

长盛航天海工装备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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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	长盛航天海工混合
基金主代码	000535
交易代码	000535
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 3 月 11 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
报告期末基金份额总额	134,399,904.14 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资航天海工装备等安全相关上市公司股票，把握中国航天海工装备等安全相关行业发展带来的投资机会，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，灵活配置国内航天海工装备等安全相关上市公司股票和债券，谋求基金资产的长期稳定增长。航天海工装备等安全相关主题包括航天装备、海洋工程装备及涉及未来战略安全的相关装备制造领域，主要包括航空装备、航天装备、领土安全装备、海洋工程装备及信息安全装备 5 个重点方向，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，选择航天海工装备等安全相关主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
业绩比较基准	50%*巨潮航天军工指数收益率 + 50%*中证综合债指数收益
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	林葛
	联系电话	010-82019988	010-66060069
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-62350088	95599

传真	010-82255988	010-68121816
----	--------------	--------------

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地址

§ 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 3 月 11 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	147,175,126.92	103,167,460.19
本期利润	110,615,860.98	160,167,796.43
加权平均基金份额本期利润	0.4695	0.3048
本期基金份额净值增长率	30.72%	40.90%
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	0.3890	0.2426
期末基金资产净值	212,522,955.13	616,335,353.57
期末基金份额净值	1.581	1.409

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	34.55%	1.86%	9.90%	1.21%	24.65%	0.65%
过去六个月	-6.51%	2.94%	-6.46%	2.16%	-0.05%	0.78%
过去一年	30.72%	2.57%	27.79%	1.83%	2.93%	0.74%
自基金合同生效起至今	84.18%	2.04%	73.33%	1.49%	10.85%	0.55%

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： $50\% \times \text{巨潮航天军工指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

基准指数的构建考虑了三个原则：

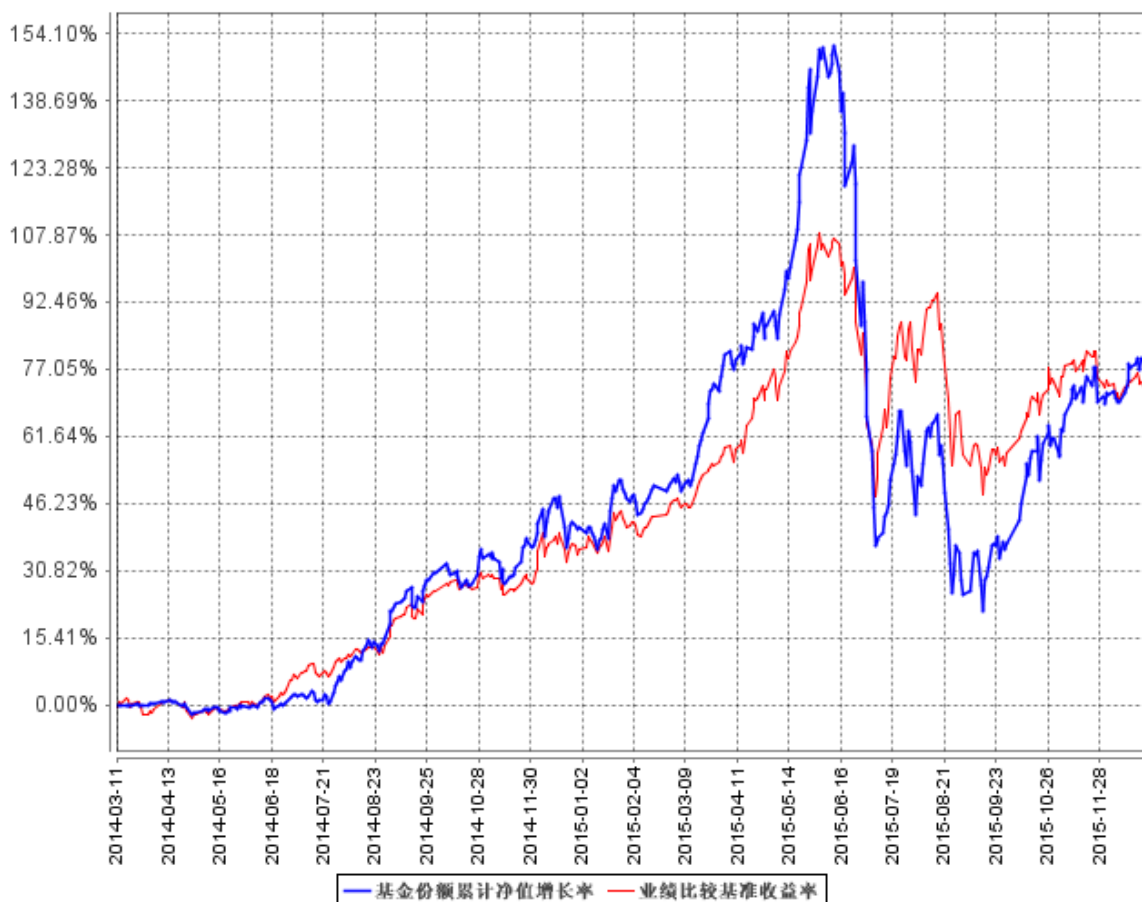
1、公允性。本基金为主题混合型基金，在综合比较目前市场上各主要行业指数的编制特点后，本基金选择以巨潮航天军工指数作为股票投资的业绩比较基准。巨潮航天军工指数是深圳证券交易所编制，反映沪深证券市场上航天军工产品相关行业股票价格变动趋势的指数。本基金主要投资于投资航天海工装备等安全相关上市公司股票，因此巨潮航天军工指数适合作为本基金的业绩比较基准。

