上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金

【2013】第二季度报告

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:2013年7月18日

§1 重要提示

基金管理人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2013年7月17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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月24日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛上证市值百强ETF
基金主代码	510700
交易代码	510700
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年4月24日
报告期末基金份额总额	77,213,677.00份
投资目标	本基金跟踪投资标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现与标的指数表现相一致的长期收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。
业绩比较基准	上证市值百强指数
风险收益特征	本基金为被动式投资的股票指数型基金,预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合风险收益特征相近,属于高风险、高收益的基金品种。
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(2013年4月24日 - 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	2,778,875.51
2.本期利润	-11,489,059.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0348
4.期末基金资产净值	123,634,797.37
5.期末基金份额净值	1.601

注:1、本基金基金合同生效日为2013年4月24日,截止本报告期末,报告期不足一季。

2、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。

3、所列数据截止到2013年6月30日。

4、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	-10.98%	1.34%	-10.67%	1.56%	-0.31%	-0.22%

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2013年4月24日,截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为:本基金投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。

§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		
赵宏宇	本基金基金经理,长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,首席产品开发师和金融工程与量化投资部副总监。	2013年4月24日	-	6年	男,1972年6月出生,中国国籍。四川大学工商管理学院管理学(金融投资研究方向)博士。历任美国晨星公司投资顾问部门数量分析师,招商银行博士后工作站博士后研究员。2007年8月加入长盛基金管理公司。历任金融工程研究员、产品开发经理,现任首席产品开发师和金融工程与量化投资部副总监,上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金(本基金)基金经理,长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

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、《上证市值百强交易型开放式指数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,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

截止报告期末,本基金份额净值为1.601元,本报告期(自成立日至报告期末)份额净值增长率为-10.98%,同期业绩比较基准增长率为-10.67%。本报告期(自成立日至报告期末)内日均跟踪偏离度绝对值均值为0.21%,年化跟踪误差为5.72%。

注:由于基金处于建仓期阶段,报告期年化跟踪误差较大,本基金管理人将逐步降低跟踪误差并控制在投资目标之内。

§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	110,123,991.21	88.51
	其中:股票	110,123,991.21	88.51
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	10,977,400.80	8.82
6	其他资产	3,318,017.11	2.67
7	合计	124,419,409.12	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	199,962.00	0.16
B	采矿业	9,769,808.88	7.90
C	制造业	25,620,648.69	20.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,250,504.00	1.82
E	建筑业	4,373,019.00	3.54
F	批发和零售业	1,389,936.00	1.12
G	交通运输、仓储和邮政业	2,322,530.00	1.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,631,039.00	2.13
J	金融业	56,459,579.64	45.67
K	房地产业	3,055,872.00	2.47
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	285,940.00	0.23
S	综合	1,765,152.00	1.43
	合计	110,123,991.21	89.07

5.2.2 报告期末积极投资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	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

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

5.3.1 报告期末指数投资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	600016	民生银行	937,600	8,035,232.00	6.50
2	600036	招商银行	585,700	6,794,120.00	5.50
3	601318	中国平安	138,000	4,796,880.00	3.88
4	601166	兴业银行	317,400	4,687,998.00	3.79
5	601989	中国重工	871,000	3,936,920.00	3.18
6	600000	浦发银行	461,500	3,821,220.00	3.09
7	601328	交通银行	813,400	3,310,538.00	2.68
8	600837	海通证券	338,100	3,171,378.00	2.57
9	600519	贵州茅台	15,702	3,020,593.74	2.44
10	600030	中信证券	282,100	2,857,673.00	2.31

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: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

注: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

注: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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期内未进行股指期货投资,报告期末无股指期货持仓。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同中未约定本基金投资股指期货的投资政策。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

(一)根据中国平安股份有限公司2013年5月22日发布的《关于平安证券收到中国证监会处罚事先告知书的公告》显示,中国平安集团的控股子公司平安证券收到证监会的处罚通知书。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。本基金做出以下说明:

