

长盛同丰分级债券型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

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7月18日

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,也不保证基金净值不致发生其未来表现,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。

本报告期内2013年4月1日起至2013年6月30日止。

基金产品概况 基金名称:长盛同丰分级债券基金 基金代码:160810

基金运作方式 契约型,封闭期为18个月,封闭期内,前4个月自基金合同生效之日起每周6个月开放一次,自第5个月起每日上市交易。

基金合同生效日 2012年12月27日

报告期末基金份额总额 989,960,640.47份

投资目标 通过资产配置和个券的精选,进行积极主动的投资管理,追求基金资产的长期增值,以最大限度取得超越业绩比较基准的收益。

投资策略 以利率风险管理为核心,以资产配置为关键技术,在满足组合流动性要求上,结合不同类属债券流动性,积极运用信用风险管理,组合配置债券资产。

业绩比较基准 中债综合指数(含债)

风险收益特征 本基金为债券型基金,属于低风险的投资品种,其长期预期收益水平低于股票型基金,高于混合型基金和股票型基金。

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

主要财务指标 本报告期(2013年4月1日至2013年6月30日)

1.本期已实现收益 20,127,826.37

2.本期公允价值变动收益 19,380,021.13

3.加权平均基金份额本期利润 0.0099

4.期末基金资产净值 999,484,418.41

5.期末基金份额总额 1,010

注:1.上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购及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.所附数据截止至2013年6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。

3.1 基金净值表现 3.2 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② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.53% 0.12% 0.12% 0.11% 0.11% 1.41% 0.01%

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

基金合同生效以来基金份额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.本基金合同生效日为2012年12月27日,截止本报告期末本基金成立未满一年。

2.按照本基金合同约定,本基金管理人按照《证券投资基金法》及基金合同第十二条的有关规定,将投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十二条(二)投资范围、(七)投资禁止行为及限制的有关约定。

3.3 其他指标 单位:人民币元

其他指标 报告(2013年4月1日至2013年6月30日)

长盛同丰分级债券A与长盛同丰分级债券B基金份额配

0.530233821

长盛同丰分级债券A的期考考

1.001

长盛同丰分级债券B的约定收益率(单利)

0.0425

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

杨勇 本基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理

注:1.上述基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定聘任和解除聘任日期。

2.“证券从业年限”指“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》的相关规定等。

4.2 报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规,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前提下,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的利益。

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、社保基金、特定客户资产管理组合。具体如下:

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7月18日

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,也不保证基金净值不致发生其未来表现,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。

本报告期内2013年4月1日起至2013年6月30日止。

基金产品概况 基金名称:长盛中证100指数基金 基金代码:519100

基金运作方式 契约型,封闭式,存续期为10年

基金合同生效日 2006年11月23日

报告期末基金份额总额 1,098,915,684.27份

投资目标 本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律跟踪和数量化风险控制,力求实现对中证100指数的有效跟踪。

投资策略 本基金为被动式指数基金,跟踪中证100指数,追求跟踪中证100指数的收益率,并控制跟踪误差。

业绩比较基准 中证100指数收益率*95%+一年期银行定期存款利率(税后)*5%

风险收益特征 本基金为被动式指数基金,跟踪中证100指数,追求跟踪中证100指数的收益率,并控制跟踪误差。

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

主要财务指标 本报告期(2013年4月1日至2013年6月30日)

1.本期已实现收益 -10,551,324.51

2.本期公允价值变动收益 -95,479,416.96

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0856

4.期末基金资产净值 715,481,837.94

5.期末基金份额总额 66511

注:1.上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购及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.所附数据截止至2013年6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。

3.1 基金净值表现 3.2 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② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -11.63% 1.40% -12.57% 1.40% 0.94% 0.00%

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

基金合同生效以来基金份额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.本基金合同生效日为2006年11月23日,截止本报告期末本基金成立未满一年。

2.按照本基金合同约定,本基金管理人按照《证券投资基金法》及基金合同第十二条的有关规定,将投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十二条(二)投资范围、(七)投资禁止行为及限制的有关约定。

3.3 其他指标 单位:人民币元

其他指标 报告(2013年4月1日至2013年6月30日)

长盛中证100指数基金基金份额配

0.530233821

长盛中证100指数的约定收益率(单利)

0.0425

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

杨勇 本基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理

注:1.上述基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定聘任和解除聘任日期。

2.“证券从业年限”指“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》的相关规定等。

4.2 报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规,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前提下,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的利益。

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、社保基金、特定客户资产管理组合。具体如下:

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7月18日

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,也不保证基金净值不致发生其未来表现,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。

本报告期内2013年4月1日起至2013年6月30日止。

基金产品概况 基金名称:长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金 基金代码:080902

基金运作方式 契约型,开放式,存续期为不定期

基金合同生效日 2008年8月4日

报告期末基金份额总额 159,844,547.03份

投资目标 选择具有创新能力和行业领先的上市公司,分享企业高速增长成长成果,在承担适度风险的基础上,追求基金资产的稳定增值。

投资策略 本基金为主动管理型股票基金,在资产配置上,主要投资于新兴产业,重点投资于具有成长性的新兴产业,追求基金资产的稳定增值。

业绩比较基准 沪深300指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%

风险收益特征 本基金为主动管理型股票基金,在资产配置上,主要投资于新兴产业,重点投资于具有成长性的新兴产业,追求基金资产的稳定增值。

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

主要财务指标 本报告期(2013年4月1日至2013年6月30日)

