长盛同丰分级债券型证券投资基金之同丰B基金份额上市交易公告书

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
注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2013年2月26日
公告日期:2013年2月21日

一、重要声明与提示

长盛同丰分级债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)之同丰B份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号《上市交易公告书的内容与格式》》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,本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、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人中国银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、深圳证券交易所(以下简称“深交所”)对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本上市交易公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2012年11月29日《证券时报》、深圳证券交易所网站《www.szse.cn》以及长盛基金管理有限公司网站《www.csfunds.com.cn》上的《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“本合同”)和《长盛同丰分级债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)。

二、基金概览

1、基金名称:长盛同丰分级债券型证券投资基金
2、基金类型:债券型
3、基金运作方式:契约型。本基金基金合同生效之日起18个月内,同丰A基金合同生效之日起每满6个月开放一次,同丰B封闭运作并上市交易;本基金基金合同生效后18个月届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。
4、基金份额分级:本基金基金合同生效之日起18个月内,本基金的基金份额划分为同丰A、同丰B两级份额,所募集的基金资产合并运作。同丰A根据基金合同的规定获取约定收益;本基金在扣除同丰A的本金及应计收益后的全部剩余资产归同丰B享有,亏损以同丰B的资产净值为限由同丰B承担。同丰A、同丰B的份额配比原则上不超过7:3。
5、本基金的存续期为不定期。
6、本基金的发售:同丰A、同丰B分别通过各自发售机构的销售网点独立进行公开发售。其中,同丰A通过基金管理人直销网点及基金代销机构的代销网点公开发售,同丰A份额登记在注册登记系统;同丰B通过场外、场内两种方式公开发售,场外发售的同丰B登记在注册登记系统,场内发售的同丰B登记在证券登记结算系统。
7、同丰A的申购与赎回:同丰A在基金合同生效后每满6个月开放一次,接受投资者在场外的申购与赎回。同丰A的开放日为自基金合同生效之日起每满6个月的最后一个工作日。在同丰A的开放日,基金管理人将对同丰A进行基金份额折算,同丰A的基金份额净值调整为1.000元,基金份额持有人持有的同丰A份额数按折算比例相应增减。
8、同丰B的封闭运作及上市交易:同丰B的封闭期为自基金合同生效之日起至18个月后对应日止,如该对应日为非工作日,则顺延至下一个工作日。在同丰B的封闭期内,同丰B可上市交易,但不接受申购赎回。同丰B上市后,登记在证券登记结算系统中的同丰B份额可直接在深圳证券交易所上市交易;登记在注册登记系统中的同丰B份额需通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中,方可上市交易。
9、基金份额总额:截至2013年2月19日,本基金的基金份额总额为1,997,372,126.07份,其中,同丰A为1,350,433,974.59份,同丰B为646,938,151.48份。
10、同丰B份额参考净值:1.003元(截至2012年2月19日)
11、本次上市交易的基金份额简称:同丰B,代码:150115
12、同丰B本次上市交易的基金份额总额:178,129,903.00份(截至2013年2月19日)
13、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
14、上市交易日期:2013年2月26日
15、基金管理人:长盛基金管理有限公司
16、基金托管人:中国银行股份有限公司
17、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、同丰B的募集与上市交易

