# 长盛货币市场基金

## 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：兴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。

基金托管人兴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 | 长盛货币 |
| 基金主代码 | 080011 |
| 交易代码 | 080011 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2005年 12 月 12 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,300,792,224.71 份 |
| 投资目标 | 在力争本金安全、保证资产高流动性的基础上，追求高于业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 本基金将根据宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行情况，以及货币市场、证券市场运行状况制定投资策略。采用积极的投资策略，通过动态调整优化投资组合，追求当期收益最大化。在动态调整过程中，基金管理小组将全面考虑收益目标、交易成本、市场流动性等特征，实现收益与风险的平衡。 |
| 业绩比较基准 | 银行一年定期存款利率（税后）。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。 |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴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 | 16,934,089.97 |
| 2. 本期利润 | 16,934,089.97 |
| 3. 期末基金资产净值 | 1,300,792,224.71 |

注：1、所列数据截止到 2014 年 9 月 30 日。

2、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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

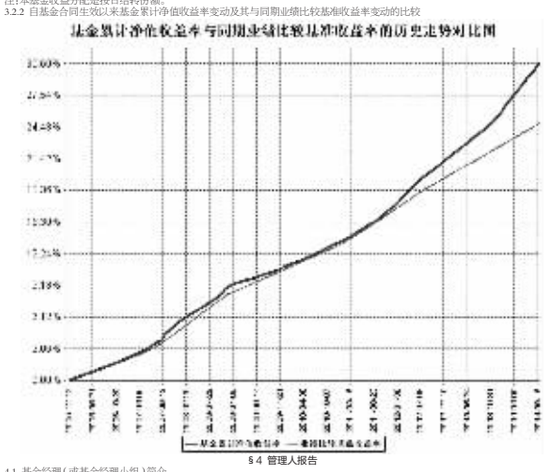
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 1.0981% | 0.0083% | 0.7562% | 0.0000% | 0.3419% | 0.0083% |

注：本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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 | | |
| 贾志敏 | 本基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，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（本基金）基金经理，长盛同禧信用增利债券型证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。 |
| 段鹏 | 本基金基金经理，长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金经理，长盛添利 60 天理财债券型发起式证券投资基金基金经理。 | 2014年 4 月 10 日 | – | 7年 | 男，1982 年 12 月出生，中国国籍，中央财经大学经济学硕士，曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易、债券投资及流动性管理等工作。2013 年 12 月加入长盛基金管理有限公司，现任长盛货币市场基金（本基金）基金经理，长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金经理，长盛添利 60 天理财债券型发起式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

三季度，经济基本面在前期有所企稳的基础上出现一定反复，说明经济回升的基础并不牢固，总体仍相对疲弱，通胀水平处于相对低位，货币政策继续定向放松，资金面整体维持宽松态势，上述因素共同推动下，债券市场延续牛市行情。

货币市场方面，受定向宽松货币政策影响，市场流动性保持相对宽松局面，除新股申购等局部时点有所波动反弹外，Shibor 利率、协议存款利率仍在下行。

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，合理安排组合资产结构和久期，始终注意保持组合流动性安全，努力在风险可控的前提下提高组合资产整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年 3 季度，长盛货币净值收益率为 1.0981%，同期业绩比较基准收益率为 0.7562%。

### §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 | 固定收益投资 | 640,506,620.46 | 44.46 |
| | 其中：债券 | 640,506,620.46 | 44.46 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 2 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 784,472,506.66 | 54.45 |
| 4 | 其他资产 | 15,711,979.38 | 1.09 |
| 5 | 合计 | 1,440,691,106.50 | 100.00 |

注：本报告期内，根据流动性管理的需要，本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的存款。

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例（%） |
|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 5.75 |
| | 其中：买断式回购融资 | – |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例（%） |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 137,367,426.82 | 10.56 |
| | 其中：买断式回购融资 | – | – |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 116 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 138 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 89 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：报告期内无投资组合平均剩余期限超过 180 天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例（%） | 各期限负债占基金资产净值的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 36.47 | 10.56 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | – | – |
| 2 | 30天(含)—60 天 | 19.99 | – |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | – | – |
| 3 | 60天(含)—90 天 | 4.62 | – |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 1.54 | – |
| 4 | 90天(含)—180 天 | 15.38 | – |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | – | – |
| 5 | 180天(含)—397 天（含） | 33.09 | – |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | – | – |
| | 合计 | 109.55 | 10.56 |

