长盛中信全债指数增强型债券投资基金

【2016】第一季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4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,保证复核内容不存在虚假记载、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛全债指数增强债券
基金主代码	510080
交易代码	510080
前端交易代码	510080
后端交易代码	511080
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年10月25日
报告期末基金份额总额	127,437,298.02份
投资目标	本基金为开放式债券型基金,将运用增强的指数化投资策略,在力求本金安全的基础上,追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳定增值
投资策略	本基金采用"自上而下"的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值,同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益
业绩比较基准	标普中国全债指数收益率×92%+标普中国A股综合指数收益率×8%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-723,149.83
2.本期利润	-357,344.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0044
4.期末基金资产净值	188,482,030.55
5.期末基金份额净值	1.4790

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、所列数据截止到2016年3月31日。

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 基金净值表现

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	-0.33%	0.18%	-0.01%	0.28%	-0.32%	-0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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

注:我司已于2016年4月15日发布公告修改本基金的业绩比较基准为"标普中国全债指数收益率×92%+标普中国A股综合指数收益率×8%"。

§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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马文祥	本基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛私募配置债券型证券投资基金基金经理,固定收益部副总监。	2014年9月10日	-	13年	男,1977年7月出生,中国国籍,清华大学经济管理学院经济学硕士。历任中国农业银行主任科员,工银瑞信企业年金基金经理、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理;2013年8月加入长盛基金管理有限公司,现任固定收益深圳副总监,长盛中信全债指数增强型债券投资基金(本基金)基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛私募配置债券型证券投资基金基金经理。

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"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对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、本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、特定客户资产管理组合等。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限。

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。

投资管理行为的监控与分析评估,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日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本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成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

2016年一季度,受基建和房地产投资增速回升等因素影响,国内经济有所改善,但持续性仍需观察;通胀方面,食品价格上涨推动通胀温和回升,大宗商品价格反弹带动PPI跌幅收窄。货币政策方面,央行运用多种工具保持适度流动性,并于3月1日起下调了存款准备金率,资金面总体呈现相对宽松的局面。债市呈现震荡调整走势,利率债方面,收益率曲线陡峭化,中短端利率下行,而长端利率上行,期限利差有所扩大;信用债方面,收益率曲线整体下行,中高评级债券信用利差均处于历史低位,而低评级债券信用利差仍较高,主要是受债市信用风险加速暴露影响所致。

货币市场方面,受央行运用多种流动性调节工具释放流动性及降准等宽松货币政策影响,市场流动性整体保持相对宽松局面,各中期期限Shibor利率及银行间质押式回购利率维持在较低水平。

一季度,A股市场呈现连续下跌后震荡盘整的走势。1月份,受人民币贬值预期、股东减持、新股发行注册制改革加速等因素影响,叠加指数熔断机制的"磁吸效应",股市连续快速下跌,其中上证综指最低下探至2638点;2月份以来,受人民币汇率趋稳、指数熔断机制暂停、国内经济小幅改善、"两会"的召开以及注册制改革和战略新兴板放缓等因素影响,股市恐慌情绪修复,呈现震荡盘整走势。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金坚持稳健操作思路,在信用风险可控的前提下重点配置中短期信用债,保持组合流动性,适度参与利率品种的投资机会。权益资产方面,根据市场行情变化,灵活调整权益资产比重,以避免净值大幅波动;同时,精选股票,择机进行波段操作,提升组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.4790元,本报告期份额净值增长率为-0.33%,同期业绩比较基准增长率为-0.01%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§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	9,680,843.78	4.88
	其中:股票	9,680,843.78	4.88
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	178,669,537.90	90.05
	其中:债券	178,669,537.90	90.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	5,904,749.82	2.98
8	其他资产	4,145,773.33	2.09
9	合计	198,400,904.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	1,161,852.00	0.62
C	制造业	3,119,853.00	1.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	748,828.00	0.40
F	批发和零售业	835,296.00	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	949,420.78	0.50
J	金融业	718,704.00	0.38
K	房地产业	190,744.00	0.10
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	1,017,544.00	0.54
R	文化、体育和娱乐业	938,602.00	0.50
S	综合	-	-
	合计	9,680,843.78	5.14