(一)同丰B上市前募集情况
1、本基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证监会证监许可[2012]1543号
2、基金运作方式:契约型。本基金基金合同生效之日起18个月内,同丰A基金合同生效之日起每满6个月开放一次,同丰B封闭运作并上市交易;本基金基金合同生效后18个月届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。
3、基金存续期:不定期
4、发售日期:2012年12月3日至2012年12月12日
5、发售价格:1.000元人民币
6、发售方式:同丰B通过场外、场内两种方式公开发售,场外发售的同丰B登记在注册登记系统,场内发售的同丰B登记在证券登记结算系统。
7、发售机构:
(1)深圳证券交易所(场内)发售机构
具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位名单如下:
爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财通证券、长城证券、长江证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏源证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、中银万国、世纪证券、首创证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信证券、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后)。
(二)同丰B募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可新增为同丰B的场内发售机构。
(2)场外发售机构
1)直销机构:长盛基金管理有限公司。
2)代销银行:中国银行、中国建设银行、交通银行、招商银行、上海浦东发展银行、中国农业银行。
3)场外代销机构包括具有场外代销业务资格的券商机构和第三方销售机构。具体名单如下:
国元证券、中银万国、中国银河证券、招商证券、国泰君安、海通证券、长江证券、东北证券、瑞银证券、第一创业、光大证券、中航证券、华福证券、中信建投、平安证券、齐鲁证券、信达证券、东方证券、兴业证券、中信证券、长城证券、中投证券、中国国际金融有限公司、华龙证券、国金证券、江海证券、华鑫证券、恒泰证券、渤海证券、国海证券、东海证券、华安证券、财通证券、国信证券、山西证券、华融证券、方正证券、浙商证券、东莞证券、广发证券、民生证券。
8、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
9、认购资金总额及入账情况:
本次认购总金额1,996,890,217.99元人民币,该资金已于2012年12月27日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户;认购资金的银行利息共计481,908.08元,已折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金帐户。
本基金按照每份基金份额1.00元计算,募集期间募集资金及其利息结转的同丰A为1,350,433,974.59份,同丰B为646,938,151.48份,合计为1,997,372,126.07份。同丰A、同丰B的份额配比为2.0874:1。
10、基金备案情况
本基金已于2012年12月27日验资完毕,当日向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续,并于2012年12月27日获得书面确认,本基金基金同自该日起正式生效。
11、基金合同生效日:2012年12月27日。
12、基金合同生效日的基金总份额:1,997,372,126.07份。
(二)同丰B基金份额上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2013]63号
2、上市交易日期:2013年2月26日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、本次上市的基金份额简称:同丰B
5、本次上市的基金份额交易代码:150115
6、本次上市交易的同丰B份额:178,129,903.00份(截至2013年2月19日)
7、基金资产净值的披露:每个工作日的次日公布长盛同丰份额净值以及同丰A和同丰B的参考净值,并在深交所行情发布系统揭示同丰B的份额参考净值。
8、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的同丰B份额托管在场外(注册登记系统),份额持有人需将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内(证券登记结算系统)后方可上市流通。
9、同丰B的跨系统转托管业务的开通
为保证同丰基金份额持有人的利益,本基金管理人向深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司提出申请,自2013年2月21日起开通同丰B的跨系统转托管业务。跨系统转托管的具体业务按照深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。场外认购的同丰B份额只有在跨系统转托管至场内后,才可在深圳证券交易所上市交易。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)同丰B基金份额持有情况
截至2013年2月19日,同丰B场内基金份额持有人户数为401户,平均每户持有的场内同丰B为444,214.22份。
场内机构投资者持有的本次上市交易的同丰B份额138,607,017.00份,占本次上市交易的同丰B的比例为77.81%;场内个人投资者持有的本次上市交易的同丰B份额39,522,886.00份,占本次上市交易的同丰B的比例为22.19%。
(二)场内同丰B份额前十名持有人情况
截至2013年2月19日,本次上市交易的同丰B前十名持有人情况具体如下:

序号	持有人名称	持有同丰B份额	占场内同丰B的比例
1	海通证券股份有限公司	50,002,430.00	28.07%
2	国泰君安证券股份有限公司	20,000,972.00	11.23%
3	中国对外经济贸易信托有限公司-伏牛1期(汇富130号)结构化证券集合信托	10,000,583.00	5.61%
4	东方证券股份有限公司	10,000,486.00	5.61%
5	英大泰和人寿保险股份有限公司-传统保险产品	10,000,486.00	5.61%
6	银河证券-建行-银河木星1号基金精选集合资产管理计划	10,000,480.00	5.61%
7	广发证券股份有限公司	6,000,291.00	3.37%
8	国联证券股份有限公司	5,000,290.00	2.81%
9	中国国际金融有限公司	5,000,243.00	2.81%
10	安信证券-光大-安信理财2号积极配置集合资产管理计划	4,000,311.00	2.25%

