改变 .....	38
9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	38
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 .....	38
9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
9.8 其他重大事件 .....	40
<b>§ 10 备查文件目录.....</b>	<b>41</b>

10.1 备查文件目录 .....	41
10.2 存放地点 .....	41
10.3 查阅方式 .....	41

## § 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 010-62350088	95566
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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	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
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	-65,298,949.26
本期利润	211,943,515.10
加权平均基金份额本期利润	0.0706
本期加权平均净值利润率	6.62%
本期基金份额净值增长率	7.02%
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	54,167,681.64
期末可供分配基金份额利润	0.0181
期末基金资产净值	3,214,196,612.70
期末基金份额净值	1.0714
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	289.26%

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

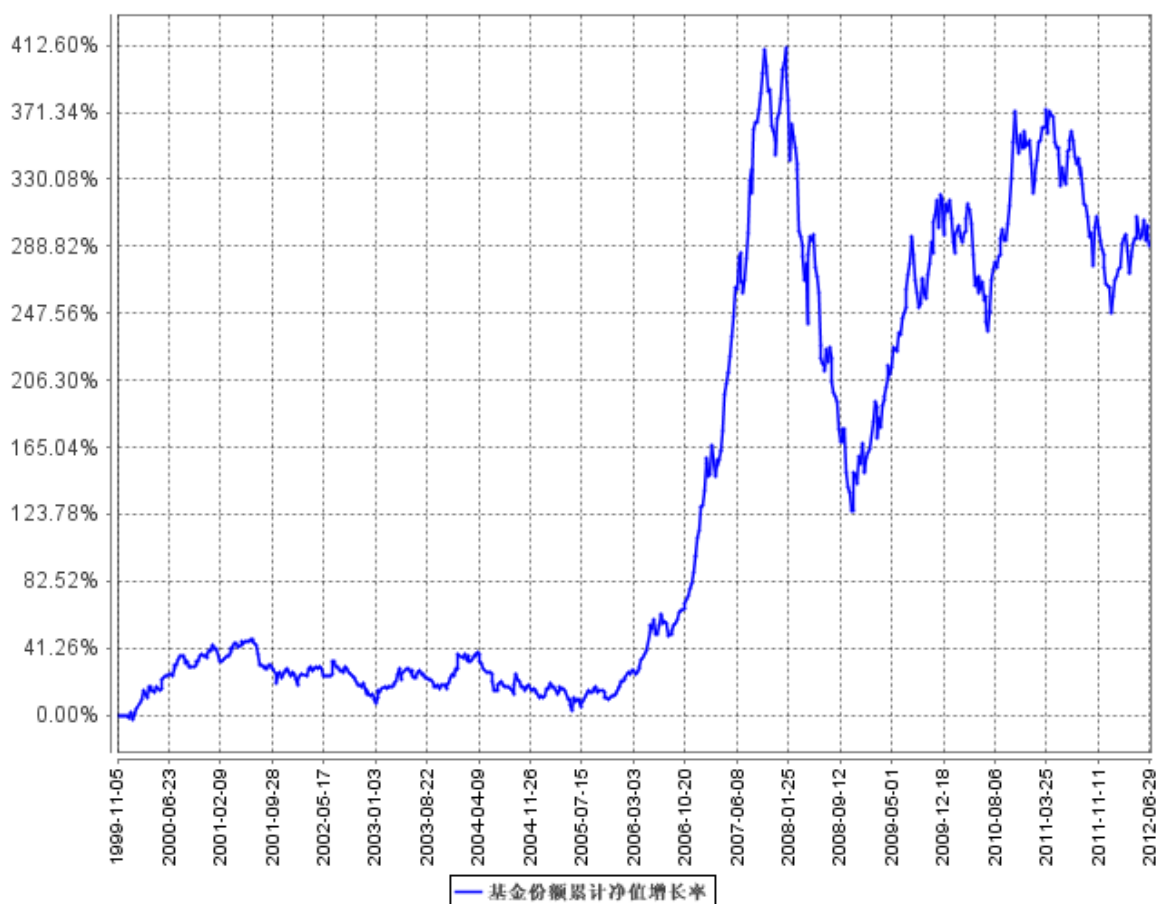
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②
过去一个月	-1.61%	2.23%
过去三个月	4.65%	2.05%
过去六个月	7.02%	2.19%
过去一年	-12.97%	2.19%
过去三年	10.94%	2.42%
自基金合同生效起至今	289.26%	2.59%

