长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金之长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额上市交易公告书

注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:上海证券交易所
上市时间:2015年6月9日
公告日期:2015年6月4日

一、重要声明与提示

长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、上海证券交易所(以下简称“上交所”)对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本上市交易公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2015年5月7日《证券时报》、《证券日报》和上海证券交易所网站(www.sse.cn)以及长盛基金管理有限公司网站(www.csfunds.com.cn)上的《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”或“本合同”)和《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)。

二、基金概览

1、基金名称:长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金

2、基金类型:股票型

3、基金运作方式:契约型开放式

4、本基金采取分级方式运作,本基金的基金份额包括长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金之基础份额(即“长盛中证申万一带一路份额”)、长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(即“长盛中证申万一带一路A份额”),与长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金之积极收益类份额(即“长盛中证申万一带一路B份额”)。此三类基金份额分配不同的基金代码,所代表的基金资产合并运作。其中,长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额在存续期内始终保持1:1的份额配比不变。

5、本基金的存续期为不定期。

6、长盛中证申万一带一路份额的申购与赎回:投资者可通过场外或场内两种方式对长盛中证申万一带一路份额进行申购与赎回。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和场外代销机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金代销业务资格且符合上海证券交易所风险控制要求的上海证券交易所会员单位,具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额将不接受投资者的申购与赎回。

7、长盛中证申万一带一路份额的跨系统转托管:通过场内、场外方式认购/申购本基金的长盛中证申万一带一路份额持有人可以通过认购/申购本基金的销售机构办理跨系统转托管业务。

8、份额配对转换:份额配对转换是指本基金的场内长盛中证申万一带一路份额与长盛中证申万一带一路A份额、长盛中证申万一带一路B份额之间的配对转换,包括基金份额的分拆和合并两个方面。分拆指基金份额持有人将其持有的长盛中证申万一带一路份额的场内份额按1:1的比例申请转换成长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额的行为;合并指场内基金份额持有人将其持有的长盛中证申万一带一路A份额与长盛中证申万一带一路B份额按1:1的比例申请转换成场内长盛中证申万一带一路份额的行为。

本基金的场内份额可以直接申请分拆与合并,场外份额通过跨系统转托管至场内后方可申请分拆与合并。

9、定期份额折算

在本基金存续期内,每个会计年度(基金合同生效不足六个月的除外)11月份的最后一个交易日,本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。在折算基准日,本基金将按照以下规则进行基金的定期份额折算。在基金份额折算前与折算后,长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额的份额配比保持1:1,长盛中证申万一带一路A份额参考净值调整为1.000元。长盛中证申万一带一路份额和长盛中证申万一带一路A份额按照基金合同规定的份额参考净值计算规则进行计算;对于长盛中证申万一带一路A份额参考净值超出1.000元部分,将折算为场内长盛中证申万一带一路份额。每两份长盛中证申万一带一路份额将按一份长盛中证申万一带一路A份额获得新增长盛中证申万一带一路份额的分配,场内长盛中证申万一带一路份额持有人折算后获得新增场内长盛中证申万一带一路份额,场外长盛中证申万一带一路份额持有人折算后获得新增场外长盛中证申万一带一路份额。

有关定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

10、不定期份额折算

除以上定期份额折算外,本基金还将在以下两种情况下进行不定期份额折算,即:当长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值大于或等于1.500元时;当长盛中证申万一带一路B份额的基金份额参考净值达到或跌破0.250元时。有关不定期份额折算的具体规定请见本基金招募说明书以及相关公告。

11、基金份额总额:截至2015年6月2日,本基金的基金份额总额为4,155,784,758.57份,其中,长盛中证申万一带一路份额3,266,539,610.57份,长盛中证申万一带一路A份额444,622,574.00份,长盛中证申万一带一路B份额444,622,574.00份。

12、长盛中证申万一带一路份额净值为:1.000元(截至2015年6月2日)

13、长盛中证申万一带一路A份额参考净值:1.001元(截至2015年6月2日)

14、长盛中证申万一带一路B份额参考净值:0.999元(截至2015年6月2日)

15、基金管理人:长盛基金管理有限公司

16、基金托管人:中国银行股份有限公司

17、基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前募集情况

1、本基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会证监许可〔2015〕758号

2、发售日期:2015年5月12日至2015年5月26日

3、发售价格:1.000元人民币

4、发售方式:本基金通过场内、场外两种方式公开发售。在基金募集阶段,本基金以同一个基金份额认购代码在上海证券交易所场内和场外代销机构同时募集。

5、发售机构:

