

# 长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金

## 2013 第四季度报告

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

**1.1 重要提示**  
基金管理人及基金托管人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。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,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,保证托管内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托职责,但不保证基金一定盈利。  
基金的过往业绩并不预示其未来业绩,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。  
本报告自2013年10月11日起至12月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金名称	长盛同辉深证100等权重分级(场内简称:长盛同辉)
基金代码	160809
交易代码	160809
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	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**  
本基金采用指数化投资方式,通过严格的投资纪律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。  
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进行相应调整。

**投资策略**  
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,基金管理人可以合理运用申购、赎回、融券、融资等手段,对投资组合进行调整,以保证基金对深证100等权重指数的有效跟踪。  
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进行相应调整。

**业绩比较基准**  
95%×中证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**  
本基金为股票型基金,属于中高风险、较高收益的品种,其净值增长率预期高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。  
本基金主要投资于具有良好流动性的股票资产,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。  
本基金为股票型基金,属于中高风险、较高收益的品种,其净值增长率预期高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。  
本基金主要投资于具有良好流动性的股票资产,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

**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A(场内简称:同辉A)

**下属三级基金交易代码**  
150108

**下属三级基金报告期末基金份额总额**  
66,428,331.00份

**下属三级基金的风险收益特征**  
低风险,收益相对稳健

**3.1 主要财务指标**

**主要财务指标**

**1.本期已实现收益**  
-3,563,261.95

**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.本期利润为截至2013年12月31日止。  
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 本报告期末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**  
过去三个月

**净值增长率①**  
-2.49%

**净值增长率标准差②**  
1.08%

**业绩比较基准收益③**  
-2.36%

**业绩比较基准收益标准差④**  
1.10%

**①-③**  
-0.13%

**②-④**  
-0.02%

**3.3 投资组合报告**

**3.4 投资组合报告**

**3.5 投资组合报告**

**3.6 投资组合报告**

**3.7 投资组合报告**

**3.8 投资组合报告**

**3.9 投资组合报告**

**3.10 投资组合报告**

**3.11 投资组合报告**

**3.12 投资组合报告**

**3.13 投资组合报告**

**3.14 投资组合报告**

**3.15 投资组合报告**

**3.16 投资组合报告**

**3.17 投资组合报告**

**3.18 投资组合报告**

**3.19 投资组合报告**

**3.20 投资组合报告**

**3.21 投资组合报告**

**3.22 投资组合报告**

**3.23 投资组合报告**

**3.24 投资组合报告**

**3.25 投资组合报告**

**3.26 投资组合报告**

**3.27 投资组合报告**

**3.28 投资组合报告**

**3.29 投资组合报告**

**3.30 投资组合报告**

**3.31 投资组合报告**

**3.32 投资组合报告**

**3.33 投资组合报告**

**3.34 投资组合报告**

**3.35 投资组合报告**

**3.36 投资组合报告**

**3.37 投资组合报告**

**3.38 投资组合报告**

**3.39 投资组合报告**

**3.40 投资组合报告**

**3.41 投资组合报告**

**3.42 投资组合报告**

**3.43 投资组合报告**

**3.44 投资组合报告**

**3.45 投资组合报告**

**3.46 投资组合报告**

**3.47 投资组合报告**

**3.48 投资组合报告**

**3.49 投资组合报告**

**3.50 投资组合报告**

**3.51 投资组合报告**

**3.52 投资组合报告**

**3.53 投资组合报告**

**3.54 投资组合报告**

**3.55 投资组合报告**

# 长盛同庆中证800指数分级证券投资基金

## 2013 第四季度报告

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

**1.1 重要提示**  
基金管理人及基金托管人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。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,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,保证托管内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托职责,但不保证基金一定盈利。  
基金的过往业绩并不预示其未来业绩,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。  
本报告自2013年10月11日起至12月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金名称	长盛同庆中证800指数分级(场内简称:长盛同庆)
基金代码	160806
交易代码	160806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2012年5月12日
报告期末基金份额总额	1,998,224,391.67份

**投资目标**  
本基金采用指数化投资方式,通过严格的投资纪律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,以实现中证800指数的有效跟踪。  
本基金采用完全复制法,按照成份股在中证800指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证800指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

**投资策略**  
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,基金管理人可以合理运用申购、赎回、融券、融资等手段,对投资组合进行调整,以保证基金对中证800指数的有效跟踪。  
本基金采用完全复制法,按照成份股在中证800指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证800指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

**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**  
本基金为股票型基金,属于中高风险、较高收益的品种,其净值增长率预期高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。  
本基金主要投资于具有良好流动性的股票资产,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。  
本基金为股票型基金,属于中高风险、较高收益的品种,其净值增长率预期高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。  
本基金主要投资于具有良好流动性的股票资产,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

