长盛中证100指数证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012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:2012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2012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及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至2012年3月31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	1,153,751,493.95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(2012年1月1日—2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-16,036,434.19
2.本期利润	42,365,543.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0351
4.期末基金资产净值	819,327,086.57
5.期末基金份额净值	0.7101

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2012年3月31日。

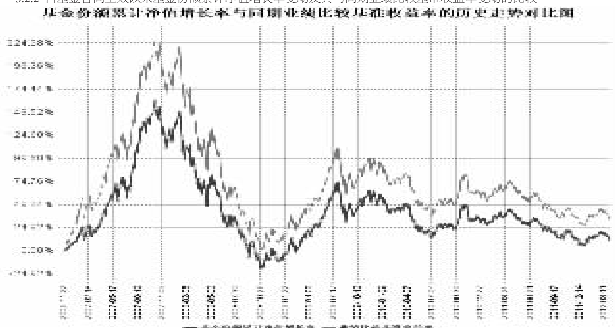
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	4.77%	1.33%	5.03%	1.32%	-0.26%	0.01%

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,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理。	2011年7月11日	—	5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,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)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

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

报告期内,长盛同庆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。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,并申请打开与公司旗下其他投资组合交易所市场的反向交易控制。上述申请已报经公司投资决策委员会批准。

报告期内,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 报告期内基金的投资策略和运作分析

1季度由于欧债危机发展相对平稳,各国央行注入流动性和美国经济数据持续超出市场预期,全球股票市场普遍上涨。A股市场在流动性好转和调控政策可能转宽松的预期下开始上涨,后因担心实体经济下滑而下跌。行业上,有色、地产和食品饮料涨幅居前,公用事业、信息服务和医药生物涨幅靠后。

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。

4.5 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0.7101元,本报告期份额净值增长率为4.77%,同期业绩比较基准增长率为5.03%。本报告期内日均跟踪误差为0.018%,年度化跟踪误差为0.28%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一个季度,货币政策整体大概率是维稳性的放松,影响市场的主要因素是房地产政策、信贷总量和上市公司季报情况。目前在流动性、地产、外需和成本四大僵局下,市场总体将大概率保持震荡行情。

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	769,285,772.31	93.65
	其中:股票	769,285,772.31	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	51,035,526.96	6.21
6	其他资产	1,114,928.11	0.14
7	合计	821,436,227.38	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	1,285,944.66	0.16
B	采掘业	93,257,905.62	11.38
C	制造业	207,404,963.45	25.31
C0	食品、饮料	57,076,699.77	6.97
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	8,545,699.92	1.04
C5	电子	1,019,503.20	0.12
C6	金属、非金属	51,466,724.70	6.28
C7	机械、设备、仪表	82,312,973.60	10.05
C8	医药、生物制品	6,983,362.26	0.85
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	16,765,295.86	2.05
E	建筑业	20,474,531.65	2.50
F	交通运输、仓储业	23,900,773.67	2.92
G	信息技术业	15,603,378.10	1.90
H	批发和零售贸易	9,886,012.50	1.21
I	金融、保险业	339,804,911.98	41.47
J	房地产业	36,048,800.49	4.40
K	社会服务业	4,853,254.33	0.59
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	769,285,772.31	93.89

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	3,686,727	43,872,051.30	5.35
2	600016	民生银行	5,542,919	34,754,102.13	4.24
3	601318	中国平安	822,619	30,091,403.02	3.67
4	601328	交通银行	5,564,898	26,210,669.58	3.20
5	601166	兴业银行	1,850,054	24,642,719.28	3.01
6	600000	浦发银行	2,735,172	24,425,085.96	2.98
7	601088	中国神华	804,044	20,591,566.84	2.51
8	600519	贵州茅台	101,184	19,929,200.64	2.43
9	000002	万 科A	2,348,078	19,442,085.84	2.37
10	600030	中信证券	1,673,793	19,399,260.87	2.37

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。

报告期内本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	-
4	应收利息	24,260.46
5	应收申购款	40,667.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,114,928.11

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	1,224,322,489.30
报告期期间基金总申购份额	36,270,084.20
减:报告期期间基金总赎回份额	106,841,079.55
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	1,153,751,493.95

