

序号	债券品种	公允价值(元)	占金融资产净值比例(%)
1	国家债券	33,674,449.50	1.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	640,585,000.00	20.62
3	其中:政策性金融债	640,585,000.00	20.62
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	674,259,449.50	21.71

7	可转债					
8	其他					
9	合计			674,259,449.50		21.71
5.6 报告期末按公允价值计量金融资产公允价值的大于前5名的金融资产明细						
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	100209	10国开09	1,000,000	150,075,000.00	4.83	
2	080411	08长安11	1,000,000	100,070,000.00	3.22	
3	110203	11国开03	700,000	70,140,000.00	2.26	
4	030203	03国开03	500,000	50,000,000.00	1.61	
5	070228	07国开28	500,000	49,995,000.00	1.61	
5.6 报告期末按公允价值计量金融资产公允价值的大于前5名的资产支持证券明细						
本基金本报告期末未持有资产支持证券。						
5.6 报告期末按公允价值计量金融资产公允价值的大于前5名的权益投资明细						
本基金本报告期末未持有权益。						

5.8.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形:

5.8.2 声明本基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库:

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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	4,280,411.45
3	应收股利	—
4	应收利息	7,972,001.10
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	12,752,411.55

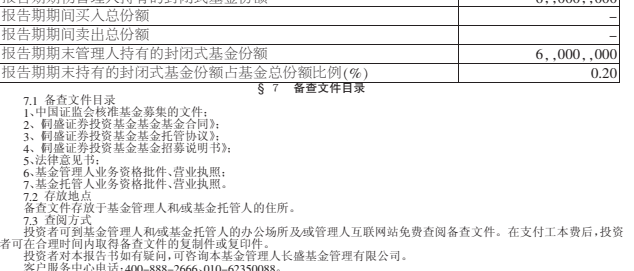
5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

5.8.6 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 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

报告期末基金管理人持有的封闭式基金份额	份额单位:份
	6,000,000



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	401,084,000.00	23.38
	其中:政策性金融债	401,084,000.00	23.38
4	企业债券	102,300.03	0.01
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-	-	
7	可转债	-	-	-	
8	其他	-	-	-	
9	合计	401,186,300.03		23.38	
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	110224	11国开24	1,000,000	100,260,000.00	5.84
2	120246	12国开46	800,000	79,864,000.00	4.66
3	110257	11国开57	500,000	50,355,000.00	2.94
4	030224	03国开24	500,000	50,215,000.00	2.93
5	110203	11国开03	500,000	50,100,000.00	2.92
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					
本基金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					
本基金本报告期末未持有权证。					
5.8 投资组合报告附注					
5.8.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公					

报告期内本基金的前十名债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。

5.8.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票目录。

基金的前十名股票,均为基金合同规定备选股票池之内的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	861,191.88
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	5,785,394.50
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,646,586.38

5.8.4	本报告期末持有的处于转股期的可转换债券余额 本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。							
5.8.5	本报告期前十名股票集中存在受限情况说明							
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	000527	美的电器	43,421,636.13	2.53	因重大事项停牌			
5.8.6	投资组合中报告期末的其它几项资产总额 由于买卖平仓的原因,持仓之和与上列数据可能存在差异。							
<b>§ 6 基金管理运用固有资金投资本封闭式基金情况</b>								
						份额单位:份		
报告期初管理人所持的封闭式基金份额						28,000,079		
报告期期间买入总份额						-		
报告期期间卖出总份额						-		
报告期末管理人持有的封闭式基金份额						28,000,079		
报告期末未持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)						1.40		

7.1 备查文件目录	§ 7 备查文件目录
1、中国证监会核准基金募集的文件； 2、利证证券投资私募基金基金合同； 3、利证证券投资私募基金基金托管协议； 4、利证证券投资私募基金招募说明书； 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、其他必要文件	7.2 备查地点 投资者可查阅与基金管理人、或基金托管人的住所。 7.3 查阅方式 投资者可至基金管理人、或基金托管人的办公场所或基金管理人互联网网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者还可对前述备查文件进行复印或复制。 投资者对中心网站有异议时，可致电本长盛基金管理公司。 客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350888。

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	600036	招商银行	3,883,777	53,401,933.75	5.91
2	600016	民生银行	5,838,452	45,890,232.72	5.08
3	601318	中国平安	866,731	39,254,246.99	4.35
4	601166	兴业银行	1,948,959	32,528,125.71	3.60
5	601328	交通银行	5,883,848	29,066,209.12	3.22

6	600000	浦发银行	2,881,462	28,584,103.04	3.16
7	000002	万科A	4,289,721	25,195,976.52	2.79
8	600030	中信证券	1,762,529	23,547,387.44	2.61
9	601088	中国神华	873,701	22,148,320.35	2.45
10	600519	贵州茅台	105,077	21,963,194.54	2.43

积极投资公允价值值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有有期限股票投资

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券

5.5 报告期末按公允价值值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券

5.6 报告期末按公允价值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

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值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证

5.8 报告期末前十名投资的主力成交主体是否是证监会部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚

5.9 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被证监会部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,050,000.00
2	应收证券清算款	2,725,282.22
3	应收股利	-
4	应收利息	21,280.64
5	应收申购款	154,321.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,950,884.56

5.8.6 报告期末持有待处置的长期股权投资账面价值

本基金本报告期末未持有待处置的长期股权投资

5.8.7 期末未指数投资前十名股票中在流通受限股份的情况说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限股份的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	25,195,976.52	2.79	重大事项停牌

期末和报告期末前十名股票中在流通受限股份的情况说明

本基金本报告期末未持有和积极投资股票

5.8.6 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
报告期初基金份额总额	1,216,839,402.43
报告期间基金份额总申购	10,769,111.98
减:报告期间基金份额总赎回	37,669,144.41

报告期间基金份额折变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期末基金份额总额	1,189,939,370.40

**§ 7 备查文件目录**

7.1 备查文件目录

一)关于中国证监会监管委员会同意设立长盛中证100指数证券投资基金的批复;

二)《长盛中证100指数证券投资基金基金合同》;

三)《长盛中证100指数证券投资基金托管协议》;

四)《长盛中证100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。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人或基金托管人的住所。

7.3 查阅方式

投资者可到基金管理人或基金托管人的办公场所或及管理人互联网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印件及复印件。

投资者对本报告有任何疑问,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:400-888-2666,010-62350808。

网址: <http://www.csfund.com.cn>。