

长盛成长价值证券投资基金

[2016] 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:2016年4月22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4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、基金净值、基金份额持有人信息等数据,核对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2016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 000001
交易代码 000001
基金运作方式 灵活配置型开放式
基金合同生效日 2002年10月18日
报告期起至基金净值
223,061,304,797
报告期目标 本基金主要投资于股票,通过精选行业,在严格控制风险的前提下挖掘价值,力争在控制风险的前提下实现基金资产的长期稳定增值。
投资目标 本基金通过行业分类的沪港通投资股票投资组合,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略 本基金主要投资于股票,通过精选行业,在严格控制风险的前提下,力争在控制风险的前提下实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准 中证成份指数×60%+中国国债指数×20%+人民币汇率指数×20%
风险收益特征 本基金属股票型基金,在风险控制的前提下,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 长盛基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元
主要财务指标 报告期:2016年1月1日 - 2016年3月31日
1.本期实现收益 14,364,026.09
2.本期利润 -46,781,013.09
3.加权平均基金份额本期利润 -0.02614
4.期末基金资产净值 360,406,405.63
5.期末基金份额总额 1,125,000.00

注:1.所列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列示数字。
2.所列数据截止到2016年3月31日。

3.本期已实现收益指基金本期收入,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变动的比较

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ① -② ③ -④ ②-③ ④-①
过去三个月 -11.42% 2.17% -12.51% 1.09% -0.13%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金简称 长盛成长价值混合
基金主代码 000001
基金运作方式 灵活配置型开放式
基金合同生效日 2002年10月18日
报告期起至基金净值
223,061,304,797
报告期目标 本基金主要投资于股票,通过精选行业,在严格控制风险的前提下挖掘价值,力争在控制风险的前提下实现基金资产的长期稳定增值。
投资目标 本基金通过行业分类的沪港通投资股票投资组合,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准 中证成份指数×60%+中国国债指数×20%+人民币汇率指数×20%
风险收益特征 本基金属股票型基金,在风险控制的前提下,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 长盛基金管理有限公司

§ 3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元
主要财务指标 报告期:2016年1月1日 - 2016年3月31日
1.本期实现收益 14,364,026.09
2.本期利润 -46,781,013.09
3.加权平均基金份额本期利润 -0.02614
4.期末基金资产净值 360,406,405.63
5.期末基金份额总额 1,125,000.00

注:1.所列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列示数字。

2.所列数据截止到2016年3月31日。

3.本期已实现收益指基金本期收入,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。

§ 3.2.3 基金净值表现

3.2.1.1 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

序号 股票代码 基金名称 数据(%) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 300001 深证综指 340,766 18,166,466.02 5.26
2 300102 深证成指 676,433 12,243,419.20 3.42
3 300003 星期五 1,233,398 9,900,500.00 2.76
4 002919 丽珠集团 602,706 9,056,187.04 2.69
5 002138 丽珠集团 682,764 9,476,625.02 2.64
6 000733 丽珠集团 476,008 8,077,625.04 2.42
7 300322 丽珠集团 224,962 7,660,077.01 2.14
8 300105 丽珠集团 503,003 7,564,000.04 2.11
9 600694 丽珠集团 380,466 7,110,226.04 1.98
10 000733 丽珠集团 207,000 6,806,426.00 1.94

3.2.1.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券代码 债券名称 数据(%) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)
1 100001 国债 7,130,000.00 1.99

2 100002 企业债 0 0.00

3 企业债 20,700,000.00 0.57

4 企业债 20,700,000.00 0.57

5 企业债 0 0.00

6 企业债 0 0.00

7 企业债 0 0.00

8 企业债 0 0.00

9 企业债 0 0.00

10 企业债 0 0.00

11 企业债 0 0.00

12 企业债 0 0.00

13 企业债 0 0.00

14 企业债 0 0.00

15 企业债 0 0.00

16 企业债 0 0.00

17 企业债 0 0.00

18 企业债 0 0.00

19 企业债 0 0.00

20 企业债 0 0.00

21 企业债 0 0.00

22 企业债 0 0.00

23 企业债 0 0.00

24 企业债 0 0.00

25 企业债 0 0.00

26 企业债 0 0.00

27 企业债 0 0.00

28 企业债 0 0.00

29 企业债 0 0.00

30 企业债 0 0.00

31 企业债 0 0.00

32 企业债 0 0.00

33 企业债 0 0.00

34 企业债 0 0.00

35 企业债 0 0.00

36 企业债 0 0.00

37 企业债 0 0.00

38 企业债 0 0.00

39 企业债 0 0.00

40 企业债 0 0.00

41 企业债 0 0.00

42 企业债 0 0.00

43 企业债 0 0.00

44 企业债 0 0.00

45 企业债 0 0.00

46 企业债 0 0.00

47 企业债 0 0.00

48 企业债 0 0.00

49 企业债 0 0.00

50 企业债 0 0.00

51 企业债 0 0.00

52 企业债 0 0.00

53 企业债 0 0.00

54 企业债 0 0.00

55 企业债 0 0.00

56 企业债 0 0.00

57 企业债 0 0.00

58 企业债 0 0.00

59 企业债 0 0.00

60 企业债 0 0.00

61 企业债 0 0.00

62 企业债 0 0.00

63 企业债 0 0.00

64 企业债 0 0.00

65 企业债 0 0.00

66 企业债 0 0.00

67 企业债 0 0.00

68 企业债 0 0.00

69 企业债 0 0.00

70 企业债 0 0.00

71 企业债 0 0.00

72 企业债 0 0.00

73 企业债 0 0.00

74 企业债 0 0.00

75 企业债 0 0.00

76 企业债 0 0.00

77 企业债 0 0.00

78 企业债 0 0.00

79 企业债 0 0.00

80 企业债 0 0.00

81 企业债 0 0.00

82 企业债 0 0.00

83 企业债 0 0.00

84 企业债 0 0.00

85 企业债 0 0.00

86 企业债 0 0.00

87 企业债 0 0.00

88 企业债 0 0.00

89 企业债 0 0.00

90 企业债 0 0.00

91 企业债 0 0.00

92 企业债 0 0.00

93 企业债 0 0.00

94 企业债 0 0.00

95 企业债 0 0.00

96 企业债 0 0.00

97 企业债 0 0.00

98 企业债 0 0.00

99 企业债 0 0.00

100 企业债 0 0.00

101 企业债 0 0.00

102 企业债 0 0.00

10