(1)场内代销机构

场内代销机构是指具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位(具体名单详见上海证券交易所网站)

(2)场外代销机构

场外将通过基金管理人的直销机构及基金代销机构办理公开发售。代销机构包括中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、申万宏源证券有限公司、中信建投证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、国元证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、江海证券有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(浙江)有限责任公司、中信证券(山东)有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、五矿证券有限公司、德邦证券股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、和讯信息科技有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司、万银财富(北京)基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、一路财富(北京)信息科技有限公司 、上海联泰资产管理有限公司(排名不分先后)。

6、验资机构名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

7、认购资金总额及入账情况:

本次募集期间净认购金额4,154,401,283.91元人民币,该资金已于2015年5月29日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户;认购资金的银行利息共计1,387,150.08元,已折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金帐户。本基金按照每份基金份额1.00元计算,募集期间募集资金及其利息结转的基金份额共计4,155,784,758.57份。募集期间基金管理人的从业人员认购的基金份额共计4,952.30份,占基金总份额比例占0.00%,募集期间基金管理人没有运用固有资金认购本基金。

8、基金备案情况

本基金已于2015年5月29日验资完毕,当日向中国证监会提交验资报告,办理基金备案手续,并于2015年5月29日获得书面确认,本基金基金合同自该日起正式生效。

9、基金合同生效日:2015年5月29日。

10、基金合同生效日的基金总份额:4,155,784,758.57份。

(二)本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所自律监管决定书【2015】234号

2、上市交易日期:2015年6月9日

3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。

4、本次上市的基金份额简称和交易代码:

基础份额简称:一带一路;交易代码:502013

稳健收益类份额简称:一带一A;交易代码:502014

积极收益类份额简称:一带一B;交易代码:502015

5、基金场内申购、赎回简称:一带一路

6、场内申购、赎回代码:502013

投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更销售机构,并予以公告。

7、本次上市交易份额:

长盛中证申万一带一路份额:222,311,289.00份;长盛中证申万一带一路A份额:444,622,574.00份;长盛中证申万一带一路B份额:444,622,574.00份(截至2015年6月2日)

8、基金资产净值的披露:每个工作日的次日公布长盛中证申万一带一路份额净值和长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额的参考净值,并在基金上市交易时间进行净值揭示。

9、未上市交易份额的流通规定:

本基金包括场内份额与场外份额,本次上市的基金份额全部为场内份额。

未上市交易的份额登记在中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下,可以通过跨系统转托管转至中国证券登记结算有限责任公司上海分公司证券登记结算系统持有人上海证券账户下后,在上海证券交易所上市交易。跨系统转托管业务将于2015年6月9日开通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)持有人户数

截至2015年6月2日,本基金份额持有人户数为75961户,平均每户持有的基金份额为54,709.45份;其中,场内基础份额持有户数为8435户,平均每户持有的基金份额为26,355.00份。一带一A份额为8435户,平均每户持有的基金份额为52,711.00份;一带一B份额为8435户,平均每户持有的基金份额为52,711.00份。

(二)持有人结构

截至2015年6月2日,场内机构投资者持有的本次上市交易的一带一A份额5,496,728.00份,占比1.24%;场内个人投资者持有的本次上市交易的场内一带一A份额439,125,846.00份,占比98.76%。

截至2015年6月2日,场内机构投资者持有的本次上市交易的一带一B份额5,496,728.00份,占比1.24%;场内个人投资者持有的本次上市交易的场内一带一B份额439,125,846.00份,占比98.76%。

(三)前十名基金份额持有人的情况

截至2015年6月2日,基础份额前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人姓名/名称(全称)	持有场内基础份额(份)	占场内基础份额比例
1	师瑞学	725,676.00	0.33%
2	张建华	600,016.00	0.27%
3	朴桂花	599,854.00	0.27%
4	周泓	499,845.00	0.22%
5	许天贤	419,857.00	0.19%
6	张平方	400,270.00	0.18%
7	刘孝良	400,218.00	0.18%
8	沈平	400,070.00	0.18%
9	程承	400,070.00	0.18%
10	朱雯黔	400,070.00	0.18%

截至2015年6月2日,一带一A份额前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人姓名/名称(全称)	持有一带一A份额(份)	占一带一A份额比例
1	师瑞学	1,451,352.00	0.33%
2	张建华	1,200,032.00	0.27%
3	朴桂花	1,199,708.00	0.27%
4	周泓	999,690.00	0.22%
5	许天贤	839,713.00	0.19%
6	张平方	800,540.00	0.18%
7	刘孝良	800,436.00	0.18%
8	沈平	800,140.00	0.18%
9	程承	800,140.00	0.18%
10	朱雯黔	800,140.00	0.18%

