长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金

2015 第四季度 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
报告送出日期:2016年1月20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2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛电子信息主题混合
基金主代码	000063
交易代码	000063
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月10日
报告期末基金份额总额	1,283,238,786.30份
投资目标	本基金的投资目标在于把握中国电子信息产业发展带来的投资机会,分享中国电子信息产业相关上市公司的持续投资收益,在严格控制投资风险的基础上,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	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,灵活配置电子信息主题的上市公司股票和债券,谋求基金资产的长期稳定增长。1、资产配置策略:本基金主要考虑宏观经济指标、微观经济指标、市场指标以及政策因素,分析市场风险,提高基金收益率。2、电子信息主题相关行业和公司的界定:本基金管理人届定的电子信息主题相关行业和公司主要包括三类:1)电子信息相关行业和公司;2)通信设备和软件相关行业和公司;3)传媒相关行业和公司。3、股票投资策略:本基金的股票投资策略,分为股票池的初步构建、细分领域培植和个股精选三个方面。
业绩比较基准	50%×中证TMT产业主题指数收益率+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,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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	87,264,093.11
2.本期利润	227,044,574.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.2918
4.期末基金资产净值	3,248,285,443.36
5.期末基金份额净值	2.531

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12月31日。

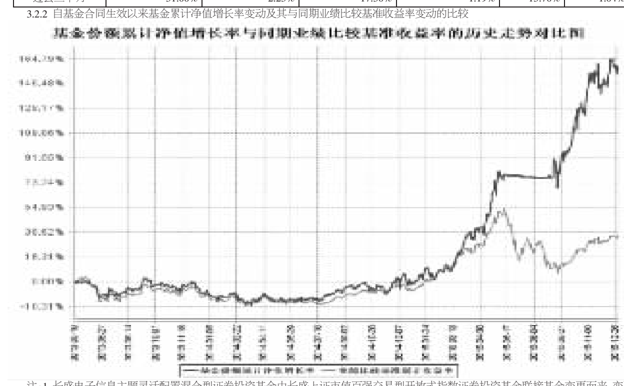
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	31.00%	2.23%	17.30%	1.19%	13.70%	1.04%

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:1、长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金由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变更而来,变更日期为2014年7月3日。

2、按照本基金合同规定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起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十四条(二)投资范围、(八)投资禁止行为与限制的有关约定。截止本报告期末,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。	2014年7月3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(本基金)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。
杨衡	本基金基金经理,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,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理,社保组合组合经理。	2015年6月18日	-	8年	男,1975年10月出生,中国国籍。中国科学院数学与系统科学研究院博士。2007年7月进入长盛基金管理公司,历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理、长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。现任社保组合组合经理,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,长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛世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和利益输送的行为。

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成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

本基金为电子信息主题基金,投资目标主要是电子、信息、传媒以及收益于信息技术进步驱动业绩增长的相关行业公司,基本反映电子信息的行业市场主题投资收益和风险特征。

2015年四季度市场呈现反弹回升走势,特别是电子信息主题板块也同时表现较好。由于本基金在报告期内通过精选个股并适当提高仓位,有效地获取了市场投资收益,使得本基金年度收益水平一直处于市场同类基金的前列。本基金在基金合同允许的主题投资范围内,最大程度投资并跟踪分享电子信息主题及相关股票市值增长的红利。在报告期内操作中,基金管理人严格遵守基金合同,按照主题投资所定义的范围内精选个股,并进行灵活配置主题板块,尽可能实现电子信息主题投资的目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为2.531元,本报告期份额净值增长率为31.00%,同期业绩比较基准收益率为17.30%。

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	3,014,084,921.25	88.39
	其中:股票	3,014,084,921.25	88.39
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	350,007,720.37	10.26
8	其他资产	45,812,272.44	1.34
9	合计	3,409,904,914.06	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	861,000.00	0.03
C	制造业	1,713,012,266.93	52.74
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	43,258,486.98	1.33
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	884,880,315.46	27.24
J	金融业	22,002,200.00	0.68
K	房地产业	22,473,000.00	0.69
L	租赁和商务服务业	29,142,544.20	0.90
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	31,796,191.44	0.98
R	文化、体育和娱乐业	227,010,140.89	6.99
S	综合	39,648,775.35	1.22
	合计	3,014,084,921.25	92.79

