长盛同丰分级债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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	长盛同丰分级债券	
基金主代码	160810	
交易代码	160810	
基金运作方式	契约型。封闭期为18个月,封闭期内,同丰A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,同丰B封闭运作并上市交易;本基金基金合同生效后18个月届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。	
基金合同生效日	2012年12月27日	
报告期末基金份额总额	989,966,640.47份	
投资目标	通过分析影响债券市场的各类要素,进行积极主动的投资管理,追求基金资产的稳定增值,以最大程度上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,以久期配置为关键技术,在满足组合流动性要求上,结合不同类型债券流动性、税收和信用风险等因素,综合确定债券组合的类属配置进行个券选择,控制风险,获取超额的投资收益。具体投资运作中将运用换券利差交易策略、凸性套利交易策略以及骑乘收益率曲线策略等多样的操作策略。	
业绩比较基准	中债综合指数(全价)	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于较低风险的证券投资基金品种,其长期预期收益和平均风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。在分级基金运作期内,本基金经过基金份额分级后,同丰A为低风险、收益相对稳定的稳健收益特征的基金份额;同丰B为较高风险、较高收益的增强收益特征的基金份额。	
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	长盛同丰分级债券A	长盛同丰分级债券B(场内简称:同丰B)
下属两级基金的交易代码	160811	150115
报告期末下属两级基金的份额总额	343,028,488.99份	646,938,151.48份
下属两级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定的稳健收益特征	较高风险、较高收益的增强收益特征

§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	-9,438,006.09
2.本期利润	-19,805,201.02
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0200
4.期末基金资产净值	979,679,280.41
5.期末基金份额净值	0.990

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。

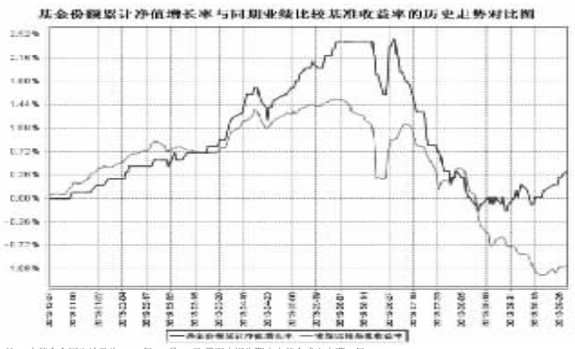
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-1.98%	0.10%	-1.92%	0.07%	-0.06%	0.03%

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.本基金合同生效日为2012年12月27日,截至本报告期末本基金成立未满一年。

2.按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十八条(二)投资范围、(七)投资禁止行为与限制的有关约定。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。

3.3 其他指标

单位:人民币元

其他指标	报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)
长盛同丰分级债券A与长盛同丰分级债券B基金份额配比	0.53023382:1
期末长盛同丰分级债券A份额参考净值	1.011
期末长盛同丰分级债券B份额参考净值	0.978
长盛同丰分级债券A的约定年收益率(单利)	0.0425

§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		
杨衡	本基金基金经理,长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理,长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理,长盛纯债债券型证券投资基金基金经理。	2012年12月27日	-	6年	男,1975年10月出生,中国国籍。中国科学院数学与系统科学研究院博士,博士后。2007年7月进入长盛基金管理公司,历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理。现任长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理,长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理,长盛同丰分级债券型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛纯债债券型证券投资基金基金经理。
张帆	本基金基金经理,长盛纯债债券型证券投资基金基金经理。	2013年9月18日	-	6年	男,1983年1月出生,中国国籍。华中科技大学硕士。曾在长江证券股份有限公司从事债券研究、债券投资工作。2012年4月加入长盛基金管理有限公司,曾任非信用研究员。现任长盛同丰分级债券型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛纯债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、"任券从业年限"中"任券从业"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、《长盛同丰分级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或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

三季度中上旬,资金面维持紧平衡状态,资金利率总体上维持在较高水平,利率债受一级市场发行持续冲击,收益率全线大幅上扬,十年期国债收益率一度达到近几年高点,同时受资金面影响,信用债市场亦继续走弱,中长期品种收益率有一定幅度上行,公司债信用评级调降加剧了信用债市场的弱势表现。随着9月资金面缓解,债券市场总体上呈现先跌后涨的格局。相对与9月初,国债收益率总体有所下行,信用债受较低的信用利差影响,收益率多以上行为主。

