长盛同禧信用增利债券型证券投资基金

【2014】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:2014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2014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2014年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同禧信用增利债券	
基金主代码	080009	
交易代码	080009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年12月6日	
报告期末基金份额总额	65,909,540.73份	
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上,积极主动调整投资组合,追求基金资产的长期稳定增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。	
投资策略	本基金通过对宏观经济形势、货币政策意图、证券市场政策导向、投资人行为、公司基本面和偿债能力等因素进行深入研究和分析,执行自上而下的债券资产期限配置与自下而上不同市场、期限品种选择相结合的组合动态构建过程。在有效控制风险和保持资产流动性的前提下,力求获取较高的超额收益。在债券类资产配置上,本基金通过积极投资配置以信用债为主的相对收益率较高的各类债券,并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会,以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上,通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票,来获取股票市场的积极收益。此外,本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。	
业绩比较基准	40%×中证国债指数收益率+60%×中证企业债指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均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	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	长盛同禧信用增利债券A	长盛同禧信用增利债券C
下属两级基金的交易代码	080009	080010
报告期末下属两级基金的份额总额	38,104,962.21份	27,804,578.52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4月1日 - 2014年6月30日)	
	长盛同禧信用增利债券A	长盛同禧信用增利债券C
1.本期已实现收益	-171,308.42	-145,683.93
2.本期利润	1,380,603.12	966,064.24
3.加权平均基金份额本期利润	0.0340	0.0321
4.期末基金资产净值	37,480,251.04	26,980,496.77
5.期末基金份额净值	0.984	0.970

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

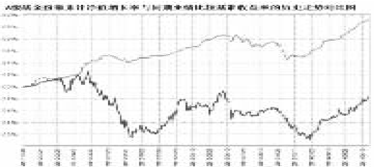
长盛同禧信用增利债券A

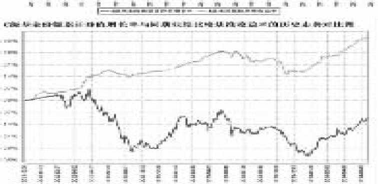
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.69%	0.20%	2.96%	0.06%	0.73%	0.14%

长盛同禧信用增利债券C

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	3.41%	0.19%	2.96%	0.06%	0.45%	0.13%

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。建仓期结束时,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。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		
贾志敏	本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理,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,长盛货币市场基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金(本基金)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。

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4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

二季度,随着稳增长政策的逐步实施,经济基本面出现企稳迹象,但总体仍相对疲弱,通胀水平处于相对低位,定向放松的货币政策及宽松的资金面驱动债券市场走出一波牛市行情。利率债方面,收益率明显下行,其中长端收益率下行幅度大于短端收益率。信用债方面,收益率曲线整体下行,其中低评级债券收益率下行幅度小于中高评级债券,主要是受信用风险事件频发及交易所高风险债券质押回购标准变动等不利影响所致。

货币市场方面,受央行公开市场操作趋于温和及定向宽松的货币政策影响,市场流动性保持相对宽松局面,各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率均保持在较低水平。

纯债资产以外,2014年二季度A股市场总体处于弱市格局。4月初,受流动性好于预期及相关政策影响,权益市场呈现短暂的反弹;随后,受新股发行重启及上市公司季度业绩表现不佳等因素影响,市场尤其是创业板相关股票大跌。5月下旬以来,随着稳增长政策的密集出台,加之新股发行数量的明确,权益市场开始呈现反弹走势。受正股反弹行情影响,可转债在二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

在报告期内,本基金始终控制配置节奏,根据市场变动调整组合久期,优化持仓结构,保持组合流动性。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,调整权益资产占比,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,长盛同禧信用增利债券A的基金份额净值为0.984元,本报告期份额净值增长率为3.69%,同期业绩比较基准增长率为2.96%。

截止报告期末,长盛同禧信用增利债券C的基金份额净值为0.970元,本报告期份额净值增长率为3.41%,同期业绩比较基准增长率为2.96%。

§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	2,193,315.67	2.57
	其中:股票	2,193,315.67	2.57
2	固定收益投资	72,347,021.11	84.73
	其中:债券	72,347,021.11	84.73
	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	2,990,210.50	3.50
7	其他资产	7,858,528.52	9.20
8	合计	85,389,075.80	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	2,187,215.67	3.39
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	6,100.00	0.01
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	2,193,315.67	3.40

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	000748	长城信息	63,901	1,448,635.67	2.25
2	002118	紫鑫药业	51,000	721,650.00	1.12
3	603369	今世缘	1,000	16,930.00	0.03
4	002727	一心堂	500	6,100.00	0.01

