同盛证券投资基金

【2013】第四季度报告

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1月22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1月21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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同盛封闭(场内简称:基金同盛)
基金主代码	184699
交易代码	184699
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年11月5日
报告期末基金份额总额	3,000,000,000份
投资目标	本基金属于成长价值复合型基金,主要投资于业绩能够持续高速增长的成长型上市公司和市场价值被低估的价值型上市公司,利用成长型和价值型两种投资方法的复合效果更好的分散和控制风险,实现基金资产的稳定增长。
投资策略	本基金将根据市场发展情况,确定在一段时间内市场发展的总体趋势,并在此基础上确定股票和国债的配置比例以及股票投资中成长型投资和价值型投资的配置比例。并分别选取成长型特征最明显的股票和价值型特征最明显的股票进行组合投资。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无
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10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	32,846,364.49
2.本期利润	-96,173,871.56
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0321
4.期末基金资产净值	3,350,451,520.18
5.期末基金份额净值	1.1168

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12月31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
过去三个月	-2.79%	2.32%

注:本基金无业绩比较基准收益率,无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

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:1、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。

2、本基金基金合同未规定建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达基金合同投资组合中规定的各项比例。

§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		
侯继雄	本基金基金经理,公司总经理助理、长盛创富资产管理有限公司执行董事、总经理。	2008年8月11日	-	12年	男,1974年5月出生,中国国籍。清华大学博士。历任国泰君安证券研究所研究员、策略部经理。2007年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理,研究部总监等职务。现任公司总经理助理,同盛证券投资基金(本基金)基金经理,兼任长盛创富资产管理有限公司执行董事、总经理。
田间	本基金基金经理。	2013年7月9日	-	5年	女,1978年11月出生,中国国籍。中央财经大学经济学硕士。2008年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任行业研究员,基金经理助理等职务。现任同盛证券投资基金(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、《同盛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

2013年四季度以来,经济数据逐月下滑,出口、消费、投资等数据都有不同程度下滑。流动性重回紧张局面,美国QE退出节奏依然阶段性影响市场对流动性的预期。海外经济中,美国日本持续复苏,欧洲国家温和复苏,新兴经济体加快结构调整。随着在十八届三中全会、中央经济工作会议的先后召开,一定程度上提振了对文化、生态、军事等领域的热度和信心。在经济数据逐月走弱与改革预期的双重作用下,四季度的市场表现为指数的箱体震荡缺少整体机会,和板块的快速轮动缺少趋势性方向,在流动性收紧、IPO重启、业绩低于预期的三重约束下,四季度市场出现了调整,在结构性机会的集中度和强度表现上远远弱于三季度。基金同盛在四季度重点加仓了医药、汽车、军工、家电,减持了银行、食品饮料等,一定程度上分享了市场的结构性上涨,但收益不理想。我们判断,2014年一季度市场很可能呈现先抑后扬的走势,在改革预期下的受益板块仍有空间,同时具备价值投资的蓝筹股和和持续消费属性的行业,值得密切关注和积极布局。

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1.1168元,本报告期份额净值增长率为-2.79%。

§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	2,219,938,432.59	65.64
	其中:股票	2,219,938,432.59	65.64
2	固定收益投资	694,147,000.00	20.52
	其中:债券	694,147,000.00	20.52
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	361,000,000.00	10.67
	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	84,648,706.95	2.50
6	其他资产	22,390,316.64	0.66
7	合计	3,382,124,456.18	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	1,666,920,644.46	49.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	44,305,801.20	1.32
F	批发和零售业	46,650,960.70	1.39
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	273,830,486.26	8.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	64,529,286.20	1.93
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	34,351,239.80	1.03
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	89,350,013.97	2.67
S	综合	-	-
	合计	2,219,938,432.59	66.26

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	002038	双鹭药业	4,249,131	214,793,572.05	6.41
2	600309	万华化学	10,000,000	207,000,000.00	6.18
3	000661	长春高新	1,248,371	135,697,927.70	4.05
4	002508	老板电器	2,499,283	98,671,692.84	2.95
5	000538	云南白药	963,123	98,228,914.77	2.93
6	600690	青岛海尔	4,993,164	97,366,698.00	2.91
7	000895	双汇发展	2,028,350	95,494,718.00	2.85
8	300113	顺网科技	1,500,000	76,905,000.00	2.30
9	600104	上汽集团	4,999,894	70,698,501.16	2.11
10	601098	中南传媒	6,339,913	69,675,643.87	2.08

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	694,147,000.00	20.72
	其中:政策性金融债	694,147,000.00	20.72
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	694,147,000.00	20.72

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	100209	10国开09	1,500,000	148,800,000.00	4.44
2	110251	11国开51	1,000,000	99,440,000.00	2.97
3	130227	13国开27	1,000,000	99,180,000.00	2.96
4	130243	13国开43	800,000	79,440,000.00	2.37
5	090411	09农发11	600,000	59,892,000.00	1.79

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

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 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

本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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	1,145,805.67
2	应收证券清算款	12,483,189.04
3	应收股利	-
4	应收利息	8,761,321.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,390,316.64

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处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

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 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

份额单位:份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	6,000,000
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	6,000,000
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	0.20

6.2 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。

§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、《同盛证券投资基金基金基金合同》;

