长盛中证100指数证券投资基金

【2013】第三季度报告

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10月23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10月22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	1,115,299,637.64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7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	1,761,533.05
2.本期利润	62,826,210.48
3.加权平均基金份额本期利润	0.0566
4.期末基金资产净值	789,540,875.74
5.期末基金份额净值	0.7079

注:1、所还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。

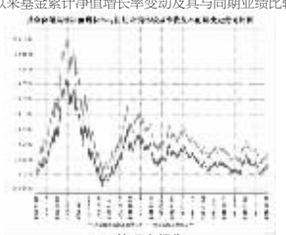
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	8.72%	1.46%	7.17%	1.44%	1.55%	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



§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、《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

3季度股票市场上涨,自贸区、电子商务和文化传媒等概念板块涨幅靠前,而装修园林、锂电池和触摸屏概念板块略有调整。行业上,信息服务、商业贸易和餐饮旅游等行业涨幅靠前,食品饮料、建筑建材和采掘涨幅靠后。风格上,小盘股3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0.7079元,本报告期份额净值增长率为8.72%,同期业绩比较基准增长率为7.17%。本报告期内日均跟踪误差为0.0624%,年度化跟踪误差为0.98%。

§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	744,234,850.61	94.08
	其中:股票	744,234,850.61	94.08
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	-	-
	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	46,140,870.84	5.83
6	其他资产	713,251.68	0.09
7	合计	791,088,973.13	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	56,292,349.88	7.13
C	制造业	194,129,664.09	24.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,615,302.41	2.61
E	建筑业	27,139,632.34	3.44
F	批发和零售业	12,934,861.40	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	17,602,553.59	2.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,684,004.04	1.35
J	金融业	360,340,672.01	45.64
K	房地产业	32,925,765.21	4.17
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	4,802,405.80	0.61
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	6,767,639.84	0.86
	合计	744,234,850.61	94.26

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	600016	民生银行	5,198,279	49,695,547.24	6.29
2	600036	招商银行	4,424,671	48,317,407.32	6.12
3	601166	兴业银行	2,677,421	29,906,792.57	3.79
4	601318	中国平安	784,770	28,016,289.00	3.55
5	600000	浦发银行	2,620,632	26,442,176.88	3.35
6	600837	海通证券	1,905,305	23,835,365.55	3.02
7	000002	万 科A	2,366,585	21,606,921.05	2.74
8	601328	交通银行	4,795,709	20,621,548.70	2.61
9	600030	中信证券	1,627,850	20,006,276.50	2.53
10	000651	格力电器	567,836	15,081,724.16	1.91

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的投资政策

本基金根据本基金合同,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。

5.8.2 报告期末本基金投资的股指期货的交易总额

5.8.3 报告期末本基金投资的股指期货的结算情况

5.8.4 报告期末本基金投资的股指期货的投资政策

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。

5.8.5 报告期末本基金投资的股指期货的投资评价

注:本基金本报告期内未进行股指期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

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	358,472.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	125,110.11
4	应收利息	21,187.65
5	应收申购款	208,481.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	713,251.68

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 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。

5.10.5.2 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:本基金本报告期末积极投资前五名股票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

报告期期初基金份额总额	1,098,915,684.27
报告期期间基金总申购份额	64,446,196.95
减:报告期期间基金总赎回份额	48,062,243.58
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,115,299,637.64

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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
2013年10月23日

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

【2013】第三季度报告

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10月23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10月22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7月1日起至9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
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	216,001,219.56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7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	4,489,043.92
2.本期利润	1,285,953.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057
4.期末基金资产净值	251,894,946.88
5.期末基金份额净值	1.1662

注:1、所还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。

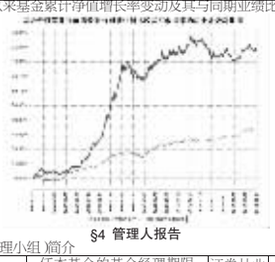
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.53%	0.13%	1.47%	0.12%	-0.94%	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



