长盛同庆中证800指数分级证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31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:2015年1月22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2015年1月21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2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同庆中证800分级		
场内简称	长盛同庆		
基金主代码	160806		
交易代码	160806		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012年5月12日		
报告期末基金份额总额	851,840,430.56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,以实现对中证800指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性,通过抽样方式构建基金股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于4%的投资目标。 当预期成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证800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。本基金将在基金合同生效3个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。		
业绩比较基准	95%×中证800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	本基金为抽样复制指数的股票型基金,具有高风险、高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金简称	长盛同庆800A	长盛同庆800B	长盛同庆中证800分级
下属分级场内简称	同庆A	同庆B	长盛同庆
下属分级基金交易代码	150098	150099	160806
下属分级基金报告期末基金份额总额	278,099,590.00份	417,149,386.00份	156,591,454.56份
下属分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（2014年10月1日－2014年12月31日）
1.本期已实现收益	193,041,715.79
2.本期利润	277,585,464.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.2626
4.期末基金资产净值	1,034,171,205.75
5.期末基金份额净值	1.214

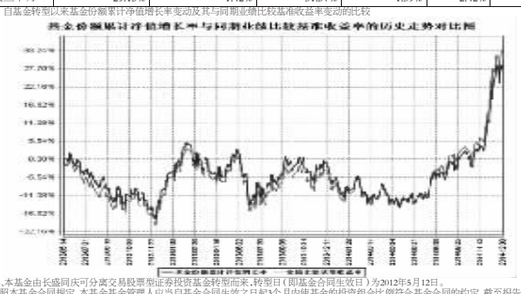
注:1.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.所列数据截止到2014年12月31日。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	29.15%	1.42%	31.57%	1.39%	-2.42%	0.03%

3.2.2 自基金转型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:1.本基金由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型而来,转型日(即基金合同生效日)为2012年5月12日。
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3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本基金合同第十七条(三)投资范围、(九)投资限制的有关约定。

§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		
王超	本基金基金经理、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理、长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理。	2012年7月20日	-	7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(本基金)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。

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、本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,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%的交易共有7次,为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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的说明

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1.214元,本报告期份额净值增长率为29.15%,同期业绩比较基准收益率为31.57%。报告期内,本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.24%,控制在0.35%之内;年化跟踪误差为3.16%,控制在4%之内。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§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	969,984,095.68	91.43
	其中:股票	969,984,095.68	91.43
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	61,060,751.60	5.76
7	其他资产	29,809,970.93	2.81
8	合计	1,060,854,818.21	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	4,993,562.44	0.48
B	采矿业	38,050,066.39	3.68
C	制造业	309,551,262.43	29.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,012,477.19	2.90
E	建筑业	36,670,340.35	3.55
F	批发和零售业	106,853,617.44	10.33
G	交通运输、仓储和邮政业	25,004,597.25	2.42
H	住宿和餐饮业	86,765.28	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,095,287.41	3.59
J	金融业	279,471,691.65	27.02
K	房地产业	48,331,492.76	4.67
L	租赁和商务服务业	9,535,467.97	0.92
M	科学研究和技术服务业	652,048.96	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	8,310,173.61	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	603,703.15	0.06
R	文化、体育和娱乐业	9,616,332.42	0.93
S	综合	3,936,457.15	0.38
	合计	948,775,343.85	91.74

5.2.2 报告期末积极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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	5,243,385.55	0.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	110,944.00	0.01
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	7,031,818.26	0.68
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,822,604.02	0.85
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,208,751.83	2.05

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	600998	九州通	4,433,529	80,113,869.03	7.75
2	601318	中国平安	406,282	30,353,328.22	2.94
3	600016	民生银行	2,300,846	25,033,204.48	2.42
4	600036	招商银行	1,400,844	23,240,001.96	2.25
5	600030	中信证券	667,991	22,644,894.90	2.19
6	600837	海通证券	686,734	16,522,820.04	1.60
7	601166	兴业银行	970,233	16,008,844.50	1.55
8	600000	浦发银行	950,327	14,910,630.63	1.44
9	601398	工商银行	2,598,495	12,654,670.65	1.22
10	000002	万科A	823,572	11,447,650.80	1.11

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

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	300315	掌趣科技	342,387	6,703,937.46	0.65
2	000043	中航地产	500,383	4,473,424.02	0.43
3	600533	栖霞建设	869,836	4,349,180.00	0.42
4	000627	天茂集团	528,100	2,165,210.00	0.21
5	002152	广电运通	94,875	2,101,481.25	0.20

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

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:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金跟踪复制标的指数中证800指数,配置了中证800指数成分股海通证券。

中国证监会2014年5月29日发布的《中国证监会对新股发行承销违规机构和个人采取监管措施》显示,海通证券因向禁止配售的配售对象配售股票,向投资者提供超出招股书范围的发行人信息等事项受到中国证监会"出具警示函"、"监管谈话"的监管措施,本基金认为:该监管措施对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