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%，其中投资于航天海工装备等安全相关上市公司股票和债券的资产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

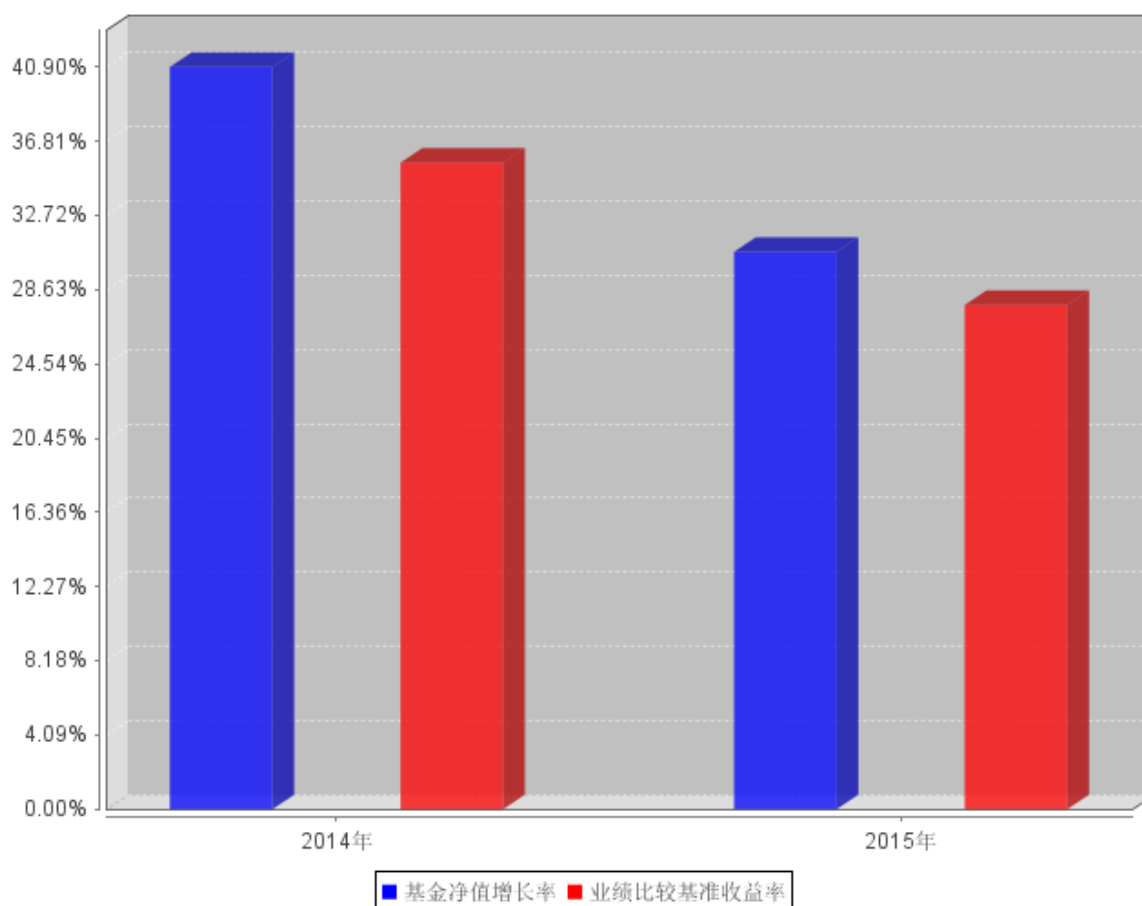
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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本基金合同第十二部分（二）投资范围、（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：本基金基金合同生效日为 2014 年 3 月 11 日，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

