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

长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金

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,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
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	108,965,268.85份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。

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25日(基金合同生效日)-2014年12月31日
本期已实现收益	300,017,634.27	10,823,270.31
本期利润	220,156,478.16	102,379,486.86
加权平均基金份额本期利润	0.6744	0.0950
本期基金份额净值增长率	31.78%	9.50%
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	0.4433	0.0100
期末基金资产净值	157,269,989.38	1,179,826,130.80
期末基金份额净值	1.443	1.095
3.1.3 累计期末指标	2015年末	2014年末
基金份额累计净值增长率	44.30%	9.50%

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	16.65%	1.72%	9.46%	0.83%	7.19%	0.89%
过去六个月	-6.18%	2.60%	-5.46%	1.34%	-0.72%	1.26%
过去一年	31.78%	2.40%	8.83%	1.24%	22.95%	1.16%
自基金合同生效起至今	44.30%	2.31%	25.80%	1.23%	18.50%	1.08%

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

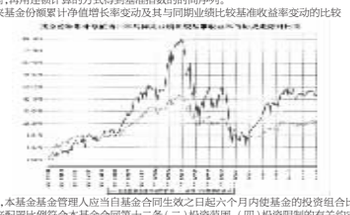
基准指数的构建考虑了三个原则:

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综合债指数。目前沪深300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性,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。

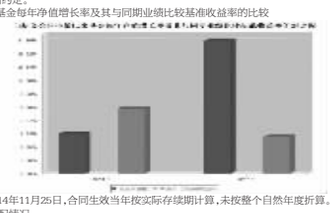
3.再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照5%、50%的比例采取再平衡,再用连续计算的方式得到基准指数的时间序列。

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



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。

3.2.3 自基金合同生效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:本基金合同生效日为2014年11月25日,合同生效当年按实际存续期计算,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年度未进行利润分配。

§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15000万元。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		
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,长盛回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	-	13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,长盛回益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。
赵宏宇	本基金基金经理助理。	2014年11月25日	2015年6月16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等职务。自2015年6月16日起不再担任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助理。
李其林	本基金基金经理助理。	2015年1月8日	2015年6月2日	4年	男,1983年2月出生,中国国籍。2012年12月加入长盛基金管理有限公司,曾任行业研究员等职务。自2015年6月2日起不再担任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。

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年是股票市场跌宕起伏、悲喜交加的一年。一季度在宏观经济增速放缓、改革预期向好、流动性宽松的牛市逻辑支持下,创业板指数率先大幅上涨,一季度涨幅超过50%,以互联网、工业4.0等为代表的新兴产业更是成为市场上涨的主线。3月中旬在产业政策放宽刺激下的带动下,场外资金开始大幅入场,尤其是融资、配资等杠杆资金,市场进入纯资金驱动的加速上涨阶段,上证指数一度达到5178.19点,六月份集中清算的市场开始渐渐式下跌,经历两轮"股灾",跌幅高达45%,九月份市场止步企稳,进入四季度投资者信心有所恢复,市场小幅反弹,在达到前期成交密集区3600点左右止步不前,结构方面四季度市场反弹中新能源汽车、虚拟现实等主题表现较好。全年来看,代表未来经济发展方向的新兴产业表现明显好于传统产业,成为市场最落上涨的主线。

1月本基金封闭期结束后,基于对养老健康主题方向的理解和新基金规模变化的特点,均衡配置重点行业,结合板块轮动特点及时调整配置,注意前瞻性布局新的投资板块,集中持仓优势个股。在市场泡沫严重期间,注重均衡配置减少市场波动带来的回撤风险。相比互联网等TMT主题方向,养老健康的主题方向相对走势较弱,也导致本基金业绩受到一定影响。3季度在市场大幅下跌过程中,本基金在合理控制仓位的同时,重点配置低估值的银行、家电等板块,减少业绩回撤。9月下旬判断市场调整结束后,结合基金的主题方向,果断进行加仓成长股。在市场进入前期密集成交期的震荡阶段,逐渐获利了结涨幅较大个股,调整仓位至中性仓位,配置也较为均衡。目上而下配置行业注思结合长期成长空间和短期催化剂。自下而上精选个股,减少持仓股票数量,深入挖掘内在价值。同时加强前瞻性布局新的板块,获取更多超额收益。今年本基金业绩好于沪深300指数26个百分点。

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1.443元,本报告期份额净值增长率为31.78%,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

