

信息披露 disclosure

长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金

“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:中国银行银行股份有限公司
送出日期:2014年08月28日

1.1 重要提示
基金管理人、董事、监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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人中国银行银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。
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	长盛添利60天理财发起式
基金代码	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	2013年11月29日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	35,267,077.04份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称:	长盛添利60天理财发起式A
下属分级基金的代码:	080018
报告期末下属分级基金的资产总额	14,466,164.74元

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求基金资产增值的基础上,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	本基金采取自上而下的资产配置策略,在确定资产配置比例的基础上,通过自下而上的行业分析和个股选择,进行资产配置,力求实现基金资产的长期增值,并控制风险,追求收益最大化。
业绩比较基准	七天通知存款利率。
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,高于货币型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长盛基金管理有限公司	中国银行银行股份有限公司
信息披露负责人	孙金松	王东明
联系电话	010-82019888	010-65948066
电子邮箱	zq@csfund.com.cn	zq@boc.com.cn
客户服务电话	400-888-2666, 010-62350888	
传真	010-82359888	010-65949442

2.4 信息披露方式
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址: <http://www.csfund.com.cn>
基金半年度报告备置地点: 基金管理人及基金托管人住所

3.1 主要会计数据和财务指标

项目	本报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	本报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	本报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)
3.1.1 期间数据指标			
本期已实现收益	567,502.83	229,292.32	
本期利润总额	567,502.83	229,292.32	
本期净利润	567,502.83	229,292.32	
3.1.2 期末数据指标			
期末基金资产净值	14,466,164.74	20,620,912.30	
期末基金份额净值	1.00	1.00	

3.2 基金业绩表现
3.2.1 基金净值增长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	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	份额净值增长率-业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去一个月	0.2210%	0.0021%	0.1189%	0.0000%	0.1189%
过去三个月	0.7526%	0.0108%	0.5360%	0.0000%	0.4796%
过去六个月	1.9449%	0.0313%	1.6495%	0.0000%	1.2754%
过去一年	3.6665%	0.0929%	1.3509%	0.0000%	2.3168%
自基金合同生效以来	5.6109%	0.0029%	2.1415%	0.0000%	3.4694%

长盛添利60天理财发起式B

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	份额净值增长率-业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去一个月	0.2433%	0.0021%	0.1110%	0.0000%	0.1325%
过去三个月	0.8248%	0.0108%	0.3366%	0.0000%	0.4882%
过去六个月	2.0826%	0.0313%	1.6495%	0.0000%	1.4131%
过去一年	3.9488%	0.0929%	1.3509%	0.0000%	2.5988%
自基金合同生效以来	6.6093%	0.0029%	2.1415%	0.0000%	3.9278%

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

3.2.1 基金净值增长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

3.2.2 基金业绩表现

注:1.本基金收益分配是按月结转份额。
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 基金业绩表现

组成人员均具有多年证券、基金从业经验,具备基金估值作业、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经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执行。
参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所,托管人根据法律法规要求对基金估值和净值计算履行复核责任,当存在异议时,托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见,会计师事务所对估值业务采用的相关估值模型、假设及方法进行审查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》的规定以及本基金基金合同第十九条中对基金利润分配原则的约定,本基金每日进行收益计算并分配,自基金合同生效日起每将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人,并在运作期末集中支付,使基金账面份额净值始终保持1.00元。同时本基金各类基金份额对应的可分配收益将有所不同,同一类别的每份基金份额享有同等分配权。

按照上述办法及基金合同约定的,2014上半年度分配利润 796,806.15元,其中:A类别份额分配利润 567,502.83元,B类别份额分配利润 229,323.27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
本报告期内,中国银行银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金(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,对本基金托管人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额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地复核,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
本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6.1 资产负债表
会计主体:长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金
报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本报告期末 2014年6月30日	上年度期末 2013年12月31日
货币资金	30,826,586.11	31,001,264.88
交易性金融资产	8,000.00	150,476.19
应收利息	2,001,394.27	20,001,807.45
其他资产	—	—
资产总计	32,834,519.03	53,680,488.73

负债和所有者权益

负债	本报告期末 2014年6月30日	上年度期末 2013年12月31日
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
应付利息	115,091.43	826,543.32
应付赎回款	105,091.43	826,543.32
应付管理人报酬	7,065.49	12,970.90
应付托管费	2,093.48	3,843.24
应付销售服务费	3,939.89	10,624.78
应付交易费用	155.00	2,877.70
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付股利	—	—
预收款项	—	—
其他应付款	—	—
负债合计	163,188.13	540,500.00
所有者权益	32,671,330.90	53,139,988.73
实收基金	35,267,077.04	53,191,928.41
未分配利润	—	—
所有者权益合计	35,267,077.04	53,191,928.41
负债和所有者权益总计	35,434,519.03	53,680,488.73

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额总额35,267,077.04份,其中A类基金份额总额为14,466,164.74份,占基金份额总额41.02%;B类基金份额总额为20,800,912.30份,占基金份额总额58.98%。

6.2 利润表
会计主体:长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本报告期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年6月30日
一、收入	1,077,332.16	13,849,960.07
1.利息收入	1,077,332.16	13,849,960.07
其中:存款利息收入	822,244.02	12,381,220.77
债券利息收入	70,724.42	1,422,662.32
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	184,363.72	42,938.94
其他利息收入	—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)	—	2,234.11
其中:股票投资收益	—	—
债券投资收益	—	—
其他投资收益	—	—
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具收益	—	—
公允价值变动收益(损失以“-”填列)	—	—
其他公允价值变动收益(损失以“-”填列)	—	—
3.其他收入(损失以“-”填列)	—	—
减:费用	280,437.01	2,679,451.38
其中:管理人报酬	52,702.78	897,545.14
托管费	15,615.63	265,209.26
销售服务费	39,545.24	105,627.20
4.其他费用	—	—
5.其他支出	—	—
其中:卖出回购金融资产支出	—	—
其他支出	—	—
利润总额(亏损以“-”填列)	796,895.15	11,169,608.69
净利润(亏损以“-”填列)	796,895.15	11,169,608.69

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本报告 2014年1月1日至 2014年6月30日	本报告 2014年1月1日至 2014年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	53,191,928.41	—
二、本期损益	796,895.15	796,895.15
三、本期基金份额变动产生的基金净值变动(金额以“-”填列)	-17,924	