

长盛中小盘精选混合型证券投资基金
(原长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金转型)
2015 年年度报告

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 重要提示及目录

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。

长盛中小盘精选混合型证券投资基金根据《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》的约定由长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来。长盛同鑫保本二号混合型证券投资基金经中国证监会证监许可【2012】679 号文核准，每个保本周期为三年，第一个保本周期自 2012 年 7 月 10 日开始至 2015 年 7 月 10 日（含）到期。根据《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，在保本周期届满后，长盛同鑫保本二号混合型证券投资基金变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，变更后基金的投资及基金费率等按照《长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。就前述基金变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及本基金基金合同约定履行相关备案手续。

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。

本报告期自 2015 年 7 月 11 日(基金合同生效日)起至 2015 年 12 月 31 日止。(注：长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 7 月 10 日止)。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现（转型前）.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	11
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）.....	13
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.9 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.....	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	20
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.....	20
§6 审计报告（转型前）	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§6 审计报告（转型后）	21
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	22
§7 年度财务报表(转型前)	23
7.1 资产负债表(转型前).....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26

§7 年度财务报表(转型后)	46
7.1 资产负债表（转型后）.....	46
7.2 利润表.....	48
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	49
7.4 报表附注.....	49
§8 投资组合报告(转型前)	68
8.1 期末基金资产组合情况.....	68
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	68
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	69
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	71
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	72
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.....	72
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.....	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
8.12 投资组合报告附注.....	72
§8 投资组合报告(转型后)	73
8.1 期末基金资产组合情况.....	73
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	73
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后).....	74
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	79
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.....	80
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	80
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.....	80
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.....	80
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	80
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	80
8.12 投资组合报告附注.....	81
§9 基金份额持有人信息(转型前)	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	82
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.....	82
§9 基金份额持有人信息(转型后)	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	83
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.....	83
§10 开放式基金份额变动	83
§11 重大事件揭示	83
11.1 基金份额持有人大会决议.....	83
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.....	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	84
11.4 基金投资策略的改变.....	84

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	84
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	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）	87
11.8 其他重大事件（转型后）	89
11.8 其他重大事件（转型前）	90
§12 备查文件目录.....	93
12.1 备查文件目录.....	93
12.2 存放地点.....	94
12.3 查阅方式.....	94

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金
基金简称	长盛同鑫二号保本混合
基金主代码	080015
交易代码	080015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 7 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	104,951,470.33 份
基金合同存续期	长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金的保本周期期限为三年，自基金合同生效日（即 2012 年 7 月 10 日）起至三个公历年后对应日止，即 2015 年 7 月 10 日。

注：上表中“报告期末”为基金转型前最后一日，即 2015 年 7 月 10 日。

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	长盛中小盘精选混合型证券投资基金
基金简称	长盛中小盘精选混合
基金主代码	080015
交易代码	080015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 11 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	51,949,750.41 份
基金合同存续期	不定期

注：上表中“报告期末”为 2015 年 12 月 31 日。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金采用投资组合保险策略，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，实现组合资产的稳定增长和保本期间收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定比例组合保险策略（CPPI）和基于期权的组合保险策略（OBPI）。其中主要通过 CPPI 策略动态调整稳健资产与收益资产的投资比例，以确保在保本期到期时本基金价值不低于事先设定的某一目标价值，从而实现基金资产在保本基础上的增值目的。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种。未持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本周期开始后申购或转换转入的基金份额，不享受保本担保。

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金通过投资具有高成长潜力的中小盘股票，追求基金资产的长期稳定增值。在严控风险的前提下，力争获取超越业绩基准的稳健收益。
投资策略	<p>本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略，重点投资于萌芽期和成长期行业中具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型上市公司，同时考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产的波动风险。</p> <p>1、资产配置 对宏观经济的经济周期进行预测，在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在各类别资产间的分配比例。具体操作中，本基金管理人采用经济周期资产配置模型，通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析，对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测，然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。</p> <p>2、行业配置 不同行业受宏观经济周期、行业自身生命周期以及相关结构性因素的影响在不同时期表现往往具有明显差异。通过宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机，据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业，把握行业景气轮换带来的投资机会。</p> <p>3、股票投资策略 基金管理人自成立及期后每六个月月末将对中国 A 股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到 A 股总流通市值 2/3 的这部分股票称为中小盘股票。在前后两次调整排序期间对于未被纳入最近一次排序范围的股票（如新股、恢复上市股票等），如果其流通市值（对未上市新股而言为本基金管理人预计的流通市值）可满足以上标准，也称为中小盘股票。本基金综合运用长盛股票研究分析方法和其它投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合，中小盘股票中的优势股票优先入选。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数*60%+中证全债指数*40%
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
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100088	100818

法定代表人	高新	田国立
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层
基金保证人	安徽省信用担保集团有限公司	合肥市长江西路 200 号

注：基金保证人指为长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金在保本周期内（2012 年 7 月 10 日至 2015 年 7 月 10 日）提供担保的安徽省信用担保集团有限公司。转型后的长盛中小盘精选混合型证券投资基金为非保本的混合型基金，没有保证人。

§ 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	转型前	转型后	2014 年	2013 年
	2015 年 1 月 1 日 -2015 年 7 月 10 日	2015 年 7 月 11 日 -2015 年 12 月 31 日		
本期已实现收益	40,630,353.84	-5,509,664.93	29,655,801.52	22,035,604.79
本期利润	8,137,465.20	-6,324,108.74	81,136,082.91	4,337,022.46
加权平均基金份额本期利润	0.0323	-0.1027	0.1858	0.0050
本期加权平均净值利润率	2.58%	-9.07%	17.60%	0.49%
本期基金份额净值增长率	1.39%	-7.44%	21.27%	-0.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 7 月 10 日)	报告期末(2015 年 12 月 31 日)	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	24,852,891.03	7,512,896.58	36,660,364.84	3,467,263.97
期末可供分配基金份额利润	0.2368	0.1446	0.1179	0.0061
期末基金资产净值	129,804,361.36	59,462,646.99	379,364,077.43	571,295,202.62
期末基金份额净	1.237	1.145	1.220	1.006

值				
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年7月10日)	报告期末(2015年12月31日)	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	23.70%	-7.44%	22.00%	0.60%

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（注：长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金本报告期最后一日，即7月10日）。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

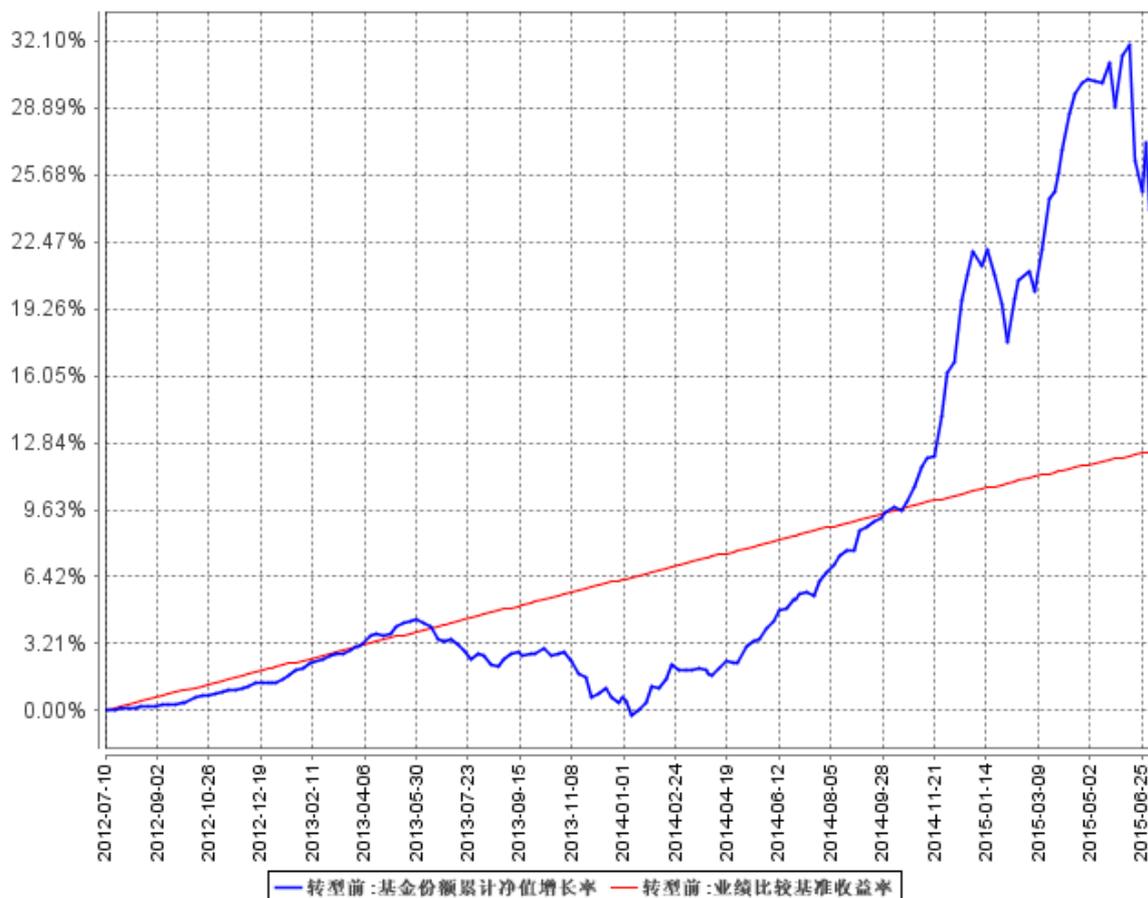
阶段	转型前					
	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2015年7月1日至2015年7月10日	-2.75%	0.92%	0.09%	0.01%	-2.84%	0.91%
2015年1月1日至2015年7月10日	1.39%	0.69%	1.95%	0.01%	-0.56%	0.68%
过去三年	22.11%	0.37%	10.42%	0.01%	11.69%	0.36%
自基金合同生效起至今	23.70%	0.34%	12.46%	0.01%	11.24%	0.33%

