长盛中证100指数证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月25日

§1 重要提示

基金管理人长盛基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2010年7月1日起至2010年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛中证100指数
交易代码	519100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月22日
报告期末基金份额总额	1,315,921,512.29份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在4%以下,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用复制指数投资策略,按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪基准指数。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金,风险中等,将获得证券市场平均收益率。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略,在投资管理上将最大限度的分散非系统性风险。对于跟踪误差的风险,本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2010年7月1日—2010年9月30日)
1.本期已实现收益	-31,956,156.12
2.本期利润	91,370,169.71
3.加权平均基金份额本期利润	0.0683
4.期末基金资产净值	1,047,665,129.43
5.期末基金份额净值	0.7961

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2010年9月30日。

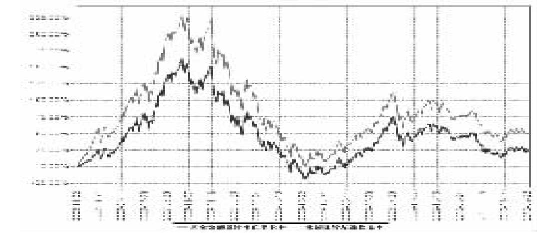
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.22%	1.25%	9.29%	1.20%	-0.07%	0.05%

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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
白仲光	本基金基金经理,金融工程与量化投资部总监。	2009年03月09日	-	7年	男,1969年8月出生,中国国籍。天津大学博士。1991年至1997年在石家庄经济学院任教,2003年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究员、高级金融工程师、基金经理等职务,现任金融工程与量化投资部总监,长盛中证100指数证券投资基金(本基金)基金经理。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日;

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,下同。

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、《长盛中证100指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 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

中国跟多数经济体一样仍处于内外再平衡的过程中,强劲的消费帮助我们在出口受阻的情况下继续保持经济快速增长,但内外经济的再平衡迫使中国增加汇率灵活性和进一步依赖国内增长来源。3季度通胀预期增强,食品饮料和资源等抗通胀板块表现较好。

在操作中,我们严格遵守基金合同,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

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0.7961,告期份额净值增长率为9.22%,较基准增长率为9.29%。本报告期内日均跟踪误差为0.0936%,年度化跟踪误差为1.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济需要重新平衡增长,更多地依靠国内增长来源,未来政策将以货币紧缩和提高汇率灵活性为主,财政紧缩为辅。消除高储蓄率和投资扭曲将促进这种平衡。中国在今后很长时间将进一步放松管制、改革金融部门和公司治理以及增强社会安全网建设。产品和服务与这种潮流适应的上市公司或将受益。

作为指数基金,我们将继续秉承指数化投资策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,控制基金的跟踪误差,在此基础上本基金将积极采用数量化投资策略增强指数,力争获取超额收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	986,027,277.45	93.65
	其中:股票	986,027,277.45	93.65
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	64,942,443.70	6.17
6	其他资产	1,867,681.85	0.18
7	合计	1,052,837,403.00	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 指数投资部分

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	119,889,492.06	11.44
C	制造业	237,561,710.88	22.68
C0	食品、饮料	49,922,104.91	4.77
C1	纺织、服装、皮毛	4,152,002.30	0.40
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	16,377,693.76	1.56
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	47,078,681.99	4.49
C7	机械、设备、仪表	120,031,227.92	11.46
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	29,095,578.34	2.78
E	建筑业	26,413,296.50	2.52
F	交通运输、仓储业	58,979,900.98	5.63
G	信息技术业	25,607,889.64	2.44
H	批发和零售贸易	21,700,323.46	2.07
I	金融、保险业	416,178,068.83	39.72
J	房地产业	41,564,591.96	3.97
K	社会服务业	3,869,561.70	0.37
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	5,166,863.10	0.49
	合计	986,027,277.45	94.12

5.2.2 积极投资部分

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
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	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

