长盛积极配置债券型证券投资基金

【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：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	长盛积极配置债券
基金主代码	080003
交易代码	080003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月8日
报告期末基金份额总额	372,619,609.83份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	本基金为积极投资策略的债券型基金，不同与传统债券型基金的投资策略特点，本基金在债券类资产配置上更强调积极主动管理。在债券类资产配置上，本基金通过积极投资配置相对收益率较高的企业债、公司债、可转换债、可分离交易可转债、资产支持证券等创新债券品种，并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会，以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上，通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票，来获取股票市场的积极收益。此外，本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，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	中国建设银行股份有限公司

§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	6,427,933.18
2.本期利润	928,070.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0023
4.期末基金资产净值	403,707,317.31
5.期末基金份额净值	1.0834

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	0.27%	0.15%	-0.06%	0.17%	0.33%	-0.02%

3.2.2 自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

注：按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条“（二）投资范围”、“（六）投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
贾志敏	本基金基金经理、长盛货币市场基金基金经理、长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理、长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、固定收益部副总监。	2013年3月21日	-	7年	男，1982年3月出生，中国国籍。北京大学经济学硕士，曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作。2012年11月底加入长盛基金管理有限公司，现任固定收益部副总监、长盛货币市场基金基金经理、长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理、长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛双月红1年期定期开放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、《长盛积极配置债券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

1、报告期内行情回顾

2013年第3季度，通胀水平始终保持在3%以下的水平、经济弱复苏态势进一步明确两者难以对债券市场形成明显的指引作用。6月中下旬钱荒过后，央行加强了货币市场流动性管理，资金成本较上半年有所提升，债券市场在波动中走出一波熊市行情。具体来看：利率债方面，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，二级市场收益率逐步上行，10年期国债收益率上行50bp左右，突破了4%的敏感点位，并一度达到4.14%高点；信用债方面，短端收益率上行幅度大于长端收益率，低等级上行幅度高于高等级，收益率曲线逐渐扁平化。

货币市场方面，3季度银行间货币市场利率较上半年中枢有所上移，银行间资金面总体保持中性偏紧的态势，以银行间七天回购利率为例，该利率在3季度总体维持在4%左右。各中短期限Shibor利率维持在相对较低水平，例如SHIBOR 2W 大体维持在4.44%左右。

纯债资产以外，2013年第3季度A股呈现震荡上行的态势。受正股震荡上行的行情带动，股性较强的转债在3季度总体呈现不断上升的走势。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金始终控制配置节奏，择机把握利率债的投资机会，品种上以短久期的中高等级信用债为主，提升组合流动性。密切关注高收益债券的信用风险暴露，严格控制其持仓比例，防控信用风险。同时，密切关注权益市场变化以及转债个券可能存在的条款博弈机会，择机进行波段操作，有效提升组合收益。

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1.0834元，本报告期份额净值增长率为0.27%，业绩比较基准收益率为-0.06%。

§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	7,711,303.35	1.19
	其中：股票	7,711,303.35	1.19
2	固定收益投资	592,537,397.53	91.20
	其中：债券	592,537,397.53	91.20
	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	33,732,179.48	5.19
6	其他资产	15,747,796.09	2.42
7	合计	649,728,676.45	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,616,583.35	1.39
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	2,094,720.00	0.52
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,711,303.35	1.91

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	300181	佐力药业	281,533	5,616,583.35	1.39
2	600763	通策医疗	64,000	2,094,720.00	0.52

注：本基金本报告期末仅持有上述两支股票。

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	9,967,000.00	2.47
	其中：政策性金融债	9,967,000.00	2.47
4	企业债券	467,792,981.04	115.87
5	企业短期融资券	29,888,000.00	7.40
6	中期票据	-	-
7	可转债	84,889,416.49	21.03
8	其他	-	-
9	合计	592,537,397.53	146.77

