

## 长盛同丰分级债券型证券投资基金

2013年6月30日

[2013] 第二季度报告

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:2013年7月18日

1)重要提示

基金管理人的董事及高级管理人员保证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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据法律法规规定，对本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告和投资收益分配政策等内容进行复核，没有发现基金存在虚假记载、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未来表现。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本基金财务数据未经审计。

本报告出自2013年4月1日起至6月30日止。

52 基金产品概况

基金简称 长盛同丰分级债券

基金主代码 160810

交易代码 160810

契约型。封闭期为18个月，封闭期内，同丰A自基金合同生效之日起每6个月开放一次，同丰B封闭运作并上市交易，本基金基金份额合同生效后18个月届满，本基金转换为上市开放式基金(LOF)。

基金运作方式 基金合同生效日 2012年12月27日

报告期末基金份额总额 989,966,540.47份

通过分析影响证券市场的各类要素，进行积极主动的投资管理，追求基金资产的稳定增值，以最大程度上取得超越业绩比较基准的收益。

投资目标 以利率风险管理为核心，以久期配置为关键技术，在满足组合流动性需求下，结合不同期限债券的流动性、税收和信用风险等因素，综合确定券种组合的配置并进行个券选择，控制久期、利率风险，获取超额的投資收益。具体投资操作中将充分考虑宏观经济形势、资金面、政策导向、机构行为策略、利率曲线等多样的操作策略。

业绩比较基准 中债综合指数(全价)

本基金为债券型基金，属于较低风险的证券投资基金品种。

风险收益特征 在长期封闭期内，本基金的风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金中的股票型基金。在二级市场运作期内，本基金经过基金份额二级后，同丰A为低风险，相对稳定的稳健收益特征的基金份额；同丰B为较高风险，较高收益的增强收益特征的基金份额。

基金管理人 长盛基金管理有限公司

中国银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称 长盛同丰分级债券A

长盛同丰分级债券B

下属两级基金的交易代码 160811 150115

报告期末下属两级基金的份额总额 343,028,488.99份 646,938,151.48份

下属两级基金的风险收益特征 风险收益、收益相对稳定的稳健收益特征

风险收益特征

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4月1日 - 2013年6月30日)

1.本期实现收益 20,127,836.37

2.本期利润 19,380,021.12

3.加权平均基金份额本期利润 0.0009

4.期末基金份额净值 999,484,481.43

5.期末基金份额百分比 1.010

注:1.本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率将要低于所列数字。

2.所列数据截至到2013年6月30日。

3.本期利润已从基金收入中扣除非收入、不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润已从已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 本期净值收益率

3.2.1 本基金基金份额净值增长率与其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② 业绩比较基准收益率③ 准确率④

过去三个月 1.53% 0.12% 0.12% 0.11%

1.41% 0.01%

3.2.2 本基金同行业收益率与同期业绩比较基准收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金业收益率与同期业绩比较基准收益率变动的历史走势图

5.6 报告期末本基金公允价值占基金资产净值比例前十名股票投资明细

5.7 报告期末本基金公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.8 报告期末本基金持有的其他证券投资的描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.9 开放式基金份额变动

单位:份

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 1282400 12汉投债 800,000 83,472,000.00 8.35

2 130201 13国开01 600,000 59,670,000.00 5.97

3 122162 12中孚债 551,720 58,151,288.00 5.82

4 112119 12恒邦债 549,045 55,233,927.00 5.53

5 122272 12东胜债 503,970 53,829,035.70 5.39

5.10 报告期初基金资产净值总额 1,350,433,974.59

5.11 报告期基金总申购金额 107,319,085.81

5.12 报告期基金总赎回金额 1,143,342,671.10

5.13 报告期基金总申购金额 28,618,099.69

5.14 报告期基金总赎回金额 343,028,488.99

5.15 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.16 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.17 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.18 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.19 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.20 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.21 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.22 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.23 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.24 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.25 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.26 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.27 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.28 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.29 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.30 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.31 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.32 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.33 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.34 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.35 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.36 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.37 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.38 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.39 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.40 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.41 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.42 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.43 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.44 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.45 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.46 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.47 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.48 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.49 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.50 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.51 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.52 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.53 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.54 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.55 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.56 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.57 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.58 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.59 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.60 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.61 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.62 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.63 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.64 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.65 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.66 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.67 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.68 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.69 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.70 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.71 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.72 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.73 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.74 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.75 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.76 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.77 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.78 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.79 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.80 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.81 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.82 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.83 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.84 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.85 报告期基金总申购金额 646,938,151.48

5.86 报告期基金总赎回金额 1,350,433,974.59

5.87 报告期基金总申购金额 646,938,151.48