**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

**下属二级基金简称**  
长盛同庆A(场内简称:同庆A)

**下属二级基金交易代码**  
150098

**下属二级基金报告期末基金份额总额**  
847,899,772.00份

**下属二级基金的风险收益特征**  
低风险,收益相对稳健

**3.1 主要财务指标**

**主要财务指标**

**1.本期已实现收益**  
-3,965,181.24

**2.本期利润**  
-46,240,190.53

**3.加权平均基金份额本期利润**  
-0.0224

**4.期末基金资产净值**  
1,833,253,220.43

**5.期末基金份额净值**  
0.917

**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.本期利润为截至2013年12月31日止。  
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 本报告期末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**  
过去三个月

**净值增长率①**  
-2.86%

**净值增长率标准差②**  
1.07%

**业绩比较基准收益③**  
-2.53%

**业绩比较基准收益标准差④**  
1.09%

**①-③**  
-0.33%

**②-④**  
-0.02%

**3.3 投资组合报告**

**3.4 投资组合报告**

**3.5 投资组合报告**

**3.6 投资组合报告**

**3.7 投资组合报告**

**3.8 投资组合报告**

**3.9 投资组合报告**

**3.10 投资组合报告**

**3.11 投资组合报告**

**3.12 投资组合报告**

**3.13 投资组合报告**

**3.14 投资组合报告**

**3.15 投资组合报告**

**3.16 投资组合报告**

**3.17 投资组合报告**

**3.18 投资组合报告**

**3.19 投资组合报告**

**3.20 投资组合报告**

**3.21 投资组合报告**

**3.22 投资组合报告**

**3.23 投资组合报告**

**3.24 投资组合报告**

**3.25 投资组合报告**

**3.26 投资组合报告**

**3.27 投资组合报告**

**3.28 投资组合报告**

**3.29 投资组合报告**

**3.30 投资组合报告**

**3.31 投资组合报告**

**3.32 投资组合报告**

**3.33 投资组合报告**

**3.34 投资组合报告**

**3.35 投资组合报告**

**3.36 投资组合报告**

**3.37 投资组合报告**

**3.38 投资组合报告**

**3.39 投资组合报告**

**3.40 投资组合报告**

**3.41 投资组合报告**

**3.42 投资组合报告**

**3.43 投资组合报告**

**3.44 投资组合报告**

**3.45 投资组合报告**

**3.46 投资组合报告**

**3.47 投资组合报告**

**3.48 投资组合报告**

**3.49 投资组合报告**

**3.50 投资组合报告**

**3.51 投资组合报告**

**3.52 投资组合报告**

**3.53 投资组合报告**

**3.54 投资组合报告**

**3.55 投资组合报告**

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

**1.1 重要提示**  
基金管理人及基金托管人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。  
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定,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,保证托管内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。  
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托职责,但不保证基金一定盈利。  
基金的过往业绩并不预示其未来业绩,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。  
本报告自2013年10月11日起至12月31日止。

**1.2 基金产品概况**

基金名称	长盛同庆中证800指数分级(场内简称:长盛同庆)
基金代码	160806
交易代码	160806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2012年5月12日
报告期末基金份额总额	1,998,224,391.67份

**投资目标**  
本基金采用指数化投资方式,通过严格的投资纪律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,以实现中证800指数的有效跟踪。  
本基金采用完全复制法,按照成份股在中证800指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证800指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

**投资策略**  
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,基金管理人可以合理运用申购、赎回、融券、融资等手段,对投资组合进行调整,以保证基金对中证800指数的有效跟踪。  
本基金采用完全复制法,按照成份股在中证800指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪中证800指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

**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**  
本基金为股票型基金,属于中高风险、较高收益的品种,其净值增长率预期高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。  
本基金主要投资于具有良好流动性的股票资产,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。  
本基金为股票型基金,属于中高风险、较高收益的品种,其净值增长率预期高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。  
本基金主要投资于具有良好流动性的股票资产,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。

**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

**下属二级基金简称**  
长盛同庆A(场内简称:同庆A)

**下属二级基金交易代码**  
150098

**下属二级基金报告期末基金份额总额**  
847,899,772.00份

**下属二级基金的风险收益特征**  
低风险,收益相对稳健

**3.1 主要财务指标**

**主要财务指标**

**1.本期已实现收益**  
-3,965,181.24

**2.本期利润**  
-46,240,190.53

**3.加权平均基金份额本期利润**  
-0.0224

**4.期末基金资产净值**  
1,833,253,220.43

**5.期末基金份额净值**  
0.917

**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.本期利润为截至2013年12月31日止。  
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 本报告期末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**  
过去三个月

**净值增长率①**  
-2.86%

**净值增长率标准差②**  
1.07%

**业绩比较基准收益③**  
-2.53%

**业绩比较基准收益标准差④**  
1.09%

**①-③**  
-0.33%

**②-④**  
-0.02%

**3.3 投资组合报告**