长盛成长价值证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011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:2011年10月26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10月25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及更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至2011年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛成长价值混合
基金主代码	080001
交易代码	080001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年9月18日
报告期末基金份额总额	1,016,359,689.35份
投资目标	本基金为平衡型基金,通过管理人的积极管理,在控制风险的前提下挖掘价值、分享成长,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略为主动性投资,在战略性资产、战术性资产、股票和债券选择三个层面进行积极配置,力争获得超过投资基准的业绩回报。在资产配置方面,股票资产比例为35%-75%,债券资产比例为20%-60%,现金资产比例不低于5%。
业绩比较基准	中信标普A股综合指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属平衡型基金,在承担适度风险的前提下,获得长期稳定的收益。
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7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-25,906,807.77
2.本期利润	-94,480,379.19
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0914
4.期末基金资产净值	862,854,949.39
5.期末基金份额净值	0.849

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。

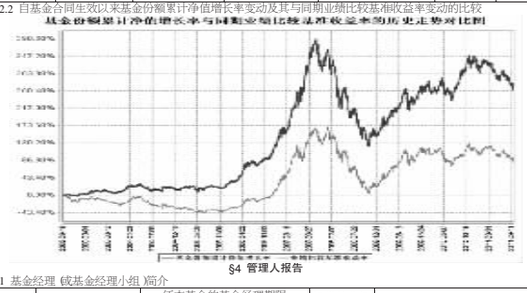
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-9.87%	0.80%	-11.79%	1.09%	1.92%	-0.29%

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		
王雪松	本基金基金经理,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理,社保组合组合经理。	2010年1月27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基金经理,长盛成长价值证券投资基金(本基金)基金经理。
王宁	本基金基金经理,长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理,投资管理部总监。	2007年12月29日	-	13年	男,1971年10月出生,中国国籍。毕业于北京大学光华管理学院,EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理,兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司,曾任投资管理部基金经理助理、长盛动态精选基金基金经理等职务。现任投资管理部总监,长盛成长价值证券投资基金(本基金)基金经理,长盛同庆可分离交易股票型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、《长盛成长价值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 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年三季度,欧债危机深化,美国政府信用评级被下调,外围市场大幅下跌。国内通胀压力持续,政策放松预期落空,对经济增长和企业盈利下行的担忧加剧,市场小幅反弹后震荡下行。

在基金管理过程中,根据本基金的特点,坚持均衡加微调的操作策略,逐渐调整组合,优化配置。在大类资产方面,我们对市场比较谨慎,股票仓位保持在较低水平;在行业和风格方面,遵守价值成长的组合设计原则,向均衡方向调整,减持了部分投资品,增持了部分竞争格局较好、盈利增长预期稳定的消费品、新材料和装备制造等。对品种选择,依旧坚持较为严格的选股标准和相对长期的价值判断,争取组合更可持续的生命力。

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0.849元,本报告期份额净值增长率为-9.87%,同期业绩比较基准增长率为-11.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年四季度,对企业盈利下调的担忧和融资扩容压力是继续压制市场的因素,通胀水平可望逐步回落,政策调控压力可能缓解,整体估值处于低位,对市场构成一定支撑,经济增长方式转型仍是长期而艰难的过程,预计市场仍处于震荡筑底阶段。我们倾向于均衡配置,继续关注竞争格局较好、盈利增长预期稳定、符合经济结构转型演变方向的板块,不断评估新的市场环境下各个经济环节供求关系的变化,根极寻找兼具估值安全性和业绩成长性的投资品种。

本基金属于平衡型股票基金,长期关注具有低估值、高成长特征的行业及个股,将继续采取均衡加微调的操作策略,通过控制可能的组合下行风险,实际提高组合的长期累计收益增长率,坚持利用公开信息以及基本面和市场面相结合的策略,积极调整组合,保持组合的有效性,为基金份额持有人提供长期持续稳定回报。

§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	481,847,236.40	55.63
	其中:股票	481,847,236.40	55.63
2	固定收益投资	234,016,523.00	27.02
	其中:债券	234,016,523.00	27.02
	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	144,882,536.49	16.73
6	其他资产	5,433,789.59	0.63
7	合计	866,180,085.48	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	16,788,930.00	1.95
C	制造业	305,555,589.42	35.41
C0	食品、饮料	30,318,500.00	3.51
C1	纺织、服装、皮毛	10,283,579.70	1.19
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	12,936,304.00	1.50
C5	电子	41,773,458.82	4.84
C6	金属、非金属	91,899,780.27	10.65
C7	机械、设备、仪表	55,826,590.07	6.47
C8	医药、生物制品	62,517,376.56	7.25
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	32,504,271.60	3.77
H	批发和零售贸易	63,799,885.62	7.39
I	金融、保险业	19,339,625.34	2.24
J	房地产业	43,858,934.42	5.08
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	481,847,236.40	55.84

