

长盛积极配置债券型证券投资基金 2013 年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 28 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代表其未来表现。投资有风险，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其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 1 |
| 1.1 重要提示..... | 1 |
| 1.2 目录..... | 2 |
| §2 基金简介 | 4 |
| 2.1 基金基本情况..... | 4 |
| 2.2 基金产品说明..... | 4 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 4 |
| 2.4 信息披露方式..... | 5 |
| 2.5 其他相关资料..... | 5 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 15 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |
| 6.4 报表附注..... | 19 |

| | |
|--|-----------|
| §7 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 35 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 35 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 35 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 35 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 37 |
| 7.6 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..... | 37 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细..... | 37 |
| 7.8 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..... | 37 |
| 7.9 投资组合报告附注..... | 38 |
| §8 基金份额持有人信息 | 39 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 39 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 39 |
| §9 开放式基金份额变动 | 39 |
| §10 重大事件揭示 | 40 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 40 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 40 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 40 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 40 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 40 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 40 |
| 10.8 其他重大事件..... | 41 |
| §11 备查文件目录 | 43 |
| 11.1 备查文件目录..... | 43 |
| 11.2 存放地点..... | 43 |
| 11.3 查阅方式..... | 43 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金名称 | 长盛积极配置债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 长盛积极配置债券 |
| 基金主代码 | 080003 |
| 交易代码 | 080003 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2008 年 10 月 8 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 417,645,439.52 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。 |
| 投资策略 | 本基金为积极投资策略的债券型基金，不同与传统债券型基金的投资策略特点，本基金在债券类资产配置上更强调积极主动管理。在债券类资产配置上，本基金通过积极投资配置相对收益率较高的企业债、公司债、可转换债、可分离交易可转债、资产支持证券等创新债券品种，并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会，以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上，通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票，来获取股票市场的积极收益。此外，本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。 |
| 业绩比较基准 | 中证全债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，高于货币市场基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|---------------------|----------------------|
| 名称 | | 长盛基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 叶金松 | 田青 |
| | 联系电话 | 010-82019988 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | yejs@csfunds.com.cn | tianqing1.zh@ccb.com |

| | | |
|--------|--|---------------------------|
| 客户服务电话 | 400-888-2666 010-62350088 | 010-67595096 |
| 传真 | 010-82255988 | 010-66275853 |
| 注册地址 | 深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心八楼 GH 单元 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | 北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼 |
| 邮政编码 | 100088 | 100033 |
| 法定代表人 | 凤良志 | 王洪章 |

注：基金管理人的注册地址于 2013 年 7 月 5 日变更为深圳市福田区福中三路诺德金融中心主楼 10D。该事项公司已于 2013 年 7 月 12 日进行公告。

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.csfunds.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|----------------------------------|
| 注册登记机构 | 长盛基金管理有限公司 | 北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2013 年 1 月 1 日 - 2013 年 6 月 30 日) |
|---------------|--|
| 本期已实现收益 | 27,067,768.07 |
| 本期利润 | 13,826,219.64 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0278 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.55% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.91% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2013 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | -51,823.83 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0001 |
| 期末基金资产净值 | 451,269,598.82 |
| 期末基金份额净值 | 1.0805 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2013 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 25.15% |

注：1、所述基金业绩指标不包括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、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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -3.10% | 0.48% | -1.98% | 0.27% | -1.12% | 0.21% |
| 过去三个月 | -1.07% | 0.35% | -0.32% | 0.19% | -0.75% | 0.16% |
| 过去六个月 | 1.91% | 0.34% | 0.90% | 0.17% | 1.01% | 0.17% |
| 过去一年 | -0.25% | 0.31% | 1.61% | 0.15% | -1.86% | 0.16% |
| 过去三年 | 10.81% | 0.33% | 8.91% | 0.17% | 1.90% | 0.16% |
| 自基金合同生效起至今 | 25.15% | 0.32% | 22.40% | 0.20% | 2.75% | 0.12% |