截至2015年6月2日,一带一B份额前十名场内基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人姓名/名称(全称)	持有一带一B份额(份)	占一带一B份额比例
1	师瑞学	1,451,352.00	0.33%
2	张建华	1,200,032.00	0.27%
3	朴桂花	1,199,708.00	0.27%
4	周泓	999,690.00	0.22%
5	许天贤	839,713.00	0.19%
6	张平方	800,540.00	0.18%
7	刘孝良	800,436.00	0.18%
8	沈平	800,140.00	0.18%
9	程承	800,140.00	0.18%
10	朱雯黔	800,140.00	0.18%

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

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、基本信息

名称:长盛基金管理有限公司

住所:深圳市福田中心区福中三路诺德金融中心主楼10D

办公地址:北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座21层

法定代表人:高新

电话:(010)82019988

传真:(010)82255988

联系人:叶金松

2、经营概况

本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6号文件批准,于1999年3月26日成立,注册资本为人民币18900万元。截至目前,基金管理人股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司占注册资本的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%。截至2015年5月29日,基金管理人共管理三十七只开放式基金和五只社保基金委托资产,同时管理专户理财产品。

公司目前下设二十三个部门、分公司及营销中心和两个全资子公司,分别是:权益投资部、研究部、交易部、国际业务部、社保业务管理部、固定收益部、专户理财部、产品开发部、市场销售总部、电子商务部、北京分公司、郑州分公司、上海分公司、杭州分公司、成都分公司、华南营销中心、业务运营部、信息技术部、财务会计部、人力资源部、总经理办公室、监察稽核部、风险管理部以及长盛基金(香港)有限公司和长盛创富资产管理有限公司。

权益投资部主要负责境内公募基金的投资组合管理;研究部主要负责行业与上市公司研究,投资备选库建立、维护与更新;交易部主要负责完成基金经理、组合经理及投资经理下达的交易指令;国际业务部主要负责QDII产品的投资运作管理及QFII投资顾问服务;社保业务管理部主要负责公司社保组合的投资管理工作;固定收益部主要负责公司固定收益产品的投资管理与研究工作;专户理财部主要负责特定资产管理业务的客户营销和服务、产品开发设计和投资管理工作;产品开发部主要负责基金新产品的开发报批及产品维护工作;市场销售总部主要负责基金销售策略及基金销售计划制订、客户服务、销售渠道管理等;电子商务部主要负责制定及实施公司品牌宣传及市场推广计划;北京分公司、郑州分公司、上海分公司、杭州分公司、成都分公司和华南营销中心主要负责所辖区域的营销策划与基金销售工作;业务运营部主要负责基金核算与估值、开放式基金注册与登记,以及资金清算等工作;信息技术部主要负责公司信息系统的日常运行与维护,以及相关系统的规划与开发等;财务会计部主要负责公司财务管理工作;人力资源部主要负责公司战略及人力资源管理;总经理办公室主要负责公司行政事务的管理;监察稽核部主要负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查;风险管理部主要负责对投资风险的管理与控制。长盛基金(香港)有限公司可开展香港证券及期货事务监察委员会颁发的第四类(就证券提供意见)和第九类(提供资产管理)牌照所允许的业务;长盛创富资产管理有限公司的业务范围为特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务。

截至2015年5月27日,公司共有员工156人,其中具有硕士及以上学历的员工占62%,具有本科学历的员工占35%。研究员和基金经理全部拥有硕士及以上学历,公司员工平均年龄为35岁,平均金融从业年限9年。公司主要业务部门人员全部具有基金从业资格。基金管理人无任何受处罚记录。

3、本基金基金经理

冯雨生先生,1983年11月出生。北京大学金融学硕士,CFA(特许金融分析师)。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。现任同盛证券投资基金基金经理助理,自2011年7月11日起任长盛中证100指数证券投资基金基金经理,自2011年12月20日起兼任长盛沪深300指数证券投资基金(LOF,本基金)基金经理,自2015年4月27日起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,自2015年5月29日起兼任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。

(二)基金托管人

1、基本情况

名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)

