

长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金

2014 第一季度报告

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:2014年7月18日
重要提示
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理并运用基金资产,但不保证基金一定盈利...

4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.1.1 报告期内基金投资策略和运作分析
1.报告期内行情回顾
二季度,随着稳增长政策的逐步实施,经济基本面出现企稳迹象,但总体仍相对疲弱,通胀水平处于低位...

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属证券投资基金名称, 报告期末下属证券投资基金份额

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 -- --
2 固定收益投资 921,572,045.00 96.80
其中:债券 921,572,045.00 96.80
资产支持证券 -- --
3 贵金属投资 -- --
4 买入返售金融资产 -- --
5 其他金融资产 -- --
6 银行存款和结算备付金合计 1,683,945.11 0.18
7 其他资产 28,806,696.65 3.03
8 合计 923,256,090.76 100.00

Table with 2 columns: 序号, 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)
1.本期已实现收益 3,579,688.76
2.本期利润 5,915,796.20
3.加权平均基金份额本期利润 0.0227
4.期末基金份额净值 274,282,843.28

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1 国债券种 205,070,450.00 32.88
2 央行票据 706,379,000.00 113.27
3 中期票据 161,230,000.00 1.62
4 企业债券 -- --
5 短期融资券 -- --
6 可转债 -- --
8 其他 -- --
9 合计 921,572,045.00 147.77

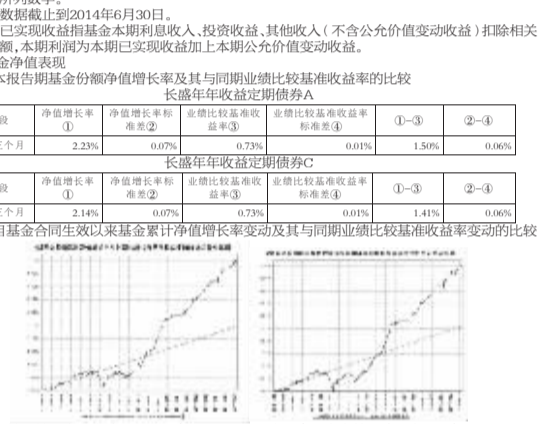


Table with 2 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1 041334683 13国债CP002 400,000 40,292,000.00 6.48
2 041335072 13国债CP001 400,000 40,388,000.00 6.48
3 041326338 13国债FC001 400,000 40,568,000.00 6.47
4 041350713 13国债CP001 400,000 40,522,000.00 6.47
5 041353800 13国债CP001 300,000 30,366,000.00 4.87

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
姓名 职务 任职日期 离任日期
曹 1963年5月出生,中国国籍,北京大学经济学博士,曾任中信银行投行部副总经理...

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)
1 银行存款 18,776,077.00
2 应收证券清算款 968,757.54
3 应收利息 27,803,973.24
4 其他应收款 -- --
5 应收申购款 -- --
6 其他应付款 -- --
7 待摊费用 -- --
8 其他 -- --
9 合计 28,806,696.65

4.2 管理人对于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》及其他各项法律法规,以及基金合同和基金托管协议的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理并运用基金资产,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。

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1 固定收益投资 921,572,045.00 15.62
其中:债券 921,572,045.00 15.62
资产支持证券 -- --
2 买入返售金融资产 5,100,000.00 26.44
其中:买入返售的买入返售金融资产 -- --
3 银行存款和结算备付金合计 11,171,989.71 57.65
4 其他资产 55,573.55 0.29
5 合计 19,286,843.35 100.00

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、投资决策与决策、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利。

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1 国债券种 205,070,450.00 32.88
2 央行票据 706,379,000.00 113.27
3 中期票据 161,230,000.00 1.62
4 企业债券 -- --
5 短期融资券 -- --
6 可转债 -- --
8 其他 -- --
9 合计 921,572,045.00 147.77

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
回顾2014年一季度,货币政策保持中性偏宽松,除个别月末时点受财政收紧等因素影响有波动外,市场流动性总体较为宽松,债券市场收益率整体下行,货币市场利率低位运行,1个月期以上存款利率下降不足4%。

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1 固定收益投资 921,572,045.00 15.62
其中:债券 921,572,045.00 15.62
资产支持证券 -- --
2 买入返售金融资产 5,100,000.00 26.44
其中:买入返售的买入返售金融资产 -- --
3 银行存款和结算备付金合计 11,171,989.71 57.65
4 其他资产 55,573.55 0.29
5 合计 19,286,843.35 100.00

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
姓名 职务 任职日期 离任日期
曹 1963年5月出生,中国国籍,北京大学经济学博士,曾任中信银行投行部副总经理...

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1 国债券种 205,070,450.00 32.88
2 央行票据 706,379,000.00 113.27
3 中期票据 161,230,000.00 1.62
4 企业债券 -- --
5 短期融资券 -- --
6 可转债 -- --
8 其他 -- --
9 合计 921,572,045.00 147.77

长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金

2014 第一季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日
重要提示
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理并运用基金资产,但不保证基金一定盈利...

4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.1.1 报告期内基金投资策略和运作分析
1.报告期内行情回顾
二季度,随着稳增长政策的逐步实施,经济基本面出现企稳迹象,但总体仍相对疲弱,通胀水平处于低位...

