# 长盛添利30天理财债券型证券投资基金

## 2013 第四季度 报告

2013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:中国银行股份有限公司**
**报告送出日期:2014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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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2013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 | 90,376,931.34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。 | |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、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 | 长盛添利30天理财债券A | 长盛添利30天理财债券B |
| 下属两级基金的交易代码 | 080016 | 080017 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 29,842,546.48份 | 60,534,384.86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10月1日 - 2013年12月31日) | |
|---|---|---|
| | 长盛添利30天理财债券A | 长盛添利30天理财债券B |
| 1.本期已实现收益 | 392,018.21 | 377,985.06 |
| 2.本期利润 | 392,018.21 | 377,985.06 |
| 3.期末基金资产净值 | 29,842,546.48 | 60,534,384.86 |

注:1、所列数据截止到2013年12月31日。

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛添利30天理财债券A

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.9892% | 0.0029% | 0.3403% | 0.0000% | 0.6489% | 0.0029% |

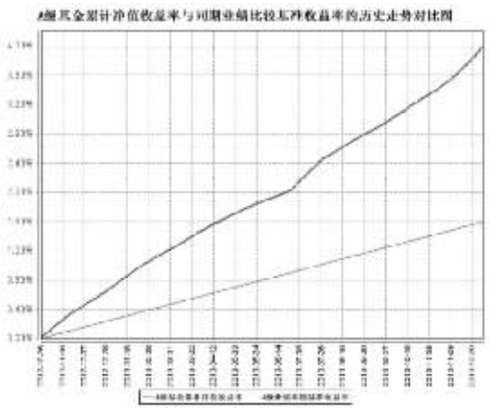
注:本基金收益分配是按日结转份额。

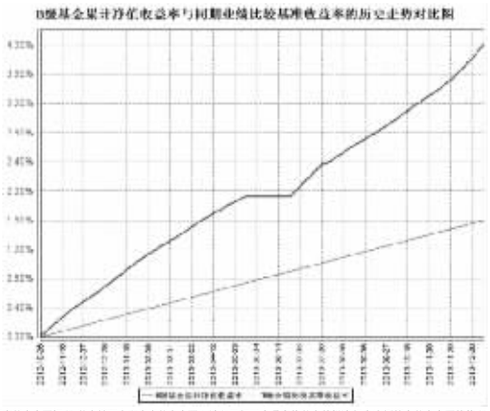
长盛添利30天理财债券B

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 1.0584% | 0.0029% | 0.3403% | 0.0000% | 0.7181% | 0.0029% |

注:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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,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本基金合同第十四条(二)投资范围、(七)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 | | |
| 杨衡 | 本基金基金经理,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基金经理,长盛纯债债券型证券投资基金基金经理,社保组合组合经理。 | 2012年10月26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等职务,现任社保组合组合经理,长盛添利30天理财债券型证券投资基金(本基金)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、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证业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、《长盛添利30天理财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 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年4季度,市场流动性仍处于相对紧平衡之中。一方面,隔夜利率和7天回购利率短期利率处于较低平稳;另一方面,21天以上,包括1个月3个月资金利率则持续维持高位,显示出市场脆弱预期。12月下旬,美联储宣布削减QE规模,时间点早于多数国内预期,国内由于年底财政存款投放时点也晚于预期,叠加央行维持中性偏紧的货币政策,自12月中下旬资金利率逐步跳升,跨年7天和14天资金利率一度超过10%。

目前组合规模有限,为避免融资回购成本摊余等及费用对组合收益的影响,在报告期内,组合未进行杠杆操作。组合操作主要通过协议存款、银行间市场和交易所市场回购等货币市场工具进行现金流期限匹配,控制组合流动性风险,赎平组合中购与赎回资金头寸。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2013年4季度,本基金A级净值收益率为0.9892%,B级净值收益率为1.0584%,同期业绩比较基准收益率0.3403%。

### §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 | 固定收益投资 | 20,000,417.28 | 21.92 |
| | 其中:债券 | 20,000,417.28 | 21.92 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 12,200,134.25 | 13.37 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 58,231,116.46 | 63.82 |
| 4 | 其他资产 | 805,977.20 | 0.88 |
| 5 | 合计 | 91,237,645.19 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | | 0.58 |
| | 其中:买断式回购融资 | | - |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%"。本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 11 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 36 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 11 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过150天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 100.06 | 0.55 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | - | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | - | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | - | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | - | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 100.06 | 0.55 |

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 | 摊余成本(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 | 20,000,417.28 | 22.13 |
| | 其中:政策性金融债 | 20,000,417.28 | 22.13 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 20,000,417.28 | 22.13 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 130201 | 13国开01 | 200,000 | 20,000,417.28 | 22.13 |

注:截至本报告期末,本基金仅持有上述1只债券。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | -0.0027% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0831% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0583% |

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 773,977.20 |
| 4 | 应收申购款 | 32,000.00 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 805,977.20 |

5.8.5 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 | 长盛添利30天理财债券A | 长盛添利30天理财债券B |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 51,909,884.73 | 30,156,399.80 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,469,034.75 | 30,377,985.06 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 23,536,373.00 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 29,842,546.48 | 60,534,384.86 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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、《长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛添利30天理财债券型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛添利30天理财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**
**2014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

## 2013 第四季度 报告

2013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:2014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2014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2013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 | 136,418,306.23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。<br>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。<br>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 | 66,428,331.00份 | 66,428,332.00份 | 3,561,643.23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10月1日 - 2013年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -5,563,261.95 |
| 2.本期利润 | -3,586,213.96 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0262 |
| 4.期末基金资产净值 | 139,113,093.49 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.020 |

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 | -2.49% | 1.08% | -2.36% | 1.10% | -0.13% | -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(本基金)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,长盛量化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等职务。曾任本基金基金经理,目前已离任。 | 2012年9月13日 | 2013年11月4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,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

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013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 | 136,418,306.23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。<br>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。<br>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 | 66,428,331.00份 | 66,428,332.00份 | 3,561,643.23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10月1日 - 2013年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -5,563,261.95 |
| 2.本期利润 | -3,586,213.96 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0262 |
| 4.期末基金资产净值 | 139,113,093.49 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.020 |

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 | -2.49% | 1.08% | -2.36% | 1.10% | -0.13% | -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,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(本基金)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(本基金)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,长盛量化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等职务。曾任本基金基金经理,目前已离任。 | 2012年9月13日 | 2013年11月4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,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

四季度,流动性紧张格局依然没有得到明显缓解,且其持续时间明显超过6月份,市场担忧情绪日渐浓重。同时,伴随商业银行"配非标、挤债券"的资产配置行为的明显变化,以及"紧货币"环境下分级债基、封闭债基的集中开放导致的债券抛售行为,促使债券市场行情总转直下,收益率一路飙升,已突破2011年通胀高企、货币紧缩时期的高点。

报告期内,本基金坚持稳健操作思路,在利率持续上行的市场形势下,严格控制组合久期和仓位,以抵御市场持续调整带来的估值压力。同时,在严格评估信用风险的前提下,在债券收益率高位的市场环境下精挑细选个券,提升组合收益。

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1.006元,本报告期份额净值增长率为-2.04%,同期业绩比较基准增长率为1.02%。

### §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 | 799,524,589.80 | 91.30 |
| | 其中:债券 | 799,524,589.80 | 91.30 |
| | 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 | 43,446,591.69 | 4.96 |
| 6 | 其他资产 | 32,784,464.07 | 3.74 |
| 7 | 合计 | 875,755,645.56 | 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 | - | - |
| | 其中:政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 728,056,589.80 | 127.44 |
| 5 | 企业