长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期: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。

基金托管人中国建设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。

基金管理人于2015年8月28日发布公告,决定自2015年9月1日起,对旗下长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")增加C类份额、调低管理费率、调整赎回费率,并对本基金的基金合同作相应修改。

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。

本基金报告期自2015年1月1日至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	
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	1,891,456,553.67份	
基金合同存续期	不定期	
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	1,071,462,553.67份	819,994,000.00份

2.2 基金产品说明

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别资产间的分配比例,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。

注:为更好维护基金份额持有人的利益,降低基金份额持有人投资成本,根据相关法规和基金合同的有关规定,管理人经与托管人协商一致,决定自2015年9月1日起,对长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金增加C类份额、调低管理费率、调整赎回费率,并对基金合同作相应修改。

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场所

§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	2013年
	长盛战略新兴产业混合A	长盛战略新兴产业混合C		
本期已实现收益	34,033,834.72	2,394,931.35	7,881,578.56	4,068,092.66
本期利润	34,098,488.31	3,621,060.22	10,133,985.29	5,284,415.26
加权平均基金份额本期利润	0.0354	0.0101	0.2068	0.1105
本期基金份额净值增长率	44.27%	0.40%	23.62%	7.76%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末	2013年末
	长盛战略新兴产业混合A	长盛战略新兴产业混合C		
期末可供分配基金份额利润	0.6446	0.0028	0.2564	0.0160
期末基金资产净值	1,941,181,340.57	823,615,060.22	38,789,634.09	64,095,344.97
期末基金份额净值	1.812	1.004	1.256	1.016

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。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

长盛战略新兴产业混合A

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	0.67%	0.03%	11.03%	1.00%	-10.36%	-0.97%
过去六个月	0.83%	0.05%	-3.83%	1.64%	4.66%	-1.59%
过去一年	44.27%	0.77%	23.96%	1.43%	20.31%	-0.66%
过去三年	92.18%	1.02%	33.55%	1.06%	58.63%	-0.04%
自基金合同生效起至今	90.06%	0.99%	32.94%	1.01%	57.12%	-0.02%

长盛战略新兴产业混合C

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	0.40%	0.04%	11.03%	1.00%	-10.63%	-0.96%
自基金合同生效起至今	0.40%	0.03%	7.28%	1.17%	-6.88%	-1.14%

注:根据《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》,业绩比较基准自2014年2月11日起,由"沪深300指数×70%+中证综合债券指数×30%"变更为"50%×中证新兴产业指数+50%×中证综合债券指数";基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

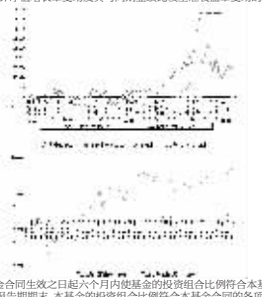
业绩比较基准=50%×中证新兴产业指数+50%×中证综合债券指数

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,选定中证新兴产业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券指数。

中证新兴产业指数是由中证指数有限公司编制,选择上海证券交易所和深圳证券交易所两市上市的新兴产业的公司中规模大、流动性好的100家公司组成,以综合反映沪深两市中新兴产业公司的整体表现,比较起来,该指数具有较好的权威性、市场代表性,用为衡量本基金业绩的基准,较为合适。

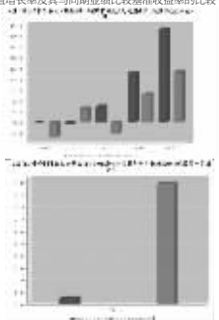
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照50%、50%的比例采取再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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:按照本基金的基金合同规定,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本基金合同第十二条"(二)投资范围"、"(七)投资限制"的有关规定。截至报告期末,本基金的投资组合比例符合本基金合同的各项规定。

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:长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金合同于2011年10月26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。

自2015年9月1日起,对长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金增加C类份额、调低管理费率、调整赎回费率,并对基金合同作相应修改。自调增C类至报告期末未满一年。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

