长盛货币市场基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛货币
基金主代码	080011
交易代码	080011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年12月12日
报告期末基金份额总额	5,160,292,765.28份
投资目标	在力争本金安全、保证资产高流动性的基础上,追求高于业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将根据宏观经济、微观经济运行状况,货币政策和财政政策执行情况,以及货币市场、证券市场运行状况制定投资策略。采用积极的投资策略,通过动态调整伏化投资组合,追求当期收益最大化。在动态调整过程中,基金管理小组将全面考虑收益目标、交易成本、市场流动性等特征,实现收益与风险的平衡。
业绩比较基准	银行一年定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	兴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10月1日 - 2015年12月31日)
1. 本期已实现收益	25,996,561.36
2. 本期利润	25,996,561.36
3. 期末基金资产净值	5,160,292,765.28

注:1、所列数据截止到2015年12月31日。

2、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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

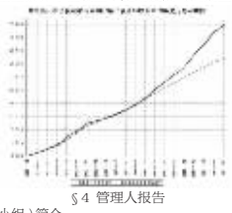
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9044%	0.0143%	0.3938%	0.0003%	0.5106%	0.0140%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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		
段鹏	本基金基金经理,长盛年化收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2014年4月10日	-	8年	男,1982年12月出生,中国国籍。中央财经大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易、债券投资及流动性管理等工作,2013年12月加入长盛基金管理有限公司,现任长盛货币市场基金(本基金)基金经理,长盛年化收益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、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

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。

4.3.2 公平交易专项说明

4.3.3.1 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年四季度,经济基本面继续呈现疲弱态势,通胀整体仍处于较低水平。货币政策方面,10月24日起央行下调了金融机构人民币存款准备金率和人民币存、贷款基准利率,资金面呈现持续宽松局面,债市延续了牛市行情。尤其是12月中下旬,受美联储加息靴子落地、降准预期、配置资金持续增持等因素影响,市场逐渐形成一致预期,并推动收益率加速下行。利率债方面,收益率曲线平坦化下行,十年国债和十年国开债收益率均突破年内低点,下行至2009年初的历史低位。信用债方面,收益率曲线整体下行,受信用风险加速暴露及流动性等因素影响,高评级信用债收益率下行幅度明显大于中低评级信用债。

货币市场方面,受央行公开市场释放流动性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维持在较低水平。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金始终控制资产配置节奏,优化持仓结构,保持组合流动性,合理调整协存和债券配置比例,努力提高组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015年4季度,长盛货币净值收益率为0.9044%,同期业绩比较基准收益率0.3938%。

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	固定收益投资	1,934,618,626.82	33.87
	其中:债券	1,934,618,626.82	33.87
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,440,184,720.27	25.21
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,299,804,824.62	40.26
4	其他资产	37,771,471.01	0.66
5	合计	5,712,379,642.72	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.30	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	544,864,782.70	10.56
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	61
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	131
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	67.45	10.56
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	11.64	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	8.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	10.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	12.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	109.97	10.56

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	摊余成本(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	280,527,348.88	5.44
	其中:政策性金融债	280,527,348.88	5.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,397,668,216.70	27.09
6	中期票据	-	-
7	同业存单	256,423,061.24	4.97
8	其他	-	-
9	合计	1,934,618,626.82	37.49
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111519111	15恒丰银行CD111	1,300,000	128,004,259.48	2.48
2	071550001	15华龙证券CP001	1,000,000	100,012,963.10	1.94
3	041551019	15杭钢铁CP001	600,000	60,001,777.39	1.16
4	071526003	15兴业证券CP003	600,000	59,996,303.17	1.16
5	041553009	15横店CP001	500,000	50,536,865.66	0.98
6	150301	15进出01	500,000	50,035,567.19	0.97
7	071530006	15财通证券CP006	500,000	50,005,893.50	0.97
8	041551007	15海尧CP001	500,000	50,000,031.30	0.97
9	041562071	15德源投资CP001	500,000	49,965,994.85	0.97
10	111593311	15徽商银行CD132	500,000	49,638,695.98	0.96

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	35
报告期内偏离度的最高值	0.4102%
报告期内偏离度的最低值	0.0299%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2196%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.8.2

本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金净值的20%的情况。

5.8.3

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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	37,744,114.26
4	应收申购款	-
5	其他应收款	27,356.75
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	37,771,471.01

5.8.5 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	2,588,442,413.55
报告期期间基金总申购份额	6,636,786,275.50
减:报告期期间基金总赎回份额	4,064,935,923.77
报告期期末基金份额总额	5,160,292,765.28

§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	申购	2015年10月8日	50,000,000.00	50,000,000.00	-
2	申购	2015年11月20日	40,000,000.00	40,000,000.00	-
3	申购	2015年12月11日	70,000,000.00	70,000,000.00	-
4	申购	2015年12月29日	11,000,000.00	11,000,000.00	-
合计			171,000,000.00	171,000,000.00	