注：本基金业绩比较基准：中证全债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%

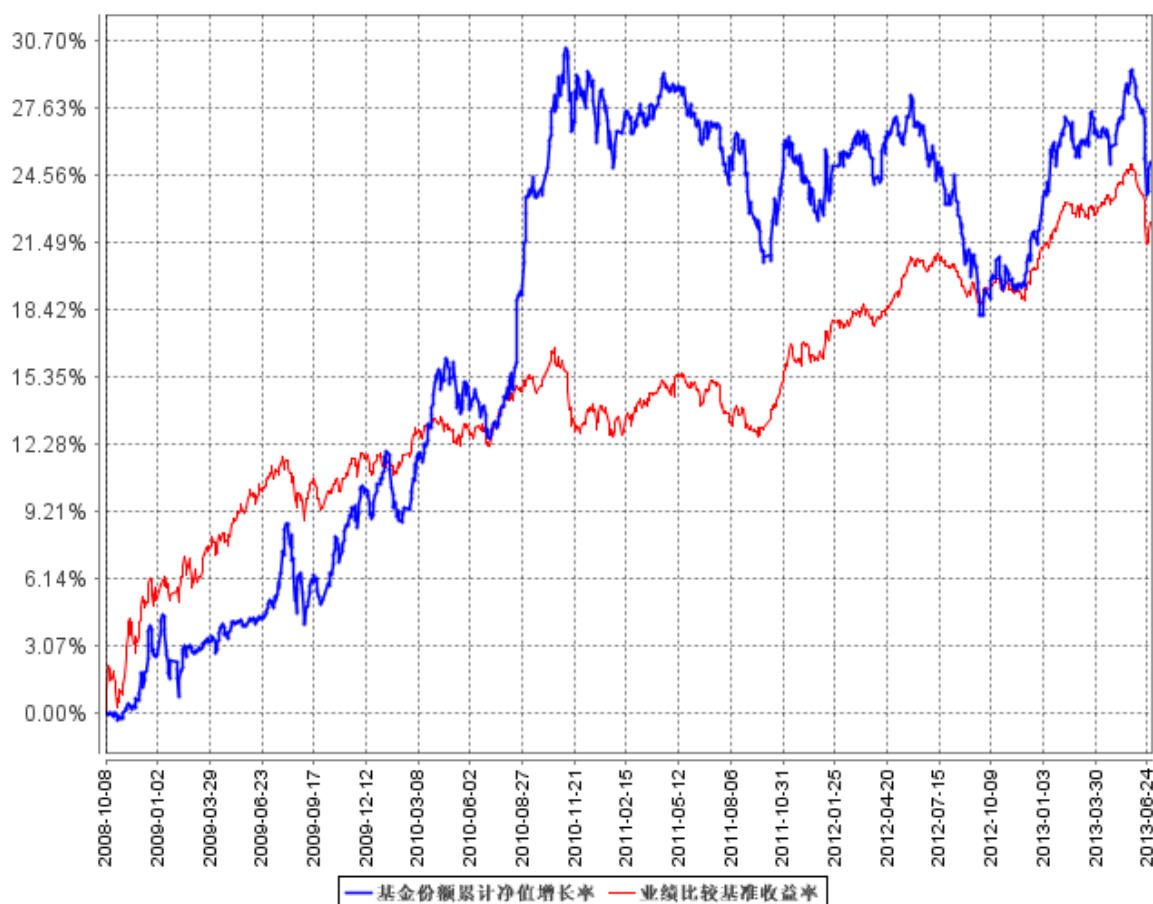
中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 90%、10%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条“（二）投资范围”、“（六）投资限制”的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 15000 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2013 年 6 月 30 日，基金管理人共管理两只封闭式基金、二十七只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理 (助理) 期限 | | 证券 从业年限 | 说明 |
|-----|--|----------------------|------|------------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 贾志敏 | 本基金基金经理，长盛货币市场基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，固定收益部副总监。 | 2013 年 3 月 21 日 | - | 7 年 | 男，1982 年 3 月出生，中国国籍。北京大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作。2012 年 11 月底加入长盛基金管理有限公司，现任固定收益部副总监，长盛货币市场基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛季季红 1 年期 |

| | | | | | |
|----|---|-----------------|-----------------|------|---|
| | | | | | 定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |
| 吴达 | 本基金基金经理（已离任），长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金经理。国际业务部总监。 | 2008 年 10 月 8 日 | 2013 年 3 月 21 日 | 11 年 | 男，1979 年 8 月出生，中国国籍。伦敦政治经济学院金融经济学硕士，CFA（美国特许金融分析师）。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理，专户投资组合经理；新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理，资产配置委员会成员；华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理；2007 年 8 月起加入长盛基金管理有限公司，现任国际业务部总监，长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金经理等职务。曾任本基金基金经理，目前已离任。 |

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、“证券从业年限”中“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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《长盛积极配置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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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资信息隔离墙制度。

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成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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

