

长盛生态环境主题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：中国银行股份有限公司

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，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛生态环境混合
基金主代码	000598
交易代码	000598
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 10 日
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
报告期末基金份额总额	308,059,257.52 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于从事或受益于生态环境主题的上市公司，通过精选个股和风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，运用科

	学严谨、规范化的资产配置方法，灵活配置国内生态环境主题行业的上市公司股票和债券，谋求基金资产的长期稳定增长。本基金对生态环境主题上市公司股票的界定是：公司主营业务中从事与生态环境主题相关的业务，或者直接或间接受益于生态环境投资主题所带来的较高回报，相关股票具体包括：节能技术和装备；节能产品、节能建材和节能服务；环保技术和设备；环保服务及环保受益相关行业；清洁生产技术和清洁产品；资源回收及循环利用产业；与有效利用土地等自然资源、形成生态与经济良性循环主题相关的行业以及城市园林等相关行业上市公司。本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，选择生态环境主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
业绩比较基准	50%*中证环保产业指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

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	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

§ 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 9 月 10 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	641,473,242.36	366,277,490.30
本期利润	510,157,370.88	529,302,592.08

加权平均基金份额本期利润	0.7620	0.2284
本期基金份额净值增长率	25.06%	30.50%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.6316	0.2663
期末基金资产净值	502,643,071.33	1,326,230,943.48
期末基金份额净值	1.632	1.305

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（为期末余额，不是当期发生数）。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

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	15.83%	1.71%	12.61%	1.00%	3.22%	0.71%
过去六个月	-11.16%	2.68%	-2.35%	1.60%	-8.81%	1.08%
过去一年	25.06%	2.46%	25.84%	1.42%	-0.78%	1.04%
自基金合同生效起至今	63.20%	2.23%	32.79%	1.30%	30.41%	0.93%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{中证环保产业指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

基准指数的构建考虑了三个原则：

1、公允性。本基金为主题混合型基金，在综合比较目前市场上各主要行业指数的编制特点后，本基金选择以中证环保产业指数作为股票投资的业绩比较基准。中证环保产业指数是由中证指数有限公司编制，根据联合国环境与发展综合核算体系对于环保产业的界定方法，将符合资源管理、清洁技术和产品、污染管理的公司纳入环保产业主题，采用等权重加权方式，反映上海和深圳市场环保产业公司表现的指数。本基金主要投资于生态环境主题相关上市公司股票，因此中证环保产业指数适合作为本基金的业绩比较基准。

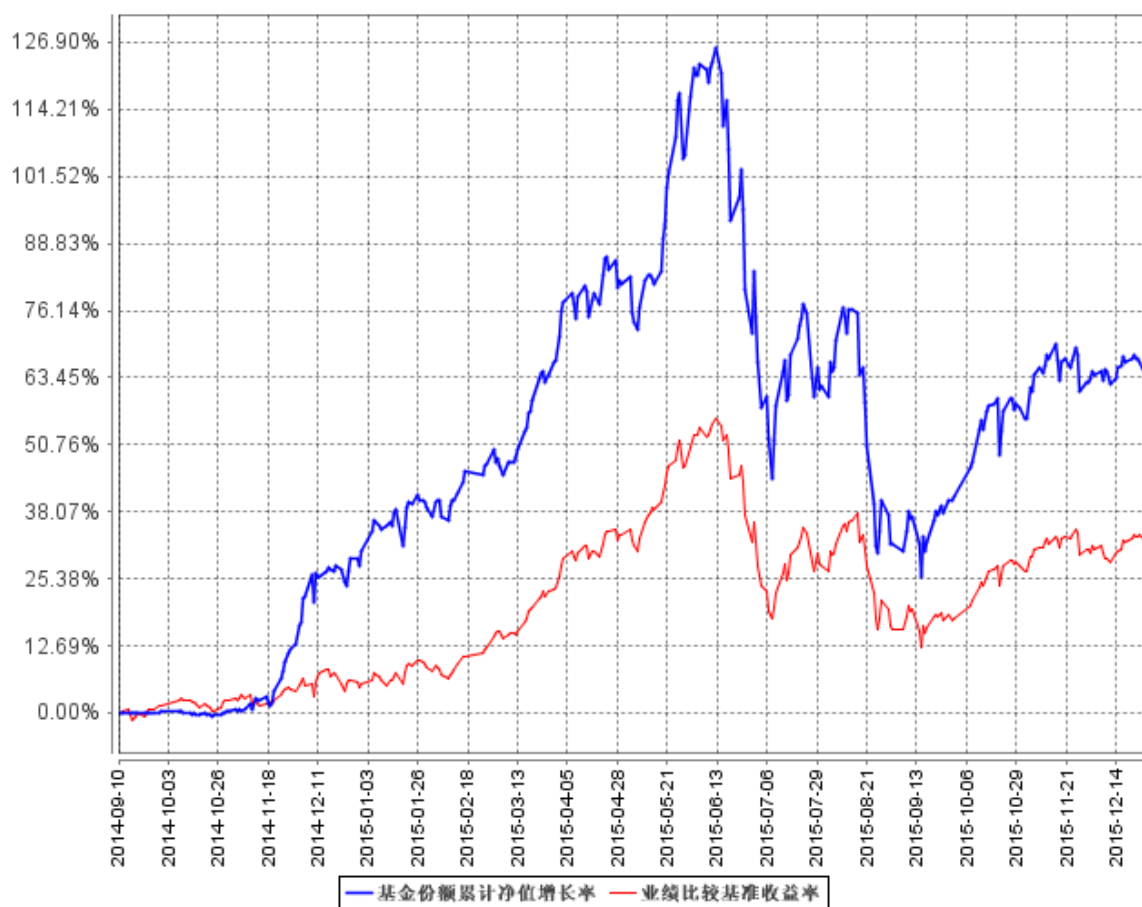
2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金股票投资占基金资产的比例为 0%–95%，其中投资于生态环境主题的股票和债券不低于非现金基金资产的 80%；根据本基金较为

灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可使业绩比较更具有合理性。

3、再平衡。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

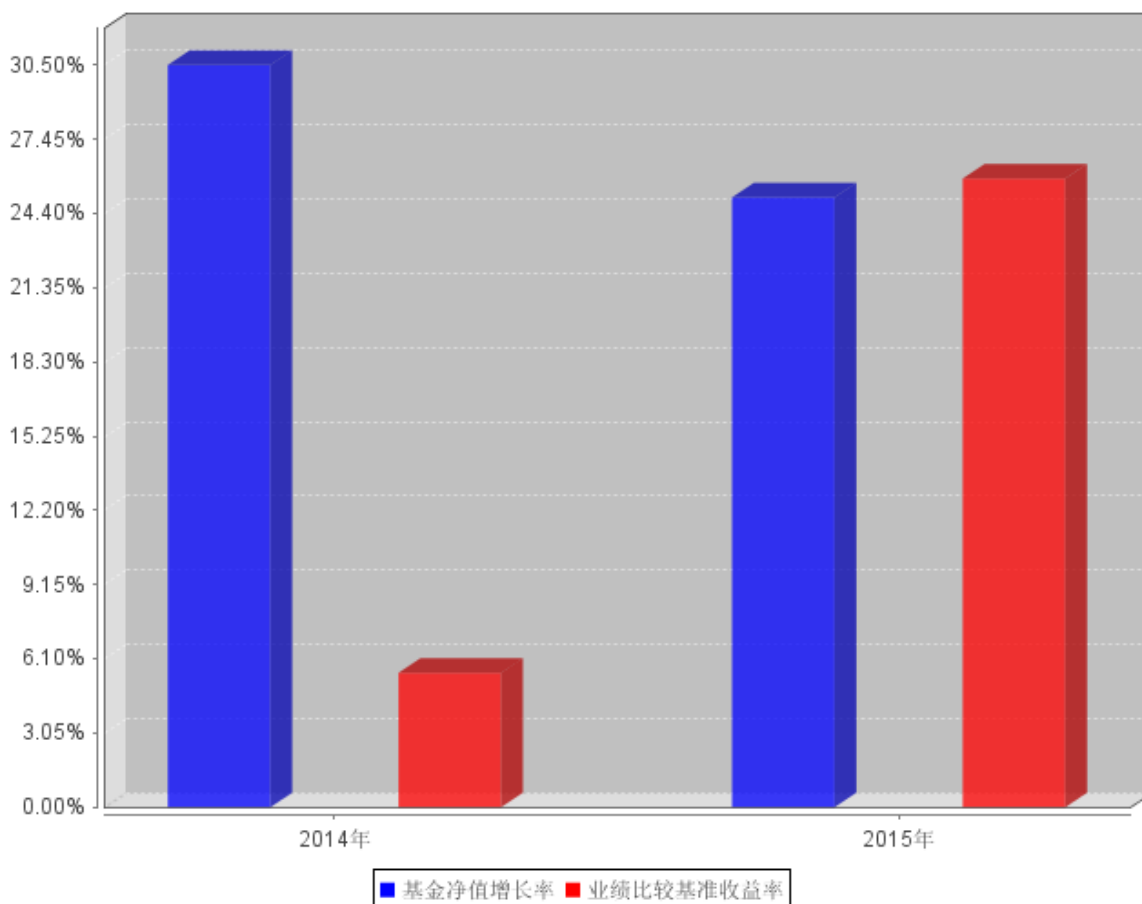
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当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十二部分“二、投资范围”和“四、投资限制”的有关约定。

