长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

【2013】第二季度报告

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7月18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7月17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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同智优势混合(LOF)
基金主代码	160805
交易代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1月5日
报告期末基金份额总额	2,228,692,387.12份
投资目标	主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司，所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	本基金为主动管理的混合型基金，对各类资产采取适度灵活的资产配置。主要选股思路是采用自上而下的路径，投资策略上偏重选股能力的发挥。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益-较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于债券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	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（2013年4月1日 - 2013年6月30日）
1.本期已实现收益	74,718,523.52
2.本期利润	18,641,314.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0082
4.期末基金资产净值	1,724,364,675.60
5.期末基金份额净值	0.7737

注：1、所述基金业绩指标不包括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6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	1.01%	1.31%	-7.44%	0.94%	8.45%	0.37%

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、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为2007年1月5日。
2、按基金合同规定，本基金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本基金合同第十五条（二）投资范围、（六）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		
王宁	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，公司总经理助理，权益投资部总监。	2012年7月20日	-	14年	男，1971年10月出生，中国国籍。毕业于北京大学光华管理学院，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理，长盛动态精选基金基金经理等职务。现任公司总经理助理，权益投资部总监，长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)，(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。

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》的相关规定等。

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、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（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年第2季度，沪深300反弹一个月后陷入了2个月的下跌，创下新低。与其相反的是，创业板指数上涨9%，创下历史新高。虽然海外流动性在撤出新兴市场，但实质上并没有威胁到二级市场里中小市值板块的估值。原因在于存量资金虽然认知到中小板的整体风险，但在宏观经济复苏偏弱的大背景下，在中小板中挖掘可持续成长的标的似乎是唯一的选择。

同智基金在市场的波动中坚持选择有基本面支持的，有中长期成长潜力的个股。在经济弱复苏的背景下，淡化周期，淡化行业。同时组合注意到了成长股系统性高估的风险，组合整体的仓位保持相对的谨慎，对基本面的考量更加严格。

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0.7737元，本报告期份额净值增长率为1.01%，同期本基金业绩比较基准收益率为-7.44%。

§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	904,263,147.56	52.19
	其中：股票	904,263,147.56	52.19
2	固定收益投资	19,956,000.00	1.15
	其中：债券	19,956,000.00	1.15
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	235,000,314.00	13.56
	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	560,521,288.32	32.35
6	其他资产	12,772,054.36	0.74
7	合计	1,732,512,804.24	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	1,948,100.00	0.11
C	制造业	652,691,866.32	37.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,656,873.64	0.44
E	建筑业	62,162,626.70	3.60
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	139,361,638.77	8.08
J	金融业	13,162,800.00	0.76
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,075,232.60	0.99
M	科学研究和技术服务业	10,204,009.53	0.59
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	904,263,147.56	52.44

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	300055	万邦达	1,589,837	62,162,626.70	3.60
2	002292	奥飞动漫	1,704,219	38,157,463.41	2.21
3	300101	国腾电子	2,122,882	33,095,730.38	1.92
4	002241	歌尔声学	893,527	32,426,094.83	1.88
5	300017	网宿科技	803,578	31,315,434.66	1.82
6	002138	顺络电子	1,664,142	29,954,556.00	1.74
7	300228	富瑞特装	374,032	29,922,560.00	1.74
8	000997	新大陆	1,840,115	27,804,137.65	1.61
9	300014	亿纬锂能	1,164,107	27,472,925.20	1.59
10	002551	尚荣医疗	975,080	26,580,680.80	1.54

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	-	-
5	企业短期融资券	19,956,000.00	1.16
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	19,956,000.00	1.16

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

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	041359005	13广汇能源CP001	200,000	19,956,000.00	1.16

注：本基金本报告期末仅持有上述1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：本基金本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
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。
5.9 投资组合报告附注
5.9.1 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。
5.9.2 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。
5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,697,885.83
2	应收证券清算款	10,004,998.49
3	应收股利	538,412.50
4	应收利息	528,783.60
5	应收申购款	1,973.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,772,054.36

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注：本基金报告期末未持有可转换债券。
5.9.5 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	000997	新大陆	27,804,137.65	1.61	重大事项停牌

5.9.6 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

本报告期期初基金份额总额	2,294,596,621.44
本报告期基金总申购份额	2,161,239.81
减：本报告期基金总赎回份额	68,065,474.13
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,228,692,387.12

§7 备查文件目录

7.1 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同智优势成长混合型证券投资基金的批复；
2、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金基金合同》；
3、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金托管协议》；
4、《长盛同智优势成长混合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。

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7月18日

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

【2013】第二季度报告

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：2013年7月18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2013年7月17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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛全债指数增强债券
基金主代码	510080
交易代码	510080
前端交易代码	510080
后端交易代码	511080
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年10月25日
报告期末基金份额总额	229,733,302.48份
投资目标	本基金为开放式债券型基金，将运用增强的指数化投资策略，在力求本金安全的基础上，追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳定增值
投资策略	本基金采用"自上而下"的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值，同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率×92%+中信标普A股综合指数收益率×8%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金
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

§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4月1日 - 2013年6月30日）
1.本期已实现收益	3,332,197.24
2.本期利润	271,219.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0011
4.期末基金资产净值	266,503,473.26
5.期末基金份额净值	1.1601

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6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	0.08%	0.25%	0.08%	0.15%	0.00%	0.10%