2013 年上半年，在通胀水平继续回落、经济弱复苏态势进一步明确及货币市场资金大部分时间相对宽松的基本面环境下，债券市场在 4-5 月走出一波牛市行情。具体来看：利率债方面，长端收益率处于窄幅震荡的走势，短端收益率曲线呈现波动向上的走势，期限利差曲线不断收窄，收益率曲线呈现扁平化趋势；信用债方面，短端收益率上行幅度大于长端收益率，收益率曲线逐渐扁平化，高低评级债券收益率均呈现窄幅震荡的态势，信用利差基本保持不变。进入 6 月中下旬，银行间市场流动性意外收紧，部分金融机构为补充流动性压缩杠杆，引发债市调整，短端收

益率大幅上升，出现利率倒挂的现象。

货币市场方面，上半年银行间货币市场利率维持在较低水平，银行间资金面总体保持充裕，以银行间七天回购利率为例，除 6 月中下旬外，该利率在 1 季度基本维持在 3.5% 左右。除 6 个月品种外，各中短期 Shibor 利率维持在较低水平。6 月中下旬银行间市场流动性意外收紧，货币市场利率飞涨，Shibor 隔夜利率曾高达 13.44%，银行间资金面相当紧张。

纯债资产以外，受经济基本面弱复苏及影子银行清理政策影响，进入 2 季度 A 股呈现震荡下行的态势。受正股震荡下行的行情带动，股性较强的转债在 2 季度总体呈现不断下降的走势。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金继续在一二级市场择优配置了一些信用资质有保障的高收益债券，在此基础上对持仓结构进行了优化。在具体投资品种方面，我们在增持信用债的同时，对权益类资产占比进行调整，并根据市场波动抓住利率债品种的交易性机会。

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 1.0805 元，本报告期份额净值增长率为 1.91%，同期业绩比较基准增长率为 0.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段市场走势，随着新一届中央政府的上台，国内经济的潜在增长率不断下降，尽管国内经济出现一定程度的复苏，但回到以前 8% 以上经济增速的可能性不断降低，迫切需要结构改革和结构转型。3 月份以来针对地产、影子银行的调控、新型禽流感 H7N9 的出现也为复苏蒙上了一抹阴影，但提前到来的政策调整，使得下半年可能出现的通胀反弹力度有所降低，同时可能使得 2013 年的复苏能够持续更长时间。

通货膨胀方面，通胀环比数据不断低于预期，使得下半年通胀压力不大，随着中央政府对经济增速容忍度的不断加大，经济增长取决于美国经济复苏进度、国内经济政策的刺激力度等因素的综合作用，保持弱复苏的概率较大。

从国内货币政策和资金面来看，2013 年，货币政策总体将保持稳定，随着人民币汇率贬值压力的不断加大和外汇占款流入额不断降低，银行间流动性压力不断加大，未来银行间资金面主要取决于央行对流动性的态度，而经济复苏程度和影子银行的清理政策将影响实体经济的资金面。此外，我们还需要关注美国经济复苏情况、美国 QE 政策退出时间及美元走势对于全球资本流动带来巨大影响。

债券市场方面，在基本面保持弱复苏的情况下，我们需要更多地关注货币政策变化、金融运

行环境变化对于债券市场及各类机构行为产生的影响，如融资结构、利率市场化、影子银行的处理政策、各类金融市场的联动关系等方面对于债券市场可能产生的影响。具体到各类债券品种，我们认为，在基本面稳定的情况下，2013 年下半年利率债将呈现窄幅波动的态势。信用品种方面，信用债的总体吸引力仍然存在，但也存在一定的风险因素，包括供给增加、信用评级的下调、当前收益率水平和信用利差的安全边际不足等方面。

权益市场方面，下半年经济增长将维持震荡的态势，经济弱复苏势头很难改变，A 股市场呈现震荡的走势，上行受制于复苏动力不足，而市场下行也支持于政府的政策空间，维持区间震荡的行情。

下一阶段，基金将在稳健原则的前提下，尽可能获取较好的风险和收益匹配。具体来说，基金将动态进行大类资产配置，以获取绝对收益为基本前提，波段性地参与权益类市场。在债券资产配置上，鉴于风险因素的存在，将适度运用杠杆，在契约要求的范围内适度缩短久期，稳健获取票息收益。同时，我们将高度重视信用风险的防范工作，防范信用风险的发生。

