

# 长盛高端装备制造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	长盛高端装备混合
基金主代码	000534
交易代码	000534
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 3 月 25 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	433,401,349.70 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标在于把握中国高端装备制造业发展带来的投资机会，分享高端装备制造相关上市公司的持续投资收益，在严格控制投资风险的基础上，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	<p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑：（1）宏观经济指标，包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口数据变化等；（2）微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期等；（3）市场指标，包括股票市场与债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金的供求关系及其变化等；（4）政策因素，包括财政政策、货币政策、产业政策及其它与证券市场密切相关的各种政策。</p> <p>本基金的股票投资策略，分为股票池初步构建、细分领域配置和个股精选三个方面。</p> <p>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。本基金的权证投资是以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。对于股指期货，本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。</p>
业绩比较基准	50%×上证高端装备 60 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	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址和基金托管人的住所

## § 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 3 月 25 日 (基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日	2013 年
本期已实现收益	60,561,066.58	69,149,590.00	-
本期利润	39,391,431.53	136,661,628.03	-
加权平均基金份额本期利润	0.0801	0.3167	-
本期基金份额净值增长率	31.34%	37.20%	-
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3986	0.2045	-
期末基金资产净值	781,152,370.51	753,120,563.21	-
期末基金份额净值	1.802	1.372	-

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	35.59%	2.25%	10.84%	1.06%	24.75%	1.19%
过去六个月	-7.07%	2.83%	-6.00%	1.81%	-1.07%	1.02%
过去一年	31.34%	2.53%	23.31%	1.55%	8.03%	0.98%
自基金合同生效起至今	80.20%	2.03%	58.26%	1.25%	21.94%	0.78%

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： $50\% \times$  上证高端装备 60 指数收益率  $+50\% \times$  中证综合债指数收益率

基准指数的构建考虑了三个原则：

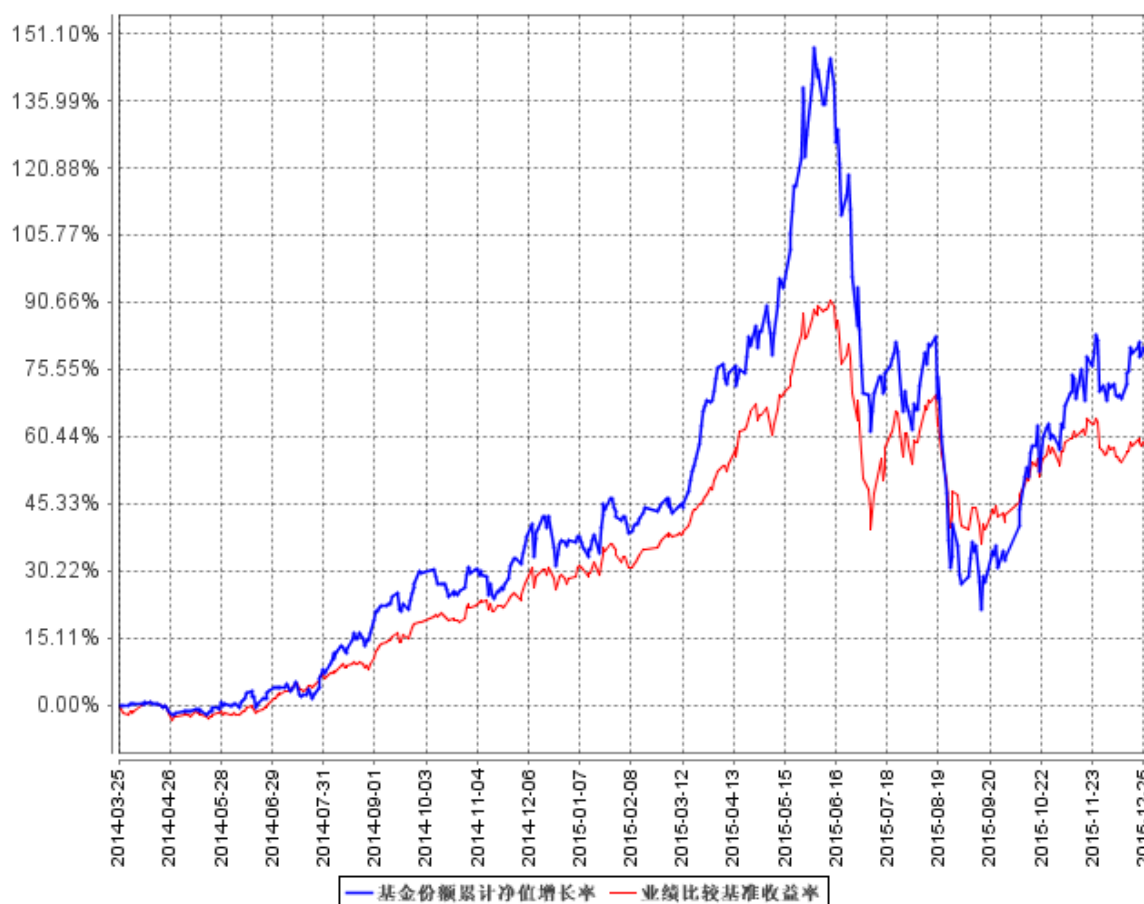
1、公允性。本基金为主题混合型基金，在综合比较目前市场上各主要行业指数的编制特点后，本基金选择以上证高端装备 60 指数作为股票投资的业绩比较基准。上证高端装备 60 指数是中证指数股份有限公司编制，反映沪市通信设备、电气部件与设备、重型电气设备、航天航空与国防等行业股票价格变动趋势的指数。本基金主要投资于投资高端装备等相关上市公司股票，因此上证高端装备 60 指数适合作为本基金的业绩比较基准。

