# 长盛季季红1年期定期开放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 | 长盛季季红1年期债券 |
| 基金主代码 | 000145 |
| 交易代码 | 000145 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年6月14日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,396,003,609.71份 |
| 投资目标 | 在严格控制投资风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,力争获取高于业绩比较基准的投资收益,给投资者带来长期的现金红利收益。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资于固定收益类金融工具,不直接买入股票,权证等权益类金融工具,本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配。本基金的投资策略包括大类资产配置策略、债券组合管理策略和期限管理策略。<br>本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上,结合政策分析,确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估,及时调整资产组合比例,保持资产配置风险、收益平衡,以稳健提升投资组合回报。<br>由于本基金封闭期为一年,基金规模相对稳定,但在开放期内本基金规模的不确定性增强。本基金将采用期限管理策略,分散化投资于不同剩余期限标的,临近开放期时,在最大限度保证收益的同时将组合剩余期限降低,保证开放期内具备足够流动性应对可能发生的组合规模变化。 |
| 业绩比较基准 | 一年期银行定期存款税后收益率。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。 |
| 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 | 长盛季季红1年期债券A / 长盛季季红1年期债券C |
| 下属两级基金的交易代码 | 000145 / 000146 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 811,480,378.28份 / 584,523,231.43份 |

### §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) | |
|---|---|---|
| | 长盛季季红1年期债券A | 长盛季季红1年期债券C |
| 1.本期已实现收益 | 7,272,294.82 | 4,793,149.26 |
| 2.本期利润 | 6,100,561.24 | 3,949,147.63 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0075 | 0.0068 |
| 4.期末基金资产净值 | 816,765,316.87 | 587,808,080.44 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.007 | 1.006 |

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

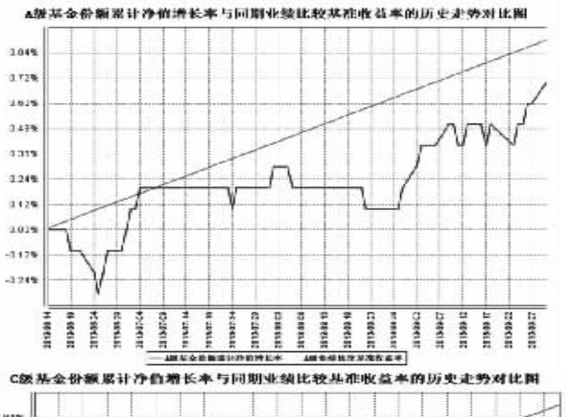
长盛季季红1年期债券A

| 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 | 0.80% | 0.05% | 0.76% | 0.01% | 0.04% | 0.04% |

长盛季季红1年期债券C

| 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 | 0.70% | 0.07% | 0.76% | 0.01% | -0.06% | 0.06% |

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.本基金基金合同生效日为2013年6月14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6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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。

### §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 | | |
| 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,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红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6月14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基金经理,长盛年年收益定期开放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,长盛双月红1年期定期开放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、"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、《长盛季季红1年期定期开放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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内行情回顾

**2013年第三季度,通胀水平始终保持在3%以下的水平,经济弱复苏态势进一步明确两者难以对债券市场形成明显的指引作用。6月中下旬钱荒过后,央行加强了货币市场流动性管理,资金成本较上半年有所提升,信用债券市场在波动中走出一波熊市行情。具体来看:利率债方面,利率产品供给压力释放引发的供需失衡导致一级市场招标利率持续超出市场预期,市场悲观情绪日渐浓重,二级市场收益率逐步上行,10年期国债收益率上行50bp左右,突破了4%的敏感点位,并一度达到4.14%高点;信用债方面,短端收益率上行幅度大于长端收益率,低等级上行幅度高于高等级,收益率曲线逐渐扁平化。**

货币市场方面,三季度银行间货币市场利率较上半年中枢有所上移,银行间资金面总体保持中性偏紧的态势,以银行间七天回购利率为例,该利率在三季度基本维持在4%左右。各中短期限Shibor利率维持在相对较低水平,例如SHIBOR 2W大体维持在4.44%左右。

(二)报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金根据资金面偏紧的状况,择机进行了协议存款,提前锁定了部分收益;信用品种上以短久期的中低等级信用债为主,提升组合流动性,确保组合收益。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,防控信用风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,长盛季季红1年期债券A的基金份额净值为1.007元,本报告期份额净值增长率为0.80%,同期业绩比较基准增长率为0.76%。

