同益证券投资基金

2012 第二季度 报告

圆园员圆年6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：圆园员圆年苑月圆园日

§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遥

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，于圆园员圆年苑月员愿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遥

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遥

基金的过往业绩并不代表其未来表现遥投资有风险，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遥

本报告中的财务资料未经审计遥

本报告期自圆园员圆年源月员日起至圆园员圆年远月猿园日止遥

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同益封闭
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	[illegible]
报告期末基金份额总额	[illegible]
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遥
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、风险最优配置遥
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（圆园员圆年源月员日-圆园员圆年远月猿园日）
1.本期已实现收益	[illegible]
2.本期利润	[illegible]
3.加权平均基金份额本期利润	[illegible]
4.期末基金资产净值	[illegible]
5.期末基金份额净值	[illegible]

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遥

2、所列数据截止到圆园员圆年远月猿园日遥

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遥

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	[illegible]	[illegible]

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遥

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遥

§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，长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理遥	[illegible]	要	[illegible]	男，[illegible]年[illegible]月出生，中国国籍遥上海交通大学硕士遥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遥[illegible]年[illegible]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，高级行业研究员遥现任同益证券投资基金基金经理，长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理遥

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曰

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》的相关规定等遥

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遥

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遥

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遥

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遥

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遥

公司对过去[illegible]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[illegible]置信水平对[illegible]日、[illegible]日的交易片段进行检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为遥

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的[illegible]的交易共有[illegible]次，为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易遥

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为遥

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

圆园员圆年圆季度的A股市场走势波荡起伏，从期初到期末上证指数和沪深[illegible]指数变动分别为[illegible]和[illegible]，在过程之中，源月份上证指数曾出现过[illegible]的上涨，但是从缘月份以来，受到国际市场上欧洲债务危机发展中国家通胀和货币贬值等外部因素以及国内经济基本面下滑的影响，市场出现了持续的回调遥

圆季度涨幅居前的行业主要是医药生物、食品饮料和房地产，而周期性强的采掘、冶金制造业出现非常明显的下跌，在经济逐渐走低的预期下，业绩更加确定的食品饮料和医药行业得到投资者的关注，而上游资源品、机械设备等行业受到持续的抛售遥

本基金在圆季度对组合进行适当的行业集中，维持了家电、电力、食品饮料等行业，减持了采掘、房地产等行业，从操作的效果上看好坏参半，但是由于组合中对食品饮料、医药等行业的配置要低于同业平均水平，导致圆季度的业绩出现明显的下滑遥

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[illegible]元，本报告期份额净值增长率为[illegible]遥

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

随着缘月到远月各项经济数据的公布，经济增速的下滑已经从预期转为现实，这里既有中国经济过去高速增长过程中积累的长期矛盾，也有外部需求不足和政策不明确带来的短期影响，从我们投资者的角度看，要适当降低对经济增速的预期，通过更加细致的研究分析企业模式和经营能力的差异遥

随着经济基本面和政策预期不确定性的消除，预计从猿季度开始会市场会表现出一定的机会，然而考虑到经济结构调整和改善的长期性，市场将处于宽幅震荡的态势，从猿季度开始企业业绩对二级市场的影响将更加明显，需要对组合做出更积极地调整遥

§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（%）
员	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
圆	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	原	原
猿	金融衍生品投资	原	原
源	买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	原	原
缘	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
远	其他资产	[illegible]	[illegible]
苑	合计	[illegible]	[illegible]

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（%）
粤	农、林、牧、渔业	[illegible]	[illegible]
月	采掘业	[illegible]	[illegible]
悦	制造业	[illegible]	[illegible]
悦园	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
悦员	纺织、服装、皮毛	原	原
悦圆	木材、家具	原	原
悦猿	造纸、印刷	原	原
悦源	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
悦缘	电子	[illegible]	[illegible]
悦远	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
悦苑	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
悦愿	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
悦怨	其他制造业	原	原
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	[illegible]	[illegible]
耘	建筑业	原	原
云	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
郧	信息技术业	[illegible]	[illegible]
匀	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
陨	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
允	房地产业	[illegible]	[illegible]
运	社会服务业	[illegible]	[illegible]
蕴	传播与文化产业	原	原
酝	综合类	原	原
	合计	[illegible]	[illegible]