除上述情况外,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,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,213,680.45
2	应收证券清算款	28,577,360.35
3	应收股利	-
4	应收利息	18,930.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,809,970.93

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300315	掌趣科技	6,703,937.46	0.65	重大事项停牌
2	000627	天茂集团	2,165,210.00	0.21	重大事项停牌
3	002152	广电运通	2,101,481.25	0.20	重大事项停牌

5.11.6 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	长盛同庆800A	长盛同庆800B	长盛同庆中证800分级
报告期期初基金份额总额	395,617,006.00	593,425,510.00	195,466,399.41
报告期期间基金总申购份额	-	-	510,536.54
减,报告期期间基金总赎回份额	-	-	333,179,021.39
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-117,517,416.00	-176,276,124.00	293,793,540.00
报告期期末基金份额总额	278,099,590.00	417,149,386.00	156,591,454.56

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§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.《长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金合同》;
3.《长盛同庆中证800指数分级证券投资基金托管协议》;
4.《长盛同庆中证800指数分级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/或基金托管人的办公地址。

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
2015年1月22日

长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金

2014 第四季度 报告

2014年12月31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:2015年1月22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2015年1月21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2014年10月1日起至12月31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	132,634,127.60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,成份股发生配股、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		
下属分级基金简称	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
下属分级场内简称	同辉100A	同辉100B	长盛同辉
下属分级基金交易代码	150108	150109	160809
下属分级基金报告期末基金份额总额	63,793,566.00份	63,793,567.00份	5,046,994.60份
下属分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（2014年10月1日－2014年12月31日）
1.本期已实现收益	12,315,219.53
2.本期利润	25,615,267.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.2419
4.期末基金资产净值	177,533,946.06
5.期末基金份额净值	1.339

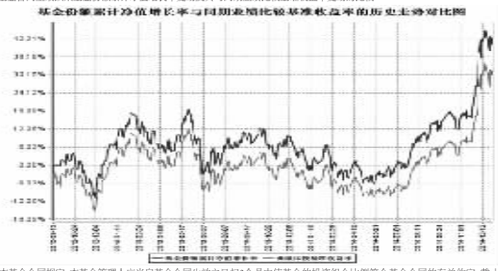
注:1.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.所列数据截止到2014年12月31日。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	23.18%	1.42%	24.39%	1.42%	-1.21%	0.00%

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,截止报告日,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。

§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	-	7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。

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、本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,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%的交易共有7次,为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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的说明

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1.339元,本报告期份额净值增长率为23.18%,同期业绩比较基准收益率为24.39%。报告期内,本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.20%,控制在0.35%之内;年化跟踪误差为2.02%,控制在4%之内。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	168,414,666.53	90.85
	其中:股票	168,414,666.53	90.85
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	16,785,342.19	9.06
7	其他资产	170,604.80	0.09
8	合计	185,370,613.52	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	693,722.40	0.39
B	采矿业	4,976,705.31	2.80
C	制造业	90,071,810.50	50.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,655,710.24	0.93
E	建筑业	1,699,605.60	0.96
F	批发和零售业	1,662,741.00	0.94
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	7,391,142.32	4.16
J	金融业	14,190,877.56	7.99
K	房地产业	9,825,044.61	5.53
L	租赁和商务服务业	3,437,330.30	1.94
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,306,838.30	2.99
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	3,283,586.65	1.85
S	综合	1,693,743.45	0.95
	合计	145,888,858.24	82.18

5.2.2 报告期末积极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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	11,476,394.02	6.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,741,391.00	0.98
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	6,371,032.87	3.59
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,655,702.40	0.93
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	1,281,288.00	0.72
S	综合	-	-
	合计	22,525,808.29	12.69

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	000831	五矿稀土	159,269	4,776,477.31	2.69
2	000783	长江证券	214,645	3,610,328.90	2.03
3	000024	招商地产	81,664	2,155,112.96	1.21
4	000001	平安银行	129,789	2,055,857.76	1.16
5	000069	华侨城A	241,510	1,992,457.50	1.12
6	000002	万科A	142,201	1,976,593.90	1.11
7	002146	荣盛发展	121,708	1,931,505.96	1.09
8	000402	金融街	153,685	1,894,936.05	1.07
9	002304	洋河股份	23,954	1,893,563.70	1.07
10	000046	泛海建设	188,766	1,866,895.74	1.05

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

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	002465	海格通信	105,785	2,043,766.20	1.15
2	300017	网宿科技	38,520	1,856,664.00	1.05
3	000963	华东医药	33,100	1,741,391.00	0.98
4	002475	立讯精密	60,700	1,680,176.00	0.95
5	002030	达安基因	83,500	1,675,845.00	0.94

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序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序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序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

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:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,024.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,362.10
5