单位：人民币元

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	1.9500	66,595,518.25	9,701,611.84	76,297,130.09	除息日：2015年1月14日
2014	-	-	-	-	
合计	1.9500	66,595,518.25	9,701,611.84	76,297,130.09	

§ 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		
王超	本基金基金经理，长盛同瑞中证 200 指数分级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，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理	2015 年 4 月 27 日	-	8 年	男，1981 年 9 月出生，中国国籍。中央财经大学硕士，金融风险管理师 (FRM)。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，从事量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同瑞中证 200 指数分级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（本基金）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，长盛量化红利策略混合型证券投资

	经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理。				基金基金经理。
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。	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，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（本基金）基金经理。
乔培涛	本基金基金经理助理，行业研究员。	2015 年 1 月 8 日	-	7 年	男，1979 年 12 月出生，中国国籍。清华大学硕士。2011 年 8 月加入长盛基金管理有限公司，现任行业研究员，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理助理，长盛电子信息产业混合型证券投资基金基金经理助理。
张锦灿	本基金基金经理，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 3 月 11 日	2015 年 4 月 27 日	10 年	男，1982 年 1 月出生，中国国籍。北京大学光华管理学院金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、研究主管、基金经理助理。2012 年 9 月加入长盛基金管理有限公司，曾任同益证券投资基金基金经理。任长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金（本基金）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,长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。自2015年4月27日起不再担任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。
--	--	--	--	--	--

注：1、上表基金经理及基金经理助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

A 股市场在 2015 年呈现了冲高之后大幅回落的特征。上证指数在 6 月 12 日创下本轮反弹新高 5178 之后，便在清查场外配资等消息的影响下出现快速大幅下跌。此后在监管层出台多项救市措施之后，上证指数于 2850 企稳，此后中小市值股票出现了大幅反弹。回顾 2015 年的行情的驱动因素，上半年的疯狂上涨主要来自于场内融资和场外配资的推动，在资金推动之下，任何主题都可以成为市场追捧的对象。之后的快速去杠杆引发了股灾，贯穿了整个第三季度，政策主导了市场的波动。在市场处于低位后，中小市值股票重新借助各类主题开始了大幅反弹。

军工主题是 2015 年上半年上涨阶段的主要驱动力，军民融合、科研院所改制、阅兵、中国制造 2025、军工信息化等主题使军工相关个股出现较大涨幅。我们在组合中对于上述主题股票予以集中配置，在市场上涨阶段表现良好，净值快速上涨。但是在市场快速下跌阶段，此类股票成为下跌“重灾区”，缺乏流动性的暴跌使得组合出现了大幅回撤。在救市期间，我们对组合进行了大幅度调整，对流动性成本予以高度重视，减轻流动性冲击对组合造成的严重伤害，大幅降低了重仓股集中度，通过分散化配置于量化选股组合，同时结合灵活的仓位管理，使得基金在保持向上高收益弹性的同时，降低基金净值的回撤幅度。