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（%）
员	[illegible]	中国太保	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	天地科技	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	中兴通讯	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	青岛海尔	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	光大证券	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	华泰证券	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	格力电器	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	青岛啤酒	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	[illegible]	中国人寿	[illegible]	[illegible]	[illegible]
员园	[illegible]	上海机场	[illegible]	[illegible]	[illegible]

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（%）
员	国家债券	原	原
圆	央行票据	原	原
猿	金融债券	[illegible]	[illegible]
	其中：政策性金融债	[illegible]	[illegible]
源	企业债券	[illegible]	[illegible]
缘	企业短期融资券	原	原
远	中期票据	原	原
苑	可转债	[illegible]	[illegible]
愿	其他	原	原
怨	合计	[illegible]	[illegible]

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（%）
员	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

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遥

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遥

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、处罚的情形遥

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、处罚遥

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遥

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遥

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
员	存出保证金	[illegible]
圆	应收证券清算款	[illegible]
猿	应收股利	[illegible]
源	应收利息	[illegible]
缘	应收申购款	原
远	其他应收款	原
苑	待摊费用	原
愿	其他	原
怨	合计	[illegible]

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（%）
员	[illegible]	国电转债	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	中行转债	[illegible]	[illegible]

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遥

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遥

§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	[illegible]
报告期期间买入总份额	原
报告期期间卖出总份额	原
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	[illegible]
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例（%）	[illegible]

§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曰

2、《同益证券投资基金基金合同》曰

3、《同益证券投资基金基金托管协议》曰

4、《同益证券投资基金基金招募说明书》曰

5、法律意见书曰

6、基金管理人业务资格批件、营业执照曰

7、基金托管人业务资格批件、营业执照遥

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遥

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遥在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件遥

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遥

客户服务中心电话：[illegible]

网址：[illegible]

同盛证券投资基金

2012 第二季度 报告

圆园员圆年6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：圆园员圆年苑月圆园日

§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遥

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于圆园员圆年苑月员愿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遥

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遥

基金的过往业绩并不代表其未来表现遥投资有风险，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遥

本报告中的财务资料未经审计遥

本报告期自圆园员圆年源月员日起至圆园员圆年远月猿园日止遥

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同盛封闭
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	[illegible]
报告期末基金份额总额	[illegible]
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遥
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遥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遥
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（圆园员圆年源月员日-圆园员圆年远月猿园日）
1.本期已实现收益	[illegible]
2.本期利润	[illegible]
3.加权平均基金份额本期利润	[illegible]
4.期末基金资产净值	[illegible]
5.期末基金份额净值	[illegible]

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遥

2、所列数据截止到圆园员圆年远月猿园日遥

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遥

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	[illegible]	[illegible]

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遥

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遥

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遥

§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，研究发展部总监遥	[illegible]	要	[illegible]	男，[illegible]年[illegible]月出生，中国国籍，清华大学博士，历任国泰君安证券研究所研究员、策略部经理遥[illegible]年[illegible]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）基金经理遥
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遥	[illegible]	要	[illegible]	男，[illegible]年[illegible]月出生，中国国籍，中国社会科学院经济学博士，曾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、高级经理遥[illegible]年[illegible]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）基金经理遥

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曰

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》的相关规定等遥

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遥

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遥

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遥

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遥

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遥

公司对过去[illegible]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[illegible]置信水平对[illegible]日、[illegible]日的交易片段进行检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为遥

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的[illegible]的交易共有[illegible]次，为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易遥

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为遥

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

[illegible]上半年，政策放松预期和经济惯性下滑位于股指跷跷板的两端，市场利率的下降配合[illegible]的环比上升会推动指数的上涨，工业增加值增速回落、大宗原材料产品下跌和企业盈利预警则会推动指数下跌遥[illegible]季度市场经历了一个上升和下跌的循环后，[illegible]季度再次经历了一个上升和下跌的循环遥本基金[illegible]季度在维持组合相对均衡的基础上，继续适度增持了消费类股票遥

