

长盛成长价值证券投资基金

[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

重要提示

基金管理人的董事会及监事保证本报告不存在虚假记载、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。投资人投资有风险，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。

本报告期财务数据未经审计。

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

长盛成长价值混合

基金简称

080001

交易代码

080001

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2002年9月18日

报告期末基金份额总额

787,880,691.78份

本基金为平衡型基金，通过管理人的积极管理，在控制风险的前提下挖掘价值、分享成长，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金投资策略为主动性投资，在资产配置方面，股票资产比例为35%~75%，债券资产比例为20%-60%，现金资产比例不超过5%。

业绩比较基准 中信标普A股综合指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%

风险收益特征 本基金属于平衡型基金，在承担适度风险的前提下，获得长期稳定的收益。

基金管理人 长盛基金管理有限公司

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 13,664,093.26

2.本期利润 -3,680,807.98

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0046

4.期末基金份额净值 723,760,542.78

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 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.43% 0.98% -1.79% 0.94% 1.36% 0.04%

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

图:长盛成长价值混合基金2013年10月1日至2013年12月31日净值增长率与业绩比较基准收益率走势图

6.4 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

翟彦东 本基金基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。 2013年7月9日 4年 男,1982年3月出生,中国国籍。中国人民银行研究生部经济学硕士,2009年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任行业研究员,基金经理助理兼债券部、现任长盛成长价值证券投资基金、长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。

刘斌 本基金基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,长盛同智深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理,长盛同智深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理,长盛量化基金投资部总监。 2012年7月20日 2013年11月4日 7年 男,1979年6月出生,中国国籍。中国科学院大学工学硕士,2006年9月加入长盛基金管理有限公司,历任行业研究员、基金经理助理兼债券部、现任长盛量化红利策略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》及其各项实施细则,《长盛成长价值证券投资基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则和管理费收入、严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的情况。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易原则的执行情况

注:本基金本报告期未进行股票买卖操作,不存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 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,公司对旗下所有投资组合,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隔离制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合指令由公司内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、强制开盘价买入交易系统公平交易平台;场外交易,严格遵守相关工作流程,确保交易执行的公平性。

投资决策、监控与分析评价,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、动态监测基金投资交易行为,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现的问题,保障旗下所有投资组合公平交易。

4.4 报告期内本基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.919元,本报告期份额净值增长率为-0.43%,业绩比较基准收益

6.5 开放式基金份额变动

单位:份

报告期初基金份额总额 827,122,076.82

报告期间基金份额变动数 9,787,905.96

减:报告期间基金份额赎回量 49,029,291.62

报告期间基金份额变动份额(份额减少以“-”填列) -

报告期末基金份额总额 787,880,691.78

注:本报告期无大额申购或赎回发生。

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金基本情况

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。

8.8 备查文件目录

1.中国证监会准予基金募集的文件;

2.《长盛成长价值证券投资基金合同》;

3.《长盛成长价值证券投资基金托管协议》;

4.《长盛成长价值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.备查文件存档于基金管理人和/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。在支付客户服务电话:400-888-2666,010-62350088。

投资者对本公司公告如有疑问,可咨询基金管理人长盛基金管理有限公司。

网址: http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司 2014年1月22日

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

重要提示

基金管理人的董事会及监事保证本报告不存在虚假记载、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。投资人投资有风险,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。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

3.本报告期已实现收益指本期利息收入、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 净值增长标准差 业绩比较基准 收益率标准差 ①-③ ②-④

过去三个月 -1.90% 0.11% -2.68% 0.10% 0.78% 0.01%

长盛稳健债券 A

长盛稳健债券 C

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 -7,952,889.67

2.本期利润 -13,206,748.15

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0174

4.期末基金资产净值 581,059,140.79

5.期末基金资产净值 0.983

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 净值增长标准差 业绩比较基准 收益率标准差 ①-③ ②-④

过去三个月 -2.00% 0.12% -2.68% 0.10% 0.68% 0.02%

长盛稳健债券 A

长盛稳健债券 C

5.4 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债券投资明细

序号 债券代码 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 国家债券 481,335,645.73 66.00

2 行政票据 481,535,645.73 66.00

3 固定收益投资 178,708,000.00 24.49

4 资产支持证券 - -

5 金融衍生品投资 - -

6 其他资产 178,708,000.00 24.49

7 合计 44,284,478.76 6.07

5.5 报告期存款和结算备付金合计 25,049,308.86 3.43

5.6 其他资产 729,577,443.35 100.00

5.7 报告期末按行业分类的股票投资组合

代碼 行業類別 公允價值(元) 占基金資產淨值比例(%)

A 农林、牧、渔业 - -

B 采矿业 - -

C 制造业 340,039,994.46 46.98

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

E 建筑业 - -

F 零售业和零售业 13,991,132.28 1.93

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 71,902,044.39 9.93

J 金融业 46,480,774.60 6.42

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 - -