截止报告期末,长盛季季红1年期债券C的基金份额净值为1.006元,本报告期份额净值增长率为0.70%,同期业绩比较基准增长率为0.76%。

### §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 | 1,533,858,194.50 | 72.26 |
| | 其中:债券 | 1,533,858,194.50 | 72.26 |
| | 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 | 498,525,485.86 | 23.49 |
| 6 | 其他资产 | 90,214,780.71 | 4.25 |
| 7 | 合计 | 2,122,598,461.07 | 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投资。

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投资。

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 | – | – |
| | 其中:政策性金融债 | – | – |
| 4 | 企业债券 | 913,865,194.50 | 65.06 |
| 5 | 企业短期融资券 | 619,993,000.00 | 44.14 |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债 | – | – |
| 8 | 其他 | – | – |
| 9 | 合计 | 1,533,858,194.50 | 109.20 |

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 | 122672 | 12西城投 | 525,500 | 55,965,750.00 | 3.98 |
| 2 | 122682 | 12营口债 | 500,000 | 55,620,000.00 | 3.96 |
| 3 | 124305 | 13瓦国资 | 500,000 | 51,250,000.00 | 3.65 |
| 4 | 124310 | 13洪水利 | 500,000 | 50,500,000.00 | 3.60 |
| 5 | 124096 | 12淮城资 | 501,000 | 50,370,540.00 | 3.59 |

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

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

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 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 320,427.43 |
| 2 | 应收证券清算款 | 61,640,678.69 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 28,253,674.59 |
| 5 | 应收申购款 | – |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 90,214,780.71 |

5.9.2 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。

5.9.3 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投资。

5.9.4 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 | 长盛季季红1年期债券A | 长盛季季红1年期债券C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 811,480,378.28 | 584,523,231.43 |
| 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 | 811,480,378.28 | 584,523,231.43 |

### §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

1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、《长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛季季红1年期定期开放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

# 上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金

## 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 | 长盛上证市值百强ETF |
| 基金主代码 | 510700 |
| 交易代码 | 510700 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年4月24日 |
| 报告期末基金份额总额 | 68,213,677.00份 |
| 投资目标 | 本基金跟踪投资标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现与标的指数表现相一致的长期收益。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将据配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。<br>在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。 |
| 业绩比较基准 | 上证市值百强指数 |
| 风险收益特征 | 本基金为被动式投资的股票指数型基金,预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合风险收益特征相近,属于高风险、高收益的基金品种。 |
| 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 |

### §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 | -676,269.69 |
| 2.本期利润 | 14,631,573.86 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1698 |
| 4.期末基金资产净值 | 119,350,432.44 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.750 |

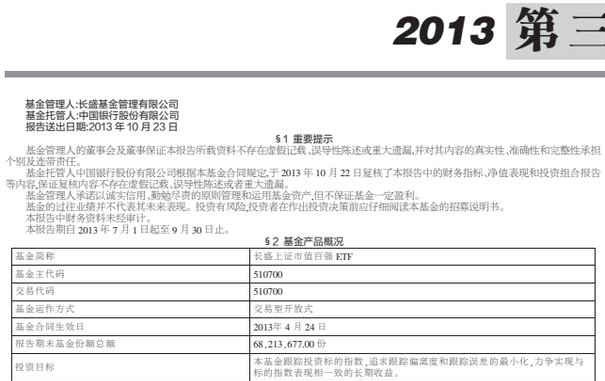
注:1.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.所列数据截止到2013年9月30日。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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 | 9.31% | 1.46% | 7.56% | 1.53% | 1.75% | -0.07% |

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2013年4月24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三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基金合同第十七条(二)投资范围、(八)投资禁止行为与限制的有关约定。

### §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 | | |
| 赵宏宇 | 本基金基金经理,长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金经理,首席产品开发师和金融工程与量化投资部副总监。 | 2013年4月24日 | – | 6年 | 男,1972年6月出生,中国国籍,四川大学工商管理学院管理学(金融投资研究方向)博士。历任美国晨星公司投资顾问部门数量分析师,招商银行博士后工作站博士后研究员。2007年8月加入长盛基金管理公司,历任金融工程研究员、产品开发经理,现任首席产品开发师和金融工程与量化投资部副总监。上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金经理,长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。 |

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、"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、《长盛上证市值百强交易型开放式指数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 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

三季度以来国内经济稍有回暖,宏观经济数据如PMI、工业增速等好于市场悲观预期。与此同时,政府先后出台优先股试点、上海自贸区和土地流转等众多改革措施。在经济复苏与改革预期的双重激励下,A股强势上扬。市值百强ETF在基金合同允许的仓位限制下保持高仓位,最大限度分享了蓝筹股上涨红利。在报告期内操作中,基金管理人严格遵守基金合同,在成分股权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,联接基金份额净值为0.973元,本报告期份额净值增长率为7.51%,同期业绩比较基准增长率为7.21%。本报告期内日均跟踪偏离度绝对值均值为0.11%,年化跟踪误差为2.46%。报告期内,联接基金有较多赎回,基金管理人市场操作比较频繁,份额净值与跟踪误差受到一定影响。