注：本基金无业绩比较基准收益率，无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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

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	—	11年	男,1974年5月出生,中国国籍。清华大学博士。历任国泰君安证券研究所研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司,现任研究发展部总监,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	—	11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、报经中国证券业协会同意,目前丁骏同志已不再担任同盛证券投资基金基金经理,该基金由侯继雄同志继续负责管理。该事项公司已于2012年7月24日进行公告;

2、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；

3、“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

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 上半年，政策放松预期和经济惯性下滑位于股指跷跷板的两端。市场利率的下降配之 PMI 的环比上升会推动指数的上涨；工业增加值增速回落、大宗原材料产品下跌和企业盈利预警则会推动指数下跌。在 1 季度市场经历了一个上升和下跌的循环后，2 季度再次经历了一个上升和下跌的循环。本基金上半年维持了组合的相对均衡，适度减持了周期股、适度增配了消费股，仓位大体稳定。

##### **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 1.0714 元，本报告期份额净值增长率为 7.02%。

#### **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**

展望下半年，本基金仍维持震荡市的观点。2012 年政策基调仍将以稳为主。宏观经济的复苏持续低于投资者的期望，但仍在决策层的容忍范围内；新的经济增长动力方向不明，积极的政策也难以明确方向；虽然 2 季度通胀回落幅度明显，但房地产销量的回暖又很快在房价上有所体现，也使得政府无法出台刺激性的房地产放松政策。全年防御性的政策抉择仍是大概率事件，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。因此，无论是从政策还是经济规律来看，股市的震荡格局还将延续。

3 季度本基金仍将坚持自下而上的投资策略，看好食品饮料、医药等稳健成长类股票。鉴于经济已经进入筑底阶段，本基金也会在低估值基础上配置中游成长股和上游资源股，并会密切跟踪周期类板块的进攻性机会。

#### 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，本基金于2012年3月29日对2011年收益进行了分配，分配金额为30,000,000.00元。

本基金截至2012年6月30日，期末可供分配收益为54,167,681.64元，期末未分配收益为214,196,612.70元，其中：未分配收益已实现部分为54,167,681.64元，未分配收益未实现部分为160,028,931.06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以及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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：同盛证券投资基金

报告截止日：2012年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	173,181,083.20	137,285,717.73
结算备付金		1,619,067.52	1,168,707.01
存出保证金		500,000.00	638,549.12
交易性金融资产	6.4.7.2	3,039,720,960.79	2,899,148,610.92
其中：股票投资		2,360,468,900.89	2,207,149,141.22
基金投资		-	-
债券投资		679,252,059.90	691,999,469.70
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	-	-
应收证券清算款		6,332,227.29	868,092.45
应收利息	6.4.7.5	6,692,479.62	9,146,601.55
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>3,228,045,818.42</b>	<b>3,048,256,278.78</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年6月30日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		4,889,046.34	6,703,686.97
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,026,742.88	3,931,284.75
应付托管费		671,123.83	655,214.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,727,064.43	2,024,103.68
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	6.4.7.8	711,336.58	865,000.00
<b>负债合计</b>		<b>13,849,205.72</b>	<b>16,003,181.18</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	6.4.7.10	214,196,612.70	32,253,097.60
<b>所有者权益合计</b>		<b>3,214,196,612.70</b>	<b>3,032,253,097.60</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>3,228,045,818.42</b>	<b>3,048,256,278.78</b>

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0714 元，基金份额总额 3,000,000,000 份。

