长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2015 年度报告摘要

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
送出日期:2016年3月26日

§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,安永华明会计师事务所(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	长盛同盛成长优选混合
场内简称	长盛同盛
基金主代码	160813
交易代码	160813
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月5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
报告期末基金份额总额	362,797,879.26份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014-12-26

2.2 基金产品说明

投资目标	聚焦经济转型、产业升级、模式创新、政策热点等板块,通过"自上而下优选行业"和"自下而上精选个股"相结合,重点布局未来增长预期高、成长确定性大的上市公司,为投资者实现资产长期增值。
投资策略	本基金将首先参考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围,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。 股票投资上,本基金将充分发挥基金管理人研究和投资的团队能力,以深入扎实的研究为基础,聚焦经济转型、产业升级、模式创新、政策热点等板块,将"自上而下优选行业"与"自下而上精选个股"相结合,将定性分析与定量分析相结合,寻找和布局未来增长预期良好、估值合理的上市公司,并审慎选择投资时机和介入时点,为投资者实现资产长期增值。 债券投资上,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。 股指期货投资上,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。
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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

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	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

§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11月5日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	576,685,167.12	490,726,501.13
本期利润	108,412,772.88	562,561,191.32
加权平均基金份额本期利润	0.1259	0.1546
本期基金份额净值增长率	0.94%	15.11%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.2743	0.1261
期末基金资产净值	390,225,916.39	4,042,163,060.04
期末基金份额净值	1.076	1.066

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	31.38%	2.29%	9.46%	0.83%	21.92%	1.46%
过去六个月	-14.74%	3.49%	-5.46%	1.34%	-9.28%	2.15%
过去一年	0.94%	2.96%	8.83%	1.24%	-7.89%	1.72%
自基金转型至今	16.19%	2.83%	29.78%	1.21%	-13.59%	1.62%

注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

本基金业绩比较基准:50%*沪深300指数收益率+50%*中证综合债指数收益率

基准指数的构建考虑了三个原则:

1.公允性。本基金为混合型基金,在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后,选定沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准;债券组合的业绩基准则采用中证全债指数。目前沪深300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有较好的市场代表性,用为衡量本基金业绩的基准较为合适。

2.可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响,本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%;根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数,可使业绩比较更具有合理性。

3.再平衡。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50%,50%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 自基金转型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.长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)由同盛证券投资基金转型而来,转型日期为2014年11月5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。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十三部分(二)投资范围、(四)投资限制的有关约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金转型以来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

注:长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)合同于2014年11月5日生效,合同生效当年按照实际存续期计算,未按整个自然年度折算。

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11月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日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		
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11月5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,本基金)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。
冯雨生	本基金基金经理助理。	2014年11月5日	2015年6月16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。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等职务。自2015年6月16日起不再担任长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理。

注:1.上表基金经理及基金经理助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2月17日起,吴博文司志兼任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,田间司志不再担任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。

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。

本报告期内,本基金管理人根据《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。

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

2015年,国内宏观经济增速逐步放缓,无论是供给端还是需求端均面临较大的下行压力。全年流动性保持持续宽松,人民币贷款增速和M2增速保持平稳增长。海外经济中,美国经济持续复苏,日本经济复苏中有反复,欧洲国家温和复苏,新兴经济体加快结构调整。

2015年1-5月,A股市场在"杠杆牛、改革牛、转型牛"的推动下,演绎出了波澜壮阔的上涨行情。在"周期搭台成长唱戏"的结构下,一系列概念板块快速交替上涨,其中以互联网+、中国制造2025、工业4.0、新能源汽车、一带一路、国企改革等主题带动下的计算机、通信、传媒、电子、电力设备、机械等行业成为市场领涨行业。传统行业则在上涨的后期出现了一定程度的估值修复行情。进入6月,基于1)监管层去杠杆和调控场外配资的决心,2)市场对央行宽松货币政策阶段性降温的猜测,3)IPO密集出台的抽水效应,4)市场过度上涨后有自身调整需要等因素,市场恐慌情绪极度蔓延,上证综指在去杠杆的连续负反馈下持续快速暴跌,大小盘股泥沙俱下,杠杆市极涨极跌的典型特征表现得淋漓尽致。整个三季度,伴随着一系列政府救市组合拳的推出,资本市场经历了去杠杆、消配资、挤泡沫的反复而激烈的震荡过程,进入三季度末,风险偏好逐步修复,市场逐步企稳。四季度伴随着资金的小增量行情,A股市场迎来了近一个季度的反弹行情。其中以网络安全、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,计算机、传媒、通信、电子等行业为反弹龙头,期间交织着券商和地产的股性脉冲行情。

