# 长盛量化红利策略股票型证券投资基金

## 2011 第一季度报告

2011年3月31日

**基金管理人:长盛基金管理有限公司**
**基金托管人:中国工商银行股份有限公司**
**报告送出日期:2011年4月21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2011年4月20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2011年1月1日起至2011年3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称: | 长盛量化红利股票 |
| 交易代码: | 080005 |
| 基金运作方式: | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日: | 2009年11月25日 |
| 报告期末基金份额总额: | 329,847,247.18份 |
| 投资目标: | 本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标,并追求风险调整后的收益最大化,满足投资人长期稳健的投资收益需求。 |
| 投资策略: | 本基金通过严格的数量化股票选择方法生成红利风格股票池,在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合,从而形成基于核心-卫星投资策略的股票资产组合。其中,大类资产配置策略综合考虑宏观经济、政策导向和市场环境(市场估值水平、资金供求)等因素,股票投资中将以红利股票投资为主导,以价值型企业及分红能力作为选择投资对象的核心标准。 |
| 业绩比较基准: | 75%×中证红利指数+25%×中证综合债指数 |
| 风险收益特征: | 本基金为股票型基金产品,风险高于混合性基金、债券基金、货币市场基金,属于较高风险,较高回报的基金产品 |
| 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(2011年1月1日-2011年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 24,241,669.06 |
| 2.本期利润 | 7,849,116.84 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0212 |
| 4.期末基金资产净值 | 337,696,710.54 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.024 |

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2011年3月31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 | ①-② | ③-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.75% | 1.33% | 3.57% | 1.01% | -1.82% | 0.32% |

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:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自本基金成立六个月内,使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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 | | |
| 刘斌 | 本基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金基金经理。 | 2009年11月25日 | - | 5年 | 男,1979年6月出生,中国国籍。清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司,在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理等职务,现任长盛量化红利策略股票型证券投资基金(本基金)基金经理、长盛沪深300指数证券投资基金基金经理。 |

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、《长盛量化红利策略股票型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,在经济结构转型的背景支撑下,中小板、创业板等小盘股一枝独秀,小盘成长股相对大盘价值股的估值溢价屡创历史新高,结构性行情逐步演变成结构性泡沫。进入2011年,市场完全颠倒过来,家用电器、黑色金属、建筑建材、房地产等板块涨幅超过10%,金融服务板块也有不错的收益,价值因子获取较多超额收益,而去年热门的医药生物、食品饮料、电子元器件、农林牧渔等板块进入下跌调整,估值修复行情已逐步开始。

本基金在1季度末按照资产配置模型降低了股票资产配置比例,在股票投资方面坚持价值型的投资策略。

4.4.2 本基金业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.024元,本报告期份额净值增长率为1.75%,同期业绩比较基准增长率为3.57%。

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

2010年下半年经济出现的反弹,将随着高通胀、紧货币,在2011年上半年出现再次回落,即短周期步入滞胀阶段。在流动性偏紧的阶段,市场不会出现系统性的上涨机会。同时,以地产、银行为代表的周期行业已经反映了未来较为悲观的经济预期,后续大幅下行的风险较小,而以消费、新兴产业为代表的中小市值公司由于具有较高的估值水平,整体板块性的机会不大。因此,市场较难形成全面上涨的趋势性行情,仍将是结构性的机会和结构性的风险,我们将淡化行业和风格的轮动,而是将重点放在寻找估值合理的确定性成长。

