

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																											
<b>§ 1 重要提示</b> 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,保证基金数据不存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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。																											
<b>§ 2 基金产品概况</b> <table><tr><td>基金名称</td><td>长盛上证市值百强ETF</td></tr><tr><td>基金代码</td><td>510700</td></tr><tr><td>交易代码</td><td>510700</td></tr><tr><td>基金运作方式</td><td>交易型开放式</td></tr><tr><td>基金合同生效日</td><td>2013年7月24日</td></tr><tr><td>报告期末基金份额总额</td><td>68,213,677.00份</td></tr></table> <p><b>投资目标</b> 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的收益表现相一致的长期投资目标。</p> <p><b>投资策略</b> 本基金主要采用完全复制法,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,并根据标的指数的成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但特殊情况(如流动性不足等)导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人有权根据中国证监会认可的合法合规的方式进行替代。本基金跟踪标的指数的成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。</p> <p>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%。如标的指数的编制出现错误或特殊原因,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。</p> <p><b>业绩比较基准</b> 上证市值百强指数</p> <p><b>风险收益特征</b> 本基金为被动式投资的股票型基金,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代表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。</p> <p>基金管理人 长盛基金管理有限公司</p> <p>基金托管人 中国银行股份有限公司</p>		基金名称	长盛上证市值百强ETF	基金代码	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7月24日	报告期末基金份额总额	68,213,677.00份														
基金名称	长盛上证市值百强ETF																										
基金代码	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7月24日																										
报告期末基金份额总额	68,213,677.00份																										
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> <div>单位:人民币元</div> <table><tr><th>主要财务指标</th><th>报告期(2013年7月1日 - 2013年9月30日)</th></tr><tr><td>1.本期已实现收益</td><td>-676,269.69</td></tr><tr><td>2.本期利润</td><td>14,631,573.86</td></tr><tr><td>3.加权平均基金份额本期利润</td><td>0.1698</td></tr><tr><td>4.期末基金资产净值</td><td>119,350,432.44</td></tr><tr><td>5.期末基金份额净值</td><td>1.750</td></tr></table> <p>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.报告期利润包括2013年9月30日:</p> <p><b>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</b></p> <table><tr><th>阶段</th><th>净值增长率</th><th>净值增长率标准差</th><th>业绩比较基准收益率</th><th>业绩比较基准收益率标准差</th><th>①-③</th><th>②-④</th></tr><tr><td>过去三个月</td><td>9.31%</td><td>1.46%</td><td>7.56%</td><td>1.53%</td><td>1.75%</td><td>-0.07%</td></tr></table> <p><b>3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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</b></p>		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	阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④	过去三个月	9.31%	1.46%	7.56%	1.53%	1.75%	-0.07%
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																										
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④																					
过去三个月	9.31%	1.46%	7.56%	1.53%	1.75%	-0.07%																					

<p>平低于下列数字。</p> <p>2. 所列数据截止到2013年9月30日。</p> <p>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。</p> <p>3.2 基金净值表现</p> <p>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</p> <table border="1"> <tr> <th>阶段</th> <th>净值增长率①</th> <th>净值增长率标准差②</th> <th>业绩比较基准收益率③</th> <th>业绩比较基准收益率标准差④</th> <th>①-③</th> <th>②-④</th> </tr> <tr> <td>过去三个月</td> <td>9.31%</td> <td>1.46%</td> <td>7.56%</td> <td>1.53%</td> <td>1.75%</td> <td>-0.07%</td> </tr> </table>							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%
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%														
<p>3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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</p> <p>基金合同生效以来基金资产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</p>																				

