长盛同德主题增长股票型证券投资基金 2009年第二季度报告

2009年6月30日

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:2009年07月21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2009年7月20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2009年4月1日起至2009年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同德主题股票
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	12,815,659,271.43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	本基金的业绩比较基准: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(2009年04月01日-2009年06月30日)
1.本期已实现收益	352,428,371.81
2.本期利润	1,542,153,196.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.1247
4.期末基金资产净值	10,676,512,229.00
5.期末基金份额净值	0.8331

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2009年6月30日。

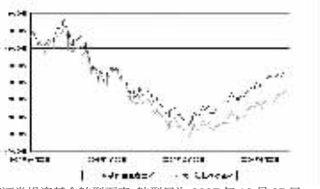
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	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	17.60%	1.21%	20.74%	1.24%	-3.14%	-0.03%

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

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六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本基金合同第十三条(三)投资范围、(九)投资限制的有关约定。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		
鲁凌蔚	本基金基金经理,公司总经理助理,投资管理部总监。	2007年10月25日	—	8年	男,1974年9月出生,中国国籍,厦门大学经济学硕士。历任融通新蓝筹基金经理、融通基金管理有限公司总经理助理、投资管理部总监、博时基金管理有限公司博时主题行业基金经理。2007年3月加入长盛基金管理有限公司,现任长盛基金管理有限公司总经理助理,投资管理部总监,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、任职日期、离任日期均指公司作出决定之日。

2、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。

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

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送,保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合,暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发生异常交易情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 行情回顾及运作分析

2009年2季度,在经济复苏预期和充裕流动性推动下,市场震荡向上,上证指数单季涨幅24.7%。

本基金2季度表现不如人意,在与同行和基准的比较方面都相对落后。我们在季度末期对组合的状况展开了全面反思。

面对充斥着宏观预期而不理会微观实际盈利能力的市场,面对群体性风险厌恶程度降低到极致的参与者,本基金依旧坚持较为严格的选股标准和相对长期的价值判断,对于组合重仓品种,我们一直从公司内生增长能力、长期的公司治理记录、清晰可见的相对竞争优势以及较为放心的公司管理层与公司战略等方面进行评估。因为我们的重仓品种既然买入,就不会考虑在短期的一年内卖出;也因为我们相信,按照这样的标准,而不是从属于简单的经济周期判断、宏观通胀预期或某些突发性事件,去构建的重仓股组合虽然可能会在短期内牺牲一定的净值增长能力,但会更有可持续的生命力,也更能帮助持有人抵御未来必然会发生的风险。

面对政府强力干预而使得经济周期波动更加频繁的现实,我们认为,股票市场的投资者实际面临的不确定性在加大,我们对市场采取相对谨慎态度的根本原因在于,基本的、传统的宏观与投资分析框架可能正在瓦解,虽然我们仍然能寻找到很多优秀的公司投资标的,但由于宏观经济波动的不稳定性,我们不能确保这些优秀公司在中短期内能够抵御系统风险而给股东带来和过去的记录一样优秀的回报,特别是在市场预期充分,股价普遍缺乏安全边际的背景之下。

我们在2季度组合平衡过程中犯的最大错误就是没有能很好地控制组合的换手率。在过去的半年中,组合换手率达到135%,这实际上反映出我们基本研究深度不足,行业轮动过于频繁,对短期业绩排名压力做出的妥协太大等缺点。

针对组合集中度不高的特点,我们的理解是:个股集中度应该提高,而提高应该建立在整个团队研究具备更强的深入性、前瞻性的基础之上,包括管理团队自身也应该努力这样去做;但我们不太认同组合行业集中度片面提高的做法,我们还是坚持自己的看法,在这样的经济发展阶段,只有夕阳的企业,而没有夕阳的行业,那种根据宏观假设的预期就把组合行业集中度无限制提高的做法无疑风险是比较大的。数量统计也证明,与大类资产配置和品种选择相比,行业主动配置与轮动的超额收益在长期看是微乎其微的。

4.4.2 本基金业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.8331元,本报告期份额净值增长率为17.60%,同期业绩比较基准增长率为20.74%。

4.4.3 市场展望和投资策略

展望未来,我们认为中国有以下几个行业正在发生结构性变化,其中可能会涌现出较好的投资机会,值得我们去关注:通信运营、航空服务、发电与输变电等等。而宏观经济复苏和企业回报能力恢复的可持续性需要继续观察,贸易顺差迅速减少乃至逆转,巨额信贷投放的质量都可能成为影响未来市场估值信心的因素。