5.3 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,229,851	65,046,819.39	6.21
2	600036	招商银行	3,939,408	51,015,333.60	4.87
3	601166	兴业银行	1,762,685	40,753,277.20	3.89
4	601328	交通银行	5,957,200	34,551,760.00	3.30
5	600016	民生银行	6,460,548	32,948,794.80	3.14
6	600000	浦发银行	2,229,920	28,899,763.20	2.76
7	000002	万科A	3,134,573	26,330,413.20	2.51
8	600030	中信证券	2,463,517	26,211,820.88	2.50
9	601088	中国神华	1,061,847	25,070,207.67	2.39
10	601601	中国太保	1,069,772	23,321,029.60	2.23

报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,050,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	775,068.44
4	应收利息	10,597.06
5	应收申购款	32,016.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,867,681.85

5.8.4 报告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可转换债券。

5.8.5 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,350,504,420.75
本报告期期间基金总申购份额	31,465,649.43
减:报告期期间基金总赎回份额	66,048,557.89
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,315,921,512.29

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(一)关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛中证100指数证券投资基金的批复;
(二)《长盛中证100指数证券投资基金基金合同》;
(三)《长盛中证100指数证券投资基金托管协议》;
(四)《长盛中证100指数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。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

7.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666、010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

同益证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月25日

§1 重要提示

基金管理人长盛基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2010年7月1日起至2010年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:	长盛同益封闭
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
报告期末基金份额总额:	2,000,000,000份
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
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2010年07月01日-2010年09月30日)
1.本期已实现收益	16,671,006.43
2.本期利润	331,126,504.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.1656
4.期末基金资产净值	2,356,908,766.29
5.期末基金份额净值	1.1785

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2010年9月30日。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

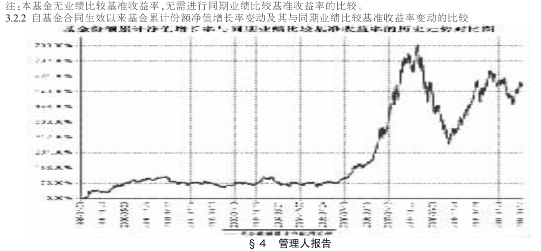
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)
过去三个月	16.35%	2.09%

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累计份额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



§4 管理人报告

4.1 基金经理小组简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯耀东	本基金基金经理	2009年2月10日	2010年7月15日	9年	男,1974年9月出生,中国国籍。毕业于武汉大学,获硕士学位。2000年7月至2001年1月就职于武汉道博股份有限公司,曾任项目经理。2001年2月至2002年11月就职于长城证券有限责任公司金融研究所,曾任研究员。2002年12月加入长盛基金管理公司,曾任高级研究员和基金经理助理、基金经理等。目前其已离职。
王克玉	本基金基金经理	2010年7月13日	-	7年	男,1979年12月出生。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、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日;

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 行情回顾及运作分析

2010年3季度A股市场出现大幅上涨,上证指数上涨11%,HS300指数上涨15%,涨幅大的股票集中在有色金属、食品饮料、商业和医药,走势落后的主要是金融、交通运输和黑色金属。7月份开始工程机械和煤炭行业在宏观调控放松的预期下率先反弹,随后食品饮料、商业行业中的中小市值和区域主题类公司大幅上涨。由于组合在中小市值股票上的配置较少,基金同益的净值在3季度弱于同行。3季度组合中增持的行业主要是有色、机械、券商,减持的行业是医药、金融和食品饮料。

4.4.2 本基金业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.1785元,本报告期份额净值增长率为16.35%。

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

在全球流动性的冲击下,进入4季度以来市场运行特征已经出现较大的转变。资源类中的有色金属、煤炭已经出现大幅反弹,房地产、保险等低PE估值行业的投资价值也开始得到市场认同;而3季度表现突出的行业和板块则出现大幅调整。

从中长期看,影响中国经济运行的关键因素将表现的愈加明显,人口结构变化带来的要素成本的结构性上升、经济增长方式的转型等挑战对全社会和企业都是很大的挑战,来自外围的各种压力也将促进转型的过程。这决定了今后一段时间内投资机会仍然来自于结构性的机遇,城镇化对中国区域发展的带动、劳动力报酬的结构性上涨将对国内的中低端消费品、保险、医药等行业带来持续的影响。

