长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9月30日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月23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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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7月1日起至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	47,426,174.72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×70%+中证综合债券指数×30%
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(2013年7月1日 — 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,327,002.76
2.本期利润	5,573,678.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.1102
4.期末基金资产净值	46,534,669.56
5.期末基金份额净值	0.981

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。

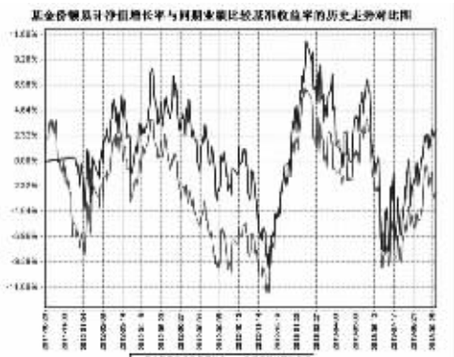
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	12.11%	1.31%	6.43%	1.00%	5.68%	0.31%

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		
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、长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2013年1月5日	-	10年	男,1979年12月出生,中国国籍。上海交通大学硕士,历任天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,曾任高级行业研究员,同盛证券投资基金基金经理助理,同益证券投资基金基金经理等职务。现任长盛电子信息产业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,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。

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,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3季度A股市场给投资者带来非常显的回报,除了创业板指数上涨35%,保持一如既往的强势之外,上半年持续下跌的沪深300指数在3季度的涨幅达到9.47%。从行业分类指数看,信息服务行业特别是传媒仍然是其中表现最好的行业,其中龙头股的轮番上涨拉动行业指数在上半年涨幅达到32.58%之后,在3季度涨幅高达53.08%;另外受到宏观经济政策、行业拓展等因素的影响,传统行业中的商业贸易和交通运输在3季度扭转了上半年的疲态,分别上涨42.21%和23.90%,而重周期行业,例如采掘、黑色金属、房地产等行业走势仍然很弱。

3季度本基金的净值上涨12.11%,基本跟住市场整体的上涨。由于2季度基金净值出现大幅下跌,因此组合在年初以来的表现仍然大幅弱于同行,需要在4季度继续努力改善。在3季度组合向投资范围内优质白马股的集中,取得了比较明显的效果。

4.4.2 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0.981元,本报告期份额净值增长率为12.11%,业绩比较基准收益率为6.43%。

§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	39,371,436.73	82.30
	其中:股票	39,371,436.73	82.30
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	4,600,000.00	9.62
	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	3,828,176.01	8.00
6	其他资产	37,459.46	0.08
7	合计	47,837,072.20	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	9,158.76	0.02
B	采矿业	2,925,498.39	6.29
C	制造业	31,983,795.25	68.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	949,970.00	2.04
F	批发和零售业	2,398,750.00	5.15
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	69,186.40	0.15
J	金融业	940,862.93	2.02
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	94,215.00	0.20
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	39,371,436.73	84.61

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	600887	伊利股份	70,366	3,143,952.88	6.76
2	600066	宇通客车	139,984	2,575,705.60	5.54
3	600690	青岛海尔	150,039	1,998,519.48	4.29
4	600267	海正药业	92,683	1,762,830.66	3.79
5	600196	复星医药	110,040	1,528,455.60	3.28
6	600276	恒瑞医药	40,046	1,456,473.02	3.13
7	000418	小天鹅A	165,091	1,375,208.03	2.96
8	600600	青岛啤酒	30,716	1,316,180.60	2.83
9	601808	中海油服	69,249	1,228,477.26	2.64
10	600537	亿晶光电	89,820	1,221,552.00	2.63

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

本基金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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未进行国债期货投资,报告期末无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未进行国债期货投资。

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(元)
1	存出保证金	30,059.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,030.90
5	应收申购款	2,368.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,459.46

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

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	600690	青岛海尔	1,998,519.48	4.29	重大事项停牌

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

报告期期初基金份额总额	57,594,570.60
报告期期间基金总申购份额	18,592,015.08
减:报告期期间基金总赎回份额	28,760,410.96
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	47,426,174.72

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 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。

8.3 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10月23日

长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)

2013 第三季度 报告

2013年9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10月23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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛沪深300指数(LOF)(场内简称:长盛300)
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	195,953,612.16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7月1日 — 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-473,968.86
2.本期利润	15,859,451.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0783
4.期末基金资产净值	159,611,711.88
5.期末基金份额净值	0.815

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。

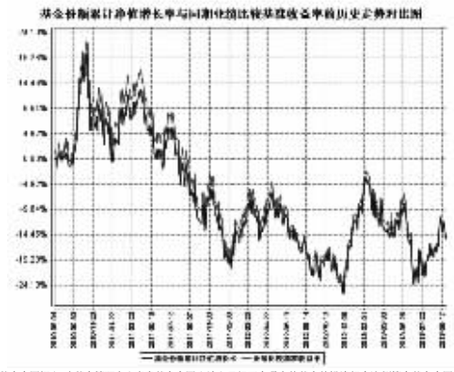
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	10.58%	1.35%	9.05%	1.36%	1.53%	-0.01%

