

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2015 年年度摘要

2015 年 12 月 31 日

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

送出日期：2016 年 3 月 26 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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
报告期末基金份额总额	71,166,050.02 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010-09-06

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	张燕
	联系电话	010-82019988	0755-83199084

	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95555
传真		010-82255988	0755-83195201

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	73,176,204.40	-2,485,910.18	-6,614,603.12
本期利润	29,805,688.10	69,046,387.91	-10,264,529.73
加权平均基金份额本期利润	0.2516	0.4420	-0.0504
本期基金份额净值增长率	5.47%	49.36%	-6.22%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2346	0.0029	-0.2163
期末基金资产净值	87,861,171.31	225,649,801.50	134,125,629.58
期末基金份额净值	1.235	1.171	0.784

注：1、所述基金业绩指标不包括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、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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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%

过去六个月	-15.24%	2.78%	-15.61%	2.54%	0.37%	0.24%
过去一年	5.47%	2.52%	5.80%	2.36%	-0.33%	0.16%
过去三年	47.73%	1.77%	46.43%	1.70%	1.30%	0.07%
过去五年	22.71%	1.57%	19.99%	1.53%	2.72%	0.04%
自基金合同生效起至今	29.71%	1.55%	30.54%	1.52%	-0.83%	0.03%

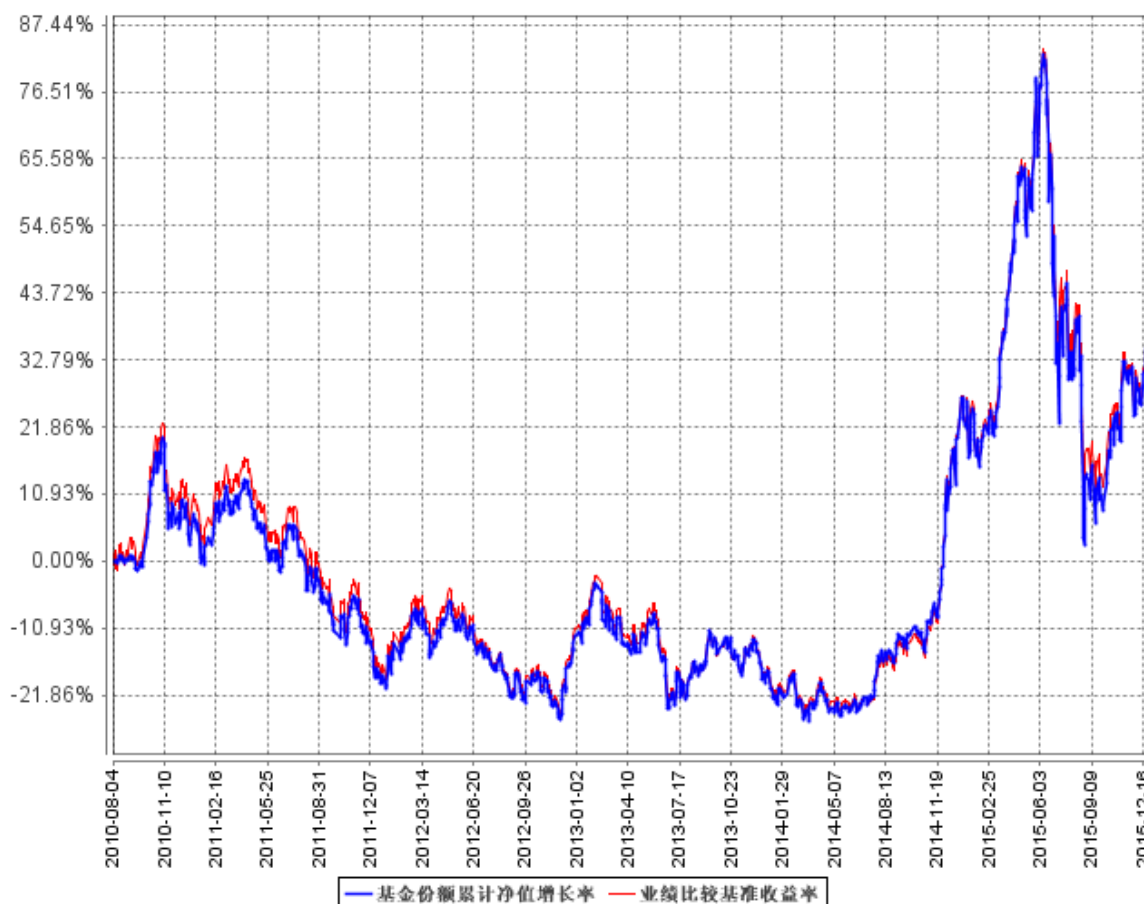
注：本基金业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