4季度组合的调整方向主要是细分行业中的龙头公司和次新股,关注的行业主要是装备制造、信息技术和化工行业。在国家的十二五规划确定之后,对相关主题的关注重点也会从概念转向公司经营能力,自下而上选股将是今后一段时间获取超额收益的有效手段。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	资产项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,732,321,596.26	73.16
	其中:股票	1,732,321,596.26	73.16
2	固定收益投资	507,301,327.65	21.43
	其中:债券	507,301,327.65	21.43
	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	105,165,069.16	4.44
6	其他资产	23,012,306.05	0.97
7	资产合计	2,367,800,299.12	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	132,358,555.80	5.62
C	制造业	882,835,301.59	37.46
C0	食品、饮料	232,751,456.60	9.88
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	67,251,698.30	2.85
C5	电子	9,333,527.45	0.40
C6	金属、非金属	61,718,161.84	2.62
C7	机械、设备、仪表	382,292,128.28	16.22
C8	医药、生物制品	128,879,380.32	5.47
C99	其他制造业	608,948.80	0.03
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	25,230,000.00	1.07
G	信息技术业	201,176,088.86	8.54
H	批发和零售贸易	251,463,107.50	10.67
I	金融、保险业	233,051,477.01	9.89
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	6,207,065.50	0.26
M	综合类	-	-
	合计	1,732,321,596.26	73.50

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	2,500,000	132,225,000.00	5.61
2	000568	泸州老窖	2,814,540	102,139,656.60	4.33
3	600036	招商银行	6,700,000	86,765,000.00	3.68
4	600875	东方电气	2,701,500	84,178,740.00	3.57
5	600765	中航重机	3,750,000	67,500,000.00	2.86
6	600739	辽宁成大	2,251,422	63,940,384.80	2.71
7	600693	东百集团	4,600,000	61,548,000.00	2.61
8	600521	华海药业	2,700,000	58,887,000.00	2.50
9	000063	中兴通讯	2,300,000	56,695,000.00	2.41
10	000858	五粮液	1,400,000	48,062,000.00	2.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	94,549,798.60	4.01
2	央行票据	239,938,000.00	10.18
3	金融债券	172,707,100.00	7.33
	其中:政策性金融债	172,707,100.00	7.33
4	企业债	106,429.05	0.00
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	507,301,327.65	21.52

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1001011	10央行票据11	1,000,000	98,060,000.00	4.16
2	010110	21国债(10)	601,180	61,019,770.00	2.59
3	030224	03国开24	500,000	51,210,000.00	2.17
4	0801059	08央行票据59	500,000	50,780,000.00	2.15
5	0801038	08央行票据38	500,000	50,630,000.00	2.15

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

根据五粮液股份有限公司2009年12月23日公告的《宜宾五粮液股份有限公司关于完善公司治理结构的整改方案》显示,五粮液被监管部门要求整改,并出具了整改报告,本基金做出以下说明:

1、对于整个食品饮料行业和五粮液公司,本公司研究员今年以来一直看好和积极推荐,并有相关的研究报告。

2、基于相关研究,本基金判断,随着国家对整个消费类行业的支持,作为典型的消费类行业,食品饮料行业未来将保持稳定增长。同时五粮液作为国内高端酒具有较好的稀缺性以及提价空间;今年以来地方政府对公司的高管实行市值考核,使得高管的利益和股东的利益保持一致。对于该公司被监管部门要求整改的事件,本基金经过认真调研,做出如下判断:在当地证监局进行现场检查并下发了《关于五粮液股份有限公司现场检查限期整改通知书》之后,该公司立即组织相关人员进行认真学习,对照现场检查发现的问题制定了切实可行的整改措施,于2009年12月23日就整改报告进行了公告。因此,我们审慎地将五粮液在配置上作为组合的阶段性重要投资品种。

