

长盛上证50指数分级证券投资基金

[2015] 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:中国银行股份有限公司
基金类型:股票型基金
基金代码:602040
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2015年1月3日
报告期末基金份额总额:36,011,546.13份
投资目标:紧密跟踪标的指数,力求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制本基金净值增长与业绩基准之间的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
风险收益特征:股票型基金
报告期截至日期:2015年12月31日

§ 1 基金产品概况

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	-	-	-
B 采矿业	946,533,000	2.30	-
C 制造业	8,151,327,933	19.81	-
D 电力、煤气及水生产和供应业	393,279,000	0.90	-
E 建筑业	4,793,132,000	11.65	-
F 批发零售业	-	-	-
G 交通运输、仓储和邮政业	1,327,604,000	3.23	-
H 住宿和餐饮业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	1,602,900,000	3.90	-
J 金融业	20,491,046,000	49.80	-
K 房地产业	682,024,000	1.66	-
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	-	-	-
S 综合	-	-	-
合计	38,387,864,933	93.20	-

1. 投资策略
本基金主要采用复制法,即按照成份股的构成比例及其权重投资组合,并根据成份股的变动情况进行相应的调整,但特殊情况如(如个股停牌、限售股解禁)涉及的股票无法通过正常途径买卖,则由基金经理根据实际情况进行适当的调整,并根据实际情况对投资组合进行定期调整。基金经理将对投资组合进行优化,提高跟踪误差。

在非常情况下,本基金的跟踪目标是选取日均跟踪偏离度的绝对值不超0.35%,年跟踪误差不超过4%的指数为跟踪目标的指数。

2. 投资组合理念
本基金将主要投资于股票,本基金可以投资于股票类资产,在一年期以内投资的股票、债券、货币市场工具、权证、基金、股票型基金、商品期货等金融工具。

本基金将主要投资于股票,本基金可投资于国债回购、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、可转换债券、分离交易的可转债、权证、股票型基金、货币市场基金、商品期货等金融工具。

3. 风险与收益
本基金的风险收益特征与股票型基金相似,预期收益和风险高于货币市场基金,低于股票型基金。

本基金将主要投资于股票,本基金可投资于国债回购、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、可转换债券、分离交易的可转债、权证、股票型基金、货币市场基金、商品期货等金融工具。

4. 业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为上证50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本基金将主要投资于股票,本基金的业绩基准为上证50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本基金将主要投资于股票,本基金的业绩基准为上证50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

5. 风险揭示
本基金将主要投资于股票,本基金的业绩基准为上证50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本基金将主要投资于股票,本基金的业绩基准为上证50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

6. 其他风险
本基金将主要投资于股票,本基金的业绩基准为上证50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本基金将主要投资于股票,本基金的业绩基准为上证50指数收益率×95%+银行活期存款利率(税