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为基金合同成立日所在年度的中国人民银行公布的3年期银行定期存款基准利率的税后收益率。本基金是保本型基金产品，保本周期为3年。以3年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量比较本基金保本保证的有效性。

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

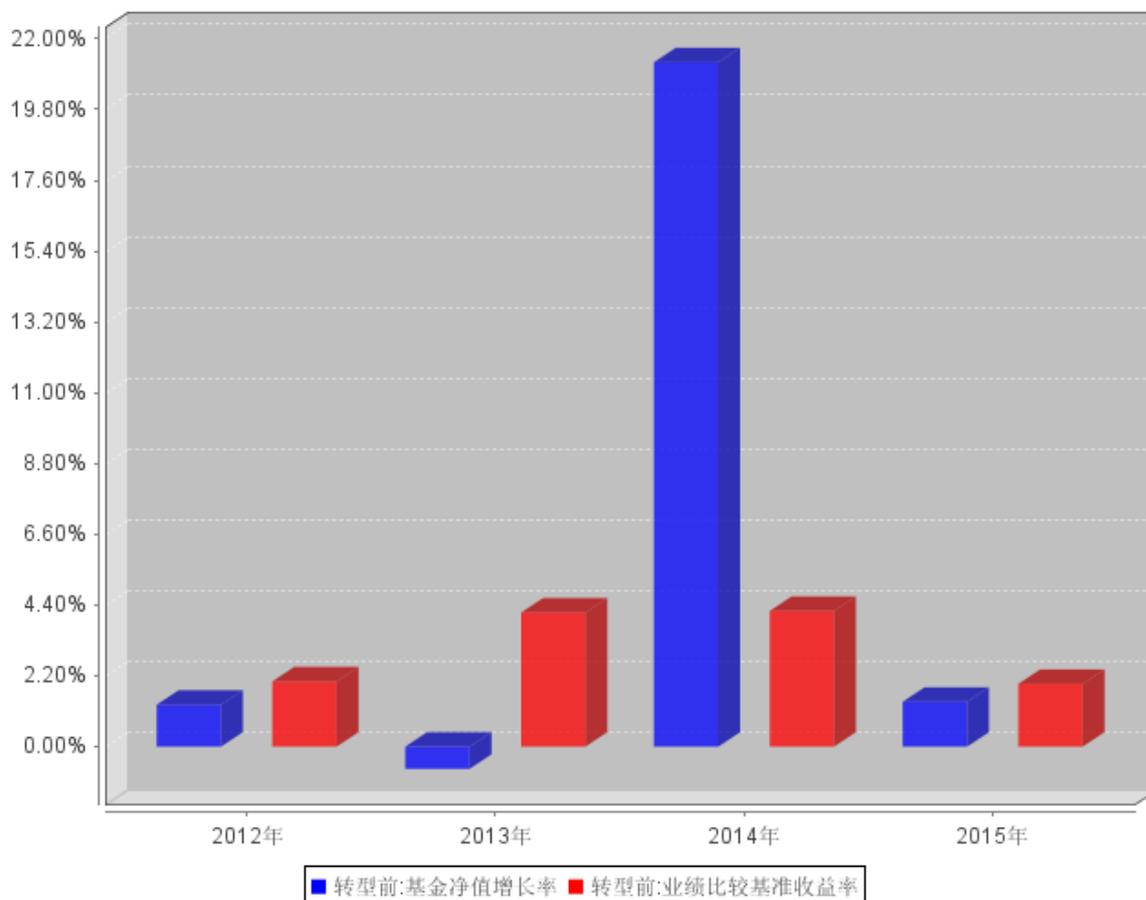
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金存续期为 2012 年 7 月 10 日至 2015 年 7 月 10 日。

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：长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同于 2012 年 7 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。长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金存续期为 2012 年 7 月 10 日至 2015 年 7 月 10 日。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

转型后						
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	14.96%	2.16%	15.60%	1.23%	-0.64%	0.93%
自基金转型起至今	-7.44%	2.09%	6.44%	1.83%	-13.88%	0.26%

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：中证 500 指数*60%+中证全债指数*40%

基准指数的构建考虑了三个原则：

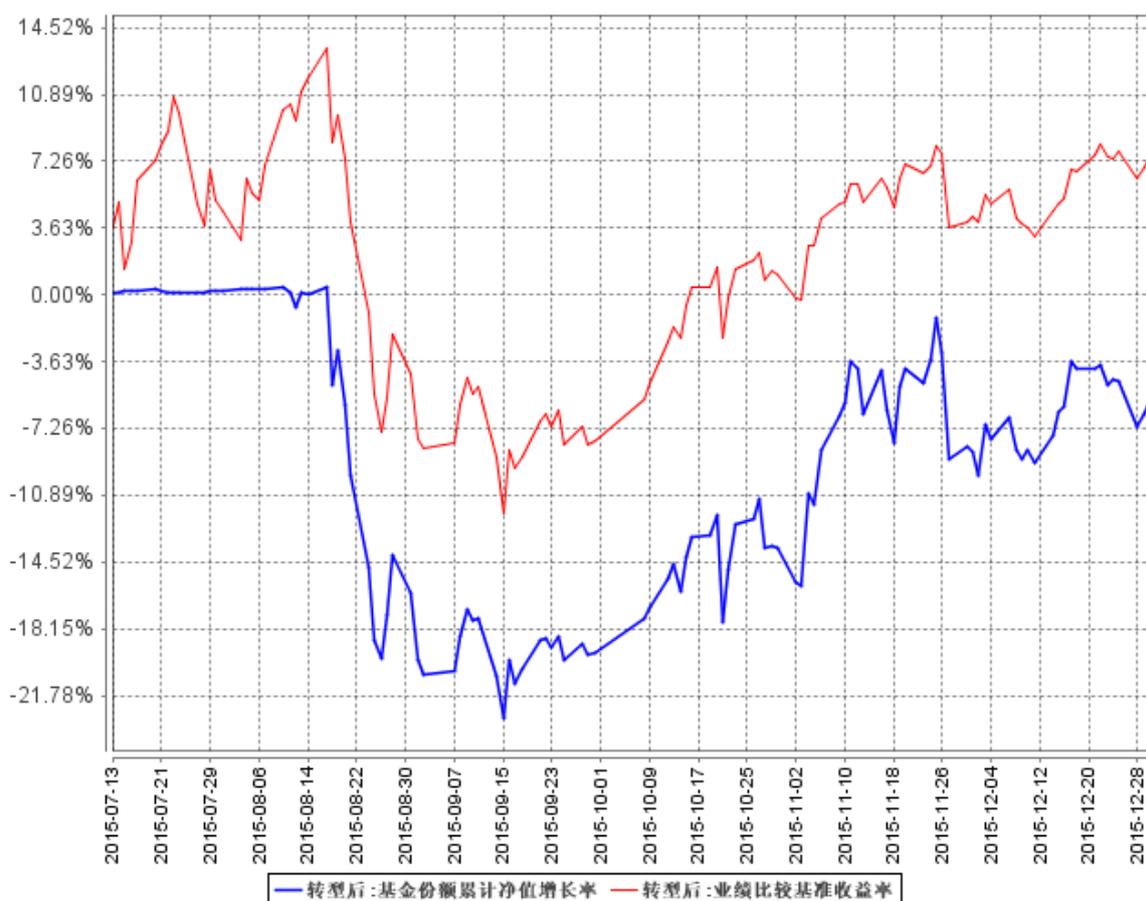
1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定中证 500 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证全债指数。中证 500 指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况，用为衡量本基金业绩的基准较为合适。

2、可比性。本基金在运作过程中将维持 40%-95%的股票、权证等权益类资产，根据本基金投资策略，业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

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 60%、40%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 自基金转型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

