同益证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

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:2014年4月21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2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同益封闭(场内简称:基金同益)
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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	102,407,508.57
2.本期利润	12,266,986.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0061
4.期末基金资产净值	1,993,781,395.19
5.期末基金份额净值	0.9969

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2014年3月31日。

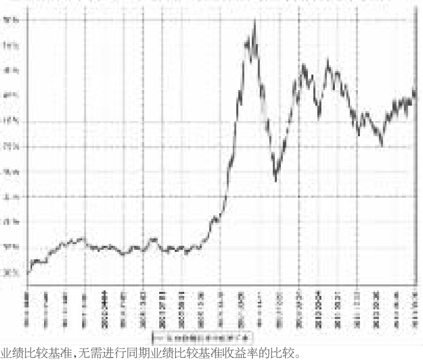
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.62%	1.64%

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,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2012年11月20日	–	9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,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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、本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

2014年一季度,市场仍处于震荡下跌趋势中。春节前后,市场在次新股、新能源汽车、移动互联网、民营医院等主题带动下,有一波短暂的反弹,基本是一季度唯一的获利时间窗口。两会以后,随着一系列较差的经济数据公布,信用违约事件出现,人民币贬值,国外新经济股票调整,国内股票市场全面调整,成长股调整幅度较大。

本基金按上次报告思路,积极参与了一季度的市场机会。在前半期积极参与了新能源汽车、电子等板块机会,后半期及时降低了配置型投资及整体仓位。一季度,本基金表现优于指数。

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0.9969元,本报告期份额净值增长率为0.62%。

§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	986,066,277.46	49.17
	其中:股票	986,066,277.46	49.17
2	固定收益投资	749,872,000.00	37.39
	其中:债券	749,872,000.00	37.39
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
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	银行存款和结算备付金合计	66,949,226.36	3.34
7	其他资产	202,614,516.81	10.10
8	合计	2,005,502,020.63	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	6.24	0.00
B	采矿业	4,158,000.00	0.21
C	制造业	794,817,264.82	39.86
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	4,798,480.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	851.00	0.00
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,603,900.00	0.18
J	金融业	138,746,090.40	6.96
K	房地产业	39,492,000.00	1.98
L	租赁和商务服务业	449,685.00	0.02
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	986,066,277.46	49.46

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	000848	承德露露	6,050,000	127,655,000.00	6.40
2	000748	长城信息	3,800,000	74,594,000.00	3.74
3	600552	方兴科技	3,250,000	69,972,500.00	3.51
4	601688	华泰证券	8,999,884	68,219,120.72	3.42
5	600690	青岛海尔	3,899,916	63,334,635.84	3.18
6	002563	森马服饰	2,016,401	61,056,622.28	3.06
7	600983	合肥三洋	4,200,000	55,692,000.00	2.79
8	600584	长电科技	6,200,000	49,042,000.00	2.46
9	600837	海通证券	5,214,557	48,182,506.68	2.42
10	600480	凌云股份	5,400,937	46,826,123.79	2.35

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	59,766,000.00	3.00
2	央行票据	–	–
3	金融债券	448,570,000.00	22.50
	其中:政策性金融债	448,570,000.00	22.50
4	企业债券	90,378,000.00	4.53
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	141,273,000.00	7.09
7	可转债	9,885,000.00	0.50
8	其他	–	–
9	合计	749,872,000.00	37.61

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	100,000,000.00	5.02
2	098087	09中铝业债1	900,000	90,378,000.00	4.53
3	120246	12国开46	800,000	78,544,000.00	3.94
4	110257	11国开57	700,000	69,790,000.00	3.50
5	0982040	09沪电力MTN2	600,000	60,456,000.00	3.03

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

根据海通证券2013年4月24日发布的《关于收到上海证监局行政监管措施决定书的公告》显示,海通证券受到上海证监局采取的行政监管措施。上海证监局发现海通证券发行的"一海财通"系列产品系现行监管规定未明确的创新产品,但公司未按照《证券公司业务(产品)创新工作指引(试行)》的规定,向中国证监会机构监管部履行创新产品方案报送义务。对此,上海证监局对海通证券采取了责令改正的监管措施。

本基金做出以下说明:

1、海通证券在行业内具有很强的竞争力,资本实力雄厚,业务发掌良好。

2、基于相关研究,本基金判断此次处罚监管措施对海通证券的经营业绩造成的影响非常小,不影响公司价值。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,753,415.32
2	应收证券清算款	184,844,452.07
3	应收股利	–
4	应收利息	16,016,649.42
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	202,614,516.81

5.11.4 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。

5.11.5 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未存在流通受限的情况。

5.11.6 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基金情况

6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

份额单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	28,000,079
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	28,000,079
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.40

6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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。

§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
2014年4月21日

同盛证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:2014年4月21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2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同盛封闭(场内简称:基金同盛)
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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	71,329,109.55
2.本期利润	-135,749,618.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0452
4.期末基金资产净值	3,097,701,901.61
5.期末基金份额净值	1.0326

