长盛中信全债指数增强型债券投资基金

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	长盛全债指数增强债券	
基金主代码	510080	
交易代码	前端:510080	后端:511080
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年10月25日	
报告期末基金份额总额	354,386,434.99份	
投资目标	本基金为开放式债券型基金,将运用增强的指数化投资策略,在力求本金安全的基础上,追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳定增值	
投资策略	本基金采用"自上而下"的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值,同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益	
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率×92%+中信标普A股综合指数收益率×8%	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金	
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	-10,977,379.23
2.本期利润	-24,713,407.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0675
4.期末基金资产净值	393,346,177.13
5.期末基金份额净值	1.1099

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	-5.80%	0.25%	-1.49%	0.14%	-4.31%	0.11%

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		
梁婷	本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理。	2011年2月15日	—	11年	女,1975年6月出生,中国国籍。中国社会科学院研究生院经济学博士。曾任中国对外经济贸易信托投资公司投资银行部项目经理;2000年10月加入长盛基金管理有限公司,先后担任产品设计经理、固定收益研究员、社保组合经理助理、社保组合经理。现任长盛中信全债指数增强型债券投资基金(本基金)基金经理,长盛货币市场基金基金经理。

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、《长盛中信全债指数增强型债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运作分析

一、报告期内行情回顾

3季度,国际、国内形势都非常严峻,美债问题、欧债问题愈演愈烈,国际股票市场大幅下跌,国内方面,通胀居高不下,政策紧缩力度没有放松迹象,在国内外经济形势都不利的影响下,国内股票市场大幅下跌,债券市场整体也大幅下跌,仅在9月份最后一周,出于经济衰退的预期,债券市场中利率品种表现较好。

二、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金在债券资产配置策略上继续保持相对稳健投资风格,对组合采用战略性和战术性配置相结合的一贯策略。基于在通胀高企、政策紧缩环境下对债券投资的不利影响,本组合在2011年3季度,大部分时间组合久期保持在略低于基准附近的位置,但由于跟踪基准的限制,久期水平仍然高于市场平均水平,仍然承担了一定的利率风险。在3季度债券市场快速下跌的过程中,各类债券资产也遭遇了一定的损失;就权益类资产部分而言,报告期内基本保持相对谨慎的仓位,但总体来说,由于市场整体下跌幅度较大,对组合收益还是产生了明显的负贡献。另外,在报告期内转债资产的继续下跌也为组合带来一定的损失。

4.5 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1.1099元,本报告期份额净值增长率为-5.80%,同期业绩比较基准增长率为-1.49%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前的经济基本面看,经济已进入衰退周期,最坏的状况可能还未出现,投资下降程度有可能超出预期,4季度的经济基本面将继续呈现下滑趋势。从通货膨胀来看,尽管需求已出现回落、PPI等上游价格也在回落,但供给方面的因素会在一定程度上会制约通胀的下行,加上国际上流动性的放松,通胀压力难仍然难以充分消除。从政策展望来看,我们认为,政府定向宽松的政策已经陆续出台,但对于整体上放松政策仍会非常慎重。

展望4季度债券市场,随着经济的下滑,全面放松的政策虽然不一定出现,但紧缩力度不会加码,4季度利率产品有望看到一定的投资机会,但由于今年以来收益率曲线的中长端,特别是长期国债的收益率调整幅度不大,且自9月末以来已有快速的收益率下行,未来通胀水平有进一步观察,收益率下行的空间会相对有限,本基金将会保持久期接近基本久期,相对积极参与利率产品的投资;信用品种方面,由于经济的下行和供给的增加,仍然相对谨慎策略,重点配置高等级信用品种;

股票市场方面,由于当前经济已进入衰退周期,股票市场经过今年以来的大幅调整,风险已大幅释放,当前市场处于相对安全的区间,基金会保持一定的仓位,并视市场情况积极调整。转债市场方面,大盘转债的风险也基本释放,基金也将维持一定的配置比例。

