长盛中信全债指数增强型债券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月21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7月20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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛全债指数增强债券
基金主代码	510080
交易代码	510080
前端交易代码	510080
后端交易代码	511080
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年10月25日
报告期末基金份额总额	83,216,832.77份
投资目标	本基金为开放式债券型基金,将运用增强的指数化投资策略,在力求本金安全的基础上,追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳定增值
投资策略	本基金采用“自上而下”的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值,同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率×92%+中信标普A股综合指数收益率×8%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金
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4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	6,394,112.85
2.本期利润	-391,706.42
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0042
4.期末基金资产净值	124,901,630.96
5.期末基金份额净值	1.5009

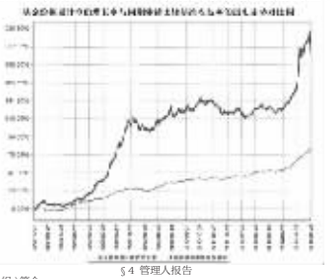
注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、所列数据截止到2015年6月30日。
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-1.04%	0.67%	2.68%	0.23%	-3.72%	0.44%

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		
马文祥	本基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,固定收益部副总监。	2014年9月10日	-	12年	男,1977年7月出生,中国国籍,清华大学经济管理学院经济学硕士。历任中国农业银行主任科员,工银瑞信企业年金基金经理、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理;2013年8月加入长盛基金管理有限公司,现任固定收益部副总监,长盛中信全债指数增强型债券投资基金(本基金)基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛季季红1年期定期开放债券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、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》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。

公司对过去4个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

1、报告期内行情回顾

2015年第二季度,经济基本面仍相对疲弱,通胀处于较低水平;货币政策方面,4月19日起央行下调了金融机构人民币存款准备金率,5月11日起下调了人民币贷款和存款基准利率,6月28日起再次下调了人民币贷款和存款基准利率,并对部分金融机构实施定向降准,资金面呈现持续宽松局面。

4月,受货币政策宽松预期等因素影响,各债券品种收益率均大幅下行;但5月以来,受地方政府债务冲击及股市快速上涨等因素影响,债市呈现调整走势。利率债方面,短端收益率快速下行并保持在低位,长端收益率则走出一波先下后上的过山车行情,收益率曲线总体延续化下行。信用债方面,收益率曲线陡峭化下行,中高等级债券信用利差有所收窄,低评级债券信用利差明显扩大,主要是受信用风险事件增多所致。

货币市场方面,受央行公开市场操作引导利率下行及降准降息等宽松货币政策影响,市场流动性保持宽松局面,各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率总体大幅下行,并维持在较低水平。

权益资产方面,4月至6月中旬,增量资金加速流入股市,券商两融规模不断创新高,市场成交量巨幅放大,A股市场延续了去年四季度以来的牛市行情,上证综指最高上涨至5178点;但6月中旬以来,受流动性预期变化、杠杆配资监管的加强、新股发行加速以及恐慌情绪等因素影响,A股市场连续大幅下挫。可转债方面,4月至6月初,可转债弹性有所下降,震荡正股上涨能力降低;6月中旬以来,受正股快速下跌和转股溢价率收窄影响,存量可转债价格呈快速下跌走势。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金坚持稳健操作思路,在信用风险可控的前提下重点配置中短期信用债,保持组合流动性,适度参与利率品种的交易性机会。同时,把握权益市场机会,优选股票和可转债,择机进行波段操作,提升组合收益;6月份以来,大幅降低了权益资产比重,但市场的大幅调整仍然对组合业绩造成较大影响。

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1.5009元,本报告期份额净值增长率为-1.04%,同期业绩比较基准增长率为2.68%。