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2014年3月31日。

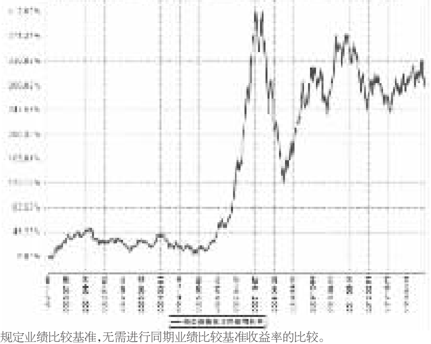
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-4.07%	2.57%

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,社保组合组合经理,公司总经理助理。长盛创富资产管理有限公司执行董事、总经理。	2008年8月11日	–	13年	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,曾任长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理,研究部总监等职务。现任公司总经理助理,社保组合组合经理,同盛证券投资基金(本基金)基金经理,兼任长盛创富资产管理有限公司执行董事、总经理。
田间	本基金基金经理。	2013年7月9日	–	6年	女,1978年11月出生,中国国籍。中央财经大学经济学硕士。2008年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任行业研究员,基金经理助理等职务。现任同盛证券投资基金(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、本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

2014年一季度以来,国内经济出现了一定程度的下滑,其中工业和出口增速明显回落,消费小幅回升,投资低位徘徊。人民币贷款增速和M2增速保持平稳,年初的流动性延续了去年底以来的宽松局面。海外经济中,美国经济持续复苏,日本复苏有反复,欧洲国家温和复苏,新兴经济体加快结构调整。在经济数据走弱与流动性前高后低的预期下,一季度的资本市场表现为大盘指数的窄幅箱体震荡和中小盘指数的新高回落,市场体现为来自新兴行业成长股的结构性机会。基金同盛在一季度适度加仓了LED、新能源汽车、智能电网、汽车、机械,减持了家电、银行等,一定程度上分享了市场的结构性上涨,但在系统调整中防御效果不理想。我们判断,2014年二季度市场处于方向的选择时期,周期性行业和具备价值属性的大盘蓝筹股会有阶段性反弹行情,转型方向上政策落实和业绩兑现的成长股值得积极布局,兼具价值投资和新兴理念的传统蓝筹公司值得密切关注。

4.4.2 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1.0326元,本报告期份额净值增长率为-4.07%。

§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	2,027,892,832.35	65.10
	其中:股票	2,027,892,832.35	65.10
2	固定收益投资	785,751,352.20	25.22
	其中:债券	785,751,352.20	25.22
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	262,000,000.00	8.41
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	16,916,176.53	0.54
7	其他资产	22,610,581.04	0.73
8	合计	3,115,170,942.12	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	采矿业	–	–
C	制造业	1,400,852,841.55	45.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	81,367,927.74	2.63
F	批发和零售业	9,960,000.00	0.32
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	240,770,454.07	7.77
J	金融业	131,610,964.68	4.25
K	房地产业	18,279,862.90	0.59
L	租赁和商务服务业	70,089,221.00	2.26
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	10,311,560.41	0.33
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	64,650,000.00	2.09
S	综合	–	–
	合计	2,027,892,832.35	65.46

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	万华化学	10,500,000	183,435,000.00	5.92
2	002038	双鹭药业	4,049,304	157,517,925.60	5.08
3	000895	双汇发展	2,328,344	91,480,635.76	2.95
4	000661	长春高新	900,000	86,670,000.00	2.80
5	300017	网宿科技	749,904	78,799,912.32	2.54
6	601299	中国北车	16,499,797	76,559,058.08	2.47
7	600104	上汽集团	4,999,894	69,248,531.90	2.24
8	300113	顺网科技	1,348,853	69,074,762.13	2.23
9	601098	中南传媒	5,000,000	64,650,000.00	2.09
10	600887	伊利股份	1,799,907	64,490,667.81	2.08

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	105,222,352.20	3.40
2	央行票据	–	–
3	金融债券	680,529,000.00	21.97
	其中:政策性金融债	680,529,000.00	21.97
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	785,751,352.20	25.37

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	150,975,000.00	4.87
2	110251	11国开51	1,000,000	99,960,000.00	3.23
3	130227	13国开27	1,000,000	99,850,000.00	3.22
4	130243	13国开43	800,000	79,896,000.00	2.58
5	090411	09农发11	600,000	60,294,000.00	1.95

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	944,619.81
2	应收证券清算款	8,860,185.32
3	应收股利	–
4	应收利息	12,805,775.91
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	22,610,581.04

5.11.4 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。

5.11.5 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未存在流通受限情况。

5.11.6 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基金情况

6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	6,000,000
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	6,000,000
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.20

6.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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。

