长盛同德主题增长混合型证券投资基金

【2015】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:2015年10月26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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同德主题混合
基金主代码	519039
交易代码	519039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月25日
报告期末基金份额总额	1,382,868,651.50份
投资目标	本基金投资目标是在确定促进中国经济持续增长的主题背景下,挖掘中国经济持续增长的动力之所在,选取具有高成长性和具备持续增长潜力的上市公司,分享中国经济高速增长的成果;在严格控制投资风险的前提下,努力保持基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将沿着全球化、城镇化、消费升级、制度变革四大主题进行大类资产配置;根据企业获利能力、增长能力、资产回报率、资产管理能力等定量指标,结合公司治理结构状况等定性指标对行业内上市公司进行综合评价,动态的寻找行业与个股的最佳结合点。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
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	中国农业银行股份有限公司

注:根据2014年8月8日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》(证监会令第104号,以下简称《运作办法》)第三十条第一项规定"百分之八十以上的基金资产投资于股票的,为股票基金",根据该规定股票型证券投资基金的股票资产投资比例下限需由60%上调至80%。如果不召开持有人大会更改合位比例,则需要基金更名为混合型基金。据此,本基金的名称由"长盛同德主题增长股票型证券投资基金"变更为"长盛同德主题增长混合型证券投资基金",变更日期为2015年7月23日。

§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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-5,299,322.28
2.本期利润	-383,423,245.14
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2661
4.期末基金资产净值	1,880,444,585.65
5.期末基金份额净值	1.3598

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2015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	-15.55%	2.05%	-22.79%	2.67%	7.24%	-0.62%

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:本基金由同德证券投资基金转型而来,转型日为2007年10月25日。

§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,长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理,社保组合组合经理,权益投资部总监,公司副总经理。	2014年10月14日	-	17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,公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理,权益投资部总监,社保组合组合经理,现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理,长盛同德主题增长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、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,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

2015年三季度,国内经济延续了上半年的情况。可以预见未来相当长的一段时期,中国经济将处于底部调整期,经济结构将随着改革进程发生巨大的变化。在CPI没有快速上行的情况下,流动性整体将继续宽松。货币方面的风险在于中国外汇储备的流失,但美国加息暂缓,部分的减少了外资流出。三季度的海外市场反而波动剧烈,油价继续位于底部区域,美国加息预期落空,9月的非农数据进一步降低了年内加息的可能性,大宗商品价格下行和大众汽车事件对欧洲股市影响巨大。中期看,美、欧的经济波动会持续。TPP协议的初步达成,对中国的负面影响反而在长期,且中国相应有对冲的策略。

基金同德三季度仓位控制较好,操作策略表现明显的防御性。在市场整体行情一致的情况下,仓位控制起了重要作用,基金跑赢沪深300指数近16个百分点、跑赢创业板指数近15个百分点。在配置上偏向大蓝筹,重点配置了银行、大众消费,还选择了新能源、工业4.0相关行业个股,取得了较好的收益。

展望未来,在无风险利率下降和充裕的流动性下,中国经济继续大幅下滑的可能性较小,以筑底稳固为主,在这期间,个股将会表现活跃。

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1.3598元,本报告期份额净值增长率为-15.55%,同期业绩比较基准增长率为-22.79%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§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	1,171,220,575.24	61.93
	其中:股票	1,171,220,575.24	61.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	29,925,164.89	1.58
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	687,566,336.03	36.36
8	其他资产	2,493,912.99	0.13
9	合计	1,891,205,989.15	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	14,971,864.32	0.80
C	制造业	461,484,730.95	24.54
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	113,444,892.10	6.03
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	419,393,780.73	22.30
K	房地产业	99,240,301.44	5.28
L	租赁和商务服务业	62,685,005.70	3.33
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	1,171,220,575.24	62.28

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

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	600036	招商银行	6,288,305	111,743,179.85	5.94
2	600246	万通地产	22,972,292	99,240,301.44	5.28
3	600016	民生银行	10,896,847	92,078,357.15	4.90
4	601398	工商银行	21,038,936	90,888,203.52	4.83
5	601628	中国人寿	3,362,192	85,836,761.76	4.56
6	000858	五粮液	3,874,637	83,924,637.42	4.46
7	600600	青岛啤酒	2,441,332	78,464,410.48	4.17
8	600750	江中药业	1,500,315	68,834,452.20	3.66
9	600998	九州通	4,165,460	66,522,396.20	3.54
10	600138	中青旅	3,118,657	62,685,005.70	3.33

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

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股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,066,726.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	293,737.14
5	应收申购款	103,449.11
6	其他应收款	30,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,493,912.99

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

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	000858	五粮液	83,924,637.42	4.46	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

报告期期初基金份额总额	1,619,033,084.92
报告期期间基金总申购份额	42,555,531.77
减:报告期期间基金总赎回份额	278,719,965.19
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	1,382,868,651.50

§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、中国证券监督管理委员会关于核准同德证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复;

2、《长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛同德主题增长股票型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛同德主题增长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。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

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
2015年10月26日

长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金

【2015】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:2015年10月26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2015年10月23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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同辉深100等权重分级
场内简称	长盛同辉
基金主代码	160809
交易代码	160809
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月13日
报告期末基金份额总额	77,380,729.62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,以实现对深证100等权重指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用完全复制法,按照成份股在深证100等权重指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合,跟踪深证100等权重指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 当预期成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪深证100等权重指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×深证100等权重指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	从基金资产整体运作来看,本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 从投资者具体持有的基金份额来看,在分级运作期内,由于基金收益分配的安排,长盛同辉深100等权重A份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额;长盛同辉深100等权重B份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。
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