1.本期已实现收益 10,206,307.08

2.本期公允价值变动收益 -1,021,024.98

3.加权平均基金份额本期利润 0.0643

4.期末基金资产净值 162,072,264.13

5.期末基金份额总额 1,019

注:1.上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购及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.所附数据截止至2013年6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。

3.1 基金净值表现 3.2 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② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -0.25% 1.34% 1.74% 1.44% 7.19% 0.60%

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

基金合同生效以来基金份额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.本基金合同生效日为2008年8月4日,截止本报告期末本基金成立未满一年。

2.按照本基金合同约定,本基金管理人按照《证券投资基金法》及基金合同第十二条的有关规定,将投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十二条(二)投资范围、(七)投资禁止行为及限制的有关约定。

3.3 其他指标 单位:人民币元

其他指标 报告(2013年4月1日至2013年6月30日)

长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金份额配

0.530233821

长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金的约定收益率(单利)

0.0425

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

王克玉 本基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理

注:1.上述基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定聘任和解除聘任日期。

2.“证券从业年限”指“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》的相关规定等。

4.2 报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规,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前提下,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的利益。

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、社保基金、特定客户资产管理组合。具体如下:

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7月18日

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,也不保证基金净值不致发生其未来表现,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。

本报告期内2013年4月1日起至2013年6月30日止。

基金产品概况 基金名称:长盛同丰分级债券基金 基金代码:160810

基金运作方式 契约型,封闭式,存续期为10年

基金合同生效日 2012年12月27日

报告期末基金份额总额 989,960,640.47份

投资目标 通过资产配置和个券的精选,进行积极主动的投资管理,追求基金资产的长期增值,以最大限度取得超越业绩比较基准的收益。

投资策略 以利率风险管理为核心,以资产配置为关键技术,在满足组合流动性要求上,结合不同类属债券流动性,积极运用信用风险管理,组合配置债券资产。

业绩比较基准 中债综合指数(含债)

风险收益特征 本基金为债券型基金,属于低风险的投资品种,其长期预期收益水平低于股票型基金,高于混合型基金和股票型基金。

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

主要财务指标 本报告期(2013年4月1日至2013年6月30日)

1.本期已实现收益 20,127,826.37

2.本期公允价值变动收益 19,380,021.13

3.加权平均基金份额本期利润 0.0099

4.期末基金资产净值 999,484,418.41

5.期末基金份额总额 1,010

注:1.上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购及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.所附数据截止至2013年6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。

3.1 基金净值表现 3.2 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② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.53% 0.12% 0.12% 0.11% 0.11% 1.41% 0.01%

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

基金合同生效以来基金份额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.本基金合同生效日为2012年12月27日,截止本报告期末本基金成立未满一年。

2.按照本基金合同约定,本基金管理人按照《证券投资基金法》及基金合同第十二条的有关规定,将投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十二条(二)投资范围、(七)投资禁止行为及限制的有关约定。

3.3 其他指标 单位:人民币元

其他指标 报告(2013年4月1日至2013年6月30日)

长盛同丰分级债券A与长盛同丰分级债券B基金份额配

0.530233821

长盛同丰分级债券A的期考考

1.001

长盛同丰分级债券B的约定收益率(单利)

0.0425

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

杨勇 本基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理、长盛同丰分级债券基金基金经理

注:1.上述基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定聘任和解除聘任日期。

2.“证券从业年限”指“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》的相关规定等。

4.2 报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金法》及其他各项法律法规,《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规,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前提下,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的利益。

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、社保基金、特定客户资产管理组合。具体如下:

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7月18日

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,也不保证基金净值不致发生其未来表现,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及更新。

本报告期内2013年4月1日起至2013年6月30日止。

基金产品概况 基金名称:长盛中证100指数基金 基金代码:519100

基金运作方式 契约型,封闭式,存续期为10年

基金合同生效日 2006年11月23日

报告期末基金份额总额 1,098,915,684.27份

投资目标 本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律跟踪和数量化风险控制,力求实现对中证100指数的有效跟踪。

投资策略 本基金为被动式指数基金,跟踪中证100指数,追求跟踪中证100指数的收益率,并控制跟踪误差。

业绩比较基准 中证100指数收益率*95%+一年期银行定期存款利率(税后)*5%

风险收益特征 本基金为被动式指数基金,跟踪中证100指数,追求跟踪中证100指数的收益率,并控制跟踪误差。

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

主要财务指标 本报告期(2013年4月1日至2013年6月30日)

1.本期已实现收益 -10,551,324.51

2.本期公允价值变动收益 -95,479,416.96

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0856

4.期末基金资产净值 715,481,837.94

5.期末基金份额总额 66511

注:1.上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购及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.所附数据截止至2013年6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。

3.1 基金净值表现 3.2 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② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 -11.63% 1.40% -12.57% 1.40% 0.94% 0.00%

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

基金合同生效以来基金份额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.本基金合同生效日为2006年11月23日,截止本报告期末本基金成立未满一年。

2.按照本基金合同约定,本基金管理人按照《证券投资基金法》及基金合同第十二条的有关规定,将投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十二