## 6.2 利润表

会计主体：同盛证券投资基金

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	附注号	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
<b>一、收入</b>		<b>243,410,242.48</b>	<b>10,371,464.24</b>
1. 利息收入		15,710,008.95	15,495,368.41
其中：存款利息收入	6.4.7.11	613,613.03	575,090.90
债券利息收入		15,011,309.70	14,794,541.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		85,086.22	125,736.42
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-49,542,230.83	239,900,218.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-71,777,568.38	230,377,708.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	149,950.00	-2,501,043.47
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	22,085,387.55	12,023,553.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	277,242,464.36	-245,024,122.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		<b>31,466,727.38</b>	<b>39,226,777.37</b>
1. 管理人报酬		23,832,437.29	28,713,920.42
2. 托管费		3,972,072.92	4,785,653.40
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,347,350.73	3,955,175.60
5. 利息支出		-	741,474.80
其中：卖出回购金融资产支出		-	741,474.80
6. 其他费用	6.4.7.19	314,866.44	1,030,553.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>211,943,515.10</b>	<b>-28,855,313.13</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>211,943,515.10</b>	<b>-28,855,313.13</b>



### 6.3 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：2012年1月1日至2012年6月30日。

单位：人民币元

项 目	本期 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）	3,000,000,000.00	32,253,097.60	3,032,253,097.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	211,943,515.10	211,943,515.10
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）	-	-30,000,000.00	-30,000,000.00
<b>五、期末所有者权益（基金净值）</b>	<b>3,000,000,000.00</b>	<b>214,196,612.70</b>	<b>3,214,196,612.70</b>
项 目	上年度可比期间 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）	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）	-	-28,855,313.13	-28,855,313.13
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
<b>五、期末所有者权益（基金净值）</b>	<b>3,000,000,000.00</b>	<b>729,000,796.30</b>	<b>3,729,000,796.30</b>

注：报表附注为本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

基金管理人负责人

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（以下简称“中信证券”）、长江证券有限责任公司（以下简称“长江证券”）、天津北方国际信托投资股份有限公司（以下简称“北方国际信托”）、国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）和长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”）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。

### 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、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、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》和《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而编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 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：**本报告期不存在会计政策变更。

**6.4.5.2 会计估计变更的说明：**本报告期不存在会计估计变更。

**6.4.5.3 差错更正的说明：**本报告期不存在差错更正。

#### **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[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；

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；

### 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。

#### 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

项目	本期末 2012年6月30日
活期存款	173,181,083.20
定期存款	-
其他存款	-
合计	173,181,083.20

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	2,203,510,673.43	2,360,468,900.89	156,958,227.46	
债券	交易所市场	33,969,256.30	33,916,059.90	-53,196.40
	银行间市场	642,212,100.00	645,336,000.00	3,123,900.00
	合计	676,181,356.30	679,252,059.90	3,070,703.60
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,879,692,029.73	3,039,720,960.79	160,028,931.06	

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末（2012年6月30日）衍生金融资产/负债余额为零。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末（2012年6月30日）的买入返售金融资产项目余额为零。

#### 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	20,249.57
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	655.65
应收债券利息	6,671,574.40
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
<b>合计</b>	<b>6,692,479.62</b>

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（2012年6月30日）的其他资产项目余额为零。

#### 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	1,726,839.43
银行间市场应付交易费用	225.00
<b>合计</b>	<b>1,727,064.43</b>

#### 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	500,000.00
预提费用	211,336.58
<b>合计</b>	<b>711,336.58</b>

#### 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	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

#### 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	149,466,630.90	-117,213,533.30	32,253,097.60
本期利润	-65,298,949.26	277,242,464.36	211,943,515.10
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	-30,000,000.00	-	-30,000,000.00
本期末	54,167,681.64	160,028,931.06	214,196,612.70

#### 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	594,150.82	
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	19,075.61	
其他	386.60	
合计	613,613.03	

#### 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	1,111,244,202.96	
减：卖出股票成本总额	1,183,021,771.34	
买卖股票差价收入	-71,777,568.38	