§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。

长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金

2012 第一季度 报告

2012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:2012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2012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及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同瑞中证200分级		
基金主代码	160808		
交易代码	160808		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年12月6日		
报告期末基金份额总额	128,521,456.30份		
投资目标	本基金运用指数化投资方式,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现对中证200指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金采用完全复制法,按照成份股在中证200指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证200指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于中证200指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%-10%(其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%)。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。		
业绩比较基准	中证200指数收益率×95%+一年期银行定期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为完全复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
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		
下属三级基金的基金简称	长盛同瑞A	长盛同瑞B	长盛同瑞中证200分级
下属三级基金的交易代码	150064	150065	160808
报告期末下属三级基金的份额总额	29,259,096.00份	43,888,644.00份	55,373,716.30份
下属三级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定	高风险、高预期收益	较高风险、较高预期收益

§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(2012年1月1日—2012年3月31日)
1.本期已实现收益	7,434,667.48
2.本期利润	6,128,881.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0292
4.期末基金资产净值	131,600,371.18
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2012年3月31日。

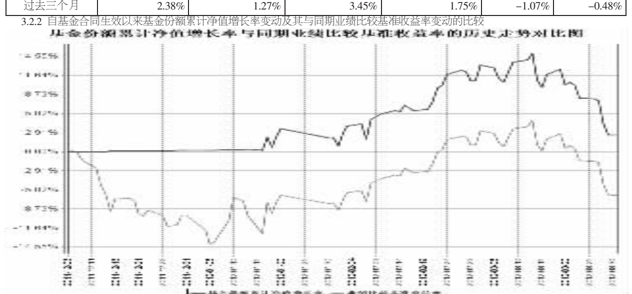
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	2.38%	1.27%	3.45%	1.75%	-1.07%	-0.48%

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:1、本基金合同生效日为2011年12月6日,截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为:投资于股票的资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于中证200指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%-10%(其中权证资产占基金资产比例为0-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

§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		
王超	本基金基金经理。	2011年12月6日	—	5年	男,1981年9月出生,中国国籍。中央财经大学硕士,中国科学技术大学金融工程专业在读博士,金融风险管理师(FRM)。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,从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金(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、《长盛同瑞中证200指数分级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

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

报告期内,长盛同庆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。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,并申请打开与公司旗下其他投资组合交易所市场的反向交易控制。上述申请已报经公司投资决策委员会批准。

报告期内,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 报告期内基金的投资策略和运作分析

自本基金2011年12月6日成立至报告期末,中证200指数经历了先大幅下跌,后大幅反弹的"V"型走势,在指数下行阶段,我们采取保守的建仓策略,使基金资产规避了14%的下跌损失,此后,我们运用数量化投资模型判断市场处于过度悲观情绪,而流动性紧张情况的边际改善有望给市场带来估值修复的反弹行情,在反弹过程中,我们采取快速建仓策略,使基金比较准确的把握了市场反弹收益。报告期内,我们运用数量化投资手段精细化执行完全复制指数策略,尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响,将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

以报告期末收盘价计算,本基金的两类分级份额,长盛同瑞A和长盛同瑞B的二级市场折溢价率分别为-12.68%和6.90%,整体折溢价率为-1.03%,与市场上同类型指数分级基金的二级市场交易情况比较接近,长盛同瑞B作为放大中盘蓝筹指数收益的交易型品种,满足了投资者的需求,填补了市场空白。

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1.024元,本报告期份额净值增长率为2.38%,同期业绩比较基准收益率为3.45%。

由于本基金成立于2011年年末,基金在2012年初开始的建仓行为对本报告期的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值产生不利影响,为了降低负面影响,本基金采取快速建仓策略,尽快使基金业绩表现能够复制基准指数,我们通过数量化手段对基金进行精细管理,降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响。在剔除建仓期数据后,本基金年化跟踪误差控制为1.59%,日均跟踪偏离度绝对值为0.02%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济进入到"L"型筑底阶段,对应投资时钟上的衰退后期或复苏前期,在这一阶段经济同比指标和通胀指标还将滞后回落,这一点已经基本成为市场共识,而且前期市场的下跌过程已经提前对此加以反映,但是市场当前博弈的焦点在于宏观调控政策调整的力度和时点,这一因素将很大程度上决定了市场今年的走向,如果政策采取预调微调,经济会延续"L"型底部调整,如果采取全面放松政策,经济很有可能出现V型反弹,但是考虑到房地产和通胀的约束,实施全面放松政策的空间较小,尽管如此,市场对于政策预期仍将给予充分重视。与此同时,美国经济复苏的持续性也将通过带动出口和提振投资者信心两个层面对国内市场产生影响。

