上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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
报告送出日期:2015年10月26日

§1 重要提示

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。

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2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛上证市值百强ETF
场内简称	百强ETF
基金主代码	510700
交易代码	510700
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年4月24日
报告期末基金份额总额	4,213,677.00份
投资目标	本基金跟踪投资标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争实现与标的指数表现相一致的长期收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金跟踪标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的90%。 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是:追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。
业绩比较基准	上证市值百强指数
风险收益特征	本基金为被动式投资的股票指数型基金,预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合风险收益特征相近,属于高风险、高收益的基金品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-4,412,706.11
2.本期利润	-5,480,386.38
3.加权平均基金份额本期利润	-0.8358
4.期末基金资产净值	10,276,294.73
5.期末基金份额净值	2.439

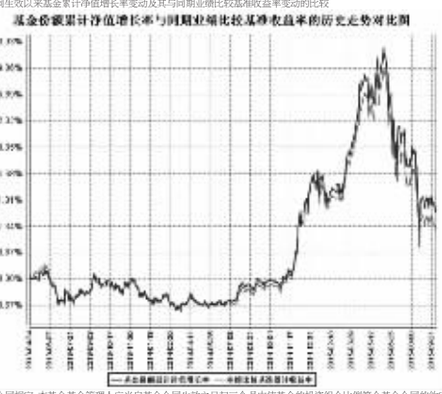
注:1.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.所列数据截止到2015年9月30日。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-25.75%	3.22%	-26.97%	3.30%	1.22%	-0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十七条(二)投资范围、(八)投资禁止行为与限制的有关约定。截止报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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,长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理,长盛中证100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。	2013年4月24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,历任英富恩基金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。现任上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金(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,长盛中小盘精选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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。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。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1 日、3 日、5 日的交易片段进行T 检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易或交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

海外市场,由于中国股票市场大幅下跌和人民币汇率大幅波动而受到全面冲击,美元指数受到美联储加息预期反复而呈现大幅震荡。3季度道琼斯指数下跌-7.58%,纳斯达克下跌-7.35%;欧元区德国DAX指数下跌-11.74%,伦敦富时100指数下跌-7.04%。全球大宗商品价格由于中国的悲观预期而出现大幅下跌,NYMEX原油下跌-23.67%,LME铜下跌-10.6%。

国内市场3季度市场呈现了大幅回落-横盘-大幅回落的特征。清理场外配资和国家队救市的信息主导了市场走势,投资者在多空信息刺激下成为惊弓之鸟,市场波动率处于历史高位,暴涨暴跌的行情多次出现。8月11日的人民币汇率定价机制改革进一步引发了境内外投资者对国内资本市场的恐慌情绪。三季度中公布的宏观经济数据也并不符合预期,反而呈现了加速下滑的态势。目前市场比较有利的情况在于大量的新兴成长股的估值出现了大幅调整,同时市场中的投资者仓位处于较低水平,具有充沛的流动性。在四季度即将召开的五中全会有可能成为诱发市场反弹的重要催化剂,十三五规划相关内容会对新兴产业板块构成向上拉动,有关地方政府大事的相关安排有望改变各级地方政府稳增长政策落实不力的被动局面。

后续我们将会积极把握上述时间窗口带来的高弹性板块的投资机会,通过量化选股策略精选高弹性、盈利能力强的品种在投资组合中予以重点布局,并适当提高整体仓位,在市场向上的时间段尽可能提高收益,待反弹临近结束时,及时获利了结。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.558元,本报告期份额净值增长率为-27.90%,业绩比较基准收益率为-22.46%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 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	10,038,707.45	95.97
	其中:股票	10,038,707.45	95.97
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	405,910.01	3.88
7	其他资产	15,216.74	0.15
8	合计	10,459,834.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按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	40,808.00	0.40
B	采矿业	482,729.50	4.70
C	制造业	2,412,773.80	23.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	346,316.00	3.37
E	建筑业	654,988.00	6.37
F	批发和零售业	82,370.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	195,006.00	1.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	461,676.25	4.49
J	金融业	5,125,140.80	49.87
K	房地产业	216,919.00	2.11
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	19,980.10	0.19
S	综合	-	-
	合计	10,038,707.45	97.69

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.3 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