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

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：本基金基金合同于 2014 年 9 月 10 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金 2015 年度及 2014 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日均未进行利润分配。

§ 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		
刘旭明	本基金基金经理，长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。	2014 年 9 月 11 日	-	13 年	男，1977 年 5 月出生，中国国籍。清华大学管理学硕士。曾任中信证券研究部首席分析师、国信证券经济研究所首席分析师。2013 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，现任研究部总监，现任长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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 年是股票市场跌宕起伏、悲喜交加的一年。一季度在宏观经济增速放缓、改革预期向好、流动性宽松的牛市逻辑支持下，创业板指数率先大幅上涨，一季度涨幅超过 50%，以互联网、工

业 4.0 等为代表的新兴产业更是成为市场上涨的主线。3 月中旬在两会释放政策利好的带动下，场外资金开始大幅入场，尤其是融资、配资等杠杆资金，市场进入纯资金驱动的加速上涨阶段，上证指数一度达到 5178.19 点，六月份集中清理配资，市场开始断崖式下跌，经历两轮“股灾”，跌幅高达 45%，九月份市场止步企稳，进入四季度投资者信心有所恢复，市场小幅反弹，在达到前期成交密集区 3600 点左右止步不前，结构方面四季度市场反弹中新能源汽车、虚拟现实等主题表现较好。全年来看，代表未来经济发展方向的新兴产业表现明显好于传统产业，成为市场震荡上涨的主线。

去年 12 月本基金封闭期结束后，按照生态环境的主题范围积极调整配置。借助去年底中小盘成长股调整阶段，重仓、低位配置一批投资价值明显的个股，为今年基金业绩增长奠定良好基础。但相比互联网等 TMT 主题方向，生态环境各子行业走势明显较弱，也导致本基金业绩受到一定影响。在市场泡沫严重期间，注重均衡配置减少市场波动带来的回撤风险，但银行等板块不在主题投资范围之内，一定程度影响基金业绩。9 月下旬判断市场调整结束后，结合基金的主题方向，果断进行加仓成长股。在市场进入前期密集成交期的震荡阶段，逐渐获利了结涨幅较大个股，调整仓位至中性仓位，配置也较为均衡。自上而下配置行业注重结合长期成长空间和短期催化剂。自下而上精选个股，减少持仓股票数量，深入挖掘内在价值。同时加强前瞻性布局新的板块，获取更多超额收益。今年本基金业绩好于沪深 300 指数 20 个百分点。

4.4.2 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 1.632 元，本报告期份额净值增长率为 25.06%，同期业绩比较基准增长率为 25.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

稳增长底线下，2016 年经济将呈现 L 型走势；以服务经济为代表的经济转型已实现，并将深化发展。货币政策仍维持宽松，但边际效应有所递减。财政政策将逐步发力，走向前台，成为影响经济和股市的重要变量。改革政策思路将延续，落地将成为关键，中国特色的供给侧改革将加速转型。无风险市场利率下行仍是目标，大类资产配置转向权益资产的趋势未变，“资产荒”将由主动转为被动投资。短期市场资金供需因素复杂化，增量资金充裕但进场周期拉长，而且各类资金投资风格差异化也带来市场风格的变化。综上所述，2016 年 A 股将呈现震荡行情，结构性特点将更为突出。基金操作将灵活调整仓位、注重自下而上选择行业及个股，关注改革落地、转型新热点，注意增量资金对市场风格的影响。