基金同盛在上半年主要布局了工业4.0、新能源、国企改革、移动医疗等主题方向,在指数上涨过程中一度取得了较好的收益。而在6-8月的系统性下跌中依然未能避免受到损失。在下半年主要布局了新能源、娱乐传媒、电子信息等方向,阶段性布局了券商和地产的博弈行情。在市场反弹过程中取得了较好的收益。未来在投资策略和风格上,坚持自上而下行业轮动与自下而上精选个股相结合,兼顾长期景气与中短期催化,成长与蓝筹的均衡,以避免短期剧烈素造成风格切换带来的净值波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,长盛同盛成长优选混合(LOF)份额净值为1.076元,本报告期份额净值增长率为0.94%,同期业绩比较基准增长率为8.83%。

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,国内经济内生性下行压力仍然较大,尽管存在资产荒与货币相对宽松,但市场风险偏好难以提升,进入股市的中长期资金有限。大小非解禁、注册制加快推出即其他扩容手段(如战略新兴板、中概股回归)均将导致股票供给增加,其中新兴行业的高估值将面临分化。

鉴于市场不确定性,2016年将重点关注结构性机会,兼顾均衡。重点关注十三五规划的投资机会、国企改革进一步落地形成的投资机会、供给侧改革带来的传统行业收缩和结构改善、新一轮的微刺激所带来的投资机会、新兴行业中符合政策导向的新题材。在操作上会在集中和分散、成长和蓝筹之间寻求均衡。

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十七条中对基金利润分配原则的约定,本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至2015年12月31日,期末可供分配利润为99,529,198.16元,其中:未分配收益已实现部分为189,916,093.85元,未分配收益未实现部分为-90,386,895.69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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师汤骏、马剑英于2016年3月24日对本基金2015年12月31日的资产负债表、2015年度利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了安永华明(2016)审字第60468688_A11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:长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

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	36,161,346.20	1,186,611,911.02
结算备付金	2,596,328.12	25,841,610.58
存出保证金	704,629.17	2,815,573.78
交易性金融资产	355,491,305.91	3,050,432,083.45
其中:股票投资	355,491,305.91	3,050,432,083.45
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	3,652,510.06	140,817,254.35
应收利息	9,972.61	105,021.42
应收股利	-	-
应收申购款	19,970.04	1,861,201.20
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	398,636,062.11	4,408,484,655.80
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	-	-
应付证券清算款	3,010,452.54	116,532,119.18
应付赎回款	766,529.55	226,783,934.52
应付管理人报酬	499,300.51	5,683,022.66
应付托管费	83,216.75	947,170.41
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,706,410.17	13,048,777.08
应交税费	1,823,891.66	1,823,891.66
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	520,344.54	1,502,680.25
负债合计	8,410,145.72	366,321,595.76
所有者权益:		
实收基金	290,696,718.23	3,038,456,128.96
未分配利润	99,529,198.16	1,003,706,931.08
所有者权益合计	390,225,916.39	4,042,163,060.04
负债和所有者权益总计	398,636,062.11	4,408,484,655.80

注:(1) 报告截止日2015年12月31日,基金份额净值为人民币1.076元,基金份额总额为362,797,879.26份。

(2) 自2014年11月5日起,由《同盛证券投资基金合同》修订而成的《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效,上年度可比期间自2014年11月5日至2014年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年11月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	152,595,720.79	593,147,566.10
1.利息收入	1,224,438.69	727,703.85
其中:存款利息收入	1,224,438.69	455,184.22
债券利息收入	-	272,519.63
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	614,877,113.18	519,820,596.77
其中:股票投资收益	608,807,395.64	513,579,390.84
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	5,158,705.89
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	6,069,717.54	1,082,500.04
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-468,272,394.24	71,834,690.19
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	4,766,563.16	764,575.29
减:二、费用	44,182,947.91	30,586,374.78
1. 管理人报酬	14,807,723.21	9,373,695.78
2. 托管费	2,467,953.86	1,562,282.59
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	26,480,275.67	19,538,278.39
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	426,995.17	112,118.02
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	108,412,772.88	562,561,191.32
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	108,412,772.88	562,561,191.32