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	600267	海正药业	999,996	32,959,868.16	3.82
2	600549	厦门钨业	649,930	25,860,714.70	3.00
3	600079	人福医药	991,530	21,298,064.40	2.47
4	601166	兴业银行	1,560,906	19,339,625.34	2.24
5	600172	黄河旋风	1,395,346	19,241,821.34	2.23
6	600111	包钢稀土	299,980	16,498,900.00	1.91
7	000501	鄂武商A	859,410	14,515,434.90	1.68
8	600809	山西汾酒	200,000	14,444,000.00	1.67
9	300064	豫金刚石	766,499	13,842,971.94	1.60
10	600060	海信电器	1,100,000	13,420,000.00	1.56

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	74,869,523.00	8.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	159,147,000.00	18.44
	其中:政策性金融债	159,147,000.00	18.44
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	234,016,523.00	27.12

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	010112	21国债(2)	747,350	74,869,523.00	8.68
2	080221	08国开21	700,000	69,825,000.00	8.09
3	080308	08进出08	500,000	49,590,000.00	5.75
4	080207	08国开07	400,000	39,732,000.00	4.60

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。

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,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	1,160,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,181,209.68
5	应收申购款	92,579.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,433,789.59

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在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在在流通受限情况。

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 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,072,649,092.78
本报告期基金总申购份额	23,335,813.59
减:本报告期基金总赎回份额	79,625,217.02
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,016,359,689.35

§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、《长盛成长价值证券投资基金基金合同》;

3、《长盛成长价值证券投资基金托管协议》;

4、《长盛成长价值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和/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 第三季度 报告

2011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:2011年10月26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10月25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7月1日起至2011年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同益封闭
基金主代码	184690
交易代码	184690
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年4月8日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00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7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-37,990,415.03
2.本期利润	-268,780,264.08
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1344
4.期末基金资产净值	1,824,611,584.90
5.期末基金份额净值	0.9123

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。

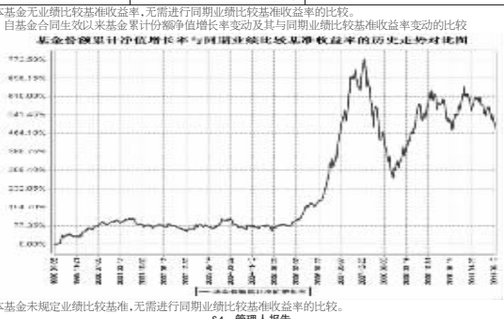
3.2 基金净值表现

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	-12.84%	1.49%

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:本基金未规定业绩比较基准,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		
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 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年3季度A股市场出现大幅下跌,上证指数与沪深300指数的跌幅分别达到14.59%和15.20%。从行业指数的表现看,食品饮料、信息服务和采掘行业指数分别下跌2.74%、8.89%和9.79%,是表现相对较好的行业,而房地产投资相关、耐用消费品等行业则出现了普遍的大幅下跌。3季度国内各类物价水平的轮番上涨使得已持续一年的货币紧缩政策在3季度继续强化,政策的累积效应对实体经济的影响则愈加显著;在企业经营成本特别是劳动力和资金成本大幅上涨的情况下,中游制造业企业盈利开始出现普遍的下调。而过去几年快速发展中存在的一些问题在此期间持续爆发,打击了投资人对相关产业的投资信心。

3季度增持的行业主要是煤炭、房地产和新能源,减持的主要是化工、建筑。期间组合净值出现了大幅的下跌,主要是在8月中市场出现大幅调整之后增加了股票仓位;另外组合中房地产、机械等行业的公司盈利出现下调,导致股价的大幅下跌。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.9123元,本报告期份额净值增长率为-12.84%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

预计从4季度开始经济增速将出现阶段性的回落。一方面是08年之后政府大规模的集中基建投资暴露出来的问题(工程质量、现金流、将延缓中央政府的投资进度,而地方政府投资则受制于整顿融资平台和土地出让金下降的限制,缺乏投资的能力);从国际形势看,欧洲与日本沉重的债务负担将约束其财政政策扩张能力。从政策选择的角度看,把国内消费与企业投资作为拉动经济增长的主要方式将成为政府的现实选择。

近期影响资本市场的正面因素开始不断出现,在盈利增速的预期逐渐兑现后,随着宏观宽松政策的出台,预计市场将会迎来阶段性的机会。后续投资关注的主要方向包括(1)具有较强的经营能力的新上市中小企业是这轮经济调整的集中受益者,可以利用较低的资金成本实现业务规模扩张和升级,并长期受益于产业集中度的提高;(2)过去几年中劳动力成本的持续快速上涨使得企业对未来人员的扩张非常谨慎,而国内的信息服务、自动化装备等能改善经营效率的业务模式也逐渐成熟,这类行业和公司将是关注的重点;(3)从国家的产业政策出发,寻找在信息技术、新能源等领域具有比较优势的企业。