§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。

长盛基金管理有限公司
2014年4月21日

长盛电子信息产业股票型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:2014年4月21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2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛电子信息产业股票
基金主代码	080012
交易代码	080012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月27日
报告期末基金份额总额	1,858,241,468.37份
投资目标	本基金主要投资于电子信息产业上市公司股票,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	(1)分析宏观经济运行状况、市场估值水平等因素,动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。(2)发挥基金管理人研究团队和投资团队"自下而上"的主动选股能力,判断公司的核心价值与成长能力,选择具有竞争优势且估值具有吸引力的公司作为投资标的,根据市场波动情况精选个股,构建股票投资组合。
业绩比较基准	80%×中证信息技术指数收益率+20%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金产品,风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金,属于高风险、高预期收益的基金产品。
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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	107,443,576.84
2.本期利润	18,266,479.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.0126
4.期末基金资产净值	2,299,753,255.62
5.期末基金份额净值	1.238

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2014年3月31日。

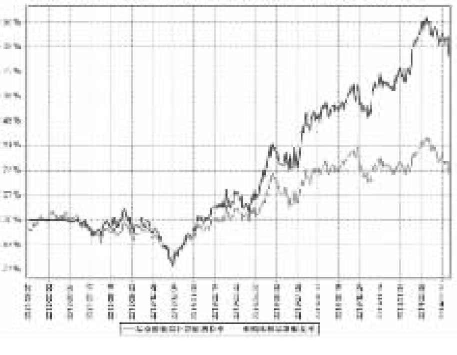
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	5.54%	1.36%	-2.33%	1.38%	7.87%	-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。

§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,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理,长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,权益投资部副总监。	2012年3月27日	–	11年	男,1979年12月出生,中国国籍。上海交通大学硕士。历任元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。现任权益投资部副总监,长盛电子信息产业股票型证券投资基金(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,长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理,长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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、本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

2014年一季度A股市场行情整体上延续了2013年的风格分化,上证指数和HS300指数分别下跌3.91%和7.89%,创业板指数上涨1.79%,不同的是中小板指数受到部分大市值公司下跌的影响出现了7.73%的下跌。从各行业分类指数看,TMT行业仍然是行情的主要热点,小市值公司的上涨带动计算机行业指数涨幅达到7.29%,成为最强的行业指数,而电子元器件行业受到部分大市值公司的持续下跌影响出现了下跌;此外受到新能源汽车等主题的影响,电力设备行业呈现大幅上涨。强周期行业如煤炭、建筑,以及受证券市场波动影响大的非银行金融、国防军工等行业都出现比较大的下跌。

一季度本基金的净值上涨5.54%,净值表现相对业绩比较基准和行业指数体现出一定的领先。组合基本上维持了去年四季度的基础架构,投资的重点在移动互联网、面向新能源应用的电子器件以及军工信息化等方向,在市值规模上相对均衡。这样的组合结构在一季度以小市值公司大幅上涨为主要特征的市场中略微跑输,在二月后市场的回落中跌幅要小于市场平均水平。

展望二季度TMT行业仍然呈现快速的增长,特别是在移动互联网与生产生活深度融合成为趋势的情况下,将对TMT相关产业链产生强大的拉动。当然2014年的行业投资将面临与2013年完全不同的起点,在二级市场大幅上涨后公司的估值水平已经有明显的提升,这种情况下需要投资者在估值、企业素质等各方面更严格的挑选投资标的。

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1.238元,本报告期份额净值增长率为5.54%,业绩比较基准收益率为-2.33%。

§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	1,634,293,740.84	69.24
	其中:股票	1,634,293,740.84	69.24
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	484,800,000.00	20.54
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	230,034,242.27	9.75
7	其他资产	11,142,014.09	0.47
8	合计	2,360,269,997.20	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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	1,073,834,771.42	46.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,607,076.64	0.72
E	建筑业	50,749,355.00	2.21
F	批发和零售业	4,052,204.25	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	2,998,821.92	0.13
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	484,056,375.88	21.05
J	金融业	1,859,250.81	0.08
K	房地产业	–	–
L	租赁和商务服务业	10,900.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	124,984.92	0.01
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	1,634,293,740.84	71.06

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	600050	中国联通	45,741,172	139,967,986.32	6.09
2	002465	海格通信	4,016,140	75,623,916.20	3.29
3	002056	横店东磁	4,055,969	71,790,651.30	3.12
4	002063	远光软件	3,290,746	65,979,457.30	2.87
5	002138	顺络电子	4,207,562	65,637,967.20	2.85
6	000733	振华科技	5,857,847	64,377,738.53	2.80
7	300207	欣旺达	2,862,365	63,887,986.80	2.78
8	300077	国民技术	2,210,832	51,689,252.16	2.25
9	300188	美亚柏科	2,999,343	51,288,765.30	2.23
10	600522	中天科技	3,574,836	41,539,594.32	1.81

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注:本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金报告期内未进行国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	795,912.19
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	174,664.08
5	应收申购款	10,171,437.82
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	11,142,014.09

5.11.4 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。

5.11.5 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。

5.11.6 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	1,060,660,981.01
报告期期间基金总申购份额	1,874,350,034.44
减:报告期期间基金总赎回份额	1,076,769,547.08
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	1,858,241,468.37

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本报告期内无基金管理人持有本基金份额变动情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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、《长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛电子信息产业股票型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛电子信息产业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
2014年4月21日