长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)

2013 第二季度 报告

2013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:招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。

基金托管人招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。

本报告中的财务资料未经审计。

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	长盛沪深300指数(LOF)
基金主代码	160807
交易代码	160807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年8月4日
报告期末基金份额总额	206,550,731.02份
投资目标	本基金采取指数化投资,跟踪沪深300指数,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于4%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性,通过抽样方式构建基金股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×沪深300 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金是股票指数型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型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	招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	-921,322.76
2.本期利润	-18,372,723.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0864
4.期末基金资产净值	152,154,803.28
5.期末基金份额净值	0.737

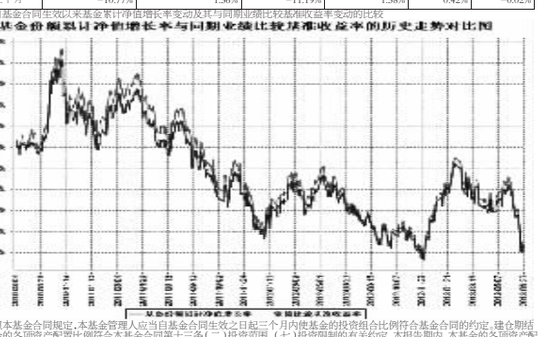
注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、所列数据截止到2013年6月30日。
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	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	-10.77%	1.36%	-11.19%	1.38%	0.42%	-0.02%

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:按照本基金合同规定,本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。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(二)投资范围、(七)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		
冯雨生	本基金基金经理,长盛中证100指数证券投资基金基金经理。	2011年12月20日	-	6年	男,1983年11月出生,中国国籍,北京大学金融学硕士,2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员,现任长盛中证100指数证券投资基金基金经理、长盛沪深300指数证券投资基金(LOF,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 管理人对投资期内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、《长盛沪深300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。

4.4.2 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。

4.5 投资策略在报告期内的执行情况

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、《长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)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。

本报告期内,本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。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(二)投资范围、(七)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。

§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	142,311,687.84	93.22
	其中:股票	142,311,687.84	93.22
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	9,753,480.43	6.39
6	其他资产	602,029.68	0.39
7	合计	152,667,197.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按投资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	815,216.03	0.54
B	采矿业	10,847,248.34	7.13
C	制造业	50,483,704.14	33.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,955,488.97	2.60
E	建筑业	5,899,189.92	3.88
F	批发和零售业	3,370,267.12	2.22
G	交通运输、仓储和邮政业	3,211,457.16	2.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,018,461.94	1.98
J	金融业	43,766,448.17	28.76
K	房地产业	8,294,732.93	5.45
L	租赁和商务服务业	920,290.55	0.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	901,807.82	0.59
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	377,938.77	0.25
S	综合	1,971,185.98	1.30
	合计	137,833,437.84	90.59

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	采掘业	126,640.00	0.08
C	制造业	2,427,340.00	1.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,126,860.00	0.74
E	建筑业	362,310.00	0.24
F	批发和零售业	278,950.00	0.18
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	115,900.00	0.08
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	40,250.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	4,478,250.00	2.94

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	654,054	5,605,242.78	3.68
2	601166	兴业银行	261,810	3,866,933.70	2.54
3	601318	中国平安	108,103	3,757,660.28	2.47
4	601328	交通银行	778,537	3,168,645.59	2.08
5	000002	万 科A	312,731	3,080,400.35	2.02
6	600000	浦发银行	333,270	2,759,475.60	1.81
7	600837	海通证券	286,751	2,689,724.38	1.77
8	600030	中信证券	261,356	2,647,536.28	1.74
9	600519	贵州茅台	13,294	2,557,366.78	1.68
10	601169	北京银行	270,291	2,154,219.27	1.42

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

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	600332	广州药业	22,000	753,720.00	0.50
2	002450	康 得 新	20,000	559,600.00	0.37
3	601991	大唐发电	100,000	514,000.00	0.34
4	600060	海信电器	35,000	363,650.00	0.24
5	002051	中工国际	13,000	362,310.00	0.24