注:本基金本报告期末仅持有上述4只股票。

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	501,500.00	0.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	68,360,888.71	106.05
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,484,632.40	5.41
8	其他	-	-
9	合计	72,347,021.11	112.23

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	112172	13普邦债	59,500	5,831,000.00	9.05
2	122703	12鞍城投	50,000	5,235,000.00	8.12
3	112077	12化机债	50,000	5,040,000.00	7.82
4	112138	12苏宁01	50,000	4,810,000.00	7.46
5	122727	12东胜债	45,000	4,612,050.00	7.15

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国债期货交易情况说明
5.9.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.9.2 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。
5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.10 投资组合报告附注

5.10.1吉林紫鑫药业股份有限公司(以下简称"公司"或"紫鑫药业")于2011年10月19日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(稽查总队调查通字11223号)。因公司涉嫌证券违法违规行为,中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")稽查总队决定对公司立案稽查。详细情况请见公司2011年10月21日发布的《关于中国证监会对公司立案稽查的公告》。 2014年2月21日,公司收到中国证监会《行政处罚决定书》[2014]24号,现将《行政处罚决定书》的内容公告如下:依据《中华人民共和国证券法》(以下简称"《证券法》")的有关规定,中国证监会对紫鑫药业信息披露违法违规行为进行了立案调查、审理,并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利。当事人紫鑫药业、郭春生、曹恩辉、祖春香、殷金龙、李飞、方勇、韩明、徐吉峰未提出陈述、申辩意见,未要求听证。本案现已调查、审理终结。

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,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	7,331.93
2	应收证券清算款	6,293,688.62
3	应收股利	-
4	应收利息	1,542,842.49
5	应收申购款	14,665.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,858,528.52

5.10.4 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	113003	重工转债	1,703,400.00	2.64
2	110015	石化转债	1,619,550.00	2.51

5.10.5 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	603369	今世缘	16,930.00	0.03	新股锁定
2	002727	一心堂	6,100.00	0.01	新股锁定

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

项目	长盛同禧信用增利债券A	长盛同禧信用增利债券C
报告期期初基金份额总额	41,617,181.93	32,704,325.21
报告期期间基金总申购份额	444,800.03	191,610.73
减:报告期期间基金总赎回份额	3,957,019.75	5,091,357.42
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	38,104,962.21	27,804,578.52

§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、《长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛同禧信用增利债券型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛同禧信用增利债券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。
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7月18日

长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

【2014】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:2014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2014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2014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)(场内简称:长盛同智)
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	1,921,750,737.74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(2014年4月1日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	-53,813,912.06
2.本期利润	-23,211,858.51
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0119
4.期末基金资产净值	1,480,534,305.97
5.期末基金份额净值	0.7704

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2014年6月30日。

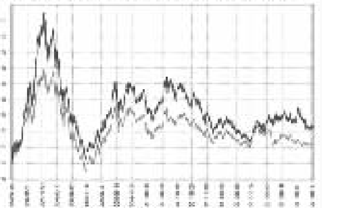
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-1.50%	0.79%	0.97%	0.57%	-2.47%	0.22%

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,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,长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理,社保组合组合经理,公司总经理助理。	2012年7月20日	-	16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、长盛动态精选证券投资基金基金经理、长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理,权益投资部总监等职务。现任公司总经理助理,社保组合组合经理,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,长盛城镇化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。

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4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

2014年二季度,市场仍处在宽幅震荡的格局,在经济仍处于弱势运行的格局下,市场主要是跟随政策的各种主题进行炒作,而创业板股票在一季度大幅调整的背景下大幅反弹,同智基金在二季度一直采取了防御的策略,组合保持了大中小盘的均衡配置,在操作上仍不断减持小盘股,增加了大盘蓝筹股的配置。

当前经济与政策的双向博弈是市场关注的焦点,对经济政策的预期以及政策的作用显然市场仍有较大分歧。尽管当前经济走势和政策节奏仍面临较大的不确定性,市场博弈和政策等待的氛围仍非常浓厚,但是我们认为在目前转型降杠杆和改革的大背景下,资本市场仍具备一定的投资机会。一方面目前市场估值水平处于底部区间,另一方面从政府角度看,降杠杆的另外一种途径就是增加权益,而这就需要资本市场的繁荣。在目前房地产市场低迷的情况下,资本市场的繁荣有助于经济的降杠杆和国企改革中混合所有制的发展。资本市场的繁荣对整个存量的盘活有重大的意义。因此我们仍将积极关注市场可能出现的机会,特别受益于改革红利和与转型相关的高成长股票。