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2012年1月1日至2012年6月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	50,000,000.00	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	48,250,050.00	
减：应收利息总额	1,600,000.00	
债券投资收益	149,950.00	

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期间（2012年1月1日-2012年6月30日）衍生工具收益为零。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2012年1月1日至2012年6月30日	
股票投资产生的股利收益	22,085,387.55	
基金投资产生的股利收益	-	
合计	22,085,387.55	

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	277,242,464.36
——股票投资	271,656,664.16
——债券投资	5,585,800.20
——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	277,242,464.36

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期（2012年1月1日-2012年6月30日）未取得其他收入。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	3,347,125.73
银行间市场交易费用	225.00
合计	3,347,350.73

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
银行费用	4,979.86
信息披露费	134,261.40
审计费用	47,239.92
上市年费	29,835.26
分红手续费	89,550.00
账户维护费	9,000.00
合计	314,866.44

#### 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

本基金无需披露的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未发生变化的情况。

#### 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
长江证券	基金发起人
长盛基金	基金发起人、基金管理人
中国银行	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 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	
	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	379,245,306.86	17.43%	95,928,008.84	3.81%
中信证券	-	-	11,001,207.66	0.44%
国元证券	-	-	434,404,321.35	17.24%
合计	379,245,306.86	17.43%	541,333,537.85	21.48%

##### 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

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债券交易。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

##### 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 2012年1月1日至2012年6月30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	326,302.83	17.79%	326,302.83	18.90%
中信证券	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-
合计	326,302.83	17.79%	326,302.83	18.90%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	77,941.79	3.69%	416,730.16	8.86%
中信证券	8,938.54	0.42%	8,938.54	0.19%
国元证券	368,256.86	17.42%	715,729.49	15.21%
<b>合计</b>	<b>455,137.19</b>	<b>21.53%</b>	<b>1,141,398.19</b>	<b>24.26%</b>

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

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
当期发生的基金应支付的管理费	23,832,437.29	28,713,920.42
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的基金资产净值的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为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值（扣除本基金持有现金比例超过20%部分的基金资产净值）

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，若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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
当期发生的基金应支付的托管费	3,972,072.92	4,785,653.40

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为每日应计提的基金托管费

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：

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30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
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	49,724,291.76	-	-	-	-	-
合计	49,724,291.76	-	-	-	-	-

#### 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
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。

##### 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%
北方国际信托	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。

#### 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

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	173,181,083.20	594,150.82	202,133,136.99	558,119.94

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

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	2012-03-28	2012-03-29	0.100	30,000,000.00	-	30,000,000.00	
合计			0.100	30,000,000.00	-	30,000,000.00	

#### 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

本基金本报告期末无因认购新发/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等流通受限股票

本基金本报告期末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

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

#### **6.4.13.2 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。

#### **6.4.13.3 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约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。

#### **6.4.13.4 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。

##### **6.4.13.4.1 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

本期末 2012年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	不计息	合计
<b>资产</b>						
银行存款	173,181,083.20	-	-	-	-	173,181,083.20
结算备付金	1,619,067.52	-	-	-	-	1,619,067.52
存出保证金	-	-	-	-	500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	181,797,000.00	131,024,000.00	201,240,000.00	165,191,059.90	2,360,468,900.89	3,039,720,960.79
应收证券清算款	-	-	-	-	6,332,227.29	6,332,227.29
应收利息	-	-	-	-	6,692,479.62	6,692,479.62
<b>资产总计</b>	<b>356,597,150.72</b>	<b>131,024,000.00</b>	<b>201,240,000.00</b>	<b>165,191,059.90</b>	<b>2,373,993,607.80</b>	<b>3,228,045,818.42</b>
<b>负债</b>						
应付证券清算款	-	-	-	-	4,889,046.34	4,889,046.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,026,742.88	4,026,742.88
应付托管费	-	-	-	-	671,123.83	671,123.83
应付交易费用	-	-	-	-	1,727,064.43	1,727,064.43
应交税费	-	-	-	-	1,823,891.66	1,823,891.66
其他负债	-	-	-	-	711,336.58	711,336.58
<b>负债总计</b>					<b>13,849,205.72</b>	<b>13,849,205.72</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>356,597,150.72</b>	<b>131,024,000.00</b>	<b>201,240,000.00</b>	<b>165,191,059.90</b>	<b>2,360,144,402.08</b>	<b>3,214,196,612.70</b>
<b>上年度末 2011年12月31日</b>	<b>1个月以内</b>	<b>1-3个月</b>	<b>3个月-1年</b>	<b>1-5年</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>						
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
<b>资产总计</b>	<b>317,848,973.86</b>	<b>129,853,000.00</b>	<b>249,055,000.00</b>	<b>133,835,469.70</b>	<b>2,217,663,835.22</b>	<b>3,048,256,278.78</b>
<b>负债</b>						
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
<b>负债总计</b>					<b>16,003,181.18</b>	<b>16,003,181.18</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>317,848,973.86</b>	<b>129,853,000.00</b>	<b>249,055,000.00</b>	<b>133,835,469.70</b>	<b>2,201,660,654.04</b>	<b>3,032,253,097.60</b>

