

同盛证券投资基金

2011 第四季度 报告

2011年 12 月 31 日

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	138,454,424.74	4.54
6	其他资产	10,653,243.12	0.35
7	合 计	3,048,256,278.78	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)	占其总资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	23,753,092.36	0.78
B	采掘业	228,291,360.12	7.53
C	制造业	1,244,141,672.98	41.03
C0	食品、饮料	259,012,860.47	8.54
C1	纺织、服装、皮毛	87,188,766.46	2.88
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	193,871,997.30	6.39
C5	电子	11,880,000.00	0.39
C6	金属、非金属	115,002,267.60	3.79
C7	机械、设备、仪器	277,028,748.73	9.14
C8	医药、生物制品	266,375,952.32	8.78
C99	其他制造业	33,601,080.10	1.11
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	56,611,060.48	1.87
G	信息技术业	70,222,611.36	2.32
H	批发和零售贸易	176,896,540.71	5.83
I	金融、保险业	222,852,632.07	7.35
J	房地产业	151,906,317.06	5.01
K	社会服务业	16,782,000.00	0.55
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	15,691,854.08	0.52

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	15,028,837	193,871,997.30	6.39
2	601318	中国平安	3,299,906	113,648,762.64	3.75

3	600036	招商银行	9,199,989	109,203,869.43	3.60
4	600123	兰花科创	2,699,910	104,972,500.80	3.46
5	600031	三一重工	8,000,000	100,320,000.00	3.23



						(%)
1	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00	100.00

2	080411	0804发 11	1,000,000	100,460,000.00	3.31
3	110203	11月开 03	700,000	70,154,000.00	2.31
4	070228	07月开 28	500,000	50,225,000.00	1.66
5	080207	08月开 07	500,000	50,150,000.00	1.65

5.6 报告期内次公开发售基金份额资产净值比例大小排名前十名权证投资说明
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期内次公开发售基金份额资产净值比例大小排名前十名权证投资说明
 本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

资产、处罚的情形。

本报告期末基金持有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 前十大重仓股

基金持有的前十名股票,均为基金合同规定选股策略范围内的股票。

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	868,092.45
3	应收股利	-
4	应收利息	9,146,601.55
5	应收中购款	-

6	待摊费用	-
7	其他	-
9	合计	10,653,243.12

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受流通限制情况说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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。

5.9 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

	份额单位:份
报告期末前次管理人持有的封闭式基金份额	6,000,000.00
报告期末前次买入总份额	-
报告期末前次卖出总份额	-
报告期末前次买入总份额	6,000,000.00
报告期末前次卖出总份额	-

报告期末持有的封闭式基金份额占期末基金份额比例(%)	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、中国证券投资基金业协会备案文件； 3、锦盛证券投资基金基金协议摘要； 4、《锦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 备查文件存放在基金管理人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或基金托管人的办公场所或基金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所有备查文件的复印件或复印件。 投资者若对本报告书有任何疑问，可咨询本基金管理人：锦盛基金管理有限公司。 客户服务中心电话：400-888-2666、010-62535088。 网址：http://www.csfund.com.cn	

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	000630	聚兴银社	750,000	4,710,000.00	0.57

2	600010	宝钢股份	674,786	2,780,118.32	0.34
3	601991	大唐发电	524,973	2,708,860.68	0.33
4	000937	冀中能源	70,000	1,180,200.00	0.14

注：本基金本报告期末仅持有四只股权投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

2	银行类	-	-	-	-
3	基金类	-	-	-	-
4	其中：政策性金融债	-	-	-	-
5	企业类	-	-	-	-
6	企业短期融资券	-	-	-	-
7	中期票据	-	-	-	-
8	可转债	745,109.70	-	-	0.09
9	其他	-	-	-	-
10	合计	745,109.70	-	-	0.09

注5：基金类资产净值占基金类资产净值比例大于或等于5%的资产名称

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	745,109.70	0.09

注6：基金类资产持有两只债券

序号	资产名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国电转债	745,109.70	0.09

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。

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	27,154.13
5	应收申购款	4,733.99
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	1,081,888.12

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

报告期初基金份额总额	1,164,138,031.82
报告期间基金总申购份额	91,329,853.75