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、基本信息
名称:长盛基金管理有限公司
住所:深圳市福田区福中三路1006号诺德中心八楼GH单元
办公地址:北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座21层
邮政编码:100088
法定代表人:凤良志
总经理:周庆
成立时间:1999年3月26日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:中国证监会证监基金字[1999]6号
组织形式:有限责任公司
注册资本:15000万元
存续期间:持续经营
信息披露负责人:叶金松
电话:010-82019988
传真:010-82255988
工商登记注册的法人营业执照文号:440301501120401
经营范围:基金募集;基金销售;资产管理;及中国证监会许可的其他业务。
2、经营概况
本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6号文件批准,于1999年3月成立,注册资本为人民币15000万元。截至目前,本公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司占注册资本的41%;新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%;安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%;安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。截至2013年1月31日,基金管理人共管理两只封闭式基金、二十三只开放式基金和五只社保基金委托资产,同时管理专户理财产品。
公司目前下设二十四个部门,分公司及营销中心,分别是:权益投资部、研究部、交易部、国际业务部、金融工程与量化投资部、社保业务管理部、固定收益部、专户理财部、产品开发部、市场销售总部、营销策划部、北京分公司、郑州分公司、上海分公司、杭州分公司、成都分公司、华南营销中心、业务运营部、信息技术部、财务会计部、人力资源部、总经理办公室、监察稽核部、风险管理部。
权益投资部主要负责境内公募基金的投资组合管理;研究部主要负责行业与上市公司研究,投资备选库建立、维护与更新;交易部主要负责完成基金经理、组合经理及投资经理下达的交易指令;国际业务部主要负责QDII产品的投资运作管理及QFII投资顾问服务;金融工程与量化投资部主要负责数量化投资、基金产品的业绩评价等;社保业务管理部主要负责公司社保组合的投资管理工作;固定收益部主要负责公司固定收益产品的投资管理与研究工作;专户理财部主要负责特定资产管理业务的客户营销和服务、产品开发设计和投资管理工作;产品开发部主要负责基金新产品的开发报批及产品维护工作;市场销售总部主要负责基金销售策略及基金销售计划制订、客户服务、销售渠道管理等;营销策划部主要负责制定及实施公司品牌宣传及市场推广计划;北京分公司、郑州分公司、上海分公司、杭州分公司、成都分公司和华南营销中心主要负责所辖区域的营销策划与基金销售工作;业务运营部主要负责基金核算与估值、开放式基金注册与登记,以及资金清算等工作;信息技术部主要负责公司信息系统的日常运行与维护,以及相关系统的规划与开发等;财务会计部主要负责公司财务管理工作;人力资源部主要负责公司战略及人力资源管理;总经理办公室主要负责公司行政事务的管理;监察稽核部主要负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查;风险管理部主要负责对投资风险的管理与控制。
截至2013年1月底,公司共有员工167人,其中具有硕士及以上学历的员工占61%,具有本科学历的员工占36.6%。研究员和基金经理98%以上拥有硕士及以上学历,公司员工平均年龄为33岁,平均金融从业年限8年。公司主要业务部门人员全部具有基金从业资格。基金管理人无任何受处罚记录。
3、本基金基金经理
杨衡先生,1975年10月出生。中国科学院数学与系统科学研究院博士、博士后。2007年7月进入长盛基金管理公司,历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理。现任长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理,兼任长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理、长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理。
(二)基金托管人
1、基本情况
名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币或什染值玖拾壹亿肆什柒佰贰拾贰万叁什壹佰玖拾伍元整
法定代表人:肖钢
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]24号
托管及投资者服务部总经理:李爱华
托管部门信息披露联系人:唐州徽
电话:010-66594855
传真:010-66594942
2、基金托管部门及主要人员情况
中国银行于1998年设立基金托管部,为进一步树立以投资者为中心的服务理念,中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部,现有员工120余人。另外,中国银行在重点分行已开展托管业务。