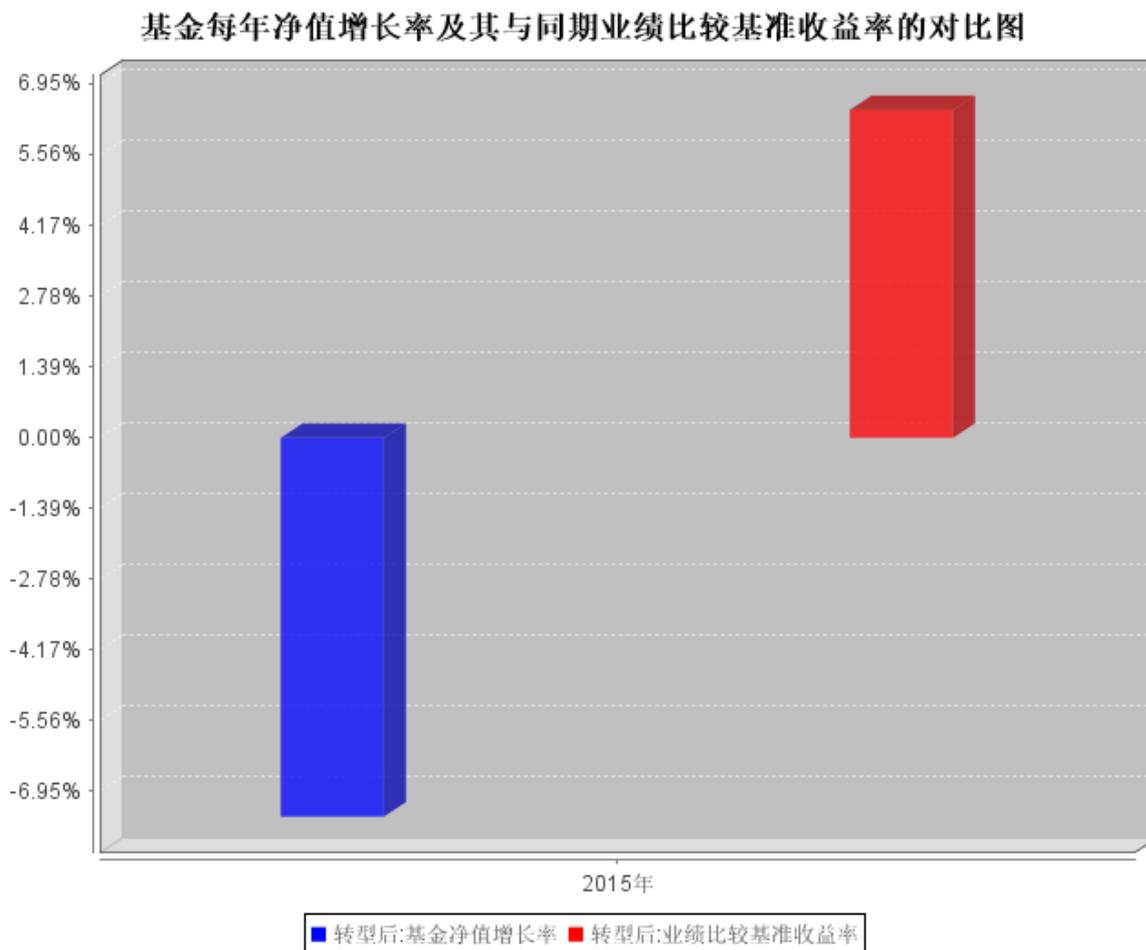


注：1、长盛中小盘精选混合型证券投资基金由长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来，变更日期为 2015 年 7 月 11 日（即基金合同生效日）。截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例

符合基金合同的有关约定。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条（二）投资范围、（六）投资限制的有关约定。

3.2.3 自基金转型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



注：长盛中小盘精选混合型证券投资基金由长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来，变更日期为 2015 年 7 月 11 日（即基金合同生效日）。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（转型前）

注：本基金于 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 7 月 10 日期间、2014 年度及 2013 年度均未进行利润分配。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

注：本基金于 2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日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（转型前）

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		
蔡宾	本基金基金经理，公司副总经理，社保组合组合经理，固定收益部总监。	2012 年 7 月 10 日	2015 年 7 月 10 日	11 年	男，1978 年 11 月出生，中国国籍。毕业于中央财经大学，获硕士学位，CFA（特许金融分析师）。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理，投资经理，长盛积极配置债券基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理，固定收益部总监，社保组合组合经理，任长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金（本基金）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。

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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		
蔡宾	本基金基金经理，公司副总经理，社保组合组合经理，固定收益部总监。	2015年7月11日	-	11年	男，1978年11月出生，中国国籍。毕业于中央财经大学，获硕士学位，CFA（特许金融分析师）。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理，投资经理，长盛积极配置债券基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，公司总经理助理等职务。现任长盛基金管理有限公司副总经理，固定收益部总监，社保组合组合经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金（本基金）基金经理。
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	2015年7月11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基金经理，

	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（本基金）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。
--	-----------------	--	--	---

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

1、报告期内行情回顾

回顾 2015 年，A 股市场走出一波持续上涨后快速下跌的高波动行情。上半年增量资金加速流入股市，券商两融规模不断创新高，市场成交量巨幅放大，A 股市场走出一波快速上涨的牛市行情。但六月中旬到九月，受宽松货币政策阶段性降温的预期、杠杆配资监管的加强、新股发行加速以及恐慌情绪等因素影响，A 股市场连续大幅下挫，市场成交量大幅萎缩。九月中至年末，股市又呈现震荡小幅反弹走势。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金密切关注市场变化，积极寻找投资机会，自下而上精选具备估值优势和高成长能力的个股。仓位上灵活管理，积极参与四季度的反弹行情，同时尽量降低市场波动带来的净值波动风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，长盛中小盘精选混合份额净值为 1.145 元，本报告期（2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日）份额净值增长率为-7.44%，同期业绩比较基准增长率为 6.44%。

截至 2015 年 7 月 10 日，长盛同鑫二号保本混合份额净值为 1.237 元，本报告期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 7 月 10 日）份额净值增长率为 1.39%，同期业绩比较基准增长率为 1.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年，在经济调结构背景下，受去产能、工业品价格低迷、内外需不足等多重因素影响，国内经济仍面临一定下行压力。预计货币政策将维持宽松，但边际效应有所递减；财政政策将会

更加积极，基建投资将成为经济能否企稳的关键。在经济前景不确定及人民币贬值预期下，短期市场偏好难以大幅提升；另外，IPO 注册制加快、战略新兴板的推出以及中概股回归均将导致股票供给增加，高估值个券将出现分化。

展望后市，A 股市场结构性特点将更加突出。重点关注十三五规划、国企改革政策落地、供给侧改革等主题投资机会。操作上，灵活调整仓位，自下而上精选高成长性个股，关注增量资金变动，把握市场结构性机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作，保障资产委托人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时敦促有关部门改进、完善，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

1、强调合规培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训等多种方式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，强化员工合规理念，深化员工合规意识，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、强调制度/流程建设，扎实公司内控制度建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，保证公司制度/流程的合法合规、全面、适时、有效。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，确保制度/流程严肃性与执行力。报告期内，监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核工作，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、登记注册、产品开发等等；并根据业务发展需要，以及日常监督中发现问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题整改效率与效果，以保障公司制度/流程的严肃性与执行力。

5、加强员工行为合规的检查监督。报告期内，监察稽核部借助信息技术系统，通过完善员工投资报备系统、建设员工合规档案系统等，提高员工行为合规管理水平，督促员工自觉合规。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

4.7 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。

4.8 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《长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》第十六部分中对基金收益分配原则的约定，长盛中小盘精选混合型证券投资基金于报告期内未进行利润分配。

长盛中小盘精选混合型证券投资基金截至 2015 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 7,512,896.58 元，其中：未分配利润已实现部分为 8,065,629.99 元，未分配利润未实现部分为 -552,733.41 元。

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》第十八条中对基金收益分配原则的约定，长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金于报告期未实施利润分配。

长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金截止 2015 年 7 月 10 日，期末可供分配利润为 24,852,891.03 元，其中：未分配利润已实现部分为 26,640,959.18 元，未分配利润未实现部分为-1,788,068.15 元。

4.9 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（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 20242 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金的财务报表，包括 2015 年 7 月 10 日(基金合同失效前日)的资产负

	债表、2015 年 1 月 1 日至 2015 年 7 月 10 日(基金合同失效前日)的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金的基金管理人长盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金 2015 年 7 月 10 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 7 月 10 日(基金合同失效前日)的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	陈玲 沈兆杰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2016 年 3 月 22 日

§ 6 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 20243 号
--------	-------------------------

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛中小盘精选混合型证券投资基金(原长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金)全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长盛中小盘精选混合型证券投资基金(原长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是长盛中小盘精选混合型证券投资基金(原长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金)的基金管理人长盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述长盛中小盘精选混合型证券投资基金(原长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金)的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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,公允反映了长盛中小盘精选混合型证券投资基金(原长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金)2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	陈玲 沈兆杰

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2016年3月22日

§ 7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表(转型前)

会计主体：长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金

报告截止日：2015年7月10日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年7月10日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	41,138,717.33	38,578,228.53
结算备付金		2,885,276.05	4,335,789.56
存出保证金		122,420.43	73,821.18
交易性金融资产	7.4.7.2	107,145,433.00	529,346,896.04
其中：股票投资		29,850.00	115,397,492.04
基金投资		-	-
债券投资		107,115,583.00	413,949,404.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,012,193.65	8,948,413.55
应收股利		-	-
应收申购款		-	28,471.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		154,304,040.46	581,311,620.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年7月10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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	185,599,908.80
应付证券清算款		8,124.99	11,434,535.95
应付赎回款		23,667,899.59	3,545,200.42
应付管理人报酬		77,040.43	392,413.65
应付托管费		12,840.07	65,402.29