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%，其中投资于高端装备制造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

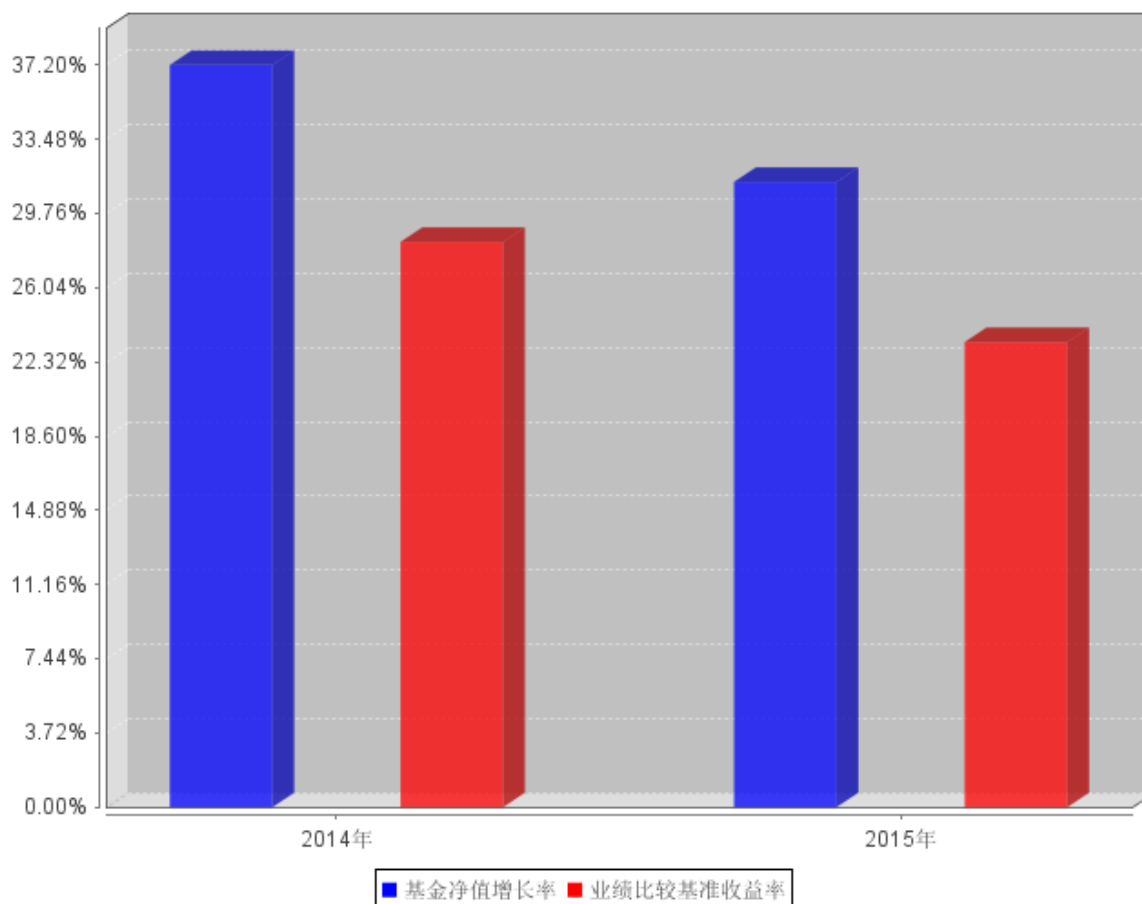
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截止报告日，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 3 月 25 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