宏观经济下行对企业盈利增速产生的负面影响对于上市公司2011年报的影响已经体现,但是对于2012年的预期还没有得到及时反映,目前全市场剔除金融行业,对2012年的盈利增长的一致预期已经下降到20.6%,但是中小板和创业板的2012年盈利增速还维持在43%和52%的高位,对于小盘股的过高预期将会随着2012年1季报的逐步披露而逐步向下修正,而这一过程往往伴随着股价下跌,估值水平下降。

证券市场面临的制度变革对于蓝筹股的投资价值倍加推崇,而且出台多项政策给予实质性支持。蓝筹价值投资有望重回股市,此种情况下,大盘蓝筹股可能仍将受到经济转型大逻辑的拖累,而且现有的大盘蓝筹大多处于银行、能源等垄断性行业,盈利将随着经济转型而被削弱。再加上市场流动性相对有限,因此,以中证200指数为代表的中盘蓝筹可能成为价值投资的重要方向。

§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	124,627,973.67	89.98
	其中:股票	124,627,973.67	89.98
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	13,469,024.19	9.72
6	其他资产	413,285.77	0.30
7	合计	138,510,283.63	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	1,994,808.94	1.52
B	采掘业	11,202,946.13	8.51
C	制造业	64,461,981.80	48.98
C0	食品、饮料	8,904,421.72	6.77
C1	纺织、服装、皮毛	1,295,455.48	0.98
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,701,313.76	3.57
C5	电子	3,087,642.27	2.35
C6	金属、非金属	15,732,348.35	11.95
C7	机械、设备、仪表	16,441,706.89	12.49
C8	医药、生物制品	14,123,265.43	10.73
C99	其他制造业	175,827.90	0.13
D	电力、煤气及水的生产和供应业	3,636,244.34	2.76
E	建筑业	3,396,996.99	2.58
F	交通运输、仓储业	3,449,847.34	2.62
G	信息技术业	6,890,495.08	5.24
H	批发和零售贸易	7,290,163.44	5.54
I	金融、保险业	6,009,113.91	4.57
J	房地产业	7,342,901.56	5.58
K	社会服务业	1,456,852.19	1.11
L	传播与文化产业	825,872.76	0.63
M	综合类	6,669,749.19	5.07
	合计	124,627,973.67	94.70

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	600887	伊利股份	127,369	2,807,212.76	2.13
2	600383	金地集团	356,187	2,133,560.13	1.62
3	600739	辽宁成大	108,703	1,735,986.91	1.32
4	000423	东阿阿胶	41,583	1,676,626.56	1.27
5	600406	国电南瑞	50,215	1,585,287.55	1.20
6	600518	康美药业	122,545	1,556,321.50	1.18
7	601009	南京银行	165,510	1,454,832.90	1.11
8	000562	宏源证券	108,321	1,390,841.64	1.06
9	600690	青岛海尔	128,327	1,320,484.83	1.00
10	000709	河北钢铁	422,807	1,217,684.16	0.93

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。

报告期内本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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	12,188.02
4	应收利息	4,698.44
5	应收申购款	73,160.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	73,239.17
8	其他	-
9	合计	413,285.77

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

项目	长盛同瑞A	长盛同瑞B	长盛同瑞中证200分级
报告期期初基金份额总额	41,364,880.00	62,047,320.00	519,784,068.63
报告期期间基金总申购份额			136,361,231.24
减:报告期期间基金总赎回份额			632,145,501.59
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-12,105,784.00	-18,158,676.00	31,373,918.02
报告期期末基金份额总额	29,259,096.00	43,888,644.00	55,373,716.30

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§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同瑞中证200指数分级证券投资基金的批复;

(二)《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同》;

(三)《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金托管协议》;

(四)《长盛同瑞中证200指数分级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

2012 第一季度 报告

2012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:2012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2012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2012年1月1日起至2012年3月31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(2012年1月1日-2012年3月31日)
1.本期已实现收益	-97,378,561.68
2.本期利润	23,606,857.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0118
4.期末基金资产净值	1,738,420,003.16
5.期末基金份额净值	0.8692

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2012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	1.38%	2.48%

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	—	9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

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

报告期内,长盛同庆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。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,并申请打开与公司旗下其他投资组合交易所市场的反向交易控制。上述申请已报经公司投资决策委员会批准。

报告期内,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 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年1季度的A股市场在投资人的失望中迎来了一波小幅的反弹,上证指数与沪深300指数分别上涨2.88%和4.65%,在3月中旬大幅下跌前上证指数最高涨幅曾经达到11.6%。经过了2011年持续不断的下跌,1季度的上涨对基金持有人还是管理人来说都显得非常珍贵。

