

长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金

[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

5.1 重要提示

基金管理人的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性和准确性承担个别及连带责任。

4.4 制作报告期内，本报告书可能存在不能完全公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4.1 报告期内本基金的投资策略和运作分析

四季以来流动性宽松局面没有得到明显缓解，且其持续时间明显超过6月份，市场担忧情绪日益浓厚。同时，伴随商业银行“资产配置”、“拆借”的资产配置行为的明显变化，以及“货币市”环境下二级市场债券、封闭基金的集中开放导致的债券抛售行为，使得货币市场情绪急转直下，收益一路飙升，已突破2011年通胀高点，货币市场短期的高收益吸引资金回流。

基金经理秉承以诚信为原则，勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

报告期间，本基金坚持稳健操作思路，在利率不断上升的市场环境下，严格控制组合久期和仓位，以抵御市场持续调整带来的估值压力，同时，在严格评估信用风险的前提下，在债券收益率高位的市场环境下挑选绩优券，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1.006元，本报告份额净值增长率为-2.04%，同期业绩比较基准增长率为1.02%。

5.2 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 080005

交易代码 080005

基金运作方式 裁约型开放式

基金合同生效日 2013年7月10日

报告期末基金份额总额 567,827,936.65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期间最大的收益。

本基金采用恒定比例保险策略(CPPI)和基于期权的组合保险策略(ORPI)。其主要通过CPPI策略动态调整资产与权益资产的比例，以确保保本期结束时基金净值不低于投资者所设定的某一目标价值，从而实现基金在保本期结束时的增值目的。

业绩比较基准 一年期定期存款税后收益率+5%

风险收益特征 本基金属于证券投资基金中的低风险品种，未持有到到期或转换持有的基金份额以及基金份额持有人在当期申购后即申购或转换持有的基金份额，不享受赎回权。

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

5.3 主要财务指标和基金净值表现

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 2,778,089.05

2.本期利润 -13,008,924.29

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0209

4.期末基金资产净值 571,295,202.62

5.期末基金份额净值 1.006

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将低于所列数字。
2.所列数据截取至2013年12月31日。

3.本期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。

4.2.2 基金净值表现

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4 报告期按照行业分类的债券投资组合

5.4.1 主要财务指标和基金净值表现

5.4.2 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.3 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.4 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.5 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.6 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.7 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.8 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.9 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.10 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.11 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.12 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.13 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.14 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.15 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.16 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.17 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.18 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.19 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.20 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.21 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.22 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.23 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.24 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.25 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.26 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.27 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.28 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.29 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.30 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.31 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.32 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.33 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.34 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.35 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.36 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.37 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.38 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.39 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.40 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.41 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.42 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.43 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.44 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.45 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.46 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.47 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.48 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.49 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.50 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.51 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.52 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.53 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.54 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.55 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.56 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.57 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.58 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.59 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.60 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.61 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.62 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.63 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.64 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.65 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.66 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.67 报告期按行业分类的股票投资组合

5.4.68 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.69 报告期按行业分类的债券投资组合

5.4.70 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

注:本基金报告期末未持有股票。

5.4.71 报告期按行业分类的股票投资组合