长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛战略新兴产业混合	
基金主代码	080008	
交易代码	080008	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年10月26日	
报告期末基金份额总额	626,697,289.05份	
投资目标	重点关注国家战略性新兴产业发展过程中带来的投资机会,分享中国经济发展的长期收益,力争为投资者创造长期稳定的投资回报。	
投资策略	(1)本基金采用"自上而下"的战略资产配置体系,通过对宏观基本面及证券市场两个层面的因素定性、定量地分析,动态调整基金资产在各类资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。(2)本基金将战略性新兴产业相关股票和债券分别纳入战略性新兴产业股票库和债券库,投资于战略性新兴产业的股票及债券比例不低于本基金非现金基金资产的80%。(3)战略新兴产业的行业配置上,本基金将深入分析判断各子行业的行业景气状况、产业政策变化、行业生命周期,结合行业可投资的规模和相对估值水平,适时调整各子行业的配置比例。	
业绩比较基准	50%*中证新兴产业指数+50%*中证综合债券指数	
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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长盛战略新兴产业混合A	长盛战略新兴产业混合C
下属分级基金的交易代码	080008	001834
报告期末下属分级基金的份额总额	626,697,289.05份	0份

§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4月1日 — 2016年6月30日)	
	长盛战略新兴产业混合A	长盛战略新兴产业混合C
1. 本期已实现收益	2,936,255.91	75,871.37
2. 本期利润	399,299.45	−640,878.75
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0006	−0.0064
4. 期末基金资产净值	1,145,194,034.22	0.00
5. 期末基金份额净值	1.827	0.000

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6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

长盛战略新兴产业混合A

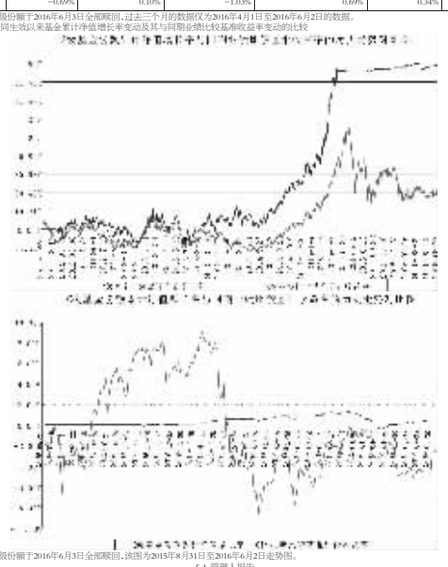
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①−③	②−④
过去三个月	0.00%	0.09%	−0.44%	0.70%	0.44%	−0.61%

长盛战略新兴产业混合C

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	−0.69%	0.10%	−1.03%	0.69%	0.34%	−0.59%

注:长盛战略C级份额于2016年6月3日全部赎回,过去三个月的数据仅为2016年4月1日至2016年6月2日的数据。

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:长盛战略C级份额于2016年6月3日全部赎回,该图为2015年8月31日至2016年6月2日走势图。

§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,长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金经理。	2015年5月14日	−	9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,历任美国摩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(本基金)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,长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金经理。
杨阑	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	−	9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,博士后,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(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》及其各项实施细则、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 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

二季度市场整体窄幅波动,但结构性机会较多,热点不断,市场不乏赚钱效应。上证综指下跌2.47%,创业板下跌0.47%。进入二季度,市场前期偏慢的货币放水逐步得到证伪,通胀的担忧逐步缓解,周期股的表现略显疲弱,市场开始寻找新的主题,锂电池、OLED、芯片国产化、物联网、次新股等主题表现较为活跃,带动市场情绪,政策方面加强借壳重组监管等一系列政策更有利于市场的长期稳定,整体来看,市场并没有集中、统一的逻辑可以带动市场持续向上,投资者风险偏好波动较大,给投资带来一定难度。

4月本基金控制仓位处于中低水平,有限地避免4月及5月初的市场调整,根据市场情况,在5月下旬提高仓位,获取一定收益。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,注重自下而上挖掘个股价值,及时跟踪公司动态,因而基金业绩基本与市场同步。