4.6 管理人对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，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，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副总经理（担任估值小组组长）、督察长（担任估值小组组长）及权益投资部、金融工程与量化投资部、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，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理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及净值计算履行复核责任，当存有异议时，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委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表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十六条中对基金利润分配原则的约定，本基金 2013 年上半年未实施利润分配。

本基金截至 2013 年 6 月 30 日，期末可供分配收益为-51,823.83 元，期末未分配收益为 33,624,159.30 元，其中，未分配收益已实现部分为-51,823.83 元，未分配收益未实现部分为 33,675,983.13 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛积极配置债券型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 | 上年度末 2012 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 12,772,619.07 | 11,116,166.21 |
| 结算备付金 | | 20,146,845.60 | 22,737,637.20 |
| 存出保证金 | | 131,473.89 | 500,000.00 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 723,423,366.39 | 808,474,070.81 |
| 其中：股票投资 | | - | 111,238,241.31 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 723,423,366.39 | 697,235,829.50 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 71,180.26 | 2,075,396.69 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 15,773,121.57 | 8,407,688.06 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 7,199.24 | 49,007.59 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 772,325,806.02 | 853,359,966.56 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 | 上年度末 2012 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 317,847,686.50 | 240,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 521,441.05 | 1,603,585.07 |
| 应付赎回款 | | 698,937.75 | 1,349,033.66 |
| 应付管理人报酬 | | 286,954.12 | 386,264.14 |
| 应付托管费 | | 76,521.09 | 103,003.78 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 94,849.99 | 130,972.90 |
| 应交税费 | | 1,197,996.24 | 839,021.10 |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息 | | 146,129.00 | 40,689.64 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 185,691.46 | 860,757.48 |
| 负债合计 | | 321,056,207.20 | 245,313,327.77 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 417,645,439.52 | 573,536,591.94 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 33,624,159.30 | 34,510,046.85 |
| 所有者权益合计 | | 451,269,598.82 | 608,046,638.79 |
| 负债和所有者权益总计 | | 772,325,806.02 | 853,359,966.56 |

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0805 元，基金份额总额 417,645,439.52 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛积极配置债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | 21,665,224.45 | 27,383,766.58 |
| 1. 利息收入 | | 11,881,702.22 | 15,271,943.81 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 177,288.41 | 3,430,335.34 |
| 债券利息收入 | | 11,645,636.16 | 11,828,779.05 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 58,777.65 | 12,829.42 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 23,015,873.35 | -18,219,661.80 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 12,570,638.39 | -16,338,158.35 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 10,275,911.72 | -3,399,560.70 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 169,323.24 | 1,518,057.25 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -13,241,548.43 | 30,228,919.02 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 9,197.31 | 102,565.55 |
| 减：二、费用 | | 7,839,004.81 | 10,436,151.93 |
| 1. 管理人报酬 | | 2,024,144.26 | 3,378,280.76 |
| 2. 托管费 | | 539,771.77 | 900,874.82 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 590,961.73 | 726,591.06 |

| | | | |
|---------------------|----------|---------------|---------------|
| 5. 利息支出 | | 4,487,707.16 | 5,223,250.43 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 4,487,707.16 | 5,223,250.43 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.19 | 196,419.89 | 207,154.86 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 13,826,219.64 | 16,947,614.65 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 13,826,219.64 | 16,947,614.65 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛积极配置债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 573,536,591.94 | 34,510,046.85 | 608,046,638.79 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 13,826,219.64 | 13,826,219.64 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -155,891,152.42 | -14,712,107.19 | -170,603,259.61 |
| 其中：1. 基金申购款 | 3,514,706.06 | 322,341.86 | 3,837,047.92 |
| 2. 基金赎回款 | -159,405,858.48 | -15,034,449.05 | -174,440,307.53 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 417,645,439.52 | 33,624,159.30 | 451,269,598.82 |
| 项目 | 上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益 | 910,119,615.60 | 62,514,222.09 | 972,633,837.69 |

| | | | |
|--|-----------------|----------------|-----------------|
| (基金净值) | | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 16,947,614.65 | 16,947,614.65 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -171,333,756.35 | -15,256,995.81 | -186,590,752.16 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 13,022,214.79 | 1,128,250.63 | 14,150,465.42 |
| 2. 基金赎回款 | -184,355,971.14 | -16,385,246.44 | -200,741,217.58 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | -2,701,362.33 | -2,701,362.33 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 738,785,859.25 | 61,503,478.60 | 800,289,337.85 |

