

长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金 2014年第3季度报告

2014年9月30日

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	长盛同鑫二号保本混合
基金主代码	080015
交易代码	080015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 7 月 10 日
报告期末基金份额总额	363,974,990.42 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间收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略（CPPI）和基于期权的组合保险策略（OBPI）。其中主要通过 CPPI 策略动态调整稳健资产与收益资产的投资比例，以确保在保本到期时本基金价值不低于事先设定的某一目标价值，从而实现基金资产在保本基础上的增值目的。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种。未持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额，不享受保本担保。
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

§ 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	13,388,183.00
2. 本期利润	16,383,543.42
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0412
4. 期末基金资产净值	398,374,292.59
5. 期末基金份额净值	1.095

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。

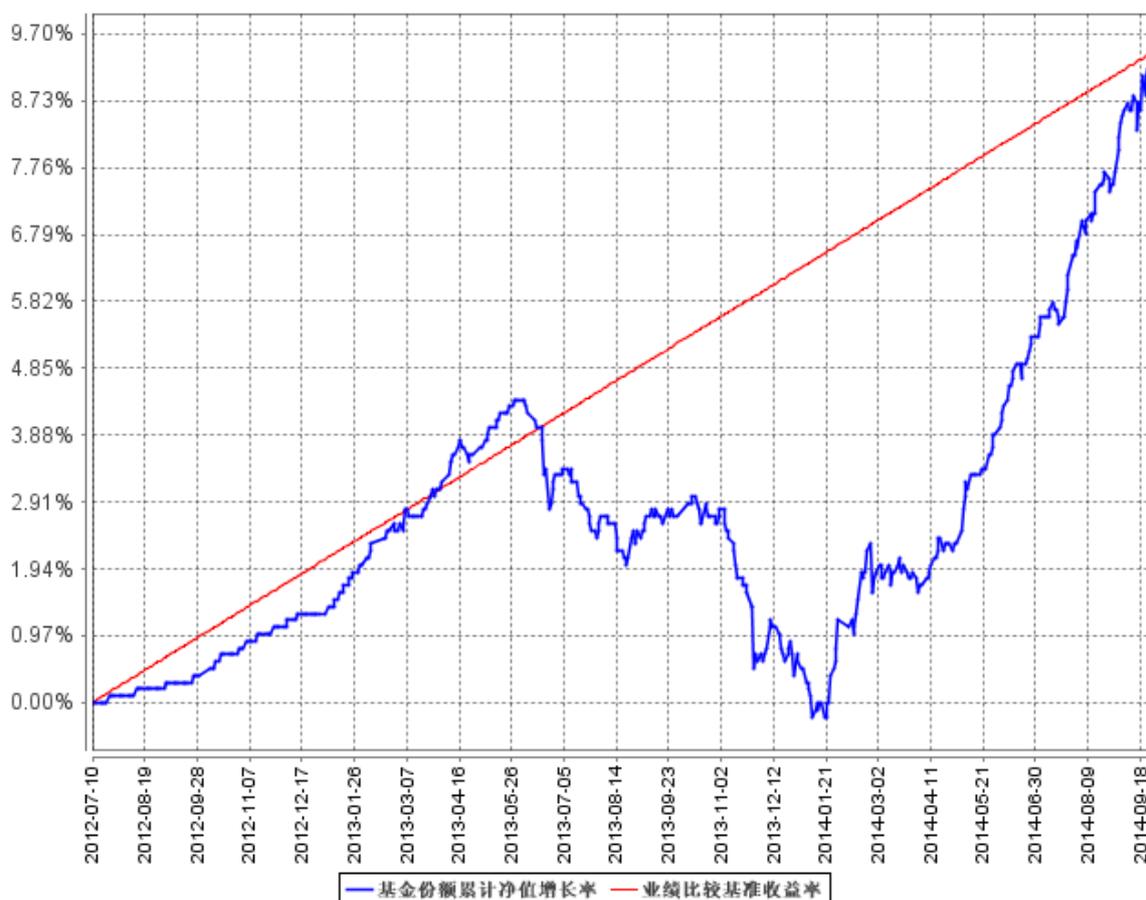
3.2 基金净值表现

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	3.99%	0.15%	1.07%	0.01%	2.92%	0.14%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本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。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四部分（二）投资范围、（八）投资禁止行为与限制的有关约定。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		
蔡宾	本基金基金经理，公司总经理助理，社保组合组合经理，固定收益部总监。	2012年7月10日	-	10年	男，1978年11月出生，中国国籍。毕业于中央财经大学，获硕士学位，CFA(特许金融分析师)。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理，投

					资经理,长盛积极配置债券基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理等职务。现任公司总经理助理,固定收益部总监,社保组合组合经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金(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、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，债券市场先抑后扬，整体走出牛市行情。7 月中上旬，受资金面趋紧、经济金融数据超预期向好等因素影响，做空情绪集中释放，债券收益率快速上行，10 年国开债收益率上行近 40bp。自 7 月下旬至 9 月末，债券市场呈现牛市格局，债券收益率持续下行，10 年国开债收益率下行 75bp 左右。其推动因素是多方面的，疲弱的经济金融数据、国务院十项措施降低社会融资成本、央行对五大行 5000 亿定向支持并降低公开市场操作利率 20bp、以及总体宽松的资金环境，均对债市走牛形成利好支撑。受经济企稳、利率环境宽松的影响，股票市场也出现了近年来少见的上涨行情，沪深 300 指数本季度涨幅达到 13.2%

报告期内，本基金坚持稳健操作思路，债券资产继续采用久期匹配策略，并规避高风险债券的信用风险，同时根据在安全垫可控的基础上，适度提高了股票等权益资产的投资比例。

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 1.095 元，本报告期份额净值增长率为 3.99%，同期业绩比较基准增长率为 1.07%。

§ 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	41,425,276.36	6.20
