长盛同德主题增长股票型证券投资基金

【2012】第三季度报告

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10月25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10月24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7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同德主题股票
基金主代码	519039
交易代码	519039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月25日
报告期末基金份额总额	7,359,949,366.41份
投资目标	本基金为股票型证券投资基金,投资目标是在确定促进中国经济持续增长的主题背景下,挖掘中国经济持续增长的动力之所在,选取具有高成长性和具备持续增长潜力的上市公司,分享中国经济高速增长的成果;在严格控制投资风险的前提下,努力保持基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将沿着全球化、城镇化、消费升级、制度变革四大主题进行大类资产配置;根据企业获利能力、增长能力、资产回报率、资产管理能力等定量指标,结合公司治理结构状况等定性指标对行业内上市公司进行综合评价,动态的寻找行业与个股的最佳结合点。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金。风险高于混合型基金、债券基金,属于较高风险、较高回报的基金产品。
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7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-361,206,421.42
2.本期利润	-289,176,232.28
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0390
4.期末基金资产净值	5,238,295,354.12
5.期末基金份额净值	0.7117

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9月30日。

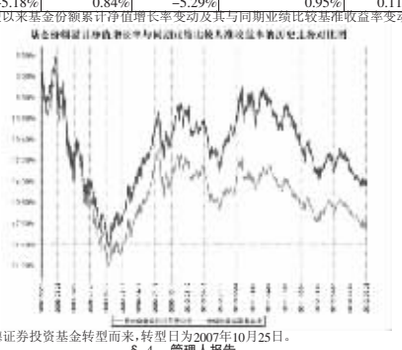
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-5.18%	0.84%	-5.29%	0.95%	0.11%	-0.11%

3.2.2 自基金转型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:本基金由同德证券投资基金转型而来,转型日为2007年10月25日。

§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		
邓永明	本基金基金经理,长盛动态精选证券投资基金基金经理,权益投资部副总监。	2010年8月12日	-	13年	男,1971年7月出生,中国国籍。毕业于山西农业大学,获学士学位。曾任大成基金管理有限公司研究员、交易员和基金经理助理。2005年7月底加入长盛基金管理有限公司,曾任基金同益基金经理助理,同德证券投资基金基金经理、长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任权益投资部副总监,长盛动态精选证券投资基金基金经理,长盛同德主题增长股票型证券投资基金(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、《长盛同德主题增长股票型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。

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

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12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。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

3季度,美国市场小幅上扬,欧洲市场因欧债危机缓和而大幅反弹。美国经济复苏的反复依然惯性存在,房地产显示出弱复苏的迹象、制造业不甚乐观、就业则不断反复;货币方面,因非农就业难以确定性好转,在美国大选关键期美联储推出了无上限QE3,超出市场预期。欧元区经济继续萎靡,9月6号先于美国QE3推出无上限的购债计划,对宽货币解决欧债危机达成了妥协。受益于美、欧、日央行的宽货币政策,海外股指和大宗商品出现普遍上涨。

国内市场,3季度经济延续了同比增速下滑、环比逐步触底的趋势,但经济触底的时间再次延后:1-9月累计发电量累计同比增速低于4%,PPI数据虽仍为负值但环比已经开始改善;货币上受外围宽货币政策的影响,国内货币宽松的空间受到抑制,3季度没有再次启动降息和降准等宽松政策,辅之以采用逆回购等手段来缓解流动性。3季度,市场的主要矛盾转化为"经济触底的时间不断推后与国家稳增长政策没有实质性出现"的矛盾,虽然发改委批准了8000亿元的轨道交通投资和总里程超过2000公里的公路建设项目,A股表现昙花一现。

由于对宽松政策预期落空,本基金降低了持仓比例,同时积极从医药、食品饮料等消费行业入手,挖掘个股,并适当参与了苹果系列产品产业链上相关配套公司,获得一些收益,但是我们仍然为前3季度未给投资人带来正收益而表示歉意。

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0.7117元,本报告期份额净值增长率为-5.18%,同期业绩比较基准增长率为-5.29%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一、对宏观经济和证券市场的展望

从经济周期的角度看,4季度将实现环比筑底。判断经济走向复苏的动力是2012年投资的重中之重,相对数量型的GDP增长,我们认为国家仍会把有质量的GDP增长作为下一个阶段经济增长的引擎,带动经济走出衰退,这些行业也会普遍受益于积极财政政策支持,当然这是一个较为长期的过程。