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	
<b>§ 1 重要提示</b> 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,保证基金数据不存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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。 本报告日期2013年7月1日起至9月30日止。	
<b>§ 2 基金产品概况</b>	
<b>2.1 基金产品情况</b>	
基金名称	长盛上证市值百强ETF联接
基金代码	000063
代码简称	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
截至期末基金份额总额	49,724,984.71份
投资目标	跟踪投资于上证ETF,紧密跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现与业绩比较基准收益表现相一致的长期收益目标。
投资策略	本基金为上证ETF的联接基金,以投资于ETF作为其主要投资策略,方便特定的投资者参与本基金投资上证ETF,本基金资产不低于投资于ETF资产的投资目。 为更有效地实现本基金跟踪投资目标,本基金资产投资于上证ETF资产,其资产投资于上证ETF资产的比例不低于基金资产净值的90%。 本基金跟踪业绩比较基准:上证市值百强指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。 本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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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。 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1.4%。如指数编制出现错误或特殊原因,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	上证市值百强指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为被动式投资的股票型基金,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代表的市场组合风险收益特征相近,属于高风险、高收益的金融产品。
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
<b>2.1.2 目标基金基本情况</b>	
基金名称	长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	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

投资目标	本基金在追求基金资产增值的基础上,力求超越业绩比较基准的收益率,力争实现与标的指数表现相一致的长期投资。
投资策略	本基金主要采用自上而下的投资策略,在控制基金资产久期、信用风险和流动性风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的增值。 本基金根据对利率走势的判断,并依据标的指数的收益率和权益类资产价格进行相应的资产配置,以期待获得超越标的指数的投资收益。 其中,基金管理人将根据使用其他方法来进行适当的替代。本基金根据标的指数的构成对标的指数的收益率的构成不低于基金资产净值的90%。 在日常管理中,本基金将根据标的指数的构成和标的指数的收益率进行适当的替代,以期在不超过2%的幅度内实现超越。如标的指数的编制规则发生变动,本基金将根据标的指数的编制规则进行适当的替代,以期在不超过2%的幅度内实现超越。 同时,本基金将根据标的指数的编制规则进行适当的替代,以期在不超过2%的幅度内实现超越。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为:长盛添利30天理财债券基金收益率。
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。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一致。

3.1 主要财务指标

3.2 主要财务指标和基金净值表现

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	-16,592,142.50
2.本期利润	10,167,018.33
3.期末平均基金份额净值	0.0875
4.期末基金资产净值	48,396,545.50
5.期末基金份额净值	0.973

注:1.本期利润包括2013年9月30日:

1.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。

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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	7.51%	1.44%	7.21%	1.45%	0.30%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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法律责任。

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,保证基金数据不存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。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。

本报告日期2013年7月1日起至9月30日止。

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

基金名称	长盛添利30天理财债券基金	
基金代码	080016	
交易代码	080016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年10月26日	
报告期末基金份额总额	82,066,284.53份	

**投资目标**

本基金在追求基金资产增值的基础上,力争为基金份额持有人获取高于业绩比较基准的长期投资收益。

**投资策略**

本基金在投资组合管理中将采用主动投资策略,在投资组合中将充分挖掘现代金融工程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及及时性,在控制风险的前提下,追求收益最大化。

**业绩比较基准**

七天通知存款收益率。

**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

本基金所投资的基金名称	长盛添利30天理财债券基金B
本基金所投资的基金代码	080016
报告期末本基金所投资的基金份额总额	51,909,884.73份

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

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)	
	长盛添利30天理财债券基金A	长盛添利30天理财债券基金B
1. 本期已实现收益	639,805.02	314,527.40
2. 本期利润	639,805.02	314,527.40
3. 期末基金资产净值	51,909,884.73	30,156,399.80

注:1. 报告期利润包括2013年9月30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。本期已实现收益指本期利润扣除公允价值变动的比较

### 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	0.8828%	0.0027%	0.3403%	0.0000%	0.5425%	0.0027%

注:本基金收益数据是按月结转的。

### 3.2.2 基金净值表现

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	0.9185%	0.0027%	0.3403%	0.0000%	0.5782%	0.0027%