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[illegible]元，本报告期份额净值增长率为[illegible]遥

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

展望全年，本基金仍维持[illegible]季度报告中的观点：[illegible]年政策基调仍将以稳为主，宏观经济的复苏持续低于投资者的期望，但仍在决策层的容忍范围内；新的经济增长动力方向不明，积极的政策也难以明确方向；虽然[illegible]季度通胀回落幅度明显，但房地产销量的回暖又很快在房价上有所体现，也使得政府无法出台刺激性的房地产放松政策；全年防御性的政策抉择仍是大概率事件，即政策的优先考虑是维持经济增长的平稳，防止经济增速快速下滑及其引发的连带负面效应；因此，无论是从政策还是经济规律来看，股市的震荡格局还将延续遥

[illegible]季度本基金仍将坚持自下而上的投资策略，看好食品饮料、医药等稳健成长类股票；鉴于经济已经进入筑底阶段，本基金也会在低估值基础上配置中游成长股和上游资源股，并会密切跟踪周期类板块的进攻性机会遥

§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（%）
员	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
圆	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	原	原
猿	金融衍生品投资	原	原
源	买入返售金融资产	原	原
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	原	原
缘	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
远	其他资产	[illegible]	[illegible]
苑	合计	[illegible]	[illegible]

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（%）
粤	农、林、牧、渔业	[illegible]	[illegible]
月	采掘业	[illegible]	[illegible]
悦	制造业	[illegible]	[illegible]
悦园	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
悦员	纺织、服装、皮毛	[illegible]	[illegible]
悦圆	木材、家具	[illegible]	[illegible]
悦猿	造纸、印刷	原	原
悦源	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
悦缘	电子	[illegible]	[illegible]
悦远	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
悦苑	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
悦愿	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
悦怨	其他制造业	[illegible]	[illegible]
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	原	原
耘	建筑业	[illegible]	[illegible]
云	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
郧	信息技术业	[illegible]	[illegible]
匀	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
陨	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
允	房地产业	[illegible]	[illegible]
运	社会服务业	[illegible]	[illegible]
蕴	传播与文化产业	[illegible]	[illegible]
酝	综合类	原	原
	合计	[illegible]	[illegible]

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（%）
员	[illegible]	烟台万华	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	中国平安	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	贵州茅台	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	三一重工	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	福星股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	国投新集	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	北京城建	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	恒瑞医药	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	[illegible]	兴业银行	[illegible]	[illegible]	[illegible]
员园	[illegible]	天地科技	[illegible]	[illegible]	[illegible]

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（%）
员	国家债券	[illegible]	[illegible]
圆	央行票据	原	原
猿	金融债券	[illegible]	[illegible]
	其中：政策性金融债	[illegible]	[illegible]
源	企业债券	原	原
缘	企业短期融资券	原	原
远	中期票据	原	原
苑	可转债	原	原
愿	其他	原	原
怨	合计	[illegible]	[illegible]

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（%）
员	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

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遥

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遥

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、处罚的情形遥

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、处罚遥

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遥

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遥

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
员	存出保证金	[illegible]
圆	应收证券清算款	[illegible]
猿	应收股利	原
源	应收利息	[illegible]
缘	应收申购款	原
远	其他应收款	原
苑	待摊费用	原
愿	其他	原
怨	合计	[illegible]

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遥

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遥

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遥

§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	[illegible]
报告期期间买入总份额	原
报告期期间卖出总份额	原
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	[illegible]
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例（%）	[illegible]

§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曰

2、《同盛证券投资基金基金合同》曰

3、《同盛证券投资基金基金托管协议》曰

4、《同盛证券投资基金基金招募说明书》曰

5、法律意见书曰

6、基金管理人业务资格批件、营业执照曰

7、基金托管人业务资格批件、营业执照遥

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遥

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遥在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件遥

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遥

客户服务中心电话：[illegible]

网址：[illegible]