稳增长底线下,2016年经济将呈现L型走势;以服务经济为代表的经济转型已实现,并将深化发展。货币政策仍维持宽松,但边际效应有所减减。财政政策将逐步发力,走向前台,成为影响经济和股市的重要变量。改革政策思路将延续,落地将成为关键,中国特色的供给侧改革将加速转型,无风险市场利率下行仍是目标,大类资产配置转向权益资产的趋势未变,"资产荒"将由主动转为被动投资,短期市场资金供需因素复杂化,增量资金充裕但结构期拉长,而且各类资金投资风格差异化也带来市场风格的变化。综上所述,2016年A股将呈现震荡行情,结构性特点将更为突出。基金操作将灵活调整仓位,注重日下而上选择行业及个股,关注改革落地、转型新热点,注意增量资金对市场风格的影响。

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的定,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、指导并执行公司基金估值业务。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回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,本基金报告期内未实施利润分配。

本基金截至2015年12月31日,期末可供分配利润为48,304,720.53元,其中:未分配利润已实现部分为82,788,884.98元,未分配利润未实现部分为-34,484,164.45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")在对长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金(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,完全尽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、基金份额申购赎回价格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2016年3月22日对本基金2015年12月31日的资产负债表、2014年11月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的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_A13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:长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金

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	61,814,670.65	109,560,755.97
结算备付金	631,094.46	6,851,827.67
存出保证金	307,422.91	67,599.93
交易性金融资产	101,185,749.96	983,924,312.46
其中:股票投资	101,185,749.96	983,924,312.46
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	-	82,245,672.51
应收利息	12,923.17	50,578.99
应收股利	-	-
应收申购款	62,162.87	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	164,014,024.02	1,182,700,747.53
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	5,230,349.71	-
应付赎回款	762,044.19	-
应付管理人报酬	207,199.04	1,430,091.16
应付托管费	34,533.20	238,348.53
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	277,685.20	1,206,177.04
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	232,223.30	-
负债合计	6,744,034.64	2,874,616.73
所有者权益:		
实收基金	108,965,268.85	1,077,446,643.94
未分配利润	48,304,720.53	102,379,486.86
所有者权益合计	157,269,989.38	1,179,826,130.80
负债和所有者权益总计	164,014,024.02	1,182,700,747.53

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值为人民币1.443元,基金份额总额为108,965,268.85份。

7.2 利润表

会计主体:长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

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25日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	232,964,179.88	105,889,400.72
1.利息收入	498,647.08	2,143,983.88
其中:存款利息收入	498,647.08	137,380.52
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	2,006,603.36
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	305,810,448.12	12,189,200.29
其中:股票投资收益	300,960,832.53	12,189,200.29
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	4,849,615.59	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-79,861,156.11	91,556,216.55
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6,516,240.79	-
减:二、费用	12,807,701.72	3,509,913.86
1. 管理人报酬	6,562,927.32	1,651,544.32
2. 托管费	1,093,821.25	275,257.39
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	4,794,474.01	1,579,313.84
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	356,479.14	3,798.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	220,156,478.16	102,379,486.86
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	220,156,478.16	102,379,486.86

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金

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)	1,077,446,643.94	102,379,486.86	1,179,826,130.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	220,156,478.16	220,156,478.16
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)	-968,481,375.09	-274,231,244.49	-1,242,712,619.58
其中:1.基金申购款	537,187,289.63	120,778,946.21	657,966,235.84
2.基金赎回款	-1,505,668,664.72	-395,010,190.70	-1,900,678,855.42
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)	108,965,268.85	48,304,720.53	157,269,989.38
项目	上年度可比期间 2014年11月25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)	1,077,446,643.94	-	1,077,446,643.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	102,379,486.86	102,379,486.86
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	1,077,446,643.94	102,379,486.86	1,179,826,130.80

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 龚晓

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

长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系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[2014]493号文《关于核准长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的注册。基金合同于2014年11月25日正式生效,存续期间不定。本基金设立时,收到首次募集扣除认购费启的有效净认购金额为人民币1,077,089,651.85元,折合1,077,089,651.85份基金份额;募集资金在募集期间产生的利息为人民币356,992.09元,折合356,992.09份基金份额;以上收到的实收基金共计人民币1,077,446,643.94元,折合1,077,446,643.94份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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)、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货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的相关规定)。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。本基金投资组合比例为: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,其中投资于养老健康产业的股票和债券不低于非现金基金资产的80%;权证投资占基金资产净值的比例不高于3%;本基金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,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较标准为: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并发布的《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《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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资等;

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资,债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5)回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行,主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值;估值日无市价,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易市价确定公允价值;如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)不存在活跃市场的金融工具,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术,优先使用相关可观察输入值,只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3)如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能适当反映公允价值的方法估值;

(4)如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若