注：本基金于 2014 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止会计期间未进行利润分配。

## § 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		
冯雨生	本基金基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理。	2015 年 4 月 27 日	-	8 年	男，1983 年 11 月出生，中国国籍。北京大学金融学硕士。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。现任长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理。
张锦灿	本基金基金经理，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，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资	2014 年 3 月 25 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。现任长盛航天海工装备



	资基金 (LOF) 基金经理。				灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金 (本基金) 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 日起不再担任长盛高端装备制造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

回顾 2015 年，上半年市场大幅上涨，6 月份开始了 3 个月的大调整，之后四季度恢复性上涨。整体上 A 股全年涨幅较大，生物识别、大数据、网络安全和互联网营销等概念板块涨幅靠前，而大央企重组、天津自贸区、沪股通和新疆区域振兴等概念板块大幅跑输市场。行业上，纺织服装、轻工制造和计算机等行业涨幅靠前，非银金融、银行和采掘等行业涨幅靠后。风格上，小盘股大幅跑赢大盘股。

#### 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 1.802 元，本报告期份额净值增长率为 31.34%，业绩比较基准收益率为 23.31%。

### 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 2016 年，居民资产配置时增加权益比例的趋势在继续，陆续出台的改革措施也有利于维持投资者的风险偏好。但经济增长不达预期的风险也在增加，股票市场不同风格股票的估值差距也在拉大，全年大幅震荡的概率在增加。

### 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 172,746,447.02 元，其中：未分配利润已实现部分为 172,746,447.02 元，未分配利润未实现部分为 175,004,573.79 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”）在对长盛高端装备制造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\_A08 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：长盛高端装备制造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
<b>资产：</b>		
银行存款	67,459,828.41	138,231,398.18
结算备付金	53,819,153.60	3,017,741.68
存出保证金	15,682,452.23	473,422.02
交易性金融资产	640,291,172.77	572,548,174.99
其中：股票投资	640,291,172.77	572,548,174.99
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	11,544,495.08	41,629,252.60
应收利息	22,774.41	18,051.11
应收股利	-	-
应收申购款	593,559.84	6,559,546.26
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	789,413,436.34	762,477,586.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2015年12月31日</b>	<b>2014年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
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	4,445,668.33	6,681,698.15
应付管理人报酬	991,384.53	864,283.80
应付托管费	165,230.73	144,047.29
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,393,409.56	1,402,142.16
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	265,372.68	264,852.23
负债合计	8,261,065.83	9,357,023.63
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	433,401,349.70	548,751,968.92
未分配利润	347,751,020.81	204,368,594.29
所有者权益合计	781,152,370.51	753,120,563.21
负债和所有者权益总计	789,413,436.34	762,477,586.84

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.802 元，基金份额总额为 433,401,349.70 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛高端装备制造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 25 日(基金合同 生效日)至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	67,044,278.78	149,794,184.24
1. 利息收入	1,556,352.81	3,733,071.72
其中：存款利息收入	1,556,297.55	2,249,573.70
债券利息收入	55.26	634,849.32
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	848,648.70
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	70,472,750.36	72,240,430.24
其中：股票投资收益	66,838,219.36	70,843,357.81
基金投资收益	-	-
债券投资收益	216,662.44	549,697.49
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	187,914.00	-
股利收益	3,229,954.56	847,374.94
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-21,169,635.05	67,512,038.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	16,184,810.66	6,308,644.25
<b>减：二、费用</b>	27,652,847.25	13,132,556.21
1. 管理人报酬	12,473,428.00	5,714,563.51
2. 托管费	2,078,904.54	952,427.26
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	12,682,954.82	6,115,975.36
5. 利息支出	-	60,006.51
其中：卖出回购金融资产支出	-	60,006.51
6. 其他费用	417,559.89	289,583.57
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	39,391,431.53	136,661,628.03
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	39,391,431.53	136,661,628.03