长盛战略新兴产业混合A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
2013	0.5000	2,015,411.92	195,497.35	2,210,909.27	
合计	0.5000	2,015,411.92	195,497.35	2,210,909.27	

单位:人民币元

长盛战略新兴产业混合C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	0.0000	0.00	0.00	0.00	
合计	-	-	-	-	

§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		
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。	2015年5月14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,自席产品开发师,金融工程与量化投资部副总监。长盛上证所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(本基金)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。
杨衡	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,长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理,长盛战略新兴产业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	-	8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、长盛新兴海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛新兴海工装备灵活配置混合型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,社保组合组合经理。
王克玉	本基金基金经理,长盛电子信息产业股票型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,长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金经理,权益投资部副总监。	2014年2月11日	2015年5月14日	12年	男,1979年12月出生,中国国籍。上海交通大学硕士。历任元大京华证券上海代表处研究员、天相投资顾问有限公司分析师、国都证券有限公司分析师。2006年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任高级行业研究员、同盛证券投资基金基金经理助理,同益证券投资基金基金经理,长盛同样证券投资主题股票型证券投资基金基金经理等职务。现任权益投资部副总监,长盛电子信息产业股票型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,长盛城镇化主题股票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。自2015年5月14日起不再担任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。

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断墙制度。

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7月后在政府推出新股发行暂停、证金公司入场救市等多项较大力度救市背景下,股票市场企稳并有所回升。2015年8月入民币突然贬值,引发A股市场大跌,随着人民币贬值预期缓解,2015年3季度股票市场整体震荡走高。2015年11月中国证监会公布IPO重启,原暂停发行的2家新股在2015年展冠决发行,2016年起IPO发行执行新规。

本基金基于绝对收益和持有人厌恶的考量,在对权益和债券市场相对偏谨慎背景下,在新股发行暂停后,本基金迅速清空了股票仓位,避免了市场大幅下跌对基金净值的影响,但也未能分享9月后A股市场震荡走高的收益。11月后在IPO重启参与新股网下申购对沪深股市各1000万元股票市值要求,但合配度少量大盘蓝筹股,通过时机选择基本赎平股价波动对组合净值的影响,并于年底28家新股完成询价后大幅降低老股票仓位。

基于组合可能面对的大额赎回压力,在7月新股暂停后,组合配置了短期协议存款、逆回购、高信用等级短融等货币类工具,保持组合高流动性和灵活性。11月IPO重启后,由于28家新股仍采用老规则,申购需要全额预缴款,因此,本基金固定收益资产配置上仍以现金类工具为主,在28家新股申购结束后逐当拉长了组合久期,陆续转换到短融等货币类工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金A类份额净值为1.812元,本报告期(2015年1月1日至2015年12月31日)净值增长率为44.27%,同期业绩比较基准增长率为23.96%;

截至2015年12月31日,本基金C类份额净值为1.004元,本报告期(2015年9月1日至2015年12月31日)净值增长率为0.40%,同期业绩比较基准增长率为7.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

最新数据显示,2015年12月中国制新制造业PMI 48.2,预期48.9,前值48.6,不及预期。宏观经济数据显示,过去两个月内中国经济并无明显向好,预示经济仍面临下行压力。政府仍有必要实施预调微调的宏观经济政策组合,避免经济出现断崖式下跌,同时继续推进供给侧改革,释放改革红利。

从最新公告的央行第四季度例会声明,和第三季度相比,措辞仅做了小幅改动。相较三季度例会声明中"国际金融市场和大宗商品价格波动性上升,跨市场、跨地区相互影响,风险隐患增多"的描述,四季度的声明会议以"国际金融市场风险隐患增多"做了替代。当前央行维持原有基调的态度意味着中国经济疲软的情况下,政策或仍保持适度宽松及灵活。