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

2012 第二季度 报告

圆园员圆年6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：圆园员圆年苑月圆园日

§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遥

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，于圆园员圆年苑月员愿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遥

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遥

基金的过往业绩并不代表其未来表现遥投资有风险，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遥

本报告中的财务资料未经审计遥

本报告期自圆园员圆年源月员日起至圆园员圆年远月猿园日止遥

§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	[illegible]		
交易代码	前端：[illegible]	后端：[illegible]	
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	[illegible]		
报告期末基金份额总额	[illegible]		
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（[illegible]）+中信标普A股综合指数收益率（[illegible]）		
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（圆园员圆年源月员日-圆园员圆年远月猿园日）
1.本期已实现收益	[illegible]
2.本期利润	[illegible]
3.加权平均基金份额本期利润	[illegible]
4.期末基金资产净值	[illegible]
5.期末基金份额净值	[illegible]

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遥

2、所列数据截止到圆园员圆年远月猿园日遥

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遥

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	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

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，社保组合组合经理，社保业务管理部副总监遥	[illegible]	要	[illegible]	女，[illegible]年[illegible]月出生，中国国籍遥中国社会科学院研究生院经济学博士遥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遥[illegible]年[illegible]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，社保组合经理遥现任社保业务管理部副总监，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遥

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曰

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》的相关规定等遥

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遥

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遥

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遥

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遥

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遥

公司对过去[illegible]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[illegible]置信水平对[illegible]日、[illegible]日的交易片段进行检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为遥

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的[illegible]的交易共有[illegible]次，为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易遥

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为遥

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

[illegible]年二季度，国内宏观经济继续下行，通胀大幅回落，信贷水平略低于预期，央行降准、降息陆续进行，货币政策逐渐转向适度宽松遥

货币市场上，二季度整体利率水平呈下行趋势，公开市场操作总体平衡，央行缘月份降准后利率水平明显下行，银行间市场苑天回购利率的中枢水平降至[illegible]附近，各期限Shibor利率呈现明显的陡峭化下行遥

债券市场上，收益率曲线呈现整体下移并有所陡峭化遥利率债方面，短端出现大幅下移[illegible]以上，而长端则发生[illegible]左右的下行遥信用债在二季度继续走出牛市行情，各评级信用债沿着评级从高到低收益率依次大幅下移，而低评级品种收益率下移幅度远高于高评级品种，短端下移幅度远超长端遥股票市场方面，随着经济见底预期被不断证伪，股票市场在四月份反弹后再度单边下行遥

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采取了适度积极的投资策略，主要体现在增加信用债的投资比例，利率产品的仓位和久期保持中性，获取了一定的价差和票息收益；但信用产品的配置力度仍显不足遥权益类资产部分而言，二季度曾出现波段性机会，之后就单边大幅下行，在波段行情中没有较好地把握好节奏，对组合收益产生了较大的负贡献遥另外，在报告期内转债市场受股票市场走势影响也在反弹后大幅回落，该部分资产配置也为组合带来较大的损失遥

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[illegible]元，本报告期份额净值增长率为[illegible]，同期业绩比较基准增长率为[illegible]遥

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，国内需求依然没有明显起色，物价虽已大幅下行但趋势依然向下，消费增速提升和基建投资扩张的空间相当有限遥微观层面上，物价下行伴随着企业收入和利润的明显下行，经济中各类企业为应对经济调整而采取压缩长期资本开支、降低经营成本等自我调整，使得经济实际上已经处于向下自我加强的收缩阶段遥

宏观政策方面，鉴于实体经济进一步衰退的状况得到确认，预计未来几个月央行还会继续采取适度宽松政策，放松货币条件，促进银行对实体经济的信贷支持，降准、降息政策有望继续出台，资金面将呈现适度宽松格局，货币市场利率有望在低位维持或继续下行；随着经济的持续下行，政府稳增长的动机会逐渐增强，各方面政策会陆续出台，对经济托底的作用会在下半年逐步显现遥