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	600487	亨通光电	8,880,781	141,559,649.14	4.36
2	300383	光环新网	1,989,630	110,842,287.30	3.41
3	600845	宝信软件	1,588,581	91,851,753.42	2.83
4	300291	华录百纳	1,887,841	67,207,139.60	2.07
5	000938	紫光股份	680,317	66,929,586.46	2.06
6	300207	欣旺达	2,282,534	64,139,205.40	1.97
7	002179	中航光电	1,680,959	63,809,203.64	1.96
8	002049	同方国芯	1,000,000	60,150,000.00	1.85
9	000997	新大陆	2,287,966	57,931,299.12	1.78
10	002292	奥飞动漫	1,088,017	56,261,359.07	1.73

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
注: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
注: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
本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未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	1,423,113.90
2	应收证券清算款	5,453,503.87
3	应收股利	-
4	应收利息	78,027.15
5	应收申购款	38,857,627.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,812,272.44

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	002049	同方国芯	60,150,000.00	1.85	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	134,908,830.58
报告期期间基金总申购份额	1,904,224,605.15
减:报告期期间基金总赎回份额	755,894,649.43
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	1,283,238,786.30

§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、中国证监会《关于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份额持有人大会决议备案的回函》;
3、《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
4、《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
5、《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
6、法律意见书;
7、基金管理人业务资格批件、营业执照;
8、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。

长盛基金管理有限公司
2016年1月20日

长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

2015 第四季度 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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛国企改革混合
基金主代码	001239
交易代码	001239
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月4日
报告期末基金份额总额	2,973,749,932.59份
投资目标	本基金的投资目标在于把握中国国企改革所蕴含的投资机会,分享国企改革带给上市公司的投资收益,在严格控制投资风险的基础上,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	(一)大类资产配置 在大类资产配置中,本基金将主要考虑宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素,动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。 (二)国企改革主题上市公司的界定 本基金投资的国企改革主题公司,主要分为两类: 一是直接或间接受益于已经公告的国企改革方案(含预案,下同)的上市公司。国企改革方案包括但不限于资产重组方案、股权激励方案及纳入国有资本投资运营平台方案等。该类上市公司包括通过改革将使经营状况和盈利能力获得提升的国有企业,参与国有企业改革并使经营状况和盈利能力获得提升的上市公司,以及其他在国企改革进程中获得发展机遇或利润增长点的上市公司。 二是处于国企改革的重点区域、行业,且改革预期较确定的国有企业,或与上述国有企业有较大业务关联的上市公司。 (三)股票投资策略 本基金将考察改革对央企和地方国企不同的影响、改革对各个行业的不同影响,筛选出具有投资机会的上市公司股票,构建并动态调整国企改革主题股票精选池。通过对内在价值、相对价值、收购价值等方面的研究,而筛选出估值水平相对合理或低估的上市公司股票,并本着审慎精选的原则,根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%
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	中国农业银行股份有限公司

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-34,707,038.95
2.本期利润	347,800,576.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.1124
4.期末基金资产净值	1,913,905,318.64
5.期末基金份额净值	0.644

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12月31日。

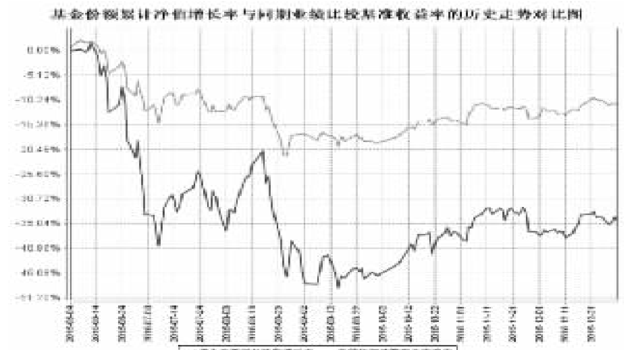
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	20.37%	2.18%	9.46%	0.83%	10.91%	1.35%

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:1、本基金合同生效日为2015年6月4日,截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,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十二条(二)投资范围、(四)投资限制的有关约定。截止本报告期末,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		
田间	本基金基金经理,长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。	2015年6月4日	-	7年	女,1978年11月出生,中国国籍。中央财经大学经济学硕士。2008年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任行业研究员,基金经理助理、同盛证券投资基金基金经理等职务。现任长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛国企改革主题灵活配置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。