注: 报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

周兵

基金管理人负责人

杨思乐

主管会计工作负责人

龚珉

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛积极配置债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 984 号《关于核准长盛积极配置债券型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,361,279,052.21 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 144 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》于 2008 年 10 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,362,144,547.24 份基金份额,其中认购资金利息折合 865,495.03 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,其中投资于债券等固定收益类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的 80%;投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%,其中,权证投资

的比例不超过基金资产的 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财政部、国家税务总局、中国证监会于 2012 年 11 月 16 日联合发布财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，

主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- 2、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。
- 4、自 2013 年 1 月 1 日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照本通知的规定计征个人所得税。
- 5、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 12,772,619.07 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 12,772,619.07 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 | | |
|--------|------------------------|----------------|--------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 582,381,209.10 | 3,508,157.29 |
| | 银行间市场 | 137,902,120.96 | -368,120.96 |
| | 合计 | 720,283,330.06 | 3,140,036.33 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 720,283,330.06 | 723,423,366.39 | 3,140,036.33 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末未持有买断式逆回购。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 2,077.61 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 8,159.49 |
| 应收债券利息 | 15,762,825.41 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 5.78 |
| 其他 | 53.28 |
| 合计 | 15,773,121.57 |

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 94,299.99 |
| 银行间市场应付交易费用 | 550.00 |
| 合计 | 94,849.99 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 36.52 |

| | |
|------|------------|
| 预提费用 | 185,654.94 |
| 合计 | 185,691.46 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 573,536,591.94 | 573,536,591.94 |
| 本期申购 | 3,514,706.06 | 3,514,706.06 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -159,405,858.48 | -159,405,858.48 |
| 本期末 | 417,645,439.52 | 417,645,439.52 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | -31,354,962.69 | 65,865,009.54 | 34,510,046.85 |
| 本期利润 | 27,067,768.07 | -13,241,548.43 | 13,826,219.64 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,235,370.79 | -18,947,477.98 | -14,712,107.19 |
| 其中：基金申购款 | -110,394.62 | 432,736.48 | 322,341.86 |
| 基金赎回款 | 4,345,765.41 | -19,380,214.46 | -15,034,449.05 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -51,823.83 | 33,675,983.13 | 33,624,159.30 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| | 活期存款利息收入 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 120,250.10 |
| 其他 | 1,256.35 |
| 合计 | 177,288.41 |

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| | 卖出股票成交总额 |
| 减：卖出股票成本总额 | 220,871,512.17 |

| | |
|----------|---------------|
| 买卖股票差价收入 | 12,570,638.39 |
|----------|---------------|

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 380,280,617.41 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 363,773,084.28 |
| 减：应收利息总额 | 6,231,621.41 |
| 债券投资收益 | 10,275,911.72 |

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期末未取得衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 169,323.24 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 169,323.24 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -13,241,548.43 |
| ——股票投资 | -3,535,362.90 |
| ——债券投资 | -9,706,185.53 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | -13,241,548.43 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 8,841.29 |
| 转换费收入 | 356.02 |
| 合计 | 9,197.31 |

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 590,411.73 |
| 银行间市场交易费用 | 550.00 |
| 合计 | 590,961.73 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 41,762.00 |
| 信息披露费 | 133,892.94 |
| 银行划款费用 | 9,864.95 |
| 账户维护费 | 10,500.00 |
| 其他 | 400.00 |
| 合计 | 196,419.89 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|---------------------|
| 长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金未开立关联方交易单元。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至 2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,024,144.26 | 3,378,280.76 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 370,199.90 | 602,876.44 |

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 539,771.77 | 900,874.82 |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | | | | | | |
|---------------------------------|--------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国建设银行 | - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 | | | | | | |
| 银行间市场交 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |

| 易的各关联方名称 | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
|----------|------|------|------|------|----------------|-----------|
| 中国建设银行 | - | - | - | - | 140,000,000.00 | 60,245.62 |

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2013年1月1日至 2013年6月30日 | 上年度可比期间 2012年1月1日至 2012年6月30日 |
|-----------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 期初持有的基金份额 | 50,001,240.00 | 50,001,240.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 50,001,240.00 | 50,001,240.00 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 11.97% | 6.77% |