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	176,567.99	195,539.80
应交税费		388,787.34	388,787.34
应付利息		-	42,257.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	168,418.69	283,497.58
负债合计		24,499,679.10	201,947,543.39
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	104,951,470.33	310,947,429.01
未分配利润	7.4.7.10	24,852,891.03	68,416,648.42
所有者权益合计		129,804,361.36	379,364,077.43
负债和所有者权益总计		154,304,040.46	581,311,620.82

注：1、报告截止日 2015 年 7 月 10 日(基金合同失效前日)，基金份额净值 1.237 元，基金份额总额 104,951,470.33 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 7 月 10 日(基金合同失效前日)止期间。

7.2 利润表

会计主体：长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 7 月 10 日(基金合同失效前日)

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 7 月 10 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		13,122,179.04	99,676,669.04
1. 利息收入		7,652,479.98	35,222,975.43
其中：存款利息收入	7.4.7.11	88,514.52	229,827.60
债券利息收入		7,556,544.49	34,991,559.22
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,420.97	1,588.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		37,764,737.34	12,457,507.77
其中：股票投资收益	7.4.7.12	28,122,758.03	12,351,841.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	8,900,562.17	-379,132.23
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	741,417.14	484,798.04

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-32,492,888.64	51,480,281.39
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	197,850.36	515,904.45
减：二、费用		4,984,713.84	18,540,586.13
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,992,594.85	5,547,713.55
2. 托管费	7.4.10.2.2	332,099.06	924,619.02
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	661,075.48	793,748.43
5. 利息支出		1,800,776.18	10,876,807.98
其中：卖出回购金融资产支出		1,800,776.18	10,876,807.98
6. 其他费用	7.4.7.19	198,168.27	397,697.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,137,465.20	81,136,082.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,137,465.20	81,136,082.91

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年7月10日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年7月10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）	310,947,429.01	68,416,648.42	379,364,077.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,137,465.20	8,137,465.20
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）	-205,995,958.68	-51,701,222.59	-257,697,181.27
其中：1. 基金申购款	4,625,249.59	1,225,018.95	5,850,268.54
2. 基金赎回款	-210,621,208.27	-52,926,241.54	-263,547,449.81
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	104,951,470.33	24,852,891.03	129,804,361.36

根据《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的保本期一般每三年为一个周期；在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人、在本基金过渡期限定期限内申购本基金的基金份额持有人以及从本基金上一个保本期默认选择转入当期保本期的基金份额持有人持有本基金至当期保本期到期的，如可赎回金额加上保本期内的累计分红金额高于或等于其投资净额，本基金的基金管理人将按可赎回金额支付给基金份额持有人；如可赎回金额加上保本期内的累计分红金额低于其投资净额，则本基金的基金管理人或担保人应补足该差额，本基金的担保人将保证向符合上述条件的本基金份额持有人承担上述差额部分的偿付并及时清偿，担保额度为人民币 51 亿元。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回的，赎回部分不适用保本条款；基金份额持有人在保本期申购或转换入的基金份额也不适用保本条款。

根据《关于长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后变更为长盛中小盘精选混合型证券投资基金及相关业务安排的公告》，第一个保本周期自 2012 年 7 月 10 日开始至 2015 年 7 月 10 日(含)到期。由于不再符合保本基金的存续条件，根据本基金基金合同相关规定，本基金在第一个保本周期届满日次日，即 2015 年 7 月 11 日起变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，变更后基金的投资及基金费率等按照《长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同鑫二号保本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，包括国内依法发行交易的债券、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、货币市场工具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。本基金在保本期内投资债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%，其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不少于 5%；投资股票、权证等收益资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，基金持有全部权证的市值不高于基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：3 年期银行定期存款税后收益率。

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》、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》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 1 月 1 日至 2015 年 7 月 10 日(基金合同失效前日)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 7 月 10 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 7 月 10 日(基金合同失效前日)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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 7 月 10 日(基金合同失效前日)。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外, 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。保本周期内，本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市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)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

对于在证券交易所上市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)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有

限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 7 月 10 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	41,138,717.33	38,578,228.53
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	41,138,717.33	38,578,228.53

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年7月10日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	8,895.00	29,850.00	20,955.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	94,421,169.21	96,989,583.00
	银行间市场	9,742,005.48	10,126,000.00
	合计	104,163,174.69	107,115,583.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	104,172,069.69	107,145,433.00	2,973,363.31
项目	上年度末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	85,708,879.56	115,397,492.04	29,688,612.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	353,852,824.81	359,071,904.00
	银行间市场	54,318,939.72	54,877,500.00
	合计	408,171,764.53	413,949,404.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	493,880,644.09	529,346,896.04	35,466,251.95

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年7月10日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	10,754.29	1,737.34
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-

应收结算备付金利息	1,395.21	1,951.10
应收债券利息	2,999,942.30	8,944,691.81
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.02	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	101.83	33.30
合计	3,012,193.65	8,948,413.55

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年7月10日	上年度末 2014年12月31日
交易所市场应付交易费用	175,805.64	195,539.80
银行间市场应付交易费用	762.35	-
合计	176,567.99	195,539.80

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年7月10日	上年度末 2014年12月31日
应付赎回费	919.66	13,452.07
预提费用	167,453.52	270,000.00
其他	45.51	45.51
合计	168,418.69	283,497.58

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年7月10日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	310,947,429.01	310,947,429.01
本期申购	4,625,249.59	4,625,249.59
本期赎回(以“-”号填列)	-210,621,208.27	-210,621,208.27
本期末	104,951,470.33	104,951,470.33

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	36,660,364.84	31,756,283.58	68,416,648.42
本期利润	40,630,353.84	-32,492,888.64	8,137,465.20
本期基金份额交易产生的变动数	-50,649,759.50	-1,051,463.09	-51,701,222.59
其中：基金申购款	1,002,786.40	222,232.55	1,225,018.95
基金赎回款	-51,652,545.90	-1,273,695.64	-52,926,241.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,640,959.18	-1,788,068.15	24,852,891.03

7.4.7.11 存款利息收入

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7月10日	2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	55,735.58	71,741.47
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	31,838.15	156,988.41
其他	940.79	1,097.72
合计	88,514.52	229,827.60

7.4.7.12 股票投资收益

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7月10日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出股票成交总额	253,619,148.96	230,663,935.95
减：卖出股票成本总额	225,496,390.93	218,312,093.99
买卖股票差价收入	28,122,758.03	12,351,841.96

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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7月10日	2014年1月1日至2014年12月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,900,562.17	-379,132.23
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-

合计	8,900,562.17	-379,132.23
----	--------------	-------------

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年7月10日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	410,450,696.01	700,472,881.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	390,341,006.51	678,395,354.00
减：应收利息总额	11,209,127.33	22,456,659.79
买卖债券差价收入	8,900,562.17	-379,132.23

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本期及上年度可比期间未取得衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年7月10日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	741,417.14	484,798.04
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	741,417.14	484,798.04

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年7月10日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1. 交易性金融资产	-32,492,888.64	51,480,281.39
——股票投资	-29,667,657.48	29,688,612.48
——债券投资	-2,825,231.16	21,791,668.91
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-32,492,888.64	51,480,281.39

7.4.7.17 其他收入

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 7 月 10 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	192,739.01	511,718.35
基金转换费收入	5,111.35	4,186.10
合计	197,850.36	515,904.45

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

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 7 月 10 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	660,525.48	792,358.43
银行间市场交易费用	550.00	1,390.00
合计	661,075.48	793,748.43

7.4.7.19 其他费用

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 7 月 10 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
信息披露费	141,288.43	270,000.00
审计费用	26,165.09	60,000.00
帐户维护费	18,000.00	36,000.00
银行划款费用	12,514.75	31,237.15
其他费用	200.00	460.00
合计	198,168.27	397,697.15

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，除已于附注 7.4.1 中披露的本基金基金合同已于 2015 年 7 月 11 日起正式失效外，本基金无其他须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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(“安徽信用担保”)	基金管理人的股东、基金担保人
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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7月10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管理费	1,992,594.85	5,547,713.55
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	955,550.99	2,665,478.45

注：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 1.20%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

7.4.10.2.2 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7月10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	332,099.06	924,619.02

注：支付基金托管人中国银行的托管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。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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末及上年度末未投资本基金。

7.4.10.5 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7月10日		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
中国银行	41,138,717.33	55,735.58	38,578,228.53	71,741.47

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/约定利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金由安徽省信用担保集团有限公司作为担保人，为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证担保。保证担保的范围为：在本保本期到期时，基金份额持有人持有到期的基金份额的可赎回金额加上本保本期内本基金的累计分红金额，低于投资净额时的差额部分，担保额度为人民币 51 亿元。基金份额持有人指在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人。持有到期指在本基金募集期内认购本基金的基金份额持有人在本保本期内一直持有其在本基金的募集期内认购的基金份额。本基金的担保费由本基金的基金管理人按基金资产净值 0.2%的年费率从基金管理费收入中列支。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2015 年 7 月 10 日（基金合同失效前日））本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：本基金本期末未持有因暂时停牌而持有的流通受限证券。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行灵活配置的保本型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资、股票投资、权证投资及货币市场工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人，通过运用投资组合保险策略，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，力争在本基金保本周期结束时，实现基金资产的收益增长。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年7月10日	上年度末 2014年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	15,014,500.00
合计	-	15,014,500.00