注:本基金收益数据是按月结转的。

3.2.2 自基金合同生效以来基金资产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

长盛添利30天理财债券基金A

长盛添利30天理财债券基金B

## 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

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逾一年。				
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符合基金合同的约定。建仓期结束后,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十七条 C、投资组合范围、D、投资禁止行为及限制的有关约定。				
§ 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	在本基金的基金经理任期	证券从业年限	说明
赵宏宇	本基金基金经理 负责本基金股票 投资及衍生品交 易,并担任基金 产品开发与金融 工程部的副总监	2013年4月24日	6年	男,1972年6月出生,中国国籍,四川大学工学工商管理学院管理学(金融投融资研究方向)博士,历任美国惠康基金投资管理顾问部门数量分析师、招商银行股份有限公司博士后研究员,2007年8月加入长盛基金管理有限公司,历任基金工程研究员、产品研究员、数量研究员、基金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.证券从业年限指《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.2. 管理人对于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的利益的行为。

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利。

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:公司实行集中交易制度,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、3、5 日的交易价差进行 T 检验,未发现违反公平交易利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易或成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。

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运作分析

注:1.本基金合同生效日为2013年5月10日,截至本报告期末本基金成立未逾一年。

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。建仓期结束后,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十七条 C、投资组合范围、D、投资禁止行为及限制的有关约定。

**§ 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
1.1	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	-	-
4	资产支持证券	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,440,214.23	5.01
8	其他资产	151,636.39	0.31
8.1	其中:应收股利	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	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	600028	中国石化	1,000	68,800.00	0.14
9	600000	浦发银行	1,000	68,800.00	0.14
10	600008	首创股份	1,000	68,800.00	0.14

**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	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	地方政府债	-	-
4	企业债	-	-
5	公司债	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
合计	合计	-	-

**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**

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	-	-	-
2	-	-	-
3	-	-	-
4	-	-	-
5	-	-	-

**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**

序号	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	-	-	-
2	-	-	-
3	-	-	-
4	-	-	-
5	-	-	-
6	-	-	-
7	-	-	-
8	-	-	-
9	-	-	-
10	-	-	-

**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权证投资明细**

序号	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	-	-	-
2	-	-	-
3	-	-	-
4	-	-	-
5	-	-	-

**5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

序号	品种名称	持仓量(合约)	公允价值(元)	报告期末持仓损益(元)
1	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
2	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
3	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
4	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
5	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
6	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
7	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
8	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
9	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
10	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
11	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
12	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
13	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
14	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
15	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
16	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
17	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
18	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
19	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
20	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
21	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
22	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
23	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
24	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
25	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
26	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
27	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
28	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
29	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
30	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
31	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
32	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
33	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
34	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
35	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
36	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
37	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
38	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
39	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
40	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
41	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
42	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
43	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
44	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
45	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
46	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
47	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
48	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
49	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
50	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
51	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
52	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
53	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
54	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
55	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
56	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
57	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
58	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
59	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
60	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
61	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
62	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
63	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
64	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
65	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
66	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
67	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
68	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
69	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
70	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
71	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
72	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
73	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
74	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
75	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
76	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
77	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
78	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
79	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
80	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
81	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
82	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
83	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
84	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
85	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
86	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
87	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
88	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
89	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
90	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
91	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
92	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
93	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
94	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
95	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
96	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
97	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
98	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
99	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
100	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00

**5.8.2 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

序号	品种名称	持仓量(合约)	公允价值(元)	报告期末持仓损益(元)
1	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
2	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
3	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
4	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
5	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
6	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
7	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
8	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
9	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
10	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
11	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
12	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
13	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
14	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
15	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
16	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
17	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
18	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
19	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
20	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
21	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
22	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
23	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
24	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
25	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
26	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
27	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
28	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
29	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
30	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
31	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
32	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
33	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
34	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
35	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
36	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
37	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
38	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
39	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
40	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
41	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
42	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
43	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
44	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
45	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
46	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
47	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
48	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
49	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
50	IF1509	100	1,000,000.00	100,000.00
51	IF1509	100	1,000,000.00	100