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	002296	辉煌科技	87,500	1,263,500.00	0.67
2	300015	爱尔眼科	34,100	1,017,544.00	0.54
3	002439	启明星辰	36,783	870,285.78	0.46
4	300148	天舟文化	39,100	837,522.00	0.44
5	000705	浙江震元	67,200	835,296.00	0.44
6	601186	中国铁建	66,800	748,828.00	0.40
7	601169	北京银行	71,300	718,704.00	0.38
8	000060	中金岭南	56,800	634,456.00	0.34
9	600188	兖州煤业	59,600	632,952.00	0.34
10	600775	南京熊猫	30,100	413,875.00	0.22

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	11,396,360.00	6.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,991,000.00	15.91
	其中:政策性金融债	29,991,000.00	15.91
4	企业债券	66,155,170.30	35.10
5	企业短期融资券	49,074,600.00	26.04
6	中期票据	21,322,000.00	11.31
7	可转债(可交换债)	730,407.60	0.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	178,669,537.90	94.79

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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110233	11国开33	200,000	19,988,000.00	10.60
2	101361015	13长沙轨交MTN001	100,000	10,903,000.00	5.78
3	1382109	13成渝MTN1	100,000	10,419,000.00	5.53
4	112150	12银轮债	100,000	10,358,000.00	5.50
5	041558063	15华电江苏CP001	100,000	10,062,000.00	5.34

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

注: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占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

报告期内基金投资的前十名证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。

5.10.2

本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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	377,991.00
2	应收证券清算款	1,732,325.83
3	应收股利	-
4	应收利息	2,032,173.17
5	应收申购款	3,283.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,145,773.33

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002439	启明星辰	870,285.78	0.46	重大事项停牌

5.10.6 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

报告期期初基金份额总额	73,856,759.68
报告期期间基金总申购份额	56,290,606.03
减:报告期期间基金总赎回份额	2,710,066.69
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	127,437,298.02

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》;

3、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金托管协议》;

4、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金招募说明书》;

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。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人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制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,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:400-888-2666,010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2016年4月22日

长盛中证100指数证券投资基金

【2016】第一季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4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,保证复核内容不存在虚假记载、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛中证100指数
基金主代码	519100
交易代码	519100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月22日
报告期末基金份额总额	394,279,062.50份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在4%以下,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用复制指数投资策略,按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪基准指数。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金,风险中等,将获得证券市场平均收益率。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略,在投资管理上将最大限度的分散非系统性风险。对于跟踪误差的风险,本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年1月1日 - 2016年3月31日)
1.本期已实现收益	-1,526,767.00
2.本期利润	-48,577,823.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1218
4.期末基金资产净值	350,939,548.13
5.期末基金份额净值	0.8901

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、所列数据截止到2016年3月31日。

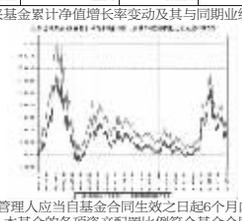
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

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	-11.68%	2.21%	-10.62%	2.05%	-1.06%	0.16%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计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



注:按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十三条"(二)投资范围"、"(八)投资限制"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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯雨生	本基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理,长盛中证金融证券公司指数分级证券投资基金基金经理。	2011年7月11日	-	9年	男,1983年11月出生,中国国籍。北京大学金融学硕士。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。现任长盛中证100指数证券投资基金(本基金)基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理,长盛中证金融证券公司指数分级证券投资基金基金经理。

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"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对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、本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、特定客户资产管理组合等。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限。

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。

投资管理行为的监控与分析评估,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日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本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成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度股票市场整体大幅下跌,基因检测、传感器和大数据板块大幅下跌,装饰园林、黄金珠宝和充电桩概念板块跌幅较少。行业上,计算机、通信和传媒等业跌幅靠前,食品饮料、银行和采掘跑赢市场。风格上,小盘成长股跑输大盘价值股。