§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、《长盛货币市场基金基金合同》;

3、《长盛货币市场基金托管协议》;

4、《长盛货币市场基金招募说明书》;

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
2016年1月20日

长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)

【2015】第四季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛沪深300指数(LOF)
场内简称	长盛300
基金主代码	160807
交易代码	160807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年8月4日
报告期末基金份额总额	71,166,050.02份
投资目标	本基金采取指数化投资,跟踪沪深300指数,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于4%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性,通过抽样方式构建基金股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于0.35%,且年化跟踪误差小于4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×沪深300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	本基金是股票指数型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	946,102.36
2.本期利润	14,255,183.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.1976
4.期末基金资产净值	87,861,171.31
5.期末基金份额净值	1.235

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12月31日。

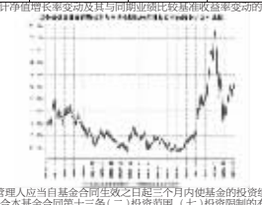
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	18.86%	1.72%	15.67%	1.59%	3.19%	0.13%

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约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十三条(二)投资范围、(七)投资限制的有关约定。截止本报告期末,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
冯雨生	本基金基金经理,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,长盛中证中万一带一路主题指数分级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,长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理。	2011年12月20日	-	8年	男,1983年11月出生,中国国籍。北京大学金融学硕士。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等职务。现任长盛中证100指数证券投资基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF,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,长盛中证中万一带一路主题指数分级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,长盛中证全指证券公司指数分级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,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

四季度股票市场整体大幅上涨,智能穿戴、创投、传感器和芯片国产化概念板块涨幅居前,沪港通、自贸区和国资改革概念板块涨幅较小。行业上,计算机、通信和房地产行业涨幅靠前,钢铁、交运和国防军工跑输市场。风格上,小盘成长股大幅跑赢大盘价值股。

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1.235元,本报告期份额净值增长率为18.86%,同期业绩比较基准增长率为15.67%。本报告期内日均跟踪误差为0.1735%,年度化跟踪误差为2.74%。

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	82,219,108.49	93.18
	其中:股票	82,219,108.49	93.18
2	固定收益投资	68,815.20	0.08
	其中:债券	68,815.20	0.08
	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	5,870,938.52	6.65
7	其他资产	76,175.40	0.09
8	合计	88,235,037.61	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	88,028.64	0.10
B	采矿业	2,607,389.11	2.97
C	制造业	27,442,838.85	31.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,195,970.90	3.64
E	建筑业	3,003,241.58	3.42
F	批发和零售业	2,112,967.50	2.40
G	交通运输、仓储和邮政业	3,002,078.06	3.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,540,649.97	6.31
J	金融业	26,330,019.60	29.97
K	房地产业	4,830,005.38	5.50
L	租赁和商务服务业	895,113.75	1.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	772,219.23	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	132,099.14	0.15
R	文化、体育和娱乐业	1,606,156.66	1.83
S	综合	402,617.72	0.46
	合计	81,961,396.09	93.29

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	257,712.40	0.29
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	257,712.40	0.29

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	601318	中国平安	88,800	3,196,800.00	3.64
2	600016	民生银行	275,152	2,652,465.28	3.02
3	601166	兴业银行	126,033	2,151,383.31	2.45
4	600000	浦发银行	93,862	1,714,858.74	1.95
5	000002	万 科A	66,148	1,615,995.64	1.84
6	600837	海通证券	79,802	1,262,467.64	1.44
7	600030	中信证券	64,607	1,250,145.45	1.42
8	601328	交通银行	192,803	1,241,651.32	1.41
9	601288	农业银行	313,040	1,011,119.20	1.15
10	600519	贵州茅台	4,082	890,651.58	1.01

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	000839	中信国安	12,664	257,712.40	0.29

注:本基金本报告期末仅持有上述1支积极投资股票。

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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	68,815.20	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	68,815.20	0.08

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	110031	航信转债	530	68,815.20	0.08

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

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	30,646.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,205.97
5	应收申购款	44,322.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	76,175.40

5.11.4 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	110031	航信转债	68,815.20	0.08

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

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	000002	万 科A	1,615,995.64	1.84	重大事项停牌

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

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票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

报告期期初基金份额总额	73,545,739.70
报告期期间基金总申购份额	3,136,849.06
减:报告期期间基金总赎回份额	5,516,538.74
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	71,166,050.02

§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	20,375,426.62
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	20,375,426.62
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	28.63

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、《长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)基金合同》;

3、《长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)托管协议》;

4、《长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)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
2016年1月20日

长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

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:2016年1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2016年1月19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10月1日起至12月31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	134,399,904.14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