长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	长盛同瑞中证200分级（场内简称：长盛同瑞）		
基金主代码	160808		
交易代码	160808		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011年12月6日		
报告期末基金份额总额	42,905,990.87份		
投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内，以实现对中证200指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金采用完全复制法，按照成份股在中证200指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证200指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%—95%，其中投资于中证200指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%—10%（其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%）。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。		
业绩比较基准	中证200指数收益率×95%＋一年期银行定期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
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		
下属三级基金简称	长盛同瑞A（场内简称：同瑞A）	长盛同瑞B（场内简称：同瑞B）	长盛同瑞中证200分级（场内简称：长盛同瑞）
下属三级基金交易代码	150064	150065	160808
下属三级基金报告期末基金份额总额	1,486,224.00份	2,229,336.00份	39,190,430.87份
下属三级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定	高风险、高预期收益	较高风险、较高预期收益

§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	274,850.58
2.本期利润	−2,446,181.86
3.加权平均基金份额本期利润	−0.0532
4.期末基金资产净值	39,935,394.98
5.期末基金份额净值	0.931

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。

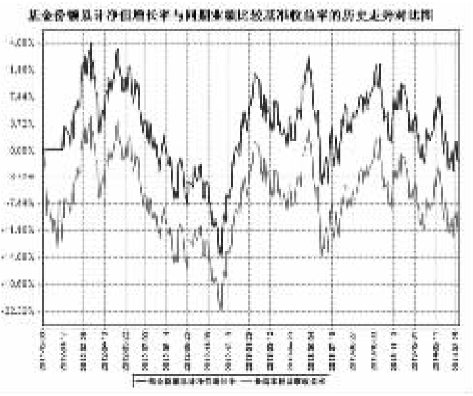
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	−6.04%	1.28%	−6.85%	1.29%	0.81%	−0.01%

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



§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		
王超	本基金基金经理，长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理，长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理。	2011年12月6日	－	7年	男，1981年9月出生，中国国籍。中央财经大学硕士，金融风险管理师(FRM)。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，从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金（本基金）基金经理，长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理，长盛同辉深证100等权重指数分级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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略，尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响，将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

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0.931元，本报告期份额净值增长率为−6.04%，同期业绩比较基准收益率为−6.85%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.12%，控制在0.35%之内；年化跟踪误差为2.53%，控制在4%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	37,349,998.99	92.96
	其中：股票	37,349,998.99	92.96
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	－	－
	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	2,805,846.72	6.98
7	其他资产	22,635.75	0.06
8	合计	40,178,481.46	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	497,533.06	1.25
B	采矿业	1,637,891.62	4.10
C	制造业	17,391,226.07	43.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,405,973.45	3.52
E	建筑业	967,820.69	2.42
F	批发和零售业	1,829,856.30	4.58
G	交通运输、仓储和邮政业	1,038,609.55	2.60
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,593,296.14	3.99
J	金融业	2,703,462.91	6.77
K	房地产业	2,555,053.96	6.40
L	租赁和商务服务业	825,106.88	2.07
M	科学研究和技术服务业	－	－
N	水利、环境和公共设施管理业	502,917.30	1.26
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	478,722.48	1.20
S	综合	390,668.58	0.98
	合计	33,818,138.99	84.68

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	－	－
C	制造业	2,135,060.00	5.35
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	800,000.00	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	424,800.00	1.06
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	172,000.00	0.43
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	3,531,860.00	8.84

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	600660	福耀玻璃	173,230	1,430,879.80	3.58
2	600340	华夏幸福	29,659	825,706.56	2.07
3	000402	金 融 街	130,513	659,090.65	1.65
4	000725	京东方A	265,300	596,925.00	1.49
5	600804	鹏 博 士	43,493	592,374.66	1.48
6	600089	特变电工	63,850	575,288.50	1.44
7	600100	同方股份	54,479	494,124.53	1.24
8	600583	海油工程	58,043	444,028.95	1.11
9	000100	TCL 集团	170,203	430,613.59	1.08
10	000061	农 产 品	46,750	420,282.50	1.05