我们可能正处在一个比较重要的历史阶段,就全球而言,推动生产力提高的主要贡献已经难以依靠体制变化带来的持续的劳动力、资金、传统资源等要素价格边际下降,而转而去寻找技术创新的突破。就中国而言,在既定框架下的精繁托改善已经走到尽头,分配的公平、社会的和谐一定会越来越重要,其中给我们带来的投资机会将是全新的,需要我们努力去把握。

§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	8,832,517,821.31	82.37
	其中:股票	8,832,517,821.31	82.37
2	固定收益投资	273,130,365.40	2.55
	其中:债券	273,130,365.40	2.55
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	3,075,456.88	0.03
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	1,537,219,796.73	14.34
6	其他资产	77,250,100.50	0.72
7	合计	10,723,193,540.82	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	-	0.00
B	采掘业	556,776,495.08	5.21
C	制造业	2,201,440,644.55	20.62
C0	食品、饮料	115,532,244.00	1.08
C1	纺织、服装、皮毛	20,910,059.10	0.20
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	22,327,744.25	0.21
C4	石油、化学、塑胶、塑料	342,504,805.85	3.21
C5	电子	187,433,232.16	1.76
C6	金属、非金属	196,017,283.58	1.84
C7	机械、设备、仪表	1,251,208,549.20	11.72
C8	医药、生物制品	7,000,000.00	0.07
C99	其他制造业	58,506,726.41	0.55
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,066,653,339.17	9.99
E	建筑业	267,251,269.43	2.50
F	交通运输、仓储业	714,064,078.89	6.69
G	信息技术业	411,676,842.00	3.86
H	批发和零售贸易	688,295,250.14	6.45
I	金融、保险业	1,947,055,048.25	18.24
J	房地产业	619,082,664.50	5.80
K	社会服务业	303,119,438.10	2.84
L	传播与文化产业	52,446,482.31	0.49
M	综合类	4,656,268.89	0.04
	合计	8,832,517,821.31	82.73

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	000001	深发展A	27,979,960	610,522,727.20	5.72
2	000024	招商地产	15,430,182	489,908,278.50	4.59
3	600028	中国石化	44,906,210	478,700,198.60	4.48
4	600900	长江电力	32,541,886	448,427,189.08	4.20
5	600875	东方电气	10,721,209	417,055,030.10	3.91
6	600036	招商银行	17,099,912	383,209,027.92	3.59
7	601006	大秦铁路	27,124,363	287,247,004.17	2.69
8	601398	工商银行	47,999,994	260,159,967.48	2.44
9	601186	中国铁建	24,139,499	248,395,444.71	2.33
10	601939	建设银行	38,785,277	233,875,220.31	2.19

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	57,771,388.00	0.54
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中:政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	215,358,977.40	2.02
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	273,130,365.40	2.56

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	1,000,000	106,380,000.00	1.00
2	115003	中兴债1	881,995	79,026,752.00	0.74
3	010004	20国债(4)	369,660	37,631,388.00	0.35
4	009908	99国债(8)	200,000	20,140,000.00	0.19
5	126011	08石化债	208,210	18,039,314.40	0.17

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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	580021	青啤CWB1	357,490	1,538,636.96	0.01
2	580022	国电CWB1	555,009	1,536,819.92	0.01

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股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,999,362.57
2	应收证券清算款	64,568,012.20
3	应收股利	4,726,401.92
4	应收利息	4,461,798.06
5	应收申购款	464,525.75
6	其他应收款	30,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,250,100.50

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	12,550,713,589.17
报告期期间基金总申购份额	796,379,780.87
报告期期间基金总赎回份额	531,434,098.61
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	12,815,659,271.43

§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、报告期内披露的各项公告原件

5、长盛基金管理有限公司营业执照和公司章程

7.2 存放地点

以上相关备查文件,置备于基金管理人的办公场所。本季度报告分别置备于基金管理人和基金托管人的办公场所。本季度报告至少登载在一种由中国证监会指定的全国性报刊及本基金管理人的互联网网站上。

