长盛同祥泛资源主题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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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及更新。

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	长盛同祥泛资源股票
基金主代码	080008
交易代码	080008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月26日
报告期末基金份额总额	60,700,763.26份
投资目标	将灵活投资于具有泛资源禀赋的上市公司股票,分享中国泛资源经济发展的长期效益,力争为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势,运用科学严谨、规范化的资产配置方法,灵活配置国内具有泛资源禀赋的上市公司股票,谋求基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	沪深300指数x70%+中证综合债券指数x30%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,预期风险和收益高于混合型基金,债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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	-547,137.04
2.本期利润	-2,293,996.81
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0440
4.期末基金资产净值	60,255,746.97
5.期末基金份额净值	0.993

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。

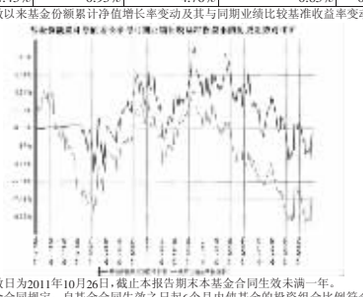
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-4.43%	0.93%	-4.76%	0.83%	0.33%	0.10%

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



注:1、本基金合同生效日为2011年10月26日,截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按照本基金的基金合同规定,自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条"(二)投资范围"、"(七)投资限制"的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
李庆林	本基金基金经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理,社保组合组合经理。	2011年10月26日	—	9年	男,1974年10月出生,中国国籍。中国人民大学硕士。曾先后在长城证券有限公司、国元证券有限公司和建信基金管理有限公司担任研究员等职务。2009年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究发展部副总监,现任社保组合组合经理,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同祥泛资源主题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、《长盛同祥泛资源主题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,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》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,同日反向交易成本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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

3季度,中国经济增速显著下降,尤其是名义经济增速更是下降明显。中国经济的调整更多地是政府主动宏观调控的结果。经济的调整对资本市场影响很大,指数在上半年下降的通道中持续调整。尽管指数跌幅较小,但是对市场参与人士的心理冲击较大。整体市场处于一种悲观观望的情绪之中,即便偶有反弹,但基本上也是昙花一现。

3季度,我们基本上维持了上半年的配置,依然重仓持有大消费板块,包括食品饮料和医药行业。

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0.993元,本报告期份额净值增长率为-4.43%,同期业绩比较基准增长率为-4.76%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

9月份的数据给了投资者一些乐观的理由:中国的经济增速依然保持在高位,出口数据创历史新高。这其实说明中国依然有保持持续增长的基础。不过,相关数据都是在社会融资总量、货币供给保持高位运行的结果。在社会流动性依然充足的情况下,资产价格的泡沫得以维系。中国经济增长结构仍然呈现病态。

中国经济仍然处于漫长的结构调整过程中。与之相对对应取的是股市调整也将漫漫长夜无期时。我们仍然会坚持大消费的配置策略,在市场震荡的情况下,寻找一些安全边际较大的个股进行投资。

§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	42,852,091.73	63.86
	其中:股票	42,852,091.73	63.86
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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	16,004,435.38	23.85
6	其他资产	8,250,564.38	12.29
7	合计	67,107,091.49	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	-	-
C	制造业	35,211,492.23	58.44
C0	食品、饮料	12,289,464.40	20.40
C1	纺织、服装、皮毛	2,589,000.00	4.30
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	1,957,735.67	3.25
C6	金属、非金属	1,019,061.60	1.69
C7	机械、设备、仪表	5,003,304.00	8.30
C8	医药、生物制品	12,352,926.56	20.50
C99	其他制造业	-	-
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	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	2,776,999.50	4.61
I	金融、保险业	4,863,600.00	8.07
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	42,852,091.73	71.12

