长盛成长价值证券投资基金

【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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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。

本报告中财务资料未经审计。

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	长盛成长价值混合
基金主代码	080001
交易代码	080001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年9月18日
报告期末基金份额总额	708,716,043.72份
投资目标	本基金为平衡型基金,通过管理人的积极管理,在控制风险的前提下挖掘价值、分享成长,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略为主动性投资,在战略性资产、战术性资产、股票和债券选择三个层面进行积极配置,力争获得超过投资基准的业绩回报。在资产配置方面,股票资产比例为35%-75%,债券资产比例为20%-60%,现金资产比例不低于5%。
业绩比较基准	中信标普A股综合指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属平衡型基金,在承担适度风险的前提下,获得长期稳定的收益。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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

主要财务指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	211,574,540.88
2.本期利润	344,652,370.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.3781
4.期末基金资产净值	1,123,737,601.16
5.期末基金份额净值	1.586

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到2015年3月31日。

3、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。

3.2 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	净值增长率①	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	33.30%	1.19%	18.92%	1.20%	14.38%	-0.01%

3.2.2 自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

§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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
翟永垒	本基金基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,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,长盛动态精选证券投资基金基金经理。	2013年7月9日	-	6年	男,1982年3月出生,中国国籍。中国人民银行研究生部经济学硕士,2009年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任行业研究员,基金经理助理等职务。现任长盛成长价值证券投资基金(本基金)基金经理、长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,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,长盛动态精选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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。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。

公司对2015年第1季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1 日、3 日、5 日的交易片段进行T 检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

海外市场,美联储加息信号逐步显现,美元强势。1季度道琼斯指数下跌1.15%,纳斯达克涨2.58%;欧元区QE继续宽松,债务危机平稳度过,经济开始显示出复苏信号,德国DAX指数涨22.03%,伦敦富时100指数涨3.45%。全球大宗商品价格在底部徘徊,铁矿石接替原油成为领跌品种。

国内市场1季度主要热点是召开了全国两会, 政府工作报告提出要把一批新兴产业培育成主导产业,并首次在国家层面提出"互联网+" 战略, "大众创业、万众创新" 预计会成为经济结构转型的一大动力。国内1季度的主要矛盾仍为"经济增速下台阶与过度宽松的流动性",股市成为好的投资场所。上证综指1季度上涨18.39%,代表超大盘股的上证50上涨9.15%。在"互联网+" 的催化下,代表成长股的创业板和中小板在1季度不断创出新高,且创业板内部结构没有再继续分化,1季度创业板综指上涨59.18%,创业板指上涨59.93%。

成长价值基金契约强调成长股与价值股的均衡,很难向某一种风格集中。在1季度的投资运作中,我们根据市场风格演变和个股的基本面的情况,继续保持相对均衡的配置,成长股注重挖掘未来3年内能够阶段性高成长的细分行业和个股,这些细分行业包括TMT、高端装备(新能源、智能装备、军工、节能环保)和医药等行业;价值股主要选择受益政策微刺激的行业,如"一带一路"、京津冀、自贸区,具体包括铁路设备、电网、军工和金融地产板块。

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1.586元,本报告期份额净值增长率为33.30%,同期业绩比较基准增长率为18.92%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	814,901,393.20	71.85
	其中:股票	814,901,393.20	71.85
2	固定收益投资	240,784,000.00	21.23
	其中:债券	240,784,000.00	21.23
	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	69,944,209.25	6.17
7	其他资产	8,520,262.68	0.75
8	合计	1,134,149,865.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,041,863.26	0.45
B	采矿业	-	-
C	制造业	515,894,189.64	45.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	56,538,991.10	5.03
F	批发和零售业	48,845,608.10	4.35
G	交通运输、仓储和邮政业	6,501,512.17	0.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,878,044.64	6.66
J	金融业	107,201,184.29	9.54
K	房地产业	-	-
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	814,901,393.20	72.52

