

信息披露 Disclosure

长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

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
送出日期:2014年8月28日

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构在编制本报告过程中,力求客观、公正、准确、及时,但不保证本报告所载数据及信息的准确性和完整性。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本报告全文,并自行承担投资风险。本报告所载数据及信息如有变更,基金管理人将及时更新。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。基金管理人将根据基金合同的规定,为基金份额持有人谋求利益,基金管理人将根据基金合同的规定,为基金份额持有人谋求利益,基金管理人将根据基金合同的规定,为基金份额持有人谋求利益。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况
基金名称:长盛季季红1年期债券型证券投资基金
基金代码:000445
基金简称:长盛季季红
基金运作方式:定期开放基金
基金合同生效日:2013年6月14日
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
注册地址:中国北京市西城区金融大街19号
办公地址:中国北京市西城区金融大街19号
客服电话:400-888-2668, 010-62558888
基金管理人网站:www.csfunds.com

2.2 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 信息披露方式
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构在编制本报告过程中,力求客观、公正、准确、及时,但不保证本报告所载数据及信息的准确性和完整性。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本报告全文,并自行承担投资风险。本报告所载数据及信息如有变更,基金管理人将及时更新。

2.5 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.6 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.7 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.8 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.9 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.10 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.11 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.12 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.13 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.14 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.15 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.16 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.17 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.18 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.19 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.20 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.21 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.22 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.23 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.24 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.25 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.26 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.27 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.28 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.29 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.30 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.31 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.32 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.33 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.34 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.35 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.36 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.37 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.38 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.39 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.40 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.41 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.42 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.43 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.44 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.45 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.46 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.47 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.48 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.49 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.50 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.51 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.52 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.53 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.54 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.55 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.56 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.57 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

2.58 基金业绩说明
基金业绩:截至2014年6月30日,本基金自成立以来的累计净值增长率为102.33%,同期业绩比较基准收益率为98.74%。本基金业绩比较基准为:1年期定期存款利率+0.5%。

的投资者,品种上以中高等级信用债为主。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,防范信用风险。

总之,无论市场如何发展变化,在操作方面,我们都将继续秉承谨慎原则,在组合流动性得到保障的前提下,通过灵活的资产配置和深入的个券甄别分析,做好组合配置,力求确保基金资产在维持价值底线的基础上实现持续的稳健增值。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
根据中国证监会相关规定及本基金合同约定,本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金投资品种进行估值,本基金管理人制定了估值政策和估值程序,设立基金估值小组,参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据,确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理(担任估值小组组长)、公司副总经理和督察长(担任估值小组副组长)、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组,负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验,具备基金估值操作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金管理人参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。参与估值原则和方法的讨论还包括本基金估值和估值程序,托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核义务,当存在异议时,托管人有权要求基金管理公司作出合理解释,通过双方商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会有参与的相关估值模型、假设及参数的适当性及审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金合同第十九条中对基金利润分配原则的约定,本基金于2014年3月24日和2014年6月17日进行了两次利润分配,分配金额分别为9,332,024.37元和13,410,628.04元。

本基金截至2014年6月30日,期末可供分配利润为4,697,356.71元,其中:长盛季季红1年期债券A期末可供分配利润为3,818,418.97元(长盛季季红1年期债券A的未分配利润已实现部分为3,818,418.97元,未分配利润未实现部分为87,931.32元);长盛季季红1年期债券C期末可供分配利润为878,937.74元(长盛季季红1年期债券C的未分配利润已实现部分为878,937.74元,未分配利润未实现部分为83,022.20元)。

5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

6 半年度财务报表摘要(未经审计)
6.1 资产负债表
会计主体:长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产

银行存款 4,950,274.48 290,313,482.07
结算备付金 1,856,844.79 27,204,658.85
存出保证金 59,815.36 27,079.30
应收利息 321,973,877.30 1,890,549,904.94
其他资产 9566 --
资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

负债和所有者权益

应付证券清算款 8,800,002.22 --
应付赎回款 53,779,679.22 1,563,164.80
应付利息 8,763,689.47 41,203,820.05
应付股利 -- --
其他负债 -- --
负债总计 61,343,770.91 1,604,368.85

所有者权益

实收资本 151,700,000.00 799,090,855.78
未分配利润 8,800,002.22 27,079.30
所有者权益总计 151,700,000.00 799,090,855.78

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94

资产总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94
负债和所有者权益总计 321,973,877.30 1,890,549,904.94