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	600998	九 州 通	50,000	800,000.00	2.00
2	002501	利源铝业	49,000	657,090.00	1.65
3	600761	安徽合力	50,000	603,500.00	1.51
4	601877	正泰电器	18,000	440,820.00	1.10
5	600362	江西铜业	35,000	433,650.00	1.09

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

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	20,380.34
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	1,463.01
5	应收申购款	792.40
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	22,635.75

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

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 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

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	600998	九州通	800,000.00	2.00	重大事项停牌

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

项目	长盛同瑞A	长盛同瑞B	长盛同瑞中证200分级
报告期期初基金份额总额	1,567,496.00	2,351,244.00	47,735,866.64
报告期期间基金总申购份额	－	－	23,159,130.27
减:报告期期间基金总赎回份额	－	－	33,259,464.17
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"−"填列）	−81,272.00	−121,908.00	1,554,898.13
报告期期末基金份额总额	1,486,224.00	2,229,336.00	39,190,430.87

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§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

（一）关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金的批复；
（二）《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同》；
（三）《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金托管协议》；
（四）《长盛同瑞中证200指数分级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。

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

长盛同禧信用增利债券型证券投资基金

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	长盛同禧信用增利债券	
基金主代码	080009	
交易代码	080009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年12月6日	
报告期末基金份额总额	74,321,507.14份	
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上，积极主动调整投资组合，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。	
投资策略	本基金通过对宏观经济形势、货币政策意图、证券市场政策导向、投资人行为、公司基本面和偿债能力等因素进行深入研究和分析，执行自上而下的债券资产期限配置与自下而上不同市场、期限品种选择相结合的组合动态构建过程。在有效控制风险和保持资产流动性的前提下，力求获取较高的超额收益。在债券类资产配置上，本基金通过积极投资配置以信用债为主的相对收益率较高的各类债券，并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会，以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上，通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票，来获取股票市场的积极收益。此外，本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。	
业绩比较基准	40%×中证国债指数收益率+60%×中证企业债指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	长盛同禧信用增利债券A	长盛同禧信用增利债券C
下属两级基金的交易代码	080009	080010
报告期末下属两级基金的份额总额	41,617,181.93份	32,704,325.21份

§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）	
	长盛同禧信用增利债券A	长盛同禧信用增利债券C
1. 本期已实现收益	178,286.13	102,588.81
2. 本期利润	1,172,423.28	889,656.59
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0272	0.0261
4. 期末基金资产净值	39,512,853.72	30,662,853.88
5. 期末基金份额净值	0.949	0.938

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

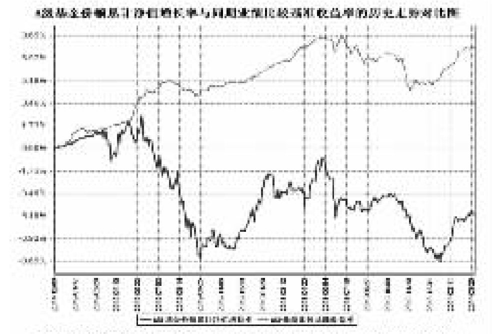
长盛同禧信用增利债券A

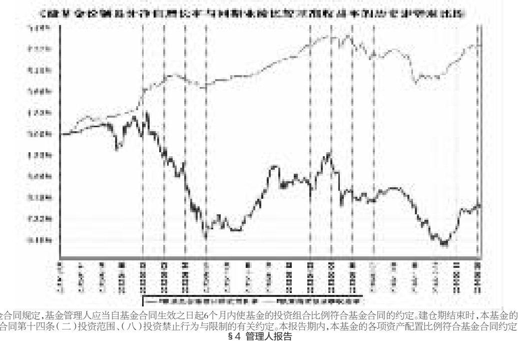
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.93%	0.20%	2.58%	0.07%	0.35%	0.13%

长盛同禧信用增利债券C

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	2.96%	0.21%	2.58%	0.07%	0.38%	0.14%

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。建仓期结束时，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。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		
贾志敏	本基金基金经理，长盛货币市场基金基金经理，长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，固定收益部副总监。	2013年2月7日	－	8年	男，1982年3月出生，中国国籍。北京大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作。2012年11月底加入长盛基金管理有限公司，现任固定收益部副总监，长盛货币市场基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛双月红1年期定期开放债券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

