长盛中小盘精选混合型证券投资基金

（原长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金）

【2015】第三季度报告

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10月26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10月23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。

长盛中小盘精选混合型证券投资基金自新《长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同》的约定由长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来，变更日期为2015年7月11日（含）。由于本周期届满后变更为一个开放式基金，变更后基金的投资及基金费率等按照《长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》的规定，在保本周期届满后，长盛同鑫保本二号基金的资产全部转入长盛中小盘精选混合型证券投资基金，变更后基金的投资及基金费率等按照《长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》的规定，在保本周期届满后，长盛同鑫保本二号基金的资产全部转入长盛中小盘精选混合型证券投资基金，变更后基金的投资及基金费率等按照《长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金合同》的规定进行运作。就前述基金变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及本基金基金合同约定履行相关准备工作。

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7月11日（基金合同生效日）起至9月30日止（注：长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金报告期自2015年7月1日起至2015年7月10日止）。

§2 基金产品概况

转型后：

基金简称	长盛中小盘精选混合
基金主代码	080015
交易代码	080015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年7月11日
报告期末基金份额总额	59,527,119.24份
投资目标	本基金通过投资具有高成长潜力的中小盘股票，追求基金资产的长期稳定增值。在严控风险的前提下，力争获取超越业绩基准的稳健收益。
投资策略	本基金将结合“自上而下”的资产配置策略和“自下而上”的个股精选策略，重点投资于调研测试通过行业中具有持续成长潜力以及未来成长空间“潜龙在渊”的中小盘上市公司，同时考虑综合品种的估值风险和大类资产的系统风险，通过品种和仓位的动态调整降低资产的波动风险。 1.资产配置 对宏观经济的经济周期进行预测，在此基础上形成对不同资产市场表现的预期和判断，确定基金资产在各类资产间的分配比例。具体操作中，本基金管理人采用经济周期资产配置模型，通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析，对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测，然后利用经济周期理论确定基金资产在各类资产间的战略配置策略。 2.行业配置 不同行业受宏观经济周期、行业自身生命周期以及相关政构性因素的影响在不同时期表现往往具有明显差异。通过宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，结合各行业的相对投资价值与投资时机，挖掘选出预期具有较好增长前景的优势行业，把握行业景气轮换带来的投资机会。 3.股票投资策略 基金管理人自成立及第后每六个月从市场对中国A股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到A股总流通市值20%的流通分股票称为中小盘股票。在前后两次调整排序间间对于未被纳入最近一次排序范围的股票（如新股、恢复上市股票等），如果其流通市值（对未上市新股而言为本基金管理人预计的流通市值）可满足上述条件，也称为中小盘股票。本基金综合运用长盛股票研究分析方法和其它投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合。中小盘股票中的优势股票优先入选。	中证500指数*60%+中证全债指数*40%
业绩比较基准	中证500指数*60%+中证全债指数*40%
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。	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	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	中国银行股份有限公司

注：长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金合同自2012年7月10日生效，第一个保本周期自2012年7月10日开始至2015年7月10日（含）期间。由于本周开始本基金的存续条件，根据基金合同相关规定，届基金自2015年7月11日起变更为非保本的混合型基金，基金名称相应变更为“长盛中小盘精选混合型证券投资基金”，基金投资及基金费率等相关内容也转根据基金合同的相关约定作相应修改。

转型前：

基金简称	长盛同鑫二号保本混合
基金主代码	080015
交易代码	080015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月10日
报告期末基金份额总额	104,951,470.33份
投资目标	本基金采用恒定性价保险策略，在严格控制风险和保证本金安全的基础上，实现相合资产的稳定增长和保本期间收益的最大化。
投资策略	本基金采用恒定性价保险策略（CPPI）和基于期权的组合保险策略（OBPI），其中主要通过CPPI策略动态调整稳健资产与收益资产的投资比例，以确保在本周期期末基金价值不低于事先设定的某一目标价值，从而实现基金资产在本基础上的增值目的。	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和被投票组合，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	3年期银行定期存款税后收益率	中证100指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种，本持有到期而赎回或转换出的基金份额以及基金份额持有人在当期保本期期开始后申购或转换转入的基金份额，不享受保本担保。	本基金为股票型基金，风险中等，将低于证券市场平均收益率。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略，在投资管理上将最大限度的分散非系统性风险，对于跟踪误差的风险，本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。
基金管理人	长盛基金管理有限公司	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	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	转型前
	报告期（2015年7月11日 – 2015年9月30日）
1.本期已实现收益	–3,848,066.38
2.本期利润	–15,102,669.68
3.加权平均基金份额本期利润	–0.2226
4.期末基金资产净值	59,310,106.85
5.期末基金份额净值	0.690