报告期内,组合策略构建上保持谨慎,从季初开始降低杠杆水平,在中下旬利用资金面缓解的机会再逐渐提升组合杠杆水平。在市场急剧调整时,组合适时对持仓品种和结构进行了调整,一定程度上回避了短期利率大幅上行对组合的负面影响,9月提升杠杆比例,亦增加了组合的利差收入和债市反弹时的利润收入。

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0.990元,本报告期份额净值增长率为-1.98%,同期业绩比较基准增长率为-1.92%。

§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	1,324,931,865.48	95.77
	其中:债券	1,324,931,865.48	95.77
	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	29,684,314.84	2.15
6	其他资产	28,795,197.28	2.08
7	合计	1,383,411,377.60	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。

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。

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	159,610,000.00	16.29
	其中:政策性金融债	159,610,000.00	16.29
4	企业债券	794,069,865.48	81.05
5	企业短期融资券	320,082,000.00	32.67
6	中期票据	51,170,000.00	5.22
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,324,931,865.48	135.24

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	130201	13国开01	600,000	59,850,000.00	6.11
2	122727	12东胜债	491,130	51,794,569.80	5.29
3	1282400	12汉城投MTN2	500,000	51,170,000.00	5.22
4	130324	13进出24	500,000	50,080,000.00	5.11
5	041360065	13湖潭龙CP001	500,000	50,045,000.00	5.11

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

注: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

注: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 本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记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.9.2 基金投资的前十名股票,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	218,625.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,554,122.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	22,448.62
8	其他	-
9	合计	28,795,197.28

5.9.4 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。

5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注: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	长盛同丰分级债券A	长盛同丰分级债券B
报告期期初基金份额总额	343,028,488.99	646,938,151.48
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	343,028,488.99	646,938,151.48

注:1.本基金合同生效日为2012年12月27日。

2.本基金封闭期为18个月,同丰A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,同丰B封闭运作并上市交易。

§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公司管理基金情况。

§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、《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛同丰分级债券型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛同丰分级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和/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

长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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	长盛同辉深100等权重分级(场内简称:长盛同辉)	
基金主代码	160809	
交易代码	160809	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年9月13日	
报告期末基金份额总额	137,242,017.30份	
投资目标	本基金运用指数化投资方式,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现对深证100等权重指数的有效跟踪。	
投资策略	本基金采用完全复制法,按照成份股在深证100等权重指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪深证100等权重指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 当预期成份股发生调整,或份额发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪深证100等权重指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。	
业绩比较基准	95%×深证100等权重指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)	
风险收益特征	从基金资产整体运作来看,本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 从投资者具体持有的基金份额来看,在分级运作期内,由于基金收益分配的安排,长盛同辉深100等权重A份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额;长盛同辉深100等权重B份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。	
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	
下属三级基金的基金简称	长盛同辉深100等权重A(场内简称:同辉100A)	长盛同辉深100等权重B(场内简称:同辉100B)	长盛同辉深100等权重分级(场内简称:长盛同辉)
下属三级基金交易代码	150108	150109	160809
下属三级基金报告期末基金份额总额	66,488,531.00份	66,488,532.00份	4,264,954.30份
下属三级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定	高风险、高预期收益	较高风险、较高预期收益

§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	1,893,576.74
2.本期利润	14,652,893.82
3.加权平均基金份额本期利润	0.1020
4.期末基金资产净值	143,546,730.51
5.期末基金份额净值	1.046