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和利益输送的行为。

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成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

2015年四季度以来,国内经济有企稳迹象,但在需求端仍面临着较大的压力。流动性方面,货币政策整体持续放松,人民币贷款增速和M2增速保持平稳。海外经济中,美国经济复苏迹象显现,日本及欧洲国家复苏步伐缓慢,新兴经济体国家加快结构调整。

四季度的资本市场在经历了三季度激烈的去杠杆、清配资、挤泡沫、反复震荡的过程后,同时伴随着资金面小增量行情的到来,市场风险偏好在四季度出现了一定的回升,资本市场也相应出现了持续一个季度的反弹行情。其中以计算机、传媒、通信、电子等行业为反弹龙头,交织着网络安全、互联网金融、体育娱乐、文化教育、虚拟现实、量子通信、无人驾驶、汽车电子、军工电子等一系列新兴题材作为催化剂引领市场,期间伴随着来自券商和地产行业的阶段性脉冲式行情。

长盛国企改革基金在四季度主要从四个维度(央企-地方国企-试点集团-行业龙头)布局了国企改革主题,在主题之外阶段性参与了新能源、娱乐传媒、电子信息等方向的投资机会。在四季度市场反弹过程中取得了一定的收益。

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0.644元,本报告期份额净值增长率为20.37%,业绩比较基准收益率为9.46%。

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	1,695,445,851.44	87.52
	其中:股票	1,695,445,851.44	87.52
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	214,538,720.27	11.07
8	其他资产	27,186,725.20	1.40
9	合计	1,937,171,296.91	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	3,723,081.60	0.19
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,045,386,460.92	54.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,598,607.00	1.02
E	建筑业	28,061,714.10	1.47
F	批发和零售业	154,241,389.65	8.06
G	交通运输、仓储和邮政业	59,392,566.96	3.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	95,899,713.93	5.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	136,390,411.13	7.13
L	租赁和商务服务业	7,841,799.60	0.41
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	144,910,106.55	7.57
S	综合	-	-
	合计	1,695,445,851.44	88.59

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	000068	*ST华赛	4,475,484	56,704,382.28	2.96
2	002460	赣锋锂业	823,700	51,835,441.00	2.71
3	300065	海兰信	1,238,288	47,302,601.60	2.47
4	002292	奥飞动漫	892,200	46,135,662.00	2.41
5	002583	海能达	3,658,809	45,698,524.41	2.39
6	002407	多氟多	589,990	44,992,637.40	2.35
7	002074	国轩高科	1,139,163	42,262,947.30	2.21
8	300291	华录百纳	1,175,060	41,832,136.00	2.19
9	000705	浙江震元	2,219,648	41,640,596.48	2.18
10	300336	新文化	971,377	40,797,834.00	2.13

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
多氟多化工股份有限公司(以下简称"公司")2015年7月22日公告:中国证券监督管理委员会河南监管局(以下简称"河南证监局")对公司下达行政监管措施决定书,分别为对董事长李世江、总经理侯红军、董事会秘书陈相举、财务总监程立静的《关于对李世江、侯红军、陈相举、程立静实施监管谈话措施的决定》(〔2015〕19号)和对公司的《关于对多氟多化工股份有限公司实施出具警示函措施的决定》(〔2015〕20号)。本基金做出如下说明:多氟多是国内锂电池产业链上最优秀的六氟磷酸锂供应商,公司设立焦作新能源公司和收购红星电源,切入电池生产及整车产业环节。新能源汽车受国家产业政策扶持,符合节能环保发展方向。公司已与新大洋公司签订动力电池供应合同,和金龙客车公司达成战略合作协议。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、信息披露等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。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。

除上述情况外,本基金报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未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股票。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,242,329.29
2	应收证券清算款	20,349,635.79
3	应收股利	-
4	应收利息	103,739.41
5	应收申购款	491,020.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,186,725.20

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	300336	新文化	40,797,834.00	2.13	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,分项之和与和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	3,212,489,970.87
报告期期间基金总申购份额	109,669,875.40
减:报告期期间基金总赎回份额	348,409,913.68
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	2,973,749,932.59

§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、《长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛国企改革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。