7.3 查阅方式

在办公时间内可查阅,也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

长盛同智优势成长混合型证券投资基金 2009年第二季度报告

2009年6月30日

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:2009年07月21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2009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2009年4月1日起至2009年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同智优势混合(LOF)
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01月05日
报告期末基金份额总额	3,845,207,594.99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(2009年04月01日-2009年06月30日)
1.本期已实现收益	38,824,230.81
2.本期利润	571,116,606.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.1443
期末基金资产净值	3,508,082,211.14
期末基金份额净值	0.9123

注:1、所述基金业绩指标不包括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2009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

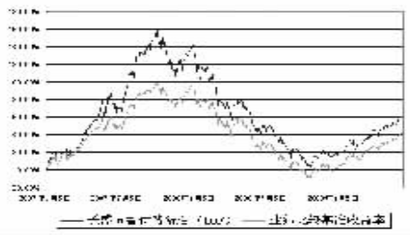
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	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	18.80%	1.20%	16.72%	1.01%	2.08%	0.19%

3.2.2 自基金转型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

长盛同智优势混合(LOF)累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势

对比图(2007年1月5日至2009年6月30日)



注:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自本基金成立六个月内,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本基金合同第十四条(二)投资范围、(八)投资限制的有关约定。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。

注:1、本基金由同智证券投资基金转型而来,转型日为2007年1月5日。

2、按基金合同规定,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本基金合同第十五条(二)投资范围、(六)投资限制的有关约定。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		
丁骏	本基金基金经理,同盛证券投资基金基金经理。	2007年2月27日	—	8年	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,先后担任研究发展部行业研究员、机构理财部组合经理助理。现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金(本基金)基金经理,同盛证券投资基金基金经理。

注:1、任职日期、离任日期均指公司作出决定之日。

2、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。

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、《长盛同智优势成长混合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

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送,保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合,暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发生异常交易情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 行情回顾及运作分析

整个2009年上半年,市场走势可以分为两个阶段。第一个阶段是年初的犹豫震荡,不乐观的宏观经济数据、低迷的市场人气是市场的背景氛围,A股市场从2008年11月初的最低点开始反弹,持续到2009年2月的相对高点,出现了一波比较明显的回调;第二个阶段是从2009年3月开始,政策的威力开始逐渐显现:宽松的货币信贷政策、强劲的经济刺激政策共同发挥作用,宏观经济逐步企稳的同时也促使A股市场持续上涨,信心再次凝聚起来。数据表明,2009年2季度沪深300指数累计上涨26.27%,其中采掘、房地产和金融行业指数分别上涨了55%、39%和35%,行业表现远超出市场平均水平,相对而言,表现较差的行业是公用事业、电子元器件和信息设备行业。本基金组合中对于金融行业的配置一直高于市场平均水平,在二季度为组合挽回了一些一季度表现落后带来的相对损失;在二季度对组合配置负面影响较大是通信设备等业绩弹性较小的行业。

4.4.2 本基金业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.9123元,本报告期份额净值增长率为18.80%,同期本基金业绩比较基准收益率为16.72%。

4.4.3 市场展望和投资策略

展望2009年下半年,从自上而下的角度出发,我们认为由于我国资源占有结构的变化、分配结构不完善导致的贫富分化程度加剧以及通货膨胀率CPI编制方法等原因,我国较低通货膨胀率与较高资产泡沫的现象很可能在一定时间段内并存,出于对宏观经济复苏基础不稳的担忧,宽松的货币政策背景在短时间内也不会有较大调整,这样,通胀预期将在这一时间段内始终存在,金融、地产及其他资源型行业的投资机会始终存在;从自下而上的角度出发,我们继续寻找价值相对低估、管理完善、竞争力优势明显并能适度转化到股东利益的上市公司作为投资标的。具体而言,下半年值得关注的行业主要包括通胀预期下的金融地产及资源型行业、具备成本和技术优势的医药、化工及机械等行业、房地产投资加快带动下的建筑建材、工程机械等相关下游产业。