1、中国平安是中国最优秀的综合金融公司,寿险业务最具竞争力,基本面良好。本公司研究员一直保持跟踪,并有相关的跟踪报告。

2、基于相关研究,本基金判断,旗下平安证券受到处罚,对中国平安的影响较小。因为证券业务板块在平安集团内的地位较低,平安证券对中国平安的收入贡献1%,利润贡献不足5%。

3、今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其风险控制机制和经营情况。

(二)根据贵州茅台酒股份有限公司2013年2月23日的公告显示,公司于2013年2月22日收到贵州物价局《行政处罚决定书》,该决定书认为:贵州茅台酒销售有限公司对全国经销商向第三人销售茅台酒的最低价格进行限定,违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定。为此,根据《中华人民共和国反垄断法》第四十六条、《中华人民共和国行政处罚法》第二十七条的规定给予处罚,限贵州茅台酒销售有限公司自收到该决定书之日起十五日内将罚款二亿四千七百万元人民币上交国库。对此,本基金做出如下说明:

1、对于白酒行业及贵州茅台,本公司研究员自2012年三季度以来一直给予风险提示,建议中短期(1年-2年)回避行业周期风险和政策风险,并有相关的研究报告。但基于更长期(2年以上),我们认为白酒板块和贵州茅台仍有投资价值。

2、基于相关研究,本基金判断,尽管在短期我国白酒行业面临较多风险因素,但随着我国国民收入的提高、城镇化的快速推进,从更长期来看(2年以上)白酒行业仍将继续维持快速增长,作为国内白酒行业的龙头公司,高端白酒中的代表性企业之一,贵州茅台公司的长期投资价值会得到提升,对于该公司被物价部门处罚的事件,本基金经过认真研究,做出如下判断:公司对前期的违法违规行为进行了深刻反思,并完全接受物价部门的处罚,并表示在未来的经营中,严格守法经营,保持稳健发展。因此,我们审慎地将贵州茅台在配置上作为组合的长期性重要投资品种。

3、今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合法合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外,本报告期内本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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	880,028.20
2	应收证券清算款	1,794,614.40
3	应收股利	639,657.37
4	应收利息	3,717.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,318,017.11

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.9.5.1 报告期末指数投资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	601989	中国重工	3,936,920.00	3.18	重大事项

5.9.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

5.9.6 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

基金合同生效日基金份额总额	622,680,523.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	32,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	301,000,000.00
本报告期期末基金份额总额	-276,466,846.00
基金合同生效日基金份额总额	77,213,677.00

注:1、本基金合同生效日为2013年4月24日。

2、依照本基金合同的规定,本基金于2013年5月15日进行了份额折算。

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

(一)关于中国证券监督管理委员会同意设立上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金的批复;

(二)《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

(三)《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

(四)《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

(五)法律意见书;

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(七)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。

长盛基金管理有限公司
2013年7月18日

同益证券投资基金

【2013】第二季度报告

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:2013年7月18日

§1 重要提示

基金管理人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2013年7月17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2013年4月1日起至2013年6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(2013年4月1日 - 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	117,893,440.66
2.本期利润	2,938,927.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0015
4.期末基金资产净值	1,821,335,420.86
5.期末基金份额净值	0.9107

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2013年6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。