1、报告期内行情回顾

回顾2014年一季度，经济增速同比明显下滑，通胀水平处于低位，春节后市场流动性逐渐宽松，一月和二月债券市场走出一波小牛市行情；但3月以来，受经济稳增长政策出台预期、超日违约事件以及投资机构配置动力不足等因素影响，债券市场呈现震荡调整走势。利率债方面，收益率曲线短端下行幅度大于长端，收益率曲线呈现陡峭化趋势。信用债方面，短端收益率下行幅度大于长端收益率，收益率曲线陡峭化，低评级债券收益率下行幅度小于高评级债券，信用利差总体呈现扩大态势。

货币市场方面，春节前市场流动性较紧，春节后受居民储蓄回流银行、央行公开市场操作力度有限等因素影响，市场流动性逐渐宽松，各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率均保持在较低水平，银行间七天回购利率基本在3.8%以下，1月期协议存款利率下降到4%水平。

纯债资产以外，2014年一季度A股市场总体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，有一波短期的反弹。两会以后，受经济增长数据同比明显下滑、人民币贬值等因素影响，国内股票市场全面调整，成长股调整幅度较大。受正股震荡行情影响，可转债在一季度总体呈现震荡走势。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金始终控制配置节奏，优化持仓结构，保持组合流动性。密切关注高收益债券的信用风险暴露，严格控制其持仓比例，防控信用风险。同时，密切关注权益市场变化以及转债个券可能存在的条款博弈机会，调整权益资产占比，择机进行波段操作，有效提升组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，长盛同禧信用增利债券A的基金份额净值为0.949元，本报告期份额净值增长率为2.93%，同期业绩比较基准增长率为2.58%。

截止报告期末，长盛同禧信用增利债券C的基金份额净值为0.938元，本报告期份额净值增长率为2.96%，同期业绩比较基准增长率为2.58%。

§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	1,643,160.00	1.51
	其中：股票	1,643,160.00	1.51
2	固定收益投资	99,483,474.83	91.33
	其中：债券	99,483,474.83	91.33
	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	5,428,595.10	4.98
7	其他资产	2,371,164.50	2.18
8	合计	108,926,394.43	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	250,380.00	0.36
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	1,392,780.00	1.98
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	1,643,160.00	2.34

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	19,000	713,640.00	1.02
2	600837	海通证券	73,500	679,140.00	0.97
3	002138	顺络电子	16,050	250,380.00	0.36

注：本基金本报告期末仅持有上述3只股票。

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	－	－
	其中：政策性金融债	－	－
4	企业债券	88,546,936.43	126.18
5	企业短期融资券	－	－
6	中期票据	－	－
7	可转债	10,936,538.40	15.58
8	其他	－	－
9	合计	99,483,474.83	141.76

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	112172	13普邦债	60,000	5,760,000.00	8.21
2	122703	12鞍城投	50,000	5,165,000.00	7.36
3	112015	09泛海债	50,000	5,000,000.00	7.12
4	112077	12化机债	50,000	4,965,000.00	7.08
5	112138	12苏宁01	50,000	4,757,500.00	6.78

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

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

（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。

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	9,549.86
2	应收证券清算款	39,671.06
3	应收股利	－
4	应收利息	2,069,855.43
5	应收申购款	252,088.15
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	2,371,164.50

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110022	同仁转债	2,659,072.00	3.79
2	110015	石化转债	2,559,250.00	3.65
3	110020	南山转债	1,373,366.40	1.96
4	110023	民生转债	885,100.00	1.26

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

项目	长盛同禧信用增利债券A	长盛同禧信用增利债券C
报告期期初基金份额总额	44,277,274.47	35,894,077.38
报告期期间基金总申购份额	3,162,979.21	1,522,724.31
减:报告期期间基金总赎回份额	5,823,071.75	4,712,476.48
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	41,617,181.93	32,704,325.21

§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、《长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金合同》；
3、《长盛同禧信用增利债券型证券投资基金托管协议》；
4、《长盛同禧信用增利债券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和/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

