长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金

2013 第三季度报告

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10月23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2013年10月22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2013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	128,908,346.83份	
投资目标	在追求本金稳妥的基础上,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与及时性,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	
下属两级基金的基金简称	长盛添利60天理财发起式A	长盛添利60天理财发起式B
下属两级基金的交易代码	080018	080019
报告期末下属两级基金的份额总额	81,397,060.50份	47,511,286.33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7月1日 - 2013年9月30日)	
	长盛添利60天理财发起式A	长盛添利60天理财发起式B
1. 本期已实现收益	788,087.43	306,329.19
2.本期利润	788,087.43	306,329.19
3.期末基金资产净值	81,397,060.50	47,511,286.33

注:1.所列数据截止到2013年9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 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益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	0.8217%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	0.4814%	0.0005%

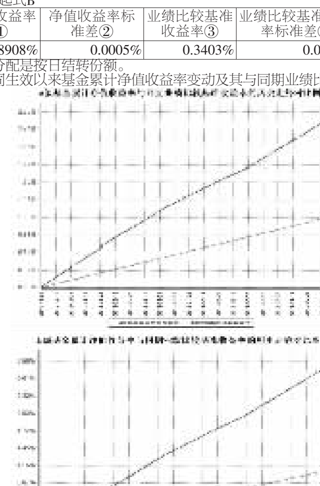
注:本基金收益分配是按日结转份额。

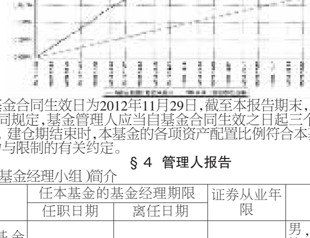
长盛添利60天理财发起式B

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	0.8908%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	0.5505%	0.0005%

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三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条(二)投资范围、(七)投资禁止行为与限制的有关约定。

§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		
杨衡	本基金基金经理,长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理,长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理,长盛纯债债券型证券投资基金基金经理。	2012年11月29日	-	6年	男,1975年10月出生,中国国籍。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(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,长盛纯债债券型证券投资基金基金经理。

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、《长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金合同》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,未发现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。

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

2013年3季度,在经历了6月份"钱荒"后,市场流动性虽较6月份有所缓解,但短期利率中枢相比5月中旬前极度宽松时有一定抬升。央行通过"锁长放短"等公开市场操作,货币市场资金面维持紧平衡。此外,受一级市场发行持续冲击,3季度各品种收益率有所上行,收益率曲线呈平坦化态势。

考虑到银行间市场债券交易和回购交易对交易对手和成交量有一定制约,受目前组合规模限制,成本摊余等费用对组合收益的占比影响比较明显。因此,在报告期内,组合未进行杠杆操作,主要通过协议存款、银行间市场和交易所市场回购等货币市场工具进行现金流期限匹配,控制组合流动性风险,熨平组合申购资金头寸。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年3季度,本基金A级净值收益率为0.8217%,B级净值收益率为0.8908%,同期业绩比较基准收益率0.3403%。

§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	固定收益投资	60,020,550.99	46.44
	其中:债券	60,020,550.99	46.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	26,608,268.81	20.59
	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	40,834,639.14	31.59
4	其他资产	1,783,677.90	1.38
5	合计	129,247,136.84	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		-
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%"。本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	91
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

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比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	52.32	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	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	46.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.88	-

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	60,020,550.99	46.56
	其中:政策性金融债	60,020,550.99	46.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	60,020,550.99	46.56
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国开01	400,000	40,003,697.14	31.03
2	110401	11农发01	200,000	20,016,853.85	15.53

注:本基金本报告期末仅持有上述2只债券。

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	-
报告期内偏离度的最高值	-0.1214%
报告期内偏离度的最低值	-0.2302%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1780%

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:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.8.2 本报告期内,本基金不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,782,677.90
4	应收申购款	1,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,783,677.90

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注: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

项目	长盛添利60天理财发起式A	长盛添利60天理财发起式B
报告期期初基金份额总额	134,444,706.82	10,204,957.14
报告期期间基金总申购份额	1,127,587.43	37,306,329.19
减:报告期期间基金总赎回份额	54,175,233.75	-
报告期期末基金份额总额	81,397,060.50	47,511,286.33