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	000895	双汇发展	75,000	4,537,500.00	7.53
2	600887	伊利股份	194,986	4,153,201.80	6.89
3	600521	华海药业	279,908	3,929,908.32	6.52
4	600837	海通证券	360,000	3,448,800.00	5.72
5	600267	海正药业	189,855	2,967,433.65	4.92
6	600519	贵州茅台	9,997	2,457,262.60	4.08
7	000963	华东医药	59,971	2,068,999.50	3.43
8	600060	海信电器	199,973	1,957,735.67	3.25
9	600276	恒瑞医药	61,449	1,862,519.19	3.09
10	600079	人福医药	80,000	1,723,200.00	2.86

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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记录,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各选股票库。

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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,658.68
5	应收申购款	7,997,905.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,250,564.38

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

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	53,724,513.47
报告期期间基金总申购份额	11,477,412.52
减:报告期期间基金总赎回份额	4,501,162.73
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	60,700,763.26

§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、《长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛同祥泛资源主题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。

同盛证券投资基金

【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
报告期末基金份额总额	3,000,000,000份
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
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	-39,507,895.86
2.本期利润	-168,392,642.03
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0561
4.期末基金资产净值	3,045,803,970.67
5.期末基金份额净值	1.0153

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。

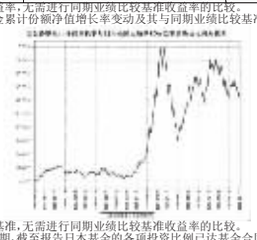
3.2 基金净值表现

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	-5.24%	2.07%

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: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。

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。

§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。	2008年8月11日	-	11	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,现任研究发展部总监,同盛证券投资基金(本基金)基金经理。
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	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。现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金经理,本基金基金经理。目前已离职。

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 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》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

3季度,市场受到了半年度业绩风险暴露、资金利率持续不降、政策环境不明朗等重因素的影响,仍然延续了2季度后半段开始的下跌趋势。经济长期前景受制于体制困境,中期前景受制于加杠杆能力的不足,短期受制于PPI下降和去库存周期,外围市场和企业利润下滑,使得投资者信心极度低迷甚至恐慌,期间的反弹都沦为博弈性的反弹而难以持续。本基金延续了自下而上和偏防御的投资思路,但仍低估了上市公司业绩下滑的幅度,导致3季度投资业绩低于预期。2季度,本基金也减持了周期股,继续适度增持了消费类股票。

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1.0153元,本报告期份额净值增长率为-5.24%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望全年,业绩风险已经体现于市场预期之中,并有望于12Q3~12Q4见到业绩环比低点。但业绩改善的幅度仍取决于对经济中期前景的看好,中期前景则取决于体制改革、财税改革、收入分配改革等,最终要从产业结构中表现出来。本基金对中期前景的判断仍较谨慎,因此在业绩环比见底之后仍对老经济结构下的传统产业反弹持谨慎态度,继续倾向于选择偏防御的消费类资产。4季度本基金将淡化对短期业绩的考虑,从长布局,仍将坚持自下而上的投资策略,看好食品饮料、医药等稳健成长类股票。

§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		
2	固定收益投资	674,281,899.00	22.08
	其中:债券	674,281,899.00	22.08
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	247,500,491.25	8.10
	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	155,805,755.83	5.10
6	其他资产	9,480,906.50	0.31
7	合计	3,054,377,989.15	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	39,845,690.63	1.31
C	制造业	1,355,291,944.61	44.50
C0	食品、饮料	445,443,729.72	14.62
C1	纺织、服装、皮毛	85,087,386.74	2.79
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	208,664,959.48	6.85
C5	电子	39,529,785.68	1.30
C6	金属、非金属	37,372,234.80	1.23
C7	机械、设备、仪表	219,832,915.43	7.22
C8	医药、生物制品	267,437,049.56	8.78
C99	其他制造业	51,923,883.20	1.70
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,695,288.50	0.09
F	交通运输、仓储业	28,877,296.00	0.95
G	信息技术业	69,766,141.18	2.29
H	批发和零售贸易	129,235,532.30	4.24
I	金融、保险业	173,263,777.40	5.69
J	房地产业	114,766,682.53	3.77
K	社会服务业	26,922,920.38	0.88
L	传播与文化产业	26,643,663.04	0.87
M	综合类	-	-
	合计	1,967,308,936.57	64.59