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属证券投资基金名称, 报告期末下属证券投资基金份额

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 -- --
2 固定收益投资 409,008,200.35 81.01
其中:债券 409,008,200.35 81.01
资产支持证券 -- --
3 贵金属投资 -- --
4 金融衍生品投资 -- --
5 买入返售金融资产 -- --
6 银行存款和结算备付金合计 82,251,118.56 16.29
7 其他资产 13,626,295.77 2.70
8 合计 504,885,614.68 100.00

Table with 2 columns: 序号, 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)
1.本期已实现收益 2,678,860.60
2.本期利润 3,094,520.35
3.加权平均基金份额本期利润 0.0206
4.期末基金份额净值 193,823,279.49

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1 国债券种 257,601,200.35 73.21
2 央行票据 151,407,000.00 43.03
3 中期票据 -- --
4 企业债券 -- --
5 企业短期融资券 -- --
6 可转债 -- --
7 待摊费用 -- --
8 其他 -- --
9 合计 409,008,200.35 116.24



Table with 2 columns: 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 132492 13国债17 200,000 20,000,000.00 5.76
2 041339079 13国债FC001 200,000 20,262,000.00 5.72
3 041363088 13央行票据003 200,000 20,180,000.00 5.74
4 112107 09年国债 174,000 17,502,500.00 4.93
5 12220 09年国债 174,000 17,478,000.00 4.97

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
姓名 职务 任职日期 离任日期
曹 1963年3月出生,中国国籍,北京大学经济学博士,曾任中信银行投行部副总经理...

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额(元)
1 银行存款 193,721,547.74 154,413,334.56
2 应收证券清算款 145,836.53
3 应收利息 13,473,697.29
4 其他应收款 -- --
5 应收申购款 -- --
6 其他应付款 -- --
7 待摊费用 -- --
8 其他 -- --
9 合计 134,286,295.77

4.2 管理人对于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》及其他各项法律法规,以及基金合同和基金托管协议的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理并运用基金资产,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。

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1 固定收益投资 409,008,200.35 81.01
其中:债券 409,008,200.35 81.01
资产支持证券 -- --
2 买入返售金融资产 5,100,000.00 26.44
其中:买入返售的买入返售金融资产 -- --
3 银行存款和结算备付金合计 11,171,989.71 57.65
4 其他资产 55,573.55 0.29
5 合计 19,286,843.35 100.00

长盛添利30天理财债券型证券投资基金

2014 第一季度报告

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:2014年7月18日
重要提示
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理并运用基金资产,但不保证基金一定盈利...

4.1 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.1.1 报告期内基金投资策略和运作分析
二季度,随着稳增长政策的逐步实施,经济基本面出现企稳迹象,但总体仍相对疲弱,通胀水平处于低位...

Table with 2 columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人, 下属证券投资基金名称, 报告期末下属证券投资基金份额

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1 权益投资 -- --
2 固定收益投资 921,572,045.00 96.80
其中:债券 921,572,045.00 96.80
资产支持证券 -- --
3 贵金属投资 -- --
4 买入返售金融资产 -- --
5 其他金融资产 -- --
6 银行存款和结算备付金合计 1,683,945.11 0.18
7 其他资产 28,806,696.65 3.03
8 合计 923,256,090.76 100.00

Table with 2 columns: 序号, 主要财务指标, 报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)
1.本期已实现收益 3,579,688.76
2.本期利润 5,915,796.20
3.加权平均基金份额本期利润 0.0227
4.期末基金份额净值 274,282,843.28

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1 国债券种 205,070,450.00 32.88
2 央行票据 706,379,000.00 113.27
3 中期票据 161,230,000.00 1.62
4 企业债券 -- --
5 短期融资券 -- --
6 可转债 -- --
8 其他 -- --
9 合计 921,572,045.00 147.77

长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金

2014 第一季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18日
重要提示
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理并运用基金资产,但不保证基金一定盈利...

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1 国债券种 257,601,200.35 73.21
2 央行票据 151,407,000.00 43.03
3 中期票据 -- --
4 企业债券 -- --
5 企业短期融资券 -- --
6 可转债 -- --
7 待摊费用 -- --
8 其他 -- --
9 合计 409,008,200.35 116.24

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
姓名 职务 任职日期 离任日期
曹 1963年3月出生,中国国籍,北京大学经济学博士,曾任中信银行投行部副总经理...

Table with 2 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)
1 固定收益投资 409,008,200.35 81.01
其中:债券 409,008,200.35 81.01
资产支持证券 -- --
2 买入返售金融资产 5,100,000.00 26.44
其中:买入返售的买入返售金融资产 -- --
3 银行存款和结算备付金合计 11,171,989.71 57.65
4 其他资产 55,573.55 0.29
5 合计 19,286,843.35 100.00

4.2 管理人对于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》及其他各项法律法规,以及基金合同和基金托管协议的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理并运用基金资产,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。

Table with 2 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)
1 国债券种 205,070,450.00 32.88
2 央行票据 706,379,000.00 113.27
3 中期票据 161,230,000.00 1.62
4 企业债券 -- --
5 短期融资券 -- --
6 可转债 -- --
8 其他 -- --
9 合计 921,572,045.00 147.77