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
送出日期:2013年3月26日

同盛证券投资基金

2012年度报告摘要

2012年12月31日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2013年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计,安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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
报告期末基金份额总额	3,000,000,000份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	1999年11月26日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	唐州徽
	联系电话	010-82019988	010-66594855
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgzxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http:Www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-228,617,863.62	135,225,080.63	420,699,405.33
本期利润	103,710,545.07	-725,603,011.83	328,849,161.19
加权平均基金份额本期利润	0.0346	-0.2419	0.1096
本期基金份额净值增长率	3.41%	-19.52%	8.89%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0364	0.0108	0.0947
期末基金资产净值	3,105,963,642.67	3,032,253,097.60	4,027,856,109.43
期末基金份额净值	1.0353	1.0108	1.3426

注:1、所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。

2、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、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的"期末"均指本报告期最后一日,即12月31日。

3.2 基金净值表现

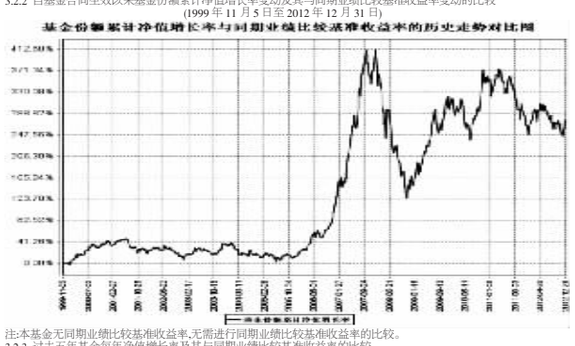
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②
过去三个月	1.97%	2.09%
过去六个月	-3.37%	2.06%
过去一年	3.41%	2.11%
过去三年	-9.38%	2.44%
过去五年	-24.37%	3.08%
自基金合同生效起至今	276.14%	2.57%

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。

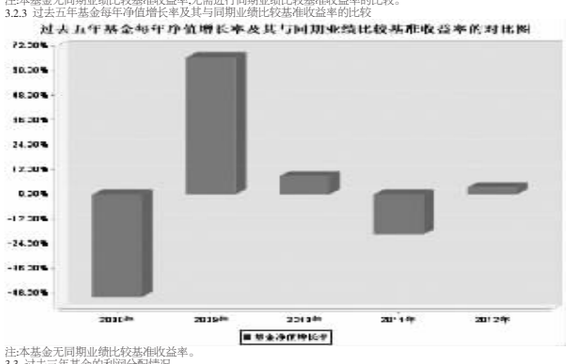
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

(1999年11月5日至2012年12月31日)



注:本基金无同期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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金无同期业绩比较基准收益率。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	0.100	30,000,000.00	-	30,000,000.00	除息日:2012年3月29日
2011年	0.900	270,000,000.00	-	270,000,000.00	除息日:2011年3月25日
2010年	-	-	-	-	2010年度末分配收益
合计	1.000	300,000,000.00	-	300,000,000.00	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6号文件批准,于1999年3月成立,注册资本为人民币15000万元。目前,本公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司(以下简称"国元证券")占注册资本的41%;新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%;安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%;安徽省投资集团控股有限公司(原"安徽省投资集团有限责任公司")占注册资本的13%。截止2012年12月31日,基金管理人共管理两支封闭式基金、二十三支开放式基金,并于2002年12月,首批取得了全国社保基金管理资格。基金管理人于2007年9月,取得合格境内机构投资者资格,并于2008年2月,取得从事特定客户资产管理业务资格。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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、公司总经理助理,研究部总监。	2008年8月11日	—	11年	男,1974年5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。2007年2月加入长盛基金管理有限公司,现任公司总经理助理,研究部总监,同盛证券投资基金(本基金)基金经理。
田间	本基金基金经理助理,行业研究员。	2012年7月5日	—	4年	女,1978年11月出生,中国国籍。毕业于中央财经大学,获硕士学位。2008年7月加入长盛基金管理有限公司,现任行业研究员,同盛证券投资基金(本基金)基金经理助理。
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	2012年7月20日	11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,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。目前已离任。

注:1、上表基金经理及基金经理助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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》为保证公司管理的所有投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,公司重新修订了《公司公平交易细则》。报告期内,公司根据该细则实际执行情况,对其进行了完善。该细则从研究、投资授权、投资决策、交易执行、投资组合信息隔离、行为监控评估与分析、报告与信息披露等环节对公平交易的管理提出明确要求。

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。投资组合经理在投资决策委员会授权范围内自主进行投资决策,超越授权范围的投资行为,需依照公司相关制度规定履行审批程序。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》规定,对交易所公开竞价交易,公司开启恒生交易系统中的公平交易程序,对符合公平交易条件的投资指令强制执行公平交易,具体如下:

一、限价指令的执行原则:对于不同限价的同向指令,按照"价格优先、时间优先、同时均分"的原则执行;对于相同限价的同向交易指令,强制执行恒生交易系统中的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托比例,按比例具体执行。