长盛基金管理有限公司
2016年1月20日

长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金

2015 第四季度 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:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛中证证券公司分级		
场内简称	券商分级		
基金主代码	502053		
交易代码	502053		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年8月13日		
报告期末基金份额总额	103,902,923.67份		
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证全指证券公司指数的有效跟踪。		
投资策略	1、股票投资策略 本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合,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(如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等)导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。 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0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 2、债券组合管理策略 基于流动性管理的需要,本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债,债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。 3、金融衍生工具投资策略 在法律法规许可时,本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以控制并降低投资组合风险、提高投资效率,降低调仓成本与跟踪误差,从而更好地实现本基金的投资目标。 4、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。		
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,由于采取了基金份额分级的结构设计,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
下属分级基金简称	长盛中证证券公司分级A	长盛中证证券公司分级B	长盛中证证券公司分级
下属分级场内简称	券商A	券商B	券商分级
下属分级基金交易代码	502054	502055	502053
下属分级基金报告期末基金份额总额	27,381,036.00份	27,381,036.00份	49,140,851.67份
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定	高风险、高预期收益	较高风险、较高预期收益

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	6,502,598.75
2.本期利润	17,520,305.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.1823
4.期末基金资产净值	129,675,439.27
5.期末基金份额净值	1.248

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12月31日。

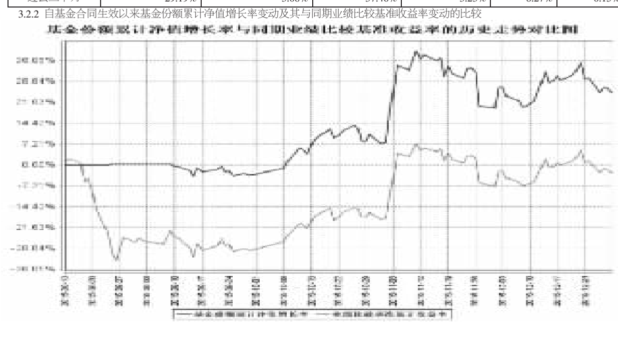
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	29.19%	3.08%	37.46%	3.23%	-8.27%	-0.15%

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



注:1、本基金合同生效日为2015年8月13日,截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为85%以上,其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的80%,现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%-10%,其中每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证投资不高于基金资产净值的3%。

§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		
冯雨生	本基金基金经理,长盛中证100指数证券投资基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理。	2015年8月13日	-	8年	男,1983年11月出生,中国国籍。北京大学金融学硕士。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。现任长盛中证100指数证券投资基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理,长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金(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。

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和利益输送的行为。

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成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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度股票市场整体大幅上涨,智能穿戴、创投、传感器和芯片国产化概念板块涨幅居前,沪港通、自贸区和国资改革概念板块涨幅较小。行业上,计算机、通信和房地产行业涨幅靠前,钢铁、交运和国防军工跑输市场。风格上,小盘成长股大幅跑赢大盘价值股。

在操作中,我们严格遵守基金合同,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

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1.248元,本报告期份额净值增长率为29.19%,同期业绩比较基准增长率为37.46%。本报告期内日均跟踪误差为0.0967%,年度化跟踪误差为1.5289%。

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	121,572,535.48	86.93
	其中:股票	121,572,535.48	86.93
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	13,979,346.53	10.00
7	其他资产	4,292,048.31	3.07
8	合计	139,843,930.32	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	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
J	金融业	121,572,535.48	93.75
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	121,572,535.48	93.75

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前十名股票投资明细
5.3.1 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	601688	华泰证券	522,960	10,312,771.20	7.95
2	000776	广发证券	469,700	9,135,665.00	7.05
3	600030	中信证券	470,877	9,111,469.95	7.03
4	000166	申万宏源	751,800	8,051,778.00	6.21
5	600837	海通证券	506,600	8,014,412.00	6.18
6	600999	招商证券	359,140	7,793,338.00	6.01
7	601377	兴业证券	679,561	7,475,171.00	5.76
8	000783	长江证券	502,900	6,246,018.00	4.82
9	601901	方正证券	650,619	6,245,942.40	4.82
10	002673	西部证券	176,000	5,792,160.00	4.47

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

(一)本基金跟踪的标的指数为中证申万证券行业指数,配置了中证申万证券行业指数成分股华泰证券。

2015年9月10日,华泰证券收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》(处罚字〔2015〕72号),公司因未按要求采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。对华泰证券责令改正,给予警告,没收违法所得18,235,275.00元,并处以54,705,825.00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。