注：未评级债券均为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2015年7月10日	上年度末 2014年12月31日
AAA	9,135,000.00	30,150,000.00
AAA 以下	97,980,583.00	368,784,904.00
未评级	-	-
合计	107,115,583.00	398,934,904.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 7 月 10 日(基金合同失效前日)，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2015年7月10日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	41,138,717.33	-	-	-	41,138,717.33
结算备付金	2,885,276.05	-	-	-	2,885,276.05
存出保证金	122,420.43	-	-	-	122,420.43
交易性金融资产	107,115,583.00	-	-	29,850.00	107,145,433.00
应收利息	-	-	-	3,012,193.65	3,012,193.65
资产总计	151,261,996.81	-	-	3,042,043.65	154,304,040.46
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,124.99	8,124.99
应付赎回款	-	-	-	23,667,899.59	23,667,899.59
应付管理人报酬	-	-	-	77,040.43	77,040.43
应付托管费	-	-	-	12,840.07	12,840.07
应付交易费用	-	-	-	176,567.99	176,567.99
应交税费	-	-	-	388,787.34	388,787.34
其他负债	-	-	-	168,418.69	168,418.69
负债总计	-	-	-	24,499,679.10	24,499,679.10
利率敏感度缺口	151,261,996.81	-	-	-21,457,635.45	129,804,361.36
上年度末 2014年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	38,578,228.53	-	-	-	38,578,228.53
结算备付金	4,335,789.56	-	-	-	4,335,789.56
存出保证金	73,821.18	-	-	-	73,821.18
交易性金融资产	276,308,304.00	137,641,100.00	-	115,397,492.04	529,346,896.04
应收利息	-	-	-	8,948,413.55	8,948,413.55
应收申购款	-	-	-	28,471.96	28,471.96
资产总计	319,296,143.27	137,641,100.00	-	124,374,377.55	581,311,620.82
负债					
卖出回购金融资产款	185,599,908.80	-	-	-	185,599,908.80
应付证券清算款	-	-	-	11,434,535.95	11,434,535.95
应付赎回款	-	-	-	3,545,200.42	3,545,200.42
应付管理人报酬	-	-	-	392,413.65	392,413.65
应付托管费	-	-	-	65,402.29	65,402.29
应付交易费用	-	-	-	195,539.80	195,539.80
应付利息	-	-	-	42,257.56	42,257.56
应交税费	-	-	-	388,787.34	388,787.34
其他负债	-	-	-	283,497.58	283,497.58

负债总计	185,599,908.80	-	-	16,347,634.59	201,947,543.39
利率敏感度缺口	133,696,234.47	137,641,100.00	-	108,026,742.96	379,364,077.43

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015年7月10日）	上年度末（2014年12月31日）
	市场利率上升 25个基点	-548,042.73	-2,304,026.38
	市场利率下降 25个基点	548,042.73	2,304,026.38

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金在保本期内投资债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%，其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不少于 5%；投资股票、权证等收益资产占基金资产的比例不高于 40%，其中，基金持有全部权证的市值不高于基金资产净值的 3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk)

指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年7月10日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	29,850.00	0.02	115,397,492.04	30.42
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	29,850.00	0.02	115,397,492.04	30.42

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2015年7月10日)	上年度末(2014年12月31日)
	业绩比较基准上升5%	-	9,841,910.62
	业绩比较基准下降5%	-	-9,841,910.62

注：于2015年7月10日(基金合同失效前日)，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为0.02%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.14 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 7 月 10 日(基金合同失效前日)，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 29,850.00 元，属于第二层次的余额为 107,115,583.00 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 472,539,396.04 元，第二层次 56,807,500.00 元，无第三层次的余额)。

(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。对于在证券交易所上市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)，本基金于 2015 年 3 月 24 日起改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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 7 月 10 日(基金合同失效前日)，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。

§ 7 年度财务报表(转型后)

7.1 资产负债表(转型后)

会计主体：长盛中小盘精选混合型证券投资基金(原长盛同鑫二号保本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	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
资产：		

银行存款	7.4.7.1	7,255,030.72
结算备付金		177,370.61
存出保证金		129,668.75
交易性金融资产	7.4.7.2	52,718,769.68
其中：股票投资		52,679,668.00
基金投资		-
债券投资		39,101.68
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		281,574.11
应收利息	7.4.7.5	1,669.74
应收股利		-
应收申购款		124,729.24
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		60,688,812.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		117,906.33
应付赎回款		182,815.22
应付管理人报酬		78,373.21
应付托管费		13,062.22
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	205,175.55
应交税费		388,787.34
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	240,045.99
负债合计		1,226,165.86
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	51,949,750.41
未分配利润	7.4.7.10	7,512,896.58
所有者权益合计		59,462,646.99
负债和所有者权益总计		60,688,812.85

注：1、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.145 元，基金份额总额 51,949,750.41

份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：长盛中小盘精选混合型证券投资基金（原长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金）

本报告期：2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-5,085,884.24
1. 利息收入		439,796.62
其中：存款利息收入	7.4.7.11	60,203.73
债券利息收入		363,132.21
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		16,460.68
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,733,978.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-8,203,273.44
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	3,466,390.66
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	2,904.33
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-814,443.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	22,741.40
减：二、费用		1,238,224.50
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	497,382.49
2. 托管费	7.4.10.2.2	82,897.11
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	468,566.79
5. 利息支出		3,892.57
其中：卖出回购金融资产支出		3,892.57
6. 其他费用	7.4.7.19	185,485.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,324,108.74
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,324,108.74

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛中小盘精选混合型证券投资基金（原长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金）

本报告期：2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 11 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)	104,951,470.33	24,852,891.03	129,804,361.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,324,108.74	-6,324,108.74
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)	-53,001,719.92	-11,015,885.71	-64,017,605.63
其中：1. 基金申购款	4,234,308.24	600,390.08	4,834,698.32
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-57,236,028.16	-11,616,275.79	-68,852,303.95
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)	51,949,750.41	7,512,896.58	59,462,646.99

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

长盛中小盘精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》的约定由长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)第一个保本周期届满后变更而来。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[2012]第 679 号《关于核准长盛同鑫二号保本混合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《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本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 1,364,600,176.73 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(2012)第 243 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同鑫二号保

本混合型证券投资基金基金合同》于 2012 年 7 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,364,877,570.48 份基金份额，其中认购资金利息折合 277,393.75 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，原基金的保本期一般每三年为一个周期；在原基金募集期内认购原基金的基金份额持有人、在原基金过渡期限定期限内申购原基金的基金份额持有人以及从原基金上一个保本期默认选择转入当期保本期的基金份额持有人持有原基金至当期保本期到期的，如可赎回金额加上保本期内的累计分红金额高于或等于其投资净额，原基金的基金管理人将按可赎回金额支付给基金份额持有人；如可赎回金额加上保本期内的累计分红金额低于其投资净额，则原基金的基金管理人或担保人应补足该差额，原基金的担保人将保证向符合上述条件的原基金份额持有人承担上述差额部分的偿付并及时清偿，担保额度为人民币 51 亿元。但上述基金份额持有人未持有到期而赎回的，赎回部分不适用保本条款；基金份额持有人在保本期申购或转换入的基金份额也不适用保本条款。根据《关于长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后变更为长盛中小盘精选混合型证券投资基金及相关业务安排的公告》，原基金在第一个保本周期届满日次日，即 2015 年 7 月 11 日起变更为本基金，变更后基金的投资及基金费率等按照《长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛中小盘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包括国内依法公开发行上市的各种股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、中期票据、金融债、地方政府债券、企业债券、公司债券、短期融资券、可转换公司债券(含分离交易的可转换公司债券)、资产支持证券、债券回购等)、货币市场工具(包括一年以内的短期国债、回购协议、银行存款等)、权证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(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为 60%X 中证 500 指数+40%X 中证全债指数。

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》、《长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》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 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间的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 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 11 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部

分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	7,255,030.72
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,255,030.72

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	50,520,750.77	52,679,668.00	2,158,917.23

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	39,099.41	39,101.68
	银行间市场	-	-
	合计	39,099.41	39,101.68
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	50,559,850.18	52,718,769.68	2,158,919.50

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	1,525.50
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	79.80
应收债券利息	6.14
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	58.30
合计	1,669.74

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	205,175.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	205,175.55

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付赎回费	0.48
预提费用	240,000.00
其他	45.51
合计	240,045.99

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年7月11日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	104,951,470.33	104,951,470.33
- 基金份额折算调整	-	-
- 未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
- 集中申购募集资金本金及利息	-	-
- 基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	4,234,308.24	4,234,308.24
本期赎回（以“-”号填列）	-57,236,028.16	-57,236,028.16
本期末	51,949,750.41	51,949,750.41

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、根据《长盛中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书》及《长盛中小盘精选混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，申购、赎回业务自2015年7月13日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	26,640,959.18	-1,788,068.15	24,852,891.03
本期利润	-5,509,664.93	-814,443.81	-6,324,108.74
本期基金份额交易产生的变动数	-13,065,664.26	2,049,778.55	-11,015,885.71
其中：基金申购款	682,103.80	-81,713.72	600,390.08
基金赎回款	-13,747,768.06	2,131,492.27	-11,616,275.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,065,629.99	-552,733.41	7,512,896.58

