

长盛公募基金中100指数分级证券投资基金招募说明书(更新)摘要

基金管理人：长盛基金管理有限公司 基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

(3)组合调整
本基金将根据股票指数编制上根据中证200指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规及《基金合同》中的投资比例限制,申购赎回变动情况,股票增发等因素变化,对股票投资组合进行实时调整,力争实现基金净值增长率与中证200指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起每个工作日内使本基金的股票投资组合比例符合《基金合同》的约定。

(定期调整)
根据中证200指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

(2)时间调整
A、当出现对基金资产发生较大、配股等影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;
B、根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪中证200指数;

C、根据法律法规的规定,成份股在沪深200指数中的权重发生变化时其原因发生相应变化的,本基金将根据相应调整,以保持基金资产中该成份股的权重跟踪一致。
(3)其他调整
针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购,认购时将根据发行价格、申购总量,运用合理的方法,对认购数量进行分配。

(4)投资组合调整
在正常市场情况下,本基金力争年跟踪误差率不超过4%,如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超出上述范围,基金管理人应采取合理措施跟踪误差跟踪误差最小化。

第十二部分 基金的投资目标
本基金业绩比较基准=95%×中证200 指数收益率+5%×一年期银行活期存款利率(税后)。

中证200 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A 股市场指数,它的样本选自沪深两个证券市场,其成份股票为中国A 股市场代表性最强、流动性高的中盘股,能够反映A 股市场整体发展趋势。

本基金认为,该业绩比较基准能够有效衡量本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化,或有更权威、更能作为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的投资业绩比较基准的指数时,本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准,并与基金托管人协商一致,报中国证监会备案后予以公告。

第十二部分 基金的风险收益特征
本基金为完全复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所持有的两类基金份额构成来看,而本基金的风险收益特征,与沪深300指数的风险收益特征相似,但本基金的风险收益特征,与沪深300指数的风险收益特征存在一定差异。

本基金的投资组合中,中国A股市场股票资产占基金资产净值比例不低于80%的财务指标符合《基金合同》约定,本基金符合《基金合同》约定。

本投资组合报告所载数据取自自长盛中证200指数分级证券投资基金2013年第四季度报告,报告截止日:2013年9月30日。本报告中财务资料未经审计。

一、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	49,565,375.74	92.50
2	其中:股票	49,565,375.74	92.50
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售金融资产的买入返售	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	3,019,363.52	5.63
9	其他资产	1,001,932.14	1.87
10	合计	53,586,671.40	100.00

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	740,480.00	1.39
B	采掘业	3,148,803.32	5.96
C	制造业	26,734,175.67	50.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,575,243.87	2.97
E	建筑业	1,803,351.58	3.40
F	交通运输、仓储和邮政业	1,003,510.50	1.93
G	住宿和餐饮业	1,046,849.41	1.97
H	信息传输、软件和信息技术服务业	2,237,133.70	4.24
I	金融业	3,727,721.49	6.18
J	房地产业	3,149,862.37	5.97
K	批发和零售业	1,049,419.36	1.98
L	教育、文化、体育和娱乐业	-	-
M	其他行业	-	-
N	其他行业	-	-
O	其他行业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他行业	-	-
R	其他行业	-	-
S	其他行业	-	-
T	其他行业	-	-

(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积极投资股票。

三、报告期末按股票投资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	600089	特变电工	73,768	890,379.76	1.68
2	600671	宝通科技	15,138	392,474.38	0.74
3	600355	天士力	16,916	761,558.32	1.43
4	600383	金通桥	125,722	756,846.44	1.43
5	600804	博通电子	40,445	749,850.30	1.41
6	002341	万邦医药	16,406	697,459.88	1.31
7	000423	青岛双星	15,349	628,335.09	1.18
8	600690	青岛海尔	46,338	617,222.16	1.16
9	600315	上海家化	12,937	569,167.17	1.06
10	000236	招商局A	29,517	595,678.82	1.05

四、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股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

五、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

六、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

七、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

八、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

九、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十一、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十二、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十三、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十四、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十五、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

长盛基金管理有限公司
二〇一四年一月十四日

基金管理人：长盛基金管理有限公司 基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

(3)组合调整
本基金将根据股票指数编制上根据中证200指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规及《基金合同》中的投资比例限制,申购赎回变动情况,股票增发等因素变化,对股票投资组合进行实时调整,力争实现基金净值增长率与中证200指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

