长盛中证100指数证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2014年10月27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10月24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7月1日起至9月30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	887,617,805.08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7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-25,267,865.15
2.本期利润	67,217,595.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0621
4.期末基金资产净值	628,451,957.86
5.期末基金份额净值	0.7080

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	11.22%	0.91%	9.83%	0.90%	1.39%	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十三条“(二)投资范围”、“(八)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		
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，同盛证券投资基金基金经理助理。	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，现任同盛证券投资基金基金经理助理，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

报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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%的交易共有2次，为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

4.3.3 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，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%的交易共有2次，为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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

三季度股票市场大幅上涨，通用航空、航母和高端装备制造等概念板块涨幅靠前，而移动互联网、职业教育和苹果产业链等概念板块涨幅靠后。行业上，国防军工、汽车和机械装备等行业涨幅靠前，银行、传媒和家用电器等行业涨幅靠后。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0.7080元，本报告期份额净值增长率为11.22%，同期业绩比较基准增长率为9.83%。本报告期内日均跟踪误差为0.0837%，年度化跟踪误差为1.325%。

§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	591,281,955.27	93.73
	其中：股票	591,281,955.27	93.73
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	39,097,103.23	6.20
7	其他资产	475,401.03	0.08
8	合计	630,854,459.53	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	39,635,067.64	6.31
C	制造业	171,636,501.34	27.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,957,516.96	3.02
E	建筑业	23,255,221.60	3.70
F	批发和零售业	6,643,338.96	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	18,457,298.73	2.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,592,995.54	1.53
J	金融业	275,223,524.90	43.79
K	房地产业	24,284,601.40	3.86
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	3,595,888.20	0.57
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	591,281,955.27	94.09

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	600036	招商银行	3,415,478	35,486,816.42	5.65
2	601318	中国平安	709,515	29,331,350.10	4.67
3	600016	民生银行	4,664,625	29,107,260.00	4.63
4	601166	兴业银行	2,067,204	21,126,824.88	3.36
5	600000	浦发银行	2,022,112	19,715,592.00	3.14
6	600030	中信证券	1,273,052	16,957,052.64	2.70
7	000002	万 科A	1,824,693	16,750,681.74	2.67
8	600837	海通证券	1,504,355	15,524,943.60	2.47
9	601328	交通银行	3,469,779	14,885,351.91	2.37
10	600519	贵州茅台	82,635	13,397,612.55	2.13

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：本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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：本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

根据中国平安股份有限公司2013年10月14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有限责任公司(以下简称“平安证券”)近日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》([2013]48号)，中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)决定责令平安证券改正及给予警告，没收其在万福生科(湖南)农业开发股份有限公司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，暂停其保荐业务许可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	383,324.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	41,983.54
5	应收申购款	50,093.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	475,401.03

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	948,879,295.87
报告期间基金总申购份额	367,553,024.82
减：报告期期间基金总赎回份额	428,814,515.61
报告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	887,617,805.08

§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：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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/或基金托管人的办公地址。

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10月27日

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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：2014年10月27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10月24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	长盛同鑫行业混合
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	2014年5月27日
报告期末基金份额总额	153,785,883.86份
投资目标	积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会，在控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	(1)本基金在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挖掘预期具有良好增长前景的优势行业，以谋求行业配置的超额收益。(2)在资产配置层面，本基金管理人对宏观经济的经济周期进行预测，在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在各类别资产间的分配比例，具体操作中，采用经济周期资产配置模型，通过对宏观经济运行指标，利率和货币政策等相关因素的分析，对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测，然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。(3)在行业配置层面，通过宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机，据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业，把握行业景气轮换带来的投资机会；(4)在股票选择层面，本基金综合运用长盛行业股票研究分析方法和其它投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合，描述优势行业中股票优先入选。
业绩比较基准	60%*沪深300指数+40%*中证全债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金，高于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7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	12,408,923.18
2.本期利润	17,833,339.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.1039
4.期末基金资产净值	179,645,359.88
5.期末基金份额净值	1.168

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。

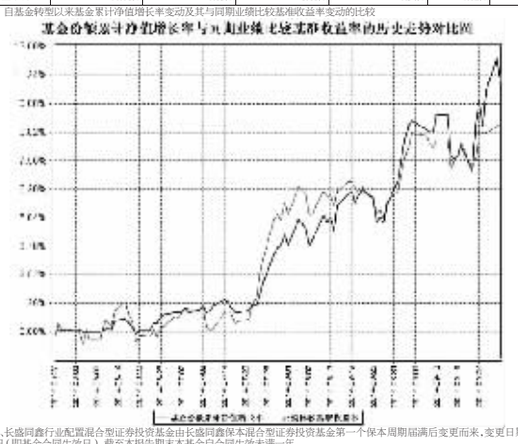
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	10.08%	0.63%	8.46%	0.54%	1.62%	0.09%