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300115	长盈精密	1,925,518	56,764,270.64	5.05
2	000733	振华科技	2,060,856	52,757,913.60	4.69
3	300081	恒信移动	673,444	38,217,947.00	3.40
4	300351	永贵电器	623,382	35,894,335.56	3.19
5	300303	聚飞光电	1,314,710	35,891,583.00	3.19
6	601390	中国中铁	2,810,796	35,500,353.48	3.16
7	002580	圣阳股份	1,229,701	34,530,004.08	3.07
8	002138	顺络电子	1,130,436	33,664,384.08	3.00
9	300155	安居宝	1,093,968	32,315,814.72	2.88
10	601299	中国北车	1,727,216	31,798,046.56	2.83

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	240,784,000.00	21.43
	其中:政策性金融债	240,784,000.00	21.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	240,784,000.00	21.43

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140213	14国开13	800,000	80,000,000.00	7.12
2	140212	14国开12	500,000	50,010,000.00	4.45
3	130420	13农发20	400,000	40,112,000.00	3.57
4	150202	15国开02	300,000	29,922,000.00	2.66
5	140418	14农发18	200,000	20,734,000.00	1.85

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	198,592.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,875,909.74
5	应收申购款	1,445,760.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,520,262.68

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300081	恒信移动	38,217,947.00	3.40	重大事项停牌
2	601299	中国北车	31,798,046.56	2.83	重大事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,145,964,015.84
报告期期间基金总申购份额	36,433,357.47
减:报告期期间基金总赎回份额	473,681,329.59
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	708,716,043.72

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	14,109,387.26
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	14,109,387.26
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2015年1月7日	14,109,387.26	17,492,395.05	0.50%
合计			14,109,387.26	17,492,395.05	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2015年 3月25日发布 《关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》,自2015年3月24日起,本基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛成长价值证券投资基金基金合同》;

3、《长盛成长价值证券投资基金托管协议》;

4、《长盛成长价值证券投资基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所和/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666、010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2015年4月20日

长盛城镇化主题股票型证券投资基金

【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。

本报告中财务资料未经审计。

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	长盛城镇化主题股票
基金主代码	000354
交易代码	000354
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年11月12日
报告期末基金份额总额	258,613,784.42份
投资目标	本基金主要投资于城镇化主题上市公司股票,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	(1)本基金将通过分析宏、微观经济指标、市场指标和政策走向等因素,动态调整基金资产在各类资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。(2)股票投资上,本基金投资于城镇化主题上市公司股票的比例将不低于非现金基金资产的80%。本基金将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,从公司基本状况和股票估值两个方面筛选具有长期持续增长能力的公司,组建并动态调整城镇化主题优选股票库,并根据市场波动情况精选个股,进而构建股票投资组合。
业绩比较基准	80%*沪深300指数收益率+20%*中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金产品,风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金,属于高风险、高预期收益的基金产品。
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

主要财务指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
1.本期已实现收益	89,975,946.44
2.本期利润	154,040,520.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.3762
4.期末基金资产净值	426,026,438.89
5.期末基金份额净值	1.647

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到2015年3月31日。

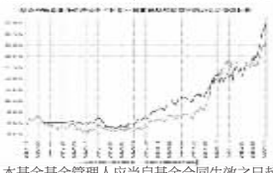
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 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	净值增长率①	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	32.18%	1.37%	11.94%	1.46%	20.24%	-0.09%

3.2.2 自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: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。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十二部分二、投资范围和四、投资限制的有关约定。

§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	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王宁	本基金基金经理,长盛回报优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理,社保组合组合经理,权益投资部总监,公司总经理助理。	2013年11月12日	-	17年	男,1971年10月出生,中国国籍。毕业于北京大学光华管理学院,EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理,兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司,曾任基金经理助理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、长盛同庆可分离交易股票型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、长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金经理等职务。现任公司总经理助理,权益投资部总监,社保组合组合经理,长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛城镇化主题股票型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。
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,长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,权益投资部副总监。	2013年11月12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,长盛同祥泛资源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(本基金)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。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。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。

公司对2015年第1季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1 日、3 日、5 日的交易片段进行T 检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年一季度对A 股市场投资者而言又是回报非常丰厚的一段美好时光, 中证流通指数的涨幅达到了26.58%,是2008年以来第二大涨幅的季度,仅次于2009年的一季度。然而市场的结构再次发生了重大的变化,沪深300指数涨幅为14.65%,而中小板和创业板指数的涨幅分别达到了46.60%和58.67%,与2014年的四季度发生了明显的差异;涨幅最好的行业主要是计算机、传媒,涨幅落后的行业主要是银行和非银行金融。