基金管理人应当自《基金合同》生效之日起每个工作日内使本基金的股票投资组合比例符合《基金合同》的约定。

(定期调整)
根据中证200指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

(2)时间调整
A、当出现对基金资产发生较大、配股等影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;
B、根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪中证200指数;

C、根据法律法规的规定,成份股在沪深200指数中的权重发生变化时其原因发生相应变化的,本基金将根据相应调整,以保持基金资产中该成份股的权重跟踪一致。
(3)其他调整
针对我国证券市场新股发行制度的特点,本基金将参与一级市场新股认购,认购时将根据发行价格、申购总量,运用合理的方法,对认购数量进行分配。

(4)投资组合调整
在正常市场情况下,本基金力争年跟踪误差率不超过4%,如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超出上述范围,基金管理人应采取合理措施跟踪误差跟踪误差最小化。

第十二部分 基金的投资目标
本基金业绩比较基准=95%×中证200 指数收益率+5%×一年期银行活期存款利率(税后)。

中证200 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A 股市场指数,它的样本选自沪深两个证券市场,其成份股票为中国A 股市场代表性最强、流动性高的中盘股,能够反映A 股市场整体发展趋势。

本基金认为,该业绩比较基准能够有效衡量本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化,或有更权威、更能作为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的投资业绩比较基准的指数时,本基金可以在履行适当程序后变更业绩比较基准,并与基金托管人协商一致,报中国证监会备案后予以公告。

第十二部分 基金的风险收益特征
本基金为完全复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其预期风险收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。从本基金所持有的两类基金份额构成来看,而本基金的风险收益特征,与沪深300指数的风险收益特征相似,但本基金的风险收益特征,与沪深300指数的风险收益特征存在一定差异。

本基金的投资组合中,中国A股市场股票资产占基金资产净值比例不低于80%的财务指标符合《基金合同》约定,本基金符合《基金合同》约定。

本投资组合报告所载数据取自自长盛中证200指数分级证券投资基金2013年第四季度报告,报告截止日:2013年9月30日。本报告中财务资料未经审计。

一、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	49,565,375.74	92.50
2	其中:股票	49,565,375.74	92.50
3	固定收益投资	-	-
4	其中:债券	-	-
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售金融资产的买入返售	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	3,019,363.52	5.63
9	其他资产	1,001,932.14	1.87
10	合计	53,586,671.40	100.00

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	740,480.00	1.39
B	采掘业	3,148,803.32	5.96
C	制造业	26,734,175.67	50.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,575,243.87	2.97
E	建筑业	1,803,351.58	3.40
F	交通运输、仓储和邮政业	1,003,510.50	1.93
G	住宿和餐饮业	1,046,849.41	1.97
H	信息传输、软件和信息技术服务业	2,237,133.70	4.24
I	金融业	3,727,721.49	6.18
J	房地产业	3,149,862.37	5.97
K	批发和零售业	1,049,419.36	1.98
L	教育、文化、体育和娱乐业	-	-
M	其他行业	-	-
N	其他行业	-	-
O	其他行业	-	-
P	其他行业	-	-
Q	其他行业	-	-
R	其他行业	-	-
S	其他行业	-	-
T	其他行业	-	-

(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积极投资股票。

三、报告期末按股票投资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	600089	特变电工	73,768	890,379.76	1.68
2	600671	宝通科技	15,138	392,474.38	0.74
3	600355	天士力	16,916	761,558.32	1.43
4	600383	金通桥	125,722	756,846.44	1.43
5	600804	博通电子	40,445	749,850.30	1.41
6	002341	万邦医药	16,406	697,459.88	1.31
7	000423	青岛双星	15,349	628,335.09	1.18
8	600690	青岛海尔	46,338	617,222.16	1.16
9	600315	上海家化	12,937	569,167.17	1.06
10	000236	招商局A	29,517	595,678.82	1.05

四、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股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

五、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

六、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

七、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

八、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

九、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十一、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十二、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十三、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十四、报告期末按股票投资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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

长盛基金管理有限公司
二〇一四年一月十四日