长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	长盛同瑞中证200分级(场内简称:长盛同瑞)		
基金主代码	160808		
交易代码	160808		
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	40,385,682.90份		
投资目标	本基金运用指数化投资方式,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现对中证200指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金采用完全复制法,按照成份股在中证200指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证200指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%-95%,其中投资于中证200指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%-10%(其中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5%)。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。		
业绩比较基准	中证200指数收益率×95%+一年期银行定期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为完全复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属三级基金简称	长盛同瑞A(场内简称:同瑞A)	长盛同瑞B(场内简称:同瑞B)	长盛同瑞中证200分级(场内简称:长盛同瑞)
下属三级基金交易代码	150064	150065	160808
下属三级基金报告期末基金份额总额	1,385,406.00份	2,078,109.00份	36,922,167.90份
下属三级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定	高风险、高预期收益	较高风险、较高预期收益

§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	-62,144.05
2.本期利润	501,289.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0113
4.期末基金资产净值	38,267,253.18
5.期末基金份额净值	0.948

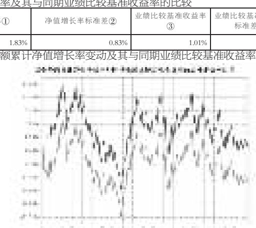
注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、所列数据截止到2014年6月30日。
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	1.83%	0.83%	1.01%	0.87%	0.82%	-0.04%

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



§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		
王超	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,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理。	2011年12月6日	-	7年	男,1981年9月出生,中国国籍。中央财经大学硕士,金融风险管理师(FRM)。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,从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金(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,长盛同辉深证100等权重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。

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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内,我们运用数量化执行跟踪指数策略,尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响,将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.948元,本报告期份额净值增长率为1.83%,同期业绩比较基准收益率为1.01%。报告期内,本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.11%,控制在0.35%之内;年化跟踪误差为2.17%,控制在4%之内。

§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	36,913,077.56	93.90
	其中:股票	36,913,077.56	93.90
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	-	-
	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	2,356,611.09	5.99
7	其他资产	42,065.81	0.11
8	合计	39,311,754.46	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	295,976.27	0.77
B	采矿业	1,960,908.34	5.12
C	制造业	17,283,564.08	45.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,633,450.07	4.27
E	建筑业	855,375.48	2.24
F	批发和零售业	1,970,086.36	5.15
G	交通运输、仓储和邮政业	997,799.06	2.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,560,430.55	6.69
J	金融业	2,739,162.30	7.16
K	房地产业	1,928,496.77	5.04
L	租赁和商务服务业	927,946.10	2.42
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	510,472.37	1.33
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	846,198.55	2.21
S	综合	383,431.99	1.00
	合计	34,893,298.29	91.18

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	77,910.54	0.20
B	采掘业	87,170.03	0.23
C	制造业	1,323,367.12	3.46
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	339,902.36	0.89
J	金融业	191,429.22	0.50
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	2,019,779.27	5.28

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	600383	金地集团	90,444	804,047.16	2.10
2	600089	特变电工	63,850	542,086.50	1.42
3	600109	国金证券	25,183	500,386.21	1.31
4	600100	同方股份	54,479	485,407.89	1.27
5	600196	复星医药	23,077	465,924.63	1.22
6	000725	京东方A	204,340	443,417.80	1.16
7	600739	辽宁成大	27,378	416,966.94	1.09
8	000100	TCL 集团	170,203	388,062.84	1.01
9	600703	三安光电	16,139	378,136.77	0.99
10	600352	浙江龙盛	22,928	370,287.20	0.97

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

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	002597	金禾实业	78,000	1,031,940.00	2.70
2	600637	百视通	10,612	339,902.36	0.89
3	600761	安徽合力	20,000	196,800.00	0.51
4	601901	方正证券	35,254	191,429.22	0.50
5	002069	獐子岛	5,573	77,910.54	0.20

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	9,763.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,659.51
5	应收申购款	395.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.07
8	其他	-
9	合计	42,065.81

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
5.11.5.1 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不存在流通受限情况。
5.11.5.2 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

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	600637	百视通	339,902.36	0.89	筹划重大事项停牌

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

项目	长盛同瑞A	长盛同瑞B	长盛同瑞中证200分级
报告期期初基金份额总额	1,486,224.00	2,229,336.00	39,190,430.87
报告期期间基金总申购份额	-	-	43,715,030.63
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	46,235,338.60
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-100,818.00	-151,227.00	252,045.00
报告期期末基金份额总额	1,385,406.00	2,078,109.00	36,922,167.90

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§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
(一)关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金的批复;
(二)《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金合同》;
(三)《长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金托管协议》;
(四)《长盛同瑞中证200指数分级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
2014年7月18日

