长盛航天海工装备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	长盛航天海工混合
基金主代码	000535
交易代码	000535
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年3月11日
报告期末基金份额总额	200,958,270.81份
投资目标	本基金通过投资航天海工装备等安全相关上市公司股票,把握中国航天海工装备等安全相关行业发展带来的投资机会,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	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,灵活配置国内航天海工装备等安全相关上市公司股票和债券,谋求基金资产的长期稳定增长。航天海工装备等安全相关主题包括航天装备、海洋工程装备及涉及未来战略安全的相关装备制造领域,主要包括航空装备、航天装备、领土安全装备、海洋工程装备及信息安全装备5个重点方向,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,选择航天海工装备等安全相关主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
业绩比较基准	50%*巨潮航天军工指数收益率+50%*中证综合债指数收益
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	128,596,548.03
2.本期利润	33,560,727.13
3.加权平均基金份额本期利润	0.1507
4.期末基金资产净值	339,787,593.71
5.期末基金份额净值	1.691

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。

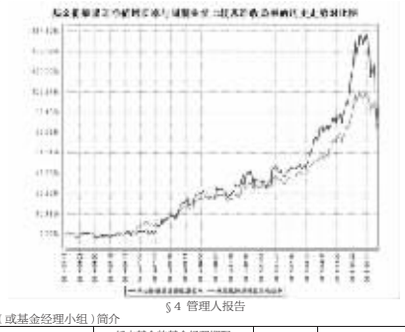
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	13.80%	2.68%	18.97%	1.74%	-5.17%	0.94%

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		
王超	本基金基金经理,长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理,长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理,长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。	2015年4月27日	-	8年	男,1981年9月出生,中国国籍。中央财经大学硕士,金融风险管理师(FRM)。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员,从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理,长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。
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,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	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、长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。现任长盛能源新兴产业灵活配置混合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、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金(本基金)基金经理。
张锦灿	本基金基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同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3月11日	2015年4月27日	10年	男,1982年1月出生,中国国籍。北京大学光华管理学院金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员、银华基金管理有限公司研究员,研究主管、基金经理助理。2012年9月加入长盛基金管理有限公司,曾任同益证券投资基金基金经理。现任长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金(本基金)基金经理、长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理。自2015年4月27日起不再担任长盛航天海工装备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》及其各项实施细则、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

海外市场,美联储关于加息的态度变得暧昧,美元指数冲高回落,2季度道琼斯指数下跌-0.88%,纳斯达克涨1.75%;欧元区虽然经济开始显示出复苏信号,但是希腊债务又成为新的不稳定因素,导致德国DAX指数下跌-8.53%,伦敦富时100指数下跌-3.72%。全球大宗商品价格仍然在底部徘徊。

国内市场2季度市场呈现了冲高之后大幅回落的特征。上证指数在6月12日创下本轮反弹新高5178之后,便在清查场外配资等消息的影响下出现快速大幅下跌。前期出现大幅上涨的创业板和中小板成为主要下跌对象,大盘蓝筹在下跌初期,由于具有较好的流动性,出现了恐慌性的抛售。针对杠杆平仓导致的本轮股市大幅下跌,已经超出了市场正常价值回归的范围,后面不及时监管干预,极有可能酿成系统性风险。对此监管机构也予以充分重视,出台了密集的救市措施予以应对。二季度公布的宏观经济数据虽然还在探底,但是已经出现了结构性回暖迹象,相信在政府保增长政策密集出台的情况下,宏观经济有望于三季度企稳。

军工主题是二季度上涨阶段的主要驱动力,军民融合、科研院所改制、阅兵、中国制造2025、军工信息化等主题使军工相关个股出现较大涨幅。我们在组合中对于上述主题股票予以集中配置,在市场上涨阶段表现良好,净值快速上涨。但是在市场快速下跌阶段,此类股票成为下跌"重灾区",缺乏流动性的暴跌使得组合出现了大幅回撤。后续,我们将对组合进行适当调整,对流动性成本予以重视,减轻流动性冲击对组合造成的严重伤害。