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0.7704元,本报告期份额净值增长率为-1.50%,同期本基金业绩比较基准收益率为0.97%。

§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	1,058,250,758.59	71.08
	其中:股票	1,058,250,758.59	71.08
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	243,400,662.60	16.35
	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	185,423,266.92	12.45
7	其他资产	1,732,348.30	0.12
8	合计	1,488,807,036.41	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	7,035,182.28	0.48
B	采矿业	17,566,884.90	1.19
C	制造业	391,052,569.65	26.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	30,050,000.00	2.03
F	批发和零售业	49,690,442.14	3.36
G	交通运输、仓储和邮政业	6,774,605.48	0.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,787,358.27	6.13
J	金融业	406,848,863.25	27.48
K	房地产业	14,879,821.44	1.01
L	租赁和商务服务业	43,565,031.18	2.94
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	1,058,250,758.59	71.48

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	600050	中国联通	22,198,959	71,702,637.57	4.84
2	601166	兴业银行	4,466,528	44,799,275.84	3.03
3	600138	中青旅	2,000,231	43,565,031.18	2.94
4	601299	中国北车	8,651,426	39,277,474.04	2.65
5	000001	平安银行	3,950,221	39,146,690.11	2.64
6	002154	报喜鸟	6,633,682	38,409,018.78	2.59
7	601766	中国南车	8,480,141	38,160,634.50	2.58
8	600016	民生银行	5,923,014	36,781,916.94	2.48
9	600036	招商银行	3,292,454	33,714,728.96	2.28
10	000768	中航飞机	3,163,576	33,312,455.28	2.25

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
本基金本报告期末无股指期货投资。
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
本基金本报告期末无国债期货投资。
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
本基金本报告期末无国债期货投资。
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	1,591,200.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	108,631.30
5	应收申购款	2,268.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.08
8	其他	-
9	合计	1,732,348.30

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	1,980,673,976.23
报告期期间基金总申购份额	1,265,594.55
减:报告期期间基金总赎回份额	60,188,833.04
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	1,921,750,737.74

§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、中国证券监督管理委员会关于核准同智证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复;
2、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;
3、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;
4、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)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
2014年7月18日

长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

(原同益证券投资基金)

【2014】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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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。

根据2014年3月17日收到的中国证监会基金监管部《关于同益证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》(基金部函[2014]150号),自2014年4月4日起《同益证券投资基金基金合同》失效且《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。同益证券投资基金转型为契约型开放式,其投资目标、理念、范围和策略调整,同时更名为"长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)"。

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4月4日(基金合同生效日)起至6月30日止。(注:同益证券投资基金报告期自2014年4月1日起至2014年4月3日止。)

§2 基金产品概况

转型后:

基金简称	长盛同益成长回报混合(LOF)(场内简称:长盛同益)
基金主代码	160812
交易代码	160812
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月4日
报告期末基金份额总额	1,787,621,340.43份
投资目标	通过自上而下筛选增长预期良好或景气复苏的行业,结合挖掘目标行业的上市公司基本面,自下而上精选个股,为投资者实现资产长期增值,力争获得绝对回报。
投资策略	本基金将通过深入分析上述指标与因素,动态调整基金资产在股票、股指期货、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。 股票投资策略上,本基金将充分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,采用定性和定量相结合的方式,以深入的基本面研究为基础,结合数据挖掘技术,密切跟踪市场景气变化,挖掘具有快速成长预期、且估值相对较低的个股进行投资,并通过对股票投资机会的精细操作,审慎选择投资时机,力争获取超额回报。本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。 本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货的投资。利用股指期货流动性好,交易成本低等特点,在市场向下带动净值走低时,通过股指期货快速降低投资组合的仓位,从而调整投资组合的风险暴露,避免市场的系统性风险,改善组合的风险收益特性;并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时,通过股指期货快速提高投资组合的仓位,从而提高基金资产收益。本基金的权证投资是以权证的市场价值分析为基础,配以权证定价模型寻求其合理估值水平,以主动式的科学投资管理为手段,充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。
业绩比较基准	50%*沪深300指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,属于较高风险、较高收益的证券投资基金,通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金,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	中国工商银行股份有限公司

转型前:

基金简称	长盛同益封闭(场内简称:基金同益)
基金主代码	184690
交易代码	184690
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年4月8日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
投资目标	本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	根据国家宏观经济环境决定投资的总体策略;根据货币政策、利率走势决定本基金的债券投资比例;根据地区及行业发展的状况决定行业投资战略;根据对上市公司研究选择所要投资的股票;根据对证券市场走势的研究作为投资择时参考。
业绩比较基准	无
风险收益特征	较高风险,较高预期收益。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工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	转型后
	报告期(2014年4月4日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	6,029,490.00
2.本期利润	7,310,768.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.0041
4.期末基金资产净值	1,793,752,070.39
5.期末基金份额净值	1.003

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。

3.1 主要财务指标

主要财务指标	转型前
	报告期(2014年4月1日 - 2014年4月3日)
1.本期已实现收益	-1,297,450.85
2.本期利润	6,789,228.06
3.加权平均基金份额本期利润	0.0034
4.期末基金资产净值	2,000,570,623.25
5.期末基金份额净值	1.0003

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4月3日。

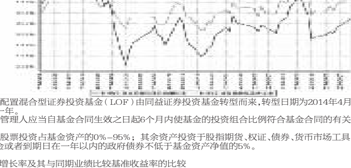
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现(转型后)

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
2014年4月4日至2014年6月30日	0.36%	0.58%	1.45%	0.44%	-1.09%	0.14%

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、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)由同益证券投资基金转型而来,转型日期为2014年4月4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6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。.

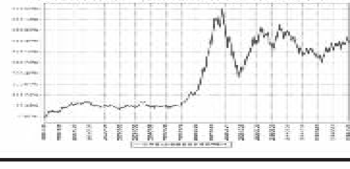
3、本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的0%-95%; 其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具;权证投资占基金资产净值的0%-3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

3.2 基金净值表现(转型前)

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
2014年4月1日至2014年4月3日	0.34%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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:本基金未规定业绩比较基准,无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (转型前)

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		
张锦灿	本基金基金经理,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2012年11月20日	2014年4月3日	9年	男,1982年1月出生,中国国籍。北京大学光华管理学院金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员,银华基金管理有限公司研究员、研究主管、基金经理助理。2012年9月加入长盛基金管理有限公司,现任同益证券投资基金(本基金)基金经理,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛高端装备制造灵活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。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 (转型后)

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		
张锦灿	本基金基金经理,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2014年4月4日	-	9年	男,1982年1月出生,中国国籍。北京大学光华管理学院金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员,银华基金管理有限公司研究员、研究主管、基金经理助理。2012年9月加入长盛基金管理有限公司,曾任同益证券投资基金基金经理。现任长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(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。

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、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》、《同益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,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4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

2014年二季度,市场仍处于弱势中。4月初,受流动性好于预期及政策影响,市场有波短暂的反弹,但随着新股发行重启,及上市公司业绩公布,市场尤其是创业板相关股票大跌。5月下旬,随着"微刺激"政策连续出台,及新股发行的明确,市场开始反弹。

本基金在报告期处于建仓阶段,自5月中下旬之后,果断加仓,但本着绝对收益的原则,整体仓位并不很高,虽然也受益于市场反弹,但并不充分

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,长盛同益成长回报混合(LOF)份额净值为1.003元,本报告期(2014年4月4日至2014年6月30日)份额净值增长率为0.36%,同期业绩比较基准增长率为1.45%。

截至2014年4月3日,长盛同益封闭份额净值为1.0003元,本报告期(2014年4月1日至2014年4月3日)份额净值增长率为0.34%。

§5 投资组合报告

转型后:

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	764,662,987.12	40.01
	其中:股票	764,662,987.12	40.01
2	固定收益投资	60,198,000.00	3.15
	其中:债券	60,198,000.00	3.15
	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	830,000,000.00	43.43
	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	253,422,255.10	13.26
7	其他资产	2,819,132.19	0.15
8	合计	1,911,102,374.41	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	656,272,377.64	36.59
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	1,339,000.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	9,640,000.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,550,451.09	2.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	50,861,158.39	2.84
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	764,662,987.12	42.63

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	000848	承德露露	3,200,000	63,584,000.00	3.54
2	600690	青岛海尔	4,100,000	60,516,000.00	3.37
3	000748	长城信息	2,499,902	56,672,778.34	3.16
4	601766	中国南车	11,500,000	51,750,000.00	2.89
5	002563	森马服饰	1,900,000	51,585,000.00	2.88
6	600597	光明乳业	2,999,759	48,116,134.36	2.68
7	600104	上汽集团	3,000,000	45,900,000.00	2.56
8	000625	长安汽车	3,400,044	41,854,541.64	2.33
9	600050	中国联通	11,000,000	35,530,000.00	1.98
10	600584	长电科技	4,000,000	35,320,000.00	1.97