(二)本基金跟踪的标的指数为中证申万证券行业指数,配置了中证申万证券行业指数成分股广发证券。

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。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。

(三)本基金跟踪的标的指数为中证申万证券行业指数,配置了中证申万证券行业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。

(四)本基金跟踪的标的指数为中证申万证券行业指数,配置了中证申万证券行业指数成分股海通证券。

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,对海通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。2015年9月10日,海通证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书《处罚字〔2015〕73号》,海通证券涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案,对海通证券责令改正,给予警告,没收违法所得28,653,000元,并处以85,959,000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。

(五)本基金跟踪的标的指数为中证申万证券行业指数,配置了中证申万证券行业指数成分股招商证券。

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,对招商证券股份有限公司采取责令限期改正的行政监管措施。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。

(六)本基金跟踪的标的指数为中证申万证券行业指数,配置了中证申万证券行业指数成分股长江证券。

证监会于5月6日对长江证券股份有限公司(以下简称长江证券)相关研究报告的制作、审批和发布等情况进行了合规性核查。从检查情况看,媒体转载内容来源于5月4日长江证券发布的题为《证成交可上1.4万亿,创业板已达巅峰——从交易成本看当前市场系列之二》的研究报告。检查中发现,长江证券未与转载机构签订协议,未明确转载责任,致使转载机构篡改了研究报告标题;研报报送审核人员不符合公司内部规定,未能严格执行其内部管理制度。上述行为反映出公司内部控制制度未能有效执行,并违反了证监会《发布证券研究报告暂行规定》第二十一条"证券公司、证券投资咨询机构授权其他机构刊载或者转发证券研究报告或者摘要,应当与相关机构作出协议约定,明确刊载或者转发责任"之规定。根据《发布证券研究报告暂行规定》第二十二条的规定,证监会对长江证券采取了出具警示函的行政监管措施。本基金做出如下说明:长江证券是中国优秀的证券公司之一,基本面良好。基于相关研究,本基金判断,这一处罚对长江证券无实质影响。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。

(七)本基金跟踪的标的指数为中证申万证券行业指数,配置了中证申万证券行业指数成分股方正证券。

公司于2015年7月14日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(稽证调查字0335号)。因公司涉嫌未披露控股股东与其他股东间关联关系等信息披露违法违规,中国证监会根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,决定对公司立案调查。因涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为,公司被中国证券监督管理委员会立案调查。9月10日,公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》(处罚字〔2015〕74号),中国证监会拟对公司及相关员工做出相关行政处罚。2015年9月9日,公司全资子公司中国民族证券有限责任公司收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(京调查字15062号)。因调查工作需要,根据证券、基金、期货法律法规的有关规定,中国证监会决定就20.5亿元款项事项对民族证券立案调查。本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩暂不构成重大影响。但我们将紧密跟踪上述案件进展,避免重大风险。

(八)本基金跟踪的标的指数为中证申万证券行业指数,配置了中证申万证券行业指数成分股申万宏源。

申万宏源集团股份有限公司收到所属子公司申万宏源证券有限公司报告,申万宏源证券于2015年11月6日收到中国证券监督管理委员会行政监管措施决定书《关于对申万宏源证券有限公司采取暂停新开证券账户1个月措施的决定》。本基金做出如下说明:申万宏源集团是中国最大、最优秀的证券公司之一,综合实力强,本次处罚对公司的影响较小。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。

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	121,984.57
2	应收证券清算款	3,741,197.78
3	应收股利	-
4	应收利息	5,336.26
5	应收申购款	423,529.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,292,048.31

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处于转股期的可转换债券。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
5.11.5.1 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

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	601377	兴业证券	7,475,171.00	5.76	重大事项停牌

5.11.5.2 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
注: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。
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

项目	长盛中证证券公司分级A	长盛中证证券公司分级B	长盛中证证券公司分级
报告期期初基金份额总额	1,912,286.00	1,912,286.00	35,488,328.13
报告期期间基金总申购份额	-	-	234,248,825.73
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	169,658,802.19
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	25,468,750.00	25,468,750.00	-50,937,500.00
报告期期末基金份额总额	27,381,036.00	27,381,036.00	49,140,851.67

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§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、《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》;
3、《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金托管协议》;
4、《长盛中证全指证券公司指数分级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。

长盛基金管理有限公司
2016年1月20日