§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	38,492,244.53	8.05
	其中:股票	38,492,244.53	8.05
2	固定收益投资	355,894,567.02	74.39
	其中:债券	355,894,567.02	74.39
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	8,736,001.10	1.83
	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	68,092,918.69	14.23
6	其他资产	7,208,190.42	1.51
7	合计	478,423,921.76	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	1,088,100.00	0.28
C	制造业	11,283,119.53	2.87
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	451,200.00	0.11
C5	电子	1,273,308.84	0.32
C6	金属、非金属	5,430,335.52	1.38
C7	机械、设备、仪表	2,849,208.37	0.72
C8	医药、生物制品	1,279,066.80	0.33
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,051,815.00	4.08
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	1,755,650.00	0.45
H	批发和零售贸易	3,986,450.00	1.01
I	金融、保险业	4,327,110.00	1.10
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	38,492,244.53	9.79

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	601669	中国水电	3,437,870	15,470,415.00	3.93
2	601677	明泰铝业	263,736	4,222,413.36	1.07
3	002024	苏宁电器	245,000	2,550,450.00	0.65
4	600030	中信证券	170,000	1,912,500.00	0.49
5	600271	航天信息	65,000	1,755,650.00	0.45
6	000417	合肥百货	80,000	1,436,000.00	0.37
7	002073	软控股份	76,101	1,383,516.18	0.35
8	601908	京运通	43,601	1,366,019.33	0.35
9	600036	招商银行	118,500	1,310,610.00	0.33
10	601607	上海医药	88,090	1,279,066.80	0.33

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	21,139,985.00	5.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,396,000.00	27.81
	其中:政策性金融债	109,396,000.00	27.81
4	企业债券	141,911,513.82	36.08
5	企业短期融资券	29,649,000.00	7.54
6	中期票据	-	-
7	可转债	53,798,068.20	13.68
8	其他	-	-
9	合计	355,894,567.02	90.48

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	080219	08国开19	300,000	29,916,000.00	7.61
2	113001	中行转债	257,030	23,387,159.70	5.95
3	110015	石化转债	261,290	22,839,358.90	5.81
4	010112	21国债⑿	210,000	21,037,800.00	5.35
5	110411	11农发11	200,000	20,100,000.00	5.11

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。

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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	960,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,228,258.20
5	应收申购款	19,932.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,208,190.42

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	23,387,159.70	5.95
2	110015	石化转债	22,839,358.90	5.81
3	113002	工行转债	7,571,549.60	1.92

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	601669	中国水电	15,470,415.00	3.93	新股流通受限
2	601677	明泰铝业	4,222,413.36	1.07	新股流通受限
3	601908	京运通	1,366,019.33	0.35	新股流通受限

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

报告期期初基金份额总额	381,353,298.13
报告期期间基金总申购份额	2,182,386.23
减:报告期期间基金总赎回份额	29,149,249.37
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	354,386,434.99

§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、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》;

3、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金托管协议》;

4、《长盛中信全债指数增强型债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

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
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(2011年7月1日-2011年9月30日)
1.本期已实现收益	48,338,134.08
2.本期利润	-435,435,660.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1451
4.期末基金资产净值	3,293,565,135.91
5.期末基金份额净值	1.0979

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。

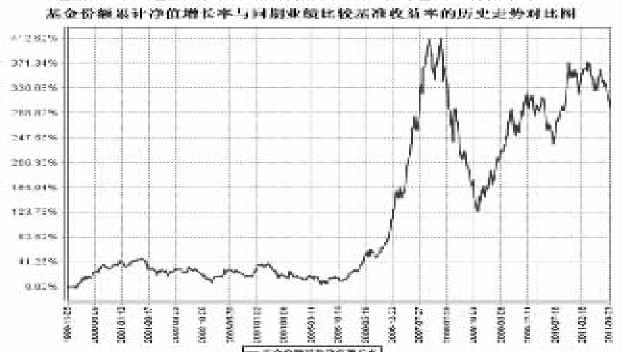
3.2 基金净值表现

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	-11.67%	1.56%

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:1、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。