一季度组合净值上涨32.18%,组合表现略好于市场平均水平。从2014年的四季度到2015年一月份之间,市场风格发生了非常大的波动;期间对组合结构进行积极调整,一方面卖出获利明显的传统产业个股,同时在优质成长股大幅下跌具备明显估值优势的情况下,逐渐买入,维持较高的权益资产的占比;买入的行业主要通信、传媒、医药和消费。遗憾在于对优质计算机行业个股的买入规模低于预期,体现出交易方法上单一的问题。

在前期的管理人报告中,我们曾经表述过看好2015年A 股市场的投资环境。主要原因包括:(1)经过多年的制度建设,目前资本市场对经济发展的促进作用越来越明显,市场的赚钱效应也将吸引更多资金进入市场,市场活跃度将显著提高;(2)经过较长时间的调整后,部分优质成长股的估值水平已经非常有吸引力;(3)随着新股发行的正常进行,以及上市公司兼并收购的效率提升,投资可选标的大幅扩张,为二级市场投资者提供了更多的选择机会。进入二季度,我们的部分预期已经在市场上得以体现,在这种情况下,需要我们再次客观的分析市场环境、上市公司经营质量与估值,通过更审慎的投资为持有人贡献回报。

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1.647元,本报告期份额净值增长率为32.18%,同期业绩比较基准收益率为11.94%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	381,184,341.58	88.44
	其中:股票	381,184,341.58	88.44
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	34,933,969.23	8.10
7	其他资产	14,910,468.81	3.46
8	合计	431,028,779.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	37,075,149.42	8.70
C	制造业	278,992,372.93	65.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,546,199.88	0.83
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,419,816.34	4.79
G	交通运输、仓储和邮政业	306,578.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,111,244.94	6.13
J	金融业	200,930.16	0.05
K	房地产业	6,447,329.06	1.51
L	租赁和商务服务业	6,496,065.13	1.52
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,177,300.00	0.28
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	411,355.72	0.10
S	综合	-	-
	合计	381,184,341.58	89.47

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600498	烽火通信	1,522,189	36,060,657.41	8.46
2	002465	海格通信	1,266,127	35,464,217.27	8.32
3	000012	南 玻A	1,275,576	15,039,041.04	3.53
4	300045	华力创通	541,090	14,890,796.80	3.50
5	601126	四方股份	513,757	14,297,857.31	3.36
6	002419	天虹商场	924,012	13,813,979.40	3.24
7	002376	新北洋	780,601	12,380,331.86	2.91
8	601238	广汽集团	1,203,425	11,829,667.75	2.78
9	000063	中兴通讯	528,599	11,555,174.14	2.71
10	601369	陕鼓动力	1,143,775	11,472,063.25	2.69

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	443,676.28
2	应收证券清算款	13,739,480.49
3	应收股利	-
4	应收利息	15,805.01
5	应收申购款	711,507.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,910,468.81

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:注:本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600498	烽火通信	36,060,657.41	8.46	重大事项停牌
2	000012	南 玻A	15,039,041.04	3.53	重大事项停牌
3	002376	新 北 洋	12,380,331.86	2.91	重大事项停牌

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	442,494,956.82
报告期期间基金总申购份额	34,210,183.05
减:报告期期间基金总赎回份额	218,091,355.45
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	258,613,784.42

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	38,539,359.16
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	19,248,315.69
报告期期末管理人持有的本基金份额	19,291,043.47
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	7.46

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2015年3月25日	19,248,315.69	30,834,839.32	0.50%
合计			19,248,315.69	30,834,839.32	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2015年 3月25日发布《关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》,自2015年3月24日起,本基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会核准基金募集的文件;

(二)《长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金合同》;

(三)《长盛城镇化主题股票型证券投资基金托管协议》;

(四)《长盛城镇化主题股票型证券投资基金招募说明书》;

(五)法律意见书;

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666、010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司