本基金采用数量化策略进行股票投资,按照红利价值型策略在价值层面深度挖掘,保持投资风格的长期稳定。

### §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 | 218,619,695.13 | 63.88 |
| | 其中:股票 | 218,619,695.13 | 63.88 |
| 2 | 固定收益投资 | 5,062,867.40 | 1.48 |
| | 其中:债券 | 5,062,867.40 | 1.48 |
| | 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 | 117,801,902.13 | 34.42 |
| 6 | 其他资产 | 725,834.64 | 0.21 |
| 7 | 资产合计 | 342,210,299.30 | 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 | 14,164,232.90 | 4.19 |
| C | 制造业 | 121,609,390.57 | 36.01 |
| C0 | 食品、饮料 | 19,392,542.33 | 5.74 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 3,989,760.60 | 1.18 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 5,047,944.72 | 1.49 |
| C5 | 电子 | 6,796,755.00 | 2.01 |
| C6 | 金属、非金属 | 20,434,261.43 | 6.05 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 43,481,608.01 | 12.88 |
| C8 | 医药、生物制品 | 22,466,518.48 | 6.65 |
| 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 | 7,013,234.72 | 2.08 |
| G | 信息技术业 | 18,849,929.79 | 5.58 |
| H | 批发和零售贸易 | 17,871,817.13 | 5.29 |
| I | 金融、保险业 | 32,876,678.38 | 9.74 |
| J | 房地产业 | 4,500,675.00 | 1.33 |
| K | 社会服务业 | 1,733,736.64 | 0.51 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 218,619,695.13 | 64.74 |

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 | 600016 | 民生银行 | 2,291,838 | 12,811,374.42 | 3.79 |
| 2 | 000568 | 泸州老窖 | 220,051 | 9,814,274.60 | 2.91 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 689,300 | 9,712,237.00 | 2.88 |
| 4 | 601989 | 中国重工 | 658,797 | 8,689,532.43 | 2.57 |
| 5 | 600585 | 海螺水泥 | 210,000 | 8,509,200.00 | 2.52 |
| 6 | 000550 | 江铃汽车 | 218,010 | 7,521,345.00 | 2.23 |
| 7 | 601088 | 中国神华 | 245,290 | 7,135,486.10 | 2.11 |
| 8 | 000858 | 五粮液 | 222,462 | 7,094,313.18 | 2.10 |
| 9 | 000680 | 山推股份 | 300,000 | 6,717,000.00 | 1.99 |
| 10 | 000999 | 三九医药 | 306,375 | 6,550,297.50 | 1.94 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | 5,062,867.40 | 1.50 |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 5,062,867.40 | 1.50 |

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 | 113001 | 中行转债 | 47,290 | 5,062,867.40 | 1.50 |

注:本基金本报告期末仅持有上述一支债券。

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 | 645,857.13 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 36,402.84 |
| 5 | 应收申购款 | 43,574.67 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 725,834.64 |

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113001 | 中行转债 | 5,062,867.40 | 1.50 |

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 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601989 | 中国重工 | 8,689,532.43 | 2.57 | 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 开放式基金份额变动

份额单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 389,891,447.10 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 14,705,418.46 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 74,749,618.38 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 329,847,247.18 |

### §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、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛量化红利策略股票型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

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

## 2011 第一季度报告

2011年3月31日

**基金管理人:长盛基金管理有限公司**
**基金托管人:中国工商银行股份有限公司**
**报告送出日期:2011年4月21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2011年4月20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2011年1月1日起至2011年3月31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(2011年1月1日-2011年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 70,783,300.66 |
| 2.本期利润 | -42,999,093.70 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0215 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,204,327,531.51 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1022 |

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2011年3月31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 | -1.87% | 1.90% |

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 | | |
| 王克玉 | 本基金基金经理 | 2010年7月13日 | — | 8年 | 男,1979年12月出生,中国国籍,上海交通大学硕士,历任元大京华证券上海代表处研究员,天相投资顾问有限公司分析师,国都证券有限公司分析师。2006年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任同盛证券投资基金基金经理助理,高级行业研究员,现任同益证券投资基金(本基金)基金经理。 |

注:1、上表基金经理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

2011年1季度市场的走势呈现出与2010年全年较大的差异,钢铁、房地产、金融等在2010年严重落后市场的板块开始大幅领先,而医药、信息服务、电子元器件等在2010年贡献超额收益的主要标的出现了显著的调整;也有部分行业比如家电、建材、采掘等在10年下半年有超额收益的品种继续保持了强势。在此期间,组合中增持的品种主要是建材、房地产、银行等低估值的品种,减持的主要是信息技术、商业中等估值较高、业绩增速下调的公司。