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	17,622,421.00	10.57
	其中:股票	17,622,421.00	10.57
2	固定收益投资	131,916,575.67	79.14
	其中:债券	131,916,575.67	79.14
	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	11,581,307.83	6.95
7	其他资产	5,563,899.74	3.34
8	合计	166,684,204.24	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	11,325.00	0.01
B	采矿业	24,750.00	0.02
C	制造业	9,241,499.00	7.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,676,313.00	1.34
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,297,516.00	1.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	676,792.00	0.54
J	金融业	2,671,956.00	2.14
K	房地产业	1,022,270.00	0.82
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	17,622,421.00	14.11

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	601166	兴业银行	154,896	2,671,956.00	2.14
2	601018	宁波港	259,900	2,297,516.00	1.84
3	600150	中国船舶	35,000	1,802,500.00	1.44
4	601992	金隅股份	122,100	1,459,095.00	1.17
5	000777	中核科技	40,000	1,314,000.00	1.05
6	601800	中国交建	66,000	1,158,960.00	0.93
7	600118	中国卫星	19,400	1,105,024.00	0.88
8	600048	保利地产	86,000	982,120.00	0.79
9	002072	凯瑞德	47,500	973,750.00	0.78
10	000778	新兴铸管	86,100	874,776.00	0.70

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	40,285,148.20	32.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,978,000.00	15.99
	其中:政策性金融债	19,978,000.00	15.99
4	企业债券	52,070,432.17	41.69
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,163,000.00	8.14
7	可转债	9,419,995.30	7.54
8	其他	-	-
9	合计	131,916,575.67	105.62

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	010107	21国债(7)	230,000	24,368,500.00	19.51
2	110233	11国开33	200,000	19,978,000.00	15.99
3	010213	02国债(13)	141,430	14,075,113.60	11.27
4	112150	12银轮债	100,000	10,203,000.00	8.17
5	1382109	13成渝MTN1	100,000	10,163,000.00	8.14

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

根据2015年6月9日兴业银行公告“2015年5月中旬,公司南宁分行下辖二级分行北海分行接到北海市公安局通报,该分行前员工苏瑜涉嫌个人非法集资已被立案,目前案件在调查阶段。公司南宁以及北海两级分行成立专项调查小组,就其涉及业务进行了全面内部排查,未发现银行资金卷入其中。目前,公司北海分行经营、财务状况与对外服务均正常。”本基金做出如下说明:

兴业银行是中国最优秀的银行之一,基本面良好,基于相关研究,本基金判断,公安机关对其前员工立案调查属于个人行为,对兴业银行影响极小。今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外,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。

5.10.2

本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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	366,114.89
2	应收证券清算款	2,819,204.48
3	应收股利	-
4	应收利息	2,125,534.06
5	应收申购款	253,046.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,563,899.74

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113501	洛钼转债	4,983,585.60	3.99

5.10.5 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	000778	新兴铸管	874,776.00	0.70	重大事项停牌

5.10.6 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	107,009,672.02
报告期期间基金总申购份额	7,805,192.24
减:报告期期间基金总赎回份额	31,598,031.49
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	83,216,832.77

§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

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》;

3、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金托管协议》;

4、《长盛中信全债指数增强型债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。

8.2 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。

8.3 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及/或管理人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7月21日

长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月21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7月20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4月21日(基金合同生效日)起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛转型升级混合
基金主代码	001197
交易代码	001197
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月21日
报告期末基金份额总额	8,137,989,389.81份
投资目标	本基金的投资目标在于把握中国经济转型升级过程中所蕴含的投资机会,在严格控制投资风险的基础上,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	(1)分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策等因素,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)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,选择转型升级主题概念的、具有竞争优势且估值具有吸引力的股票,组建并动态调整转型升级主题优选股票库。
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。
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4月21日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	46,856,883.35
2.本期利润	-597,850,337.67
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0698
4.期末基金资产净值	7,573,877,363.26
5.期末基金份额净值	0.931

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6月30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	-6.90%	2.11%	0.60%	1.42%	-7.50%	0.69%

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:1、长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效日2015年4月21日,截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为:股票占基金资产的0%-95%;其中投资于转型升级主题的证券不低于非现金基金资产的80%;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,保持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%。