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期
----	----

	2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	52,104.10
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,863.64
其他	1,235.99
合计	60,203.73

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	150,247,851.80
卖出股票成本总额	158,451,125.24
买卖股票差价收入	-8,203,273.44

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付) 差价收入	3,466,390.66
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,466,390.66

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付) 成交总额	110,927,073.53
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付) 成本总额	104,163,075.28
减: 应收利息总额	3,297,607.59
买卖债券差价收入	3,466,390.66

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本期未取得衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,904.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,904.33

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-814,443.81
——股票投资	2,137,962.23
——债券投资	-2,952,406.04
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-814,443.81

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	11,766.17
基金转换费收入	10,975.23
合计	22,741.40

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减。

2、本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、基金转换费用由转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用的补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费差异情况和转出基金的赎回费而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	468,391.79
银行间市场交易费用	175.00
合计	468,566.79

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	33,834.91
信息披露费	128,711.57
银行划款费用	4,939.06
帐户维护费	18,000.00
合计	185,485.54

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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（“安徽信用担保”）	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期间的关联方交易

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年7月11日至2015年12月31日
当期应支付的管理费	497,382.49
其中：支付销售机构的客户维护费	245,153.49

注：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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年7月11日至2015年12月31日
当期应支付的托管费	82,897.11

注：支付基金托管人中国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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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：本基金本期未除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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7月11日至2015年12月31日

	期末余额	当期利息收入
中国银行	7,255,030.72	52,104.10

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/约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本期无利润分配事项。

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

7.4.12.1 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

7.4.12.1.2 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
123001	蓝标转债	2015 年 12 月 21 日	2016 年 1 月 8 日	新债未上市	100.00	100.00	390	39,000.00	39,000.00

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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
300104	乐视网	2015 年 12 月 7 日	重大事项停牌	60.17	-	-	39,800	1,952,796.84	2,394,766.00	-
300088	长信科技	2015 年 12 月 14 日	重大事项停牌	14.77	2016 年 2 月 29 日	12.63	39,000	403,428.00	576,030.00	-
300238	冠昊生物	2015 年 11 月 12 日	重大事项停牌	55.14	-	-	10,000	407,387.29	551,400.00	-
600699	均胜电子	2015 年 11 月 4 日	重大事项停牌	35.91	2016 年 3 月 10 日	29.00	15,000	459,960.00	538,650.00	-
300324	旋极信息	2015 年 12 月 1 日	重大事项停牌	50.57	2016 年 3 月 10 日	44.33	8,000	297,260.00	404,560.00	-
300043	互动娱乐	2015 年 12 月 17 日	重大事项停牌	17.18	-	-	23,500	397,483.00	403,730.00	-
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	12,000	214,457.39	303,960.00	-
300010	立思辰	2015 年 12 月	重大事项	31.90	2016 年 1 月	28.71	8,900	327,692.07	283,910.00	-

		30 日	停牌		8 日					
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	5,000	153,018.50	215,500.00	-
300011	鼎汉技术	2015 年 12 月 31 日	重大事项 停牌	29.80	2016 年 1 月 22 日	26.82	6,800	204,016.32	202,640.00	-
300036	超图软件	2015 年 10 月 30 日	重大事项 停牌	43.18	2016 年 1 月 15 日	35.11	4,500	142,727.00	194,310.00	-
300351	永贵电器	2015 年 10 月 19 日	重大事项 停牌	36.42	2016 年 2 月 18 日	29.80	2,900	90,299.00	105,618.00	-
300431	暴风科技	2015 年 10 月 27 日	重大事项 停牌	104.59	-	-	800	81,646.00	83,672.00	-

注：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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行灵活配置的混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.0658%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证

券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,255,030.72	-	-	-	7,255,030.72
结算备付金	177,370.61	-	-	-	177,370.61
存出保证金	129,668.75	-	-	-	129,668.75
交易性金融资产	-	101.68	39,000.00	52,679,668.00	52,718,769.68
应收证券清算款	-	-	-	281,574.11	281,574.11
应收利息	-	-	-	1,669.74	1,669.74
应收申购款	-	-	-	124,729.24	124,729.24
资产总计	7,562,070.08	101.68	39,000.00	53,087,641.09	60,688,812.85

负债					
应付证券清算款	-	-	-	117,906.33	117,906.33
应付赎回款	-	-	-	182,815.22	182,815.22
应付管理人报酬	-	-	-	78,373.21	78,373.21
应付托管费	-	-	-	13,062.22	13,062.22
应付交易费用	-	-	-	205,175.55	205,175.55
应交税费	-	-	-	388,787.34	388,787.34
其他负债	-	-	-	240,045.99	240,045.99
负债总计	-	-	-	1,226,165.86	1,226,165.86
利率敏感度缺口	7,562,070.08	101.68	39,000.00	51,861,475.23	59,462,646.99

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0658%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票、权证等权益类资产占基金资产的 40%-95%；投资于债券、货币市场工具、资产支持证券等其他证券品种占基金资产的 0%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格

风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	52,679,668.00	88.59
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	52,679,668.00	88.59

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2015 年 12 月 31 日，本基金运营不满一年，无足够历史数据分析利率风险敏感性。

7.4.14 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 46,459,922.00 元，属于第二层次的余额为 6,258,847.68 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。

(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(转型前)

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	29,850.00	0.02
	其中：股票	29,850.00	0.02
2	固定收益投资	107,115,583.00	69.42
	其中：债券	107,115,583.00	69.42
	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	44,023,993.38	28.53
7	其他资产	3,134,614.08	2.03
8	合计	154,304,040.46	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	7,640.00	0.01

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		-
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	22,210.00	0.02
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	29,850.00	0.02

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所有股票投资明细

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	600959	江苏有线	1,000	22,210.00	0.02
2	002770	科迪乳业	500	7,640.00	0.01

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	000625	长安汽车	23,718,585.00	6.25

2	000001	平安银行	16,199,462.80	4.27
3	601601	中国太保	12,899,577.67	3.40
4	600887	伊利股份	11,793,989.88	3.11
5	600048	保利地产	8,331,310.00	2.20
6	000776	广发证券	6,049,752.00	1.59
7	601398	工商银行	6,027,000.00	1.59
8	600276	恒瑞医药	5,869,870.16	1.55
9	600030	中信证券	5,834,800.00	1.54
10	600519	贵州茅台	5,275,644.00	1.39
11	601939	建设银行	5,150,000.00	1.36
12	000400	许继电气	4,914,698.00	1.30
13	000157	中联重科	4,614,000.00	1.22
14	600050	中国联通	4,278,000.00	1.13
15	600009	上海机场	2,763,123.40	0.73
16	601928	凤凰传媒	2,206,377.35	0.58
17	600415	小商品城	1,859,216.00	0.49
18	000401	冀东水泥	1,716,411.47	0.45
19	600859	王府井	1,655,657.00	0.44
20	600362	江西铜业	1,567,879.54	0.41

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	000001	平安银行	31,767,672.78	8.37
2	601601	中国太保	21,648,419.30	5.71
3	000625	长安汽车	19,509,391.05	5.14
4	600887	伊利股份	16,186,544.07	4.27
5	600048	保利地产	10,384,304.31	2.74
6	000401	冀东水泥	8,273,834.28	2.18
7	601318	中国平安	7,900,249.57	2.08
8	600276	恒瑞医药	7,454,977.31	1.97
9	600795	国电电力	7,050,339.87	1.86
10	601398	工商银行	6,259,000.00	1.65
11	000400	许继电气	5,737,680.72	1.51
12	600309	万华化学	5,666,796.48	1.49
13	600050	中国联通	5,649,155.68	1.49

14	600498	烽火通信	5,546,517.48	1.46
15	000581	威孚高科	5,175,178.35	1.36
16	000157	中联重科	5,063,583.00	1.33
17	600519	贵州茅台	5,021,007.68	1.32
18	000776	广发证券	5,015,981.72	1.32
19	601117	中国化学	5,007,717.09	1.32
20	600030	中信证券	4,842,000.00	1.28

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	139,796,406.37
卖出股票收入（成交）总额	253,619,148.96

注：本项 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	96,989,583.00	74.72
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,126,000.00	7.80
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	107,115,583.00	82.52

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	112127	12 华西债	200,000	20,662,000.00	15.92
2	122204	12 双良节	169,900	17,304,315.00	13.33
3	122164	12 通威发	150,000	15,303,000.00	11.79
4	112152	12 亚达债	150,000	15,070,500.00	11.61
5	1282512	12 西北院 MTN1	100,000	10,126,000.00	7.80

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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**

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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	122,420.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,012,193.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,134,614.08

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（2015年7月10日）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。

§8 投资组合报告(转型后)