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9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。

转型后：

主要财务指标	转型前
	报告期（2015年7月1日 – 2015年7月10日）
1.本期已实现收益	–4,862,383.27
2.本期利润	–5,750,228.23
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0214
4.期末基金资产净值	129,894,361.36
5.期末基金份额净值	1.237

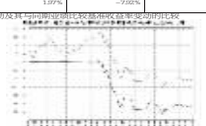
注：1.所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.所列数据截止到2015年7月10日。
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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
2015年7月11日至2015年9月30日	–19.48%	1.97%	–7.02%	2.32%	–11.56%	–0.35%

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.长盛中小盘精选混合型证券投资基金由长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来，变更日期为2015年7月11日（即基金合同生效日），截至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三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。

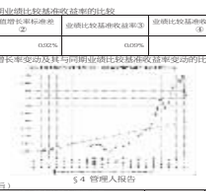
“本基金的投资组合比例为：权益类资产（股票、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他权益类资产）占基金资产的比例为40%–95%；其中，持有的全部权证投资比例不得超过基金资产净值的3%；债券、货币市场工具以及法律法规或不时颁布监管机构允许基金投资的其他固定收益类资产占基金资产的比例为0%–60%，其中基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金投资于中小盘股票的比例不低于股票投资资产的80%。

3.2 基金净值表现（转型前）

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
2015年7月1日至2015年7月10日	–2.75%	0.92%	0.09%	0.01%	–2.84%	0.91%

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



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

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		
蔡宾	本基金基金经理、公司副总经理、社保组合经理、固定收益部总监。	2015年7月11日	–	11年	男，1979年11月出生，中国国籍，毕业于中央财经大学，获硕士学位，CFA（特许金融分析师）。历任宏源基金管理有限公司研究员、基金经理助理、2006年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理、投资经理、长盛和福配置债券基金基金经理、长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理、长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理、长盛同鑫行业配置股票型证券投资基金基金经理、长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理、公司投资总监兼基金管理人投资决策委员会委员、固定收益部总监、社保组合投资总监兼基金管理人投资决策委员会委员、长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理。
赵宗宇	本基金基金经理、主动投资部总监兼基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛电子信息主题沪深300指数证券投资基金基金经理、长盛稳健回报混合型证券投资基金基金经理、长盛稳健成长混合型证券投资基金基金经理、长盛同鑫行业配置股票型证券投资基金基金经理、长盛中证100指数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。	2012年7月10日	2015年7月10日	11年	男，1979年11月出生，中国国籍，同济大学工商管理学硕士、金融学硕士，有丰富的国内证券投资管理经验。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所，2007年2月加入长盛基金管理公司，任长盛工程研究员、产品开发经理、投资产品开发部、金融工程与量化投资部副总监，长盛上证中低价强交易型开放式指数证券投资基金基金经理、长盛上证中低价强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、长盛电子信息主题沪深300指数证券投资基金基金经理、长盛稳健成长混合型证券投资基金基金经理、长盛同鑫行业配置股票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。

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 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

三季度股票市场整体大幅下跌，自贸区、移动支付和油气改革板块大幅下跌，新能源汽车、IP流量变现和苹果概念板块跌幅较少。行业上，采掘、家电和信息技术行业跌幅靠前，银行、医药和食品饮料跑赢市场。风格上，小盘成长股跑输大盘价值股。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

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0.9118元，本报告期内日均跟踪误差为0.0932%，年度化跟踪误差为1.5327%。

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	371,643,375.43	92.52
	其中：股票	371,643,375.43	92.52
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	29,587,335.35	7.37
7	其他资产	449,941.78	0.11
8	合计	401,680,652.56	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	–	–
B	采矿业	15,973,462.24	4.02
C	制造业	102,561,604.95	25.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,138,572.91	3.31
E	建筑业	19,766,265.47	4.98
F	批发和零售业	4,203,906.84	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	8,265,596.63	2.08
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,089,061.07	1.76
J	金融业	103,359,313.40	46.17
K	房地产业	14,626,056.30	3.68
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	1,895,682.42	0.48
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	370,779,106.23	93.37

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	采矿业	572,390.00	0.50
C	制造业	1,236,888.00	1.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	1,141,680.34	0.99
F	批发和零售业	962,172.00	0.84
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	3,913,130.34	3.40