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛高端装备制造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）	548,751,968.92	204,368,594.29	753,120,563.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,391,431.53	39,391,431.53
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）	-115,350,619.22	103,990,994.99	-11,359,624.23
其中：1. 基金申购款	1,673,315,988.25	1,456,377,405.63	3,129,693,393.88
2. 基金赎回款	-1,788,666,607.47	-1,352,386,410.64	-3,141,053,018.11
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）	433,401,349.70	347,751,020.81	781,152,370.51
项目	上年度可比期间 2014 年 3 月 25 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）	510,326,262.72	-	510,326,262.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	136,661,628.03	136,661,628.03
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）	38,425,706.20	67,706,966.26	106,132,672.46
其中：1. 基金申购款	1,203,133,858.93	328,462,783.37	1,531,596,642.30
2. 基金赎回款	-1,164,708,152.73	-260,755,817.11	-1,425,463,969.84
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）	548,751,968.92	204,368,594.29	753,120,563.21

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：

<u>周兵</u>	<u>杨思乐</u>	<u>龚珉</u>
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

长盛高端装备制造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]106 号文《关于核准长盛高端装备制造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 25 日正式生效，于基金合同生效日本基金规模为 510,326,262.72 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。本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例 0%-95%，其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具，其中投资于高端装备制造的股票和债券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。本基金的业绩比较标准为：50%\*上证高端装备 60 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、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

注：本基金本期及上年度可比期间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3月25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	12,473,428.00	5,714,563.51
其中：支付销售机构的客户维护费	5,468,693.79	2,286,010.85

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% 的年费率计提。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

###### 7.4.8.2.2 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3月25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	2,078,904.54	952,427.26

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% 的年费率计提。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：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		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年3月25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	67,459,828.41	1,376,743.54	138,231,398.18	535,199.74

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 3 月 25 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 利润分配情况

##### 7.4.9.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金于本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.10 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.10.1 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。

**7.4.10.2 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
300351	永贵电器	2015年10月19日	重大资产重组	36.42	2016年2月18日	29.80	419,239	11,662,643.57	15,268,684.38	-
000748	长城信息	2015年6月18日	重大资产重组	24.68	2016年3月10日	31.39	450,400	8,084,121.15	11,115,872.00	-
600271	航天信息	2015年10月12日	重大资产重组	71.47	-	-	124,700	7,156,003.89	8,912,309.00	-
600155	宝硕股份	2015年3月10日	重大资产重组	21.08	2016年1月27日	13.48	400,000	5,905,131.00	8,432,000.00	-
002707	众信旅游	2015年11月6日	重大资产重组	52.71	2016年3月15日	47.36	149,249	6,709,789.91	7,866,914.79	-
300036	超图软件	2015年10月30日	重大资产重组	43.18	2016年1月15日	35.11	170,100	4,646,564.14	7,344,918.00	-
000973	佛塑科技	2015年12月18日	重大资产重组	12.99	2016年2月22日	11.70	564,000	6,536,688.97	7,326,360.00	-
300104	乐视网	2015年12月7日	重大资产重组	60.17	-	-	108,200	5,105,899.83	6,510,394.00	-
300222	科大智能	2015年8月21日	重大资产重组	20.84	2016年1月7日	21.16	305,618	6,140,380.58	6,369,079.12	-
300366	创意信息	2015年12月29日	重大资产重组	77.70	-	-	75,000	6,289,263.00	5,827,500.00	-
600990	四创电子	2015年9月1日	重大资产重组	82.63	2016年3月25日	69.03	65,879	4,652,838.06	5,443,581.77	-
000968	*ST 煤气	2015年12月24日	重大资产重组	8.45	-	-	636,917	4,983,885.88	5,381,948.65	-
002698	博实股份	2015年12月28日	重大资产重组	29.33	2016年1月5日	26.40	133,915	3,486,313.68	3,927,726.95	-
601137	博威合金	2015年12月21日	重大资产重组	24.24	2016年2月29日	22.37	158,625	3,876,761.05	3,845,070.00	-