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	52,679,668.00	86.80
	其中：股票	52,679,668.00	86.80
2	固定收益投资	39,101.68	0.06
	其中：债券	39,101.68	0.06
	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	7,432,401.33	12.25
7	其他资产	537,641.84	0.89
8	合计	60,688,812.85	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	166,000.00	0.28
C	制造业	24,314,392.00	40.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	195,200.00	0.33
E	建筑业	293,085.00	0.49
F	批发和零售业	59,400.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	1,269,360.00	2.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,801,955.00	18.17
J	金融业	5,910,900.00	9.94
K	房地产业	1,304,000.00	2.19
L	租赁和商务服务业	617,580.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	295,080.00	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	2,666,020.00	4.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	556,096.00	0.94
R	文化、体育和娱乐业	4,230,600.00	7.11
S	综合	-	-
	合计	52,679,668.00	88.59

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所有股票投资明细(转型后)

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	601336	新华保险	50,000	2,610,500.00	4.39
2	300104	乐视网	39,800	2,394,766.00	4.03
3	600104	上汽集团	80,000	1,697,600.00	2.85
4	300370	安控科技	80,000	1,564,800.00	2.63

5	000776	广发证券	80,000	1,556,000.00	2.62
6	600519	贵州茅台	7,000	1,527,330.00	2.57
7	002262	恩华药业	50,000	1,463,500.00	2.46
8	300059	东方财富	27,000	1,404,810.00	2.36
9	300070	碧水源	26,000	1,346,020.00	2.26
10	000069	华侨城 A	150,000	1,320,000.00	2.22
11	600325	华发股份	80,000	1,304,000.00	2.19
12	600009	上海机场	43,000	1,269,360.00	2.13
13	002056	横店东磁	45,000	1,264,950.00	2.13
14	601009	南京银行	70,000	1,239,000.00	2.08
15	300027	华谊兄弟	26,000	1,078,480.00	1.81
16	000063	中兴通讯	50,000	931,500.00	1.57
17	600373	中文传媒	38,000	892,620.00	1.50
18	300088	长信科技	39,000	576,030.00	0.97
19	300017	网宿科技	9,600	575,904.00	0.97
20	300133	华策影视	19,000	566,010.00	0.95
21	300238	冠昊生物	10,000	551,400.00	0.93
22	600699	均胜电子	15,000	538,650.00	0.91
23	002050	三花股份	50,000	532,500.00	0.90
24	300058	蓝色光标	36,000	530,280.00	0.89
25	601998	中信银行	70,000	505,400.00	0.85
26	300315	掌趣科技	35,000	490,000.00	0.82
27	601098	中南传媒	20,000	478,000.00	0.80
28	300271	华宇软件	10,000	474,800.00	0.80
29	300251	光线传媒	15,000	454,350.00	0.76
30	300291	华录百纳	12,000	427,200.00	0.72
31	600594	益佰制药	20,000	424,000.00	0.71
32	300124	汇川技术	8,900	420,080.00	0.71
33	300024	机器人	6,000	411,000.00	0.69
34	300077	国民技术	9,000	406,620.00	0.68
35	300324	旋极信息	8,000	404,560.00	0.68
36	300043	互动娱乐	23,500	403,730.00	0.68
37	300267	尔康制药	12,000	403,200.00	0.68
38	300142	沃森生物	30,000	395,400.00	0.66
39	300207	欣旺达	13,900	390,590.00	0.66
40	300408	三环集团	10,000	372,800.00	0.63
41	300203	聚光科技	10,500	360,045.00	0.61
42	300079	数码视讯	29,400	356,328.00	0.60
43	300002	神州泰岳	27,100	355,010.00	0.60

44	300115	长盈精密	10,500	352,485.00	0.59
45	300170	汉得信息	17,600	349,360.00	0.59
46	002001	新和成	20,000	348,800.00	0.59
47	300085	银之杰	6,000	335,400.00	0.56
48	300144	宋城演艺	11,800	333,940.00	0.56
49	000333	美的集团	10,000	328,200.00	0.55
50	300090	盛运环保	28,000	327,880.00	0.55
51	300363	博腾股份	12,000	325,560.00	0.55
52	300182	捷成股份	13,300	319,200.00	0.54
53	300287	飞利信	17,500	316,750.00	0.53
54	002232	启明信息	14,800	314,944.00	0.53
55	300244	迪安诊断	4,500	312,930.00	0.53
56	300003	乐普医疗	8,000	308,800.00	0.52
57	300072	三聚环保	9,000	305,730.00	0.51
58	300054	鼎龙股份	12,000	303,960.00	0.51
59	300146	汤臣倍健	7,700	296,450.00	0.50
60	300012	华测检测	12,000	295,080.00	0.50
61	300055	万邦达	13,500	293,085.00	0.49
62	300147	香雪制药	11,700	292,617.00	0.49
63	300053	欧比特	7,000	285,250.00	0.48
64	600498	烽火通信	10,000	285,100.00	0.48
65	300010	立思辰	8,900	283,910.00	0.48
66	002268	卫士通	5,000	281,050.00	0.47
67	300367	东方网力	4,000	278,800.00	0.47
68	300039	上海凯宝	20,000	277,200.00	0.47
69	300136	信维通信	8,900	262,995.00	0.44
70	300001	特锐德	8,900	258,100.00	0.43
71	300274	阳光电源	9,300	255,006.00	0.43
72	300212	易华录	5,500	253,935.00	0.43
73	300026	红日药业	11,900	251,090.00	0.42
74	300015	爱尔眼科	7,700	243,166.00	0.41
75	300032	金龙机电	7,900	240,160.00	0.40
76	002126	银轮股份	12,900	238,005.00	0.40
77	300171	东富龙	7,300	218,854.00	0.37
78	300257	开山股份	7,000	215,950.00	0.36
79	300365	恒华科技	5,000	215,500.00	0.36
80	600439	瑞贝卡	30,000	213,000.00	0.36
81	300156	神雾环保	4,200	209,958.00	0.35
82	300205	天喻信息	10,000	206,400.00	0.35

83	300068	南都电源	10,300	204,352.00	0.34
84	300011	鼎汉技术	6,800	202,640.00	0.34
85	300332	天壕环境	8,000	195,200.00	0.33
86	300036	超图软件	4,500	194,310.00	0.33
87	300005	探路者	8,400	192,360.00	0.32
88	300253	卫宁软件	4,500	188,460.00	0.32
89	300352	北信源	3,000	187,200.00	0.31
89	300228	富瑞特装	6,000	187,200.00	0.31
90	300358	楚天科技	4,900	186,739.00	0.31
91	300369	绿盟科技	3,500	170,240.00	0.29
92	300014	亿纬锂能	5,100	167,382.00	0.28
93	000571	新大洲A	20,000	166,000.00	0.28
94	300075	数字政通	5,000	156,750.00	0.26
95	300202	聚龙股份	4,800	154,512.00	0.26
96	300183	东软载波	5,700	153,729.00	0.26
97	300177	中海达	8,000	153,440.00	0.26
98	300101	振芯科技	5,100	150,501.00	0.25
99	300229	拓尔思	4,700	147,580.00	0.25
100	300137	先河环保	7,000	146,650.00	0.25
101	300004	南风股份	5,500	146,245.00	0.25
102	300122	智飞生物	3,900	141,882.00	0.24
103	300006	莱美药业	3,500	140,000.00	0.24
104	300096	易联众	5,200	138,684.00	0.23
105	300166	东方国信	4,100	131,323.00	0.22
106	300052	中青宝	4,300	124,657.00	0.21
107	603000	人民网	5,000	114,050.00	0.19
108	300351	永贵电器	2,900	105,618.00	0.18
109	300074	华平股份	6,900	101,706.00	0.17
110	300386	飞天诚信	1,800	89,010.00	0.15
111	300178	腾邦国际	3,000	87,300.00	0.15
112	300152	科融环境	7,700	86,317.00	0.15
113	300431	暴风科技	800	83,672.00	0.14
114	300181	佐力药业	5,900	70,151.00	0.12
115	300413	快乐购	1,500	59,400.00	0.10
116	300113	顺网科技	500	50,685.00	0.09

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600009	上海机场	3,302,930.79	5.55
2	300017	网宿科技	3,168,511.75	5.33
3	600519	贵州茅台	3,013,393.00	5.07
4	300059	东方财富	2,845,968.00	4.79
5	601009	南京银行	2,832,482.00	4.76
6	601336	新华保险	2,725,000.00	4.58
7	300104	乐视网	2,281,534.00	3.84
8	300027	华谊兄弟	2,128,040.00	3.58
9	601998	中信银行	2,005,424.60	3.37
10	300072	三聚环保	1,966,559.98	3.31
11	600276	恒瑞医药	1,914,068.04	3.22
12	300370	安控科技	1,850,412.00	3.11
13	000776	广发证券	1,737,254.48	2.92
14	600104	上汽集团	1,721,800.00	2.90
15	300024	机器人	1,662,827.31	2.80
16	300271	华宇软件	1,600,231.68	2.69
17	600521	华海药业	1,509,014.72	2.54
18	000069	华侨城 A	1,496,004.00	2.52
19	600373	中文传媒	1,492,681.54	2.51
20	600663	陆家嘴	1,466,756.00	2.47
21	002262	恩华药业	1,441,838.00	2.42
22	601933	永辉超市	1,372,641.00	2.31
23	300063	天龙集团	1,319,224.76	2.22
24	300070	碧水源	1,319,029.40	2.22
25	300136	信维通信	1,270,010.00	2.14
26	002594	比亚迪	1,267,761.56	2.13
27	600325	华发股份	1,264,082.00	2.13
28	300257	开山股份	1,210,210.00	2.04
29	002572	索菲亚	1,194,210.00	2.01
30	002717	岭南园林	1,189,833.00	2.00