二、市价指令的执行原则:对于市价同向交易指令,按照"时间优先"的原则执行交易指令,后到达指令后按照先到指令剩余数量和新到指令数量采用公平委托系统执行;对于同时同向交易指令,强制执行恒生交易系统中的公平交易程序,按照各投资组合委托数量设置委托比例,按比例具体执行。

三、部分限价指令与部分市价指令的执行原则:对于不同投资经理下达的不同类型的同向交易指令,按照"价格优先"的原则执行交易指令,在未满足限价执行条件时,先执行市价指令,后执行限价指令。

对债券一级市场申购、非公开发行股票等以公司名义进行的交易,公司依照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

对于银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价的交易,则按照"时间优先、价格优先、同时申报时要求价格差异趋于零且申购量等比分配"的原则进行。

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。风险管理部每日通过系统监控不同组合的反向交易等,监控分析发现异常情况时,要求相关人员作出合理性解释备查,每月度出具上月度公平交易监控分析报告,每季度和每年度分别出具公平交易专项分析报告;公司通过系统记录场内异常交易情况,监察稽核部定期对其进行分析评估,每月度出具异常交易总结报告;针对场外交易,监察稽核部每月度对公司旗下所有投资组合场外交易进行专项检查,检查范围包括但不限于:银行间市场、交易所大宗交易等,每月度出具检查报告;监察稽核部对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案、分配过程进行监督,确保分配结果符合公平交易原则。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》各项规定,保证公平对待旗下的每一个投资组合。各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;交易环节中,严格执行集中交易制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;事后监控分析环节中,公司定期对投资组合公平交易情况和异常交易情况进行分析,并出具公平交易执行情况分析报告;同时,公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查,并对发现的问题进行及时报告。

报告期内,公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》中的规定对公司所有投资组合同向交易价差进行分析,取最近4个季度交易记录,分别以1、3、5日为时间片段分析不同基金间以及公募基金、社保组合、专户组合等大类资产间的同向交易情况。对于同向交易次数足够进行T检验的情况,以95%置信水平对其进行假设检验排查;对于同向交易次数较少的情况考察交易价差对基金净值带来的累计贡献。分析结果显示本投资组合与公司其它组合间同向交易价差未见异常。

本报告期内,公司严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.3 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5%的交易共有37次,其中24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;13次为长盛同庆封闭式基金转型为指数型基金前的反向交易。

本报告期一季度内,长盛同庆投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,该基金一季度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。上述申请已投经公司投资决策委员会批准。打开反向交易控制期间,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。

本报告期内,未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2012年中国经济总体呈现探底寻底的过程,但底部依然不明朗。表现在季度GDP持续下滑至今尚未见底,工业增加值持续低于预期,CPI平稳下降,但由于经济疲软,PPI下滑较快,企业盈利拐点的出现也一再滞后。政策方面,呈现典型的"在稳增长和结构转型之间寻求平衡"。表现在政府依然严控房地产,主要依靠中央基建投资来对冲经济下滑;央行上半年两次降准,两次降息,7月之后主要通过逆回购和加大社会融资总量来调节市场流动性;十八前夕各部委陆续出台的维稳政策。海外方面呈现艰难弱复苏态势。表现在欧美经济在2011年4季度出现短暂触底回升之后,2012年2、3季度欧美经济增速集体环比下滑,欧债风险重新提升,10月份后随着QE3预期的逐步兑现和美国大选的尘埃落定,"财政悬崖"有成为美国经济复苏的最大隐忧。

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1.0353元,本报告期份额净值增长率为3.41%。

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

2013年,在改革红利和城镇化的拉动下,大方向上会好于2012年。经济呈现底部企稳态势,CPI前低后高但总体可控,政策将延续"在稳增长和结构转型之间寻求平衡"。上市公司的盈利能力有望于2013年上半年环比见底,流动性上仍延续结构性定向宽松的基调。未来的政策导向对经济走势是一个很大的变量,长期前景将取决于体制改革、财税改革、收入分配改革等。外围经济预计2013年下半年将环比改善,但力度较弱。但年内来看,国内经济在政府基建投资的带动下呈现的阶段性企稳又比较脆弱,地方债和房地产调控,影子银行监管力度,美国"财政悬崖"都将成为经济确定见底的干扰因素。鉴于隐忧的存在和长期改善的确定性,本基金认为对2013年无需继续恐慌,但股票市场难以出现系统性的投资机会,而一些供需关系转好的细分领域,以及具备管理、资金、品牌等优势的龙头企业值得重点研究。本基金对中期前景的判断乐观谨慎,从长布局,仍将坚持自下而上的投资策略,看好食品饮料、医药、旅游等涉及民生的稳健成长类公司,并阶段性配置拉动经济的投资品行业。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定,本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值小组,参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据,确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理(担任估值小组组长)、公司副总经理和督察长(担任估值小组副组长)、权益投资部、金融工程与量化投资部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组,负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验,具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存在异议时,托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金未签约与任何估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十七条中对基金利润分配原则的约定,本基金于2012年3月29日对2011年收益进行了分配,分配金额为30,000,000.00元。