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》的规定以及本基金基金合同第十六条中对基金利润分配原则的约定，2015 年度未实施利润分配。

本基金截至 2015 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 194,583,813.81 元，其中：未分配利润已实现部分为 297,050,299.36 元，未分配利润未实现部分为-102,466,485.55 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师汤骏、马剑英 2016 年 3 月 22 日对本基金 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注出具了安永华明（2016）审字第 60468688_A10 号标准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：长盛生态环境主题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	193,481,462.13	110,552,611.97

结算备付金	1,757,284.66	32,653,009.76
存出保证金	805,550.63	1,976,546.15
交易性金融资产	318,737,841.54	1,222,490,097.20
其中：股票投资	318,737,841.54	1,222,490,097.20
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	-
应收证券清算款	-	10,225,396.80
应收利息	41,448.51	31,671.38
应收股利	-	-
应收申购款	83,290.52	6,412,831.11
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	514,906,877.99	1,384,342,164.37
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	9,616,220.81	3,379,151.59
应付赎回款	949,073.07	47,183,861.72
应付管理人报酬	657,792.81	1,883,765.82
应付托管费	109,632.11	313,960.96
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	657,914.49	5,175,316.66
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	273,173.37	175,164.14
负债合计	12,263,806.66	58,111,220.89
所有者权益：		
实收基金	308,059,257.52	1,016,568,452.31
未分配利润	194,583,813.81	309,662,491.17
所有者权益合计	502,643,071.33	1,326,230,943.48
负债和所有者权益总计	514,906,877.99	1,384,342,164.37

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.632 元，基金份额总额为 308,059,257.52 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛生态环境主题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 9 月 10 日(基金合 同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	540,491,485.00	551,390,131.93
1. 利息收入	1,404,355.78	14,253,386.07
其中：存款利息收入	1,404,355.78	6,060,503.45
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	8,192,882.62
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	652,885,889.84	364,398,566.85
其中：股票投资收益	641,144,435.78	363,780,835.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	11,741,454.06	617,730.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-131,315,871.48	163,025,101.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	17,517,110.86	9,713,077.23
减：二、费用	30,334,114.12	22,087,539.85
1. 管理人报酬	16,414,612.98	11,271,225.92
2. 托管费	2,735,768.82	1,878,537.67
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	10,775,137.91	8,813,296.13
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	408,594.41	124,480.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	510,157,370.88	529,302,592.08
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	510,157,370.88	529,302,592.08

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛生态环境主题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）	1,016,568,452.31	309,662,491.17	1,326,230,943.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	510,157,370.88	510,157,370.88
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）	-708,509,194.79	-625,236,048.24	-1,333,745,243.03
其中：1. 基金申购款	1,725,306,572.27	958,486,659.98	2,683,793,232.25
2. 基金赎回款	-2,433,815,767.06	-1,583,722,708.22	-4,017,538,475.28
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）	308,059,257.52	194,583,813.81	502,643,071.33
项目	上年度可比期间 2014 年 9 月 10 日（基金合同生效日）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）	2,910,089,921.32	-	2,910,089,921.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	529,302,592.08	529,302,592.08
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）	-1,893,521,469.01	-219,640,100.91	-2,113,161,569.92
其中：1. 基金申购款	491,382,625.62	105,842,902.59	597,225,528.21
2. 基金赎回款	-2,384,904,094.63	-325,483,003.50	-2,710,387,098.13
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）	1,016,568,452.31	309,662,491.17	1,326,230,943.48

金净值)			
------	--	--	--

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

长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]303 号文《关于核准长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的注册，由长盛基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2014 年 9 月 10 日正式生效，于基金合同生效日本基金规模为 2,910,089,921.32 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期间不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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）、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货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（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的 0%-95%；其中投资于生态环境主题的股票和债券不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较标准为：50%*中证环保产业指数收益率+50%*中证综合债指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁

布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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的说明

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发（2014）24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 24 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司
长盛基金（香港）有限公司	基金管理人子公司

注：以下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

本基金于本报告期及上年度可比期间 2014 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间均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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,414,612.98	11,271,225.92
其中：支付销售机构的客户维护费	5,338,715.03	4,028,568.62