住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期:1983年10月31日

注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人:田国立

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号

托管业务部总经理:李爱华

托管部门信息披露联系人:王永民

客服电话:95566

传真:(010)66594942

2、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

3、证券投资基金托管情况

截至2015年3月31日,中国银行已托管328只证券投资基金,其中境内基金303只,QDII基金25只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

(三)基金验资机构

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:北京市东城区东长安街1 号东方广场安永大楼17 层01-12室

办公地址:北京市东城区东长安街1 号东方广场安永大楼17 层01-12室

执行事务合伙人:吴港平

电话:(010)58153000

传真:(010)85188298

经办注册会计师:汤骏、贺耀

联系人:贺耀

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不得从基金财产中列支。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

本基金截至2015年6月2日的资产负债表如下:

资 产	期末数	负债和所有者权益	期末数
资 产:		负 债:	
银行存款	4,154,123,459.44	短期借款	-
结算备付金	-	交易性金融负债	-
存出保证金	-	衍生金融负债	-
交易性金融资产	278,614,110.71	卖出回购金融资产款	-
其中:股票投资	278,614,110.71	应付证券清算款	276,165,221.76
基金投资	-	应付赎回款	-
债券投资	-	应付管理人报酬	227,706.10
资产支持证券投资	-	应付托管费	50,095.34
贵金属投资	-	应付销售服务费	-
衍生金融资产	-	应付交易费用	251,392.81
买入返售金融资产	-	应交税费	-
应收证券清算款	-	应付利息	-
应收利息	332,352.12	应付利润	-
应收股利	-	递延所得税负债	-
应收申购款	-	其他负债	18,900.97
递延所得税资产	-	负债合计	276,713,316.98
其他资产	1,387,150.08	所有者权益:	
		实收基金	4,155,784,758.57
		未分配利润	1,958,996.80
		所有者权益合计	4,157,743,755.37
资产总计	4,434,457,072.35	负债和所有者权益总计	4,434,457,072.35

八、基金投资组合

截至2015年6月2日,本基金的投资组合如下:

(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	278,614,110.71	6.28
	其中:股票	278,614,110.71	6.28
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	4,154,123,459.44	93.68
7	其他资产	1,719,502.20	0.04
8	合计	4,434,457,072.35	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

1、报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	16,970,272.80	0.41
C	制造业	102,857,310.79	2.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	101,282,363.02	2.44
F	批发和零售业	4,951,268.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	52,552,896.10	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	278,614,110.71	6.70

2、报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

(三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1、报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	市值占净值比(%)
601390	中国中铁	2,194,000	42,168,680.00	1.01
601186	中国铁建	987,858	21,920,569.02	0.53
601018	宁波港	1,171,600	15,160,504.00	0.36
600089	特变电工	832,741	15,047,629.87	0.36
601669	中国电建	922,400	14,795,296.00	0.36
601727	上海电气	619,600	14,325,152.00	0.34
601919	中国远洋	990,400	13,845,792.00	0.33
600031	三一重工	981,200	13,059,772.00	0.31
600068	葛洲坝	737,600	10,009,232.00	0.24
600875	东方电气	312,787	9,120,868.92	0.22

2、报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

(五)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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

(六)报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七)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

本基金本报告期末未持有贵金属。

(八)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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

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。

(十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

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。

(十一)投资组合报告附注

1、声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

2、声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

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。

3、其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	332,352.12
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,387,150.08
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,719,502.20

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5、报告期末股票中存在流通受限情况的说明

(1)报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

(2)报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

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。

九、重大事件揭示

无。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、备查文件目录

(一)中国证监会准予长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金注册募集的文件

(二)《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》

(三)《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金托管协议》

(四)《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金招募说明书》

(五)法律意见书

(六)基金管理人业务资格批件和营业执照

(七)基金托管人业务资格批件和营业执照

(八)中国证监会规定的其它文件

以上第(七)项备查文件存放在基金托管人的办公场所,其他文件存放在基金管理人的办公场所。基金投资者在营业时间内可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

风险提示: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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

长盛基金管理有限公司
2015年6月4日

附件:

长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利和义务

(一)基金管理人的权利和义务

本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:

(1)依法募集资金;

(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

(4)销售基金份额;

(5)召集基金份额持有人大会;

(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;

(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;

(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请;

(12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资、融券及转融通业务;

(14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构;

(16)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则;

(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:

(1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2)办理基金备案手续;

(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,确定基金份额申购、赎回的价格;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制季度、半年度和年度基金报告;

(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计帐册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26)建立并保存基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二)基金托管人的权利和义务

本基金的基金托管人为中国银行股份有限公司。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:

(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算;

(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定