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。

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

(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	16,600.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	439,083.70
4	应收利息	1,947.12
5	应收申购款	144,398.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	602,029.68

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

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

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

本报告期期初基金份额总额	218,307,878.45
本报告期基金总申购份额	5,335,967.99
减:本报告期基金总赎回份额	17,093,115.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	206,550,731.02

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)的批复;
2、《长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)基金合同》;
3、《长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)托管协议》;
4、《长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)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

长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013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: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

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛环球行业股票(QDII)
基金主代码	080006
交易代码	080006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月26日
报告期末基金份额总额	53,738,329.81份
投资目标	本基金主要投资于全球证券市场,把握全球经济趋势,精选景气投资行业,并在此基础上投资于其中的优势公司,实现充分分享全球经济增长收益的目标;同时在投资国家或地区配置上,有效实现全球分散化投资,力争充分分散风险,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法,运用Black-Litterman资产配置模型实现行业层面的风险最优配置,在行业内部,运用全球量化选股模型精选个股,投资管理人将两者进行有机结合,构建最优化的投资组合。
业绩比较基准	摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index)
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金。同时,本基金为全球股票型证券投资基金,除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险,此外,由于投资国家与地区市场的分散,风险低于投资单一市场的股票型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

2.2 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	GOLDMAN SACHS ASSET MANAGEMENT,L.P.	BANK OF CHINA (HONG KONG LIMITED)
	中文	高盛资产管理有限责任合伙	中国银行(香港)有限公司
注册地址		200 West Street, New York, NY 10282-2198	香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港皇后大道中2号长江集团中心68楼	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

§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	930,245.20
2.本期利润	-447,566.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0083
4.期末基金资产净值	49,020,766.74
5.期末基金份额净值	0.912

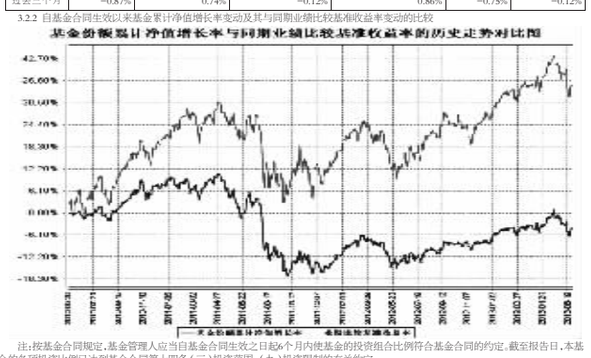
注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、所列数据截止到2013年6月30日。
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	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	-0.87%	0.74%	-0.12%	0.86%	-0.75%	-0.12%

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: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。截至报告日,本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(三)投资范围、(九)投资限制的有关约定。

§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		
吴达	本基金基金经理,国际业务部总监。	2010年5月26日	-	11年	男,1979年8月出生,中国国籍,伦敦政治经济学院金融经济学硕士,CFA(美国特许金融分析师)。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理,专户投资组合经理,新加坡毕盛高效资产管理公司亚太专户投资组合经理,资产配置委员会成员;华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理;2007年8月起加入长盛基金管理有限公司,曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理、现任国际业务部总监,长盛环球景气行业大盘精选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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Len Ioffe	高盛全球量化股票团队的高级投资组合经理,全球量化股票投资政策委员会成员。	20年	俄罗斯圣彼得堡理工大学颁发的计算机科学硕士,纽约大学斯特恩商学院工商管理硕士,曾供职于史密斯、巴尼.希尔森公司,1994年加入高盛资产管理,曾负责美国国内及国际投资组合的建立及风险分析,并实施不同的交易策略。

4.3 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《长盛环球景气行业大盘精选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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.5 投资策略在报告期内的执行情况

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、《长盛环球景气行业大盘精选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。

4.5.1 报告期内基金投资策略和业绩表现说明

截至2013年上半年,全球市场的货币调整后回报中表现比较好的是日本和美国的股票市场,对于财政悬崖谈判的担忧并没有引发市场的大幅度调整,日本方面在一季度推出超级量化宽松,目标扩大基础货币供应一倍来刺激经济,日元随即大幅贬值,增强了日本制造业出口的国际竞争力。