#### 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。		
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 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	+25 个基点	-3,090,153.04	-3,289,364.81
-25 个基点	+3,090,153.04	+3,289,364.81	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，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

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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-股票投资	2,360,468,900.89	73.44	2,207,149,141.22	72.79
交易性金融资产-债券投资	679,252,059.90	21.13	691,999,469.70	22.82
合计	3,039,720,960.79	94.57	2,899,148,610.92	95.61

##### 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。		
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 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	+150,409,937.59	+132,811,363.92
	业绩比较基准下降 5%	-150,409,937.59	-132,811,363.92

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

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	2,360,468,900.89	73.12
	其中：股票	2,360,468,900.89	73.12
2	固定收益投资	679,252,059.90	21.04
	其中：债券	679,252,059.90	21.04
	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	174,800,150.72	5.42
6	其他各项资产	13,524,706.91	0.42
7	合计	3,228,045,818.42	100.00

### 7.2 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	25,823,225.28	0.80
B	采掘业	164,882,774.75	5.13
C	制造业	1,370,751,703.71	42.65
C0	食品、饮料	432,974,656.32	13.47
C1	纺织、服装、皮毛	91,630,231.97	2.85
C2	木材、家具	1,799,427.60	0.06
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	205,930,047.60	6.41
C5	电子	3,667,201.44	0.11
C6	金属、非金属	51,244,808.00	1.59
C7	机械、设备、仪表	343,274,087.33	10.68
C8	医药、生物制品	183,832,421.37	5.72
C99	其他制造业	56,398,822.08	1.75
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,853,888.00	0.06
F	交通运输、仓储业	31,366,382.18	0.98
G	信息技术业	97,163,712.00	3.02
H	批发和零售贸易	148,721,430.86	4.63
I	金融、保险业	271,065,490.00	8.43
J	房地产业	195,402,286.60	6.08
K	社会服务业	31,799,322.71	0.99