未来一个季度,需要平衡"经济何时探底与国内稳增长政策何时实质推出"这一矛盾,短期内需要更加积极地平衡政策和经济,关注4季度的"十八大"会议的召开和银行业中长期贷款的增速情况;策略上相对于"价",我们一直在关注"量"的机会,在过去重点关注业绩确定性强的低估值品种的基础上,会尽可能精确地平衡经济增速触底带来的盈利能力回升的时间节奏。

二、本基金下阶段投资策略

未来积极布局以下投资主题:①继续布局必需消费品主题,包括与大众消费密切相关的品牌消费品和人口老龄化受益的医药股。②阶段性关注经济触底后的高弹性机会,包括券商、保险、房地产、建材、煤炭等。③积极财政政策的受益领域,包括节能环保、信息服务、新材料、电子、传媒等。④科技创新带来的成长主题,包括具有优秀管理团队、技术领先优势或独特商业模式的科技、医药和化工行业中能够持续成长的企业。

§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	3,559,895,014.06	67.06
	其中:股票	3,559,895,014.06	67.06
2	固定收益投资	150,723,600.00	2.84
	其中:债券	150,723,600.00	2.84
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	988,002,402.00	18.61
	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	602,854,089.53	11.36
6	其他资产	6,895,478.90	0.13
7	合计	5,308,370,584.49	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	23,300,215.36	0.44
C	制造业	2,185,042,720.75	41.71
C0	食品、饮料	554,653,896.11	10.59
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	189,848,648.46	3.62
C5	电子	161,641,212.78	3.09
C6	金属、非金属	69,497,289.87	1.33
C7	机械、设备、仪表	513,682,498.96	9.81
C8	医药、生物制品	695,719,174.57	13.28
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	93,035,401.90	1.78
E	建筑业	25,768,648.15	0.49
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	265,357,967.04	5.07
H	批发和零售贸易	149,000,989.04	2.84
I	金融、保险业	698,539,646.04	13.34
J	房地产业	119,849,425.78	2.29
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,559,895,014.06	67.96

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	000581	威孚高科	10,009,855	248,945,093.85	4.75
2	000895	双汇发展	3,199,054	193,542,767.00	3.69
3	600837	海通证券	19,338,924	185,266,891.92	3.54
4	600887	伊利股份	8,523,739	181,555,640.70	3.47
5	600521	华海药业	12,350,996	173,407,983.84	3.31
6	600267	海正药业	10,501,856	164,144,009.28	3.13
7	600406	国电南瑞	8,691,813	154,192,762.62	2.94
8	600519	贵州茅台	500,471	123,015,771.80	2.35
9	600030	中信证券	10,003,498	117,941,241.42	2.25
10	601318	中国平安	2,700,553	113,261,192.82	2.16

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	150,723,600.00	2.88
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	150,723,600.00	2.88

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	088039	08兵器装备债	800,000	81,432,000.00	1.55
2	115003	中兴债1	700,000	69,291,600.00	1.32

注:本基金本报告期末仅持有上述两支债券。

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。

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。

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股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,000,000.00
2	应收证券清算款	1,655,296.80
3	应收股利	364,574.66
4	应收利息	1,831,973.22
5	应收申购款	13,634.22
6	其他应收款	30,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,895,478.90

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可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600406	国电南瑞	154,192,762.62	2.94	因重大事项停牌

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	7,455,453,890.29
报告期期间基金总申购份额	7,248,321.35
减:报告期期间基金总赎回份额	102,752,845.23
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	7,359,949,366.41

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会关于核准同德证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复;

2、《长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛同德主题增长股票型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛同德主题增长股票型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】第三季度报告

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10月25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10月24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7月1日起至2012年9月30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7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-67,350,432.04
2.本期利润	-85,855,674.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0429
4.期末基金资产净值	1,691,433,735.75
5.期末基金份额净值	0.8457

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9月30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	-4.83%	2.11%

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,长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理。	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,长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理。

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

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12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。

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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年3季度A股市场呈现交替下跌的态势。期间上证指数和沪深300指数分别下跌6.26%和6.85%,而中小板指数和创业板指数分别下跌4.76%和5.10%。在7月份受到企业集中公布中期业绩盈利调整公告的影响,中小型公司出现集中下跌,导致中小板和创业板指数在7月份分别下跌了6.69%和6.84%;而进入8月份受到有效需求不足、地产价格波动等因素的影响,房地产等行业带动上证指数和沪深300指数出现下跌;尽管在9月上旬出现预期推动的短暂上涨,但是国际形势的复杂性导致反弹缺乏持续性。