1季度涨幅居前的行业主要是有色金属、房地产和家电等早周期和强周期的板块,而医药、信息服务和公用事业等相对稳定的行业出现小幅下跌。整个1季度经济基本面的运行在逐渐兑现前期的市场预期,大量的小型企业和中游企业的盈利出现明显的下滑,市场的上涨主要来自于市场风险的释放带来的估值水平的反弹。

本基金在1季度对组合进行了积极的调整,适当调整了组合的分散度,增持了券商、电力等基本面出现拐点的行业,减持了建材、房地产等强周期行业,在1-2月份组合表现尚可,但是由于组合仍然具有很高的波动性,导致在3月下旬的下跌中资产净值出现比较快速的下跌。

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0.8692元,本报告期份额净值增长率为1.38%。

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

综合考虑经济发展的状况和社会运行的态势,2012年仍处于明显的过渡阶段,出口和房地产为主的基建投资作为过去拉动中国经济增长的主要驱动力的影响将逐渐减弱,调整和转型成为社会发展的必然选择。在这个过程之中,包括企业在内的各个阶层对经济的新的增长源泉和发展模式还处于探索之中,不同企业的经营绩效会体现出比较大的差异。

2季度经济基本面仍然会不断兑现过去的悲观预期,经济增速处于不断下降过程之中,然而由于劳动力成本的持续上涨和价格改革的影响,导致物价指数的回落可能慢于市场的预期,初步判断市场仍然处于震荡的格局。在这种情况下,我们会重点关注基本面发生重大变化的行业,通过相对集中的行业配置来获取一定的收益。同时经过过去持续的下跌,我们看到部分有竞争力的成长型企业的估值已经处于合理的范围内,我们也会有针对性的增加对成长型企业的投资。

§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	1,161,729,217.50	66.61
	其中:股票	1,161,729,217.50	66.61
2	固定收益投资	433,851,559.55	24.87
	其中:债券	433,851,559.55	24.87
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	20,000,000.00	1.15
	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	103,642,160.26	5.94
6	其他资产	24,960,579.55	1.43
7	合计	1,744,183,516.86	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	94,871,918.16	5.46
C	制造业	488,876,365.77	28.12
C0	食品、饮料	36,618,914.75	2.11
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	54,801,667.99	3.15
C5	电子	43,057,055.90	2.48
C6	金属、非金属	91,025,604.65	5.24
C7	机械、设备、仪表	241,185,816.76	13.87
C8	医药、生物制品	22,187,305.72	1.28
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	51,688,000.00	2.97
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	38,758,785.52	2.23
G	信息技术业	133,306,848.51	7.67
H	批发和零售贸易	64,364,656.40	3.70
I	金融、保险业	138,294,279.53	7.96
J	房地产业	93,775,246.09	5.39
K	社会服务业	30,169,175.60	1.74
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	27,623,941.92	1.59
	合计	1,161,729,217.50	66.83

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	3,900,000	64,077,000.00	3.69
2	600582	天地科技	3,000,000	49,020,000.00	2.82
3	601601	中国太保	2,199,947	42,436,977.63	2.44
4	600009	上海机场	2,999,906	38,758,785.52	2.23
5	600690	青岛海尔	3,500,000	36,015,000.00	2.07
6	601788	光大证券	2,934,170	35,122,014.90	2.02
7	600720	祁连山	3,600,000	33,660,000.00	1.94
8	601898	中煤能源	3,599,736	32,721,600.24	1.88
9	601688	华泰证券	3,696,574	32,455,919.72	1.87
10	600886	国投电力	5,000,000	29,500,000.00	1.70

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	5,002,500.20	0.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	373,287,300.00	21.47
	其中:政策性金融债	373,287,300.00	21.47
4	企业债券	102,259.35	0.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	55,459,500.00	3.19
8	其他	-	-
9	合计	433,851,559.55	24.96

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	110257	11国开57	500,000	50,565,000.00	2.91
2	110015	石化转债	500,000	50,540,000.00	2.91
3	030224	03国开24	500,000	50,505,000.00	2.91
4	110224	11国开24	500,000	50,195,000.00	2.89
5	070409	07农发09	500,000	50,110,000.00	2.88

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	750,000.00
2	应收证券清算款	17,243,514.79
3	应收股利	-
4	应收利息	6,967,064.76
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,960,579.55

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	110015	石化转债	50,540,000.00	2.91
2	110013	国投转债	4,919,500.00	0.28

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、《同益证券投资基金托管协议》;

4、《同益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。