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,735,768.82	1,878,537.67

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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：本基金于本报告期及上年度可比期间 2014 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间均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：本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间 2014 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间均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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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 9 月 10 日(基金合同生效日)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
中国银行	193,481,462.13	1,327,726.97	110,552,611.97	1,060,185.77

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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：本基金于本报告期及上年度可比期间 2014 年 9 月 10 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日止期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

000971	高升控股	2015 年 9 月 21 日	重大事项停牌	34.97	2015 年 12 月 31 日	26.39	100,700	2,265,636.00	3,521,479.00	-
600271	航天信息	2015 年 10 月 12 日	重大事项停牌	71.47	-	-	48,200	2,268,632.68	3,444,854.00	-

注：1、本基金截至 2015 年 12 月 31 日持有的高升控股已于本期末复牌，但交易仍不活跃、流通仍受限，因此仍作为流通受限股票。

2、本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

银行存款、结算备付金、应收证券清算款、应收申购款、应付交易费用等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 311,771,508.54 元，属于第二层次的余额为人民币 6,966,333.00 元，无属于第三层次的余额（2014 年 12 月 31 日：第一层次人民币 1,178,255,058.95 元，第二层次人民币 44,235,038.25 元，无属于第三层次的余额）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，由第一层次转入第二层次的金额为人民币 63,054,833.94 元（2014 年度：人民币零元），由第二层次转入第一层次的金额为人民币零元（2014 年度：人民币零元）。

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发（2014）24 号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 24 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（2014 年度：无）。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	318,737,841.54	61.90
	其中：股票	318,737,841.54	61.90
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	195,238,746.79	37.92
7	其他各项资产	930,289.66	0.18
8	合计	514,906,877.99	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	203,930,456.50	40.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	64,232,431.29	12.78

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	19,780,345.80	3.94
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	30,794,607.95	6.13
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	318,737,841.54	63.41

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	002236	大华股份	1,185,306	43,737,791.40	8.70
2	002085	万丰奥威	1,311,807	42,213,949.26	8.40
3	300070	碧水源	594,835	30,794,607.95	6.13
4	601877	正泰电器	968,239	24,970,883.81	4.97
5	600969	郴电国际	1,109,100	20,995,263.00	4.18
6	600406	国电南瑞	1,084,685	18,092,545.80	3.60
7	601126	四方股份	1,045,016	13,877,812.48	2.76
8	600617	国新能源	892,037	13,674,927.21	2.72
9	000049	德赛电池	240,474	13,654,113.72	2.72
10	601222	林洋电子	339,296	12,462,342.08	2.48

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	600690	青岛海尔	91,199,919.00	6.88
2	000333	美的集团	89,785,826.46	6.77
3	600406	国电南瑞	79,601,975.92	6.00
4	002236	大华股份	76,062,724.93	5.74
5	600979	广安爱众	70,835,094.28	5.34
6	601166	兴业银行	64,745,547.00	4.88
7	000400	许继电气	63,445,181.99	4.78
8	600340	华夏幸福	62,280,837.53	4.70
9	300070	碧水源	61,241,365.88	4.62
10	600021	上海电力	61,129,249.89	4.61
11	002202	金风科技	60,357,744.91	4.55
12	002048	宁波华翔	56,265,626.12	4.24
13	601126	四方股份	54,123,351.17	4.08
14	002051	中工国际	53,861,191.41	4.06
15	002454	松芝股份	51,718,043.19	3.90
16	601318	中国平安	49,229,747.48	3.71
17	000049	德赛电池	46,634,201.01	3.52
18	600969	郴电国际	45,959,008.71	3.47
19	600066	宇通客车	44,612,130.59	3.36
20	002085	万丰奥威	44,303,773.96	3.34
21	600617	国新能源	44,276,447.93	3.34
22	600887	伊利股份	42,699,755.44	3.22
23	000651	格力电器	41,546,386.58	3.13
24	600089	特变电工	36,409,647.14	2.75
25	000001	平安银行	35,067,994.79	2.64
26	300083	劲胜精密	34,624,769.18	2.61
27	002654	万润科技	33,414,477.87	2.52
28	600261	阳光照明	33,105,129.44	2.50
29	601877	正泰电器	32,835,904.52	2.48

30	002510	天汽模	29,768,026.22	2.24
31	600674	川投能源	29,440,805.28	2.22
32	002101	广东鸿图	28,883,458.91	2.18

