# 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

## 2016 第一季度 报告

2016年3月31日

**基金管理人：长盛基金管理有限公司**
**基金托管人：中国工商银行股份有限公司**
**报告送出日期：2016年4月22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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月21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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 长盛同益成长回报混合（LOF） |
| 场内简称 | 长盛同益 |
| 基金主代码 | 160812 |
| 交易代码 | 160812 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年4月4日 |
| 报告期末基金份额总额 | 173,817,325.08份 |
| 投资目标 | 通过自上而下筛选增长预期良好或景气复苏的行业，结合挖掘目标行业的上市公司基本面，自下而上精选个股，为投资者实现资产长期增值，力争获得绝对回报。 |
| 投资策略 | 本基金将通过深入分析上述指标与因素，动态调整基金资产在股票、股指期货、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。<br>股票投资策略上，本基金将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，采用定性和定量相结合的方式，以深入的基本面研究为基础，结合数据挖掘技术，密切跟踪市场景气变化，挖掘具有快速成长预期，且估值相对较低的个股进行投资，并通过对股票投资机会的精细操作，审慎选择投资时机，力争获取正回报。本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。<br>本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资，利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，在市场向下带动净值走低时，通过股指期货快速降低投资组合的仓位，从而调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特性；并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时，通过股指期货快速提高投资组合的仓位，从而提高基金资产收益。本基金的权证投资是以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。 |
| 业绩比较基准 | 50%*沪深300指数收益率+50%*中证综合债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |

§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（2016年1月1日 - 2016年3月31日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -19,045,448.78 |
| 2.本期利润 | -52,438,155.95 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.2984 |
| 4.期末基金资产净值 | 242,009,516.71 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.392 |

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2016年3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 | -17.54% | 2.29% | -6.17% | 1.22% | -11.37% | 1.07% |

3.2.2 自基金转型以来基金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、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同益证券投资基金转型而来，转型日期为2014年4月4日（即基金合同生效日）。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6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十二部分"二、投资范围"、"四、投资限制"的有关约定。

§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 | | |
| 刘旭明 | 本基金基金经理，长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，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，研究部总监。 | 2015年4月27日 | - | 14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.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 报告期内基金投资策略和运作分析

年初本基金合理控制仓位，较为有限地避免1月份市场深度调整。2月以后结合市场震荡及板块风格变化，适当增减仓位获取一定超额收益。在有效调整仓位的同时，注重对持仓结构的优化。在经济环境不稳，熊市震荡期间，注重目下而上挖掘个股价值，及时跟踪公司动态。个别2015年年初弹劾的重仓股因为估值问题对本期业绩影响较大。

4.5 报告期内基金的业绩表现

全报告期末，本基金份额净值为1.392元，本报告期份额净值增长率为-17.54%，同期业绩比较基准收益率为-6.17%。

4.6 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 | 106,076,335.72 | 43.00 |
| | 其中：股票 | 106,076,335.72 | 43.00 |
| 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 | 140,338,781.07 | 56.89 |
| 8 | 其他资产 | 275,563.74 | 0.11 |
| 9 | 合计 | 246,690,680.53 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 61,405,784.64 | 25.37 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 15,288,719.40 | 6.32 |
| E | 建筑业 | 36,234.48 | 0.01 |
| 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 | 13,726,203.20 | 5.67 |
| 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 | 15,619,394.00 | 6.45 |
| 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 | 106,076,335.72 | 43.83 |

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金报告期内未持有沪港通投资股票。

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

| 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 | 002236 | 大华股份 | 664,768 | 23,958,238.72 | 9.90 |
| 2 | 002085 | 万丰奥威 | 639,321 | 22,785,400.44 | 9.42 |
| 3 | 300070 | 碧水源 | 400,600 | 15,619,394.00 | 6.45 |
| 4 | 600406 | 国电南瑞 | 928,763 | 13,374,187.20 | 5.53 |
| 5 | 600617 | 国新能源 | 697,676 | 9,997,697.08 | 4.13 |
| 6 | 000400 | 许继电气 | 365,986 | 5,295,817.42 | 2.19 |
| 7 | 600969 | 郴电国际 | 333,607 | 5,291,007.02 | 2.19 |
| 8 | 000625 | 长安汽车 | 158,700 | 2,502,699.00 | 1.03 |
| 9 | 601126 | 四方股份 | 250,916 | 2,458,976.80 | 1.02 |
| 10 | 600198 | 大唐电信 | 143,000 | 2,399,540.00 | 0.99 |

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

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，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 | 156,379.46 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 28,220.73 |
| 5 | 应收申购款 | 90,963.55 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 275,563.74 |

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存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末无流通受限情况的说明

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 | 176,446,496.92 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,951,420.21 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 5,580,592.05 |
| 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 | 173,817,325.08 |

§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、中国证券监督管理委员关于核准同智证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复；
3、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
4、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
5、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）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4月22日

# 长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

## 2016 第一季度 报告

2016年3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4月22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4月21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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 长盛同智优势混合（LOF） |
| 场内简称 | 长盛同智 |
| 基金主代码 | 160805 |
| 交易代码 | 160805 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007年1月5日 |
| 报告期末基金份额总额 | 935,130,377.69份 |
| 投资目标 | 主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司，所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。 |
| 投资策略 | 本基金为主动管理的混合型基金，对各类资产采取适度灵活的资产配置，主要选股思路是采用自上而下的路径，投资策略上偏重选股能力的发挥。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是较高预期收益-较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。 |
| 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（2016年1月1日 - 2016年3月31日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -199,013,055.93 |
| 2.本期利润 | -197,507,715.86 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.2132 |
| 4.期末基金资产净值 | 829,332,279.53 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.8869 |

