

# 长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

2016 年 12 月 31 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

报告送出日期：2017 年 1 月 21 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 2017 年 1 月 20 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	长盛同瑞中证 200 分级
场内简称	长盛同瑞
基金主代码	160808
交易代码	160808
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 12 月 6 日
报告期末基金份额总额	17,808,728.66 份
投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束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 200 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用完全复制法，按照成份股在中证 200 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 200 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 200 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%（其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%）。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。
业绩比较基准	中证 200 指数收益率×95%+一年期银行定期存款利率（税后）
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，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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		
下属分级基金简称	长盛同瑞 A	长盛同瑞 B	长盛同瑞中证 200 分级
下属分级场内简称	同瑞 A	同瑞 B	长盛同瑞
下属分级基金交易代码	150064	150065	160808
下属分级基金报告期末基金份额总额	2,825,421.00 份	4,238,131.00 份	10,745,176.66 份
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定	高风险、高预期收益	较高风险、较高预期收益

### § 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10月1日—2016年12月31日）
1. 本期已实现收益	-164,643.02
2. 本期利润	16,787.49
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0009
4. 期末基金资产净值	18,091,812.96
5. 期末基金份额净值	1.016

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12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。

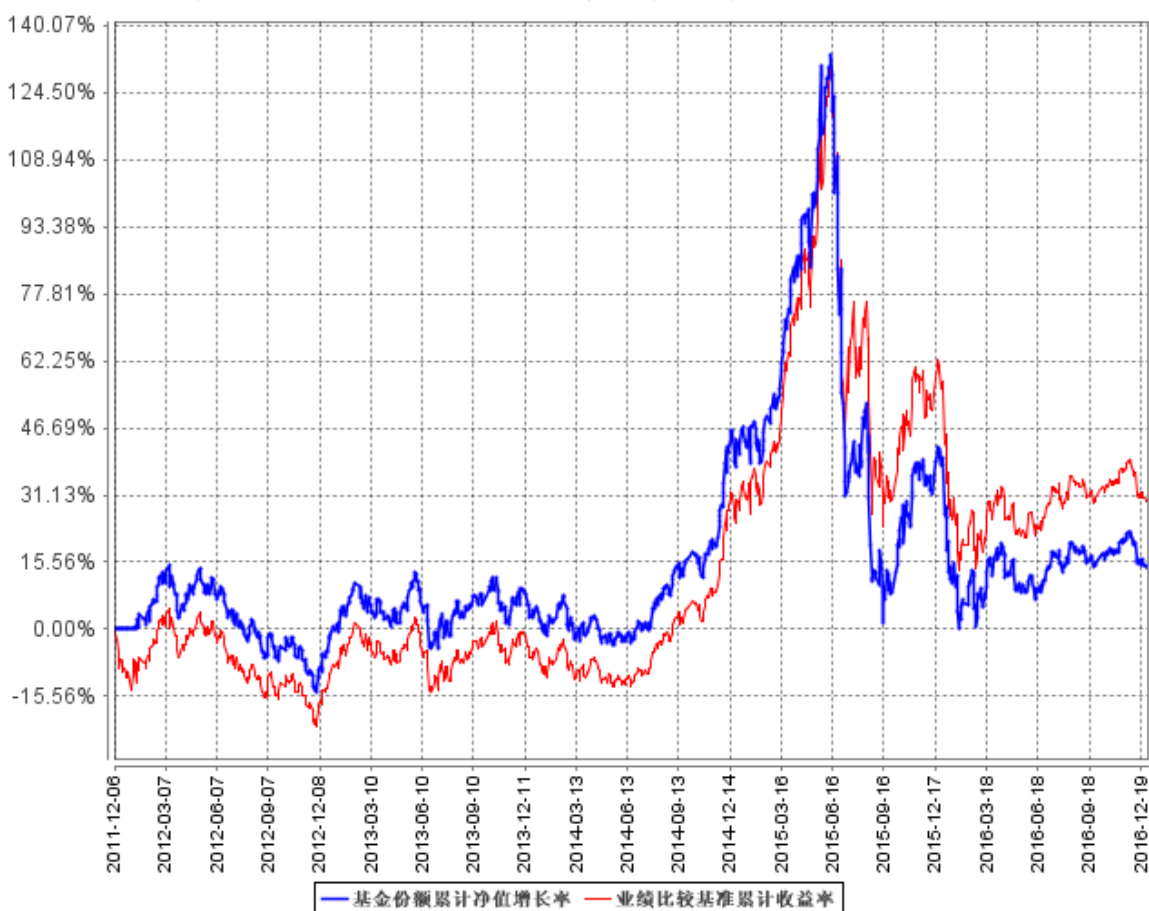
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-0.68%	0.73%	-0.38%	0.74%	-0.30%	-0.01%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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		
王超	本基金基金经理, 长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理, 长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理, 长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理, 长盛量化红利策	2011 年 12 月 6 日	-	10 年	王超先生, 1981 年 9 月出生。中央财经大学硕士, CFA (特许金融分析师), FRM (金融风险管理师)。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

	略混合型证券投资基金基金经理,长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理。				部金融工程研究员等职务。
--	-------------------------------------------------------------	--	--	--	--------------

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合规守信情况的说明

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

在报告期内，我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略，尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响，将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.016 元，本报告期份额净值增长率为-0.68%，同期业绩比较基准收益率为-0.38%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为 0.04%，控制在 0.35%之内；年化跟踪误差为 0.82%，控制在 4%之内。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自 2016 年 10 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。

## § 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	16,798,782.34	90.15
	其中：股票	16,798,782.34	90.15
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	1,832,030.17	9.83

8	其他资产	3,520.69	0.02
9	合计	18,634,333.20	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	44,683.20	0.25
B	采矿业	645,803.44	3.57
C	制造业	6,853,038.77	37.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	259,492.01	1.43
E	建筑业	372,528.67	2.06
F	批发和零售业	884,524.28	4.89
G	交通运输、仓储和邮政业	749,800.65	4.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,813,242.53	10.02
J	金融业	1,688,129.39	9.33
K	房地产业	909,255.88	5.03
L	租赁和商务服务业	518,258.99	2.86
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	213,498.80	1.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	59,800.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	544,103.96	3.01
S	综合	230,602.20	1.27
	合计	15,786,762.77	87.26

### 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

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	采掘业	42,339.00	0.23
C	制造业	300,841.09	1.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	347,119.76	1.92
E	建筑业	73,386.80	0.41
F	批发和零售业	39,571.92	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	37,129.00	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	108,324.00	0.60

K	房地产业	-	-
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	63,308.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	1,012,019.57	5.59

### 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	002450	康得新	12,788	244,378.68	1.35
2	600739	辽宁成大	12,607	226,421.72	1.25
3	601939	建设银行	38,100	207,264.00	1.15
4	601009	南京银行	17,966	194,751.44	1.08
5	601099	太平洋	33,964	174,914.60	0.97
6	000783	长江证券	16,683	170,667.09	0.94
7	002142	宁波银行	9,500	158,080.00	0.87
8	000503	海虹控股	3,706	155,837.30	0.86
9	600703	三安光电	11,020	147,557.80	0.82
10	600383	金地集团	11,200	145,152.00	0.80

### 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

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	601198	东兴证券	5,400	108,324.00	0.60
2	601106	中国一重	14,297	77,346.77	0.43
3	600642	申能股份	12,528	73,539.36	0.41
4	601117	中国化学	10,840	73,386.80	0.41
5	600027	华电国际	13,600	67,320.00	0.37



## **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**

注：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**

本基金跟踪的标的指数为中证 200 指数，配置了中证 200 指数成分股长江证券。2016 年 3 月 17 日，中国证监会湖北监管局（以下简称湖北证监局）下发了《关于对长江证券股份有限公司采

取出具警示函监管措施的决定》（[2016]3号），认为公司作为武汉四方交通物流有限责任公司（以下简称四方物流）2014年中小企业私募债项目的受托管理人，在履行受托管理职责的过程中未勤勉尽责，未按照《四方物流2014年中小企业私募债券受托管理协议》的约定，如实披露募集资金使用情况。上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》第七条关于“为公司债券发行提供服务的承销机构、资信评级机构、受托管理人、会计师事务所、资产评估机构、律师事务所等专业机构和人员应当勤勉尽责，严格遵守执业规范和监管规则，按规定和约定履行义务”的规定。按照《公司债券发行与交易管理办法》第五十八条的规定，湖北证监局决定对公司采取出具警示函的监管措施。本基金做出如下说明：长江证券是中国优秀的证券公司之一，综合实力突出，基本面良好。基于相关研究，本基金判断，这一处罚对长江证券无实质影响。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述情况外，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，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	2,930.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	589.98
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,520.69

### 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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

### 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：本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

### 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

项目	长盛同瑞 A	长盛同瑞 B	长盛同瑞中证 200 分级
报告期期初基金份额总额	3,908,117.00	5,862,175.00	12,073,108.56
报告期期间基金总申购份额	-	-	174,198.10
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	4,208,870.00
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-1,082,696.00	-1,624,044.00	2,706,740.00
报告期期末基金份额总额	2,825,421.00	4,238,131.00	10,745,176.66

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

## § 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

(一) 关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金的批复；

(二) 《长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金合同》；

(三) 《长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金托管协议》；

- (四) 《长盛同瑞中证 200 指数分级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  
2017年1月21日