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	29,787,000.00	1.66
	其中:政策性金融债	29,787,000.00	1.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,411,000.00	1.70
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	60,198,000.00	3.36

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	1182261	11鲁商MTN1	300,000	30,411,000.00	1.70
2	120246	12国开46	300,000	29,787,000.00	1.66

注:本基金本报告期末仅持有上述2支债券。
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
本基金本报告期末无股指期货投资。
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
本基金本报告期末无国债期货投资。
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
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1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。
5.11.2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	603,963.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,184,625.69
5	应收申购款	295.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,246.94
8	其他	-
9	合计	2,819,132.19

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
注:本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。
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。

转型前:

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	979,722,585.71	48.87
	其中:股票	979,722,585.71	48.87
2	固定收益投资	714,288,500.00	35.63
	其中:债券	714,288,500.00	35.63
	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	108,838,977.51	5.43
7	其他资产	201,858,145.82	10.07
8	合计	2,004,708,209.04	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	6.50	0.00
B	采矿业	4,158,000.00	0.21
C	制造业	786,117,188.20	39.29
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	4,489,577.85	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	888.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,574,500.00	0.18
J	金融业	141,064,251.71	7.05
K	房地产业	39,852,000.00	1.99
L	租赁和商务服务业	466,173.45	0.02
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	979,722,585.71	48.97

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	000848	承德露露	5,950,000	127,032,500.00	6.35
2	000748	长城信息	3,800,000	75,620,000.00	3.78
3	601688	华泰证券	8,999,884	69,479,104.48	3.47
4	600552	方兴科技	3,290,000	65,701,300.00	3.28
5	002563	森马服饰	2,016,401	64,323,191.90	3.22
6	600690	青岛海尔	3,899,916	62,398,656.00	3.12
7	601299	中国北车	11,509,890	55,362,570.90	2.77
8	600983	合肥三洋	3,900,000	53,625,000.00	2.68
9	600584	长电科技	6,200,000	49,662,000.00	2.48
10	600837	海通证券	5,214,557	48,964,690.23	2.45

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	59,334,000.00	2.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	448,520,000.00	22.42
	其中:政策性金融债	448,520,000.00	22.42
4	企业债券	105,508,500.00	5.27
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	90,804,000.00	4.54
7	可转债	10,122,000.00	0.51
8	其他	-	-
9	合计	714,288,500.00	35.70

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	110224	11国开24	1,000,000	100,010,000.00	5.00
2	098087	09中铝业债1	900,000	90,405,000.00	4.52
3	120246	12国开46	800,000	78,472,000.00	3.92
4	110257	11国开57	700,000	69,797,000.00	3.49
5	0982040	09沪电力MTN2	600,000	60,468,000.00	3.02

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
本基金本报告期末无股指期货投资。
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
本基金本报告期末无国债期货投资。
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
本基金本报告期末无国债期货投资。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1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。
5.11.2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	1,721,737.54
2	应收证券清算款	185,345,210.07
3	应收股利	-
4	应收利息	14,791,198.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	201,858,145.82

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
注:本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。
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

基金合同生效日(2014年4月4日)基金份额总额	2,000,000,000.00
报告期期初基金份额总额	-
报告期期间基金总申购份额	686,754,621.79
减:报告期期间基金总赎回份额	900,776,023.36
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	1,642,742.00
报告期期末基金份额总额	1,787,621,340.43

注:基金管理人以2014年5月14日作为基金份额折算基准日,对折算基准日登记在册的由原基金同益转型所得的本基金基金份额进行折算与变更登记。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况(转型后)

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	28,000,079.00
报告期期间买入/申购总份额	22,999.00
报告期期间卖出/赎回总份额	28,023,078.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

注:基金管理人以2014年5月14日作为基金份额折算基准日,对折算基准日登记在册的由原基金同益转型所得的本基金基金份额进行折算与变更登记。折算后,本基金管理人持有的基金份额调整为22,999.00份。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细(转型后)

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	赎回	2014年6月5日	18,014,864.00	17,853,090.52	0.50%
2	赎回	2014年6月26日	10,008,214.00	9,908,382.07	0.50%
合计			28,023,078.00	27,761,472.59	

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况(转型前)

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	28,000,079.00
报告期期间买入/申购总份额	-
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	28,000,079.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.40

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细(转型前)
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、《同益证券投资基金基金合同》;
3、《同益证券投资基金托管协议》;
4、《同益证券投资基金招募说明书》;
5、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;
6、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;
7、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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
2014年7月18日