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
送出日期：2016年3月26日

长盛积极配置债券型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2015年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛积极配置债券
基金主代码	080003
交易代码	080003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月8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
报告期末基金份额总额	87,822,929.08份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	本基金为积极投资策略的债券型基金，不同与传统债券型基金的投资策略特点，本基金在债券类资产配置上更强调积极主动管理。在债券类资产配置上，本基金通过积极投资配置组对收益率较高的企业债、公司债、可转换债、可分离交易可转债、资产支持证券等创新债券品种，并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会，以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上，通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票，来获取股票市场的积极收益。此外，本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666，010-62350088	010-67595096
传真		010-82255988	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	28,702,754.89	25,668,980.48	31,434,100.22
本期利润	10,124,698.76	57,786,738.24	1,587,001.09
加权平均基金份额本期利润	0.1046	0.2497	0.0037
本期基金份额净值增长率	5.21%	30.49%	-1.41%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.4240	0.1607	0.0105
期末基金资产净值	126,020,991.91	168,300,306.67	344,675,469.28
期末基金份额净值	1.4349	1.3639	1.0452

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、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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即12月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	2.47%	0.31%	4.13%	0.17%	-1.66%	0.14%
过去六个月	2.30%	0.33%	3.38%	0.27%	-1.08%	0.06%
过去一年	5.21%	0.58%	9.16%	0.26%	-3.95%	0.32%
过去三年	35.34%	0.49%	23.10%	0.20%	12.24%	0.29%
过去五年	30.19%	0.42%	31.34%	0.18%	-1.15%	0.24%
自基金合同生效起至今	66.21%	0.40%	49.33%	0.20%	16.88%	0.20%

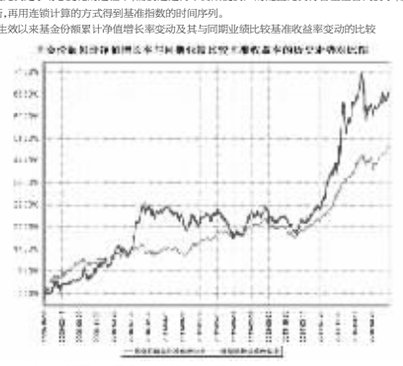
注：本基金业绩比较基准：中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

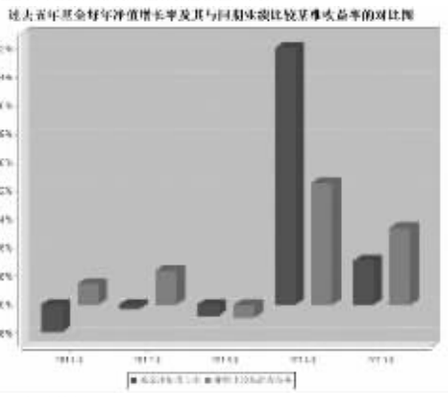
沪深300指数是由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。沪深300指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照90%、10%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2015年度、2014年度、2013年度会计期间未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于1999年3月26日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币18900万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）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%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格，截至2015年12月31日，基金管理人共管理四十二只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外QFII基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张帆	本基金基金经理，长盛纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛添利宝货币市场基金基金经理，长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。	2014年10月24日	-	8年	男，1983年1月出生，中国国籍。华中科技大学硕士。曾在长江证券股份有限公司从事债券研究、债券投资工作。2012年4月加入长盛基金管理有限公司，曾任非信用研究员，长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理等职务。现任长盛纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛添利宝货币市场基金基金经理，长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金（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。

3、报经中国证券投资基金业协会同意，自2016年1月20日起，马文祥同志兼任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，张帆同志不再担任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对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

1、报告期内行情回顾

回顾2015年，经济增速有所下滑，通胀处于较低水平；货币政策方面，央行进行了多次降准降息，资金面呈现持续宽松局面，债券市场总体上仍处于牛市进程中。尤其是下半年以来，受股市连续大跌及新股发行暂停等因素影响，大规模资金由权益市场流入债券市场，各债券品种收益率均呈现趋势性下行走势。利率债方面，收益率曲线陡峭化下行，10年与1年国开债期限利差由年初的12bp走阔至年末的73bp，十年国债和十年国开债收益率均下行至2009年初的历史低位；信用债方面，收益率曲线整体下行，受信用风险加速暴露及流动性等因素影响，高评级信用债收益率下行幅度明显大于中低评级信用债。