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 1.581 元，本报告期份额净值增长率为 30.72%，同期业绩比较基准增长率为 27.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来的行情，我们并不认同市场当前广为流传的“资产荒”概念，我们认为在风险偏好没有明显提升的情况下，泛滥的流动性并不能增加配置高风险的权益类资产。当前流动性宽松主要是应对中国庞大的地方政府和企业债务问题，而非刺激股市上涨。中小市值股票高高在上的估值将在大非解禁、战略新兴版、注册制等新的供给因素推动下逐步降低。市场存量资金也将会追逐改革后新股发行产生的大量打新和次新股投资机会，对现有处于高位的品种将会形成明显资金分流。中央新提出的“供给侧改革”，更多意味着去产能和调结构进入到了攻坚阶段，对稳增长政策不能再予以过高期待。在外部冲击方面，美联储在 2016 年的加息节奏对全球资本市场的影响都至关重要，再加上“811”汇改以来人民币汇率的大幅波动，进一步加大了国内资本市场的不稳定性。基于这些判断，我们认为 2016 年市场将呈现大幅震荡并且估值中枢逐步下移的行情，因此我们将对基金进行防御性配置，在市场经过风险释放之后，存在大量风险收益比适宜的投资机会时，再予以果断出击，参与市场反弹机会，并注重及时获利了结。

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部分中对基金利润分配原则的约定，本基金于 2016 年 1 月 18 日对 2015 年度利润进行了分配，分配金额为 44,878,955.14 元。

本基金截至 2015 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 52,286,834.26 元，其中：未分配利润已实现部分为 52,286,834.26 元，未分配利润未实现部分为 25,836,216.73 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长盛基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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_A09 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：长盛航天海工装备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	59,153,271.78	89,562,128.66
结算备付金	13,684,588.24	14,914,977.97
存出保证金	587,176.93	585,303.41
交易性金融资产	139,599,486.74	454,126,768.49
其中：股票投资	139,599,486.74	454,126,768.49
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	12,110,272.50	71,408,760.86
应收利息	17,568.33	28,006.87
应收股利	-	-
应收申购款	732,176.24	3,077,624.28
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	225,884,540.76	633,703,570.54
负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 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	-	-
应付赎回款	12,224,408.03	14,967,805.76
应付管理人报酬	273,368.44	754,251.57
应付托管费	45,561.41	125,708.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	580,262.91	1,249,870.83
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	237,984.84	270,580.21
负债合计	13,361,585.63	17,368,216.97
所有者权益：		
实收基金	134,399,904.14	437,326,811.17
未分配利润	78,123,050.99	179,008,542.40
所有者权益合计	212,522,955.13	616,335,353.57
负债和所有者权益总计	225,884,540.76	633,703,570.54

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.581 元，基金份额总额为 134,399,904.14 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛航天海工装备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 3 月 11 日(基金合 同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	121,316,578.40	175,102,212.28
1. 利息收入	1,611,341.62	6,879,388.64
其中：存款利息收入	1,611,341.62	3,259,630.57
债券利息收入	-	2,667,883.25
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	951,874.82
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	151,082,778.72	105,774,363.57
其中：股票投资收益	149,998,735.73	103,232,956.86
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	1,513,753.36
资产支持证券投资	-	-

贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	669,780.00	14,460.00
股利收益	414,262.99	1,013,193.35
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-36,559,265.94	57,000,336.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,181,724.00	5,448,123.83
减：二、费用	10,700,717.42	14,934,415.85
1. 管理人报酬	5,132,134.64	7,142,526.10
2. 托管费	855,355.77	1,190,420.99
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,329,064.20	6,189,366.93
5. 利息支出	-	120,654.12
其中：卖出回购金融资产支出	-	120,654.12
6. 其他费用	384,162.81	291,447.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	110,615,860.98	160,167,796.43
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	110,615,860.98	160,167,796.43