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

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)	3,038,456,128.96	1,003,706,931.08	4,042,163,060.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	108,412,772.88	108,412,772.88
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)	-2,747,759,410.73	-1,012,590,505.80	-3,760,349,916.53
其中:1.基金申购款	39,633,095.41	13,941,618.44	53,574,713.85
2.基金赎回款	-2,787,392,506.14	-1,026,532,124.24	-3,813,924,630.38
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)	290,696,718.23	99,529,198.16	390,225,916.39

项目	上年度可比期间 2014年11月5日(基金合同生效日)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)	3,000,000,000.00	467,153,706.99	3,467,153,706.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	562,561,191.32	562,561,191.32
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)	38,456,128.96	-26,007,967.23	12,448,161.73
其中:1.基金申购款	498,713,341.64	124,483,554.76	623,196,896.40
2.基金赎回款	-460,257,212.68	-150,491,521.99	-610,748,734.67
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)	3,038,456,128.96	1,003,706,931.08	4,042,163,060.04

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

长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)由同盛证券投资基金(以下简称"基金同盛")转型而成。根据基金同盛的基金份额持有人大会审议通过的《关于同盛证券投资基金转型有关事项的议案》,并经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于准予同盛证券投资基金更注册的批复》(证监许可[2014]998号)及深圳证券交易所《终止上市通知书》(深证上[2014]406号)的同意,基金同盛于2014年11月4日进行终止上市权益登记,2014年11月5日终止上市。自基金同盛终止上市之日起,基金同盛转型为长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金"),由《同盛证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金为契约型上市开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》、《关于同盛证券投资基金转换所得长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金份额折算的公告》等相关规定,基金管理人确定2014年12月3日作为基金份额折算基准日。经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算基准日基金份额净值为人民币1.247592463元,折算基准日本基金份额净值采用四舍五入的方法保留到小数点后第9位。本基金管理人按照1:1.247592463的折算比例对基金同盛进行了基金份额折算,折算后的基金份额净值为人民币1.000元,折算后本基金的基金份额数采用截尾的方式保留到整数,所产生的误差归入基金资产。折算前基金同盛份额总额为30亿份,折算后基金份额总额为3,743,977,389.00份。本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于2014年12月4日对折算后的份额进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自2014年11月17日至2014年11月28日期间开放集中申购,集中申购款扣除申购费用后的净申购金额为人民币609,423,974.44元,折合609,423,974.44份基金份额;申购资金在集中申购期间产生的利息为人民币88,606.90元,折合88,606.90份基金份额;集中申购期间收到的实收基金共计人民币609,512,581.34元,折合609,512,581.34份基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定),如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%;其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具;权证投资占基金资产净值的0%-3%;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以后,现金或到期日在一年期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:50%*沪深300指数收益率+50%*中证综合债指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号(年度报告的内容与格式)、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号(会计报表附注的编制及披露)、《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)》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<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>的通知》的规定,自2015年3月24日起,交易所上市交易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)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况(2014年度:无)。

7.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2016年3月22日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.4 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	355,491,305.91	89.18
	其中:股票	355,491,305.91	89.18
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	38,757,674.32	9.72
7	其他各项资产	4,387,081.88	1.10
8	合计	398,636,062.11	100.00

8.5 期末按行业分类的股票投资组合

8.5.9 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	215,288,622.23	55.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,726,755.00	1.47
F	批发和零售业	26,275,150.30	6.73
G	交通运输、仓储和邮政业	3,424,046.01	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,575,532.05	7.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	15,329,996.31	3.93
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	8,883,496.62	2.28
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	41,927,483.73	10.74
S	综合	10,060,224.66	2.58
	合计	355,491,305.91	91.10

8.5.10 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。

8.6 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000668	*ST华塑	1,068,700	13,540,429.00	3.47
2	002292	奥飞动漫	253,500	13,108,485.00	3.36
3	000705	浙江震元	585,050	10,975,538.00	2.81
4	002583	海能达	863,034	10,779,294.66	2.76
5	300065	海兰信	272