下属分级基金简称	长盛同辉深100等权重A	长盛同辉深100等权重B	长盛同辉深100等权重分级
下属分级场内简称	同辉100A	同辉100B	长盛同辉
下属分级基金交易代码	150108	150109	160809
下属分级基金报告期末基金份额总额	20,899,303.00份	20,899,303.00份	35,582,123.62份
下属分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(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-20,222,759.82
2.本期利润	-73,646,450.73
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4187
4.期末基金资产净值	74,421,621.48
5.期末基金份额净值	0.962

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2015年9月30日。

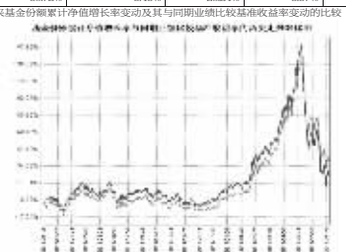
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-36.72%	3.43%	-28.24%	3.37%	-8.48%	0.06%

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3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截止报告日,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十六条"(二)投资范围"、"(八)投资限制"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		
王超	本基金基金经理,长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理,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,长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理,长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理。	2013年1月5日	-	8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基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金(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,长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理,长盛量化红利策略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,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

1、报告期内行情回顾

2015年三季度,经济基本面继续呈现疲弱态势,通胀整体仍处于较低水平。货币政策方面,8月26日起央行下调了金融机构人民币存款准备金率和人民币存、贷款基准利率,资金面呈现持续宽松局面。同时,受新股发行暂停等因素影响,打新资金大规模由权益市场流入债券市场,各债券品种收益率均大幅下行,债市走出一波牛市行情。利率债方面,长端收益率下行幅度较大,收益率曲线平坦化下行;信用债方面,收益率曲线整体下行,中高评级债券信用利差已下行至历史低位,而低评级债券信用利差仍处于历史较高水平,主要是受信用风险事件频发等因素影响所致。

货币市场方面,受央行公开市场释放流动性及降准降息等宽松货币政策影响,市场流动性保持宽松局面,各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率维持在较低水平。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金始终控制资产配置节奏,在信用风险可控的前提下重点配置中短期信用债,保持组合流动性,积极参与利率品种的交易性机会,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1.143元,本报告期份额净值增长率为3.44%,业绩比较基准收益率为1.12%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	69,496,596.05	88.05
	其中:债券	69,496,596.05	88.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,458,508.94	8.18
8	其他资产	2,977,837.56	3.77
9	合计	78,932,942.55	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	764,652.00	1.03
C	制造业	38,244,946.20	51.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	374,169.00	0.50
E	建筑业	376,090.00	0.51
F	批发和零售业	1,635,170.20	2.20
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	9,972,302.63	13.40
J	金融业	5,181,788.47	6.96
K	房地产业	4,141,208.14	5.56
L	租赁和商务服务业	1,637,247.00	2.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,982,396.34	2.66
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	2,001,726.02	2.69
S	综合	557,489.37	0.75
	合计	66,869,185.37	89.85

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	1,206,850.14	1.62
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,420,560.54	1.91
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	2,627,410.68	3.53

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	000917	电广传媒	152,100	2,935,530.00	3.94
2	000024	招商地产	67,570	1,925,069.30	2.59
3	000839	中信国安	90,708	1,294,403.16	1.74
4	000876	新希望	91,100	1,243,515.00	1.67
5	002353	杰瑞股份	52,881	1,195,110.60	1.61
6	000778	新兴铸管	185,247	1,192,990.68	1.60
7	000630	铜陵有色	505,835	1,168,478.85	1.57
8	000858	五粮液	52,800	1,143,648.00	1.54
9	000878	云南铜业	110,384	1,093,905.44	1.47
10	300027	华谊兄弟	33,229	1,050,368.69	1.41

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	002106	莱宝高科	113,554	1,420,560.54	1.91
2	002069	獐子岛	109,614	1,206,850.14	1.62

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金跟踪的标的指数为深证100等权重指数,配置了深证100等权重指数成分股獐子岛。根据獐子岛公司公告,公司于2014年12月4日收到中国证券监督管理委员会大连监管局下发的《行政监管措施决定书》(【2014】5号,【2014】6号),分别为《关于对獐子岛集团股份有限公司采取责令改正监管措施的决定》(【2014】5号,以下简称"《责令改正的决定》")、《关于对獐子岛集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》(【2014】6号,以下简称"《警示函》")。其中,"《责令改正的决定》"涉及:1,部分事项决策程序不规范;2,内部控制制度执行不规范;"《警示函》"涉及:1,海域收购决策存在瑕疵;2,深海底播缺乏充分论证;3,公司深海底播信息披露及风险揭示问题。本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

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。

5.11.2

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	130,209.91
2	应收证券清算款	2,846,609.52
3	应收股利	-
4	应收利息	1,018.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,977,837.56

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

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	000917	电广传媒	2,935,530.00	3.94	重大事项停牌
2	000839	中信国安	1,294,403.16	1.74	重大事项停牌
3	000876	新希望	1,243,515.00	1.67	重大事项停牌
4	002353	杰瑞股份	1,195,110.60	1.61	重大事项停牌
5	000630	铜陵有色	1,168,478.85	1.57	重大事项停牌
6	000858	五粮液	1,143,648.00	1.54	重大事项停牌
7	300027	华谊兄弟	1,050,368.69	1.41	重大事项停牌

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	002106	莱宝高科	1,420,560.54	1.91	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	长盛同辉深100等权重A	长盛同辉深100等权重B	长盛同辉深100等权重分级
报告期期初基金份额总额	88,741,185.00	88,741,186.00	14,765,747.03
报告期期间基金总申购份额	-	-	85,300,506.96
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	96,101,386.88
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-67,841