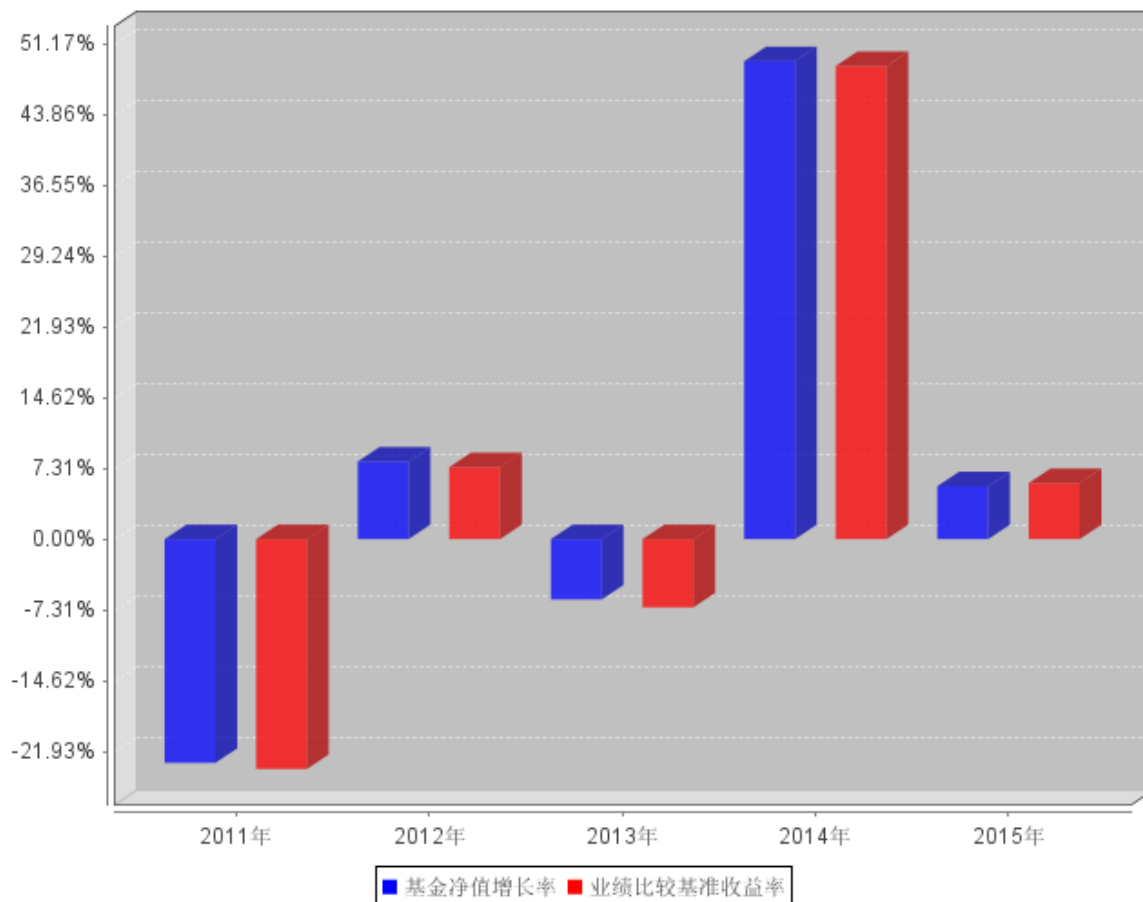
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2015 年度，2014 年度及 2013 年度未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 15000 万元。公司注册地在深

圳，总部设在北京，并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2015 年 12 月 31 日，基金管理人共管理四十二只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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，长盛中证申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，长盛中证申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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。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。

4.3.2 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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2015 年,上半年市场大幅上涨,6 月份开始了 3 个月的大调整,之后四季度恢复性上涨。整体上 A 股全年涨幅较大,生物识别、大数据、网络安全和互联网营销等概念板块涨幅靠前,而大央企重组、天津自贸区、沪股通和新疆区域振兴等概念板块大幅跑输市场。行业上,纺织服装、轻工制造和计算机等行业涨幅靠前,非银金融、银行和采掘等行业涨幅靠后。风格上,小盘股大幅跑赢大盘股。

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 5.47%,同期业绩比较基准增长率为 5.80%。本报告期内日均跟踪误差为 0.1207%,年度化跟踪误差为 1.9084%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年,居民资产配置时增加权益比例的趋势在继续,陆续出台的改革措施也有利于维持投资者的风险偏好。但经济增长不达预期的风险也在增加,股票市场不同风格股票的估值差距也在拉大,全年大幅震荡的概率在增加。