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。

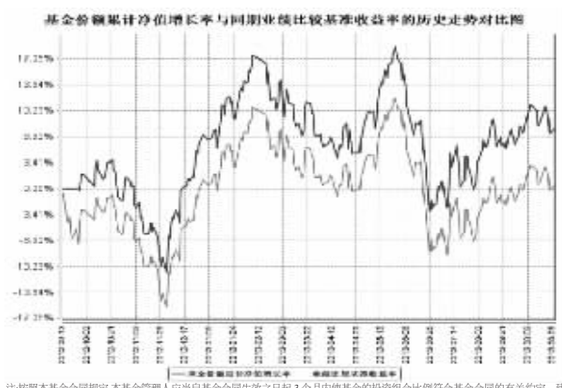
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	10.32%	1.41%	8.81%	1.43%	1.51%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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,本基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十六条(二)投资范围、(八)投资限制的有关约定。截止报告日,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		
王超	本基金基金经理,长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理,长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理。	2013年1月5日	-	6年	男,1981年9月出生,中国国籍。中央财经大学硕士,金融风险管理师(FRM)。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员,从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理,长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理。
刘斌	本基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,金融工程与量化投资部总监。	2012年9月13日	-	7年	男,1979年6月出生,中国国籍。清华大学工学学士,中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司,在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理、长盛沪深300指数证券投资基金基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部总监,长盛成长价值证券投资基金基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金(本基金)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、"任券从业年限"中"任券从业"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、《长盛同辉深证100等权重指数分级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或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

在报告期内,我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略,尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响,将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.046元,本报告期份额净值增长率为10.32%,同期业绩比较基准收益率为8.81%。报告期内,本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.07%,控制在0.35%之内;年化跟踪误差为1.48%,控制在4%之内。

§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	135,367,665.63	93.99
	其中:股票	135,367,665.63	93.99
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	5,669,051.04	3.94
6	其他资产	2,990,808.62	2.08
7	合计	144,027,525.29	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	3,031,559.99	2.11
B	采矿业	9,197,050.36	6.41
C	制造业	78,420,211.81	54.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,471,480.94	1.72
E	建筑业	3,231,998.44	2.25
F	批发和零售业	3,307,076.00	2.30
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	4,628,850.04	3.22
J	金融业	12,207,789.63	8.50
K	房地产业	10,688,396.72	7.45
L	租赁和商务服务业	1,485,542.40	1.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,078,691.90	2.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,376,384.20	0.96
S	综合	1,242,633.20	0.87
	合计	135,367,665.63	94.30

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	002024	苏宁云商	257,360	3,307,076.00	2.30
2	000783	长江证券	236,125	2,153,460.00	1.50
3	000917	电广传媒	103,492	1,935,300.40	1.35
4	002415	海康威视	67,459	1,780,917.60	1.24
5	002001	新和成	80,719	1,761,288.58	1.23
6	000063	中兴通讯	104,434	1,733,604.40	1.21
7	000039	中集集团	130,805	1,722,701.85	1.20
8	000538	云南白药	14,689	1,719,494.34	1.20
9	002041	登海种业	62,591	1,689,957.00	1.18
10	000562	宏源证券	197,524	1,639,449.20	1.14

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注: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

注: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 本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记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.9.2 基金投资的前十名股票,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	31,903.40
2	应收证券清算款	2,956,997.38
3	应收股利	-
4	应收利息	1,907.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,990,808.62

5.10.4 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处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五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积极投资股票。

5.10.6 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

项目	长盛同辉深100等权重A	长盛同辉深100等权重B	长盛同辉深100等权重分级
报告期期初基金份额总额	70,531,046.00	70,531,047.00	18,716,850.34
报告期期间基金总申购份额	-	-	145,827.61
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	27,086,356.42
报告期期间基金拆分变动份额	-4,042,515.00	-4,042,515.00	12,488,632.77
报告期期末基金份额总额	66,488,531.00	66,488,532.00	4,264,954.30

注:1.拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额及基金折算变动份额。

2.依照本基金合同的规定,本基金于2013年9月12日进行了份额折算。

§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

(一)关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金的批复;

(二)《长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金合同》;

(三)《长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金托管协议》;

(四)《长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金招募说明书》;

(五)法律意见书;

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(七)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

长盛添利30天理财债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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	长盛添利30天理财债券	
基金主代码	080016	
交易代码	080016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年10月26日	
报告期末基金份额总额	82,066,284.53份	
投资目标	在追求本金稳妥的基础上,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	本基金在投资组合管理中将采用主动投资策略,在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用,以提高投资决策的科学性与及时性,在控制风险的前提下,追求收益最大化。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。