4.5 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1.827元,本报告期份额净值增长率为0%,同期业绩比较基准增长率为−0.44%,截止2016年6月2日(C级份额全部赎回前的最后一天)长盛战略新兴产业混合C的份额净值为1.005元,本报告期份额净值增长率为−0.69%,同期业绩比较基准增长率为−1.03%。

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	31,869,663.78	2.78
	其中:股票	31,869,663.78	2.78
2	基金投资	−	−
3	固定收益投资	595,305,206.20	51.91
	其中:债券	595,305,206.20	51.91
	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	300,000,000.00	26.16
	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	30,891,131.51	2.69
8	其他资产	188,676,233.06	16.45
9	合计	1,146,742,234.55	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	191,361.36	0.02
B	采矿业	125,444.82	0.01
C	制造业	14,089,166.66	1.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	−	−
E	建筑业	714,221.01	0.06
F	批发和零售业	529,784.00	0.05
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	6,783,854.08	0.59
J	金融业	5,745,843.00	0.50
K	房地产业	−	−
L	租赁和商务服务业	366,067.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	136,807.85	0.01
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	3,187,114.00	0.28
	合计	31,869,663.78	2.78

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	300383	光环新网	128,187	4,858,287.30	0.42
2	601988	中国银行	1,245,100	3,996,771.00	0.35
3	600783	鲁信创投	127,400	2,753,114.00	0.24
4	600487	亨通光电	214,900	2,703,442.00	0.24
5	002104	恒宝股份	125,700	2,066,508.00	0.18
6	002296	辉煌科技	100,400	1,822,260.00	0.16
7	600845	宝信软件	71,800	1,601,858.00	0.14
8	603508	XD思维列	13,605	1,352,473.05	0.12
9	601689	拓普集团	39,900	1,314,705.00	0.11
10	000001	平安银行	120,000	1,044,000.00	0.09

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	−	−
2	央行票据	−	−
3	金融债券	183,453,000.00	16.02
	其中:政策性金融债	183,453,000.00	16.02
4	企业债券	338,093,206.20	29.52
5	企业短期融资券	20,034,000.00	1.75
6	中期票据	53,725,000.00	4.69
7	可转债(可交换债)	−	−
8	同业存单	−	−
9	其他	−	−
10	合计	595,305,206.20	51.98

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150218	15国开18	1,100,000	113,465,000.00	9.91
2	101462013	14铝国贸MTN001	500,000	53,725,000.00	4.69
3	1380221	13无国资债	600,000	50,160,000.00	4.38
4	160401	16农发01	500,000	49,990,000.00	4.37
5	1480269	14长交投债01	400,000	44,020,000.00	3.84

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	82,186.36
2	应收证券清算款	178,090,185.31
3	应收股利	−
4	应收利息	10,442,274.26
5	应收申购款	61,587.13
6	其他应收款	−
7	待摊费用	−
8	其他	−
9	合计	188,676,233.06

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:本基金本报告期末前十名股票中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

报告期期初基金份额总额	630,929,679.27
报告期期间基金总申购份额	1,971,465.02
减:报告期期间基金总赎回份额	6,203,855.24
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	626,697,289.05

§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.《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《长盛基金管理人开展基金投资指数型证券投资基金互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理的函》;

4.《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

5.《长盛战略新兴产业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.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和/或基金托管人的办公地点。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或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7月20日

长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6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:2016年7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7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2016年4月1日起至6月30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	106,585,633.02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,如度假地产、运动健身;健康食品,医疗保健,健康金融等。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,选择养老健康产业概念的、具有长期持续增长能力的公司。
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(2016年4月1日 — 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	−1,044,349.60
2.本期利润	−2,639,741.09
3.加权平均基金份额本期利润	−0.0245
4.期末基金资产净值	128,895,266.49
5.期末基金份额净值	1.209