长盛中证100指数证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	长盛中证100指数
基金主代码	519100
交易代码	519100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月22日
报告期末基金份额总额	972,794,847.57份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在4%以下，以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%＋一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，风险中等，将获得证券市场平均收益率。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略，在投资管理上将最大限度的分散非系统性风险。对于跟踪误差的风险，本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。
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（2014年1月1日 — 2014年3月31日）
1.本期已实现收益	−20,908,535.13
2.本期利润	−55,814,811.25
3.加权平均基金份额本期利润	−0.0562
4.期末基金资产净值	607,021,201.33
5.期末基金份额净值	0.6240

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。

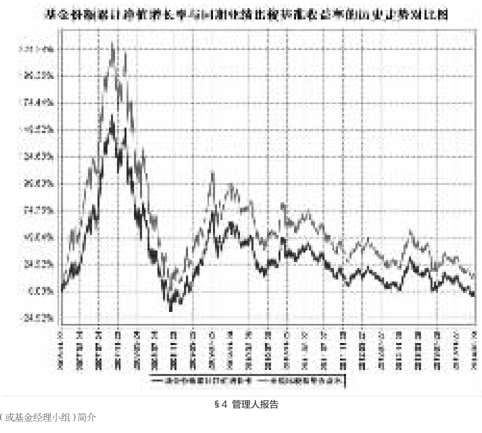
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	−8.17%	1.12%	−7.78%	1.12%	−0.39%	0.00%

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



§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，长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理。	2011年7月11日	－	7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（本基金）基金经理，长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）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

一季度股票市场整体上震荡下行，智能汽车、在线教育旅游和京津冀板块大幅上涨，航母、移动转售和装饰园林概念板块大幅下跌。行业上，休闲旅游、综合和轻工制造涨幅靠前，采掘、农林牧渔和非银金融持续下跌。风格上，小盘成长股一季度跑赢大盘价值股。

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0.6240元，本报告期份额净值增长率为−8.17%，同期业绩比较基准增长率为−7.78%。本报告期内日均跟踪误差为0.0282%，年度化跟踪误差为0.4455%。

§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	573,582,618.97	94.31
	其中：股票	573,582,618.97	94.31
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	－	－
	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	34,232,335.59	5.63
7	其他资产	391,557.21	0.06
8	合计	608,206,511.77	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	－	－
B	采矿业	40,651,599.86	6.70
C	制造业	161,779,439.42	26.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,341,841.53	2.69
E	建筑业	20,761,394.57	3.42
F	批发和零售业	5,936,757.84	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	14,987,533.92	2.47
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,794,848.12	1.45
J	金融业	272,790,176.13	44.94
K	房地产业	23,659,809.39	3.90
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	3,314,424.04	0.55
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	4,564,794.15	0.75
	合计	573,582,618.97	94.49

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	－	－
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	600036	招商银行	3,716,349	36,494,547.18	6.01
2	600016	民生银行	4,233,700	32,430,142.00	5.34
3	601318	中国平安	779,257	29,268,892.92	4.82
4	601166	兴业银行	2,248,649	21,407,138.48	3.53
5	600000	浦发银行	2,201,179	21,395,459.88	3.52
6	000002	万 科A	1,987,719	16,080,646.71	2.65
7	600837	海通证券	1,615,888	14,930,805.12	2.46
8	600030	中信证券	1,367,309	14,397,763.77	2.37
9	601328	交通银行	3,780,587	14,290,618.86	2.35
10	000651	格力电器	476,720	13,348,160.00	2.20

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

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。

5.10 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

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。

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	360,531.54
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	20,517.35
5	应收申购款	10,508.32
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	391,557.21

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

5.11.5.1 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中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 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：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	1,083,286,318.93
报告期期间基金总申购份额	9,047,582.25
减:报告期期间基金总赎回份额	119,539,053.61
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	972,794,847.57

§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

（一）关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛中证100指数证券投资基金的批复；
（二）《长盛中证100指数证券投资基金基金合同》；
（三）《长盛中证100指数证券投资基金托管协议》；
（四）《长盛中证100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。

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