货币市场方面，受央行公开市场操作引导利率下行及降准降息等宽松货币政策影响，市场流动性总体保持宽松局面，各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率总体大幅下行，期末处于较低水平。

权益资产方面，股市整体呈现持续上涨后快速下跌的过山车行情。年初至六月中旬，增量资金加速流入股市，券商两融规模不断创新高，市场成交量巨幅放大，A股市场呈现快速上涨的牛市行情，上证综指最高上涨至5178点；但六月中旬到九月，受杠杆配资监管的加强、新股发行加速以及恐慌情绪等因素影响，A股市场连续大幅下挫，上证综指最低下探至2850点，市场成交量大幅萎缩；十月至年末，股市呈现震荡反弹走势。可转债方面，年初至6月初，可转债弹性有所下降，跟随正股上涨能力降低；6月中旬以来，存量可转债呈快速下跌后震荡调整走势。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金坚持稳健操作思路，在信用风险可控的前提下重点配置中短期信用债，保持组合流动性，适度参与利率品种的交易性机会。同时，把握权益市场机会，优选股票和可转债，择机进行波段操作，提升组合收益；虽然在股市大跌前我们已降低了权益资产的投资比重，但市场的巨幅调整仍然对组合业绩造成较大影响。

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1.4349元，本报告期份额净值增长率为5.21%，同期业绩比较基准增长率为9.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年，在经济调结构背景下，受去产能、工业品价格低迷、内外需不足等多重因素影响，国内经济仍面临一定下行压力；另外，相对宽松的货币政策、较低的通胀水平以及旺盛的配置需求预计将继续为债市提供有利支撑。但同时也要密切关注财政政策加码、人民币贬值压力对货币政策的制约、美联储加息预期、信用风险爆发、利率债供给冲击等风险因素的影响。

在流动性相对充裕和配置需求较强的局面下，我们依然看好中短期债券的表现；对于长期债券品种，总体持谨慎乐观态度，需要在波动中寻找机会，这种波段性的操作机会可能在于人民币汇率暂稳、稳增长压力和地方政府债务置换压力下货币政策的继续放松，以及稳增长效果低于预期和经济增速进一步下行的预期。信用债配置方面，我们将严控信用风险，规避产能过剩行业的低评级信用债以及财政实力偏弱地区的城投债。同时，我们也将密切关注权益市场变化以及转债个券可能存在的条款博弈机会，择机进行波段操作，以提升组合收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六条中对基金利润分配原则的约定，本基金2015年未实施利润分配。

本基金截至2015年12月31日，期末可供分配利润为37,236,784.58元，期末未分配利润为38,198,062.83元，其中，未分配利润已实现部分为37,236,784.58元，未分配利润未实现部分为961,278.25元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师陈玲、沈兆杰于2016年3月22日对本基金2015年的资产负债表、2015年度利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2016)第20227号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛积极配置债券型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产：		
银行存款	3,838,791.77	4,895,287.02
结算备付金	2,272,480.34	4,634,546.96
存出保证金	30,450.45	45,478.04
交易性金融资产	135,318,746.82	270,002,706.60
其中：股票投资	17,173,226.93	32,842,752.69
基金投资	-	-
债券投资	118,145,519.89	237,159,953.91
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	17,037,978.61	4,386,452.63
应收利息	4,094,870.52	5,962,094.12
应收股利	-	-
应收申购款	11,706.65	22,778.70
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	162,605,025.16	289,949,344.07
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	22,000,000.00	116,499,929.70
应付证券清算款	13,002,572.90	1,854,079.70
应付赎回款	138,191.00	1,548,840.94
应付管理人报酬	81,175.39	110,112.62
应付托管费	21,646.77	29,363.38
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	64,369.86	108,652.34
应交税费	1,201,336.86	1,201,336.86
应付利息	2,163.52	4,134.54
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	72,576.95	292,587.32
负债合计	36,584,033.25	121,649,037.40
所有者权益：		
实收基金	87,822,929.08	123,395,000.69
未分配利润	38,198,062.83	44,905,305.98
所有者权益合计	126,020,991.91	168,300,306.67
负债和所有者权益总计	162,605,025.16	289,949,344.07