3、《同盛证券投资基金基金托管协议》;

4、《同盛证券投资基金基金招募说明书》;

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
2014年1月22日

同益证券投资基金

【2013】第四季度报告

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1月22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1月21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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

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	始终如一地奉行"价值投资"的基本原则,并在不同的市场环境以及市场发展变化的不同阶段,灵活运用适合自身运作特点的投资原则、投资理念和投资技巧。在战略资产配置层,寻求现金、债券、股票资产的动态收益、风险最优配置;在战术资产配置层,寻求成长型股票和价值型股票的动态收益、风险最优配置。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无
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	报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-8,240,387.98
2.本期利润	-12,595,403.98
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0063
4.期末基金资产净值	1,981,514,408.59
5.期末基金份额净值	0.9908

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12月31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
过去三个月	-0.63%	2.28%

注:本基金无业绩比较基准收益率,无需进行同期业绩比较基准收益率的比较。

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

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	2012年11月20日	-	8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,现同益证券投资基金(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、《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,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

2013年四季度,市场震荡下跌。受流动性收紧、上市公司三季报业绩低于预期影响自10月下旬开始下跌,创业板跌幅巨大;11月中下旬,恐慌情绪释放后,受三中全会改革预期激励,市场在家电、汽车等业绩、销售较好的低估值行业带领下有所反弹,保险和前期跌幅较大的创业板龙头涨幅也较可观;12月初,随着新股发行重开、监管机构规范影子银行力度加大,和美国QE退出,市场尤其是蓝筹股又产生不小幅度的下跌。

本基金在四季度坚持了"自下而上"的选股思路,整体仓位不高。季度初,由于对市场风险预期不足,仓位弹性偏大,组合发生了不小幅度的调整。三中全会以后,本基金及时加仓,尤其是对低估值蓝筹加仓力度较大,阶段性收益较好。季度末,考虑到流动性问题,及时降低了一些配置型投资,下跌中损失不大。三季度,本基金的表现优于指数。

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0.9908元,本报告期份额净值增长率为-0.63%。

§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	1,317,891,405.30	65.99
	其中:股票	1,317,891,405.30	65.99
2	固定收益投资	577,966,660.00	28.94
	其中:债券	577,966,660.00	28.94
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	59,500,194.25	2.98
	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	27,076,462.63	1.36
6	其他资产	14,608,283.04	0.73
7	合计	1,997,043,005.22	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	6.53	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,137,693,883.23	57.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	28,902,258.24	1.46
F	批发和零售业	32,146,122.80	1.62
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	19,734,825.80	1.00
J	金融业	99,017,108.70	5.00
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	397,200.00	0.02
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	1,317,891,405.30	66.51

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	6,102,036	149,194,780.20	7.53
2	300181	佐力药业	5,102,486	137,767,122.00	6.95
3	600983	合肥三洋	7,200,000	108,216,000.00	5.46
4	600584	长电科技	11,855,497	75,875,180.80	3.83
5	002563	森马服饰	2,347,750	63,130,997.50	3.19
6	002470	金 正 大	2,802,454	59,692,270.20	3.01
7	601601	中国太保	3,199,790	59,292,108.70	2.99
8	000748	长城信息	2,999,969	54,509,436.73	2.75
9	002612	朗姿股份	1,549,991	43,368,748.18	2.19
10	600643	爱建股份	3,500,000	39,725,000.00	2.00

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	9,735,000.00	0.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	445,225,000.00	22.47
	其中:政策性金融债	445,225,000.00	22.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	123,006,660.00	6.21
8	其他	-	-
9	合计	577,966,660.00	29.17

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	110224	11国开24	1,000,000	99,510,000.00	5.02
2	120246	12国开46	800,000	77,312,000.00	3.90
3	110257	11国开57	700,000	69,349,000.00	3.50
4	113005	平安转债	610,160	65,439,660.00	3.30
5	110203	11国开03	600,000	59,976,000.00	3.03

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

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 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

本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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	1,551,116.67
2	应收证券清算款	5,556,375.01
3	应收股利	-
4	应收利息	7,500,791.36
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,608,283.04

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	110023	民生转债	28,959,000.00	1.46
2	110015	石化转债	28,608,000.00	1.44

5.10.5 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。

5.10.6 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 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

6.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

份额单位: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

6.2 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。

§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、《同益证券投资基金基金基金合同》;

3、《同益证券投资基金基金托管协议》;

4、《同益证券投资基金基金招募说明书》;

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
2014年1月22日

长盛中证100指数证券投资基金

【2013】第四季度报告

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1月22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1月21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10月1日起至12月31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	1,083,286,318.93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10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-25,409,553.02
2.本期利润	-30,814,375.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0281
4.期末基金资产净值	736,068,656.59
5.期末基金份额净值	0.6795

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12月31日。

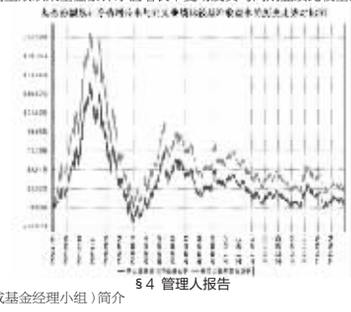
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-4.01%	1.09%	-3.68%	1.08%	-0.33%	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		
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。