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛航天海工装备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）	437,326,811.17	179,008,542.40	616,335,353.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	110,615,860.98	110,615,860.98
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）	-302,926,907.03	-135,204,222.30	-438,131,129.33
其中：1. 基金申购款	549,309,897.44	271,460,022.38	820,769,919.82
2. 基金赎回款	-852,236,804.47	-406,664,244.68	-1,258,901,049.15
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“-”	-	-76,297,130.09	-76,297,130.09

号填列)			
五、期末所有者权益（基金净值）	134,399,904.14	78,123,050.99	212,522,955.13
项目	上年度可比期间 2014年3月11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）	741,260,519.36	-	741,260,519.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	160,167,796.43	160,167,796.43
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）	-303,933,708.19	18,840,745.97	-285,092,962.22
其中：1. 基金申购款	889,273,380.00	257,065,176.85	1,146,338,556.85
2. 基金赎回款	-1,193,207,088.19	-238,224,430.88	-1,431,431,519.07
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）	437,326,811.17	179,008,542.40	616,335,353.57

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

长盛航天海工装备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]107号文《关于核准长盛航天海工装备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3月11日正式生效，于基金合同生效日，本基金规模为741,260,519.36份基金份额。本期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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金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、股指期货、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（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的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 0%–95%，其中投资于航天海工装备等安全相关上市公司股票和债券的资产不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为：50%*巨潮航天军工指数收益率+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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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
长盛基金（香港）有限公司	基金管理人子公司
长盛创富资产管理有限公司	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 3 月 11 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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金于本报告期及上年度可比期间 2014 年 3 月 11 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。

7.4.8.2.2 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 3 月 11 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	5,132,134.64	7,142,526.10
其中：支付销售机构的客户维护费	2,049,490.21	2,957,543.89

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% 年费率计提。

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

7.4.8.2.3 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 3 月 11 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	855,355.77	1,190,420.99

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：本基金本报告期及上年度可比期间 2014 年 3 月 11 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 3 月 11 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 3 月 11 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
中国农业银行	59,153,271.78	1,518,124.55	89,562,128.66	1,566,533.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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 3 月 11 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
600990	四创电子	2015 年 9 月 1 日	重大事项停牌	82.63	2016 年 3 月 25 日	69.03	99,995	7,460,234.24	8,262,586.85	-
600155	宝硕股份	2015 年 3 月 9 日	重大事项停牌	21.08	2016 年 1 月 27 日	13.48	300,000	4,368,579.68	6,324,000.00	-
000657	中钨高新	2015 年 8 月 6 日	重大事项停牌	16.12	2016 年 2 月 25 日	16.30	379,449	8,542,830.52	6,116,717.88	-
000748	长城信息	2015 年 6 月 18 日	重大事项停牌	24.68	2016 年 3 月 10 日	31.39	185,082	2,120,608.19	4,567,823.76	-
000065	北方国际	2015 年 10 月 21 日	重大事项停牌	29.32	2016 年 3 月 15 日	27.48	129,800	3,788,860.00	3,805,736.00	-

300281	金明精机	2015 年 12 月 7 日	重大事项停牌	19.45	2016 年 1 月 6 日	17.06	99,910	1,782,382.50	1,943,249.50	-
300054	鼎龙股份	2015 年 11 月 23 日	重大事项停牌	25.33	2016 年 3 月 14 日	22.19	70,500	1,199,203.60	1,785,765.00	-
002246	北化股份	2015 年 11 月 23 日	重大事项停牌	14.50	-	-	100,854	940,903.41	1,462,383.00	-
300365	恒华科技	2015 年 11 月 16 日	重大事项停牌	43.10	2016 年 1 月 27 日	38.58	33,500	935,354.25	1,443,850.00	-
300081	恒信移动	2015 年 11 月 26 日	重大事项停牌	46.49	2016 年 3 月 25 日	47.84	30,000	1,099,688.00	1,394,700.00	-