### §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 | 2,390,530.00 | 4.91 |
| | 其中:股票 | 2,390,530.00 | 4.91 |
| 2 | 基金投资 | 43,750,000.00 | 89.78 |
| 3 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中:债券 | – | – |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 5 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,440,214.23 | 5.01 |
| 7 | 其他资产 | 151,636.39 | 0.31 |
| 8 | 合计 | 48,732,380.62 | 100.00 |

5.2 报告期末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 | 5,509.00 | 0.01 |
| B | 采矿业 | 161,965.00 | 0.33 |
| C | 制造业 | 639,483.00 | 1.32 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 44,542.00 | 0.09 |
| E | 建筑业 | 64,759.00 | 0.13 |
| F | 批发和零售业 | 151,950.00 | 0.31 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 35,442.00 | 0.07 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 49,560.00 | 0.10 |
| J | 金融业 | 1,171,495.00 | 2.42 |
| K | 房地产业 | 40,954.00 | 0.08 |
| L | 租赁和商务服务业 | – | – |
| M | 科学研究和技术服务业 | – | – |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | – | – |
| 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 | 6,935.00 | 0.01 |
| S | 综合 | 17,936.00 | 0.04 |
| | 合计 | 2,390,530.00 | 4.94 |

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

| 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 | 601901 | 方正证券 | 46,800 | 276,588.00 | 0.57 |
| 2 | 600690 | 青岛海尔 | 20,000 | 266,400.00 | 0.55 |
| 3 | 600058 | 五矿发展 | 9,600 | 130,176.00 | 0.27 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 13,400 | 128,104.00 | 0.26 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 9,800 | 107,016.00 | 0.22 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | 6,800 | 75,956.00 | 0.16 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 2,000 | 71,400.00 | 0.15 |
| 8 | 600000 | 浦发银行 | 6,600 | 66,594.00 | 0.14 |
| 9 | 600837 | 海通证券 | 4,800 | 60,048.00 | 0.12 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 4,100 | 50,389.00 | 0.10 |

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 上证百强ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 长盛基金管理有限公司 | 43,750,000.00 | 90.40 |

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金报告期内未进行股指期货投资,报告期末无股指期货持仓。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金基金合同中未约定本基金投资股指期货的投资政策。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同中未约定国债期货的投资政策。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未进行国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

根据中国平安股份有限公司2013年5月22日发布的《关于平安证券收到中国证监会处罚事先告知书的公告》显示,中国平安集团的控股子公司平安证券收到证监会的处罚通知书。中国证监会决定对平安证券给予警告并没收其在万福生科发行上市项目中的业务收入人民币2,555万元,并处以人民币5,110万元的罚款,暂停其保荐机构资格3个月。

本基金做出以下说明:

1.中国平安是中国最优秀的综合金融公司,寿险业务最具竞争力,基本面良好。本公司研究员一直保持跟踪,并有相关的跟踪报告。

2.基于相关研究,本基金判断,旗下平安证券受到处罚,对中国平安的影响较小。因为证券业务板块在平安集团内的地位较低,平安证券对中国平安的收入贡献1%,利润贡献不足5%。

3.今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其风险控制机制和经营情况。

除上述事项外,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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 776,180.93 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | 32,783.31 |
| 4 | 应收利息 | 630.86 |
| 5 | 应收申购款 | – |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 809,595.10 |

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

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 77,213,677.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 126,000,000.00 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 135,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | – |
| 报告期期末基金份额总额 | 68,213,677.00 |

### §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上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金的批复;
(二)《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
(三)《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
(四)《上证市值百强交易型开放式指数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

# 长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 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 | 长盛上证市值百强ETF联接 |
| 基金主代码 | 000063 |
| 交易代码 | 000063 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年5月10日 |
| 报告期末基金份额总额 | 49,724,984.71份 |
| 投资目标 | 通过投资于目标ETF,紧密跟踪基金业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为目标ETF的联接基金,以目标ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。<br>为实现投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。<br>在正常市场情况下,本基金力争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不超过0.3%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 |
| 业绩比较基准 | 上证市值百强指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |
| 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 |

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码 | 510700 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年4月24日 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2013年5月31日 |
| 基金管理人名称 | 长盛基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国银行股份有限公司 |

2.1.2 目标基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金跟踪投资标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现与标的指数表现相一致的长期收益。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成