从全市场行业指数的情况看,3季度各行业普遍下跌,跌幅相对较小的主要是信息服务、医药生物、餐饮旅游等稳定类行业,而跌幅较大的包括纺织服装、机械设备、房地产等。

本基金在3季度保持相对稳定的股票仓位,增持的主要是医药、农化、家电、电力设备等,卖出的主要是通信设备、建材等,另外在8月份买入了业绩增速快的中小盘公司。

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0.8457元,本报告期份额净值增长率为-4.83%。

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

目前经济发展仍处于过渡期,增速的下滑已经从预期转为现实。过去高速增长过程中积累的风险开始爆发,导致市场呈现持续低迷的态势。从10月份开始市场再次进入业绩的密集披露期,受到需求及价格的影响,预计整体的业绩增速仍然不如预期,特别是金融(银行、保险、证券)、上游资源的业绩增速下滑或绝对值下滑将导致市场整体的盈利水平出现一定程度的下降。

4季度仍然处于政策的真空期,对各类政策的预期大都是空中楼阁,无法证实或执行,缺乏基于政策的投资机会。同时在市场规模快速扩张的情况下,行业和企业间的差异性拉大,需要更加细致的观察市场和基本面的研究为投资提供决策支持。后期投资研究的重点会放在寻找业绩分化状态下的结构性机会,增强对中小市值公司的研究,平衡公司估值、长期成长与中短期减持之间的关系,通过更积极主动的组合管理来改善组合的业绩。

§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	1,188,543,192.01	69.42
	其中:股票	1,188,543,192.01	69.42
2	固定收益投资	440,207,021.08	25.71
	其中:债券	440,207,021.08	25.71
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	30,000,000.00	1.75
	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	44,277,093.05	2.59
6	其他资产	9,102,936.71	0.53
7	合计	1,712,130,242.85	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	21,321,828.00	1.26
B	采掘业	52,540,467.00	3.11
C	制造业	660,223,597.12	39.03
C0	食品、饮料	83,889,912.21	4.96
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	77,371,388.82	4.57
C5	电子	71,847,240.24	4.25
C6	金属、非金属	39,625,253.94	2.34
C7	机械、设备、仪表	270,801,857.52	16.01
C8	医药、生物制品	116,687,944.39	6.90
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	43,086,619.75	2.55
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	105,460,558.53	6.23
H	批发和零售贸易	27,056,710.26	1.60
I	金融、保险业	215,884,646.34	12.76
J	房地产业	28,842,794.30	1.71
K	社会服务业	34,125,970.71	2.02
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,188,543,192.01	70.27

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	601601	中国太保	3,599,640	72,820,717.20	4.31
2	600582	天地科技	4,499,488	46,299,731.52	2.74
3	601788	光大证券	3,299,891	41,512,628.78	2.45
4	000527	美的电器	4,481,077	41,136,286.86	2.43
5	600690	青岛海尔	3,598,835	40,774,800.55	2.41
6	601607	上海医药	3,399,887	40,084,667.73	2.37
7	601688	华泰证券	4,103,586	39,558,569.04	2.34
8	601628	中国人寿	1,991,564	37,640,559.60	2.23
9	002028	思源电气	2,822,779	37,430,049.54	2.21
10	600600	青岛啤酒	999,860	32,495,450.00	1.92

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	420,872,000.00	24.88
	其中:政策性金融债	420,872,000.00	24.88
4	企业债券	103,021.08	0.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	19,232,000.00	1.14
8	其他	-	-
9	合计	440,207,021.08	26.03

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	110224	11国开24	1,000,000	100,340,000.00	5.93
2	110257	11国开57	500,000	50,470,000.00	2.98
3	030224	03国开24	500,000	50,440,000.00	2.98
4	110203	11国开03	500,000	50,110,000.00	2.96
5	020214	02国开14	500,000	50,015,000.00	2.96

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	760,712.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	12,584.88
4	应收利息	8,329,638.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,102,936.71

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	113001	中行转债	19,232,000.00	1.14

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000527	美的电器	41,136,286.86	2.43	因重大事项停牌

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、《同益证券投资基金基金托管协议》;

4、《同益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。

长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

【2012】第三季度报告

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:2012年10月25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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10月24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7月1日起至2012年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同智优势混合(LOF)
基金主代码	160805
交易代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1月5日
报告期末基金份额总额	2,459,856,661.68份
投资目标	主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司,所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下,谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	本基金为主动管理的混合型基金,对各类资产采取适度灵活的资产配置。主要选股思路是采用自上而下的路径,投资策略上偏重选股能力的发挥。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益-较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。
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(2012年7月1日-2012年9月30日)
1.本期已实现收益	-198,774,732.85
2.本期利润	-139,021,882.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0562
4.期末基金资产净值	1,738,824,272.64
5.期末基金份额净值	0.7069

注: