

长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资 基金 2015 年年度报告摘要

2015 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人于 2015 年 8 月 28 日发布公告，决定自 2015 年 9 月 1 日起，对旗下长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）增加 C 类份额、调低管理费率、调整赎回费率，并对本基金的基金合同作相应修改。

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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本基金报告期自 2015 年 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛战略新兴产业混合	
基金主代码	080008	
交易代码	080008	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 10 月 26 日	
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	
报告期末基金份额总额	1,891,456,553.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C
下属分级基金的交易代码	080008	001834
报告期末下属分级基金的份额总额	1,071,462,553.67 份	819,994,000.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	重点关注国家战略性新兴产业发展过程中带来的投资机会，分享中国经济发展的长期收益，力争为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	(1) 本基金采用“自上而下”的战略资产配置体系，通过对宏观基本面及证券市场两个层面的因素定性、定量地分析，动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。(2) 本基金将战略性新兴产业相关股票和债券分别纳入战略性新兴产业股票库和债券库，投资于战略性新兴产业的股票及债券比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。(3) 战略性新兴产业的行业配置上，本基金将深入分析判断各子行业的行业景气状况、产业政策变化、行业生命周期，结合行业可投资的规模和相对估值水平，适时调整各子行业的配置比例。
业绩比较基准	50%*中证新兴产业指数+50%*中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

注：为更好维护基金份额持有人的利益，降低基金份额持有人投资成本，根据相关法规和基金合同的有关规定，管理人经与托管人协商一致，决定自 2015 年 9 月 1 日起，对长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额、调低管理费率、调整赎回费率，并对基金合同作相应修改。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096

	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	010-67595096
传真		010-82255988	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年		2014 年	2013 年
	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C		
本期已实现收益	34,033,834.72	2,394,931.35	7,881,578.56	4,058,092.66
本期利润	34,098,488.31	3,621,060.22	10,133,985.29	5,284,415.26
加权平均基金份额本期利润	0.0354	0.0101	0.2068	0.1105
本期基金份额净值增长率	44.27%	0.40%	23.62%	7.76%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末		2014 年末	2013 年末
	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C		
期末可供分配基金份额利润	0.6446	0.0028	0.2564	0.0160
期末基金资产净值	1,941,181,340.57	823,615,060.22	38,789,634.09	64,095,344.97
期末基金份额净值	1.812	1.004	1.256	1.016

注：1、所述基金业绩指标不包括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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

长盛战略新兴产业混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.67%	0.03%	11.03%	1.00%	-10.36%	-0.97%
过去六个月	0.83%	0.05%	-3.83%	1.64%	4.66%	-1.59%
过去一年	44.27%	0.77%	23.96%	1.43%	20.31%	-0.66%
过去三年	92.18%	1.02%	33.55%	1.06%	58.63%	-0.04%
自基金合同生效起至今	90.06%	0.99%	32.94%	1.01%	57.12%	-0.02%

长盛战略新兴产业混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.40%	0.04%	11.03%	1.00%	-10.63%	-0.96%
自基金合同生效起至今	0.40%	0.03%	7.28%	1.17%	-6.88%	-1.14%

注：根据《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 2 月 11 日起，由“沪深 300 指数×70%+中证综合债券指数×30%”变更为“50%×中证新兴产业指数+50%×中证综合债券指数”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

业绩比较基准=50%×中证新兴产业指数+50%×中证综合债券指数

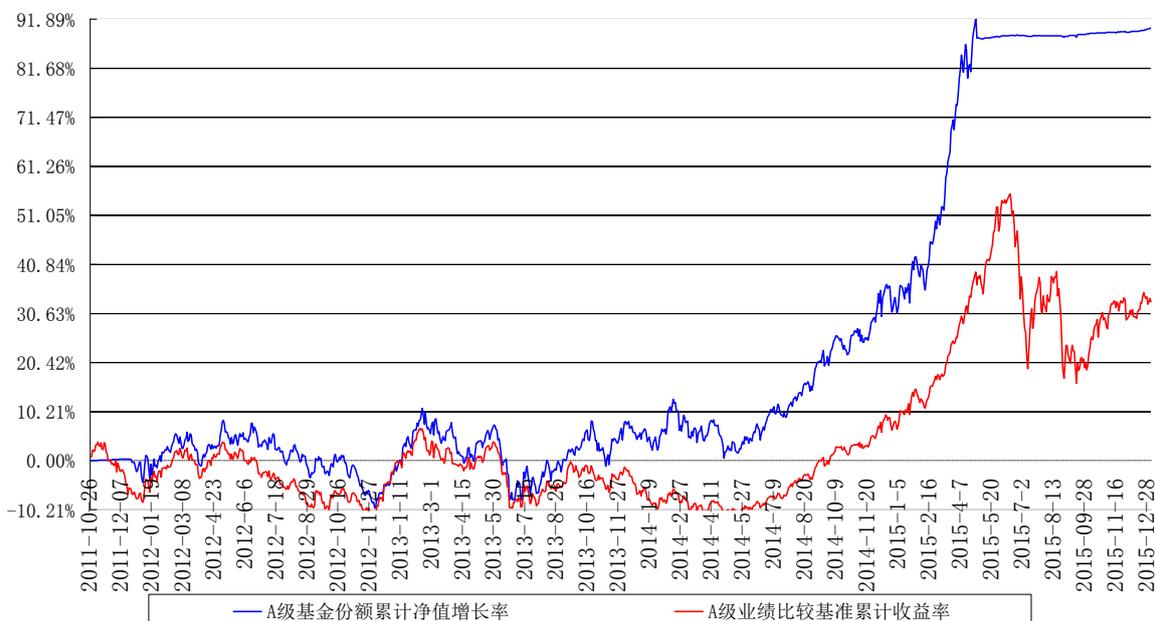
本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定中证新兴产业指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债券指数。

中证新兴产业指数是由中证指数有限公司编制，选择上海证券交易所和深圳证券交易所两市上市的新兴产业的公司中规模大、流动性好的 100 家公司组成，以综合反映沪深两市中新兴产业公司的整体表现。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准，较为合适。

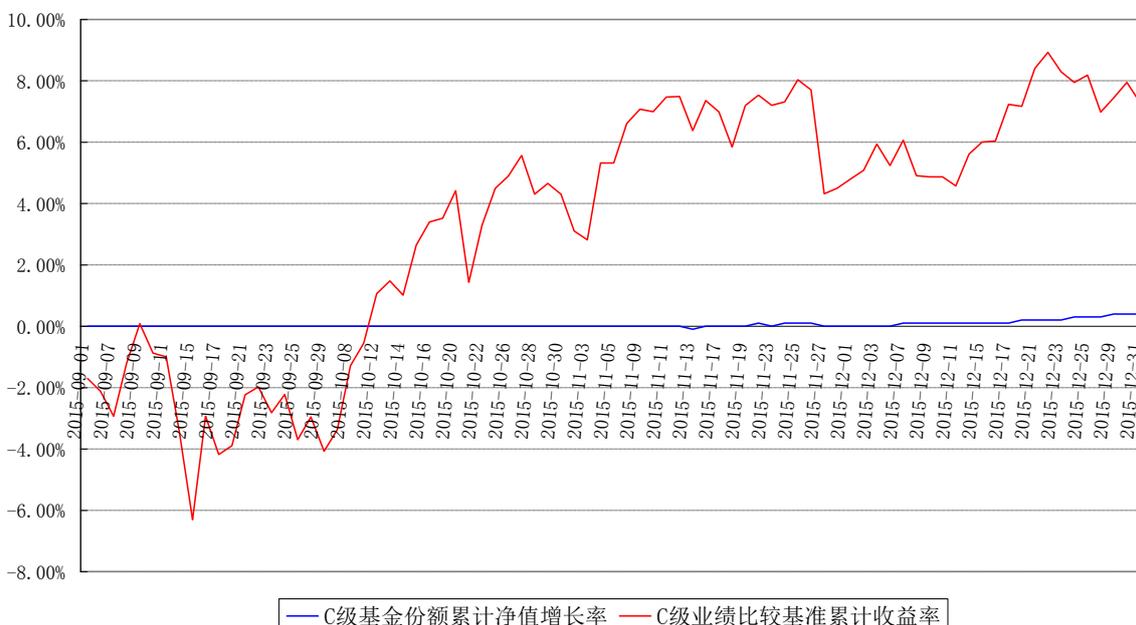
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 50%、50%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

A级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



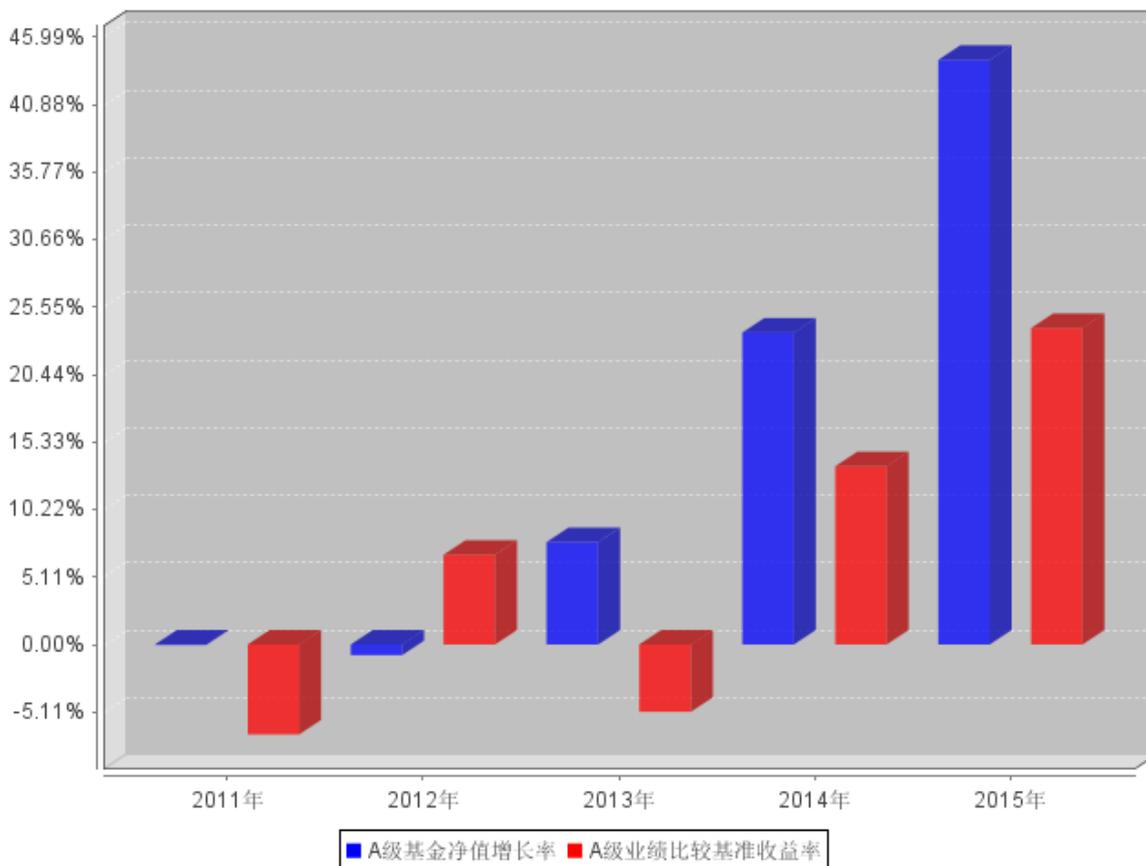
C类基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



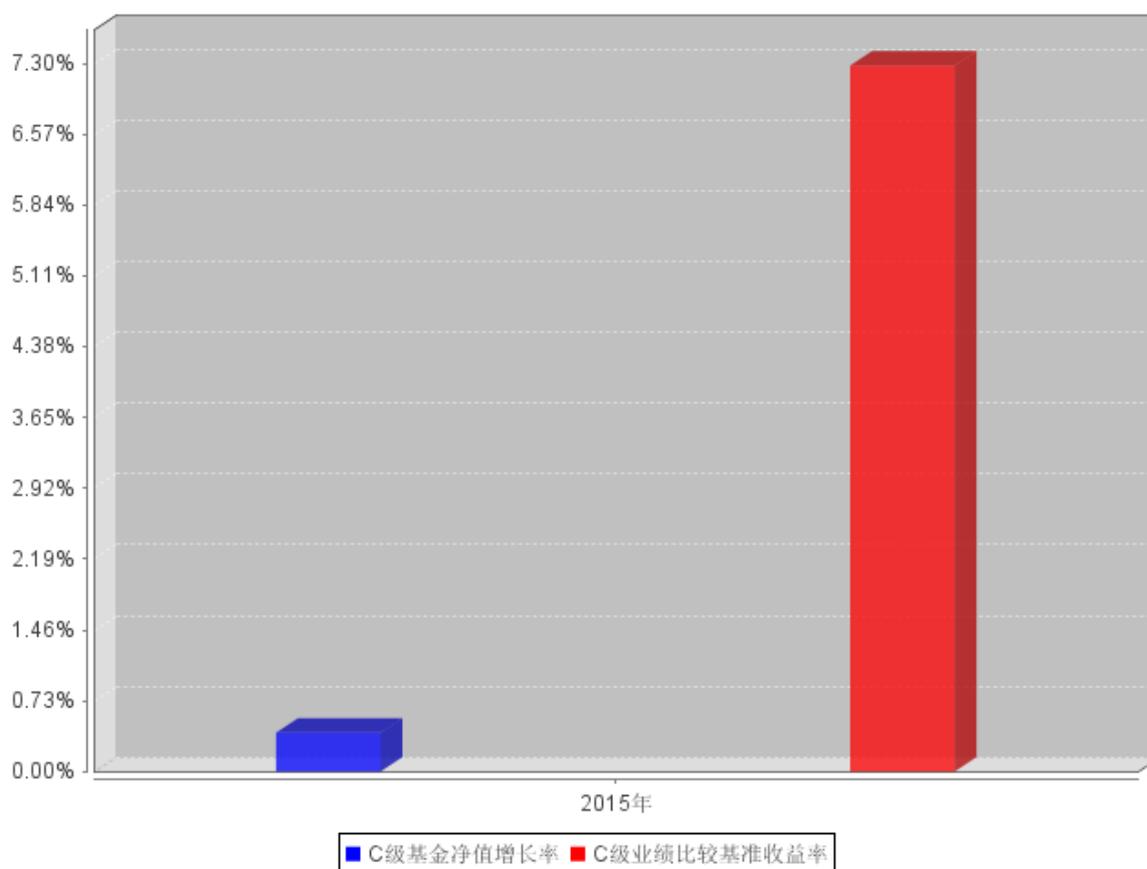
注：按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二条“（二）投资范围”、“（七）投资限制”的有关规定。截至报告期期末，本基金的投资组合比例符合本基金合同的各项规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金合同于 2011 年 10 月 26 日生效，合同生效当年按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

自 2015 年 9 月 1 日起，对长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额、调低管理费率、调整赎回费率，并对基金合同作相应修改。自调增 C 类至报告期末未满一年。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长盛战略新兴产业混合 A					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
2013	0.5000	2,015,411.92	195,497.35	2,210,909.27	
合计	0.5000	2,015,411.92	195,497.35	2,210,909.27	

