# 长盛电子信息产业股票型证券投资基金

## 【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 | 242,604,633.13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(2013年4月1日 - 2013年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 10,557,487.71 |
| 2.本期利润 | 3,082,061.45 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0205 |
| 4.期末基金资产净值 | 285,597,183.53 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.177 |

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。

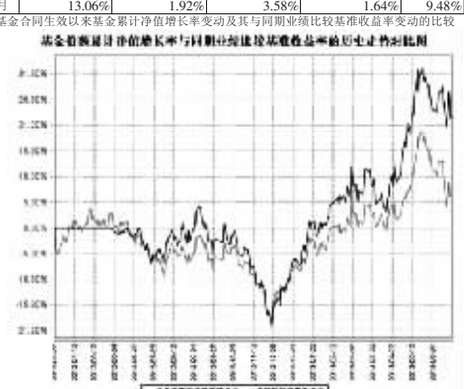
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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 | 13.06% | 1.92% | 3.58% | 1.64% | 9.48% | 0.28% |

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，长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理。 | 2012年3月27日 | - | 10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，长盛同祥泛资源主题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、《长盛电子信息产业股票型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）报告期内行情回顾及运作分析

2013年2季度A股市场的走势延续了1季度的风格和结构分化的格局。在市场整体下跌的状况下，分类指数中只有创业板指数实现16.76%的上涨，而传统大盘股影响较大的上证指数和沪深300指数分别下跌了11.51%和11.80%，结构型的分化行情继续得到强化。

从市场中各行业指数看，2季度实现正收益的行业只有信息服务、电子和信息设备，其他在1季度表现较好的行业中医药小幅下跌3%，化工和公用事业分别下跌12.66%和8.32%。1季度表现最弱的有色金属、采掘仍然是2季度表现最弱的两个行业。

受益于行业指数的上涨和主动管理的效果，本基金净值在2季度上涨了13.06%，同期信息服务、电子和信息设备行业的涨幅分别为17.73%、5.61%和2.44%，业绩比较基准涨幅为3.58%。

在2季度的投资运作中，我们对结构性行业继续演绎的程度表现出一定程度的谨慎，整体保持比较中性的仓位。从投资的结构上错失了在影视内容、传统传媒公司转型等方面的机会，过早的卖出了与之相关的股票；同时组合中的部分公司也面临业绩增速的下移，需要重新评估期中短期的投资价值。

（二）报告期内投资策略分析

本基金是专注于投资电子信息产业上市公司的行业型基金，经过过去多年的快速增长，电子信息产业已经成为国内的支柱型产业，国内企业的综合竞争力得到大幅增强；随着众多处于成长期的企业选择在A股上市，国内的投资者有了较好的投资机会。在经济转型的背景下，电子信息行业既是转型的主要方向，同时也承担着为转型提供工具、改善效率的功能，必然会成为后期经济发展中的重点领域。同时我们也要看到作为创新驱动的快速增长行业，也会有部分企业不可避免的受到创新的负面影响甚至是毁灭性的打击，需要用更加开放的思维来观察、判断企业的投资价值。

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1.177元，本报告期份额净值增长率为13.06%，同期业绩比较基准增长率为3.58%。

### §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 | 233,175,122.82 | 79.86 |
| | 其中：股票 | 233,175,122.82 | 79.86 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 29,000,000.00 | 9.93 |
| | 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 | 24,513,337.38 | 8.40 |
| 6 | 其他资产 | 5,298,445.27 | 1.81 |
| 7 | 合计 | 291,986,905.47 | 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 | 142,006,139.74 | 49.72 |
| 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 | 89,213,762.20 | 31.24 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,558,385.70 | 0.55 |
| 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 | 396,835.18 | 0.14 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 233,175,122.82 | 81.64 |

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 | 300241 | 瑞丰光电 | 1,328,007 | 16,666,487.85 | 5.84 |
| 2 | 300017 | 网宿科技 | 400,154 | 15,594,001.38 | 5.46 |
| 3 | 002073 | 软控股份 | 1,413,937 | 11,862,931.43 | 4.15 |
| 4 | 600570 | 恒生电子 | 853,393 | 10,667,412.50 | 3.74 |
| 5 | 002281 | 光迅科技 | 365,304 | 9,176,436.48 | 3.21 |
| 6 | 002465 | 海格通信 | 305,615 | 9,153,169.25 | 3.20 |
| 7 | 300182 | 捷成股份 | 336,286 | 8,925,030.44 | 3.13 |
| 8 | 002138 | 顺络电子 | 481,855 | 8,673,390.00 | 3.04 |
| 9 | 300188 | 美亚柏科 | 520,422 | 8,503,695.48 | 2.98 |
| 10 | 300207 | 欣旺达 | 452,444 | 8,008,258.80 | 2.80 |

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名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 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。

5.9.2 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股票。

5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 97,989.03 |
| 2 | 应收证券清算款 | 3,341,600.74 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 28,544.17 |
| 5 | 应收申购款 | 1,830,311.33 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,298,445.27 |

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.9.6 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 | 132,617,477.03 |
| 本报告期基金总申购份额 | 268,919,423.09 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 158,932,266.99 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 242,604,633.13 |

### §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。

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**
**2013年7月18日**

# 长盛动态精选证券投资基金

## 【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。

本报告中财务资料未经审计。

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 | 1,038,258,475.70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(2013年4月1日 - 2013年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 27,658,424.57 |
| 2.本期利润 | -3,776,138.47 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0035 |
| 4.期末基金资产净值 | 951,594,431.40 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9165 |

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 | -0.20% | 1.26% | -9.50% | 1.35% | 9.30% | -0.09% |