	其中：股票	41,425,276.36	6.20
2	固定收益投资	586,547,076.60	87.78

	其中：债券	586,547,076.60	87.78
	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	12,362,551.29	1.85
7	其他资产	27,835,776.00	4.17
8	合计	668,170,680.25	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	32,620,366.47	8.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,215,601.76	0.31
F	批发和零售业	-	-
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	6,527,308.13	1.64
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	1,062,000.00	0.27
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	41,425,276.36	10.40

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	600587	新华医疗	149,879	5,606,973.39	1.41
2	600073	上海梅林	500,364	4,638,374.28	1.16
3	002242	九阳股份	400,000	4,460,000.00	1.12
4	600177	雅戈尔	400,000	3,312,000.00	0.83
5	002063	远光软件	149,943	3,135,308.13	0.79
6	002230	科大讯飞	80,000	2,504,000.00	0.63
7	600498	烽火通信	150,000	2,370,000.00	0.59
8	600329	中新药业	142,120	2,163,066.40	0.54
9	600309	万华化学	100,000	1,731,000.00	0.43
10	002250	联化科技	99,978	1,579,652.40	0.40

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,028,900.00	3.77
	其中：政策性金融债	15,028,900.00	3.77
4	企业债券	531,275,176.60	133.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,243,000.00	10.10
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	586,547,076.60	147.24

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	122117	11 闽高速	320,000	32,352,000.00	8.12
2	122596	12 沪城开	305,000	30,927,000.00	7.76
3	122200	12 晋兰花	310,010	30,814,994.00	7.74
4	122230	12 沪海立	300,000	29,880,000.00	7.50
5	122225	12 一拖 01	300,000	29,820,000.00	7.49

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	81,524.64
2	应收证券清算款	9,842,247.49
3	应收股利	-
4	应收利息	17,908,933.57
5	应收申购款	3,070.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	27,835,776.00
---	----	---------------

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	444,588,630.84
报告期期间基金总申购份额	292,408.95
减：报告期期间基金总赎回份额	80,906,049.37
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	363,974,990.42

§ 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、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同鑫二号保本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和/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