§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		
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、长盛养老健康产业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。	2015年4月21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基金经理、长盛转型升级主题混合型证券投资基金(本基金)基金经理、长盛成长价值证券投资基金(LOF)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。

公司对过去4个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

地方融资平台、银行理财进一步规范,无风险利率下行驱动牛市延续的逻辑未变。央行持续降息降准也符合预期。大类资产配置转移背景下,资金加速进入股市。资金来源和市场风格转换,“两会”政策导向驱动,以创业板为主成长股出现大幅上涨,“互联网+”等主题投资板块涨幅明显。

本基金在报告期处于建仓阶段。建仓期初始充分认识到市场局部泡沫化的问题,秉承谨慎和绝对收益理念,适度控制建仓速度,选择低风险板块和成长确定性高的个股逐步建仓,并辅以打新积累收益。行业配置结构相对合理,蓝筹和价值板块配置高,本轮市场大跌中相对较好,而且保持较好的流动性调节手段。但本轮市场大跌超越预期,对于大基金操作提出很高要求,基金管理人力求在震荡中调整结构和仓位,最大限度的实现较好业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,长盛转型升级混合份额净值为0.931元,本报告期份额净值增长率为-6.90%,同期业绩比较基准增长率为0.60%。

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	6,663,488,209.11	85.60
	其中:股票	6,663,488,209.11	85.60
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	1,077,301,348.37	13.84
7	其他资产	43,805,175.58	0.56
8	合计	7,784,594,733.06	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,544,005,880.87	46.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,503,510.99	0.61
E	建筑业	73,495,153.63	0.97
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	290,548,105.01	3.84
J	金融业	2,189,402,357.92	28.91
K	房地产业	196,589,614.12	2.60
L	租赁和商务服务业	69,247,637.70	0.91
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	253,695,948.87	3.35
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	6,663,488,209.11	87.98

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	000333	美的集团	9,989,834	372,421,011.52	4.92
2	600690	青岛海尔	11,711,333	355,204,729.89	4.69
3	000651	格力电器	5,470,752	349,581,052.80	4.62
4	600887	伊利股份	17,321,730	327,380,697.00	4.32
5	002202	金风科技	16,689,556	324,945,655.32	4.29
6	601126	四方股份	9,224,667	281,352,343.50	3.71
7	600406	国电南瑞	13,119,109	271,434,365.21	3.58
8	300070	碧水源	5,199,753	253,695,948.87	3.35
9	601318	中国平安	3,049,100	249,843,254.00	3.30
10	000400	许继电气	9,234,529	232,340,749.64	3.07

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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: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 投资组合报告附注

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

根据2014年12月8日中国证券监督管理委员会发布对中国平安控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称“平安证券”)的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》,决定对平安证券给予警告,没收保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2867万元,并处以440万元罚款。本基金做出如下说明:中国平安是中国最优秀的综合金融公司,寿险业务最具竞争力,基本面良好。基于相关研究,本基金判断,旗下平安证券受到处罚,对中国平安的影响较小,因为证券业务板块在平安集团内的地位较低。今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述情况外,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,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	3,733,172.72
2	应收证券清算款	35,155,378.98
3	应收股利	-
4	应收利息	229,610.86
5	应收申购款	4,687,013.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,805,175.58

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

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

基金合同生效日(2015年4月21日)基金份额总额	8,582,941,405.86
报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	32,720,099.38
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	477,672,115.43
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	8,137,989,389.81

§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

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛转型升级主题灵活配置混合型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。

8.2 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。

8.3 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/或基金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7月21日

长盛中证100指数证券投资基金

【2015】第二季度报告

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7月21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7月20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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛中证100指数
基金主代码	519100
交易代码	519100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月22日
报告期末基金份额总额	478,272,859.46份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在4%以下,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用复制指数投资策略,按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪基准指数。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%
风险收