注：1. 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。

**7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有银行间债券正回购交易中作为抵押的债券。

**7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 7.4.11 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 536,718,814.11 元，属于第二层次的余额为人民币 103,572,358.66 元，无属于第三层次的余额（2014 年 12 月 31 日：第一层次人民币 530,749,980.79 元，第二层次人民币 41,798,194.20 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 69,666,711.20 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 2015 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	640,291,172.77	81.11
	其中：股票	640,291,172.77	81.11
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	121,278,982.01	15.36
7	其他各项资产	27,843,281.56	3.53
8	合计	789,413,436.34	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	5,175,846.00	0.66
B	采矿业	16,166,538.65	2.07
C	制造业	541,023,637.47	69.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,342,678.00	0.43
E	建筑业	11,511,629.00	1.47
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	55,203,928.86	7.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,866,914.79	1.01
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	640,291,172.77	81.97

### 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	300351	永贵电器	419,239	15,268,684.38	1.95
2	300342	天银机电	242,500	11,155,000.00	1.43
3	000748	长城信息	450,400	11,115,872.00	1.42
4	600271	航天信息	124,700	8,912,309.00	1.14
5	002606	大连电瓷	475,805	8,564,490.00	1.10
6	600155	宝硕股份	400,000	8,432,000.00	1.08
7	002609	捷顺科技	395,972	8,259,975.92	1.06
8	002309	中利科技	424,450	7,971,171.00	1.02
9	002707	众信旅游	149,249	7,866,914.79	1.01
10	002580	圣阳股份	382,512	7,650,240.00	0.98

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.csfund.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	601766	中国中车	75,168,769.60	9.98
2	000338	潍柴动力	62,604,778.48	8.31
3	600685	中船防务	49,759,697.05	6.61
4	000625	长安汽车	49,226,182.70	6.54
5	601989	中国重工	48,906,821.83	6.49
6	002606	大连电瓷	48,281,019.80	6.41
7	600855	航天长峰	46,111,153.67	6.12



8	000948	南天信息	45,213,898.05	6.00
9	300072	三聚环保	45,010,933.81	5.98
10	600340	华夏幸福	42,704,926.00	5.67
11	601088	中国神华	41,098,560.95	5.46
12	002013	中航机电	40,326,650.74	5.35
13	002063	远光软件	39,400,633.15	5.23
14	600149	廊坊发展	38,898,822.31	5.17
15	600460	士兰微	38,830,099.46	5.16
16	000400	许继电气	37,646,338.23	5.00
17	600660	福耀玻璃	37,289,292.45	4.95
18	300351	永贵电器	37,122,916.97	4.93
19	300250	初灵信息	36,648,866.83	4.87
20	300275	梅安森	36,289,071.52	4.82
21	600845	宝信软件	35,540,095.07	4.72
22	600406	国电南瑞	35,287,517.65	4.69
23	002156	通富微电	35,017,227.65	4.65
24	002454	松芝股份	34,803,991.09	4.62
25	600446	金证股份	33,778,659.88	4.49
26	600570	恒生电子	33,727,608.07	4.48
27	300034	钢研高纳	33,397,618.06	4.43
28	002031	巨轮智能	33,176,024.92	4.41
29	002085	万丰奥威	33,085,209.04	4.39
30	601231	环旭电子	32,870,591.79	4.36
31	000768	中航飞机	32,611,777.49	4.33
32	002559	亚威股份	32,447,367.53	4.31
33	002410	广联达	32,253,300.42	4.28
34	002001	新 和 成	32,084,880.96	4.26
35	000333	美的集团	32,060,716.64	4.26
36	600171	上海贝岭	31,824,103.17	4.23
37	002271	东方雨虹	31,361,103.04	4.16
38	600498	烽火通信	31,308,089.63	4.16
39	002396	星网锐捷	31,271,933.79	4.15
40	600118	中国卫星	31,254,936.86	4.15
41	000988	华工科技	30,678,412.38	4.07
42	000651	格力电器	30,095,975.58	4.00
43	002138	顺络电子	30,082,529.93	3.99

