

长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金

[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日重要提示
本基金不存在虚假记载、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。

本基金的基金管理人和基金托管人严格按照有关法律法规及基金合同的约定，于2013年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:长盛添利60天理财债券型发起式

基金主代码:080018

交易代码:080018

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2012年11月29日

报告期初基金份额总额:144,649,663.96份

投资目标:在追求基金稳定的收益基础上，力争为基金份额持有人获取高于业绩比较基准的稳定收益。

投资策略:本基金在投资组合管理中将采用主动投资策略，在投资中将充分考虑现代金融工程与数学分析技术方法的辅助运用，以提高投资的科学性与及时性，在控制风险的前提下，追求收益的最大化。

业绩比较基准:货币市场基金。

风险收益特征:本基金属于货币市场基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金、高货币市场基金。

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:长盛添利60天理财债券型发起式A

长盛添利60天理财债券型发起式B

下属两级基金的基金代码:080018 080019

报告期初下属两级基金的份额总额:134,444,706.82份 10,204,957.14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(2013年4月1日-2013年6月30日)

长盛添利60天理财债券型发起式 A 长盛添利60天理财债券型发起式 B

1. 本期已实现收益 1,367,683.00 74,812.46

2. 本期利润 1,367,683.00 74,812.46

3. 期末基金份额净值 134,444,706.82 10,204,957.14

注:1. 所列数据截止到2013年6月30日。

2. 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，由于本基金采用摊余成本法核算，本期利润即为本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2.1 本期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

长盛添利60天理财债券型发起式 A

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.669% 0.0007% 0.3366% 0.0000% 0.3330% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.3 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.4 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

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.5 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.6 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.7 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.8 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.9 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.10 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.11 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.12 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.13 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.14 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.15 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净值收益率(①) 净值收益率标准差(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 0.7385% 0.0000% 0.3366% 0.0000% 0.4019% 0.0007%

注:本基金收益分配是按日精算份额。

3.2.16 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

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 -0.47% 1.00% -9.93% 1.00% 5.76% -0.10%

注:本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

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

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 -0.47% 1.00% -9.93% 1.00% 5.76% -0.10%

注:本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

长盛添利60天理财债券型发起式 A

长盛添利60天理财债券型发起式 B

阶段 净