3、今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除此之外,报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	766,880.15
2	应收证券清算款	16,072,524.09
3	应收股利	-
4	应收利息	6,172,901.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,012,306.05

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600765	中航重机	67,500,000.00	2.86	重大事项

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

份额单位:份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	28,000,079
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	28,000,079
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	1.40

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、《同益证券投资基金基金基金合同》;
3、《同益证券投资基金基金托管协议》;
4、《同益证券投资基金基金招募说明书》
5、法律意见书
6、基金管理人业务资格批件、营业执照
7、基金托管人业务资格批件、营业执照

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

7.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666、010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

同盛证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月25日

§1 重要提示

基金管理人长盛基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2010年7月1日起至2010年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称:	长盛同盛封闭
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05日
报告期末基金份额总额:	3,000,000,000.00份
投资目标:	本基金属于成长价值复合型基金,主要投资于业绩能够持续高速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
基金管理人:	长盛基金管理有限公司
基金托管人:	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2010年07月01日-2010年09月30日)
1.本期已实现收益	73,353,652.90
2.本期利润	542,380,014.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.1808
4.期末基金资产净值	3,589,194,485.62
5.期末基金份额净值	1.1964

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2010年09月30日。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

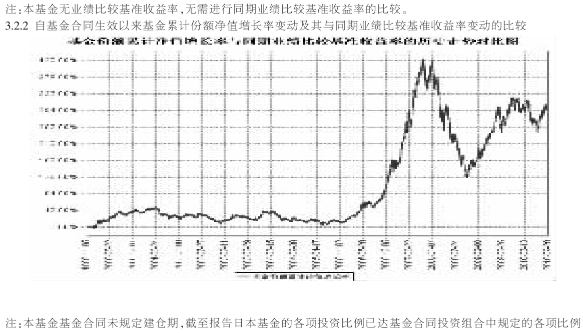
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)
过去三个月	17.80%	2.09%

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累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金基金合同未规定建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达基金合同投资组合中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理小组简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
侯继雄	本基金基金经理	2008年8月11日	-	9年	男,1974年5月出生,中国国籍。清华大学博士,CFA(美国特许金融分析师)。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	-	9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,先后担任研究发展部行业研究员、机构理财部组合经理助理。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、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日;

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《同盛证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 行情回顾及运作分析

2010年3季度可以总结为投资者预期的转换期。期初在存货下行周期、房地产下行周期、技术进步的空白期、政策刺激手段匮乏等担忧下,市场步入中长期熊市的思维不断在市场蔓延,房地产销量下降、PMI回落、CPI上涨、升值压力等多种指标也在印证市场的恐慌。但事后看,经济的回落仍然是有序的,经济基本面并非市场预期的那么悲观,最终股市呈现震荡整固之格局,并在3季度末在汇率调整、PMI回升、海外市场明确货币宽松的因素下,市场迎来了转机。3季度,同盛基金总体维持了前期的核心配置,适当增加了对消费、中小板股票的投资。

4.4.2 本基金业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.1964元,本报告期份额净值增长率为17.80%。