44	002609	捷顺科技	29,434,689.76	3.91
45	000733	振华科技	28,549,837.44	3.79
46	300014	亿纬锂能	27,111,281.20	3.60
47	002309	中利科技	27,016,224.34	3.59
48	600271	航天信息	26,507,232.02	3.52
49	002230	科大讯飞	26,011,273.29	3.45
50	002073	软控股份	25,734,549.68	3.42
51	300045	华力创通	25,579,683.28	3.40
52	000800	一汽轿车	25,097,112.21	3.33
53	002642	荣之联	24,823,670.18	3.30
54	601313	江南嘉捷	24,374,860.11	3.24
55	002444	巨星科技	24,310,240.29	3.23
56	002535	林州重机	24,307,991.56	3.23
57	600066	宇通客车	24,281,691.94	3.22
58	603308	应流股份	23,728,742.86	3.15
59	000418	小天鹅A	23,387,954.91	3.11
60	002185	华天科技	22,921,095.05	3.04
61	600104	上汽集团	22,755,404.32	3.02
62	600893	中航动力	22,627,649.02	3.00
63	600584	长电科技	22,586,455.28	3.00
64	002111	威海广泰	22,121,503.20	2.94
65	300128	锦富新材	21,895,291.27	2.91
66	002698	博实股份	21,855,586.10	2.90
67	300036	超图软件	21,821,989.90	2.90
68	002282	博深工具	21,573,476.46	2.86
69	300023	宝德股份	21,417,639.79	2.84
70	002008	大族激光	21,057,228.40	2.80
71	600674	川投能源	20,806,664.06	2.76
72	002009	天奇股份	20,770,677.46	2.76
73	300342	天银机电	20,620,553.98	2.74
74	002253	川大智胜	20,475,815.79	2.72
75	600835	上海机电	20,462,503.70	2.72
76	000410	沈阳机床	19,998,326.28	2.66
77	002508	老板电器	19,844,677.91	2.63
78	002179	中航光电	19,622,261.26	2.61
79	300059	东方财富	19,550,158.57	2.60

80	300271	华宇软件	19,320,052.25	2.57
81	600391	成发科技	19,208,742.20	2.55
82	002151	北斗星通	18,802,869.79	2.50
83	002153	石基信息	18,706,436.35	2.48
84	300124	汇川技术	18,615,031.68	2.47
85	000738	中航动控	18,567,398.00	2.47
86	600029	南方航空	18,299,826.09	2.43
87	600699	均胜电子	18,225,789.56	2.42
88	600690	青岛海尔	18,048,077.56	2.40
89	300077	国民技术	17,877,756.48	2.37
90	000973	佛塑科技	17,748,368.03	2.36
91	300057	万顺股份	17,710,809.67	2.35
92	000926	福星股份	17,635,331.49	2.34
93	000039	中集集团	17,250,841.69	2.29
94	600588	用友网络	17,237,587.92	2.29
95	600150	中国船舶	17,000,960.60	2.26
96	601179	中国西电	16,953,719.13	2.25
97	002707	众信旅游	16,710,971.89	2.22
98	000837	秦川机床	16,523,960.65	2.19
99	300324	旋极信息	16,472,050.20	2.19
100	300173	智慧松德	16,463,181.94	2.19
101	002184	海得控制	16,423,145.83	2.18
102	002580	圣阳股份	16,282,023.72	2.16
103	002649	博彦科技	16,176,651.40	2.15
104	600651	飞乐音响	15,681,487.12	2.08
105	600316	洪都航空	15,371,416.94	2.04

#### 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	106,479,824.89	14.14
2	600685	中船防务	69,559,193.78	9.24
3	601766	中国中车	67,982,836.60	9.03
4	601989	中国重工	62,880,393.40	8.35
5	600066	宇通客车	62,201,828.86	8.26
6	300072	三聚环保	58,269,165.25	7.74

