长盛同禧信用增利债券型证券投资基金

【2014】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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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10月24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	长盛同禧信用增利债券
基金主代码	080009
交易代码	080009
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	41,500,570.83份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上,积极主动调整投资组合,追求基金资产的长期稳定增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	本基金通过对宏观经济形势、货币政策意图、证券市场政策导向、投资人行为、公司基本面和盈债能力等因素进行深入研究和分析,执行自上而下的债券资产期限配置与自下而上不同市场、期限品种选择相结合的组合动态构建过程。在有效控制风险和保持资产流动性的前提下,力求获取较高的超额收益。在债券类资产配置上,本基金通过积极投资配置以信用债为主的相对收益率较高的各类债券,并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会,以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上,通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票,来获取股票市场的积极收益。此外,本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。
业绩比较基准	40%×中证国债指数收益率+60%×中证企业债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
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

下属两级基金的基金简称	长盛同禧信用增利债券A	长盛同禧信用增利债券C
下属两级基金的交易代码	080009	080010
报告期末下属两级基金的份额总额	20,784,164.82份	20,716,406.01份

§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7月1日 - 2014年9月30日)	
	长盛同禧信用增利债券A	长盛同禧信用增利债券C
1.本期已实现收益	1,371,932.18	898,193.92
2.本期利润	2,074,762.86	1,408,011.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.0577	0.0558
4.期末基金资产净值	21,708,191.37	21,318,631.57
5.期末基金份额净值	1.044	1.029

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

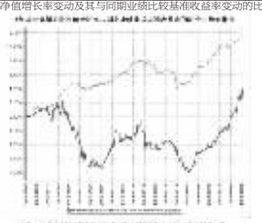
长盛同禧信用增利债券A

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	6.10%	0.28%	1.43%	0.06%	4.67%	0.22%

长盛同禧信用增利债券C

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	6.08%	0.29%	1.43%	0.06%	4.65%	0.23%

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



注:按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6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基金合同第十四条(二)投资范围、(八)投资禁止行为与限制的有关约定。本报告期内,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		
贾志敏	本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理,长盛中信企债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,固定收益部副总监。	2013年2月7日	-	8年	男,1982年3月出生,中国国籍,北京大学经济学硕士,曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作,2012年11月底加入长盛基金管理有限公司,现任固定收益部副总监,长盛货币市场基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。
马文祥	本基金基金经理,长盛中信企债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,固定收益部副总监。	2014年9月10日	-	11年	男,1977年7月出生,中国国籍,清华大学经济管理学院经济学硕士,历任中国农业银行主任科员,工银瑞信企业年金基金经理,工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2007年10月入长盛基金管理有限公司,现任固定收益部副总监,长盛中信企债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券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,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2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年三季度,市场强势反弹,投资者心态从极冷到极热,全市场季度涨幅超过30%的股票接近四成。从行业和主题角度看,军工、农业、小市值、低价股、资产重组个股表现最好,所有行业指数均实现了正收益。

本基金在报告期初期,市场较为恐慌的氛围下,从投资价值角度精选个股,果断加仓,整体保持了较高的仓位,获得了较好的投资收益。

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1.046元,本报告期份额净值增长率为6.10%,同期业绩比较基准增长率为6.08%,同期业绩比较基准增长率为1.43%。

§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	5,944,539.40	12.24
	其中:股票	5,944,539.40	12.24
2	固定收益投资	38,311,614.28	78.87
	其中:债券	38,311,614.28	78.87
	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	3,201,363.17	6.59
7	其他资产	1,118,037.04	2.30
8	合计	48,575,553.89	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	4,170,289.40	9.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,520,000.00	3.53
F	批发和零售业	254,250.00	0.59
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	5,944,539.40	13.82

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	000748	长城信息	63,901	1,878,689.40	4.37
2	002454	松芝股份	100,000	1,593,000.00	3.70
3	601186	中国铁建	200,000	1,046,000.00	2.43
4	601800	中国交建	100,000	474,000.00	1.10
5	600600	青岛啤酒	10,000	391,200.00	0.91
6	600998	九州通	15,000	254,250.00	0.59
7	600686	金龙汽车	15,000	189,900.00	0.44
8	300003	乐普医疗	5,000	117,500.00	0.27

注:本基金本报告期末仅持有上述8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	501,450.00	1.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	33,433,531.70	77.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,376,632.58	10.17
8	其他	-	-
9	合计	38,311,614.28	89.04

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	112077	12化机债	34,950	3,522,960.00	8.19
2	112172	13晋邦债	35,000	3,500,000.00	8.13
3	110027	东方转债	27,670	3,325,657.30	7.73
4	122703	12鞍城投	30,000	3,165,000.00	7.36
5	111052	09经城投	30,000	3,091,500.00	7.19

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国债期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的国债期货投资政策
本基金本报告期内未投资国债期货。
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:本基金本报告期末无国债期货投资。
5.9.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期内未投资国债期货。
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	15,772.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,089,467.91
5	应收申购款	12,796.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,118,037.04

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	110015	石化转债	872,240.00	2.03

5.10.5 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	002454	松芝股份	1,593,000.00	3.70	重大事项停牌

5.10.6 报告期末投资组合情况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	长盛同禧信用增利债券A	长盛同禧信用增利债券C
报告期期初基金份额总额	38,104,962.21	27,804,578.52
报告期期间基金总申购份额	15,858,518.90	3,066,518.18
减:报告期期间基金总赎回份额	33,179,316.29	10,154,690.69
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	20,784,164.82	20,716,406.01

