

## 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：中国工商银行股份有限公司  
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。  
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年7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预示其未来表现。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
报告期末基金份额总额	144,649,663.96份
投资目标	在追求基金稳定的基础上，力争为基金份额持有人获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在投资组合管理中将采用主动投资策略，在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用，以提高投资决策的科学性及及时性，在控制风险的前提下，追求收益最大化。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
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
下属两级基金的基本信息	长盛添利60天理财发起式A 080019
下属两级基金的交易代码	080018
报告期末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

主要财务指标	报告期(2013年4月1日—2013年6月30日)	单位:人民币元
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. 期末基金资产净值	134,444,706.82	10,204,957.14

注:1. 所列数据截止至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，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2.2 自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

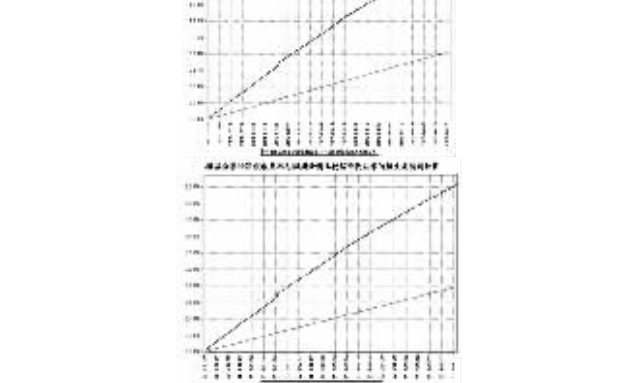
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.0696%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.3330%	0.0007%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

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%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.4019%	0.0007%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自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



注:1. 本基金的基金合同生效日为2012年11月29日，截至本报告期末，基金成立未满足一年。  
2. 按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束后，本基金的各项资产投资比例符合本基金合同第十四条(二)投资范围、(七)投资禁止行为及限制的有关约定。

## § 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
杨衡	基金经理	2012年11月29日	6年	男，1975年10月出生，中国科学大学理学专业，理学硕士，2007年7月进入长盛基金管理有限公司，历任固定收益研究员、社保组合基金经理。现任长盛添利60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(本基金)基金经理，长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理，长盛同瑞分级债券型证券投资基金基金经理。

注:1. 本基金的基金经理任期和离任日期均指公司决定聘任和解聘的任期和解聘日期。  
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  
报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项法规、《长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则和审慎原则履行投资管理职责，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的合法权益。

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：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利。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
公司对过去一个季度的所有交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占比等指标，使用双向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。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.3 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.7 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.9 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.11 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.13 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.15 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.17 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.19 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.21 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.23 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

4.4.25 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明  
报告期内，本基金管理人严格执行《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：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利。

## § 5 投资组合报告

4.4.2 报告期内基金的业绩表现  
2013年2季度，本基金A级净值收益率为0.696%，B级净值收益率为0.7385%，同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	80,037,188.72	54.93
其中:债券	80,037,188.72	54.93	
2	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	63,953,848.87	43.89
4	其他资产	1,718,388.59	1.18
5	合计	145,709,426.18	100.00

注:本报告期内,根据流动性管理的需要,本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的资金。

5.2 报告期末债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	12.69
其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期末每个交易日融资余额占基金资产净值比例的平均值。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期末债券回购融资余额	12.69
其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期末每个交易日融资余额占基金资产净值比例的平均值。

5.3.1 基金投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明  
注:报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	30.39
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	27.65
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	-
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	41.51
其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计	80,037,188.72	55.33

注:本基金本报告期无资产支持证券。

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	摊余成本(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	80,037,188.72	55.33
其中:政策性金融债	80,037,188.72	55.33	
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	80,037,188.72	55.33

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国债01	400,000	40,007,035.69
2	110401	11农发01	200,000	20,031,775.61
3	120228	12国债28	200,000	19,998,377.42

注:本基金本报告期无资产支持证券。

5.6 影子定价与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	6次
报告期内偏离度的最高值	-0.0225%
报告期内偏离度的最低值	-0.3798%
报告期内偏离度绝对值在0.5%以上(不含0.5%)的次数	0.0615%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.2 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.3 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.4 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.5 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.6 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.7 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.8 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.9 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.10 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.11 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.12 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.13 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.14 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.15 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.16 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.17 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.18 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.19 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.20 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.21 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.22 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.23 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.24 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.25 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.26 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.27 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.28 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.29 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.30 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.31 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.32 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.33 本基金报告期内未持有资产支持证券。

5.8.34 本基金报告期内未持有资产支持证券。

## 长盛添利30天理财债券型证券投资基金

## 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：中国工商银行股份有限公司  
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。  
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年7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预示其未来表现。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30天理财债券
基金主代码	080016
交易代码	080016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年10月26日
报告期末基金份额总额	129,757,760.72份
投资目标	在追求基金稳定的基础上，力争为基金份额持有人获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在投资组合管理中将采用主动投资策略，在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用，以提高投资决策的科学性及及时性，在控制风险的前提下，追求收益最大化。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
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
下属两级基金的基本信息	长盛添利30天理财债券A 080017
下属两级基金的交易代码	080016
报告期末下属两级基金的份额总额	89,735,865.95份 40,021,894.77份

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2013年4月1日—2013年6月30日)	单位:人民币元
1. 本期已实现收益	890,538.44	429,892.72
2. 本期利润	890,538.44	429,892.72
3. 期末基金资产净值	89,735,865.95	40,021,894.77

注:1. 所列数据截止至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，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2.2 自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

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----