2、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(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		
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,上证综指一路下跌约15%,回头看,每次短暂的反弹都成为减仓良机。3季度内外忧困。国内通胀的严峻性持续超出市场预期,持续维持在6%高位之上。经济下滑之事态明显,工业增加值屡创新低;民间和市场持续攀升,政府却受制于通胀,仍维持观望之姿态。欧债问题持续发酵,海外市场跌幅一片。唯一支持市场信心的低估值在利空持续超预期的情况下也无能为力。市场的困境还需要时间消化,并等待政策的转向。同盛期初未能认识到风险暴露后的严峻性,操作较为滞后、幅度不足,3季度的损失较大。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.0979元,本报告期份额净值增长率为-11.67%。

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

展望4季度,通胀将呈逐步回落之势,但其绝对水平仍然会维持在高位。欧债问题还在发酵期。加上政府换届因素,使得短期内难以形成政策转向的预期。近期房价已开始明显松动,民间也连续出现高利贷崩盘事件,说明宏观调控的效果已经逐步体现;大宗商品价格的大幅度回落、工业增加值的持续下滑,也使得未来通胀的压力将逐步释放。此时,政策反而会更加担忧过度紧缩下的经济衰退风险。目前,经济已处于较底部的位置,市场的预期则更为悲观,股市已进入寻底并等待转机的时期。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。

§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	2,363,175,900.51	69.80
	其中:股票	2,363,175,900.51	69.80
2	固定收益投资	814,917,443.00	24.07
	其中:债券	814,917,443.00	24.07
	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	2.36
	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	114,884,129.16	3.39
6	其他资产	12,620,513.35	0.37
7	合计	3,385,597,986.02	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	-	-
B	采掘业	288,971,665.45	8.77
C	制造业	1,375,335,341.86	41.76
C0	食品、饮料	273,897,006.04	8.32
C1	纺织、服装、皮毛	58,163,608.46	1.77
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	280,485,679.63	8.52
C5	电子	22,485,000.00	0.68
C6	金属、非金属	123,742,008.76	3.76
C7	机械、设备、仪表	314,386,022.25	9.55
C8	医药、生物制品	302,176,016.72	9.17
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	32,771,808.00	1.00
G	信息技术业	111,417,324.88	3.38
H	批发和零售贸易	209,123,185.49	6.35
I	金融、保险业	191,402,000.00	5.81
J	房地产业	120,879,254.11	3.67
K	社会服务业	15,642,000.00	0.47
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	17,633,320.72	0.54
	合 计	2,363,175,900.51	71.75

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	600309	烟台万华	14,028,923	223,200,164.93	6.78
2	600031	三一重工	8,400,000	121,044,000.00	3.68
3	601607	上海医药	7,572,306	109,949,883.12	3.34
4	600123	兰花科创	2,400,000	103,968,000.00	3.16
5	601318	中国平安	3,000,000	100,710,000.00	3.06
6	000937	冀中能源	4,000,000	94,440,000.00	2.87
7	600036	招商银行	8,200,000	90,692,000.00	2.75
8	000933	神火股份	6,319,865	90,563,665.45	2.75
9	600519	贵州茅台	450,000	85,765,500.00	2.60
10	000581	威孚高科	2,280,682	74,395,846.84	2.26

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	103,649,443.00	3.15
2	央行票据	175,241,000.00	5.32
3	金融债券	536,027,000.00	16.27
	其中:政策性金融债	536,027,000.00	16.27
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	814,917,443.00	24.74