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

本基金于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

本基金于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

7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、应收证券清算款、应收申购款、应付赎回款等，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 102,492,674.75 元，属于第二层次的余额为人民币 37,106,811.99 元，无属于第三层次的余额（2014 年 12 月 31 日：第一层次人民币 424,871,649.27 元，第二层次人民币 29,255,119.22 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 87,745,336.18 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	139,599,486.74	61.80
	其中: 股票	139,599,486.74	61.80
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	72,837,860.02	32.25
7	其他各项资产	13,447,194.00	5.95
8	合计	225,884,540.76	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	1,353,412.00	0.64
C	制造业	126,602,358.24	59.57

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,805,906.25	1.79
F	批发和零售业	1,394,700.00	0.66
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	6,443,110.25	3.03
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	139,599,486.74	65.69

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	300342	天银机电	378,486	17,410,356.00	8.19
2	600990	四创电子	99,995	8,262,586.85	3.89
3	600155	宝硕股份	300,000	6,324,000.00	2.98
4	000657	中钨高新	379,449	6,116,717.88	2.88
5	000748	长城信息	185,082	4,567,823.76	2.15
6	000065	北方国际	129,800	3,805,736.00	1.79
7	002296	辉煌科技	158,200	3,382,316.00	1.59
8	002510	天汽模	150,700	2,671,911.00	1.26
9	002347	泰尔重工	98,100	2,318,103.00	1.09
10	002579	中京电子	135,449	2,125,194.81	1.00

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	300250	初灵信息	50,139,489.37	8.14
2	601989	中国重工	43,099,719.00	6.99
3	600685	中船防务	37,380,369.50	6.06
4	300342	天银机电	29,392,306.30	4.77
5	000733	振华科技	26,032,822.80	4.22
6	600081	东风科技	25,050,903.60	4.06
7	600855	航天长峰	24,350,484.33	3.95
8	002465	海格通信	23,954,416.20	3.89
9	600522	中天科技	23,693,502.25	3.84
10	600149	廊坊发展	23,284,641.22	3.78
11	002101	广东鸿图	23,156,948.62	3.76
12	300309	吉艾科技	22,775,226.00	3.70
13	300072	三聚环保	22,694,209.51	3.68
14	600705	中航资本	22,603,558.98	3.67
15	002013	中航机电	22,497,999.96	3.65
16	002028	思源电气	20,922,257.88	3.39
17	000519	江南红箭	20,215,933.32	3.28
18	601166	兴业银行	20,121,891.44	3.26
19	000960	锡业股份	19,568,718.49	3.18
20	600340	华夏幸福	18,542,702.68	3.01
21	603308	应流股份	18,473,216.00	3.00
22	300310	宜通世纪	17,807,627.19	2.89
23	000657	中钨高新	16,884,185.24	2.74
24	600699	均胜电子	16,418,923.93	2.66
25	000768	中航飞机	16,189,521.82	2.63
26	600562	国睿科技	15,207,050.68	2.47
27	600990	四创电子	12,911,362.14	2.09

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	300159	新研股份	65,794,246.82	10.68
2	601989	中国重工	54,833,346.25	8.90
3	600685	中船防务	51,136,292.91	8.30
4	000748	长城信息	47,273,397.04	7.67
5	300250	初灵信息	43,945,690.36	7.13
6	600169	太原重工	39,478,603.05	6.41
7	000957	中通客车	35,947,290.58	5.83
8	600990	四创电子	35,211,324.74	5.71
9	600184	光电股份	34,983,203.64	5.68
10	000768	中航飞机	34,950,583.15	5.67
11	600562	国睿科技	33,933,404.33	5.51
12	600149	廊坊发展	31,545,215.55	5.12
13	000997	新大陆	27,946,043.52	4.53
14	300342	天银机电	27,367,015.43	4.44
15	300072	三聚环保	26,657,747.34	4.33
16	600038	中直股份	26,163,443.03	4.25
17	002013	中航机电	25,627,445.29	4.16
18	000065	北方国际	25,261,956.00	4.10
19	600855	航天长峰	24,774,795.60	4.02
20	600699	均胜电子	24,653,079.33	4.00
21	600392	盛和资源	24,005,743.42	3.89
22	002028	思源电气	23,607,558.37	3.83
23	000519	江南红箭	21,968,856.72	3.56
24	002501	利源精制	21,724,876.95	3.52
25	601166	兴业银行	20,617,452.07	3.35
26	300007	汉威电子	20,177,796.87	3.27
27	002544	杰赛科技	20,135,874.95	3.27
28	002037	久联发展	19,999,359.46	3.24
29	600705	中航资本	18,338,998.58	2.98
30	002260	德奥通航	17,870,400.00	2.90
31	603308	应流股份	17,809,965.00	2.89
32	600480	凌云股份	17,636,622.44	2.86
33	000733	振华科技	17,547,008.89	2.85
34	600340	华夏幸福	17,515,402.63	2.84