7	600169	太原重工	56,173,671.91	7.46
8	000768	中航飞机	54,238,172.47	7.20
9	600855	航天长峰	52,089,306.63	6.92
10	600184	光电股份	51,747,876.53	6.87
11	000338	潍柴动力	51,481,946.19	6.84
12	000748	长城信息	51,406,476.15	6.83
13	600118	中国卫星	51,086,666.47	6.78
14	002013	中航机电	50,339,489.17	6.68
15	600149	廊坊发展	48,971,294.50	6.50
16	600038	中直股份	48,970,091.92	6.50
17	600340	华夏幸福	44,688,576.02	5.93
18	300250	初灵信息	44,018,521.17	5.84
19	002606	大连电瓷	43,512,874.41	5.78
20	000625	长安汽车	42,366,530.67	5.63
21	000400	许继电气	41,416,922.22	5.50
22	600990	四创电子	40,839,249.33	5.42
23	600446	金证股份	40,801,227.37	5.42
24	300275	梅安森	38,706,725.62	5.14
25	002085	万丰奥威	37,088,372.07	4.92
26	300098	高新兴	36,656,000.05	4.87
27	601088	中国神华	36,619,342.94	4.86
28	000997	新大陆	36,523,727.59	4.85
29	600391	成发科技	35,422,638.85	4.70
30	600660	福耀玻璃	34,837,039.89	4.63
31	002031	巨轮智能	34,210,915.98	4.54
32	000948	南天信息	34,158,894.75	4.54
33	600460	士兰微	33,343,449.94	4.43
34	600171	上海贝岭	33,337,873.67	4.43
35	002156	通富微电	33,329,126.32	4.43
36	000065	北方国际	33,011,114.55	4.38
37	000957	中通客车	32,481,199.63	4.31
38	600562	国睿科技	32,265,721.65	4.28
39	000333	美的集团	30,893,950.83	4.10
40	600406	国电南瑞	30,785,547.66	4.09
41	002001	新和成	29,949,523.68	3.98
42	002271	东方雨虹	29,396,819.06	3.90
43	300014	亿纬锂能	29,134,383.07	3.87
44	600498	烽火通信	28,650,180.19	3.80

45	002544	杰赛科技	28,216,510.91	3.75
46	600845	宝信软件	27,526,697.08	3.66
47	000988	华工科技	27,496,588.21	3.65
48	000800	一汽轿车	27,328,361.78	3.63
49	300034	钢研高纳	27,045,124.98	3.59
50	300045	华力创通	26,896,914.00	3.57
51	600699	均胜电子	26,868,108.24	3.57
52	002642	荣之联	26,607,046.82	3.53
53	002410	广联达	26,220,472.80	3.48
54	300351	永贵电器	25,988,842.50	3.45
55	000528	柳 工	25,753,318.41	3.42
56	600570	恒生电子	25,446,009.43	3.38
57	002063	远光软件	24,760,434.19	3.29
58	002454	松芝股份	24,672,602.12	3.28
59	002501	利源精制	24,116,166.26	3.20
60	600392	盛和资源	23,310,622.00	3.10
61	600104	上汽集团	23,249,365.40	3.09
62	002559	亚威股份	22,921,543.11	3.04
63	601231	环旭电子	22,668,730.45	3.01
64	600480	凌云股份	22,585,818.77	3.00
65	000651	格力电器	22,395,998.25	2.97
66	002535	林州重机	22,359,669.60	2.97
67	002230	科大讯飞	22,323,626.74	2.96
68	300271	华宇软件	22,177,759.75	2.94
69	002396	星网锐捷	21,951,890.95	2.91
70	002111	威海广泰	21,580,495.32	2.87
71	300128	锦富新材	21,251,822.76	2.82
72	002138	顺络电子	21,099,940.71	2.80
73	000418	小天鹅A	20,768,559.56	2.76
74	000926	福星股份	20,478,667.97	2.72
75	000733	振华科技	20,379,298.44	2.71
76	300023	宝德股份	20,243,239.32	2.69
77	000039	中集集团	20,127,315.43	2.67
78	002008	大族激光	19,969,633.70	2.65
79	300342	天银机电	19,890,090.82	2.64
80	300059	东方财富	19,494,872.77	2.59
81	002508	老板电器	19,420,639.57	2.58
82	002073	软控股份	19,282,386.04	2.56