单位：人民币元

长盛战略新兴产业混合 C					
年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	0.0000	0.00	0.00	0.00	

合计	-	-	-	-
----	---	---	---	---

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2015 年 12 月 31 日，基金管理人共管理四十二只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵宏宇	本基金基金经理，长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金	2015 年 5 月 14 日	-	8 年	男，1972 年 6 月出生，中国国籍。四川大学工商管理学院管理学（金融投资研究方向）博士。历任美国晨星公司投资顾问部门数量分析师，招商银行博士后工作站博士后研究员。2007 年 8 月加入长盛基金管理公司，历任金融工程研究员、产品开发经理，首席产品开发师，金融工程与量化投资部副总监、长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理等职务。现任长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

	基金经理。				
杨衡	本基金基金经理，长盛电子信息主题灵活配置混合型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，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理，社保组合组合经理。	2015年6月18日	-	8年	男，1975年10月出生，中国国籍。中国科学院数学与系统科学研究院博士、博士后。2007年7月进入长盛基金管理公司，历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理、长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。现任社保组合组合经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛电子信息主题灵活配置混合型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，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
王克玉	本基金基金经理，长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理，权益投资部副总监。	2014年2月11日	2015年5月14日	12年	男，1979年12月出生，中国国籍。上海交通大学硕士。历任元大京华证券上海代表处研究员，天相投资顾问有限公司分析师，国都证券有限公司分析师。2006年7月加入长盛基金管理有限公司，曾任高级行业研究员，同盛证券投资基金基金经理助理，同益证券投资基金基金经理，长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理等职务。现任权益投资部副总监，长盛电子信息产业股票型证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理。自2015年5月14日起不再担任长盛战略新兴产业灵活配置混合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、本基金的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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年 7 月后在政府推出新股发行暂停、证金公司入场救市等多项较大力度救市背景下，股

票市场企稳并有所回升。2015 年 8 月人民币突然贬值，引发 A 股市场大跌，随着人民币贬值预期缓解，2015 年 3 季度股票市场整体震荡走高。2015 年 11 月中国证监会公布 IPO 重启，原暂停发行的 28 家新股 2015 年底完成发行，2016 年起 IPO 发行执行新规。

本基金基于绝对收益和持有人厌恶的考量，在对权益和债券市场相对偏谨慎背景下，在新股发行暂停后，本基金迅速清空了股票仓位，避免了市场大幅下跌对基金净值的影响，但也未能分享 9 月后 A 股市场震荡走高的收益。11 月后在 IPO 重启参与新股网下申购对沪深股市各 1000 万元股票市值要求，组合配置少量大盘蓝筹股，通过时机选择基本熨平股价波动对组合净值的影响，并于年底 28 家新股完成询价后大幅降低老股票仓位。

基于组合可能面对的大额赎回压力，在 7 月新股暂停后，组合配置了短期协议存款、逆回购、高信用等级短融等货币类工具，保持组合高流动性和灵活性。11 月 IPO 重启后，由于 28 家新股仍采用老规则，申购需要全额预缴款，因此，本基金固定收益资产配置上仍以现金类工具为主，在 28 家新股申购结束后适当拉长了组合久期，陆续转换到短融等货币类工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.812 元，本报告期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）净值增长率为 44.27%，同期业绩比较基准增长率为 23.96%；

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金 C 类份额净值为 1.004 元，本报告期（2015 年 9 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）净值增长率为 0.40%，同期业绩比较基准增长率为 7.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

最新数据显示，2015 年 12 月中国财新制造业 PMI 48.2，预期 48.9，前值 48.6，不及预期。宏观经济数据显示，过去两个月内中国经济并无明显向好，预示经济仍面临下行压力。政府仍有必要实施预调微调的宏观经济政策组合，避免经济出现断崖式下跌，同时继续推进供给侧改革，释放改革红利。

从最新公告的央行第四季度例会声明，和第三季度相比，措辞仅做了小幅改动。相较三季度例会声明中“国际金融市场和大宗商品价格波动性上升，跨市场、跨地区相互影响，风险隐患增多”的描述，四季度的声明会议以“国际金融市场风险隐患增多”做了替代。当前央行维持原有基调的态度意味着在中国经济疲软的情况下，政策或仍保持适度宽松及灵活。

2015 年以来信用评级调整结果显示，受企业财报披露时点、政策监管规范和跟踪评级工作特点影响，在宏观经济下滑背景下，企业基本面持续弱化，出现主体评级下调的家次增多。煤炭、有色等传统周期性行业普遍存在行业产能过剩，企业经营效率低下的问题，未来负面调整仍需重

点防范。从系统性风险的角度来看，在外部融资条件宽松条件下，资产厚度缓冲以及外部保刚兑压力，较大程度上会延缓持续的内部盈利现金流恶化带来的系统性风险，但是尾部信用风险的加速暴露，会主导阶段性的市场波动，尤其是中低评级（实际信用资质较弱的品种）的估值分化。无论是从避免违约的角度，还是从避免估值损失的角度，信用风险排雷都是当前和未来信用债投资重要的主题。因此，考虑继续维持组合高评级配置。

