长盛城镇化主题股票型证券投资基金

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	长盛城镇化主题股票
基金主代码	000354
交易代码	000354
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月12日
报告期末基金份额总额	595,527,871.91份
投资目标	本基金主要投资于城镇化主题上市公司股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	(1)本基金将通过分析宏、微观经济指标、市场指标和政策走向等因素，动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。(2)股票投资上，本基金投资于城镇化主题上市公司股票的比例将不低于非现金基金资产的80%。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，从公司基本状况和股票估值两个方面筛选具有长期持续增长能力的公司，组建并动态调整城镇化主题优选股票库，并根据市场波动情况精选个股，进而构建股票投资组合。
业绩比较基准	80%*沪深300指数收益率+20%*中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金产品，风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金，属于高风险、高预期收益的基金产品。
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（2014年7月1日 － 2014年9月30日）
1.本期已实现收益	67,773,995.16
2.本期利润	155,594,643.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.1721
4.期末基金资产净值	667,566,892.91
5.期末基金份额净值	1.121

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。

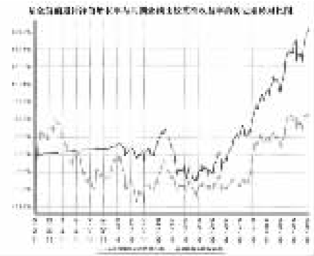
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	17.89%	0.74%	10.81%	0.72%	7.08%	0.02%

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：1、本基金基金合同生效日为2013年11月12日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十二部分"二、投资范围"和"四、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，社保组合组合经理，公司总经理助理。	2013年11月12日	－	16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，权益投资部总监等职务。现任公司总经理助理，社保组合组合经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金（本基金）基金经理。
王克玉	本基金基金经理，长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，权益投资部副总监。	2013年11月12日	－	11年	男，1979年12月出生，中国国籍。上海交通大学硕士。历任元大京华证券上海代表处研究员，天相投资顾问有限公司分析师，国都证券有限公司分析师。2006年7月加入长盛基金管理有限公司，曾任高级行业研究员，同盛证券投资基金基金经理助理，同益证券投资基金基金经理，长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理等职务。现任权益投资部副总监，长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置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，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

三季度毫无疑问是给A 股投资者带来丰厚回报的一个季度。在经过了二季度的小幅波动之后，市场从七月份开始迎来了全面的上涨，中证流通指数上涨20%，上证综指和沪深300指数涨幅分别达到了15.4%和13.2%，而中证500指数涨幅达到25%，市场上涨的主体是中小盘的公司。创业板指数单季度涨幅为9.7%，较为罕见的落后于上涨指数，主要是受到大市值的指数成分股大幅落后于市场的影响。从分行业表现来看，军工行业毫无疑问是三季度的明星，行业指数涨幅达到38%，而众多传统行业，包括煤炭、有色金属、电力、钢铁、化工、建筑、机械、电力设备等季度表现大都在20-30%之间，体现出非常明显的普涨的特征。表现相对落后的行业主要是银行和传媒。

三季度本基金的净值上涨17.89%，表现基本同步于市场整体水平。目前组合的投资方向主要是TMT 、电力设备、新能源、汽车、机械设备等行业，组合的行业比较分散，重仓股持股相对集中。

今年以来宏观经济运行保持比较平稳的状态，在三季度我们看到社会消费仍然能够实现比较稳定的增长，但大宗原材料价格出现非常明显的下跌，传统产业的出清将进入关键时期。随着社会无风险收益率水平的逐渐下降，权益投资的机会从长周期看将逐渐好转。在后期的投资中，除了在TMT、医药、电力设备、机械设备等行业的重点投资外，也会根据国家相关政策的方向，增加部分主题投资的布局，持续改善业绩。

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1.121元，本报告期份额净值增长率为17.89%，同期业绩比较基准收益率为10.81%。

§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	514,638,084.39	75.92
	其中：股票	514,638,084.39	75.92
2	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	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	162,132,103.04	23.92
7	其他资产	1,107,988.97	0.16
8	合计	677,878,176.40	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	10,143,869.35	1.52
C	制造业	385,107,171.57	57.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,535,329.81	2.78
E	建筑业	745,437.51	0.11
F	批发和零售业	13,631,839.90	2.04
G	交通运输、仓储和邮政业	10,221,390.56	1.53
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	67,799,166.02	10.16
J	金融业	11,380.14	0.00
K	房地产业	996,441.87	0.15
L	租赁和商务服务业	630,540.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	6,815,517.66	1.02
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	514,638,084.39	77.09