目前,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管等门类齐全的托管产品体系。在国内,中国银行率先开展续效评估、风险管理等增值服务,为各类客户提供个性化的托管服务,托管资产规模居同业前列。
3、证券投资基金托管情况
截至2012年12月末,中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合(LOF)、大成2020生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选LOF、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通债券、海富通精选灵活配置混合、海富通收益增长混合、海富通中证100指数(LOF)、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报混合、华夏行业股票(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300指数(LOF)、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF联接、万家180指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益混合、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证180金融交易型开放式指数、国泰上证180金融交易型开放式指数证券投资基金联接、诺德优选30股票型、泰达宏利聚利分级债券型、国联安优选行业股票型、长盛同鑫保本混合型、金鹰中证技术领先指数增强型、泰信中证200指数、大成内需增长股票型、银华永祥保本混合型、招商深圳电子信息传媒产业(MT)50交易型开放式指数、招商深证TMT50交易型开放式指数证券投资基金联接、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接、深证基本面120交易型开放式指数、上证180成长交易型开放式指数、华宝兴业上证180成长交易型开放式指数证券投资基金联接、易方达资源行业股票型、华安深证300指数、嘉实信用债券型、平安大华行业先锋股票型、华泰柏瑞信用增利债券型、泰信中小盘精选股票型、南富通国策导向股票型、中邮上证380指数增强型、泰达宏利中证500指数分级、长盛同裕信用增利债券型、银华中证内地资源主题指数分级、平安大华深证300指数增强型、嘉实安心货币市场、上投摩根健康品质生活股票型、工银瑞信睿智中证500指数分级、招商优势企业灵活配置混合型、国泰中小板300成长交易型开放式指数、国泰中小板300成长交易型开放式指数证券投资基金联接、景顺长城优信增利债券型、诺德周期策略股票型、长盛电子信息产业股票型、诺安中证创业成长指数分级、信诚双盈分级债券型、嘉实沪深300交易型开放式指数、民生加银信用双利债券型、工银瑞信基本面量化策略股票型、信诚周期轮动股票型、富兰克林国海研究精选股票型、诺安汇鑫保本混合型、平安大华策略先锋混合型、华宝兴业中证短融50指数债券型、180等权重交易型开放式指数、华安双月鑫短期理财债券型、大成景恒保本混合型、景顺长城上证180等权重交易型开放式指数证券投资基金联接、上投摩根分红添利债券型、嘉实优化红利股票型、长盛同鑫二号保本混合型、招商信用增强债券型、华宝兴业源优选股票型、中证500沪市交易型开放式指数、大成中证500沪市交易型开放式指数证券投资基金联接、博时医疗保健行业股票型、诺德深证300指数分级、华夏安康信用优选债券型、汇添富多元收益债券型、广发双债添利债券型、长盛添利30天理财债券型、信诚理财7日盈债券型、长盛添利60天理财债券型发起式、平安大华添利债券型、大成理财21天债券型发起式、华泰柏瑞稳健收益债券型、信诚添金分级债券型、国泰现金管理货币市场、国投瑞银纯债债券型、银华中证中票50指数债券型、华安信用增强债券型、长盛同丰分级债券型、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型(QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型(QDII)、信诚金砖四国积极配置(QDII)、海富通大中华精选股票型(QDII)、招商标普金砖四国指数(LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选(QDII)、大成标普500等权重指数(QDII)、长信标普100等权重指数(QDII)、博时抗通胀增强回报(QDII)、华安大中华升级股票型(QDII)、信诚全球商品主题(QDII)、上投摩根全球天然资源股票型、工银瑞信中国机会全球配置股票型(QDII)、易方达标普全球高端消费品指数增强型(QDII)、建信全球资源股票型(QDII)、恒生交易型开放式指数(QDII)、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接(QDII)、广发纳斯达克100指数(QDII)等189只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。
(三)基金验资机构
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
电话:021-23238888
传真:021-23238800
经办注册会计师:汪棣、张晓艺