2015年以来信用评级调整结果显示,受企业财报披露时点、政策监管规范和跟踪评级工作特点影响,在宏观经济下滑背景下,企业基本面持续弱化,出现主体评级下调的家次增多。煤炭、有色等传统周期性行业普遍存在行业产能过剩,企业经营效率低下的问题,未来负面调整仍需重点防范。从系统性风险的角度来看,在外部融资条件宽松条件下,资产规度缓冲以及外部保刚兑压力,较大程度上会延缓持续的内部高利现金流恶化带来的系统性风险,但是局部信用风险的加速暴露,会主导新股性的市场波动,尤其是中低评级(实际信用资质较弱的品种)的估值分化。无论是从避免违约的角度,还是从避免估值损失的角度,信用风险排雷都是当前和未来信用债投资重要的主题。因此,考虑继续维持组合高评级配置。

2016年除新股发行可能大幅提速外,债券供给也可能面临较大规模的扩容。一方面,赤字率有望从原来的2.3%扩大到3.0%,另一方面,地方债的置换规模仍然较大,此外,公司债规模或持续扩大。资金面上,2016年IPO发行采用新规则,网上网下中购不需要全额预缴款,因此相对过去,预计2016年新股发行对资金面的短期冲击将较为有限。

2015年中国对外汇制度进行了重大改革,按市场在决定人民币参考汇率方面拥有更大的发言权,允许更多的境外金融机构进入国内外汇市场,将交易时间延长一倍。根据中国外汇交易中心的数据,2015年人民币对美元的汇率跌4.5%,12月31日报收于1美元兑6.4936元人民币,创下1994年以来的最大年度跌幅。在前期人民币持续升值通道中,我国部分行业企业发行美元债券,享受低息和升值的收益,但在未来人民币贬值背景下,将面临较大的付息清偿压力,或将对债券市场形成较大冲击。

2015年12月,美联储宣布将联邦基金利率目标区间由0-0.25%上调至0.25%-0.5%,首次加息尘埃落定,美联储结束长达7年之久的零利率政策,这也是美国9年来首次加息,市场普遍预计在未来2-3年美元将进入加息通道。这或对中国未来货币政策走向带来了不容忽视的影响:一方面,美元进入加息通道,带来美元走强,人民币若进一步降息将导致市场对于美元资产需求增加,资本外流和人民币贬值压力加大;另一方面,2016年中国经济稳增长的局面将维持,央行仍然需要通过宏观调控,维持市场流动性,来对冲外汇占款的减少。而我国基准利率水平已经降至20年以来最低,未来货币政策向宽松的调整区间有限,或造成中国债市构成压制。

从对未来发行转债的信息统计,未来待发行转债或超过14只,规模或超过273亿元,扩容一方面增加了目前转债市场供给和流动性,另一方面将压缩目前转债风格缺性带来的高溢价空间。

综合以上,展望后市,我们坚持持谨慎乐观、相对谨慎态度。

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,具备基金估值监督、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人公司作出合理解释,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可以非场交易的债券品种和在交易所市场交易或违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《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》第十六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873,339,847.12,其中,A类份额期末可供分配利润为690,688,209.33元(A类份额未分配利润已实现部分为690,688,209.33元,未分配利润未实现部分为179,030,577.57元),C类份额期末可供分配利润为2,296,024.70元(C类份额未分配利润已实现部分为2,296,024.70元,未分配利润未实现部分为1,325,035.52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2016年3月22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普华永道中天审字(2016)第20239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:长盛战略新兴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	215,552,258.83	9,534,180.11
结算备付金	2,789,046.11	115,861.38
存出保证金	171,156.83	15,777.03
交易性金融资产	2,510,450,981.75	29,410,369.54
其中:股票投资	11,051,981.75	29,383,385.54
基金投资	-	-
债券投资	2,499,399,000.00	26,984.00
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	10,000,000.00	400,000.00
应收证券清算款	1,499,639.46	-
应收利息	35,014,613.95	3,638.85
应收股利	-	-
应收申购款	50,160.91	13,362.23
7.2 递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,775,527,857.84	39,493,189.14
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	2,889,978.24	541.96
应付赎回款	4,033,247.07	336,102.39
应付管理人报酬	2,344,309.43	51,025.19
应付托管费	586,077.33	8,504.19
应付销售服务费	221,461.47	-
应付交易费用	481,447.67	31,326.32
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	174,935.84	276,055.00
负债合计	10,731,457.05	703,555.05
所有者权益:		
实收基金	1,891,456,553.67	30,874,184.03
未分配利润	873,339,847.12	7,915,450.06
所有者权益合计	2,764,796,400.79	38,789,634.09
负债和所有者权益总计	2,775,527,857.84	39,493,189.14