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	-	5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。

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。

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

三季度股票市场上涨,自贸区、电子商务和文化传媒等概念板块涨幅靠前,而装修园林、锂电池和触摸屏概念板块略有调整。行业上,信息服务、商业贸易和餐饮旅游等行业涨幅靠前,食品饮料、建筑建材和采掘涨幅靠后。风格上,小盘股三季度仍然跑赢大盘股。

在操作中,我们严格遵守基金合同,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.4.2 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0.815元,本报告期份额净值增长率为10.58%,同期业绩比较基准增长率为9.05%。本报告期内日均跟踪误差为0.0763%,年度化跟踪误差为1.20%。

§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	150,870,151.36	94.23
	其中:股票	150,870,151.36	94.23
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	8,402,080.93	5.25
6	其他资产	832,677.54	0.52
7	合计	160,104,909.83	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	1,103,993.13	0.69
B	采矿业	10,905,076.29	6.83
C	制造业	55,370,674.14	34.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,825,440.98	3.02
E	建筑业	5,758,562.94	3.61
F	批发和零售业	5,089,670.12	3.19
G	交通运输、仓储和邮政业	3,540,199.60	2.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,847,886.99	2.41
J	金融业	47,074,583.83	29.49
K	房地产业	8,742,521.71	5.48
L	租赁和商务服务业	1,096,332.46	0.69
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,170,307.82	0.73
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	625,536.31	0.39
S	综合	1,719,365.04	1.08
	合计	150,870,151.36	94.52

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本报告期末未持有积极投资的股票。

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	687,883	6,576,161.48	4.12
2	601166	兴业银行	416,994	4,657,822.98	2.92
3	601318	中国平安	103,826	3,706,588.20	2.32
4	600837	海通证券	275,478	3,446,229.78	2.16
5	600000	浦发银行	320,260	3,231,423.40	2.02
6	601328	交通银行	748,168	3,217,122.40	2.02
7	000002	万科A	340,738	3,110,937.94	1.95
8	600030	中信证券	251,130	3,086,387.70	1.93
9	600887	伊利股份	49,064	2,192,179.52	1.37
10	601169	北京银行	259,797	2,096,561.79	1.31

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:本报告期末未持有积极投资的股票。

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未进行国债期货投资,报告期末无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未进行国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

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。

5.10.2 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(元)
1	存出保证金	13,454.03
2	应收证券清算款	789,318.04
3	应收股利	16,757.75
4	应收利息	1,671.51
5	应收申购款	11,476.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	832,677.54

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处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 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。

5.10.5.2 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。

5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	206,550,731.02
报告期期间基金总申购份额	2,748,887.80
减:报告期期间基金总赎回份额	13,346,006.66
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	195,953,612.16

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 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。

8.3 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10月23日

长盛同鑫保本混合型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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10月23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10月22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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同鑫保本混合
基金主代码	080007
交易代码	080007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月24日
报告期末基金份额总额	789,430,400.72份
投资目标	依据本基金的保证合同,本基金通过运用投资组合保险策略,在严格控制风险和保证本金安全的基础上,力争在本基金保本周期结束时,实现基金资产的收益增长。
投资策略	本基金投资策略实出强调配置的科学性与纪律性,通过严格金融工程手段有效控制风险,保证实现投资期中的稳定收益,并通过有效地资产配置和保本投资策略以保障基金资产本金的安全。 本基金将按照恒定比例组合保险机制(CPPI)将资产配置于安全资产与风险资产,用投资于固定收益类证券的现金净流入来冲抵风险资产组合潜在的最大亏损,并通过投资股票等风险资产来获得资本利得。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,未持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额,不享受保本担保。
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
基金保证人	安徽省信用担保集团有限公司

§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7月1日 — 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	6,062,384.87
2.本期利润	5,207,967.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0060
4.期末基金资产净值	814,252,657.28
5.期末基金份额净值	1.031

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。

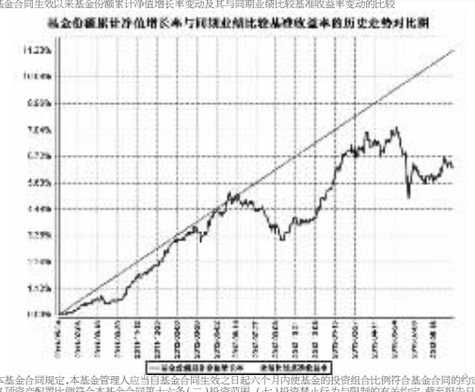
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.59%	0.11%	1.09%	0.01%	-0.50%	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: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十六条(二)投资范围、(七)投资禁止行为与限制的有关约定。截至报告日,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5月24日	-	9年	男,1978年11月出生,中国国籍,毕业于中央财经大学,