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2013年1月1日至2013年6月30日 | | 上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 | |
|--------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 12,772,619.07 | 55,781.96 | 14,943,629.23 | 98,914.33 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
|----------------------|--------|-----------------|-----------------|--------|--------|--------|--------------|---------------|---------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：张) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 112172 | 13 普邦债 | 2013 年 5 月 14 日 | 2013 年 7 月 12 日 | 新债认购 | 100.00 | 100.00 | 120,000 | 12,000,000.00 | 12,000,000.00 | |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 317,847,686.50 元，于 2013 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的债券型证券投资基金，属于偏低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括债券投资、股票投资及权证投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与

风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 39,848,000.00 | 10,032,000.00 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 9,967,000.00 | 40,020,000.00 |
| 合计 | 49,815,000.00 | 50,052,000.00 |

注：未评级债券为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2013年6月30日 | 上年度末 2012年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 176,023,307.67 | 357,493,894.70 |
| AAA 以下 | 446,800,058.72 | 238,714,934.80 |

| | | |
|-----|----------------|----------------|
| 未评级 | 50,785,000.00 | 50,975,000.00 |
| 合计 | 673,608,366.39 | 647,183,829.50 |

注：未评级债券为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2013 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 317,847,686.50 元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2013年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 12,772,619.07 | - | - | - | 12,772,619.07 |
| 结算备付金 | 20,146,845.60 | - | - | - | 20,146,845.60 |
| 存出保证金 | 131,473.89 | - | - | - | 131,473.89 |
| 交易性金融资产 | 242,093,893.64 | 389,554,995.50 | 91,774,477.25 | - | 723,423,366.39 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 71,180.26 | 71,180.26 |
| 应收利息 | - | - | - | 15,773,121.57 | 15,773,121.57 |
| 应收申购款 | 248.51 | - | - | 6,950.73 | 7,199.24 |
| 资产总计 | 275,145,080.71 | 389,554,995.50 | 91,774,477.25 | 15,851,252.56 | 772,325,806.02 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 317,847,686.50 | - | - | - | 317,847,686.50 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 521,441.05 | 521,441.05 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 698,937.75 | 698,937.75 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 286,954.12 | 286,954.12 |
| 应付托管费 | - | - | - | 76,521.09 | 76,521.09 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 94,849.99 | 94,849.99 |
| 应付税费 | - | - | - | 1,197,996.24 | 1,197,996.24 |
| 应付利息 | - | - | - | 146,129.00 | 146,129.00 |
| 其他负债 | - | - | - | 185,691.46 | 185,691.46 |
| 负债总计 | 317,847,686.50 | - | - | 3,208,520.70 | 321,056,207.20 |
| 利率敏感度缺口 | -42,702,605.79 | 389,554,995.50 | 91,774,477.25 | 12,642,731.86 | 451,269,598.82 |
| 上年度末 2012年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 11,116,166.21 | - | - | - | 11,116,166.21 |
| 结算备付金 | 22,737,637.20 | - | - | - | 22,737,637.20 |
| 存出保证金 | - | - | - | 500,000.00 | 500,000.00 |
| 交易性金融资产 | 295,453,032.20 | 358,363,015.90 | 43,419,781.40 | 111,238,241.31 | 808,474,070.81 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 2,075,396.69 | 2,075,396.69 |
| 应收利息 | - | - | - | 8,407,688.06 | 8,407,688.06 |

| | | | | | |
|----------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|
| 应收申购款 | 6,113.33 | - | - | 42,894.26 | 49,007.59 |
| 资产总计 | 329,312,948.94 | 358,363,015.90 | 43,419,781.40 | 122,264,220.32 | 853,359,966.56 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 240,000,000.00 | - | - | - | 240,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,603,585.07 | 1,603,585.07 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,349,033.66 | 1,349,033.66 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 386,264.14 | 386,264.14 |
| 应付托管费 | - | - | - | 103,003.78 | 103,003.78 |
| 应付利息 | - | - | - | 40,689.64 | 40,689.64 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 130,972.90 | 130,972.90 |
| 应交税费 | - | - | - | 839,021.10 | 839,021.10 |
| 其他负债 | - | - | - | 860,757.48 | 860,757.48 |
| 负债总计 | 240,000,000.00 | - | - | 5,313,327.77 | 245,313,327.77 |
| 利率敏感度缺口 | 89,312,948.94 | 358,363,015.90 | 43,419,781.40 | 116,950,892.55 | 608,046,638.79 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 （2013年6月30日） | 上年度末 （2012年12月31日） |
| | 市场利率下降25个基点 | 4,698,860.69 | 4,459,433.21 |
| | 市场利率上升25个基点 | -4,698,860.69 | -4,459,433.21 |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金