2016 年除新股发行可能大幅提速外，债券供给也可能面临较大规模的扩容。一方面，赤字率有望从原来的 2.3% 扩大到 3.0%，另一方面，地方债的置换规模仍然较大，此外，公司债规模或持续扩大。资金面上，2016 年 IPO 发行采用新规则，网上网下申购不需要全额预缴款，因此相对过去，预计 2016 年新股发行对资金面的短期冲击将较为有限。

2015 年中国对外汇制度进行了重大改革，使市场在决定人民币参考汇率方面拥有更大的发言权，允许更多的境外金融机构进入国内外汇市场，将交易时间延长一倍。根据中国外汇交易中心的数据，2015 年人民币对美元的汇率跌 4.5%，12 月 31 日报收于 1 美元兑 6.4936 元人民币，创下 1994 年以来的最大年度跌幅。在前期人民币持续升值通道中，我国部分行业企业发行美元债券，享受低息和升值的收益，但在未来人民币贬值背景下，将面临较大的付息清偿压力，或将对债券市场形成较大冲击。

2015 年 12 月，美联储宣布将联邦基金利率目标区间由 0~0.25% 上调至 0.25%~0.5%，首次加息尘埃落定，美联储结束长达 7 年之久的零利率政策，这也是美国 9 年来首次加息，市场普遍预计在未来 2~3 年美元将进入加息通道。这或对中国未来货币政策走向带来了不容忽视的影响：一方面，美元进入加息通道，带来美元走强，人民币若进一步降息将导致市场对于美元资产需求增加，资本外流和人民币贬值压力加大；另一方面，2016 年中国经济稳增长的局面将维持，央行仍然需要通过宏观调控，维持市场流动性，来对冲外汇占款的减少。而我国基准利率水平已经降至 20 年以来最低，未来货币政策向宽松的调整区间有限，或造成中国债市构成压制。

从对未来发行转债的信息统计，未来待发行转债或超过 14 只，规模或超过 273 亿元，扩容一方面增加了目前转债市场供给和流动性，另一方面将压缩目前转债因稀缺性带来的高溢价空间。

综合以上，展望后市，我们总体持谨慎乐观、相对谨慎态度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》第十六条中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期未实施利润分配。本基金截至 2015 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 873,339,847.12，其中，A 类份额期末可供分配利润为 690,688,209.33 元（A 类份额未分配利润已实现部分为 690,688,209.33 元，未分配利润未实现部分为 179,030,577.57 元），C 类份额期末可供分配利润为 2,296,024.70 元（C 类份额未分配利润已实现部分为 2,296,024.70 元，未分配利润未实现部分为 1,325,035.52 元）。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责

责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师陈玲、沈兆杰 2016 年 3 月 22 日对本基金 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2016)第 20239 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	215,552,258.83	9,534,180.11
结算备付金	2,789,046.11	115,861.38
存出保证金	171,156.83	15,777.03
交易性金融资产	2,510,450,981.75	29,410,369.54
其中：股票投资	11,051,981.75	29,383,385.54
基金投资	-	-
债券投资	2,499,399,000.00	26,984.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-

衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	10,000,000.00	400,000.00
应收证券清算款	1,499,639.46	-
应收利息	35,014,613.95	3,638.85
应收股利	-	-
应收申购款	50,160.91	13,362.23
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,775,527,857.84	39,493,189.14
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015年12月31日	2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,889,978.24	541.96
应付赎回款	4,033,247.07	336,102.39
应付管理人报酬	2,344,309.43	51,025.19
应付托管费	586,077.33	8,504.19
应付销售服务费	221,461.47	-
应付交易费用	481,447.67	31,326.32
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	174,935.84	276,055.00
负债合计	10,731,457.05	703,555.05
所有者权益:		
实收基金	1,891,456,553.67	30,874,184.03
未分配利润	873,339,847.12	7,915,450.06
所有者权益合计	2,764,796,400.79	38,789,634.09
负债和所有者权益总计	2,775,527,857.84	39,493,189.14

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,891,456,553.67 份，其中长盛战略新兴产业混合 A 类的份额 1,071,462,553.67 份，基金份额净值为 1.812 元；长盛战略新兴产业混合 C 类的份额 819,994,000.00 份，基金份额净值为 1.004 元。

7.2 利润表

会计主体：长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
一、收入	67,329,235.39	11,736,195.86
1. 利息收入	38,207,342.26	222,100.29
其中：存款利息收入	9,628,111.22	65,519.62
债券利息收入	18,410,826.36	313.28
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	10,168,404.68	156,267.39
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	22,417,370.76	9,159,427.44
其中：股票投资收益	30,078,190.36	8,497,925.07
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-7,836,572.89	61,052.69
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	175,753.29	600,449.68
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,290,782.46	2,252,406.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,413,739.91	102,261.40
减：二、费用	29,609,686.86	1,602,210.57
1. 管理人报酬	23,323,802.82	783,121.14
2. 托管费	4,521,874.73	130,520.08
3. 销售服务费	221,461.47	-
4. 交易费用	1,306,889.24	299,217.51
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	235,658.60	389,351.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	37,719,548.53	10,133,985.29
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	37,719,548.53	10,133,985.29