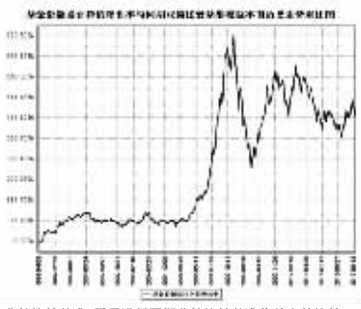
3.2 基金净值表现

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	0.16%	2.32%

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



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(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		
张锦灿	本基金基金经理	2012年11月20日	-	8年	男,1982年1月出生,中国国籍。北京大学光华管理学院金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员,银华基金管理有限公司研究员、研究主管、基金经理助理。2012年9月加入长盛基金管理有限公司,现任同益证券投资基金(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、《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,未发现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。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年二季度市场分化极其严重,创业板、传媒等成长股表现出巨大的结构性机会,而与投资相关的行业跌幅巨大。本季度,投资者从熊市心态转变为结构性牛市心态,主流板块从银行、医药切换到电子、传媒,市场关注点则从消费防御股转向成长股。在智能手机普及、国产电影票房火爆、文化环保政策频出等因素的刺激下,成长股不断挑战估值和投资者的心理极限。与此同时,在流动性收紧、新股发行、经济数据不理想和美国QE退出预期等因素的影响下,传统行业,尤其是周期性行业,不断创出新低。

本基金在二季度坚持了"自下而上"的选股思路。前半期,结合基本面数据,进一步降低了配置型标的的投资比重,如水泥、家电、金融等行业的个股,因此在这些行业的损失较少,也使得仓位得以保持在一个偏低的水平。后半期,在消费股方面获得了较好的选股收益,成长股投资方面则偏保守。尽管在传媒行业有所斩获,但未能有效扩大战果;且个别个股减持也偏早,未能充分享受成长股的泡沫。二季度本基金的表现虽大幅优于指数,但仍有很大的改进空间。

4.4.2 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0.9107元,本报告期份额净值增长率为0.16%。

§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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	1,120,912,001.23	61.31
	其中:股票	1,120,912,001.23	61.31
2	固定收益投资	399,752,581.01	21.86
	其中:债券	399,752,581.01	21.86
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,000.00	2.73
	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	211,303,164.27	11.56
6	其他资产	46,347,957.15	2.54
7	合计	1,828,315,703.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	9,610,734.42	0.53
B	采矿业	-	-
C	制造业	850,762,387.45	46.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	136,021,176.72	7.47
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,991,000.00	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,806,874.90	3.23
J	金融业	35,644,000.00	1.96
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	21,075,827.74	1.16
S	综合	-	-
	合计	1,120,912,001.23	61.54

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	3,297,942	110,118,283.38	6.05
2	601117	中国化学	11,299,861	107,574,676.72	5.91
3	000848	承德露露	4,405,566	100,050,403.86	5.49
4	000625	长安汽车	6,000,000	55,740,000.00	3.06
5	000748	长城信息	3,999,863	36,638,745.08	2.01
6	600837	海通证券	3,800,000	35,644,000.00	1.96
7	600597	光明乳业	2,449,816	33,048,017.84	1.81
8	600309	万华化学	2,049,887	32,839,189.74	1.80
9	002612	朗姿股份	1,599,908	32,574,126.88	1.79
10	600887	伊利股份	1,020,000	31,905,600.00	1.75

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	399,651,000.00	21.94
	其中:政策性金融债	399,651,000.00	21.94
4	企业债券	101,581.01	0.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	399,752,581.01	21.95

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	99,930,000.00	5.49
2	120246	12国开46	800,000	79,536,000.00	4.37
3	110257	11国开57	700,000	70,084,000.00	3.85
4	110203	11国开03	600,000	59,796,000.00	3.28
5	090205	09国开05	400,000	40,156,000.00	2.20

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

注: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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期内未进行股指期货投资,报告期末无股指期货持仓。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金基金合同中未约定本基金投资股指期货的投资政策。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 基金的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,095,143.80
2	应收证券清算款	38,752,506.11
3	应收股利	-
4	应收利息	6,500,307.24
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,347,957.15

5.9.4 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。

5.9.5 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未存在流通受限的情况。

5.9.6 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。

长盛基金管理有限公司
2013年7月18日

同盛证券投资基金

【2013】第二季度报告

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:2013年7月18日

§1 重要提示

基金管理人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2013年7月17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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6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(2013年4月1日 - 2013年6月30日)
1.本期已实现收益	119,155,932.31
2.本期利润	-26,179,298.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0087
4.期末基金资产净值	3,117,945,045.20
5.期末基金份额净值	1.0393

注