在操作中,我们严格遵守基金合同,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为0.8901元,本报告期份额净值增长率为-11.68%,同期业绩比较基准增长率为-10.62%。本报告期内日均跟踪误差为0.0947%,年度化跟踪误差为1.4973%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§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	328,475,642.15	93.35
	其中:股票	328,475,642.15	93.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	22,947,206.19	6.52
8	其他资产	448,315.33	0.13
9	合计	351,871,163.67	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	10,452,728.96	2.98
C	制造业	88,277,190.34	25.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,266,274.25	3.50
E	建筑业	14,281,330.80	4.07
F	批发和零售业	3,123,067.65	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	7,811,153.49	2.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,710,616.90	2.77
J	金融业	165,669,471.18	47.21
K	房地产业	14,684,114.36	4.18
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	1,573,198.22	0.45
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	626,498.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	328,475,642.15	93.60

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601318	中国平安	679,784	21,623,929.04	6.16
2	600036	招商银行	1,083,815	17,438,583.35	4.97
3	600016	民生银行	1,851,392	16,866,181.12	4.81
4	601166	兴业银行	839,305	13,034,406.65	3.71
5	600000	浦发银行	587,204	10,528,567.72	3.00
6	000002	万 科A	494,108	9,294,171.48	2.65
7	600030	中信证券	488,631	8,697,631.80	2.48
8	601328	交通银行	1,491,385	8,307,014.45	2.37
9	600519	贵州茅台	31,830	7,882,381.20	2.25
10	600837	海通证券	501,496	7,166,377.84	2.04

5.3.2 报告期末积极投资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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注: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占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

(1)本基金跟踪的标的指数为中证100指数,配置了中证100指数成分股兴业银行。

根据 2015年6月9日兴业银行公告"2015年5月中旬,公司南宁分行下辖二级分行北海分行接到北海市公安局通报,该分行前员工苏瑜涉嫌个人非法集资已被立案,目前案件在调查阶段。公司南宁以及北海两级分行成立专项调查小组,就其涉及业务进行了全面内部排查,未发现银行资金卷入其中。目前,公司北海分行经营、财务状况与对外服务均正常。本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

(2)本基金跟踪的标的指数为中证100指数,配置了中证100指数成分股中信证券。

2015年8月25日,公司有几名高级管理人员和员工被公安机关要求协助调查有关问题,调查工作尚在进行之中。2015年9月15日,公司总经理程博明、经纪业务发展与管理委员会运营管理部负责人于新利、信息技术中心汪锦岭等人因涉嫌内幕交易、泄露内幕信息被公安机关依法要求接受调查。本基金做出如下说明:上述事件尚未有最终结论,我们将密切跟踪事件进展,避免潜在风险。

(3)本基金跟踪复制标的指数中证100指数,配置了中证100指数成分股海通证券。

2015年9月10日,海通证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书(处罚字【2015】73号),海通证券涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案,对海通证券责令改正,给予警告,没收违法所得28,653,000元,并处以 85,959,000元罚款。本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

除上述事项外,本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	344,569.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,242.26
5	应收申购款	91,513.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	448,315.33

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000002	万 科A	9,294,171.48	2.65	重大事项停牌

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.11.6 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

报告期期初基金份额总额	396,395,212.75
报告期期间基金总申购份额	16,745,485.13
减:报告期期间基金总赎回份额	18,861,635.38
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	394,279,062.50

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,157,456.32
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	10,157,456.32
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2016年2月18日	10,157,456.32	8,487,628.91	0.25%
合计			10,157,456.32	8,487,628.91	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)关于中国证券监督管理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。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人互联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制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,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:400-888-2666,010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2016年4月22日

长盛中证金融地产指数分级证券投资基金

【2016】第一季度报告

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
报告送出日期:2016年4月22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2016年4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,保证复核内容不存在虚假记载、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。

基金的过往业绩并不代表其未来