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	30,874,184.03	7,915,450.06	38,789,634.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,719,548.53	37,719,548.53
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,860,582,369.64	827,704,848.53	2,688,287,218.17
其中：1. 基金申购款	3,625,390,291.34	2,218,518,125.32	5,843,908,416.66
2. 基金赎回款	-1,764,807,921.70	-1,390,813,276.79	-3,155,621,198.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,891,456,553.67	873,339,847.12	2,764,796,400.79
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	63,084,494.99	1,010,849.98	64,095,344.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,133,985.29	10,133,985.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-32,210,310.96	-3,229,385.21	-35,439,696.17
其中：1. 基金申购款	61,576,857.23	3,174,941.99	64,751,799.22
2. 基金赎回款	-93,787,168.19	-6,404,327.20	-100,191,495.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	30,874,184.03	7,915,450.06	38,789,634.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵

杨思乐

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金(以下简称“原基金”)基金份额持有人大会的决议由长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2011]第 1219 号《关于核准长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 941,564,638.02 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 411 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 10 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 941,658,939.32 份基金份额,其中认购资金利息折合 94,301.30 份基金份额。

原基金基金份额持有人大会自 2013 年 12 月 23 日起至 2014 年 1 月 22 日止以通讯方式召开,会议审议通过了《关于修改长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,经中国证监会备案后决议生效。根据原基金基金份额持有人大会决议,《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2014 年 2 月 11 日生效,基金投资目标、范围和策略调整,同时“长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金”更名为“长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金”。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司 2015 年 8 月 28 日发布的《关于长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额,调低管理费率、调整赎回费率并修改基金合同的公告》,本基金自 2015 年 9 月 1 日起,根据赎回费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合

中对股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；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的 5%；投资于战略新兴产业的股票及债券不低于本基金非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：50% X 中证新兴产业指数+50% X 中证综合债券指数。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2016 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红

利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本期未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的管理费	23,323,802.82	783,121.14
其中：支付销售机构的客户维护费	197,898.44	178,423.84

注：1、据《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，自基金合同生效日至 2015 年 8 月 31 日，支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div \text{当年天数}。$$

2、根据长盛基金管理有限公司《关于长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额，调低管理费率、调整赎回费率并修改基金合同的公告》，自 2015 年 9 月 1 日起，本基金调低管理费率，支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% \div \text{当年天数}。$$

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,521,874.73	130,520.08

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}。$$

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C	合计
长盛基金	-	221,461.47	221,461.47
合计	-	221,461.47	221,461.47

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给长盛基金公司，再由长盛基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公

式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.20 % ÷ 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方本期及上年度可比期间未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国建设银行	15,552,258.83	6,117,092.02	9,534,180.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002778	高科石化	2015/12/28	2016/1/6	新股中签	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在

新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.1.1

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015/12/23	2016/1/8	未上市	100.00	100.00	4,660	466,000.00	466,000.00	

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本期末未持有因暂时停牌而持有的流通受限证券。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 11,004,381.75 元，属于第二层次的余额为 2,499,446,600.00 元，无属于第三层次的余额。(2014 年 12 月 31 日：第一层次 28,484,064.72 元，第二层次 926,304.82 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输

入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,051,981.75	0.40
	其中：股票	11,051,981.75	0.40
2	固定收益投资	2,499,399,000.00	90.05
	其中：债券	2,499,399,000.00	90.05
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	10,000,000.00	0.36
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	218,341,304.94	7.87
7	其他各项资产	36,735,571.15	1.32
8	合计	2,775,527,857.84	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	3,575,870.93	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,002,328.20	0.04
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
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	4,649,478.18	0.17
J	金融业	-	-
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	1,602,000.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	11,051,981.75	0.40

8.2.2 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。

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300383	光环新网	37,000	2,061,270.00	0.07
2	300291	华录百纳	45,000	1,602,000.00	0.06
3	600487	亨通光电	80,000	1,275,200.00	0.05
4	603508	思维列控	14,605	1,136,853.20	0.04
5	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.03
6	002781	奇信股份	21,600	807,192.00	0.03
7	603996	中新科技	16,729	494,174.66	0.02
8	002104	恒宝股份	18,000	431,820.00	0.02
9	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.01
10	002782	可立克	13,312	283,146.24	0.01

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.csfunds.com.cn> 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000001	平安银行	29,751,905.74	76.70
2	601857	中国石油	21,250,816.98	54.78
3	000063	中兴通讯	15,145,268.74	39.04
4	600050	中国联通	13,842,887.00	35.69
5	002142	宁波银行	13,797,700.00	35.57
6	002104	恒宝股份	13,204,473.71	34.04
7	600028	中国石化	12,748,145.00	32.86
8	002063	远光软件	11,733,154.70	30.25
9	600588	用友网络	11,079,480.41	28.56
10	601988	中国银行	10,976,405.00	28.30
11	000938	紫光股份	8,642,152.00	22.28
12	600570	恒生电子	8,568,400.00	22.09
13	300303	聚飞光电	8,568,000.00	22.09
14	000917	电广传媒	8,497,480.00	21.91
15	601998	中信银行	7,708,210.46	19.87
16	002049	同方国芯	7,554,200.00	19.47
17	601668	中国建筑	7,306,700.00	18.84
18	002570	贝因美	7,157,766.57	18.45
19	600715	*ST 松辽	6,846,200.00	17.65
20	002456	欧菲光	6,814,785.92	17.57
21	002436	兴森科技	6,630,338.84	17.09
22	000402	金融街	6,349,310.12	16.37
23	300347	泰格医药	6,078,660.04	15.67
24	000776	广发证券	5,894,178.08	15.20
25	600571	信雅达	5,259,350.00	13.56
26	002055	得润电子	4,851,685.00	12.51
27	300253	卫宁软件	4,819,005.10	12.42
28	300085	银之杰	4,798,916.00	12.37
29	603939	益丰药房	4,793,534.00	12.36
30	300314	戴维医疗	4,413,831.00	11.38
31	601006	大秦铁路	4,320,000.00	11.14
32	300357	我武生物	4,287,272.00	11.05