5.3.1 报告期末按投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	24,400	728,584.00	7.09
2	600036	招商银行	34,000	604,180.00	5.88
3	600016	民生银行	60,820	513,929.00	5.00
4	600000	浦发银行	23,500	390,805.00	3.80
5	601166	兴业银行	23,600	343,616.00	3.34
6	601328	交通银行	40,400	245,632.00	2.39
7	601766	中国中车	18,880	244,873.60	2.38
8	600519	贵州茅台	1,240	235,984.40	2.30
9	600030	中信证券	16,600	225,428.00	2.19
10	601398	工商银行	50,000	216,000.00	2.10

5.3.2 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
注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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
注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1
1、本基金跟踪的标的为上证市值百强指数,配置了上证市值百强指数成分股中国平安。
根据2014年12月8日中国证券监督管理委员会发布对该公司控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》,决定对平安证券给予警告,没收保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2867万元,并处以440万元罚款。本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。
2、本基金跟踪的标的为上证市值百强指数,配置了上证市值百强指数成分股兴业银行。
根据2015年6月9日兴业银行公告"2015年5月中旬,公司南宁分行下辖二级分行北海分行接到北海市公安局通报,该分行前员工苏瑜沙橱个人非法集资已被立案,目前案件在调查阶段。公司南宁以及北海两级分行成立专项调查小组,就其涉及业务进行了全面内部排查,未发现银行资金卷入其中。目前,公司北海分行经营、财务状况与对外服务均正常。"本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。
3、本基金跟踪的标的指数为上证市值百强指数,配置了上证市值百强指数成分股中信证券。
根据2015年1月16日中国证券监督管理委员会2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报,对中信证券采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。 2015年8月25日,公司有几名高级管理人员和员工被公安机关要求协助调查有关问题,调查工作尚在进行之中。2015年9月15日,公司总经理程博明、经纪业务发展与管理委员会运营管理部负责人于新利、信息技术中心汪锦岭等人因涉嫌内幕交易、泄露内幕信息被公安机关依法要求接受调查。本基金做出如下说明:上述事件尚未有最终结论,我们将密切跟踪事件进展,避免潜在风险。

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	26.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	65.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,124.16
8	其他	-
9	合计	15,216.74

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中在在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	碧水源	29,002,951.15	6.11	重大事项停牌
2	601877	正泰电器	23,913,852.33	5.04	重大事项停牌

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	6,213,677.00
报告期期间基金总申购份额	15,000,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	17,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	4,213,677.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于2015年10月12日以现场开会方式在北京召开基金份额持有人大会。会议表决通过了《关于上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金终止上市并终止基金合同有关事项的议案》,根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定,基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效,基金管理人将按照上海证券交易所的业务规则申请百强ETF终止上市等业务,且根据基金份额持有人大会通过的议案及方案说明,本基金从2015年10月14日起进入基金财产清算期。基金管理人将按照《基金合同》约定,组织成立基金财产清算组履行基金财产清算程序,并及时予以公告。本基金进入清算程序后,基金管理人不再接受投资者提出的申购、赎回申请。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
3、《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
4、《上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;
5、法律意见书;
6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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。

9.3 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
2015年10月26日

长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30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
报告送出日期:2015年10月26日

§1 重要提示

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。

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2015年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛生态环境混合
基金主代码	000598
交易代码	000598
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月10日
报告期末基金份额总额	336,860,614.09份
投资目标	本基金主要投资于从事或受益于生态环境主题的上市公司,通过精选个股和风险控制,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势,运用科学严谨、规范化的资产配置方法,灵活配置国内生态环境主题行业的上市公司股票和债券,谋求基金资产的长期稳定增长。本基金对生态环境主题上市公司股票的界定是:公司主营业务中从事与生态环境主题相关的业务,或者直接或间接受益于生态环境投资主题所带来的较高回报,相关股票具体包括:节能技术和装备;节能产品、节能建材和节能服务;环保技术和设备;环保服务及环保受益相关行业;清洁生产技术和清洁产品;资源回收及能环利用产业;与有效利用土地等自然资源,形成生态与经济良性循环主题相关的行业以及城市园林等相关行业上市公司。本基金将结合定性与定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队"自下而上"的主动选股能力,选择生态环境主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
业绩比较基准	50%*中证环保产业指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-15,094,419.45
2.本期利润	-205,906,079.46
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5006
4.期末基金资产净值	474,691,748.12
5.期末基金份额净值	1.409