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	300017	网宿科技	2,713,679.99	4.56
2	600009	上海机场	1,998,833.24	3.36
3	600276	恒瑞医药	1,864,358.88	3.14
4	601009	南京银行	1,580,098.00	2.66
5	300059	东方财富	1,546,256.00	2.60
6	600663	陆家嘴	1,531,428.00	2.58
7	300072	三聚环保	1,490,017.00	2.51
8	600519	贵州茅台	1,412,058.00	2.37
9	600521	华海药业	1,393,696.50	2.34
10	601998	中信银行	1,389,800.00	2.34
11	300271	华宇软件	1,288,113.00	2.17
12	300063	天龙集团	1,280,851.00	2.15
13	601933	永辉超市	1,240,932.00	2.09
14	300024	机器人	1,201,235.20	2.02
15	002594	比亚迪	1,190,323.00	2.00
16	300284	苏交科	1,181,271.00	1.99
17	002572	索菲亚	1,166,533.00	1.96
18	300027	华谊兄弟	1,153,934.30	1.94
19	300033	同花顺	1,129,992.00	1.90
20	002717	岭南园林	1,065,391.00	1.79

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	208,962,981.01
卖出股票收入（成交）总额	150,247,851.80

注：本项 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	101.68	0.00
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	39,000.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,101.68	0.07

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	123001	蓝标转债	390	39,000.00	0.07
2	112139	12 北新债	1	101.68	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述两只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

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

根据 2015 年 1 月 16 日中国证券监督管理委员会通报的 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况,对广发证券股份有限公司采取责令限期改正的行政监管措施。2015 年 8 月 24 日,广发证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(鄂证调查字 2015023 号)。因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对公司立案调查,对广发证券责令整改,给予警告,没收违法所得 6,805,135.75 元,并处以 20,415,407.25 元罚款。本基金做出如下说明:广发证券是中国最优秀的证券公司之一,综合实力突出,基本面良好。基于相关研究,本基金判断,这一处罚对广发证券无实质影响。今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外,本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,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 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	129,668.75
2	应收证券清算款	281,574.11
3	应收股利	-
4	应收利息	1,669.74
5	应收申购款	124,729.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	537,641.84

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

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	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	--------	----------

				值比例 (%)	
1	300104	乐视网	2,394,766.00	4.03	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(转型前)

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
1,219	86,096.37	-	-	104,951,470.33	100.00%

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	-	-

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

§ 9 基金份额持有人信息(转型后)

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
881	58,966.80	-	-	51,949,750.41	100.00%

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	281,027.88	0.5410%

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年7月11日）基金份额总额	104,951,470.33
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,234,308.24
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	57,236,028.16
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	51,949,750.41

§ 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

报经中国证监会批准，自2015年7月11日起，长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金转型

为长盛中小盘精选混合型证券投资基金。

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2015 年 7 月 11 日起，蔡宾、赵宏宇同志担任长盛中小盘精选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

长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金于第一个保本周期届满日次日，即 2015 年 7 月 11 日起变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，《长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》生效，《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》同时失效，基金的投资策略相应调整。调整后的投资策略要点是：“结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略，重点投资于萌芽期和成长期行业中具有持续成长潜力以及未来成长空间广阔的中小型上市公司，同时考虑组合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产的波动风险。”调整后的投资策略详见 2015 年 7 月 1 日发布在基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上的《长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》和《长盛中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书》。

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中天会计师事务所（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 60,000.00 元，已连续提供审计服务 4 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（转型后）

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	
首创证券	1	245,502,339.72	68.34%	179,538.26	62.90%	-
联讯证券	1	96,272,048.37	26.80%	89,658.82	31.41%	-
银河证券	1	17,426,544.72	4.85%	16,229.23	5.69%	-
广发证券	1	9,900.00	0.00%	9.01	0.00%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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
首创证券	20,559,524.84	21.08%	46,694,000.00	49.31%	-	-
联讯证券	58,629,841.41	60.11%	48,000,000.00	50.69%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	18,352,902.98	18.82%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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、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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	首创证券	深圳	1
2	渤海证券	上海	1

3	日信证券	上海	1
---	------	----	---

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

4、本基金租用证券公司上海交易单元均为共用交易单元。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

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	
广发证券	1	153,160,908.11	38.98%	139,437.78	38.98%	-
联讯证券	1	136,862,294.46	34.83%	124,599.08	34.83%	-
海通证券	1	102,941,447.76	26.20%	93,718.53	26.20%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	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
广发证券	252,389,308.40	60.03%	710,146,000.00	28.42%	-	-
联讯证券	130,795,421.35	31.11%	1,114,800,000.00	44.61%	-	-
海通证券	37,242,287.88	8.86%	674,000,000.00	26.97%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

4、本基金租用证券公司的上海交易单元为共用交易单元。

11.8 其他重大事件（转型后）

除上述事项外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于长盛基金指数熔断机制实施后基金配套工作安排的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》及本公司网站	2015 年 12 月 31 日
2	关于增加金观诚为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2015 年 12 月 15 日
3	关于增加国信证券为旗下部分开放式基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务的公告	同上	2015 年 12 月 15 日
4	长盛基金管理有限公司关于参加长量基金费率优惠活动并开通转换业务的公告	同上	2015 年 11 月 30 日
5	关于增加盈米财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及费率优惠活动的公告	同上	2015 年 11 月 24 日
6	关于增加凯石财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及费率优惠活动的公告	同上	2015 年 11 月 24 日
7	关于增加富济财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及费率优惠活动的公告	同上	2015 年 11 月 24 日
8	关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定投及转换业务	同上	2015 年 11 月 16 日

	的公告		
9	关于增加民生银行为长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	同上	2015 年 11 月 13 日
10	关于增加招商银行为长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	同上	2015 年 11 月 11 日
11	关于增加工商银行为长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构以及开通基金转换业务并参加个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2015 年 11 月 2 日
12	长盛中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书	同上	2015 年 7 月 1 日
13	长盛中小盘精选混合型证券投资基金托管协议	同上	2015 年 7 月 1 日
14	长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同摘要	同上	2015 年 7 月 1 日
15	长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同	同上	2015 年 7 月 1 日

11.8 其他重大事件（转型前）

除上述事项外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在部分代销机构开	《中国证券报》《上海证券报》《证券时	2015 年 7 月 10 日

	通转换业务的公告	报》及本公司网站	
2	长盛基金管理有限公司关于安信证券开通旗下部分开放式基金定投及转换业务的公告	同上	2015 年 7 月 8 日
3	长盛中小盘精选混合型证券投资基金开放日常申购 赎回 转换及定期定额投资业务的公告	同上	2015 年 7 月 8 日
4	长盛基金管理有限公司关于在直销柜台开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告	同上	2015 年 7 月 7 日
5	关于长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后变更为长盛中小盘精选混合型证券投资基金及相关业务安排的第二次提示性公告	同上	2015 年 7 月 1 日
6	关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2015 年 6 月 30 日
7	关于旗下部分基金参加一路财富和同花顺费率优惠活动的公告	同上	2015 年 6 月 26 日
8	关于长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后变更为长盛中小盘精选混合型证券投资基金及相关业务安排的第一次提示性公告	同上	2015 年 6 月 23 日
9	关于增加汇付金融和增财基金	同上	2015 年 6 月 19 日

	为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠活动的公告		
10	关于增加中经北证和品今财富为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠活动的公告	同上	2015 年 6 月 19 日
11	关于长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后变更为长盛中小盘精选混合型证券投资基金及相关业务安排的公告	同上	2015 年 6 月 19 日
12	关于我公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2015 年 6 月 1 日
13	关于在直销柜台开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告	同上	2015 年 5 月 27 日
14	关于增加中国农业银行为旗下部分开放式基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务的公告	同上	2015 年 5 月 15 日
15	长盛基金管理有限公司关于子公司法定代表人、执行董事及高管变更情况的公告	同上	2015 年 5 月 15 日
16	长盛基金管理有限公司关于新任副总经理的公告	同上	2015 年 4 月 24 日
17	长盛同鑫二号保本混合型证券	同上	2015 年 4 月 20 日

	投资基金 2015 年第 1 季度报告		
18	关于旗下部分基金参加众禄基金费率优惠活动的公告	同上	2015 年 4 月 20 日
19	关于开展网上直销金算盘定期定额计划费率优惠活动的公告	同上	2015 年 4 月 9 日
20	关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2015 年 4 月 1 日
21	关于旗下部分基金参加大连银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2015 年 4 月 1 日
22	长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金 2014 年度报告	同上	2015 年 3 月 28 日
23	长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金 2014 年度报告摘要	同上	2015 年 3 月 28 日
24	长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2015 年 2 月 7 日
25	长盛同鑫二号保本混合型基金招募说明书（更新）	同上	2015 年 2 月 7 日
26	长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	同上	2015 年 1 月 22 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、《长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》；

- 6、《长盛中小盘精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 7、《长盛中小盘精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 8、法律意见书；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 10、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司
2016年3月26日