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 | 摊余成本（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 | 110,059,207.05 | 8.46 |
| | 其中：政策性金融债 | 110,059,207.05 | 8.46 |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 企业短期融资券 | 530,447,413.41 | 40.78 |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 其他 | – | – |
| 8 | 合计 | 640,506,620.46 | 49.24 |
| 9 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 20,035,902.98 | 1.54 |

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量（张） | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 130243 | 13国开 43 | 500,000 | 49,979,161.21 | 3.84 |
| 2 | 041458021 | 14山钢 CP001 | 300,000 | 30,238,257.98 | 2.32 |
| 3 | 041456014 | 14中铝业 CP002 | 300,000 | 30,209,433.00 | 2.32 |
| 4 | 041453069 | 14山煤 CP001 | 300,000 | 30,000,104.54 | 2.31 |
| 5 | 041452032 | 14蚌埠 CP001 | 300,000 | 30,000,099.56 | 2.31 |
| 6 | 041466014 | 14鄂长产 CP001 | 300,000 | 30,000,098.93 | 2.31 |
| 7 | 090205 | 09国开 05 | 200,000 | 20,035,902.98 | 1.54 |
| 8 | 140204 | 14国开 04 | 200,000 | 20,031,038.76 | 1.54 |
| 9 | 140212 | 14国开 12 | 200,000 | 20,013,104.10 | 1.54 |
| 10 | 041464044 | 14西电集 CP001 | 200,000 | 20,008,323.42 | 1.54 |

5.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)—0.5%间的次数 | 7 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.2883% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.1148% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.2014% |

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 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金的债券投资采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.8.2

本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金净值的 20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | – |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收利息 | 15,684,622.63 |
| 4 | 应收申购款 | – |
| 5 | 其他应收款 | 27,356.75 |
| 6 | 待摊费用 | – |
| 7 | 其他 | – |
| 8 | 合计 | 15,711,979.38 |

5.8.5 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 | 1,131,790,822.15 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,692,646,828.28 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,523,645,425.72 |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,300,792,224.71 |

### §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、《长盛货币市场基金基金合同》；

3、《长盛货币市场基金托管协议》；

4、《长盛货币市场基金招募说明书》；

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

# 长盛动态精选证券投资基金

## 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 | 长盛动态精选混合 |
| 基金主代码 | 510081 |
| 交易代码 | 510081 |
| 前端交易代码 | 510081 |
| 后端交易代码 | 511081 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004年 5 月 21 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 836,696,721.82 份 |
| 投资目标 | 本基金通过积极投资于能够充分分享中国经济长期增长的，在各自行业中已经或将要取得领袖地位的 50 家上市公司股票，在承担适度风险的前提下，追求当期收益和基金资产超过业绩比较基准的长期稳定回报。 |
| 投资策略 | 本基金投资策略上偏重选股能力的发挥，时机的选择放在次要位置。 |
| 业绩比较基准 | 中信标普 A 股综合指数收益率×95%＋金融同业存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中的适度风险品种，在承担适度风险的前提下，获取长期稳定的收益。 |
| 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 | 34,909,219.54 |
| 2.本期利润 | 129,884,387.15 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1489 |
| 4.期末基金资产净值 | 996,148,427.54 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1906 |

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 | 14.47% | 0.85% | 19.32% | 0.81% | −4.85% | 0.04% |

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”、“（七）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 | | |
| 邓永明 | 本基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理，权益投资部总监。 | 2008年 8 月 11 日 | – | 15年 | 男，1971 年 7 月出生，中国国籍。毕业于山西农业大学，获学士学位。曾任大成基金管理有限公司研究员、交易员和基金经理助理。2005 年 7 月底加入长盛基金管理有限公司，曾任基金同益基金经理助理，同德证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长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，权益投资部副总监等职务。现任权益投资部总监，长盛动态精选证券投资基金（本基金）基金经理，长盛同德主题增长股票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

宏观经济在 7 月份小幅反弹后，8、9 月份重回疲软。在微刺激不能持续的状况下，经济缺少内生动力，经济短期需忍受阵痛，但长期则期待改革和转型所形成的新的力量。不过，目前经济增速可能会继续下滑，货币政策将相对宽松，这有利于资金流入股市。在叠加资金流入和改革转型预期下，三季度市场处于可投资阶段，军工和并购重组等题材股表现活跃。

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 1.1906 元，本报告期份额净值增长率为 14.47%，同期业绩比较基准增长率为 19.32% 。