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2016年3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 | -18.18% | 1.84% | -8.41% | 1.58% | -9.77% | 0.26% |

3.2.2 自基金转型以来基金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、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为2007年1月5日。
2、按基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起6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十五条（二）投资范围、（六）投资限制的有关约定。截止报告期内，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 | | |
| 吴博文 | 本基金基金经理，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，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同合定价策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 | 2016年1月6日 | - | 8年 | 男，1983年6月出生，中国国籍，毕业于北京大学，金融学硕士。历任富德兄弟证券股份有限公司分析师助理、鹏扬证券股份有限公司分析师助理、浙安基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。2015年8月加入长盛基金管理有限公司，现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF.本基金）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、长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理、长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 王宁 | 本基金基金经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理，社保组合组合经理，权益投资部总监，公司副总经理。 | 2012年7月20日 | 2016年1月6日 | 18年 | 男，1971年10月出生，中国国籍，毕业于北京大学光华管理学院，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理、兴业基金经理等职务，2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理，长盛动态精选证券投资基金基金经理，长盛同庆可分离交易股票型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，长盛同庆中证800指数分级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，权益投资部总监，社保组合组合经理，现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF.本基金）基金经理，长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。自2016年1月6日起不再担任长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF.本基金）基金经理。 |
| 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基金经理。 | 2014年10月14日 | 2016年1月6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，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.本基金）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，长盛同盛成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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.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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年一季度我国的货币政策继续延续去年的宽松政策，但逐渐呈现出边际效用递减的态势；美联储在15年12月份首次加息，开启了新一轮加息周期，未来我国面临通胀和货币币值压力的双重压力，流动性可能在今年出现拐点，这是未来市场走向的最核心因素。今年一季度我们的操作比较谨慎，在一月份增持了一些原油化工类周期股，继而在3月份增持了一些中大市值成长股，总体仓位较轻，在3月份市场的反弹中暂时落后。

我们判断二季度整体市场将比较稳定，进入5月份可能面临6月份美联储年内第一次加息的时点，是个重要的时间窗口。未来我们仍然整体保持谨慎，仓位中性，选取在市场中最有价值的一批大市值品种进行均衡配置，希望在震荡市中取得超越市场的阿尔法收益。我们整体看好人工智能，新能源汽车，生物医药，高端装备制造等领域。

4.5 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0.8869元，本报告期份额净值增长率为-18.18%，同期本基金业绩比较基准收益率为-8.41%。

4.6 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 | 440,406,811.93 | 50.26 |
| | 其中：股票 | 440,406,811.93 | 50.26 |
| 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 | 433,991,501.56 | 49.53 |
| 8 | 其他资产 | 1,832,938.86 | 0.21 |
| 9 | 合计 | 876,231,252.35 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 317,409,206.09 | 38.27 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 36,234.48 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 638,400.00 | 0.08 |
| 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 | 57,248,553.26 | 6.90 |
| J | 金融业 | 24,789,933.37 | 2.99 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 18,080,184.10 | 2.18 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 124.60 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 132,779.52 | 0.02 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 896,409.92 | 0.11 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | 21,174,986.59 | 2.55 |
| | 合计 | 440,406,811.93 | 53.10 |

5.2.2 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。

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 | 600804 | 鹏博士 | 1,221,940 | 25,941,786.20 | 3.13 |
| 2 | 002701 | 奥瑞金 | 1,036,856 | 25,299,286.40 | 3.05 |
| 3 | 600498 | 烽火通信 | 1,002,863 | 25,232,033.08 | 3.04 |
| 4 | 002508 | 老板电器 | 545,162 | 25,072,000.38 | 3.02 |
| 5 | 601336 | 新华保险 | 611,041 | 24,789,933.37 | 2.99 |
| 6 | 600398 | 海澜之家 | 2,135,801 | 24,583,069.51 | 2.96 |
| 7 | 000034 | 深信泰丰 | 1,017,539 | 21,174,986.59 | 2.55 |
| 8 | 002074 | 国轩高科 | 574,238 | 21,091,761.74 | 2.54 |
| 9 | 600487 | 亨通光电 | 1,606,650 | 18,765,672.00 | 2.26 |
| 10 | 603019 | 中科曙光 | 245,726 | 16,989,495.64 | 2.05 |

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 | 1,723,446.28 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 89,057.11 |
| 5 | 应收申购款 | 20,435.47 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,832,938.86 |

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 | 000034 | 深信泰丰 | 21,174,986.59 | 2.55 | 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 | 884,183,871.53 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 63,207,667.43 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 12,261,161.27 |
| 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 | 935,130,377.69 |

§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、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
3、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
4、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）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4月22日

# 长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金

## 2016 第一季度 报告

2016年3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4月22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4月21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2016年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 长盛养老健康混合 |
| 基金主代码 | 000684 |
| 交易代码 | 000684 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年11月25日 |
| 报告期末基金份额总额 | 108,456,507.45份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于养老健康产业的上市公司股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 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，灵活配置国内养老健康产业的上市公司股票和债券，谋求基金资产的长期稳定增长。本基金对养老健康产业上市公司股票的界定是：公司主营业务中从事与养老健康产业相关的业务，或者直接或间接受益于养老健康产业所带来的较高回报。具体包括：养老产业链，如养老地产，老年医疗护理，养老消费，养老金融，健康产业链，如变假地产，