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附录:基金合同摘要。

七、基金财务状况

深圳证券交易所在长盛同丰分级债券型证券投资基金认购期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比率收取认购费。
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
长盛同丰分级债券型证券投资基金截止2013年2月19日资产负债表如下:

单位:人民币元

资产	期末数	负债及持有人权益	期末数
资产:		负债:	
银行存款	672,664,990.77	应付证券清算款	57,416.40
清算备付金	102,334,368.40	应付赎回款	-
交易保证金	191,836.23	应付赎回费	-
应收证券清算款	53,905,556.01	应付管理人报酬	731,125.97
应收股利	-	应付托管费	208,893.12
应收利息	18,468,746.81	应付销售服务费	313,339.71
应收申购款	-	应付交易费用	594.45
其他应收款	-	应付利息	-
股票投资市值	-	应付收益	-
其中:股票投资成本	-	未交税金	-
债券投资市值	865,372,113.62	其他应付款	580.50
其中:债券投资成本	863,899,845.91	卖出回购证券款	-
权证投资市值	-	短期借款	-
其中:权证投资成本	-	预提费用	58,904.00
配股权证	-	其他负债	-
买入返售证券	296,300,253.95	负债合计	1,370,854.15
待摊费用	-	持有人权益:	
其它资产	-	实收基金	1,997,372,126.07
		未实现利得	1,472,267.71
		未分配收益	9,022,617.86
		持有人权益合计	2,007,867,011.64
资产合计:	2,009,237,865.79	负债与持有人权益总计	2,009,237,865.79

八、基金投资组合

长盛同丰分级债券型证券投资基金的投资组合如下:
(一)截至2013年2月19日,基金资产组合情况

资产项目	金额(人民币元)	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金	774,999,359.17	38.57%
股票市值	-	-
债券市值	865,372,113.62	43.07%
权证市值	-	-
买入返售金融资产	296,300,253.95	14.75%
其他资产	72,566,139.05	3.61%
合计	2,009,237,865.79	100.00%

(二)截至2013年2月19日,按行业分类的股票投资组合
截至2013年2月19日,本基金未持有股票。
(三)截至2013年2月19日,按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细
截至2013年2月19日,本基金未持有股票。
(四)截至2013年2月19日,按券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	197,976,115.50	9.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	667,395,998.12	33.24
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	865,372,113.62	43.10

(五)截至2013年2月19日,按市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	010303	03国债(3)	1,042,690	101,662,275.00	5.06
2	010107	21国债(7)	906,900	94,852,671.00	4.72
3	122162	12中孚债	550,050	57,205,200.00	2.85
4	122102	11广汇01	481,470	49,880,292.00	2.48
5	122186	12力帆02	373,860	38,769,282.00	1.93

(六)投资组合报告附注
1、声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
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。
2、声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。
依照本基金合同的规定,股票不在本基金投资范围内,截至2013年2月19日,本基金未持有股票。
3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	191,836.23
2	应收证券清算款	53,905,556.01
3	应收股利	-
4	应收利息	18,468,746.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,566,139.05

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
截至2013年2月19日,本基金未持有可转换债券。
5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
截至2013年2月19日,本基金未持有股票。
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。