4.4.2 本基金业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.1022元,本报告期份额净值增长率为-1.87%。

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

为了应对国内的结构性成本上涨压力和国外持续泛滥的流动性,国内维持中性偏紧的货币市场流动性是必然的选择。在这样一种宏观形势下,企业盈利会出现明显的分化,整体上看企业盈利会向上游的资源类企业集中,而中下游企业则要在成本上涨压力和国外的终端价格中经受很大的压力。因此从企业盈利角度看,我们对市场暂时持相对谨慎的看法。这种状况也将成为企业经营能力的试金石,经过考验后的优势公司将会扩大在行业中的领先优势,成为我们长期投资的核心品种。

在2季度会延续前期的操作思路,结合企业盈利的确定性和估值两个因素对组合进行优化调整,主要调整的方向是:①尾球范围内的货币宽松和供给冲击对大宗原材料价格的冲击还在继续,结合企业资源量、价格弹性等因素增加对上游资源行业的投资将可以继续为组合贡献收益;②中游部分行业供给结构持续集中化趋势使得企业盈利能力得到改善,这在部分领域已经得到体现,对相关行业的拓展研究是后期的工作重点;③消费品行业短期内价格扰动和成本压力还存在一定负面影响,然而具有主动调整能力的公司的盈利在后期会逐渐改善,经过前期的调整,从估值和盈利增速结合来看已经具有吸引力,后期会关注增持消费品行业的机会。

后面需要关注的问题有以下两个方面:①企业经营成本中折旧占比较高的重资产行业的盈利能力的波动性很大,在各类价格进入快速上涨阶段的后期往往体现出较强的业绩弹性;②消费品价格上涨对消费能力的伤害会在什么阶段开始体现,从而导致消费品行业估值水平的调整。

### §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 | 1,637,621,522.70 | 73.99 |
| | 其中:股票 | 1,637,621,522.70 | 73.99 |
| 2 | 固定收益投资 | 474,338,176.37 | 21.43 |
| | 其中:债券 | 474,338,176.37 | 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 | 87,170,154.01 | 3.94 |
| 6 | 其他资产 | 14,206,222.41 | 0.64 |
| 7 | 资产合计 | 2,213,336,075.49 | 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 | 67,051,103.39 | 3.04 |
| C | 制造业 | 724,889,714.19 | 32.88 |
| C0 | 食品、饮料 | 97,023,699.93 | 4.40 |
| 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 | 148,485,841.21 | 6.74 |
| C5 | 电子 | 54,785,989.82 | 2.49 |
| C6 | 金属、非金属 | 142,085,311.98 | 6.45 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 245,653,211.25 | 11.14 |
| C8 | 医药、生物制品 | 36,855,660.00 | 1.67 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 68,920,155.64 | 3.13 |
| E | 建筑业 | 77,915,537.15 | 3.53 |
| F | 交通运输、仓储业 | 45,336,176.60 | 2.06 |
| G | 信息技术业 | 277,299,278.41 | 12.58 |
| H | 批发和零售贸易 | 138,987,925.45 | 6.31 |
| I | 金融、保险业 | 125,985,278.02 | 5.72 |
| J | 房地产业 | 59,502,461.85 | 2.70 |
| K | 社会服务业 | 18,774,000.00 | 0.85 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 32,959,892.00 | 1.50 |
| | 合计 | 1,637,621,522.70 | 74.29 |

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 | 000063 | 中兴通讯 | 3,600,000 | 108,000,000.00 | 4.90 |
| 2 | 600765 | 中航重机 | 3,650,361 | 73,408,759.71 | 3.33 |
| 3 | 600271 | 航天信息 | 2,903,168 | 72,346,946.56 | 3.28 |
| 4 | 000568 | 泸州老窖 | 1,381,985 | 61,636,531.00 | 2.80 |
| 5 | 600739 | 辽宁成大 | 1,840,244 | 56,679,515.20 | 2.57 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 1,079,637 | 53,398,846.02 | 2.42 |
| 7 | 600582 | 天地科技 | 2,147,656 | 51,457,837.76 | 2.33 |
| 8 | 600720 | 祁连山 | 1,945,124 | 43,668,033.80 | 1.98 |
| 9 | 002122 | 天马股份 | 2,847,142 | 42,792,544.26 | 1.94 |
| 10 | 600096 | 云天化 | 1,696,444 | 39,900,362.88 | 1.81 |