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	350,000	34,261,500.00	8.49
2	122102	11广汇01	289,920	29,279,020.80	7.25
3	113002	工行转债	250,000	27,707,500.00	6.86
4	122757	11丹东债	209,450	21,736,721.00	5.38
5	122727	12东胜债	200,000	21,092,000.00	5.22

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国债期货交易情况说明

5.8.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

5.8.2 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。

5.8.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未进行国债期货投资。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.9.2 基金的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	79,190.16
2	应收证券清算款	195,274.31
3	应收股利	-
4	应收利息	15,467,361.46
5	应收申购款	5,970.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,747,796.09

5.9.4 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	8.49
2	113002	工行转债	27,707,500.00	6.86
3	110022	同仁转债	6,682,500.00	1.66
4	110020	南山转债	6,589,779.00	1.63
5	113003	重工转债	3,178,500.00	0.79
6	110023	民生转债	2,189,208.90	0.54
7	110016	川投转债	1,266,200.00	0.31
8	110018	国电转债	1,088,600.00	0.27
9	125089	深机转债	964,310.00	0.24
10	110007	博汇转债	810,953.10	0.20

5.9.5 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。

5.9.6 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。

§６ 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	417,645,439.52
报告期期间基金总申购份额	2,998,302.74
减：报告期期间基金总赎回份额	48,024,132.43
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	372,619,609.83

§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、《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》；

3、《长盛积极配置债券型证券投资基金托管协议》；

4、《长盛积极配置债券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

长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金

【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	长盛季季红1年期债券
基金主代码	000145
交易代码	000145
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月14日
报告期末基金份额总额	1,396,003,609.71份
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，给投资者带来长期的现金红利收益。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类金融工具，不直接买入股票、权证等权益类金融工具。本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配。本基金的投资策略包括大类资产配置策略、债券组合管理策略和期限管理策略。 本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置，同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险 收益平衡，以稳健提升投资组合回报。 由于本基金封闭期为一年，基金规模相对稳定，但在开放期内本基金规模的不确定性增强，本基金将采用期限管理策略，分散化投资于不同剩余期限标的，临近开放期时，在最大限度保证收益的同时将组合剩余期限降低，保证开放期内具备足够流动性应对可能发生的组合规模变化。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，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	长盛季季红1年期债券A　　长盛季季红1年期债券C
下属两级基金的交易代码	000145　　000146
报告期末下属两级基金的份额总额	811,480,378.28份　　584,523,231.43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）	
	长盛季季红1年期债券A	长盛季季红1年期债券C
1.本期已实现收益	7,272,294.82	4,793,149.26
2.本期利润	6,100,561.24	3,949,147.63
3.加权平均基金份额本期利润	0.0075	0.0068
4.期末基金资产净值	816,765,316.87	587,808,080.44
5.期末基金份额净值	1.007	1.006

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

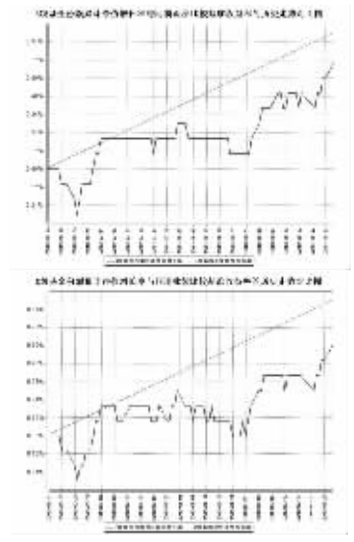
长盛季季红1年期债券A

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	0.80%	0.05%	0.76%	0.01%	0.04%	0.04%

长盛季季红1年期债券C

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	0.70%	0.07%	0.76%	0.01%	-0.06%	0.06%

3.2.2 自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



注：1、本基金基金合同生效日为2013年6月14日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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		
贾志敏	本基金基金经理、长盛货币市场基金基金经理、长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理、长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、固定收益部副总监。	2013年6月14日	-	7年	男，1982年3月出生，中国国籍。北京大学经济学硕士，曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作。2012年11月底加入长盛基金管理有限公司，现任固定收益部副总监、长盛货币市场基金基金经理、长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理、长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理、长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛双月红1年期定期开放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、《长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规、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