§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	1,291,651,984.68	68.10
	其中:股票	1,291,651,984.68	68.10
2	固定收益投资	386,324,001.37	20.37
	其中:债券	386,324,001.37	20.37
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	80,000,000.00	4.22
	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	126,156,946.93	6.65
6	其他资产	12,527,190.04	0.66
7	合计	1,896,660,123.02	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	20,335,593.60	1.11
B	采掘业	117,457,770.60	6.44
C	制造业	561,211,030.50	30.76
C0	食品、饮料	10,227,411.81	0.56
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	105,772,240.88	5.80
C5	电子	61,910,849.91	3.39
C6	金属、非金属	101,092,080.25	5.54
C7	机械、设备、仪表	244,334,456.95	13.39
C8	医药、生物制品	37,873,990.70	2.08
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	98,933,785.15	5.42
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	28,134,964.20	1.54
G	信息技术业	176,211,850.72	9.66
H	批发和零售贸易	87,336,687.87	4.79
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	152,003,749.51	8.33
K	社会服务业	31,664,070.81	1.74
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	18,362,481.72	1.01
	合计	1,291,651,984.68	70.79

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	4,679,945	88,450,960.50	4.85
2	600582	天地科技	3,445,611	64,226,189.04	3.52
3	600720	祁连山	3,389,441	40,029,298.21	2.19
4	000012	南玻A	2,490,987	35,222,556.18	1.93
5	000402	金融街	5,600,000	34,160,000.00	1.87
6	600858	银座股份	1,827,283	32,671,820.04	1.79
7	600497	驰宏锌锗	1,782,906	32,288,427.66	1.77
8	600570	恒生电子	2,316,371	31,873,264.96	1.75
9	002122	天马股份	3,443,847	30,546,922.89	1.67
10	601088	中国神华	1,194,323	30,264,144.82	1.66

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	63,122,405.00	3.46
2	央行票据	99,220,000.00	5.44
3	金融债券	219,893,200.00	12.05
	其中:政策性金融债	219,893,200.00	12.05
4	企业债券	101,405.07	0.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,986,991.30	0.22
8	其他	-	-
9	合计	386,324,001.37	21.17

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	1101051	11央行票据51	1,000,000	99,220,000.00	5.44
2	010112	21国债(2)	530,000	53,095,400.00	2.91
3	070409	07农发09	500,000	49,950,000.00	2.74
4	030224	03国开24	500,000	49,865,000.00	2.73
5	110245	11国开45	500,000	49,195,000.00	2.70

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	873,285.65
2	应收证券清算款	7,403,575.57
3	应收股利	-
4	应收利息	4,250,328.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,527,190.04

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在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在在流通受限情况。

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	28,000,079.00
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	28,000,079.00
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和/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。

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

2011 第三季度 报告

2011年9月30日

基金管理人:东吴基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年十月二十六日

§1 重要提示

基金管理人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10月25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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	东吴进取策略混合
基金主代码	580005
交易代码	580005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年5月6日
报告期末基金份额总额	1,345,290,657.54份
投资目标	本基金为混合型基金,在适度控制风险并保持良好流动性的前提下,以成长股作为投资对象,并对不同成长类型股票采取不同操作策略,追求超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下策略,根据对宏观经济、政策和证券市场走势的综合分析,对基金资产在股票、债券、现金和衍生产品上的投资比例进行灵活配置。本基金的投资策略主要体现在资产配置策略、选股策略、股票操作策略、债券投资策略、权证投资策略等几方面。
业绩比较基准	65%*沪深300指数+35%*中信标普全债指数。
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的混合型基金,其风险和预期收益要低于股票型基金,高于货币市场基金和债券型基金,在证券投资基金中属于风险较高、预期收益也较高的基金产品。
基金管理人	东吴基金管理有限公司
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7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-29,384,006.72
2.本期利润	-126,970,059.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0941
4.期末基金资产净值	1,280,264,479.74
5.期末基金份额净值	0.9517

注:1、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。

2、上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。

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	-8.61%	1.17%	-9.98%	0.86%	1.37%	0.31%

注:比较基准=65%*沪深300指数+35%*中信标普全债指数。

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

东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009年5月6日至2011年9月30日)

注:1、东吴进取策略基金于2009年5月6日成立。

2、比较基准=65%*沪深300指数+35%*中信标普全债指数。

§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		
朱昆鹏	本基金的基金经理	2009-12-23	-	10年	中国人民大学毕业,经济学学士。2008年11月加入东吴基金,曾担任云南国际信托投资有限公司研究员、资产管理部副总经理,国金证券高级投资经理,云南国际信托有限公司信托经理,东吴基金基金经理助理等职,现担任东吴进取策略混合基金经理。

注:1、此处的任职日期和离职日期均指公司作出决定之日。

2、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。

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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、中国证监会的规定和基金合同的规定及其他有关法律规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平