8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600887	伊利股份	153,202,726.27	11.55
2	002454	松芝股份	124,630,824.12	9.40
3	600690	青岛海尔	115,928,181.34	8.74
4	600617	国新能源	109,135,412.16	8.23
5	600021	上海电力	108,123,057.41	8.15
6	601222	林洋能源	107,153,169.57	8.08
7	601006	大秦铁路	103,844,915.29	7.83
8	000333	美的集团	97,366,529.94	7.34
9	600104	上汽集团	93,492,155.77	7.05
10	600886	国投电力	90,599,352.14	6.83
11	601628	中国人寿	82,726,939.02	6.24
12	600271	航天信息	82,556,575.10	6.22
13	002309	中利科技	80,453,549.89	6.07
14	601166	兴业银行	80,248,080.77	6.05
15	002654	万润科技	78,274,105.59	5.90
16	002085	万丰奥威	77,544,080.51	5.85
17	600340	华夏幸福	77,096,206.91	5.81
18	600979	广安爱众	76,312,229.86	5.75
19	300070	碧水源	75,617,500.61	5.70
20	002051	中工国际	67,306,991.96	5.08
21	601318	中国平安	66,431,884.80	5.01
22	600741	华域汽车	62,766,235.02	4.73
23	600066	宇通客车	57,492,136.47	4.34
24	002202	金风科技	54,825,483.60	4.13
25	002351	漫步者	50,465,833.51	3.81
26	000651	格力电器	47,174,160.18	3.56
27	600496	精工钢构	47,081,059.24	3.55
28	000049	德赛电池	45,041,871.55	3.40
29	600406	国电南瑞	43,842,860.30	3.31
30	002048	宁波华翔	40,825,852.59	3.08

31	600089	特变电工	40,171,856.44	3.03
32	600261	阳光照明	39,971,360.50	3.01
33	000400	许继电气	39,405,764.49	2.97
34	002121	科陆电子	39,382,090.44	2.97
35	000001	平安银行	38,155,940.67	2.88
36	600363	联创光电	37,428,857.97	2.82
37	002510	天汽模	36,958,382.63	2.79
38	601126	四方股份	36,235,822.63	2.73
39	600000	浦发银行	34,057,159.42	2.57
40	000002	万科A	31,851,561.40	2.40
41	002462	嘉事堂	30,835,556.08	2.33
42	600674	川投能源	30,698,266.41	2.31
43	300083	劲胜精密	30,606,221.30	2.31
44	002101	广东鸿图	30,487,854.96	2.30
45	300098	高新兴	29,640,426.43	2.23
46	601398	工商银行	28,730,594.99	2.17
47	002236	大华股份	28,354,273.84	2.14
48	000650	仁和药业	28,351,135.12	2.14
49	600048	保利地产	27,721,149.31	2.09

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	2,602,175,686.68
卖出股票收入（成交）总额	4,015,756,506.64

注：本项中 8.4.1、8.4.2 和 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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。

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投资。

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

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	805,550.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	41,448.51

5	应收申购款	83,290.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	930,289.66

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

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中不存在流通受限情况。

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

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
13,424	22,948.40	81,336,420.69	26.40%	226,722,836.83	73.60%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	143,897.26	0.0467%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年9月10日）基金份额总额	2,910,089,921.32
本报告期期初基金份额总额	1,016,568,452.31
本报告期基金总申购份额	1,725,306,572.27
减:本报告期基金总赎回份额	2,433,815,767.06
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	308,059,257.52

§ 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 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2015年4月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期内应支付该会计师事务所的报酬为90,000.00元。已连续为本基

金服务 2 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	
招商证券	1	742,760,980.65	11.22%	676,209.92	11.17%	-
国泰君安	2	54,614,839.38	0.83%	49,721.45	0.82%	-
齐鲁证券	1	1,046,414,538.66	15.81%	968,175.70	15.99%	-
联讯证券	1	2,724,692,896.35	41.17%	2,480,558.11	40.98%	-
银河证券	2	2,049,448,938.28	30.97%	1,878,339.30	31.03%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-

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) 财力雄厚，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
要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

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

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	渤海证券	上海	1
2	日信证券	上海	1
3	川财证券	深圳	1
4	信达证券	深圳	

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无。

长盛基金管理有限公司
2016年3月26日