本基金截至2012年12月31日,期末可供分配利润为-109,151,232.72元,其中:未分配收益已实现部分为-109,151,232.72元,未分配收益未实现部分为215,114,875.39元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对同盛证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师李慧民、王珊珊2013年3月13日对本基金2012年12月31日的资产负债表、2012年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了安永华明(2013)审字第60468688_A01号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:同盛证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	110,444,041.91	137,285,717.73
结算备付金	2,013,091.96	1,168,707.01
存出保证金	500,000.00	638,549.12
交易性金融资产	3,023,250,440.89	2,899,148,610.92
其中:股票投资	2,348,990,991.39	2,207,149,141.22
基金投资	-	-
债券投资	674,259,449.50	691,999,469.70
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	4,280,411.45	868,092.45
应收利息	7,972,001.10	9,146,601.55
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,148,459,987.31	3,048,256,278.78
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	33,785,043.55	6,703,686.97
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,722,640.40	3,931,284.75
应付托管费	620,440.04	655,214.12
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,679,328.99	2,024,103.68
应交税费	1,823,891.66	1,823,891.66
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	865,000.00	865,000.00
负债合计	42,496,344.64	16,003,181.18
所有者权益:		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	105,963,642.67	32,253,097.60
所有者权益合计	3,105,963,642.67	3,032,253,097.60
负债和所有者权益总计	3,148,459,987.31	3,048,256,278.78

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值人民币1.0353元,基金份额总额3,000,000,000份。

7.2 利润表

会计主体:同盛证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	166,256,570.50	-653,502,866.39
1.利息收入	30,673,320.38	32,264,798.86
其中:存款利息收入	1,737,748.90	1,093,153.85
债券利息收入	28,052,990.11	31,000,166.16
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	882,581.37	171,478.85
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"号填列)	-196,745,158.57	175,060,427.21
其中:股票投资收益	-230,524,254.34	157,090,571.78
基金投资收益	-	-
债券投资收益	149,033.36	-3,004,915.71
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	33,630,062.41	20,974,771.14
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	332,328,408.69	-860,828,092.46
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	62,546,025.43	72,100,145.44
1.管理人报酬	46,715,905.82	54,614,447.35
2.托管费	7,785,984.21	9,102,407.84
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	7,499,762.88	6,375,178.14
5.利息支出	-	741,474.80
其中:卖出回购金融资产支出	-	741,474.80
6.其他费用	544,372.52	1,266,637.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	103,710,545.07	-725,603,011.83
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	103,710,545.07	-725,603,011.83

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:同盛证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	32,253,097.60	3,032,253,097.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	103,710,545.07	103,710,545.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-30,000,000.00	-30,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	105,963,642.67	3,105,963,642.67
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	1,027,856,109.43	4,027,856,109.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-725,603,011.83	-725,603,011.83
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-270,000,000.00	-270,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	32,253,097.60	3,032,253,097.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

周 兵 杨思乐 戴君棉

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

同盛证券投资基金(以下简称"本基金")系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[1999]30号文《关于同意同盛证券投资基金设立的批复》批准,由中信证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、天津北方国际信托投资股份有限公司、国元证券股份有限公司和长盛基金管理有限公司五家发起人共同发起并向社会募集设立。基金合同于1999年11月5日正式生效,本基金为契约型封闭式,存续期为15年,发行规模为30亿份基金份额。本基金经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上字[1999]109号文审核同意,于1999年11月26日在深交所挂牌交易。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其股票投资部分将主要投资于成长型股票和价值型股票。本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%,本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%。本基金并未就业绩比较基准做出相关规定。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明:本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明:本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明:本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰。

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长江证券股份有限公司("长江证券")	基金发起人
天津北方国际信托投资股份有限公司("天津国际信托")	基金发起人
中信证券股份有限公司("中信证券")	基金发起人
长盛基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
国元证券	基金发起人、基金管理人股东
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
中国银行股份有限公司("中国银行")	基金托管人

注:1、根据中国证券会2012年7月10日发布的证监许可[2012]917号《关于核准长盛基金管理有限公司修改章程的批复》,安徽省投资集团有限责任公司更名为安徽省投资集团控股有限公司后仍为长盛基金管理有限公司的股东。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
长江证券	855,609,730.92	17.34%	254,865,267.76	6.15%
中信证券	78,618,789.68	1.59%	195,187,895.12	4.71%
国元证券	607,465,870.34	12.31%	919,909,126.60	22.19%

7.4.8.1.2 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.4 回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
长江证券	100,000,000.00	11.36%	-	-

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	743,109.44	17.30%	-	-
中信证券	69,570.10	1.62%	41,678.29	2.48%
国元证券	553,035.32	12.87%	553,035.32	32.95%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	207,079.47	5.96%	20,346.18	1.01%
中信证券	158,591.96	4.56%	129,527.06	6.40%
国元证券	773,376.47	22.26%	405,119.61	20.02%

注:1、上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年12月31日 | 上年度可比期间 2011年1月