83	002444	巨星科技	18,645,506.01	2.48
84	600271	航天信息	18,333,302.14	2.43
85	601313	江南嘉捷	18,165,791.05	2.41
86	002609	捷顺科技	18,114,424.00	2.41
87	603308	应流股份	17,910,179.05	2.38
88	002698	博实股份	17,812,557.39	2.37
89	600584	长电科技	17,749,485.75	2.36
90	600674	川投能源	17,468,938.13	2.32
91	002260	德奥通航	17,412,199.79	2.31
92	300077	国民技术	17,262,816.50	2.29
93	300124	汇川技术	17,094,472.49	2.27
94	600029	南方航空	16,975,045.78	2.25
95	600893	中航动力	16,886,009.34	2.24
96	600835	上海机电	16,716,728.42	2.22
97	300202	聚龙股份	16,617,850.40	2.21
98	300161	华中数控	16,615,495.67	2.21
99	002037	久联发展	16,592,738.81	2.20
100	600588	用友网络	16,332,622.39	2.17
101	600150	中国船舶	16,104,245.00	2.14
102	600690	青岛海尔	16,092,271.00	2.14
103	002185	华天科技	16,029,921.51	2.13
104	600651	飞乐音响	15,884,399.52	2.11
105	300173	智慧松德	15,876,428.00	2.11
106	002151	北斗星通	15,402,719.50	2.05
107	000410	沈阳机床	15,077,094.98	2.00

#### 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	4,177,675,377.43
卖出股票收入（成交）总额	4,155,446,003.96

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

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。

**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/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1601	IC1601	40	59,192,000.00	264,680.00	-
IC1602	IC1602	7	10,062,640.00	-109,720.00	-
公允价值变动总额合计（元）					154,960.00
股指期货投资本期收益（元）					187,914.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					154,960.00

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本组合在基金合同上允许投资于股指期货，多头头寸比例限制为基金净值的 10%，空头头寸比例限制为基金净值的 20%。三季度股指期货贴水运行，本组合持有部分多头头寸进行现货的资产替代。由于折价的存在，使得期货跌幅少于现货跌幅。四季度股指期货仍然贴水运行，本组合持有部分多头头寸进行现货的资产替代。由于折价的存在，使得期货涨幅大于现货涨幅。整体上资产替代策略取得了成功。

**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

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

### 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	15,682,452.23
2	应收证券清算款	11,544,495.08
3	应收股利	-
4	应收利息	22,774.41
5	应收申购款	593,559.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,843,281.56

### 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

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	300351	永贵电器	15,268,684.38	1.95	重大资产重组
2	000748	长城信息	11,115,872.00	1.42	重大资产重组
3	600271	航天信息	8,912,309.00	1.14	重大资产重组
4	600155	宝硕股份	8,432,000.00	1.08	重大资产重组
5	002707	众信旅游	7,866,914.79	1.01	重大资产重组

### 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
18,717	23,155.49	49,156,423.90	11.34%	384,244,925.80	88.66%

### 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	1,444,507.72	0.3333%

### 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	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2014 年 3 月 25 日 ) 基金份额总额	510,326,262.72
本报告期期初基金份额总额	548,751,968.92
本报告期基金总申购份额	1,673,315,988.25
减:本报告期基金总赎回份额	1,788,666,607.47
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	433,401,349.70

## § 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 4 月 27 日起，冯雨生同志兼任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，张锦灿同志不再担任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。

### 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

本报告期内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 70,000.00 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
国信证券	1	2,101,474,637.73	25.22%	1,913,187.21	25.03%	-
中信建投	2	1,932,396,771.88	23.19%	1,761,449.47	23.04%	-
东兴证券	1	1,045,567,238.39	12.55%	973,740.76	12.74%	-
招商证券	1	1,042,877,423.71	12.51%	971,236.32	12.70%	-
华安证券	1	711,890,251.10	8.54%	648,103.23	8.48%	-
西南证券	1	592,608,540.58	7.11%	551,895.01	7.22%	-
东海证券	2	356,142,105.92	4.27%	324,232.40	4.24%	-
安信证券	2	304,051,280.29	3.65%	276,808.63	3.62%	-
长江证券	1	246,113,131.79	2.95%	224,060.54	2.93%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

## 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
国信证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	789,717.70	100.00%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

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