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1.691元,本报告期份额净值增长率为13.80%,同期业绩比较基准增长率为18.97%。

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	280,579,764.03	76.10
	其中:股票	280,579,764.03	76.10
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	86,710,221.42	23.52
7	其他资产	1,414,034.40	0.38
8	合计	368,704,019.85	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	240,556,909.25	70.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	27,240,386.28	8.02
J	金融业	12,782,468.50	3.76
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	280,579,764.03	82.58

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	002465	海格通信	599,945	19,312,229.55	5.68
2	300098	高新兴	639,702	18,640,916.28	5.49
3	600522	中天科技	799,965	18,183,204.45	5.35
4	600081	东风科技	799,913	16,966,154.73	4.99
5	002101	广东鸿图	550,000	16,566,000.00	4.88
6	000733	振华科技	599,974	16,193,298.26	4.77
7	300250	初灵信息	246,542	15,186,987.20	4.47
8	300309	吉艾科技	999,966	14,999,490.00	4.41
9	600685	广船国际	260,252	13,985,942.48	4.12
10	600562	国睿科技	236,784	13,724,000.64	4.04

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 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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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

注: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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未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	340,576.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	36,824.01
5	应收申购款	1,036,633.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,414,034.40

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 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末无流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	285,150,404.06
报告期期间基金总申购份额	167,067,203.70
减:报告期期间基金总赎回份额	251,259,336.95
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	200,958,270.81

§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:本基金本报告期末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、《长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金合同》;

3、《长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛航天海工装备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

长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	长盛同辉深100等权重分级
场内简称	长盛同辉
基金主代码	160809
交易代码	160809
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月13日
报告期末基金份额总额	192,248,118.03份
投资目标	本基金运用指数化投资方式,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内,以实现对深证100等权重指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用完全复制法,按照成份股在深证100等权重指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪深证100等权重指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 当预期成份股发生调整、成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪深证100等权重指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,以力争使跟踪误差控制在预定的范围之内。
业绩比较基准	95%×深证100等权重指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	从基金资产整体运作来看,本基金为股票型基金,属于高风险、高收益的基金品种,基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 从投资者具体持有的基金份额来看,在分级运作期内,由于基金收益分配的安排,长盛同辉深100等权重A份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额;长盛同辉深100等权重B份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。
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

下属分级基金简称	长盛同辉深100等权重A	长盛同辉深100等权重B	长盛同辉深100等权重分级
下属分级场内简称	同辉100A	同辉100B	长盛同辉
下属分级基金交易代码	150108	150109	160809
下属分级基金报告期末基金份额总额	88,741,185.00份	88,741,186.00份	14,765,747.03份
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定	高风险、高预期收益	较高风险、较高预期收益

§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	57,251,408.94
2.本期利润	38,755,084.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.2078
4.期末基金资产净值	173,922,928.22
5.期末基金份额净值	0.905

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。

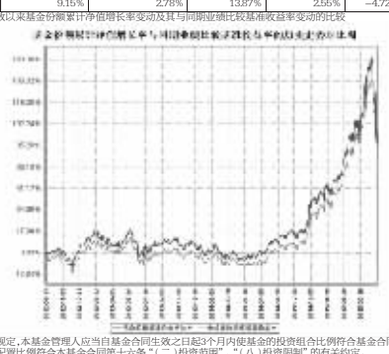
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	9.15%	2.78%	13.87%	2.55%	-4.72%	0.23%

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,本基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止报告日,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十六条"(二)投资范围"、"(八)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		
王超	本基金基金经理,长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理,长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。	2013年1月5日	-	8年	男,1981年9月出生,中国国籍。中央财经大学硕士,金融风险管理师(FRM)。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员,从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理,长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金(本基金)基金经理,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理,长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。

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》及其各项实施细则、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

2015年二季度以来,国内经济增速进一步放缓。二季度的数据指标验证了经济无论是供给端还是需求端均面临较大的下行压力。流动性方面,货币政策整体持续放松,人民币贷款增速和M2增速保持平稳。海外经济中,美国经济持续复苏,日本复苏有反复,欧洲国家温和复苏,新兴经济体加快结构调整。