管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券等固定收益类资产（含可转换债券）的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2013 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2012 年 12 月 31 日 | |
|--------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | - | - | 111,238,241.31 | 18.29 |
| 合计 | - | - | 111,238,241.31 | 18.29 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2013 年 6 月 30 日，本基金未持有的交易性权益类投资（2012 年 12 月 31 日：18.29%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2012 年 12 月 31 日：无重大影响）。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察

输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 585,889,366.39 元, 属于第二层级的余额为 137,534,000.00 元, 无属于第三层级的余额 (2012 年 12 月 31 日: 第一层级 687,058,070.81 元, 第二层级 121,416,000.00 元, 无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃 (包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末, 本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具 (2012 年 12 月 31 日: 同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级的金额为零元, 计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元 (2012 年度: 净转入/(转出)第三层级的金额为零元, 计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元)。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 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 | 723,423,366.39 | 93.67 |
| | 其中：债券 | 723,423,366.39 | 93.67 |
| | 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 | 32,919,464.67 | 4.26 |
| 6 | 其他各项资产 | 15,982,974.96 | 2.07 |
| 7 | 合计 | 772,325,806.02 | 100.00 |

7.2 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投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 000002 | 万科A | 11,875,000.00 | 1.95 |
| 2 | 000598 | 兴蓉投资 | 7,120,635.07 | 1.17 |
| 3 | 002146 | 荣盛发展 | 5,933,234.00 | 0.98 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 5,906,978.56 | 0.97 |
| 5 | 601288 | 农业银行 | 5,824,458.00 | 0.96 |
| 6 | 002028 | 思源电气 | 5,407,819.84 | 0.89 |
| 7 | 002650 | 加加食品 | 5,386,988.81 | 0.89 |
| 8 | 000726 | 鲁泰A | 5,353,771.00 | 0.88 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 9 | 000028 | 国药一致 | 5,348,843.12 | 0.88 |
| 10 | 002022 | 科华生物 | 5,322,375.03 | 0.88 |
| 11 | 002035 | 华帝股份 | 5,306,852.88 | 0.87 |
| 12 | 601117 | 中国化学 | 5,300,805.00 | 0.87 |
| 13 | 600583 | 海油工程 | 5,294,702.70 | 0.87 |
| 14 | 600718 | 东软集团 | 5,139,487.28 | 0.85 |
| 15 | 002430 | 杭氧股份 | 4,531,473.63 | 0.75 |
| 16 | 002179 | 中航光电 | 4,119,467.70 | 0.68 |
| 17 | 600479 | 千金药业 | 3,992,359.53 | 0.66 |
| 18 | 000917 | 电广传媒 | 3,396,949.25 | 0.56 |
| 19 | 002344 | 海宁皮城 | 2,949,693.00 | 0.49 |
| 20 | 300134 | 大富科技 | 2,882,029.11 | 0.47 |

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 24,796,910.85 | 4.08 |
| 2 | 600887 | 伊利股份 | 21,690,835.88 | 3.57 |
| 3 | 601390 | 中国中铁 | 17,595,149.30 | 2.89 |
| 4 | 600406 | 国电南瑞 | 16,711,800.88 | 2.75 |
| 5 | 600547 | 山东黄金 | 14,435,274.82 | 2.37 |
| 6 | 000598 | 兴蓉投资 | 10,708,329.21 | 1.76 |
| 7 | 000002 | 万科A | 10,585,988.73 | 1.74 |
| 8 | 002275 | 桂林三金 | 8,623,210.65 | 1.42 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 8,125,784.64 | 1.34 |
| 10 | 600583 | 海油工程 | 6,551,297.61 | 1.08 |
| 11 | 600376 | 首开股份 | 5,946,760.62 | 0.98 |
| 12 | 002028 | 思源电气 | 5,865,123.43 | 0.96 |
| 13 | 600519 | 贵州茅台 | 5,810,982.00 | 0.96 |
| 14 | 002022 | 科华生物 | 5,644,551.37 | 0.93 |
| 15 | 000726 | 鲁泰A | 5,634,498.39 | 0.93 |
| 16 | 601117 | 中国化学 | 5,605,496.84 | 0.92 |
| 17 | 601288 | 农业银行 | 5,593,710.91 | 0.92 |
| 18 | 002035 | 华帝股份 | 5,510,317.06 | 0.91 |
| 19 | 002146 | 荣盛发展 | 5,175,670.86 | 0.85 |
| 20 | 002650 | 加加食品 | 5,160,923.70 | 0.85 |