§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、《长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛同禧信用增利债券型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛同禧信用增利债券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10月27日

长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

【2014】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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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10月24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	长盛同益成长回报混合(LOF)
场内简称	长盛同益
基金主代码	160812
交易代码	160812
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月4日
报告期末基金份额总额	1,484,577,983.66份
投资目标	通过自上而下筛选增长预期良好或景气复苏的行业,结合挖掘目标行业的上市公司基本面,自下而上精选个股,为投资者实现资产长期增值,力争获得绝对回报。
投资策略	本基金将通过深入分析上述指标与因素,动态调整基金资产在股票、股指期货、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。 股票投资策略上,本基金将充分发挥基金管理人研究团队和投资团队"自下而上"的主动选股能力,采用定性和定量相结合的方式,以深入的基本面研究为基础,结合数据挖掘技术,密切跟踪市场景气变化,挖掘具有快速成长预期、且估值相对较低的个股进行投资,并通过对股票投资机会的精细操作,审慎选择投资时机,力争获取正回报。本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。 本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货的投资。利用股指期货流动性好、交易成本低等特点,在市场向下带动净值走低时,通过股指期货快速降低投资组合的仓位,从而调整投资组合的风险暴露,避免市场的系统性风险,改善组合的风险收益特性;并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时,通过股指期货快速提高投资组合的仓位,从而提高基金资产收益。本基金的权证投资是以权证的市场价值分析为基础,配以权证定价模型寻求其合理估值水平,以主动式的科学投资管理为手段,充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,追求基金资产稳定的当期收益。
业绩比较基准	50%*沪深300指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,属于较高风险、较高收益的证券投资基金,通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
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(2014年7月1日 - 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	94,498,416.29
2.本期利润	246,577,014.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.1693
4.期末基金资产净值	1,744,334,153.80
5.期末基金份额净值	1.175

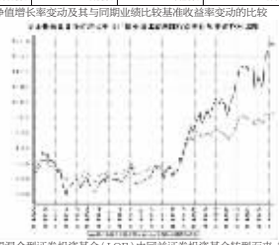
注:1.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.所列数据截止到2014年9月30日。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	17.15%	0.85%	7.26%	0.45%	9.89%	0.40%

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.长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)由同益证券投资基金转型而来,转型日期为2014年4月4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6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金仍处于建仓期。.
3.本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的0%-95%;其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具;权证投资占基金资产净值的0%-3%;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的5%。

§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,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,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2014年4月4日	-	9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,曾任同益证券投资基金基金经理。现任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,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF,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,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2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年三季度,市场强势反弹,投资者心态从极冷到极热,全市场季度涨幅超过30%的股票接近四成。从行业和主题角度看,军工、农业、小市值、低价股、资产重组个股表现最好,所有行业指数均实现了正收益。

本基金在报告期初期,市场较为恐慌的氛围下,从投资价值角度精选个股,果断加仓,整体保持了较高的仓位,获得了较好的投资收益。

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1.175元,本报告期份额净值增长率为17.15%,同期业绩比较基准增长率为7.26%。

§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	1,466,420,380.63	81.65
	其中:股票	1,466,420,380.63	81.65
2	固定收益投资	29,868,000.00	1.66
	其中:债券	29,868,000.00	1.66
	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	138,240,407.36	7.70
	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	149,586,557.21	8.33
7	其他资产	11,926,756.54	0.66
8	合计	1,796,042,101.74	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	80,326,078.50	4.60
B	采矿业	-	-
C	制造业	845,425,507.87	48.47
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	138,286,523.05	7.93
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	91,051,775.11	5.22
J	金融业	250,311,115.30	14.35
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	61,019,380.80	3.50
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	1,466,420,380.63	84.07

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	600597	光明乳业	5,399,920	88,450,689.60	5.07
2	600552	方兴科技	4,599,968	87,445,391.68	5.01
3	601555	东吴证券	8,000,000	82,400,000.00	4.72
4	000748	长城信息	2,799,969	82,319,088.60	4.72
5	600686	金龙汽车	5,200,000	65,832,000.00	3.77
6	600050	中国联通	18,000,031	64,440,110.98	3.69
7	601099	太平洋	6,499,910	63,894,115.30	3.66
8	600690	青岛海尔	4,000,000	63,200,000.00	3.62
9	000848	承德露露	2,800,000	61,544,000.00	3.53
10	000625	长安汽车	4,400,027	60,280,369.90	3.46

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	29,868,000.00	1.71
	其中:政策性金融债	29,868,000.00	1.71
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	29,868,000.00	1.71

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	120246	12国开46	300,000	29,868,000.00	1.71

注:本基金本报告期末仅持有上述1只债券。
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
本基金本报告期内未投资国债期货。
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	1,550,092.30
2	应收证券清算款	9,285,878.04
3	应收股利	-
4	应收利息	1,054,141.35
5	应收申购款	21,521.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,123.06
8	其他	-
9	合计	11,926,756.54

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	600552	方兴科技	87,445,391.68	5.01	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	1,787,621,340.43
报告期期间基金总申购份额	355,801,234.71
减:报告期期间基金总赎回份额	658,844,591.48
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	1,484,577,983.66

§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.中国证监会基金监管部(关于同益证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函)(基金部函[2014]150号)
3.《同益证券投资基金基金合同》;
4.《同益证券投资基金基金托管协议》;
5.《同益证券投资基金招募说明书》;
6.《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;
7.《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)托管协议》;
8.《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》;
9.法律意见书;
10.基金管理人业务资格批件、营业执照;
11.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10月27日

长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

【2014】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:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月27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10月24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