35	300310	宜通世纪	17,024,209.41	2.76
36	002268	卫士通	16,756,926.02	2.72
37	000960	锡业股份	16,656,125.59	2.70
38	002651	利君股份	16,297,763.64	2.64
39	300098	高新兴	16,007,801.63	2.60
40	600522	中天科技	15,643,785.70	2.54
41	002465	海格通信	15,079,444.86	2.45
42	300309	吉艾科技	15,072,368.90	2.45
43	002101	广东鸿图	13,872,822.50	2.25
44	600118	中国卫星	13,474,247.71	2.19
45	002564	天沃科技	12,596,615.85	2.04

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	1,139,127,665.78
卖出股票收入（成交）总额	1,567,094,417.32

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

代码	名称	持仓量（买/	合约市值	公允价值变	风险说明
----	----	--------	------	-------	------

	卖)	(元)	动(元)	
公允价值变动总额合计(元)				0.00
股指期货投资本期收益(元)				669,780.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)				0.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

2016年,根据我们对市场的预判,市场波动将会大幅上升,我们将继续探索通过股指期货产品投资,减少规模波动、仓位变化、系统风险对组合的负面冲击。

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未超出基金合同规定的备选股票库。

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	587,176.93
2	应收证券清算款	12,110,272.50
3	应收股利	-
4	应收利息	17,568.33
5	应收申购款	732,176.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,447,194.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600990	四创电子	8,262,586.85	3.89	重大事项停牌
2	600155	宝硕股份	6,324,000.00	2.98	重大事项停牌
3	000657	中钨高新	6,116,717.88	2.88	重大事项停牌
4	000748	长城信息	4,567,823.76	2.15	重大事项停牌
5	000065	北方国际	3,805,736.00	1.79	重大事项停牌

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
10,931	12,295.30	618,860.96	0.46%	133,781,043.18	99.54%

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	2,817.90	0.0021%

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3月11日）基金份额总额	741,260,519.36
本报告期期初基金份额总额	437,326,811.17
本报告期基金总申购份额	549,309,897.44
减:本报告期基金总赎回份额	852,236,804.47
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	134,399,904.14

§ 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

报经中国证券投资基金业协会同意，自2015年4月27日起，王超同志兼任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，张锦灿同志不再担任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；自2015年6月18日起，杨衡同志兼任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。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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 55,000.00 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	
光大证券	1	870,358,995.60	32.16%	805,389.06	32.47%	-
中投证券	2	830,529,040.67	30.69%	756,114.52	30.48%	-
中信证券	1	336,005,762.29	12.42%	305,899.23	12.33%	-
国金证券	1	227,945,837.67	8.42%	210,020.82	8.47%	-
齐鲁证券	1	191,443,370.15	7.07%	174,289.78	7.03%	-
华福证券	1	69,748,088.56	2.58%	63,497.94	2.56%	-
申银万国	1	66,604,635.34	2.46%	62,029.14	2.50%	-
国信证券	1	59,608,309.26	2.20%	54,267.67	2.19%	-
安信证券	1	53,978,043.56	1.99%	49,141.32	1.98%	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-

国元证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
第一创业	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) 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	联讯证券	深圳	1
2	银河证券	深圳	1
3	方正证券	深圳	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	华宝证券	深圳	1

长盛基金管理有限公司
2016年3月26日