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额总额1,891,456,553.67份,其中长盛战略新兴产业混合A类的份额1,071,462,553.67份,基金份额净值为1.812元;长盛战略新兴产业混合C类的份额819,994,000.00份,基金份额净值为1.004元。

7.3 利润表

会计主体:长盛战略新兴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	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	67,329,235.39	11,736,195.86
1.利息收入	38,207,342.26	222,100.29
其中:存款利息收入	9,628,111.22	65,519.62
债券利息收入	18,410,826.36	313.28
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	10,168,404.68	156,267.39
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	22,417,370.76	9,159,427.44
其中:股票投资收益	30,078,190.36	8,497,925.07
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-7,836,572.89	61,052.69
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	175,753.29	600,449.68
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	1,290,782.46	2,252,406.73
7.4 4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	5,413,739.91	102,261.40
减:二、费用	29,609,686.86	1,602,210.57
1. 管理人报酬	23,323,802.82	783,121.14
2. 托管费	4,521,874.73	130,520.08
3. 销售服务费	221,461.47	-
4. 交易费用	1,306,889.24	299,217.51
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	235,658.60	389,351.84
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	37,719,548.53	10,133,985.29
7.5 减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	37,719,548.53	10,133,985.29

7.6 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛战略新兴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)	30,874,184.03	7,915,450.06	38,789,634.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,719,548.53	37,719,548.53
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)	1,860,582,369.64	827,704,848.53	2,688,287,218.17
其中:1.基金申购款	3,625,390,291.34	2,218,518,125.32	5,843,908,416.66
2.基金赎回款	-1,764,807,921.70	-1,390,813,276.79	-3,155,621,198.49
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)	1,891,456,553.67	873,339,847.12	2,764,796,400.79
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)	63,084,494.99	1,010,849.98	64,095,344.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,133,985.29	10,133,985.29
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)	-32,210,310.96	-3,229,385.21	-35,439,696.17
其中:1.基金申购款	61,576,857.23	3,174,941.99	64,751,799.22
2.基金赎回款	-93,787,168.19	-6,404,327.20	-100,191,495.39
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)	30,874,184.03	7,915,450.06	38,789,634.09

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

7.7 报表附注

7.7.1 基金基本情况

长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")是根据长盛同祥证券投资主题股票型证券投资基金(以下简称"原基金")基金份额持有人大会的决议由长盛同祥证券投资主题股票型证券投资基金转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会以下简称"中国证监会")证监基金字[2011]第1219号《关于核准长盛同祥证券投资主题股票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《长盛同祥证券投资主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原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941,564,638.02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(2011)第411号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同祥证券投资主题股票型证券投资基金合同》于2011年10月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为941,658,939.32份基金份额,其中认购资金利息折合94,301.30份基金份额。

原基金基金份额持有人大会自2013年12月23日起至2014年1月22日止以通讯方式召开,会议审议通过了《关于修改长盛同祥证券投资主题股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,经中国证监会备案后决议生效。根据原基金基金份额持有人大会决议,《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》自2014年2月11日生效,基金投资目标、范围和策略调整,同时"长盛同祥证券投资主题股票型证券投资基金"更名为"长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金"。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。

根据本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司2015年8月28日发布的《关于长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金增加C类份额、调低管理费率、调整赎回费率并修改基金合同的公告》,本基金自2015年9月1日起,根据赎回费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定,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)、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。本基金投资组合中对股票投资占基金资产的比例为70%-95%;权证投资占基金资产净值的比例不高于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%;投资于战略新兴产业的股票及债券不低于本基金非现金基金资产的80%。本基金的业绩比较基准为:50%×中证新兴产业指数+50%×中证综合债券指数。

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。

7.7.2 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》、《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证