二季度的资本市场演绎出了"波澜壮阔"的上涨和下跌行情。4~5月创业板指数持续创新高,"互联网+"相关概念板块此起彼伏,呈现快速轮动的上涨行情,创业板在"转型牛"的预期下成为机构博弈的重要阵地;主板方面,以中国制造2025、一带一路、国企改革为龙头的相关概念板块在"改革牛"的预期下成为领涨主题。随着住户部门加速入市,A股市场整体呈现充裕流动性推动下的快速上涨行情。然而进入6月,基于1)监管层去杠杆和清理场外配资的决心,2)市场对央行宽松货币政策阶段性降温的猜测,3)IPO密集出台的抽水效应,4)市场过度上涨后有自身调整需要等因素,上证综指在短时间内出现了1500点的猛烈下跌,大小盘股泥沙俱下,市场恐慌情绪极度蔓延。虽然伴随着一系列救市组合拳的推出,但是市场信心修复需要时间。可以说,二季度的资本市场表现出了杠杆市典型的极涨极跌特征,A股史无前例。

基金同盛在二季度前期主要布局了工业4.0、新能源、国企改革、移动医疗等主题方向,在指数上涨过程中一度取得了较好的收益。然而在6月的系统性调整中,由于没有大幅降仓,使得前期收益受到损失。

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1.262元,本报告期份额净值增长率为4.04%,同期业绩比较基准增长率为6.74%。

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	160,956,526.05	92.05
	其中:股票	160,956,526.05	92.05
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	13,761,062.75	7.87
7	其他资产	134,754.03	0.08
8	合计	174,852,342.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	2,596,169.16	1.49
B	采矿业	3,520,029.42	2.02
C	制造业	92,327,194.14	53.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,156,869.45	0.67
E	建筑业	2,288,379.63	1.32
F	批发和零售业	2,948,355.38	1.70
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	22,352,761.30	12.85
J	金融业	10,029,885.22	5.77
K	房地产业	8,837,439.27	5.08
L	租赁和商务服务业	4,534,116.98	2.61
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,502,009.12	2.59
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	3,749,054.05	2.16
S	综合	1,212,534.33	0.70
	合计	160,054,797.45	92.03

5.2.2 报告期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
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	901,728.60	0.52
S	综合	-	-
	合计	901,728.60	0.52

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

5.3.1 报告期末指数投资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	000917	电广传媒	152,100	4,687,722.00	2.70
2	002292	奥飞动漫	100,152	3,734,668.08	2.15
3	002405	四维图新	79,451	3,479,953.80	2.00
4	300104	乐视网	66,327	3,433,085.52	1.97
5	000024	招商地产	76,470	2,791,155.00	1.60
6	002069	獐子岛	144,714	2,596,169.16	1.49
7	002030	达安基因	57,936	2,566,564.80	1.48
8	300017	网宿科技	54,610	2,534,996.20	1.46
9	000878	云南铜业	132,384	2,454,399.36	1.41
10	002008	大族激光	85,216	2,447,403.52	1.41

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300251	光线传媒	36,214	901,728.60	0.52

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 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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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

注: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

本基金跟踪的标的指数为深证100等权重指数,配置了深证100等权重指数成分股簕子岛。根据簕子岛公司公告,公司于2014年12月4日收到中国证券监督管理委员会大连监管局下发的《行政监管措施决定书》(【2014】5号、【2014】6号),分别为《关于对獐子岛集团股份有限公司采取责令改正监管措施的决定》(【2014】5号,以下简称"《责令改正的决定》")、《关于对獐子岛集团股份有限公司采取出具警示函措施的决定》(【2014】6号,以下简称"《警示函》")。其中,"《责令改正的决定》"涉及:1、部分事项决策程序不规范;2、内部控制制度执行不规范;"《警示函》"涉及:1、海域收购决策存在瑕疵;2、深海底播缺乏充分论证;3、公司深海底播信息披露及风险揭示问题。本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

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,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	33,336.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,368.82
5	应收申购款	99,049.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	134,754.03

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 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资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	000917	电广传媒	4,687,722.00	2.70	重大事项停