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	600900	长江电力	50,000	1,395,000.00	2.34
2	600519	贵州茅台	7,000	1,352,170.00	2.25
3	600621	华鸿控股	40,000	884,000.00	1.49
4	002701	奥瑞金	40,000	850,000.00	1.43
5	000963	华东医药	12,000	838,200.00	1.41
6	300017	网宿科技	15,000	790,650.00	1.33
7	601888	中国国旅	15,000	784,200.00	1.32
8	000858	万科A	40,000	775,200.00	1.31
9	002572	索菲亚	20,000	760,400.00	1.28
10	300002	智云股份	20,000	705,000.00	1.19

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	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	16,316,995.66	27.51
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	16,316,995.66	27.51

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	112127	12苏酒债	80,000	8,194,604.00	13.82
2	112152	12宏达债	40,000	4,012,400.00	6.77
3	112139	12北新债	30,000	3,036,000.00	5.12
4	122586	12河城开	10,070	1,073,864.80	1.81

注：本基金本报告期末仅持有上述两只债券。

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

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

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	184,677.69
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	660,028.37
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	744,662.46

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。

转型前：

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	29,850.00	0.02
	其中：股票	29,850.00	0.02
2	固定收益投资	107,115,582.00	69.42
	其中：债券	107,115,582.00	69.42
	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	44,023,093.38	28.53
7	其他资产	3,134,614.08	2.03
8	合计	154,304,040.46	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	7,680.00	0.01
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	22,170.00	0.02
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	–	–
S	综合	–	–
	合计	29,850.00	0.02

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	600010	包钢股份	7,000	7,680.00	0.01
2	002572	索菲亚	500	7,680.00	0.01

注：本基金本报告期末（2015年7月10日）仅持有上述两只股票。

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	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	96,989,582.00	74.72
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	10,126,000.00	7.80
7	可转债	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	107,115,582.00	82.52

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	112127	12苏酒债	200,000	20,602,000.00	15.92
2	122204	12双汇节	169,000	17,304,315.00	13.33
3	123164	12通威发	150,000	15,303,000.00	11.79
4	112152	12宏达债	150,000	15,070,500.00	11.61
5	1282512	12西正债(MTN)	100,000	10,126,000.00	7.80

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

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

（1）本基金跟踪的标的指数为中证100指数，配置了中证100指数成分股中国平安。

根据2014年12月8日中国证券监督管理委员会发布对该公司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。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

（2）本基金跟踪的标的指数为中证100指数，配置了中证100指数成分股兴业银行。

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。”本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

（3）本基金跟踪的标的指数为中证100指数，配置了中证100指数成分股中信证券。

根据2015年1月16日中国证券监督管理委员会2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，对中信证券采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。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。 2015年8月25日，公司有几名高级管理人员和员工被公安机关要求协助调查有关问题，调查工作尚在进行之中。2015年9月15日，公司总经理程博明、经纪业务发展与管理委员会运营管理部负责人于新利、信息技术中心汪锦岭等人因涉嫌内幕交易、泄露内幕信息被公安机关依法要求接受调查。本基金做出如下说明：上述事件尚未有最终结论，我们将密切跟踪事件进展，避免潜在风险。

（4）本基金跟踪复制标的指数中证100指数，配置了中证100指数成分股海通证券。

根据2015年1月16日中国证券监督管理委员会2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，对海通证券采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。2015年9月10日，海通证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书（处罚字【2015】73号），海通证券涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案，对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得28,653,000元，并处以85,959,000元罚款。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	428,896.60
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	12,391.18
5	应收申购款	8,654.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	449,941.78

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处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五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	002353	杰瑞股份	864,269.20	0.22	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	476,272,850.46
报告期期间基金总申购份额	36,436,082.90
减：报告期期间基金总赎回份额	79,181,688.71
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	435,527,253.65

§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	10,157,464.32
报告期期间买入/申购总份额	–
报告期期间卖出/赎回总份额	–
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,157,464.32
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	2.33

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

（一）关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛中证100指数证券投资基金的批复；
（二）《长盛中证100指数证券投资基金基金合同》；
（三）《长盛中证100指数证券投资基金托管协议》；
（四）《长盛中证100指数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。

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上。

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10月26日

长盛中信全债指数增强型债券投资基金

【2015】第三季度报告

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10月26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10月23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7月1日起至9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	77,528,049.29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%+中信标普人民币综合指数收益率×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