

同盛证券投资基金

2012 半年度报告摘要

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围且执行一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联交易单元进行的不交易

6.4.8.1.1 股票交易

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		本期 2011年1月1日至2011年6月30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	379,245,306.86	17.43%	95,928,008.84	3.81%
中信证券	-	-	11,001,207.66	0.44%
国元证券	-	-	434,404,321.35	17.24%
合计	379,245,306.86	17.43%	541,333,537.85	21.48%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方佣金

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	当期佣金	占当期佣金总额的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金余额总额的比例
长江证券	326,302.83	17.79%	326,302.83	18.90%
中信证券	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-
合计	326,302.83	17.79%	326,302.83	18.90%

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券费、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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金托管费

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	金额	占基金资产净值比例	金额	占基金资产净值比例
当期发生的基金应支付的管理费	23,832,437.29	-	28,713,920.42	-

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，本基金成立三个月后，若有现金的比例超过本基金资产净值的20%，超出部分不计提基金管理费。计算方法如下：

H=H×1.50%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值 扣除本基金持有现金比例超过20%部分的基金资产净值

本基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.8.2.2 基金托管费

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	金额	占基金资产净值比例	金额	占基金资产净值比例
当期发生的基金应支付的托管费	3,972,072.92	-	4,785,653.40	-

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=H×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

本基金管理人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 回购/交易；

银行间市场交易各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购	基金正回购
合计	-	-	-	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间内未发生银行间债券回购交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	金额	占基金资产净值比例	金额	占基金资产净值比例
期初持有的基金份额	6,000,000	-	6,000,000	-
期间申购/买入总额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
期间赎回/卖出总额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	6,000,000	-	6,000,000	-
期末持有的基金份额占基金总份额的比例	0.20%	-	0.20%	-

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

关联方名称	本期 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	持有的基金份额	占基金总份额的比例	持有的基金份额	占基金总份额的比例
国元证券	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%
北方国际信托	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%
长江证券	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%
中信证券	3,000,000	0.10%	3,000,000	0.10%

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	存款余额	当期利息收入	存款余额	当期利息收入
中国银行	173,181,083.20	594,150.82	22,133,136.99	558,119.94

注：本基金银行存款存放于基金托管人中国银行股份有限公司，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联方交易

无。

6.4.9 期末2012年6月30日本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发增发行证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发增发行证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末流通受限资产交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末持有回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额		占基金资产净值比例 (%)	
		金额	占基金资产净值比例 (%)	金额	占基金资产净值比例 (%)
1	权益投资	2,360,468,900.89	73.12		
	其中：股票	2,360,468,900.89	73.12		
2	固定收益投资	679,252,059.90	21.04		
	其中：债券	679,252,059.90	21.04		
3	资产支持证券	-	-		
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	174,800,150.72	5.42		
6	其他各项资产	13,524,706.91	0.42		
7	合计	3,228,045,818.42	100.00		

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值		占基金资产净值比例 (%)	
		公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	25,823,225.28	0.80		
B	采掘业	164,882,774.75	5.13		
C	制造业	1,370,751,703.71	42.65		
D	食品、饮料	432,974,656.32	13.47		
C1	纺织、服装、皮毛	6,170,231.97	2.85		
C2	木材、家具	1,939,427.60	0.06		
C3	造纸、印刷	-	-		
C4	石油、化学、塑胶、塑料	205,930,047.60	6.41		
C5	电子	3,667,201.44	0.11		
C6	金属、非金属	51,244,808.00	1.59		
C7	机械、设备、仪表	343,274,087.33	10.68		
C8	医药、生物制品	183,832,421.37	5.72		
C9	其他制造业	56,398,822.08	1.75		
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-		
E	建筑业	1,853,888.00	0.06		
F	交通运输、仓储业	31,366,382.18	0.98		
G	信息技术业	97,163,712.00	3.02		
H	批发和零售业	148,721,430.86	4.63		
I	金融、保险	271,065,490.00	8.43		
J	房地产业	195,402,286.60	6.08		
K	社会服务业	31,799,322.71	0.99		
L	传播与文化产业	21,638,684.80	0.67		
M	综合类	-	-		
合计		2,360,468,900.89	73.44		

7.3 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

代码	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600309	烟台万华	14,332,037	191,332,693.95	5.95
2	601318	中国平安	3,299,906	150,937,700.44	4.70
3	600519	贵州茅台	594,246	142,113,930.90	4.42
4	600031	三一重工	8,000,000	111,360,000.00	3.46
5	000926	福星股份	10,451,531	97,617,299.54	3.04
6	601918	国投新集	5,983,846	70,627,759.66	2.27
7	600266	北京城建	4,517,774	68,624,987.06	2.16
8	600276	恒瑞医药	2,306,305	66,214,016.55	2.04
9	601166	兴业银行	5,036,181	65,369,629.38	2.03
10	600882	天地科技	4,274,199	61,762,175.55	1.92

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读刊载于http://www.csfund.com.cn网站的半年度报告全文。

7.4 报告期末股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%前20名的股票明细

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%前20名的股票明细

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.4 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.5 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.6 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.7 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.8 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.9 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.10 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.11 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.12 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.13 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.14 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.15 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.16 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.17 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.18 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.19 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.20 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.21 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.22 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.23 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.24 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.25 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.26 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.27 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.28 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.29 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.30 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.31 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.32 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.33 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.34 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.35 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.36 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.37 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.38 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.39 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.40 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.41 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.42 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.43 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.44 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.45 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.46 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.47 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.48 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.49 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.50 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.51 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.52 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.53 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.54 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.55 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.56 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.57 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.58 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.59 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.60 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.61 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.62 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.63 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.64 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.65 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.66 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.67 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.68 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.69 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.70 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.71 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.72 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.73 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.74 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.75 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.76 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.77 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.78 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.79 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.80 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.81 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.82 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.83 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.84 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.85 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.86 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.87 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.88 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.89 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.90 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.91 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.92 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.93 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.9