美国第一季度零售数据环比继续改善,房地产市场进一步复苏,自去年以来的企业补库存动作得以持续,美联储的会议纪要显示虽然央行官员对经济的复苏仍然不尽满意,但也承认继续大规模执行量化宽松的风险,逐步退出当前极度宽松的政策开始进入议事日程。二季度美国失业率水平下滑到7.6%的水平,美联储认为经济整体好转,特别是房地产价格提振,促进了消费者信心与家庭开支的改善,抵消了部分财政政策缩减带来的拖累。在最近的政策发布会上,联储官员高调讨论了量化宽松政策的退出路径,凸显对下半年美国经济的信心。

由于财政政策的制约和货币政策的相对收缩,中国国内经济在经历了短暂的季节性反弹后重新进入缓慢下滑轨道,反应国内经济的港股主流板块都有明显的下探,估值进一步降低。

组合在报告期内仍然选择了重点配置美国市场,适当配置香港市场,同时规避欧洲市场系统性风险的策略,整体收益表现良好,但错失了日本市场的大幅上涨和香港市场的下滑对于组合收益有一定拖累。对于美国市场消费板块和医疗板块的配置取得了比较好的效果,但高科技和能源板块仍然受累于弱复苏表现差强人意。

4.5.2 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0.912元,本报告期份额净值增长率为-0.87%,同期业绩比较基准增长率为-0.12%。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	37,819,927.54	75.87
	其中:普通股	35,899,550.51	72.01
	优先股	-	-
	存托凭证	687,689.31	1.38
	房地产信托凭证	1,232,687.72	2.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,827,741.82	23.73
8	其他资产	203,551.44	0.41
9	合计	49,851,220.80	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	27,876,091.69	56.87
香港	9,475,567.33	19.33
法国	468,268.52	0.96

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
医疗	7,574,338.85	15.45
非必需消费品	6,314,883.56	12.88
信息技术	6,164,546.49	12.58
工业	5,978,789.00	12.20
金融	5,540,368.72	11.30
能源	2,753,994.88	5.62
必需消费品	2,108,407.23	4.30
公用事业	588,809.76	1.20
电信服务	468,268.52	0.96
材料	327,520.53	0.67
合计	37,819,927.54	77.15

注:本基金持有的股票及存托凭证采用全球行业分类标准(GICS)进行行业分类

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	VISA INC-CLASS A SHA	-	V US	纽约证券交易所	美国	1,500	1,693,736.14	3.46
2	PRICELINE.COM	-	PCLN US	纳斯达克证券交易所	美国	300	1,533,176.44	3.13
3	GILEAD SCIENCES INC	-	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	4,000	1,265,644.91	2.58
4	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	-	DFS US	纽约证券交易所	美国	4,000	1,177,413.07	2.40
5	CHINA STATE CONS	中国建筑国际	3311 HK	香港证券交易所	中国香港	122,000	1,173,923.53	2.39
6	DANAHER CORP	-	DHR US	纽约证券交易所	美国	3,000	1,173,335.13	2.39
7	QUALCOMM INC	-	QCOM US	纳斯达克证券交易所	美国	3,000	1,132,184.99	2.31
8	EBAY INC	-	EBAY US	纳斯达克证券交易所	美国	3,500	1,118,468.27	2.28
9	SINOPEC ENGINEER	中石油炼化工程	2386 HK	香港证券交易所	中国香港	130,000	1,081,077.66	2.21
10	CHEVRON CORP	-	CVX US	纽约证券交易所	美国	1,450	1,060,221.67	2.16

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

注:本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	167,816.21
3	应收股利	29,405.70
4	应收利息	896.55
5	应收申购款	5,432.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	203,551.44

5.10.4 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可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.6 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

本报告期期初基金份额总额	54,734,838.41
本报告期基金总申购份额	5,029,021.00
减:本报告期基金总赎回份额	6,025,529.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	53,738,329.81

§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、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛环球景气行业大盘精选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