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§8 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,234,493.22	7.94	10,000,944.44	7.76	三年
基金管理公司高级管理人员	-	-	-	-	三年
基金经理等人员	-	-	-	-	三年
基金管理公司股东	-	-	-	-	三年
其他	-	-	-	-	三年
合计	10,234,493.22	7.94	10,000,944.44	7.76	-

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、《长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金合同》;
3、《长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金托管协议》;
4、《长盛添利60天理财债券型发起式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。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 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及/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
2013年10月23日

长盛同鑫保本混合型证券投资基金

2013 第三季度报告

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10月23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2013年10月22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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同鑫保本混合
基金主代码	080007
交易代码	080007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月24日
报告期末基金份额总额	789,430,400.72份
投资目标	依照本基金的保证合同,本基金通过运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,力争在本基金保本周期结束时,实现基金资产的收益增长。
投资策略	本基金投资策略突出强调配置的科学性与纪律性,通过严格金融工程手段有效控制风险,保证实现投资期中的稳定收益,并通过有效地资产配置和保本投资策略以保障基金资产本金的安全。 本基金将按照恒定比例组合保险机制(CPPI)将资产配置于安全资产与风险资产,用投资于固定收益类证券的现金净流入来冲抵风险资产组合潜在的最大亏损,并通过投资股票等风险资产来获得资本利得。
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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	6,062,384.87
2.本期利润	5,207,967.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0060
4.期末基金资产净值	814,252,657.28
5.期末基金份额净值	1.031

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2013年9月30日。

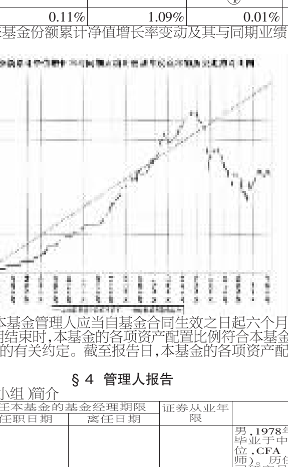
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.59%	0.11%	1.09%	0.01%	-0.50%	0.10%

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



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十六条(二)投资范围、(七)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,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理,社保组合组合经理,固定收益部总监。	2011年5月24日	-	9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(美国特许金融分析师)。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等职务。现任固定收益部总监,社保组合组合经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理。

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、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》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,未发现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。

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

在经历过6月中旬的"钱荒"之后,利率债收益率出现较为明显的回落。但进入7月份,资金面再度趋紧,且一级市场发行持续冲击,利率债市场哀鸿遍野,各品种收益率全线大幅上扬,收益率曲线呈平坦化态势。随后央行开展逆回购操作,市场情绪有明显缓和,中短端利率债收益率有较为明显的下滑。整体来看,7月份利率债收益率较6月末大幅上行,国债收益率上行幅度明显大于金融债。

信用债方面,受相对偏紧的资金面推动,7月份信用债市场继续走弱,中长期品种收益率有一定幅度上行。虽然经济增长疲弱、通胀压力总体不大,但是不确定的宏观政策走向和持续偏紧的资金面导致当前信用债疲弱。二级市场表现亦影响一级市场中长期信用债供给,收益率水平的持续走高影响企业的发行需求并导致部分产品出现发行失败或延期的现象。从利差看,中长期基本保持稳定,形成高等级品种收益率上行带动中低等级联动的局面;短期品种低等级表现不及高等级,等级利差有所扩大。

8月份,央行货币政策继续保持既有的连贯性和一致性,资金利率总体上维持高位。在此背景下,利率产品供给压力释放引发的供需失衡导致一级市场招标利率持续超出市场预期,市场悲观情绪日渐浓重。在一级市场持续疲弱的带动下,二级市场收益率逐步上行,10年期国债收益率上行30bp以上,突破4%的敏感点位。

进入9月份,资金面紧张程度明显低于市场预期,伴随市场预期的起落,债券市场总体上呈现先跌后涨的格局。相对与9月初,国债收益率总体有所下行,信用债受较低的信用利差影响,收益率多以上行为主。