长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金

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	长盛同鑫二号保本混合
基金主代码	080015
交易代码	080015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月10日
报告期末基金份额总额	444,588,630.84份
投资目标	本基金采用投资组合保险策略,在严格控制风险和保证本金安全的基础上,实现组合资产的稳定增长和保本期间收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略(CPPI)和基于期权的组合保险策略(OBPI)。其中主要通过CPPI策略动态调整稳健资产与收益资产的投资比例,以确保在保本期到期时本基金价值不低于事先设定的某一目标价值,从而实现基金资产在保本基础上的增值目的。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种。未持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额,不享受保本担保。
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
基金保证人	安徽省信用担保集团有限公司

§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	3,031,529.28
2.本期利润	16,179,934.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0341
4.期末基金资产净值	468,029,612.83
5.期末基金份额净值	1.053

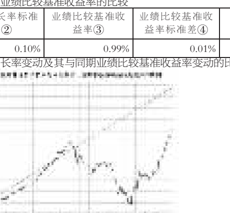
注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、所列数据截止到2014年6月30日。
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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	3.44%	0.10%	0.99%	0.01%	2.45%	0.09%

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: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六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十四部分(二)投资范围、(八)投资禁止行为与限制的有关约定。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		
蔡宾	本基金基金经理,长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理,公司总经理助理,社保组合组合经理,固定收益部总监。	2012年7月10日	-	10年	男,1978年11月出生,中国国籍。毕业于中央财经大学,获硕士学位,CFA(特许金融分析师)。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究员、社保组合助理,投资经理,长盛积极配置债券基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理等职务。现任公司总经理助理,固定收益部总监,社保组合组合经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛同鑫行业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。

4.2 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

二季度,债券市场总体呈现牛市格局,疲弱的经济基本面、定向放松的货币政策以及宽松的资金面共同驱动本轮上涨行情。从不同品种的市场表现看,利率债收益率在经历了去年下半年的大幅攀升后,出现了明显回落。信用债呈现出明显的分化趋势,其中城投债由于背靠政府信用,受到市场追捧;但受违约风险上升、信托产品刚性兑付打破以及交易所高风险债券质押回购标准改变的负面影响,低等级信用债特别是交易所低等级公司债收益率则出现了明显上升。

报告期内,本基金坚持稳健操作思路,继续采用久期匹配策略,并规避高风险债券的信用风险。

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1.053元,本报告期份额净值增长率为3.44%,同期业绩比较基准增长率为0.99%。

§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	18,895,083.60	2.61
	其中:股票	18,895,083.60	2.61
2	固定收益投资	677,568,232.20	93.59
	其中:债券	677,568,232.20	93.59
	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	9,495,651.37	1.31
7	其他资产	18,025,269.58	2.49
8	合计	723,984,236.75	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	8,815,083.60	1.88
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	6,460,000.00	1.38
J	金融业	3,620,000.00	0.77
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	18,895,083.60	4.04

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	2,000,000	6,460,000.00	1.38
2	600000	浦发银行	400,000	3,620,000.00	0.77
3	601766	中国南车	700,000	3,150,000.00	0.67
4	600660	福耀玻璃	350,129	2,941,083.60	0.63
5	601299	中国北车	600,000	2,724,000.00	0.58

注:本基金本报告期末仅持有上述5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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,049,200.00	3.22
	其中:政策性金融债	15,049,200.00	3.22
4	企业债券	622,526,032.20	133.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	39,993,000.00	8.54
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	677,568,232.20	144.77

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	122117	11闽高速	341,000	34,509,200.00	7.37
2	088027	08嘉城投债	300,000	30,885,000.00	6.60
3	122596	12沪城开	305,000	30,835,500.00	6.59
4	122200	12晋兰花	310,010	30,783,993.00	6.58
5	122230	12沪海立	300,000	29,790,000.00	6.36

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	47,198.49
2	应收证券清算款	970,438.24
3	应收股利	-
4	应收利息	17,006,642.47
5	应收申购款	990.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,025,269.58

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	506,451,242.09
报告期期间基金总申购份额	214,046.70
减:报告期期间基金总赎回份额	62,076,657.95
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	444,588,630.84

§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、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛同鑫二号保本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。
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

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金

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。

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定由长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来。长盛同鑫保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可【2011】519号文核准,每个保本周期为三年,第一个保本周期自2011年5月24日开始至2014年5月24日(含)到期,鉴于2014年5月24日至5月25日为非工作日,因此第一个保本周期到期日顺延至下一工作日,即2014年5月26日。根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,在保本周期届满后,长盛同鑫保本混合型证券投资基金变更为"长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金",变更后基金的投资及基金费率等按照《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。就前述基金变更事项,本基金管理人已按照相关法律法规及本基金基金合同约定履行相关备案手续。