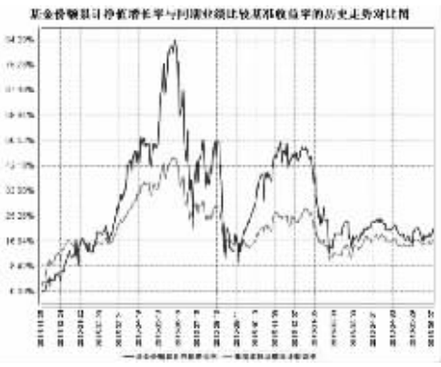
注:1.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.所列数据截止到2016年6月30日。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	−2.03%	0.79%	−0.72%	0.51%	−1.31%	0.28%

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		
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,长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金(本基金)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11月25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(本基金)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》及其各项实施细则、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 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

二季度市场整体窄幅波动,但结构性机会较多,热点不断,市场不乏赚钱效应。上证综指下跌2.47%,创业板下跌0.47%。进入二季度,市场前期偏慢的货币放水逐步得到证伪,通胀的担忧逐步缓解,周期股的表现略显疲弱,市场开始寻找新的主题,锂电池、OLED、芯片国产化、物联网、次新股等主题表现较为活跃,带动市场情绪,政策方面加强借壳重组监管等一系列政策更有利于市场的长期稳定,整体来看,市场并没有集中、统一的逻辑可以带动市场持续向上,投资者风险偏好波动较大,给投资带来一定难度。

4月本基金控制仓位处于中低水平,有限地避免4月及5月初的市场调整,根据市场情况,在5月下旬提高仓位,获取一定收益。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,注重自下而上挖掘个股价值,及时跟踪公司动态,因而基金业绩基本与市场同步。

4.5 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1.209元,本报告期份额净值增长率为−2.03%,同期业绩比较基准增长率为−0.72%。

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	80,619,430.48	62.19
	其中:股票	80,619,430.48	62.19
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	48,461,031.00	37.38
8	其他资产	557,534.13	0.43
9	合计	129,637,995.61	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	2,584,738.00	2.01
B	采矿业	−	−
C	制造业	61,007,086.80	47.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,008,766.10	1.56
E	建筑业	63,283.00	0.05
F	批发和零售业	1,288,770.00	1.00
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	22,534.85	0.02
J	金融业	−	−
K	房地产业	−	−
L	租赁和商务服务业	1,312,677.00	1.02
M	科学研究和技术服务业	14,887.80	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	8,982,594.72	6.97
O	居民服务、修理和其他服务业	−	−
P	教育	−	−
Q	卫生和社会工作	156,708.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	3,177,384.21	2.47
S	综合	−	−
	合计	80,619,430.48	62.55

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	002085	万丰奥威	748,114	12,860,079.66	9.98
2	002236	大华股份	886,718	11,616,005.80	9.01
3	002415	海康威视	487,500	10,461,750.00	8.12
4	300070	碧水源	603,669	8,982,594.72	6.97
5	600703	三安光电	190,400	3,802,288.00	2.95
6	300267	尔康制药	252,800	3,620,096.00	2.81
7	600887	伊利股份	209,680	3,495,365.60	2.71
8	300148	天舟文化	208,901	3,177,384.21	2.47
9	600104	上汽集团	131,000	2,657,990.00	2.06
10	002454	松芝股份	140,000	2,545,200.00	1.97

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:本基金本报告期末无国债期货投资。

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	87,505.89
2	应收证券清算款	439,551.07
3	应收股利	−
4	应收利息	10,325.65
5	应收申购款	20,151.52
6	其他应收款	−
7	待摊费用	−
8	其他	−
9	合计	557,534.13

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

注:本基金本报告期末前十名股票中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

报告期期初基金份额总额	108,456,507.45
报告期期间基金总申购份额	2,828,186.88
减:报告期期间基金总赎回份额	4,699,061.31
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	106,585,633.02

§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.《长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4.《长盛养老健康产业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和/或基金托管人的办公地址和/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7月20日

长盛新兴成长主题灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6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:2016年7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