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 | | |
| 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，权益投资部副总监。 | 2008年8月11日 | - | 14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。现任权益投资部副总监，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、《长盛动态精选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

二季度，随着宏观数据公布，经济下滑的态势显露无余，A股中与经济密切相关的强周期行业迅速回落。而与此同时，新一代信息产业行业在强劲的消费带动下，经营状况继续超出预期；另外，受政策支持的传媒、环保等行业或者通过自身的发展或者通过并购和新增订单的作用下，走势凌厉。

本基金在宏观数据公布后，发现经济下滑的问题，逐步减持了与经济关联密切的地产、银行等行业，逐步增持了消费电子、环保等行业，取得一定效果，但配置比例仍然偏低。

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0.9165元，本报告期份额净值增长率为-0.20%，同期业绩比较基准增长率为-9.50%。

### §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 | 701,187,368.83 | 73.30 |
| | 其中：股票 | 701,187,368.83 | 73.30 |
| 2 | 固定收益投资 | 137,129,040.00 | 14.34 |
| | 其中：债券 | 137,129,040.00 | 14.34 |
| | 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 | 93,732,890.68 | 9.80 |
| 6 | 其他资产 | 24,536,450.26 | 2.57 |
| 7 | 合计 | 956,585,749.77 | 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 | 13,690,897.86 | 1.44 |
| C | 制造业 | 533,279,154.53 | 56.04 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 23,232,884.00 | 2.44 |
| E | 建筑业 | 11,734,785.84 | 1.23 |
| F | 批发和零售业 | 19,924,760.90 | 2.09 |
| 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 | 49,503,958.32 | 5.20 |
| 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 | 49,820,927.38 | 5.24 |
| 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 | 701,187,368.83 | 73.69 |

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 | 1,400,218 | 53,138,273.10 | 5.58 |
| 2 | 000581 | 威孚高科 | 1,501,637 | 50,139,659.43 | 5.27 |
| 3 | 002318 | 久立特材 | 2,107,167 | 36,095,770.71 | 3.79 |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 1,009,511 | 31,577,504.08 | 3.32 |
| 5 | 000895 | 双汇发展 | 780,121 | 29,987,851.24 | 3.15 |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,056,457 | 27,848,206.52 | 2.93 |
| 7 | 300070 | 碧水源 | 600,649 | 22,632,454.32 | 2.38 |
| 8 | 002241 | 歌尔声学 | 560,601 | 20,344,210.29 | 2.14 |
| 9 | 000963 | 华东医药 | 499,994 | 19,924,760.90 | 2.09 |
| 10 | 600637 | 百视通 | 700,755 | 19,621,140.00 | 2.06 |

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 | 77,459,040.00 | 8.14 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 59,670,000.00 | 6.27 |
| | 其中：政策性金融债 | 59,670,000.00 | 6.27 |
| 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 | 137,129,040.00 | 14.41 |

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 | 130201 | 13国开01 | 600,000 | 59,670,000.00 | 6.27 |
| 2 | 010107 | 21国债(7) | 551,000 | 57,877,040.00 | 6.08 |
| 3 | 010213 | 02国债(3) | 200,000 | 19,582,000.00 | 2.06 |

注：本基金本报告期末仅持有上述3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 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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,020,375.17 |
| 2 | 应收证券清算款 | 21,065,194.96 |
| 3 | 应收股利 | 229,462.43 |
| 4 | 应收利息 | 2,096,896.45 |
| 5 | 应收申购款 | 124,521.25 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 24,536,450.26 |

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.9.6 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 | 1,249,168,159.77 |
| 本报告期基金总申购份额 | 5,637,143.92 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 216,546,827.99 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,038,258,475.70 |

### §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。

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**

# 长盛沪深300指数证券投资基金（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：招商银行股份有限公司**
**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。

基金托管人招商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 | 长盛沪深300指数(LOF) |
| 基金主代码 | 160807 |
| 交易代码 | 160807 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2010年8月4日 |
| 报告期末基金份额总额 | 206,550,731.02份 |
| 投资目标 | 本基金采取指数化投资，跟踪沪深300指数，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%，且年化跟踪误差小于4%，以实现对基准指数的有效跟踪。 |
| 投资策略 | 本基金采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%，且年化跟踪误差小于4%的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 95%×沪深300指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金是股票指数型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型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 | 招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(2013年4月1日 - 2013年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -921,322.76 |
| 2.本期利润 | -18,372,723.68 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0864 |
| 4.期末基金资产净值 | 152,154,803.28 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.737 |

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。

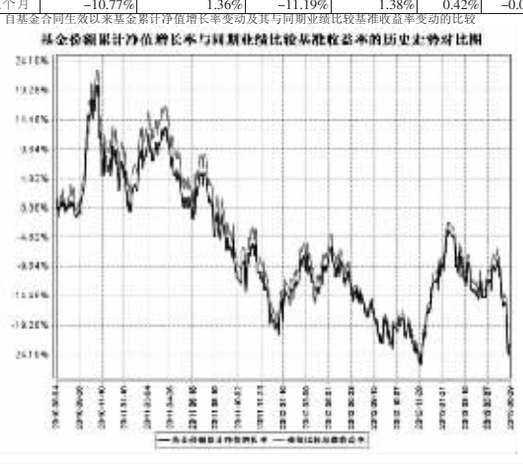
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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 | -10.77% | 1.36% | -11.19% | 1.38% | 0.42% | -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：按照本基金合同规定，本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十三条（二）投资范围、（七）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 | | |
| 冯雨生 | 本基金基金经理，长盛中证100指数证券投资基金基金经理。 | 2011年12月20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指数证券投资基金基金经理，长盛沪深300指数证券投资基金（LOF，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、《长盛沪深300指数证券投资基金（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