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	600050	中国联通	13,500,678	48,332,427.24	7.24
2	002056	横店东磁	1,300,322	29,075,199.92	4.36
3	002073	软控股份	2,361,708	29,049,008.40	4.35
4	601369	陕鼓动力	3,986,000	27,583,120.00	4.13
5	601238	广汽集团	2,853,955	24,172,998.85	3.62
6	600875	东方电气	1,621,259	23,508,255.50	3.52
7	000012	南 玻 A	2,600,000	20,488,000.00	3.07
8	601126	四方股份	1,016,716	17,467,180.88	2.62
9	600498	烽火通信	1,024,400	16,185,520.00	2.42
10	002465	海格通信	881,484	15,496,488.72	2.32

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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	174,845.75
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	37,138.96
5	应收申购款	896,004.26
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	1,107,988.97

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	1,202,952,356.28
报告期期间基金总申购份额	305,872,604.19
减:报告期期间基金总赎回份额	913,297,088.56
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	595,527,871.91

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	－
报告期期间买入/申购总份额	20,439,116.38
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	20,439,116.38
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.43

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2014年7月23日	20,439,116.38	20,000,000.00	0.00%
合计			20,439,116.38	20,000,000.00	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（一）中国证监会核准基金募集的文件；
（二）《长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金合同》；
（三）《长盛城镇化主题股票型证券投资基金托管协议》；
（四）《长盛城镇化主题股票型证券投资基金招募说明书》；
（五）法律意见书；
（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；
（七）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

长盛动态精选证券投资基金

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：中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	长盛动态精选混合
基金主代码	510081
交易代码	510081
前端交易代码	510081
后端交易代码	511081
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年5月21日
报告期末基金份额总额	836,696,721.82份
投资目标	本基金通过积极投资于能够充分分享中国经济长期增长的、在各自行业中已经或将要取得领袖地位的50家上市公司股票，在承担适度风险的前提下，追求当期收益和基金资产超过业绩比较基准的长期稳定回报。
投资策略	本基金投资策略上偏重选股能力的发挥，时机的选择放在次要位置。
业绩比较基准	中信标普A股综合指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的适度风险品种，在承担适度风险的前提下，获取长期稳定的收益。
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（2014年7月1日 － 2014年9月30日）
1.本期已实现收益	34,909,219.54
2.本期利润	129,884,387.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.1489
4.期末基金资产净值	996,148,427.54
5.期末基金份额净值	1.1906

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。

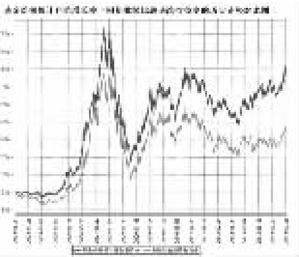
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	14.47%	0.85%	19.32%	0.81%	-4.85%	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



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。截至报告日，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"、"（七）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		
邓永明	本基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理，权益投资部总监。	2008年8月11日	－	15年	男，1971年7月出生，中国国籍。毕业于山西农业大学，获学士学位。曾任大成基金管理有限公司研究员、交易员和基金经理助理。2005年7月底加入长盛基金管理有限公司，曾任基金同益基金经理助理，同德证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，权益投资部副总监等职务。现任权益投资部总监，长盛动态精选证券投资基金（本基金）基金经理，长盛同德主题增长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，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

宏观经济在7月份小幅反弹后，8、9月份重回疲软。在微刺激不能持续的状况下，经济缺少内生动力，经济短期需忍受阵痛，但长期则期待改革和转型所形成的新的力量。不过，目前经济增速可能会继续下滑，货币政策将相对宽松，这有利于资金流入股市。在叠加资金流入和改革转型预期下，三季度市场处于可投资阶段，军工和并购重组等题材股表现活跃。

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1.1906元，本报告期份额净值增长率为14.47%，同期业绩比较基准增长率为19.32% 。

§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	857,765,016.35	85.57
	其中：股票	857,765,016.35	85.57
2	固定收益投资	19,270,000.00	1.92
	其中：债券	19,270,000.00	1.92
	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	124,386,062.83	12.41
7	其他资产	1,019,993.12	0.10
8	合计	1,002,441,072.30	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	9,137,012.20	0.92
B	采矿业	－	－
C	制造业	522,848,918.04	52.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,526,363.74	1.86
E	建筑业	10,576,454.50	1.06
F	批发和零售业	68,207,749.55	6.85
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	103,194,669.08	10.36
J	金融业	85,556,169.70	8.59
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	13,719,044.54	1.38
N	水利、环境和公共设施管理业	25,998,635.00	2.61
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	857,765,016.35	86.11