注：报告截止日2015年12月31日，基金份额净值1.4349元，基金份额总额87,822,929.08份。

7.2 利润表

会计主体：长盛积极配置债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	12,969,835.46	68,583,126.41
1.利息收入	8,921,630.85	21,678,644.32
其中：存款利息收入	129,370.39	218,040.26
债券利息收入	8,792,260.46	21,446,689.88
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	13,914.18
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	22,593,465.28	14,775,923.09
其中：股票投资收益	5,373,814.22	6,619,981.49
基金投资收益	-	-
债券投资收益	17,052,344.89	8,019,781.80
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	167,306.17	136,159.80
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-18,578,056.13	32,117,757.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	32,795.46	10,801.24
减：二、费用	2,845,136.70	10,796,388.17
1. 管理人报酬	1,025,698.15	1,943,136.40
2. 托管费	273,519.43	518,169.74
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	415,172.63	507,101.36
5. 利息支出	946,354.44	7,454,278.39
其中：卖出回购金融资产支出	946,354.44	7,454,278.39
6. 其他费用	184,392.05	373,702.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	10,124,698.76	57,786,738.24
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	10,124,698.76	57,786,738.24

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛积极配置债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	123,395,000.69	44,905,305.98	168,300,306.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,124,698.76	10,124,698.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-35,572,071.61	-16,831,941.91	-52,404,013.52
其中：1.基金申购款	67,504,355.20	25,758,499.48	93,262,854.68
2.基金赎回款	-103,076,426.81	-42,590,441.39	-145,666,868.20
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	87,822,929.08	38,198,062.83	126,020,991.91

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	329,764,048.21	14,911,421.07	344,675,469.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	57,786,738.24	57,786,738.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-206,369,047.52	-27,792,853.33	-234,161,900.85
其中：1.基金申购款	16,375,594.04	2,838,785.63	19,214,379.67
2.基金赎回款	-222,744,641.56	-30,631,638.96	-253,376,280.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	123,395,000.69	44,905,305.98	168,300,306.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____周兵_____ _____杨思乐_____ _____龚珉_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛积极配置债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第984号《关于核准长盛积极配置债券型证券投资基金募集的批复》核准，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,361,279,05.21元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第144号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》于2008年10月8日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,362,144,547.24份基金份额，其中认购资金利息折合865,495.03份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，其中投资于债券等固定收益类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%；投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的20%，其中，权证投资的比例不超过基金资产的3%；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%。本基金的业绩比较基准为：中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率× 10%。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于2016年3月22日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)，中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛积极配置债券型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限责任公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金公司”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,025,698.15	1,943,136.40
其中：支付销售机构的客户维护费	158,993.92	357,581.57

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费＝前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	273,519.43	518,169.74

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
基金合同生效日（2008年10月8日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	50,001,240.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	50,001,240.00
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,838,791.77	52,053.76	4,895,287.02	57,064.90

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（ 2015年12月31日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015年12月23日	2016年1月8日	新债未上市	100.00	100.00	810	81,000.00	81,000.00	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600271	航天信息	2015年10月12日	重大事项停牌	71.47	-	-	15,000	1,016,374.00	1,072,050.00	-
000748	长城信息	2015年6月18日	重大事项停牌	24.68	2016年3月10日	31.39	5,000	193,500.00	123,400.00	-
000901	航天科技	2015年8月19日	重大事项停牌	52.88	2016年2月18日	47.59	5,000	267,550.00	264,400.00	-
300104	乐视网	2015年12月7日	重大事项停牌	60.17	-	-	5,000	256,998.00	300,850.00	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	1,734,422.00	1,760,700.00	-

注：本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复