展望三季度债券市场，利率债收益率可能在区间内小幅下行，信用债收益率在一季度大幅下降后二季度将小幅下行，债券市场整体仍然存在投资机会，但鉴于经济衰退进入后期阶段，我们也需时刻保持谨慎，将机缩短久期，仓位上仍将适度积极，权益类市场上，我们将适度谨慎，以绝对收益为理念，适当进行波段操作；可转债方面，我们认为，部分大盘转债已经具备较好的防御和投资价值，但由于其表现将很大程度跟随股票市场，因此，在战略配置的基础上，也将适当进行波段操作遥

§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（%）
员	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
圆	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	[illegible]	[illegible]
猿	金融衍生品投资	原	原
源	买入返售金融资产	[illegible]	[illegible]
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	原	原
缘	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
远	其他资产	[illegible]	[illegible]
苑	合计	[illegible]	[illegible]

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（%）
粤	农、林、牧、渔业	原	原
月	采掘业	[illegible]	[illegible]
悦	制造业	[illegible]	[illegible]
悦园	食品、饮料	原	原
悦员	纺织、服装、皮毛	原	原
悦圆	木材、家具	原	原
悦猿	造纸、印刷	原	原
悦源	石油、化学、塑胶、塑料	原	原
悦缘	电子	原	原
悦远	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
悦苑	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
悦愿	医药、生物制品	原	原
悦怨	其他制造业	原	原
阅	电力、煤气及水的生产和供应业	原	原
耘	建筑业	[illegible]	[illegible]
云	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
郧	信息技术业	原	原
匀	批发和零售贸易	原	原
陨	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
允	房地产业	[illegible]	[illegible]
运	社会服务业	[illegible]	[illegible]
蕴	传播与文化产业	原	原
酝	综合类	原	原
	合计	[illegible]	[illegible]

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（%）
员	[illegible]	中信证券	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	航空动力	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	中国重工	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	中国南车	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	招商证券	[illegible]	[illegible]	[illegible]
远	[illegible]	万 科 粤	[illegible]	[illegible]	[illegible]
苑	[illegible]	招商地产	[illegible]	[illegible]	[illegible]
愿	[illegible]	铁龙物流	[illegible]	[illegible]	[illegible]
怨	[illegible]	国投新集	[illegible]	[illegible]	[illegible]
员园	[illegible]	冀中能源	[illegible]	[illegible]	[illegible]

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（%）
员	国家债券	[illegible]	[illegible]
圆	央行票据	原	原
猿	金融债券	[illegible]	[illegible]
	其中：政策性金融债	[illegible]	[illegible]
源	企业债券	[illegible]	[illegible]
缘	企业短期融资券	[illegible]	[illegible]
远	中期票据	原	原
苑	可转债	[illegible]	[illegible]
愿	其他	原	原
怨	合计	[illegible]	[illegible]

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（%）
员	[illegible]	石化转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	工行转债	[illegible]	[illegible]	[illegible]
猿	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
源	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
缘	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

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

序号	证券代码	证券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
员	[illegible]	宁公控 员	[illegible]	[illegible]	[illegible]

注：本基金本报告期末仅持有上述一支资产支持证券遥

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遥

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、处罚的情形遥

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、处罚遥

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遥

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遥

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
员	存出保证金	[illegible]
圆	应收证券清算款	[illegible]
猿	应收股利	原
源	应收利息	[illegible]
缘	应收申购款	[illegible]
远	其他应收款	原
苑	待摊费用	原
愿	其他	原
怨	合计	[illegible]

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（%）
员	[illegible]	石化转债	[illegible]	[illegible]
圆	[illegible]	工行转债	[illegible]	[illegible]

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不存在流通受限情况遥

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遥

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	[illegible]
报告期期间基金总申购份额	[illegible]
减：报告期期间基金总赎回份额	[illegible]
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	原
报告期期末基金份额总额	[illegible]

§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曰

2、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》曰

3、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金托管协议》曰

4、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金招募说明书》曰

5、法律意见书曰

6、基金管理人业务资格批件、营业执照曰

7、基金托管人业务资格批件、营业执照遥

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遥

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遥在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件遥

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遥

客户服务中心电话：[illegible]

网址：[illegible]