九、重大事件揭示

本基金基金合同已于2012年12月27日正式生效,基金管理人已于2012年12月28日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》刊登长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同生效公告。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金份额产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
(1)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
(2)设立专门的基金托管部,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
(3)按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
(4)除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得以基金财产为自己及任何第三人谋取非法利益,不得委托第三人托管基金财产;
(5)对所托管的不同基金财产分别设置账户,确保基金财产的完整和独立;
(6)保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
(7)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
(8)按照基金合同的约定,根据基金管理人的指令,及时办理清算、交割事宜;
(9)保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予以保密,不得向他人泄露;
(10)根据法律法规及本合同的约定,办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
(11)对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告的相关内容出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行;如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
(12)保存基金份额持有人名册;
(13)复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回价格;
(14)按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
(15)依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
(16)按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;
(17)按照法律法规监督基金管理人的投资运作;
(18)因违反基金合同导致基金财产损失,应承担赔偿责任,其责任不因其退任而免除;
(19)因基金管理人违反基金合同造成基金财产损失时,应为基金向基金管理人追偿,除法律法规另有规定外,基金托管人不承担连带责任;
(20)法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他义务。
(二)基金份额持有人
1、基金份额持有人的权利
(1)分享基金财产收益;
(2)参与分配清算后的剩余基金财产;
(3)依法转让或者申请赎回其持有的基金份额;
(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会;
(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
(7)监督基金管理人的投资运作;
(8)对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
(9)法律法规、基金合同规定的其他权利。
2、基金份额持有人的义务
(1)遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;
(2)缴纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用;
(3)在持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;
(4)不从事任何有损基金、其他基金份额持有人及其他基金合同当事人合法利益的活动;
(5)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(6)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;
(7)遵守基金管理人、销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则;
(8)法律法规及基金合同规定的其他义务。

第二节 基金份额持有人大会

(一)本基金的基金份额持有人大会,由本基金的基金份额持有人组成。基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。
1、本基金在分级基金运作期内,基金份额持有人大会的审议事项应分别由同丰A、同丰B的基金份额持有人独立进行表决。同丰A、同丰B的基金份额持有人持有的每一份基金份额在各自份额级别内拥有同等的投票权。
2、本基金根据基金合同的约定转换为上市开放式基金(LOF)后,基金份额持有人持有的每一基金份额享有同等的投票权。
(二)有以下情形之一时,应召开基金份额持有人大会:
1、终止基金合同;
2、转换基金运作方式;
3、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;
4、更换基金管理人、基金托管人;
5、变更基金类别;
6、变更基金投资目标、范围或策略;
7、变更基金份额持有人大会议事程序、表决方式和表决程序;
8、本基金与其他基金合并;
9、对基金份额持有人权利、义务产生重大不利影响,需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项;
10、单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
本基金在分级基金运作期内,依据基金合同享有基金份额持有人大会召集提议权、自行召集权、提案权、新任基金管理人和基金托管人提名权的单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人或类似表述均指“单独或合计持有同丰A、同丰B各自的基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人”或其类似表述。
11、法律法规或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。
(三)有以下情形之一的,不需召开基金份额持有人大会:
1、调低基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率;
2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率或收费方式;
3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改;
4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;
5、对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
6、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。
(四)召集方式
1、除法律法规或基金合同另有约定外,基金份额持有人大会由基金管理人召集。
2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知基金托管人。
基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,基金托管人仍认为有必要召开的,应当自行召集。
3、代表基金份额10%以上的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。
基金管理人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开;基金管理人决定不召集,代表基金份额10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的,应当向基金托管人提出书面提议。
基金托管人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集,并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人;基金托管人决定召集的,应当自出具书面决定之日起60日内召开。
4、代表基金份额10%的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会,而基金管理人、基金托管人都不召集的,代表基金份额10%以上的基金份额持有人有权自行召集,并至少提前30日报中国证监会备案。
5、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的,基金管理人、基金托管人应当配合,不得阻碍、干扰。
6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。
(五)通知
召开基金份额持有人大会,召集人应当于会议召开前30天在至少一种指定媒体上公告。基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容:
1、会议召开的时间、地点、方式;
2、会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式;
3、代理投票授权委托书送达时间和地点;
4、会务常设联系人姓名、电话;
5、权益登记日;
6、如采用通讯表决方式,还应载明具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表达意见的寄交和收取方式、投票表决的截止日以及表决票的送达地址等内容。
(六)开会方式
基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委派其代理人出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席;通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。会议的召开方式由召集人确定,但决定基金管理人更换或基金托管人的更换、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持