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5月27日(基金合同生效日)起至6月30日止(注:长盛同鑫保本混合型证券投资基金报告期自2014年4月1日起至2014年5月26日止)。

§2 基金产品概况

转型后:

基金简称	长盛同鑫行业混合
基金主代码	080007
交易代码	080007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月27日
报告期末基金份额总额	196,779,756.42份
投资目标	积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会,在控制风险的前提下,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	(1)本基金在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上,把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化,挖掘预期具有良好增长前景的优势行业,以谋求行业配置的超额收益。(2)在资产配置层面,本基金管理人对宏观经济的经济周期进行预测,在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断,确定基金资产在各类别资产间的分配比例。具体操作中,采用经济周期资产配置模型,通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析,对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测,然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。(3)在行业配置层面,通过宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响,得出各行业的相对投资价值与投资时机,据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业,把握行业景气轮换带来的投资机会;(4)在股票选择层面,本基金综合运用长盛行业股票研究分析方法和其它投资分析工具,采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合,前述优势行业中股票优先入选。
业绩比较基准	60%*沪深300指数+40%*中证全债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金、高于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	中国银行股份有限公司

转型前:

基金简称	长盛同鑫保本混合
基金主代码	080007
交易代码	080007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月24日
报告期末基金份额总额	351,679,073.44份
投资目标	依据本基金的保证合同,本基金通过运用投资组合保险策略,在严格控制风险和保证本金安全的基础上,力争在本基金保本周期结束时,实现基金资产的收益增长。
投资策略	本基金投资策略突出强调配置的科学性与纪律性,通过严格金融工程手段有效控制风险,保证实现投资期中的稳定收益,并通过有效地资产配置和保本投资策略以保障基金资产本金的安全。 本基金将按照恒定比例组合保险机制(CPPI)将资产配置于安全资产与风险资产,用投资于固定收益类证券的现金净流入来冲抵风险资产组合潜在的最大亏损,并通过投资股票等风险资产来获得资本利得。
业绩比较基准	3年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种。未持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额,不享受保本担保。
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
基金保证人	安徽省信用担保集团有限公司

§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5月27日 - 2014年6月30日)
1.本期已实现收益	1,160,424.41
2.本期利润	1,881,874.44
3.加权平均基金份额本期利润	0.0082
4.期末基金资产净值	208,848,893.50
5.期末基金份额净值	1.061

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5月26日)
1.本期已实现收益	5,361,667.76
2.本期利润	4,031,917.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0068
4.期末基金资产净值	370,035,450.40
5.期末基金份额净值	1.052

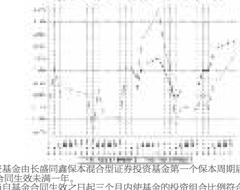
注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、所列数据截止到2014年5月26日。
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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5月27日至2014年6月30日	0.86%	0.15%	0.68%	0.45%	0.18%	-0.30%

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、长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金由长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来,变更日期为2014年5月27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三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末仍处于建仓期。
3、本基金的投资组合比例为:股票、权证等权益类资产占基金资产的40%-95%;其中,持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;债券、货币市场工具(包括一年以内的短期国债、回购协议等)、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的0%-40%,其中基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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	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1日至2014年5月26日	0.57%	0.05%	0.64%	0.01%	-0.07%	0.04%

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

§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		
蔡宾	本基金基金经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理,公司总经理助理,社保组合组合经理,固定收益部总监。	2011年5月24日	2014年5月26日	10年	男,1978年11月出生,中国国籍。毕业于中央财经大学,获硕士学位,CFA(特许金融分析师)。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究员、社保组合助理,投资经理,长盛积极配置债券基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理等职务。现任公司总经理助理,固定收益部总监,社保组合组合经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛同鑫二号保本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		
蔡宾	本基金基金经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理,公司总经理助理,社保组合组合经理,固定收益部总监。	2014年5月27日	-	10年	男,1978年11月出生,中国国籍。毕业于中央财经大学,获硕士学位,CFA(特许金融分析师)。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究员、社保组合助理,投资经理,长盛积极配置债券基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理等职务。现任公司总经理助理,固定收益部总监,社保组合组合经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理,长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金(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、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》、《长盛同鑫行业配置混合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,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2季度,债券市场总体呈现牛市格局,疲弱的经济基本面、定向放松的货币政策以及宽松的资金面共同驱动本轮上涨行情。从不同品种的市场表现看,利率债收益率在经历了去年下半年的大幅攀升后,出现了明显回落。信用债则呈现出明显的分化趋势,其中城投债由于背靠政府信用,受到市场追捧;但受违约风险上升、信托产品刚性兑付打破以及交易所高风险债券质押回购标准改变的负面影响,低等级信用债特别是交易所低等级公司债收益率则出现了明显上升。