§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,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,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、《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年第三季度,通胀水平始终保持在3%以下的水平、经济弱复苏态势进一步明确两者难以对债券市场形成明显的指引作用。6月中下旬钱荒过后,央行加强了货币市场流动性管理,资金成本较上半年有所提升,债券市场在波动中走出一波熊市行情。具体来看:利率债方面,利率产品供给压力释放引发的供需失衡导致一级市场招标利率持续超出市场预期,市场悲观情绪日渐浓重,二级市场收益率逐步上行,10年期国债收益率上行50bp左右,突破了4%的敏感点位,并一度达到4.14%高点;信用债方面,短端收益率上行幅度大于长端收益率,低等级上行幅度高于高等级,收益率曲线逐渐扁平化。

货币市场方面,三季度银行间货币市场利率较上半年中枢有所上移,银行间资金面总体保持中性偏紧的态势,以银行间七天回购利率为例,该利率在三季度基本维持在4%左右。各中短期限Shibor利率维持在相对较低水平,例如SHIBOR 2W大体维持在4.44%左右。

纯债资产以外,2013年第三季度A股呈现震荡上行的态势。受正股震荡上行的行情带动,股性较强的转债在三季度总体呈现不断上升的走势。

(二)报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金始终控制配置节奏,择机把握利率债的投资机会,品种上以短久期的中高等级信用债为主,提升组合流动性。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,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,本基金份额净值为1.1662元,本报告期份额净值增长率为0.53%,同期业绩比较基准增长率为1.47%。

§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	9,894,395.70	2.19
	其中:股票	9,894,395.70	2.19
2	固定收益投资	372,571,778.75	82.40
	其中:债券	372,571,778.75	82.40
	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	33,143,974.60	7.33
6	其他资产	36,548,954.47	8.08
7	合计	452,159,103.52	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	8,586,668.55	3.41
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	1,307,727.15	0.52
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	9,894,395.70	3.93

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	600479	千金药业	399,974	5,279,656.80	2.10
2	300181	佐力药业	165,765	3,307,011.75	1.31
3	600763	通策医疗	39,955	1,307,727.15	0.52

注:本基金本报告期末仅持有上述三支股票。

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	11,254,398.00	4.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,142,000.00	15.54
	其中:政策性金融债	39,142,000.00	15.54
4	企业债券	263,521,923.46	104.62
5	企业短期融资券	19,915,000.00	7.91
6	中期票据	9,848,000.00	3.91
7	可转债	28,890,457.29	11.47
8	其他	-	-
9	合计	372,571,778.75	147.91

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	19,702,000.00	7.82
2	110233	11国开33	200,000	19,440,000.00	7.72
3	122995	08合建投	149,700	15,474,489.00	6.14
4	110015	石化转债	144,580	14,152,936.20	5.62
5	122757	11丹东债	120,000	12,453,600.00	4.94

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国债期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 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。

5.9 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,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	351,512.24
2	应收证券清算款	27,510,475.64
3	应收股利	-
4	应收利息	8,683,383.44
5	应收申购款	3,583.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,548,954.47

5.9.4 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	14,152,936.20	5.62
2	113002	工行转债	6,400,432.50	2.54
3	110017	中海转债	4,619,000.00	1.83
4	113003	重工转债	1,220,544.00	0.48
5	110023	民生转债	1,090,901.10	0.43
6	110022	同仁转债	668,250.00	0.27
7	110018	国电转债	612,881.80	0.24

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

报告期期初基金份额总额	229,733,302.48
报告期期间基金总申购份额	5,221,033.57
减:报告期期间基金总赎回份额	18,953,116.49
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	216,001,219.56

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

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。

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10月23日

长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金

【2013】第三季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2013年10月23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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年10月22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	长盛同祥泛资源股票
基金主代码	080008
交易代码	080008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年10月26日
报告期末基金份额总额	47,426,174.72份
投资目标	将灵活投资于具有泛资源禀赋的上市公司股票,分享中国泛资源经济发展的长期效益,力争为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势,运用科学严谨、规范化的资产配置方法,灵活配置国内具有泛资源禀赋的上市公司股票,谋求基金资产的长期稳定增长。
业绩比较基准	沪深300指数×70%+中证综合债券指数×30%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,预期风险和收益高于混合型基金,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	中国建设银行股份有限公司

§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7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-1,327,002.76
2.本期利润	5,573,678.41
3.加权平均基金份额本期利润	0.1102
4.期末基金资产净值	46,534,669.56
5.期末基金份额净值	0.981

注:1、所还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	12.11%	1.31%	6.43%	1.00%	5.68%	0.31%

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