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1.031元,本报告期份额净值增长率为0.59%,同期业绩比较基准增长率为1.09%。

§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	31,936,058.18	2.76
	其中:股票	31,936,058.18	2.76
2	固定收益投资	1,047,617,505.93	90.61
	其中:债券	1,047,617,505.93	90.61
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	20,000,000.00	1.73
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	34,267,593.50	2.96
6	其他资产	22,353,026.58	1.93
7	合计	1,156,174,184.19	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	1,366,200.00	0.17
B	采矿业	974,709.84	0.12
C	制造业	21,449,648.34	2.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	440,000.00	0.05
F	批发和零售业	1,976,200.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	1,333,200.00	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	572,600.00	0.07
J	金融业	2,298,000.00	0.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	414,400.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	1,111,100.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	31,936,058.18	3.92

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	600837	海通证券	80,000	1,000,800.00	0.12
2	600887	伊利股份	20,000	893,600.00	0.11
2	601166	兴业银行	80,000	893,600.00	0.11
4	600522	中天科技	80,000	859,200.00	0.11
5	000063	中兴通讯	50,000	830,000.00	0.10
6	002041	登海种业	30,000	810,000.00	0.10
7	002415	海康威视	30,000	792,000.00	0.10
8	600100	同方股份	80,000	744,000.00	0.09
9	600271	航天信息	40,000	732,800.00	0.09
10	601006	大秦铁路	100,000	728,000.00	0.09

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	49,955,000.00	6.14
	其中:政策性金融债	49,955,000.00	6.14
4	企业债券	663,243,062.09	81.45
5	企业短期融资券	109,629,000.00	13.46
6	中期票据	110,781,000.00	13.61
7	可转债	114,009,443.84	14.00
8	其他	-	-
9	合计	1,047,617,505.93	128.66

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110015	石化转债	900,000	88,101,000.00	10.82
2	126011	08石化债	600,000	59,070,000.00	7.25
3	126008	08上汽债	550,000	54,532,500.00	6.70
4	120318	12进出18	500,000	49,955,000.00	6.14
5	126017	08葛洲债	509,780	49,311,019.40	6.06

5.6 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名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期内未进行股指期货投资,报告期末无股指期货持仓。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金基金合同中未约定本基金投资股指期货的投资政策。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未进行国债期货投资,报告期末无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金报告期内未进行国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	101,774.55
2	应收证券清算款	2,718,145.96
3	应收股利	-
4	应收利息	19,530,431.96
5	应收申购款	2,674.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,353,026.58

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	88,101,000.00	10.82
2	113002	工行转债	25,490,900.00	3.13

5.10.5 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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注: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	940,215,439.96
报告期基金总申购份额	591,009.58
减:报告期基金总赎回份额	151,376,048.82
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	789,430,400.72

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§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、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛同鑫保本混合型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛同鑫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/或基金托管人的住所。

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
2013年10月23日

长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金

2013 第三季度报告

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10月23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2013年10月22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2013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	691,184,971.56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,以确保在保本期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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	5,926,761.17
2.本期利润	-4,956,039.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0063
4.期末基金资产净值	710,128,509.29
5.期末基金份额净值	1.027

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2013年9月30日。

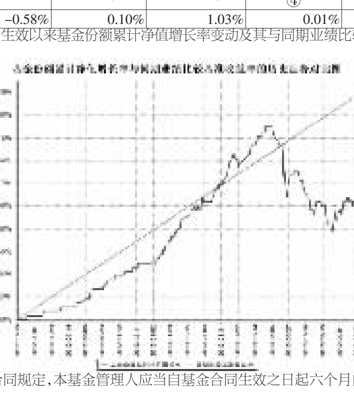
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-0.58%	0.10%	1.03%	0.01%	-1.61%	0.09%

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



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,长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理,社保组合组合经理,固定收益部总监。	2012年7月10日	-	9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(美国特许金融分析师)。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等职务。现任固定收益部总监,社保组合组合经理,长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理,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、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》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,未发现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。