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	148,755,000.00	4.52
2	080411	08农发11	1,000,000	99,210,000.00	3.01
3	1001100	10央票100	1,000,000	97,580,000.00	2.96
4	010112	21国债⑿	700,000	70,126,000.00	2.13
5	070228	07国开28	500,000	49,840,000.00	1.51

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。

根据河南神火煤电股份有限公司2010年12月7日公告的《河南神火煤电股份有限公司关于财政部驻河南省财政监察专员办事处对公司2008年度会计信息质量检查及公司整改情况的公告》显示,公司在会计信息质量方面存在问题,具体包括:1)收入不实222,182,577.84元,2)成本费用不实导致漏缴企业所得税,3)涉税问题1,616,524.98元,4)企业无真实交易利用银行承兑汇票违规融资。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,下游钢铁、化工、电力等行业的开工量逐渐加大,公司生产的无烟煤在未来会出现持续紧张的局面。并且随着公司矿井开采煤层的恢复正常、整合小矿的复产、电厂投产以及铝板块的减亏,公司的基本面改善明显且确定性大。作为煤炭和电解铝双主业的公司将具有更大的业绩弹性。结合目前的估值,及未来有可能的资源整合,公司无论从内生性还是外延式都具备投资价值。

2、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:在接到《2008年度会计信息质量检查情况的处理决定》后,公司相关人员已加强了新会计准则和税收政策的学习,并按《处理决定》的有关要求在2009年及时对账务进行了调整,及时缴纳了罚款、补缴了企业所得税、代扣的个人所得税,各项内控制度得到了全面加强和完善,符合财政部驻河南省财政监察专员办事处的要求。截至本公告披露之日,公司已经着手落实整改措施。因此,我们审慎地将神火股份在配置上作为组合的阶段性投资品种。

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。

除上述事项外,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	638,549.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,981,964.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合 计	12,620,513.35

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中未存在流通受限情况。

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	6,000,000.00
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	6,000,000.00
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。

长盛中证100指数证券投资基金

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	长盛中证100指数
基金主代码	519100
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	1,164,138,031.82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(2011年7月1日—2011年9月30日)
1.本期已实现收益	-2,829,304.34
2.本期利润	-143,672,903.63
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1226
4.期末基金资产净值	839,841,389.26
5.期末基金份额净值	0.7214

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。

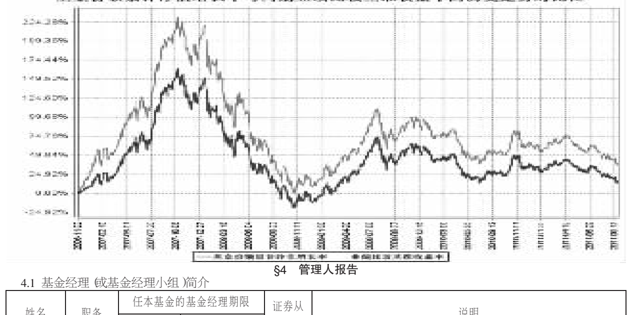
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-14.57%	1.24%	-14.45%	1.24%	-0.12%	0.00%

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		
冯雨生	本基金基金经理。	2011年7月11日	—	4年	男,1983年11月出生。北京大学金融学硕士。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员。现任长盛中证100指数证券投资基金(本基金)基金经理。
白仲光	本基金基金经理。	2009年3月9日	2011年7月12日	8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,在公司期间历任研究员、高级金融工程师、基金经理、金融工程与量化投资部总监等职务,曾任本基金基金经理。目前已离职。

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运作分析

3季度在全球经济前景持续恶化和欧洲债务危机影响下,A股市场连续下行,其估值水平已创出历史新低。其中食品饮料、餐饮旅游和信息服务等防御性板块跌幅较少,而建筑建材、家用电器和交运设备等周期性板块领跌大市。在风格特征上,小盘股和大盘股表现相差不大。

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购赎回变动时,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。