3.2.2 自基金转型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：1、长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金由长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来，变更日期为2014年5月27日(即基金合同生效日)，截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，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有关约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年，截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十二部分(二)投资范围、(四)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		
田间	本基金基金经理，同盛证券投资基金基金经理。	2014年9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基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金(本基金)基金经理。
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，公司总经理助理，社保组合组合经理，固定收益部总监。	2014年5月27日	2014年9月9日	10年	男，1978年11月出生，中国国籍，毕业于中央财经大学，获硕士学位，CFA(特许金融分析师)。历任宝盈基金管理有限公司研究员，基金经理助理，2006年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员，社保组合助理，投资经理，长盛积极配置债券基金基金经理，长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理，长盛同鑫债券混合型证券投资基金基金经理等职务，现任公司总经理助理，固定收益部总监，社保组合组合经理，长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理。自2014年9月9日起不再担任长盛同鑫行业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，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%的交易共有2次，为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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年第三季度，经济增速有所下滑，通胀水平处于低位，货币政策定向放松，资金面呈现持续宽松局面，债券市场延续了牛市行情。利率债方面，长端收益率下行幅度较大，收益率曲线有所平坦化。信用债方面，收益率曲线平坦化下行，信用利差有所收窄。

货币市场方面，受央行公开市场操作引导利率下行及定向宽松的货币政策影响，市场流动性保持宽松局面，各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率总体呈震荡下行走势。

纯债资产以外，三季度权益市场强势反弹，投资者心态从惊恐到极热，全市场季度涨幅超过30%的股票接近四成。从行业和主题角度看，军工、农业、小市值、低价股、资产重组个股表现最好，所有行业指数均实现了正收益；受正股强势反弹行情影响，可转债在三季度总体呈现震荡上涨走势。

2、报告期内本基金投资策略分析

本基金的第一个开放期在报告期内到来，在开放期前本基金始终控制配置节奏，随开放期临近逐步降低组合久期，优化持仓结构，提高组合流动性，严防信用风险，在控制流动性风险和信用风险的前提下，尽可能提高组合资产收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，长盛双月红1年期债券A的基金份额净值为1.028元，本报告期份额净值增长率为2.62%，同期业绩比较基准增长率为0.76%。

截止报告期末，长盛双月红1年期债券C的基金份额净值为1.028元，本报告期份额净值增长率为2.67%，同期业绩比较基准增长率为0.76%。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	75,406,953.00	66.98
	其中：债券	75,406,953.00	66.98
	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	25,184,083.71	22.37
7	其他资产	11,992,991.11	10.65
8	合计	112,584,027.82	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	65,293,953.00	83.89
5	企业短期融资券	10,113,000.00	12.99
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	75,406,953.00	96.88

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	122809	11淮国资	136,000	13,953,600.00	17.93
2	041458006	14天延化工CP001	100,000	10,113,000.00	12.99
3	122708	12伊旗债	70,000	7,210,000.00	9.26
4	122936	09鹤城投	70,000	7,176,400.00	9.22
5	124402	13丹投01	70,000	7,168,000.00	9.21

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：本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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：本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

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	162,256.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,553.75
5	应收申购款	72,182.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	236,992.27

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	196,779,756.42
报告期期间基金总申购份额	1,442,364.08
减：报告期期间基金总赎回份额	44,436,236.64
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	153,785,883.86

§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：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》；

3、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金托管协议》；

4、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金招募说明书》；

5、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》；

6、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金托管协议》；

7、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金招募说明书》；

8、法律意见书；

9、基金管理人业务资格批件、营业执照；

10、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/或基金托管人的办公地址。

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10月27日

长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014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：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2014年10月27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10月24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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛双月红定期债券
基金主代码	000303
交易代码	000303
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月24日
报告期末基金份额总额	75,724,881.13份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，给投资者带来长期的现金红利收益。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类金融工具，不直接买入股票、权证等权益类金融工具，本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配，本基金的投资策略包括大类资产配置策略、债券组合管理策略和期限管理策略。 本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置，同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。 由于本基金封闭期为一年，基金规模相对稳定，但在开放期内本基金规模的不确定性增强，本基金将采用期限管理策略，分散化投资于不同剩余期限标的，临近开放期时，在最大限度保证收益的同时将组合剩余期限降低，保证开放期内具备足够流动性应对可能发生的组合规模变化。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期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	中国农业银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	长盛双月红定期债券A / 长盛双月红定期债券C
下属两级基金的交易代码	000303 / 000304
报告期末下属两级基金的份额总额	37,987,451.56份 / 37,737,429.57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7月1日 - 2014年9月30日)	
	长盛双月红定期债券A	长盛双月红定期债券C
1.本期已实现收益	4,720,890.33	3,821,834.64
2.本期利润	4,126,987.47	3,294,584.84
3.加权