§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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	2,851,414,127.54	80.62
	其中:股票	2,851,414,127.54	80.62
2	固定收益投资	39,143,351.40	1.11
	其中:债券	39,143,351.40	1.11
	资产支持证券	-	0.00
3	金融衍生品投资	-	0.00
4	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
5	银行存款和结算备付金合计	642,516,281.29	18.17
6	其他资产	3,569,331.31	0.10
7	资产合计	3,536,643,091.54	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	7,836,566.52	0.22
B	采掘业	315,104,776.60	8.98
C	制造业	900,301,244.95	25.66
C0	食品、饮料	134,309,667.67	3.83
C1	纺织、服装、皮毛	12,278,571.00	0.35
C2	木材、家具	-	0.00
C3	造纸、印刷	2,905,000.00	0.08
C4	石油、化学、塑胶、塑料	108,078,367.09	3.08
C5	电子	7,335,000.00	0.21
C6	金属、非金属	171,787,950.56	4.90
C7	机械、设备、仪表	346,215,630.61	9.87
C8	医药、生物制品	117,391,058.02	3.35
C99	其他制造业	-	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	152,680,434.88	4.35
E	建筑业	25,270,370.10	0.72
F	交通运输、仓储业	105,703,377.29	3.01
G	信息技术业	100,551,700.10	2.87
H	批发和零售贸易	116,521,315.90	3.32
I	金融、保险业	645,585,612.56	18.40
J	房地产业	350,602,525.19	9.99
K	社会服务业	88,992,943.69	2.54
L	传播与文化产业	42,263,259.76	1.20
M	综合类	-	0.00
	合计	2,851,414,127.54	81.28

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	601318	中国平安	2,980,660	147,423,443.60	4.20
2	600028	中国石化	11,421,858	121,757,006.28	3.47
3	601166	兴业银行	3,149,838	116,890,488.18	3.33
4	600000	浦发银行	4,967,250	114,346,095.00	3.26
5	000024	招商地产	3,477,261	110,403,036.75	3.15
6	600016	民生银行	12,859,192	101,844,800.64	2.90
7	600048	保利地产	3,284,526	91,605,430.14	2.61
8	000002	万 科A	6,651,778	84,810,169.50	2.42
9	000063	中兴通讯	2,781,267	78,153,602.70	2.23
10	000069	华侨城A	3,707,300	77,482,570.00	2.21

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	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中:政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	39,143,351.40	1.12
5	企业短期融资券	-	0.00
6	可转债	-	0.00
7	其他	-	0.00
8	合计	39,143,351.40	1.12

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	088050	08渝城投债	200,000	20,976,000.00	0.60
2	126017	08郑洲债	227,490	18,167,351.40	0.52

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

根据中兴通讯股份有限公司董事会2008年10月7日《中兴通讯股份有限公司关于财政部驻深圳市财政监察专员办事处2007年度会计信息检查结论和处理决定的公告》,中兴通讯在财政检查中受到16万元的行政罚款并被要求补缴企业所得税380万元。本基金认为,该处罚不会对中兴通讯投资价值构成实质性负面影响。

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	2,266,972.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	300,835.30
4	应收利息	711,178.07
5	应收申购款	290,344.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,569,331.31

5.8.4 报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,065,133,074.23
报告期期间基金总申购份额	24,624,741.91
报告期期间基金总赎回份额	244,550,221.15
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	3,845,207,594.99

§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智证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复

2、长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金合同

3、长盛同智优势成长混合型证券投资基金托管协议

4、报告期内披露的各项公告原件

5、长盛基金管理有限公司营业执照和公司章程

7.2 存放地点

以上相关备查文件,置备于基金管理人的办公场所。本季度报告分别置备于基金管理人、基金托管人和深圳证券交易所的办公场所。本季度报告至少登载在一种由中国证监会指定的全国性报刊及本基金管理人的互联网网站上。

7.3 查阅方式

在办公时间内可查阅,也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

长盛中信全债指数增强型债券投资基金 2009年第二季度报告

2009年6月30日

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:2009年07月21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2009年7月20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2009年4月1日起至2009年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛全债指数增强债券
交易代码	510080(前端收费模式) 511080(后端收费模式)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年10月25日
报告期末基金份额总额	1,009,527,374.82份
投资目标	本基金为开放式债券型基金,将运用增强的指数化投资策略,在力求本金安全的基础上,追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳定增值
投资策略	本基金采用"自上而下"的投资策略对各类资产进行合理配置,通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值,同时运用一些积极的,低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益
业绩比较基准	中信全债指数收益率×92%+中信综合指数收益率×8%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金
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(2009年04月01日-2009年06月30日)
1.本期已实现收益	33,107,937.56
2.本期利润	28,746,332.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0267
4.期末基金资产净值	1,250,532,440.49
5.期末基金份额净值	1.2387

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2009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	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