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 113,168,633.76 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 233,442,150.56 |

注：本项中 7.4.1、7.4.2 和 7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 60,752,000.00 | 13.46 |
| | 其中：政策性金融债 | 60,752,000.00 | 13.46 |
| 4 | 企业债券 | 537,577,533.19 | 119.13 |
| 5 | 企业短期融资券 | 39,848,000.00 | 8.83 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 85,245,833.20 | 18.89 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 723,423,366.39 | 160.31 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 110314 | 11 进出 14 | 500,000 | 50,785,000.00 | 11.25 |
| 2 | 126017 | 08 葛洲债 | 441,470 | 42,248,679.00 | 9.36 |
| 3 | 110015 | 石化转债 | 350,000 | 34,937,000.00 | 7.74 |
| 4 | 122102 | 11 广汇 01 | 289,920 | 30,209,664.00 | 6.69 |
| 5 | 113002 | 工行转债 | 250,000 | 27,345,000.00 | 6.06 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 131,473.89 |
| 2 | 应收证券清算款 | 71,180.26 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 15,773,121.57 |
| 5 | 应收申购款 | 7,199.24 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 15,982,974.96 |

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|---------------|
| 1 | 110015 | 石化转债 | 34,937,000.00 | 7.74 |
| 2 | 113002 | 工行转债 | 27,345,000.00 | 6.06 |
| 3 | 110020 | 南山转债 | 6,525,122.10 | 1.45 |
| 4 | 110022 | 同仁转债 | 6,481,500.00 | 1.44 |
| 5 | 113003 | 重工转债 | 2,733,000.00 | 0.61 |
| 6 | 110007 | 博汇转债 | 1,830,805.60 | 0.41 |
| 7 | 110016 | 川投转债 | 1,208,000.00 | 0.27 |
| 8 | 110018 | 国电转债 | 1,074,800.00 | 0.24 |
| 9 | 125089 | 深机转债 | 959,880.00 | 0.21 |

7.9.5 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投资。

7.9.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|---------------|------------|----------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 11,533 | 36,213.08 | 50,846,348.45 | 12.17% | 366,799,091.07 | 87.83% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|----------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员 持有本基金 | 45,303.84 | 0.0108% |

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0 万份。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0 万份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2008 年 10 月 8 日）基金份额总额 | 1,362,144,547.24 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 573,536,591.94 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,514,706.06 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 159,405,858.48 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 417,645,439.52 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本报告期基金管理人的高级管理人员未曾变动。

10.2.2 基金经理变动情况

本基金管理人于 2013 年 3 月 23 日发布关于调整基金经理的公告，公司决定聘任贾志敏担任本基金经理，吴达不再担任本基金经理。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|-------|-----------|-------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票 | 佣金 | 占当期佣金 | |
| | | | | | | |

| | | | 成交总额的比例 | | 总量的比例 | |
|------|---|----------------|---------|------------|--------|--|
| 红塔证券 | 1 | 184,902,341.58 | 53.53% | 168,335.92 | 53.92% | |
| 海通证券 | 1 | 101,321,306.00 | 29.33% | 91,472.31 | 29.30% | |
| 东方证券 | 1 | 59,183,386.74 | 17.13% | 52,371.34 | 16.78% | |

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|----------------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 红塔证券 | 391,524,842.87 | 64.33% | 13,411,600,000.00 | 76.97% | - | - |
| 海通证券 | 217,133,401.17 | 35.67% | 3,529,781,000.00 | 20.26% | - | - |
| 东方证券 | - | - | 482,500,000.00 | 2.77% | - | - |

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的

服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.8 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事件如下：

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|------------------------------|------------|
| 1 | 关于增加湘财证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站 | 2013年5月31日 |
| 2 | 长盛积极配置债券型证券投资基金招募说明书（更新） | 同上 | 2013年5月21日 |
| 3 | 长盛基金管理有限公司成都分公司负责人变更的公告 | 同上 | 2013年4月19日 |
| 4 | 关于增加东兴证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告 | 同上 | 2013年4月12日 |
| 5 | 长盛基金管理有限公司关于调整长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理的公告 | 同上 | 2013年3月23日 |
| 6 | 关于增加方正证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告/关于增加国海证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告 | 同上 | 2013年1月25日 |
| 7 | 关于增加财通证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购费率优惠的公告 | 同上 | 2013年1月18日 |

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛积极配置债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛积极配置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。

11.2 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。

11.3 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>。