L	传播与文化产业	21,638,684.80	0.67
M	综合类	-	-
	合计	2,360,468,900.89	73.44

### 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

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	14,332,037	191,332,693.95	5.95
2	601318	中国平安	3,299,906	150,937,700.44	4.70
3	600519	贵州茅台	594,246	142,113,930.90	4.42
4	600031	三一重工	8,000,000	111,360,000.00	3.46
5	000926	福星股份	10,451,531	97,617,299.54	3.04
6	601918	国投新集	5,983,846	73,062,759.66	2.27
7	600266	北京城建	4,517,774	68,624,987.06	2.14
8	600276	恒瑞医药	2,306,305	66,214,016.55	2.06
9	601166	兴业银行	5,036,181	65,369,629.38	2.03
10	600582	天地科技	4,274,199	61,762,175.55	1.92
11	000028	国药一致	1,975,521	58,831,015.38	1.83
12	600702	沱牌舍得	1,600,000	58,000,000.00	1.80
13	000937	冀中能源	3,731,301	56,976,966.27	1.77
14	002345	潮宏基	2,432,032	56,398,822.08	1.75
15	000581	威孚高科	2,001,090	54,829,866.00	1.71
16	002304	洋河股份	397,137	53,434,783.35	1.66
17	000423	东阿阿胶	1,272,408	50,909,044.08	1.58
18	600570	恒生电子	3,400,000	46,648,000.00	1.45
19	600655	豫园商城	5,612,326	44,225,128.88	1.38
20	002029	七匹狼	1,541,400	42,850,920.00	1.33
21	000895	双汇发展	643,829	39,840,138.52	1.24
22	600059	古越龙山	2,694,000	38,443,380.00	1.20
23	000651	格力电器	1,734,624	36,166,910.40	1.13
24	600271	航天信息	1,813,000	34,283,830.00	1.07
25	600809	山西汾酒	902,026	33,997,359.94	1.06
26	600123	兰花科创	1,820,923	32,885,869.38	1.02
27	600739	辽宁成大	2,000,000	31,200,000.00	0.97
28	000661	长春高新	657,505	31,073,686.30	0.97
29	600383	金地集团	4,500,000	29,160,000.00	0.91
30	600125	铁龙物流	3,435,200	29,130,496.00	0.91
31	600600	青岛啤酒	727,367	27,778,145.73	0.86
32	000563	陕国投A	1,999,866	27,458,160.18	0.85
33	600036	招商银行	2,500,000	27,300,000.00	0.85
34	002051	中工国际	993,376	26,384,066.56	0.82
35	000786	北新建材	2,013,200	26,050,808.00	0.81
36	002299	圣农发展	1,788,312	25,823,225.28	0.80
37	600177	雅戈尔	2,999,853	25,468,751.97	0.79
38	600585	海螺水泥	1,700,000	25,194,000.00	0.78

39	600690	青岛海尔	2,000,000	23,440,000.00	0.73
40	002612	朗姿股份	640,400	23,310,560.00	0.73
41	600637	百视通	1,651,808	21,638,684.80	0.67
42	000927	一汽夏利	2,788,528	20,439,910.24	0.64
43	000538	云南白药	338,899	20,089,932.72	0.63
44	000869	张裕A	293,096	19,713,636.96	0.61
45	000858	五粮液	599,917	19,653,280.92	0.61
46	002050	三花股份	1,677,732	18,438,274.68	0.57
47	000963	华东医药	478,983	14,465,286.60	0.45
48	002153	石基信息	552,000	14,158,800.00	0.44
49	600079	人福医药	580,108	13,452,704.52	0.42
50	603001	奥康国际	468,690	12,612,447.90	0.39
51	002073	软控股份	826,667	6,927,469.46	0.22
52	600686	金龙汽车	1,000,000	6,560,000.00	0.20
53	002400	省广股份	282,781	5,415,256.15	0.17
54	600115	东方航空	534,901	2,235,886.18	0.07
55	002138	顺络电子	189,600	2,163,336.00	0.07
56	600521	华海药业	138,520	2,093,037.20	0.07
57	600498	烽火通信	78,200	2,073,082.00	0.06
58	002250	联化科技	115,067	1,984,905.75	0.06
59	600489	中金黄金	90,947	1,957,179.44	0.06
60	002482	广田股份	106,240	1,853,888.00	0.06
61	002572	索菲亚	92,754	1,799,427.60	0.06
62	002662	京威股份	82,300	1,760,397.00	0.05
63	601717	郑煤机	136,990	1,589,084.00	0.05
64	002484	江海股份	138,096	1,503,865.44	0.05