报告期内,本基金坚持稳健操作思路,久期匹配策略在保本期内始终得到贯彻,完成了保本基金周期,并为转换进入行业配置型基金做了相应的准备。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,长盛同鑫行业混合份额净值为1.061元,本报告期(2014年5月27日至2014年6月30日)份额净值增长率为0.86%,同期业绩比较基准增长率为0.68%。

截至2014年5月26日,长盛同鑫保本混合份额净值为1.052元,本报告期(2014年4月1日至2014年5月26日)份额净值增长率为0.57%,同期业绩比较基准增长率为0.64%。

§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	38,935,873.00	18.18
	其中:股票	38,935,873.00	18.18
2	固定收益投资	81,687,602.33	38.14
	其中:债券	81,687,602.33	38.14
	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	90,706,868.49	42.35
7	其他资产	2,843,557.37	1.33
8	合计	214,173,901.19	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	21,317,873.00	10.21
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	9,690,000.00	4.64
J	金融业	7,928,000.00	3.80
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	38,935,873.00	18.64

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	600050	中国联通	3,000,000	9,690,000.00	4.64
2	000001	平安银行	800,000	7,928,000.00	3.80
3	002056	横店东磁	200,000	3,892,000.00	1.86
4	601766	中国南车	829,194	3,731,373.00	1.79
5	600460	士兰微	500,000	2,960,000.00	1.42
6	601299	中国北车	400,000	1,816,000.00	0.87
7	600660	福耀玻璃	200,000	1,680,000.00	0.80
8	600276	恒瑞医药	50,000	1,658,000.00	0.79
9	002025	航天电器	100,000	1,569,000.00	0.75
10	300155	安居宝	50,000	1,105,000.00	0.53

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	10,002,000.00	4.79
	其中:政策性金融债	10,002,000.00	4.79
4	企业债券	49,149,052.33	23.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,120,000.00	4.85
7	可转债	12,416,550.00	5.95
8	其他	-	-
9	合计	81,687,602.33	39.11

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	110015	石化转债	115,000	12,416,550.00	5.95
2	1182229	11津药MTN2	100,000	10,120,000.00	4.85
3	130236	13国开36	100,000	10,002,000.00	4.79
4	122947	09合建投	99,510	9,951,000.00	4.76
5	122029	09万通债	93,070	9,358,188.50	4.48

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	151,615.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,689,662.65
5	应收申购款	2,279.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,843,557.37

5.11.4 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	12,416,550.00	5.95

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。

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	10,226,242.26	2.19
	其中:股票	10,226,242.26	2.19
2	固定收益投资	101,798,724.00	21.85
	其中:债券	101,798,724.00	21.85
	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	351,065,039.14	75.34
7	其他资产	2,866,935.91	0.62
8	合计	465,956,941.31	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	10,226,242.26	2.76
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	10,226,242.26	2.76

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	601766	中国南车	829,194	3,557,242.26	0.96
2	601299	中国北车	400,000	1,784,000.00	0.48
3	600660	福耀玻璃	200,000	1,654,000.00	0.45
4	002025	航天电器	100,000	1,449,000.00	0.39
5	000418	小天鹅A	100,000	915,000.00	0.25
6	000887	中鼎股份	100,000	867,000.00	0.23

注:本基金本报告期末(2014年5月26日)仅有上述6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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,006,000.00	2.70
	其中:政策性金融债	10,006,000.00	2.70
4	企业债券	66,111,724.00	17.87
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,114,000.00	2.73
7	可转债	15,567,000.00	4.21
8	其他	-	-
9	合计	101,798,724.00	27.51

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	110015	石化转债	150,000	15,567,000.00	4.21
2	1182229	11津药MTN2	100,000	10,114,000.00	2.73
3	122029	09万通债	100,000	10,070,000.00	2.72
4	112042	11东控01	100,000	10,060,000.00	2.72
5	112054	11鄂能债	100,000	10,045,000.00	2.71

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	154,395.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,712,540.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,866,935.91

5.11.4 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	15,567,000.00	4.21

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	000418	小天鹅A	915,000.00	0.25	重大事项

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5月27日)基金份额总额	351,679,073.44
报告期期初基金份额总额	-
报告期期间基金总申购份额	88,881.66
减:报告期期间基金总赎回份额	154,988,198.68
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	196,779,756.42

§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	19,999,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	19,999,000.00
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(%)	-

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	19,999,000.00	21,058,947.00	-
合计			19,999,000.00	21,058,947.00	

§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	-
报告期期间买入/申购总份额	19,999,000.00
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	19,999,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	5.69

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、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金招募说明书》;
5、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》;
6、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金托管协议》;
7、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金招募说明书》;
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