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 | 121,181,635.60 | 5.50 |
| 2 | 央行票据 | 230,349,000.00 | 10.45 |
| 3 | 金融债券 | 122,704,000.00 | 5.57 |
| | 其中:政策性金融债 | 122,704,000.00 | 5.57 |
| 4 | 企业债 | 103,540.77 | 0.00 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 474,338,176.37 | 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 | 010110 | 21国债(10) | 881,180 | 88,153,247.20 | 4.00 |
| 2 | 0801059 | 08央行票据59 | 700,000 | 70,196,000.00 | 3.18 |
| 3 | 030224 | 03国开24 | 500,000 | 50,430,000.00 | 2.29 |
| 4 | 0801038 | 08央行票据38 | 500,000 | 50,020,000.00 | 2.27 |
| 5 | 090205 | 09国开05 | 400,000 | 40,816,000.00 | 1.85 |

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 | 1,611,945.88 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 12,594,276.53 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 14,206,222.41 |

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

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

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。

# 长盛同德主题增长股票型证券投资基金

## 2011 第一季度报告

2011年3月31日

**基金管理人:长盛基金管理有限公司**
**基金托管人:中国农业银行股份有限公司**
**报告送出日期:2011年4月21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2011年4月20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2011年1月1日起至2011年3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 长盛同德主题股票 |
| 交易代码 | 519039 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007年10月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 8,115,039,544.45份 |
| 投资目标 | 本基金为股票型证券投资基金,投资目标是在确定促进中国经济持续增长的主题背景下,挖掘中国经济持续增长的动力之所在,选取具有高成长性和具备持续增长潜力的上市公司,分享中国经济高速增长的成果;在严格控制投资风险的前提下,努力保持基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将沿着全球化、城镇化、消费升级、制度变革四大主题进行大类资产配置;根据企业获利能力、增长能力、资产回报率、资产管理能力等定量指标,结合公司治理结构状况等定性指标对行业内上市公司进行综合评价,动态的寻找行业与个股的最佳结合点。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准:沪深300指数×80%+上证国债指数×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金。风险高于混合型基金、债券基金,属于较高风险、较高回报的基金产品。 |
| 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(2011年01月01日-2011年03月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 219,597,911.13 |
| 2.本期利润 | -194,327,808.45 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0225 |
| 4.期末基金资产净值 | 7,915,023,802.83 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9754 |

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2011年3月31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 | -2.52% | 1.41% | 2.72% | 1.09% | -5.24% | 0.32% |

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

注:本基金由同德证券投资基金转型而来,转型日为2007年10月25日。

### §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 | | |
| 邓本明 | 本基金基金经理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、投资管理部副总监。 | 2010年8月12日 | — | 12年 | 男,1971年7月出生,中国国籍,毕业于山西农业大学,获学士学位。曾任大成基金管理有限公司研究员、交易员和基金经理助理。2005年7月底加入长盛基金管理有限公司投资管理部,曾任基金同益基金经理助理,同德证券投资基金基金经理,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任投资管理部副总监,长盛动态精选证券投资基金基金经理。 |
| 王雪松 | 本基金基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理、社保组合组合经理。 | 2009年8月24日 | — | 9年 | 男,1968年10月出生,中国国籍,北京大学硕士。历任巨田证券有限公司研究员、新世纪基金管理公司研究员。2007年8月加入长盛基金管理有限公司,曾任长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理助理,行业研究员,现任社保组合组合经理,长盛同德主题增长股票型证券投资基金(本基金)基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理。 |

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 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、《长盛同德主题增长股票型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

1季度,世界极为动荡,欧债危机再度浮现,中东北非政局不稳,日