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季度,经济回稳并复苏的态势仍在持续,GDP增长可望进入季度环比正增长事情;美国货币宽松政策和日本减息等外围货币注水行为进一步增加了股票资产的吸引力。总体判断股票市场走好概率更大,风格上也将会向传统周期类、低估值股票进行转移。中远期看,中国经济的转型压力依旧,多种攻坚性制度改革政策也有望在十二五规划中得以明确,因此还难以言及传统周期类行业有持续的机会,对新兴产业、消费服务、先进制造业等长期优势产业的关注仍非常重要。4季度,同盛基金仍将优先从周期类行业中挖掘估值安全和竞争力突出的优秀个股,其次利用市场调整计划,选择新能源、新技术、新材料、新业务模式中的优秀个股作中长期战略配置。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,761,530,192.90	76.69
	其中:股票	2,761,530,192.90	76.69
2	固定收益投资	752,391,528.90	20.89
	其中:债券	752,391,528.90	20.89
	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	77,077,879.28	2.14
6	其他各项资产	9,965,034.79	0.28
7	合计	3,600,964,635.87	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	373,153,610.31	10.40
C	制造业	1,368,639,525.10	38.13
C0	食品、饮料	162,103,620.81	4.52
C1	纺织、服装、皮毛	27,691,158.90	0.77
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	259,375,963.72	7.23
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	7,968,000.00	0.22
C7	机械、设备、仪表	512,036,566.70	14.27
C8	医药、生物制品	399,464,214.97	11.13
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	64,993,896.10	1.81
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	88,493,709.87	2.47
H	批发和零售贸易	312,219,047.87	8.70
I	金融、保险业	361,968,601.51	10.08
J	房地产业	89,777,408.64	2.50
K	社会服务业	72,476,542.02	2.02
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	29,807,851.48	0.83
	合计	2,761,530,192.90	76.94

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	3,461,490	183,078,206.10	5.10
2	600309	烟台万华	10,031,753	170,439,483.47	4.75
3	600031	三一重工	5,600,000	163,856,000.00	4.57
4	000338	潍柴动力	1,660,000	125,662,000.00	3.50
5	600016	民生银行	21,239,984	108,323,918.40	3.02
6	600655	豫园商城	6,231,494	95,154,913.38	2.65
7	600739	辽宁成大	3,331,529	94,615,423.60	2.64
8	000423	东阿阿胶	1,736,525	85,575,952.00	2.38
9	000937	冀中能源	3,149,919	84,764,320.29	2.36
10	600765	中航重机	4,125,000	74,250,000.00	2.07

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	49,726,528.90	1.39
2	央行票据	231,767,000.00	6.46
3	金融债券	470,898,000.00	13.12
	其中:政策性金融债	470,898,000.00	13.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	752,391,528.90	20.96

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	100209	10国开09	1,500,000	150,015,000.00	4.18
2	0801029	08央行票据29	1,000,000	101,100,000.00	2.82
3	060208	06国开08	1,000,000	100,290,000.00	2.79
4	100221	10国开21	1,000,000	98,940,000.00	2.76
5	0801050	08央行票据50	400,000	40,568,000.00	1.13

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

根据冀中能源股份有限公司2009年12月30日公告的《河北金牛能源股份有限公司关于公司治理持续整改情况的公告》显示,公司金牛能源大酒店未及时办理房产证和公司养老保险账户未单独设立,被监管部门要求进行整改,并出具了整改报告。本基金做出以下说明:

1、基于相关研究,本基金判断,随着经济的复苏,冶金煤在未来会出现持续紧张的局面,作为冶金煤的主要供应企业,且位于钢铁企业集中的河北地区,该公司价值会得到提升,同时该公司未来有继续收购集团优质资产的可能,内在价值将进一步提升;对于该公司被监管部门要求整改的事件,本基金经过认真调研,做出如下判断:在中国证监会河北监管局对该公司进行了现场检查并下发了《关于持续推进上市公司治理整改活动的通知》之后,该公司立即组织相关人员进行认真学习,对照现场检查发现的问题制定了切实可行的整改措施,于2009年12月30日就整改报告进行了公告,截至本公告签署之日,公司已办理了金牛能源大酒店的房产证和公司养老保险账户的单独设立。因此,我们审慎地将冀中能源在配置上作为组合的阶段性重要投资品种。

2、今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除此之外,报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	838,655.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,126,379.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,965,034.79

5.8.4 报告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可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600765	中航重机	74,250,000.00	2.07	重大事项

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

份额单位:份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	6,000,000
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	6,000,000
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	0.20

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、《同盛证券投资基金基金基金合同》;
3、《同盛证券投资基金基金托管协议》;
4、《同盛证券投资基金基金招募说明书》
5、法律意见书
6、基金管理人业务资格批件、营业执照
7、基金托管人业务资格批件、营业执照

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

7.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666、010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。