33	000100	TCL 集团	4,210,000.00	10.85
34	002329	皇氏集团	4,136,751.88	10.66
35	300202	聚龙股份	4,069,743.00	10.49
36	600030	中信证券	4,065,000.00	10.48
37	002415	海康威视	4,050,291.00	10.44
38	002546	新联电子	4,003,457.00	10.32
39	300006	莱美药业	3,966,759.00	10.23
40	300369	绿盟科技	3,940,000.00	10.16
41	601336	新华保险	3,859,772.00	9.95
42	600958	东方证券	3,825,590.46	9.86
43	300168	万达信息	3,431,600.00	8.85
44	300257	开山股份	3,162,300.00	8.15
45	300213	佳讯飞鸿	3,159,523.00	8.15
46	000725	京东方 A	3,110,000.00	8.02
47	300383	光环新网	2,692,602.00	6.94
48	300039	上海凯宝	2,421,911.55	6.24
49	600562	国睿科技	2,202,597.00	5.68
50	600999	招商证券	1,866,491.00	4.81
51	002146	荣盛发展	1,746,500.00	4.50
52	002024	苏宁云商	1,622,000.00	4.18
53	300291	华录百纳	1,610,700.00	4.15
54	601688	华泰证券	1,543,925.00	3.98
55	600487	亨通光电	1,262,800.00	3.26
56	002429	兆驰股份	1,256,000.00	3.24
57	603979	金诚信	1,135,622.97	2.93
58	002465	海格通信	1,040,763.82	2.68
59	601368	绿城水务	980,883.64	2.53
60	300113	顺网科技	888,300.00	2.29
61	600566	济川药业	876,400.00	2.26
62	300219	鸿利光电	851,500.00	2.20
63	300473	德尔股份	823,830.20	2.12

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000001	平安银行	30,382,370.76	78.33
2	601857	中国石油	20,915,809.15	53.92
3	000063	中兴通讯	16,161,119.59	41.66
4	002142	宁波银行	14,287,750.04	36.83
5	600050	中国联通	13,942,991.83	35.95

6	002104	恒宝股份	13,112,820.92	33.80
7	600028	中国石化	12,671,261.04	32.67
8	002063	远光软件	12,376,732.75	31.91
9	601988	中国银行	11,505,914.00	29.66
10	600588	用友网络	10,963,223.07	28.26
11	000938	紫光股份	8,809,740.00	22.71
12	600570	恒生电子	8,706,114.98	22.44
13	300303	聚飞光电	8,543,751.80	22.03
14	000917	电广传媒	8,475,082.00	21.85
15	002049	同方国芯	7,979,375.26	20.57
16	601998	中信银行	7,899,293.00	20.36
17	601668	中国建筑	7,405,800.00	19.09
18	002456	欧菲光	7,160,461.98	18.46
19	002570	贝因美	7,106,009.95	18.32
20	600715	*ST 松辽	7,084,802.00	18.26
21	300347	泰格医药	6,554,346.70	16.90
22	002436	兴森科技	6,228,194.52	16.06
23	000402	金融街	6,083,230.65	15.68
24	000776	广发证券	6,003,134.08	15.48
25	600571	信雅达	5,357,820.62	13.81
26	002055	得润电子	5,137,134.00	13.24
27	300253	卫宁软件	4,996,137.73	12.88
28	603939	益丰药房	4,942,554.00	12.74
29	300085	银之杰	4,771,023.65	12.30
30	300314	戴维医疗	4,520,427.09	11.65
31	002329	皇氏集团	4,349,469.00	11.21
32	601006	大秦铁路	4,306,500.00	11.10
33	300357	我武生物	4,289,450.06	11.06
34	002546	新联电子	4,242,709.00	10.94
35	000100	TCL 集团	4,160,000.00	10.72
36	600030	中信证券	4,114,000.00	10.61
37	300006	莱美药业	4,044,700.10	10.43
38	300202	聚龙股份	4,043,193.80	10.42
39	600958	东方证券	4,028,955.60	10.39
40	002415	海康威视	3,995,066.00	10.30
41	300168	万达信息	3,765,050.00	9.71
42	300369	绿盟科技	3,761,343.00	9.70
43	601336	新华保险	3,688,600.00	9.51