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

在经历过6月中旬的"钱荒"之后,利率债收益率出现较为明显的回落。但进入7月份,资金面再度趋紧,且一级市场发行持续冲击,利率债市场哀鸿遍野,各品种收益率全线大幅上扬,收益率曲线呈平坦化态势。随后央行开展逆回购操作,市场情绪有明显缓和,中短端利率债收益率有较为明显的下滑。整体来看,7月份利率债收益率较6月末大幅上行,国债收益率上行幅度明显大于金融债。

信用债方面,受相对偏紧的资金面推动,7月份信用债市场继续走弱,中长期品种收益率有一定幅度上行。虽然经济增长疲弱、通胀压力总体不大,但是不确定的宏观政策走向和持续偏紧的资金面导致当前信用债疲弱。二级市场表现亦影响一级市场中长期信用债供给,收益率水平的持续走高影响企业的发行需求并导致部分产品出现发行失败或延期的现象。从利差看,中长期基本保持稳定,形成高等级品种收益率上行带动中低等级联动的局面;短期品种低等级表现不及高等级,等级利差有所扩大。

8月份,央行货币政策继续保持既有的连贯性和一致性,资金利率总体上维持高位。在此背景下,利率产品供给压力释放引发的供需失衡导致一级市场招标利率持续超出市场预期,市场悲观情绪日渐浓重。在一级市场持续疲弱的带动下,二级市场收益率逐步上行,10年期国债收益率上行30bp以上,突破4%的敏感点位。

进入9月份,资金面紧张程度明显低于市场预期,伴随市场预期的起落,债券市场总体上呈现先跌后涨的格局。相对与9月初,国债收益率总体有所下行,信用债受较低的信用利差影响,收益率多以上行为主。

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1.027元,本报告期份额净值增长率为-0.58%,同期业绩比较基准增长率为1.03%。

§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	25,247,597.55	2.35
	其中:股票	25,247,597.55	2.35
2	固定收益投资	976,703,940.50	90.81
	其中:债券	976,703,940.50	90.81
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	44,228,197.52	4.11
6	其他资产	29,372,273.01	2.73
7	合计	1,075,552,008.58	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	1,095,309.00	0.15
B	采矿业	902,200.00	0.13
C	制造业	16,878,676.33	2.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,317,600.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	1,036,300.00	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	571,166.64	0.08
J	金融业	2,061,312.30	0.29
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	414,400.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	970,633.28	0.14
S	综合	-	-
	合计	25,247,597.55	3.56

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	600100	同方股份	80,750	750,975.00	0.11
2	600837	海通证券	60,000	750,600.00	0.11
3	600511	国药股份	40,000	749,600.00	0.11
4	002202	金风科技	100,000	702,000.00	0.10
5	601928	凤凰传媒	50,000	693,500.00	0.10
6	600104	上汽集团	50,000	676,500.00	0.10
7	601166	兴业银行	60,000	670,200.00	0.09
8	600522	中天科技	60,000	644,400.00	0.09
9	000729	燕京啤酒	100,000	643,000.00	0.09
10	601006	大秦铁路	80,000	582,400.00	0.08

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	791,731,896.66	111.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	150,293,000.00	21.16
7	可转债	34,679,043.84	4.88
8	其他	-	-
9	合计	976,703,940.50	137.54

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	341,000	34,614,910.00	4.87
2	110015	石化转债	350,000	34,261,500.00	4.82
3	126016	08宝钢债	340,000	33,017,400.00	4.65
4	126008	08上汽债	330,000	32,719,500.00	4.61
5	122596	12沪城开	300,000	30,750,000.00	4.33

5.6 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名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未进行股指期货投资,报告期末无股指期货持仓。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金基金合同中未约定本基金投资股指期货的投资政策。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未进行国债期货投资,报告期末无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金报告期内未进行国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	87,344.99
2	应收证券清算款	2,275,370.95
3	应收股利	-
4	应收利息	27,009,160.52
5	应收申购款	396.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,372,273.01

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	34,261,500.00	4.82

5.10.5 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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注: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	881,056,364.17
报告期基金总申购份额	132,573.43
减:报告期基金总赎回份额	190,003,966.04
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	691,184,971.56

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

注:本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§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/或基金托管人的住所。

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
2013年10月23日