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的历史走势对比图

§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，固定收益部副总监。	2013年3月21日	-	7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基金经理，长盛中信全债指数增强型债券投资基金（本基金）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。

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》的相关规定等。

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、《长盛中信全债指数增强型债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

（一）报告期内行情回顾

2013年第二季度，在通胀水平继续回落、经济弱复苏态势进一步明确及货币市场资金大部分时间相对宽松的基本面环境下，债券市场在4-5月走出一波牛市行情。具体来看：利率债方面，长端收益率在窄幅震荡的走势，短端收益率曲线呈现波动向上的走势，期限利差曲线不断收窄，收益率曲线呈现扁平化趋势；信用债方面，短端收益率上行幅度大于长端收益率，收益率曲线逐渐扁平化，高低评级债券收益率均呈现窄幅震荡的态势，信用利差基本保持不变。进入6月中下旬，银行间市场流动性意外收紧，部分金融机构为补充流动性压缩杠杆，引发债市调整，短端收益率大幅上升，出现利率倒挂的现象。

货币市场方面，二季度银行间货币市场利率维持在较低水平，银行间资金面总体保持充裕，以银行间七天回购利率为例，除6月中下旬外，该利率在一季度基本维持在3.5%左右。除6个月品种外，各中短期限Shibor利率维持在较低水平。6月中下旬银行间市场流动性意外收紧，货币市场利率飞涨，Shibor隔夜利率曾高达13.44%，银行间资金面相当紧张。

纯债资产以外，受经济基本面弱复苏及影子银行清理政策影响，二季度A股呈现震荡下行的态势。受正股震荡下行的行情带动，股性较强的转债在2季度总体呈现不断下降的走势。

（二）报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金继续在一二级市场择优配置了一些信用资质有保障的高收益债券，在此基础上对持仓结构进行了优化。在具体投资品种方面，我们在增持信用债的同时，对权益类资产占比进行调整，并根据市场波动抓住利率债品种的交易性机会。

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1.1601元，本报告期份额净值增长率为0.08%，同期业绩比较基准增长率为0.08%。

§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	23,304.96	0.01
	其中：股票	23,304.96	0.01
2	固定收益投资	401,283,865.37	92.84
	其中：债券	401,283,865.37	92.84
	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	20,859,244.63	4.83
6	其他资产	10,085,206.71	2.33
7	合计	432,251,621.67	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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	23,304.96	0.01
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	23,304.96	0.01

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	601117	中国化学	2,448	23,304.96	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述一支股票。

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	17,783,000.00	6.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,346,000.00	14.76
	其中：政策性金融债	39,346,000.00	14.76
4	企业债券	278,728,803.87	104.59
5	企业短期融资券	19,842,000.00	7.45
6	中期票据	10,066,000.00	3.78
7	可转债	35,518,061.50	13.33
8	其他	-	-
9	合计	401,283,865.37	150.57

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

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	110261	11国开61	200,000	19,734,000.00	7.40
2	110233	11国开33	200,000	19,612,000.00	7.36
3	122995	08合建投	149,700	16,212,510.00	6.08
4	110015	石化转债	144,580	14,431,975.60	5.42
5	122757	11丹东债	120,000	12,631,200.00	4.74

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 投资组合报告附注
5.8.1 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，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
5.8.2 本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。
5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	403,876.28
2	应收证券清算款	659,947.21
3	应收股利	-
4	应收利息	9,018,302.46
5	应收申购款	3,080.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,085,206.71

5.8.4 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	110015	石化转债	14,431,975.60	5.42
2	113002	工行转债	6,316,695.00	2.37
3	110017	中海转债	4,613,000.00	1.73
4	110007	博汇转债	3,649,100.00	1.37
5	110003	新钢转债	3,132,832.00	1.18
6	113003	重工转债	1,049,472.00	0.39
7	110022	同仁转债	648,150.00	0.24
8	110018	国电转债	605,112.40	0.23

5.8.5 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。
5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	243,113,139.47
本报告期基金总申购份额	2,862,890.55
减：本报告期基金总赎回份额	16,242,727.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	229,733,302.48

§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、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》；
3、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金托管协议》；
4、《长盛中信全债指数增强型债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。

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7月18日

长盛中证100指数证券投资基金
2013年第2季度报告
2013年6月30日

长盛中证100指数证券投资基金

【2013】第二季度报告

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：2013年7月18日

§1 重要提示

基金管理人长盛基金管理有限公司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2013年7月17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及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至2013年6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	1,098,915,684.27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（2013年4月1日 - 2013年6月30日）
1.本期已实现收益	-10,551,324.51
2.本期利润	-95,479,416.96
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0856
4.期末基金资产净值	715,451,837.94
5.期末基金份额净值	0.6511

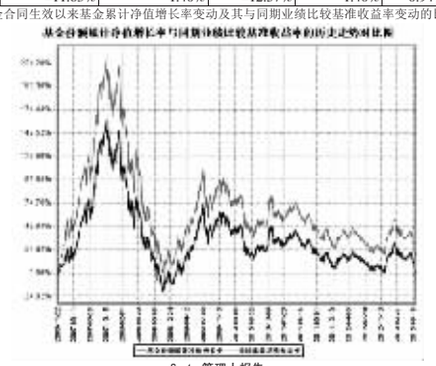
注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、所列数据截止到2013年6月30日。
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-11.63%	1.40%	-12.57%	1.40%	0.94%	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	-	6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作出决定之日；
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》的相关规定等，下同。

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、《长盛中证100指数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