44	300213	佳讯飞鸿	3,194,656.00	8.24
45	000725	京东方 A	3,120,000.00	8.04
46	300257	开山股份	3,101,785.00	8.00
47	002465	海格通信	3,082,809.52	7.95
48	600498	烽火通信	2,938,578.00	7.58
49	300039	上海凯宝	2,395,470.13	6.18
50	600562	国睿科技	2,279,600.00	5.88
51	002376	新北洋	2,138,296.17	5.51
52	603979	金诚信	2,122,009.15	5.47
53	601968	宝钢包装	1,912,594.00	4.93
54	601126	四方股份	1,662,666.09	4.29
55	601368	绿城水务	1,592,601.12	4.11
56	600875	东方电气	1,584,356.03	4.08
57	300219	鸿利光电	1,547,003.20	3.99
58	002024	苏宁云商	1,505,583.75	3.88
59	603589	口子窖	1,496,102.36	3.86
60	000012	南 玻 A	1,490,605.45	3.84
61	002056	横店东磁	1,423,345.30	3.67
62	603616	韩建河山	1,406,839.00	3.63
63	300470	日机密封	1,380,240.00	3.56
64	300473	德尔股份	1,311,081.65	3.38
65	002429	兆驰股份	1,270,044.00	3.27
66	002146	荣盛发展	1,263,000.00	3.26
67	300465	高伟达	1,248,800.00	3.22
68	600999	招商证券	1,206,500.00	3.11
69	300485	赛升药业	1,189,113.40	3.07
70	603800	道森股份	1,159,092.48	2.99
71	601688	华泰证券	1,153,070.45	2.97
72	601238	广汽集团	1,138,794.07	2.94
73	000733	振华科技	1,136,494.31	2.93
74	300188	美亚柏科	1,116,756.23	2.88
75	300077	国民技术	1,045,612.16	2.70
76	300045	华力创通	1,029,372.47	2.65
77	300113	顺网科技	990,587.00	2.55
78	603999	读者传媒	977,710.50	2.52
79	002419	天虹商场	976,413.19	2.52
80	000937	冀中能源	976,019.79	2.52
81	603669	灵康药业	954,933.18	2.46

82	600460	士兰微	954,327.26	2.46
83	002335	科华恒盛	889,397.75	2.29
84	002783	凯龙股份	885,234.00	2.28
85	600566	济川药业	879,600.00	2.27
86	600166	福田汽车	847,243.41	2.18
87	601699	潞安环能	846,754.93	2.18
88	000568	泸州老窖	806,821.18	2.08

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	389,459,364.90
卖出股票收入（成交）总额	438,239,211.67

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	190,312,000.00	6.88
	其中：政策性金融债	190,312,000.00	6.88
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,257,876,000.00	81.67
6	中期票据	50,745,000.00	1.84
7	可转债（可交换债）	466,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,499,399,000.00	90.40

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	011599280	15 中普天 SCP002	1,300,000	130,702,000.00	4.73
2	011514004	15 中粮 SCP004	1,300,000	130,325,000.00	4.71
3	071508005	15 东方证券 CP005	1,300,000	130,117,000.00	4.71
4	011599294	15 北大荒 SCP001	1,100,000	110,660,000.00	4.00
5	071548002	15 国开证券 CP002	1,100,000	110,154,000.00	3.98

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1**

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	171,156.83
2	应收证券清算款	1,499,639.46
3	应收股利	-
4	应收利息	35,014,613.95
5	应收申购款	50,160.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,735,571.15

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长盛战略新兴产业混合 A	1,447	740,471.70	1,058,808,048.78	98.82%	12,654,504.89	1.18%
长盛战略新兴产业混合 C	5	163,998,800.00	819,994,000.00	100.00%	-	-
合计	1,452	1,302,656.03	1,878,802,048.78	99.33%	12,654,504.89	0.67%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
----	------	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛战略新兴产业混合 A	85,948.46	0.0080%
	长盛战略新兴产业混合 C	-	
	合计	85,948.46	0.0045%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长盛战略新兴产业混合 A	0
	长盛战略新兴产业混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛战略新兴产业混合 A	0
	长盛战略新兴产业混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C
基金合同生效日（2011 年 10 月 26 日）基金份额总额	941,658,939.32	-
本报告期期初基金份额总额	30,874,184.03	-
本报告期基金总申购份额	2,805,396,291.34	819,994,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,764,807,921.70	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	1,071,462,553.67	819,994,000.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司第六届董事会第七次会议决议，公司聘任林培富、王宁、蔡宾担任公司副总经理；聘任孙杰、刁俊东为公司高管人员。以上三名副总经理于 2015 年 4 月 22 日通过中国证券投资基金业协会（以下简称基金业协会）组织的高级管理人员证券投资法律知识考试，公司已及时向基金业协会进行备案。

11.2.2 基金经理的变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2015 年 5 月 14 日起，赵宏宇同志兼任长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，王克玉同志不再担任长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理；自 2015 年 6 月 18 日起，杨衡同志兼任长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 80,000.00 元，已连续提供审计服务 5 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	1	513,240,266.27	62.81%	476,863.17	62.85%	-
民生证券	1	303,940,884.53	37.19%	281,832.08	37.15%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	3,567,164.20	100.00%	11,348,300,000.00	100.00%	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无

长盛基金管理有限公司
2016年3月26日