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	300122	智飞生物	2,500,385	72,786,207.35	7.31
2	300290	荣科科技	2,021,704	44,517,922.08	4.47
3	300303	聚飞光电	1,700,754	34,576,328.82	3.47
4	300003	乐普医疗	1,309,785	30,779,947.50	3.09
5	600363	联创光电	2,803,726	30,196,129.02	3.03
6	600030	中信证券	2,257,294	30,067,156.08	3.02
7	600837	海通证券	2,700,707	27,871,296.24	2.80
8	600122	宏图高科	4,500,000	27,000,000.00	2.71
9	300187	永清环保	799,958	25,998,635.00	2.61
10	002454	松芝股份	1,500,612	23,904,749.16	2.40

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	19,270,000.00	1.93
2	央行票据	－	－
3	金融债券	－	－
	其中：政策性金融债	－	－
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	19,270,000.00	1.93

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	010213	02国债⒀	200,000	19,270,000.00	1.93

注：本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

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

本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	868,775.22
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	69,223.81
5	应收申购款	81,994.09
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	1,019,993.12

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处于转股期的可转换债券。

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	300122	智飞生物	72,786,207.35	7.31	重大事项停牌
2	002454	松芝股份	23,904,749.16	2.40	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	888,580,660.37
报告期期间基金总申购份额	33,834,735.66
减:报告期期间基金总赎回份额	85,718,674.21
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	836,696,721.82

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	－
报告期期间买入/申购总份额	19,346,786.70
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	19,346,786.70
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.31

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2014年7月23日	19,346,786.70	20,000,000.00	0.20%
合计			19,346,786.70	20,000,000.00	

§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、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》；
3、《长盛动态精选证券投资基金托管协议》；
4、《长盛动态精选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
2014年10月27日

长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金

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	长盛高端装备混合
基金主代码	000534
交易代码	000534
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月25日
报告期末基金份额总额	431,561,698.61份
投资目标	本基金的投资目标在于把握中国高端装备制造业发展带来的投资机会，分享高端装备制造相关上市公司的持续投资收益，在严格控制投资风险的基础上，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	在大类资产配置中，本基金将主要考虑：(1)宏观经济指标，包括GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口数据变化等；(2)微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期等；(3)市场指标，包括股票市场与债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金的供求关系及其变化等；(4)政策因素，包括财政政策、货币政策、产业政策及其它与证券市场密切相关的各种政策。 本基金的股票投资策略，分为股票池初步构建、细分领域配置和个股精选三个方面。 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。对于股指期货，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。
业绩比较基准	50%×上证高端装备60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	44,357,521.59
2.本期利润	75,762,106.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.2546
4.期末基金资产净值	559,830,864.96
5.期末基金份额净值	1.297

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	25.07%	1.05%	16.96%	0.62%	8.11%	0.43%

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：1、本基金合同生效日为2014年3月25日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截止报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十二部分"二、投资范围"和"四、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		
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，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。	2014年3月25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（本基金）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)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，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，从主题机会角度判断，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1.297元，本报告期份额净值增长率为25.07%，业绩比较基准收益率为16.96%。

§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	386,101,584.49	64.80
	其中：股票	386,101,584.49	64.80
2	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	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	108,780,403.17	18.26
	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	75,067,325.76	12.60
7	其他资产	25,868,508.91	4.34
8	合计	595,817,822.33	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	302,188,202.49	53.98
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	26,100,000.00	4.66
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	57,813,382.00	10.33
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	386,101,584.49	68.97

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	1,100,008	32,340,235.20	5.78
2	300159	新研股份	2,450,070	28,420,812.00	5.08
3	002037	久联发展	1,699,970	27,335,517.60	4.88
4	300007	汉威电子	800,421	27,054,229.80	4.83
5	300022	吉峰农机	3,000,000	26,100,000.00	4.66
6	000997	新 大 陆	969,950	25,742,473.00	4.60
7	600184	光电股份	820,000	24,870,600.00	4.44
8	600990	四创电子	439,923	19,765,740.39	3.53
9	600169	太原重工	4,399,934	18,875,716.86	3.37
10	002338	奥普光电	350,000	18,861,500.00	3.37

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

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

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	276,806.34
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	－
4	应收利息	39,191.22
5	应收申购款	25,552,511.35
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	25,868,508.91

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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	410,492,147.05
报告期期间基金总申购份额	448,790,037.38
减:报告期期间基金总赎回份额	427,720,485.82
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	431,561,698.61

§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、《长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
3、《长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
4、《长盛高端装备制造灵活配置混合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