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	600309	烟台万华	13,092,943	181,206,331.12	5.95
2	600519	贵州茅台	594,246	146,065,666.80	4.80
3	601318	中国平安	2,890,756	121,238,306.64	3.98
4	600690	青岛海尔	6,635,243	75,177,303.19	2.47
5	600276	恒瑞医药	2,405,429	72,908,552.99	2.39
6	000028	国药一致	1,975,521	66,970,161.90	2.20
7	000895	双汇发展	933,254	56,461,867.00	1.85
8	002304	洋河股份	427,137	53,392,125.00	1.75
9	002345	潮宏基	2,432,032	51,923,883.20	1.70
10	000581	威孚高科	2,001,090	49,767,108.30	1.63

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	33,791,899.00	1.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	640,490,000.00	21.03
	其中:政策性金融债	640,490,000.00	21.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	674,281,899.00	22.14

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	100209	10国开09	1,500,000	149,610,000.00	4.91
2	080411	08农发11	1,000,000	100,350,000.00	3.29
3	110203	11国开03	700,000	70,154,000.00	2.30
4	030203	03国开03	500,000	50,205,000.00	1.65
5	070228	07国开28	500,000	50,085,000.00	1.64

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各选股票库。

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	600,182.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	390,252.06
4	应收利息	8,490,471.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,480,906.50

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。

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

单位:份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	6,000,000
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	6,000,000
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	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、《同盛证券投资基金基金基金合同》;

3、《同盛证券投资基金基金托管协议》;

4、《同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。

长盛同禧信用增利债券型证券投资基金

【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及更新。

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	长盛同禧信用增利债券	
基金主代码	080009	
交易代码	080009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年12月6日	
报告期末基金份额总额	139,592,978.90份	
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上,积极主动调整投资组合,追求基金资产的长期稳定增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。	
投资策略	本基金通过对宏观经济形势、货币政策意图、证券市场政策导向、投资人行为、公司基本面和偿债能力等因素进行深入研究和分析,执行自上而下的债券资产期限配置与自下而上不同市场、期限品种选择相结合的组合动态构建过程。在有效控制风险和保持资产流动性的前提下,力求获取较高的超额收益。在债券类资产配置上,本基金通过积极投资配置以信用债为主的相对收益率较高的各类债券,并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会,以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上,通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票,来获取股票市场的积极收益。此外,本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。	
业绩比较基准	40%x中证国债指数收益率+60%x中证企业债指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	长盛同禧信用增利债券A	长盛同禧信用增利债券C
下属两级基金的交易代码	080009	080010
报告期末下属两级基金的份额总额	74,553,349.78份	65,039,629.12份

§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)	
	长盛同禧信用增利债券A	长盛同禧信用增利债券C
1.本期已实现收益	-4,770,807.77	-4,292,087.50
2.本期利润	-4,854,027.73	-4,437,111.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0617	-0.0624
4.期末基金资产净值	69,038,129.28	59,835,767.21
5.期末基金份额净值	0.926	0.920

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

长盛同禧信用增利债券A

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	-6.28%	0.40%	-0.14%	0.07%	-6.14%	0.33%

长盛同禧信用增利债券C

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	-6.31%	0.41%	-0.14%	0.07%	-6.17%	0.34%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:1、本基金合同生效日为2011年12月6日,截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十四条(二)投资范围、(八)投资禁止行为与限制的有关约定。本报告期内,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
蔡宾	本基金基金经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理,社保组合组合经理,固定收益部总监。	2011年12月6日	-	8年	男,1978年11月出生,中国国籍。毕业于中央财经大学,获硕士学位,CFA(美国特许金融分析师)。历任宝盈基金管理有限公司研究员,基金经理助理。2006年2月