海外市场，美国3季度道琼斯指数涨1.48%，纳斯达克涨10.82%；欧洲德国法兰克福DAX指数涨7.98%，伦敦富时100指数上涨3.97%。大宗商品在3季度止跌反弹。

国内市场3季度市场风格和结构的分化被继续强化。流动性压力趋缓，上海自贸区改革、土地流转预期获得趋势性机会、上证指数上涨9.88%。市场风格的分化加剧，以创业板、传媒信息服务为代表的新兴行业持续获得高收益，其中创业板指数实现了35%的上涨。

在3季度的投资运作中，我们根据市场风格演变和个股的基本面的情况，在维持红利价值股风格的前提下，适度增加了动量成长股的投资比重。

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0.909元，本报告期份额净值增长率为6.94%，业绩比较基准收益率为6.74%。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,533,858,194.50	72.26
	其中：债券	1,533,858,194.50	72.26
	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	498,525,485.86	23.49
6	其他资产	90,214,780.71	4.25
7	合计	2,122,598,461.07	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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	913,865,194.50	65.06
5	企业短期融资券	619,993,000.00	44.14
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,533,858,194.50	109.20

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	122672	12西城投	525,500	55,965,750.00	3.98
2	122682	12营口债	500,000	55,620,000.00	3.96
3	124305	13瓦国资	500,000	51,250,000.00	3.65
4	124310	13洪水利	500,000	50,500,000.00	3.60
5	124096	12淮城资	501,000	50,370,540.00	3.59

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国债期货交易情况说明

5.8.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

5.8.2 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。

5.8.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未进行国债期货投资。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	320,427.43
2	应收证券清算款	61,640,678.69
3	应收股利	-
4	应收利息	28,253,674.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,214,780.71

5.9.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.9.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

5.9.4 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。

§６ 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛季季红1年期债券A	长盛季季红1年期债券C
报告期期初基金份额总额	811,480,378.28	584,523,231.43
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	811,480,378.28	584,523,231.43

§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、《长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》；

3、《长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金托管协议》；

4、《长盛季季红1年期定期开放债券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

长盛量化红利策略股票型证券投资基金

【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：中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	长盛量化红利股票
基金主代码	080005
交易代码	080005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年11月25日
报告期末基金份额总额	234,706,858.64份
投资目标	本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标，并追求风险调整后的收益最大化，满足投资人长期稳健的投资收益需求。
投资策略	本基金通过严格的数量化股票选择方法生成红利风格股票池，在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合，从而形成基于核心-卫星投资策略的股票资产组合。其中，大类资产配置策略综合考虑宏观经济、政策导向和市场环境（市场估值水平、资金供求）等因素，股票投资中将以红利股票投资为主导，以价值型企业及分红能力作为选择投资对象的核心标准。
业绩比较基准	75%×中证红利指数+25%×中证综合债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金产品，风险高于混合性基金，债券基金，货币市场基金，属于较高风险，较高回报的基金产品
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

§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	-2,227,652.67
2.本期利润	14,062,811.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0589
4.期末基金资产净值	213,245,931.29
5.期末基金份额净值	0.909

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。

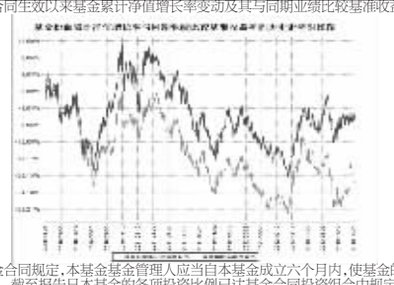
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	6.94%	0.96%	6.74%	1.16%	0.20%	-0.20%

3.2.2 自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



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自本基金成立六个月内，使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日本基金的各项投资比例已达基金合同投资组合中规定的各项比例。

§４ 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

|