4.5 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0.7214元,本报告期份额净值增长率为-14.57%,同期业绩比较基准增长率为-14.45%。本报告期内日均跟踪误差为0.0015%,年度化跟踪误差为0.2366%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前股票市场处于各种因素的弱平衡状态,指数可能在一段时间内维持震荡格局。市盈率已经到达历史低位,估值修复行情亦有望在4季度出现。能够影响这种弱平衡的阶段性因素包括:国内财政和货币政策的微调、欧债危机的发展趋势和相关产业政策变化等。

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	792,275,592.37	93.98
	其中:股票	792,275,592.37	93.98
2	固定收益投资	684,792.30	0.08
	其中:债券	684,792.30	0.08
	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	48,707,151.92	5.78
6	其他资产	1,341,481.55	0.16
7	合计	843,009,018.14	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	1,717,901.60	0.20
B	采掘业	104,532,468.05	12.45
C	制造业	223,084,812.05	26.56
C0	食品、饮料	59,068,954.22	7.03
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	11,397,129.04	1.36
C5	电子	984,479.02	0.12
C6	金属、非金属	49,241,595.12	5.86
C7	机械、设备、仪表	90,644,662.01	10.79
C8	医药、生物制品	8,717,875.64	1.04
C99	其他制造业	3,030,117.00	0.36
D	电力、煤气及水的生产和供应业	13,948,826.56	1.66
E	建筑业	23,896,985.30	2.85
F	交通运输、仓储业	29,305,652.18	3.49
G	信息技术业	19,110,938.46	2.28
H	批发和零售贸易	11,123,626.32	1.32
I	金融、保险业	324,685,725.84	38.66
J	房地产业	33,948,002.51	4.04
K	社会服务业	4,549,584.15	0.54
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	2,371,069.35	0.28
	合计	792,275,592.37	94.34

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	600036	招商银行	3,117,676	34,481,496.56	4.11
2	600016	民生银行	5,751,934	31,750,675.68	3.78
3	601318	中国平安	853,175	28,641,084.75	3.41
4	601328	交通银行	6,137,212	27,494,709.76	3.27
5	600000	浦发银行	2,811,545	24,010,594.30	2.86
6	601166	兴业银行	1,922,188	23,815,909.32	2.84
7	600030	中信证券	1,997,000	22,466,250.00	2.68
8	601088	中国神华	839,777	21,279,949.18	2.53
9	600519	贵州茅台	105,448	20,097,334.32	2.39
10	000858	五 粮 液	512,330	18,597,579.00	2.21

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

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	中期票据	-	-
7	可转债	684,792.30	0.08
8	其他	-	-
9	合计	684,792.30	0.08

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

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110018	国电转债	7,030	684,792.30	0.08

注:本基金本报告期末仅持有一只债券。

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。

根据宜宾五粮液股份有限公司2011年5月27日公告的《关于收到中国证监会行政处罚决定书的公告》显示,公司因违规披露、信息披露不及时、不完整等事项受到中国证监会行政处罚,公司表示接受证监会的行政处罚,吸取教训,不断完善公司治理和合规经营。本基金做出如下说明:

1、对于白酒行业及五粮液,本公司研究员自二季度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,随着我国国民收入的提高、城镇化的快速推进,我国白酒行业将继续维持高速增长,作为国内最大的白酒生产企业,高端白酒中的代表性企业之一,五粮液公司的投资价值会得到提升,对于该公司被监管部门处罚的事件,本基金经过认真研究,做出如下判断:公司自2009年底以来,对公司治理、信息披露、关联交易进行了很大改进,并使得公司业绩保持了良好的发展势头。公司也在2011年5月27日的公告中,对公司整改情况进行了披露。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。

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	139,680.25
4	应收利息	20,494.07
5	应收申购款	131,307.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,341,481.55

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 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

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	1,186,763,533.13
报告期期间基金总申购份额	28,138,960.00
减:报告期期间基金总赎回份额	50,764,461.31
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	1,164,138,031.82

§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。