### §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 | 857,765,016.35 | 85.57 |
| | 其中：股票 | 857,765,016.35 | 85.57 |
| 2 | 固定收益投资 | 19,270,000.00 | 1.92 |
| | 其中：债券 | 19,270,000.00 | 1.92 |
| | 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 | 124,386,062.83 | 12.41 |
| 7 | 其他资产 | 1,019,993.12 | 0.10 |
| 8 | 合计 | 1,002,441,072.30 | 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 | 9,137,012.20 | 0.92 |
| B | 采矿业 | – | – |
| C | 制造业 | 522,848,918.04 | 52.49 |
| D | 电力,热力,燃气及水生产和供应业 | 18,526,363.74 | 1.86 |
| E | 建筑业 | 10,576,454.50 | 1.06 |
| F | 批发和零售业 | 68,207,749.55 | 6.85 |
| 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 | 103,194,669.08 | 10.36 |
| J | 金融业 | 85,556,169.70 | 8.59 |
| 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 | 13,719,044.54 | 1.38 |
| N | 水利,环境和公共设施管理业 | 25,998,635.00 | 2.61 |
| 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 | 857,765,016.35 | 86.11 |

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 | 300122 | 智飞生物 | 2,500,385 | 72,786,207.35 | 7.31 |
| 2 | 300290 | 荣科科技 | 2,021,704 | 44,517,922.08 | 4.47 |
| 3 | 300303 | 聚飞光电 | 1,700,754 | 34,576,328.82 | 3.47 |
| 4 | 300003 | 乐普医疗 | 1,309,785 | 30,779,947.50 | 3.09 |
| 5 | 600363 | 联创光电 | 2,803,726 | 30,196,129.02 | 3.03 |
| 6 | 600030 | 中信证券 | 2,257,294 | 30,067,156.08 | 3.02 |
| 7 | 600837 | 海通证券 | 2,700,707 | 27,871,296.24 | 2.80 |
| 8 | 600122 | 宏图高科 | 4,500,000 | 27,000,000.00 | 2.71 |
| 9 | 300187 | 永清环保 | 799,958 | 25,998,635.00 | 2.61 |
| 10 | 002454 | 松芝股份 | 1,500,612 | 23,904,749.16 | 2.40 |

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 | 19,270,000.00 | 1.93 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | – | – |
| | 其中：政策性金融债 | – | – |
| 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 | 19,270,000.00 | 1.93 |

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 | 0110213 | 02国债03 | 200,000 | 19,270,000.00 | 1.93 |

注：本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

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

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股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 868,775.22 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 69,223.81 |
| 5 | 应收申购款 | 81,994.09 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 1,019,993.12 |

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

| 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 | 300122 | 智飞生物 | 72,786,207.35 | 7.31 | 重大事项停牌 |
| 2 | 002454 | 松芝股份 | 23,904,749.16 | 2.40 | 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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 888,580,660.37 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 33,834,735.66 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 85,718,674.21 |
| 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 | 836,696,721.82 |

### §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

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | – |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 19,346,786.70 |
| 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 | 19,346,786.70 |
| 报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 2.31 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 申购 | 2014年 7 月 23 日 | 19,346,786.70 | 20,000,000.00 | 0.20% |
| 合计 | | | 19,346,786.70 | 20,000,000.00 | |

### §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、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》；

3、《长盛动态精选证券投资基金托管协议》；

4、《长盛动态精选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

# 长盛创新先锋灵活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 | 长盛创新先锋混合 |
| 基金主代码 | 080002 |
| 交易代码 | 080002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008年 6 月 4 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 498,596,686.26 份 |
| 投资目标 | 选择具有创新能力和行业领先的上市公司，分享企业高速增长成果，在承担适度风险的基础上，追求基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金为混合型证券投资基金，在资产配置上会考虑宏观经济因素、政策因素及市场估值水平。在个股选择上将根据不同行业景气度、“长盛创新选股体系”和“长盛优势选股体系”的股票筛选原则和方法优化个股投资比重。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数×65%＋上证国债指数×35% |
| 风险收益特征 | 本基金强调精选投资价值较大的创新领先企业，突出资产配置的灵活性和主动性，风险收益略低于股票型基金，高于债券型基金和平衡型基金。 |
| 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 |

### §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 | 18,967,007.60 |
| 2.本期利润 | 59,198,882.35 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1422 |
| 4.期末基金资产净值 | 661,784,835.04 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3273 |

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 | 11.21% | 0.56% | 8.88% | 0.58% | 2.33% | −0.02% |

3.2.2 自基金合同生