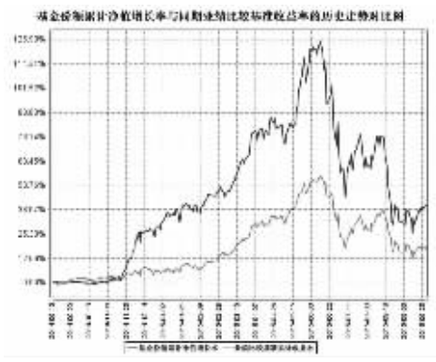
注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.所列数据截止到2015年9月30日。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-23.30%	3.33%	-13.28%	2.01%	-10.02%	1.32%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘旭明	本基金基金经理,长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。	2014年9月11日	-	13年	男,1977年5月出生,中国国籍。清华大学管理学硕士。曾任中信证券研究部首席分析师、国信证券经济研究所首席分析师。2013年7月加入长盛基金管理有限公司。现任研究部总监,现任长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。

注:1.上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;
2."证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。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。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1 日、3 日、5 日的交易片段进行T 检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易或交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

6月份股市泡沫破裂后的下行行情延续至3季度。在国内外经济、制度等多重因素影响下,上证综指下滑见底后企稳。8月底以来市场恐慌情绪缓解,超跌反弹及结构性行情特点明显。经济环境不容乐观,但稳增长措施不断出台;货币政策宽松依旧,财政政策逐渐成为焦点;改革步伐继续推进;国内外环境趋稳;A股市场将震荡调整,结构性行情特点依旧,自下而上选股将更为重要。

受本基金主题投资方向对银行等板块投资的限制,2季度以来市场大幅波动对基金运作影响比较大。在市场大幅下跌过程中,本基金在合理控制仓位的同时,配置股价相对合理的板块和个股,减少业绩回撤。市场企稳后,结合震荡市的特点,本基金注重择时。目上而下配置行业注重结合长期成长空间和短期催化剂,优选新能源汽车、环保等板块。自下而上精选个股,减少持仓股票数量,深入挖掘内在价值。同时加强前瞻性布局新的板块,获取更多超额收益。因此3季度本基金业绩好于沪深300指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.409元,本报告期份额净值增长率为-23.30%%,同期本基金业绩比较基准收益率为-13.28%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 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	394,071,743.47	82.54
	其中:股票	394,071,743.47	82.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	75,152,672.69	15.74
8	其他资产	8,197,167.83	1.72
9	合计	477,421,583.99	100.00

5.2 报告期末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	-	-
C	制造业	286,071,212.14	60.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,616,416.42	10.24
E	建筑业	8,861,400.00	1.87
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	18,970,667.76	4.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,549,096.00	0.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	29,002,951.15	6.11
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	394,071,743.47	83.02

5.3 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002085	万丰奥威	1,435,507	41,773,253.70	8.80
2	002236	大华股份	958,106	32,393,563.86	6.82
3	300070	碧水源	663,835	29,002,951.15	6.11
4	000049	德赛电池	750,274	28,570,433.92	6.02
5	002454	松芝股份	1,883,650	24,638,142.00	5.19
6	601877	正泰电器	1,168,239	23,913,852.33	5.04
7	002202	金风科技	1,760,867	23,789,313.17	5.01
8	600617	国新能源	1,485,359	23,394,404.25	4.93
9	002309	中利科技	1,527,166	21,807,930.48	4.59
10	601126	四方股份	738,358	19,514,801.94	4.11

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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
注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1
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。

5.11.2
基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,370,407.09
2	应收证券清算款	6,719,662.73
3	应收股利	-
4	应收利息	13,259.47
5	应收申购款	93,838.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,197,167.83

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300070	碧水源	29,002,951.15	6.11	重大事项停牌
2	601877	正泰电器	23,913,852.33	5.04	重大事项停牌

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	563,609,547.26
报告期期间基金总申购份额	78,106,712.67
减:报告期期间基金总赎回份额	304,855,645.84
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	336,860,614.09

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会核准基金募集的文件;
2、《长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
5、法律意见书;
6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 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。

8.3 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