#### 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	601166	兴业银行	69,208,261.62	2.28
2	601918	国投新集	56,216,263.66	1.85
3	600059	古越龙山	54,577,304.01	1.80
4	002304	洋河股份	52,852,910.81	1.74
5	600637	百视通	45,350,796.46	1.50
6	600176	中国玻纤	40,672,476.52	1.34
7	600271	航天信息	38,683,167.70	1.28
8	000651	格力电器	37,333,811.44	1.23
9	000926	福星股份	32,587,972.25	1.07
10	600383	金地集团	31,659,636.56	1.04
11	600111	包钢稀土	31,607,970.68	1.04
12	601788	光大证券	30,039,405.52	0.99
13	000661	长春高新	29,427,563.76	0.97
14	000563	陕国投A	29,358,953.34	0.97

15	002345	潮宏基	28,949,801.18	0.95
16	600519	贵州茅台	28,759,492.00	0.95
17	000629	攀钢钒钛	28,536,920.50	0.94
18	601818	光大银行	27,643,842.00	0.91
19	002050	三花股份	20,421,719.73	0.67
20	000858	五粮液	20,036,681.88	0.66

#### 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	600036	招商银行	93,611,128.07	3.09
2	601607	上海医药	90,455,002.40	2.98
3	600123	兰花科创	84,651,497.60	2.79
4	000629	攀钢钒钛	53,373,894.00	1.76
5	002024	苏宁电器	52,036,712.89	1.72
6	600111	包钢稀土	43,815,028.72	1.44
7	000568	泸州老窖	43,691,586.31	1.44
8	600060	海信电器	41,490,615.09	1.37
9	600266	北京城建	40,282,061.45	1.33
10	600176	中国玻纤	36,084,705.20	1.19
11	601788	光大证券	34,371,322.00	1.13
12	000933	神火股份	32,563,975.11	1.07
13	600690	青岛海尔	30,537,769.68	1.01
14	600693	东百集团	28,373,089.49	0.94
15	600059	古越龙山	27,832,470.60	0.92
16	600252	中恒集团	26,933,917.04	0.89
17	601818	光大银行	26,531,507.27	0.87
18	600221	海南航空	24,522,094.81	0.81
19	600637	百视通	21,485,594.54	0.71
20	000926	福星股份	20,995,808.90	0.69

#### 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	1,064,684,866.85
卖出股票收入（成交）总额	1,111,244,202.96

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	33,916,059.90	1.06
2	央行票据	-	-

3	金融债券	645,336,000.00	20.08
	其中：政策性金融债	645,336,000.00	20.08
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	679,252,059.90	21.13

#### 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

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	151,410,000.00	4.71
2	080411	08 农发 11	1,000,000	100,660,000.00	3.13
3	110203	11 国开 03	700,000	70,630,000.00	2.20
4	100230	10 国开 30	500,000	50,400,000.00	1.57
5	030203	03 国开 03	500,000	50,325,000.00	1.57

#### 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

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。

##### 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

本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	500,000.00
2	应收证券清算款	6,332,227.29
3	应收股利	-
4	应收利息	6,692,479.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,524,706.91

### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 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未存在流通受限情况。

### 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

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
54,111	55,441.59	1,831,399,674	61.05%	1,168,600,326	38.95%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	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	136,945,509	4.56%
4	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L-FH002 深	126,157,464	4.21%
5	阳光人寿保险股份有限公司—分红保险产品	100,420,523	3.35%
6	中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品—013C-CT001 深	78,799,890	2.63%
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	嘉禾人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	60,114,379	2.00%
9	阳光财产保险股份有限公司—自有资金	59,039,147	1.97%
10	UBS AG	48,476,339	1.62%

## § 9 重大事件揭示

### 9.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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。

### 9.4 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。

### 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 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	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-
长江证券	2	379,245,306.86	17.43%	326,302.83	17.79%
东方证券	1	1,124,149,689.15	51.66%	957,760.10	52.22%
齐鲁证券	1	672,534,073.80	30.91%	550,153.94	29.99%

### 9.7.2 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	债券回购交易	
		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	-	-
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	680,000,000.00	100.00%
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。

## 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	2012-04-17
2	同盛证券投资基金 2011 年度收益分配公告	同上	2012-03-21

## § 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、《同盛证券投资基金基金合同》；
- 3、《同盛证券投资基金托管协议》；
- 4、《同盛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>。