

## 长盛养老保险健康产业灵活配置混合型证券投资基金

## [2015]第一季度报告

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:2015年4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2015年4月17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。投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称:长盛养老保险健康产业灵活配置混合型证券投资基金

基金代码:000684

交易代码:000684

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:454,004,503.63份

本基金主要投资于养老金健康产业的上市公司股票，在严格控制风险的前提下，追求超越行业平均水平的稳定回报。

本基金充分把握养老金投资的长期性，运用科学严谨、规范化的产品配置方法，灵活配置国内外养老金健康产业的上市公司股票和债券，谋取基金资产的长期稳定增长。本基金对养老金健康产业上市公司股票的配置比例不低于基金资产的80%，投资于养老金健康产业的上市公司股票的配置比例不低于基金资产的50%。

投资策略

本基金运用“资产配置+行业轮动”的投资策略，通过资产配置策略，将长期持有的养老金投资组合在不同行业之间进行动态配置，充分发掘养老金管理研究近年来取得的成果，通过行业轮动，选择具备长期投资价值的行业，从而持续获得长期稳定的收益。

业绩比较基准:50%×沪深300指数收益率+50%×中信证券债基指数收益率

风险收益特征:本基金具有较高风险，较高预期收益的特征，其风险和预期收益水平高于股票型基金、高风险债基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

报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)

1.本期实现收益:137,828,989.82

2.本期利润:162,595,426.76

3.期末基金总份额利润:2,224,224

4.期末基金净值:609,184,239.13

5.期末基金净值:1.342

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(1) 净值增长标准差(2) 业绩比较基准收益(3) 业绩比较基准标准差(4) ①-③ ②-④

过去三个月 22.56% 1.32% 7.84% 0.92% 14.72% 0.60%

3.2.2 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:本基金合同生效日为2014年11月25日，截至本报告期末本基金成立满一年。

2.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，截至本报告期初仍处于建仓期。

3.本基金的投资组合比例为: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，其中投资于养老金健康产业的股票和债券不高于基金资产的90%，权证投资占基金资产净值的比例不高于3%，本基金每个交易日在扣除股指期货保证金后的交易保证金后，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相关法律法规的规定。

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 任本基金基金经理期间 证券从业年限 说明

刘加明 基金经理,长盛养老保险健康产业灵活配置混合型证券投资基金 2014年11月25日 - 13年

注:刘加明先生于2014年11月25日出任本基金基金经理,并担任长盛养老保险健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:刘加明先生于2014年11月25日开始担任本基金基金经理,并担任长盛养老保险健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:刘加明先生于2014年11月25日开始担任本基金基金经理,并担任长盛养老保险健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。