作为指数基金,我们将继续秉承指数化投资策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,控制基金的跟踪误差。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定,本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值小组,参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据,确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理(担任估值小组组长)、公司副总经理和督察长(担任估值小组副组长)、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组,负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验,具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十七条中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至 2015 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 16,695,121.29 元，其中：未分配利润已实现部分为 40,045,828.56 元，未分配利润未实现部分为-23,350,707.27 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师陈玲、沈兆杰于 2016 年 3 月 23 日对本基金 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2016)第 20283 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	5,870,938.52	16,824,509.79
结算备付金	-	505,357.27
存出保证金	30,646.54	16,914.87
交易性金融资产	82,287,923.69	210,376,488.00
其中：股票投资	82,219,108.49	210,376,488.00
基金投资	-	-
债券投资	68,815.20	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,205.97	3,036.11
应收股利	-	-
应收申购款	44,322.89	199,841.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	88,235,037.61	227,926,147.59

负债和所有者权益	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	65,356.47	1,743,019.25
应付管理人报酬	56,151.76	130,934.30
应付托管费	11,230.35	26,186.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	10,968.49	99,972.64
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	230,159.23	276,233.02
负债合计	373,866.30	2,276,346.09
所有者权益:		
实收基金	71,166,050.02	192,732,025.26
未分配利润	16,695,121.29	32,917,776.24
所有者权益合计	87,861,171.31	225,649,801.50
负债和所有者权益总计	88,235,037.61	227,926,147.59

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.235 元，基金份额总额 71,166,050.02 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	32,152,282.35	70,776,205.02
1.利息收入	75,272.64	56,120.06
其中：存款利息收入	75,225.53	56,067.47
债券利息收入	47.11	52.59
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）	75,184,626.78	-829,057.48
其中：股票投资收益	73,196,285.46	-3,529,396.59
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,225.28	41,732.98
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,987,116.04	2,658,606.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-43,370,516.30	71,532,298.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	262,899.23	16,844.35
减：二、费用	2,346,594.25	1,729,817.11
1. 管理人报酬	1,156,756.60	941,091.10
2. 托管费	231,351.31	188,218.31
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	569,971.14	225,546.92
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	388,515.20	374,960.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	29,805,688.10	69,046,387.91
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	29,805,688.10	69,046,387.91

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	192,732,025.26	32,917,776.24	225,649,801.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	29,805,688.10	29,805,688.10

期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-121,565,975.24	-46,028,343.05	-167,594,318.29
其中:1.基金申购款	103,795,375.51	25,496,771.45	129,292,146.96
2.基金赎回款	-225,361,350.75	-71,525,114.50	-296,886,465.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	71,166,050.02	16,695,121.29	87,861,171.31
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	171,150,229.64	-37,024,600.06	134,125,629.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	69,046,387.91	69,046,387.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	21,581,795.62	895,988.39	22,477,784.01
其中:1.基金申购款	96,082,860.62	-8,524,808.05	87,558,052.57
2.基金赎回款	-74,501,065.00	9,420,796.44	-65,080,268.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	192,732,025.26	32,917,776.24	225,649,801.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>周兵</u>	<u>杨思乐</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以

下简称“中国证监会”)证监基金字[2010]第 646 号《关于核准长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 898,648,405.80 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 193 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2010 年 8 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 898,915,869.33 份基金份额,其中认购资金利息折合 267,463.53 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第 276 号文审核同意,本基金 112,932,582 份基金份额于 2010 年 9 月 6 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票资产投资比例不低于基金资产净值的 90%,其中,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%;保持不低于基金资产净值 5%的现金以及到期日在一年以内的政府债券。本基金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%。本基金的业绩比较基准为:95%×沪深 300 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)。本基金标的指数使用费由基金管理人长盛基金管理有限公司承担,不计入本基金费用。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2016 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股

息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司(“长盛创富”)	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国元证券	237,168,083.72	73.65%	102,253,074.37	67.22%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月 31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
国元证券	20,610.10	100.00%	600,879.20	93.44%

7.4.8.1.3 权证交易

注：本基金本期末及上年度末未通过关联方交易单元发生权证交易。

7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国元证券	216,359.14	73.64%	7,258.64	66.18%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国元证券	93,091.67	67.22%	70,828.52	70.85%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,156,756.60
其中：支付销售机构的客户维护费	405,494.40	475,290.86

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.75% ÷ 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	231,351.31	188,218.31

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% ÷ 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金合同生效日（ 2010 年 8 月 4 日）持有的 基金份额	-	-
期初持有的基金份额	11,375,426.62	-
期间申购/买入总份额	9,000,000.00	11,375,426.62
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	20,375,426.62	11,375,426.62
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	28.6300%	5.9000%

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2015 年 12 月 31 日		2014 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
长盛创富	-	-	7,082,027.58	3.6700%

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	5,870,938.52	72,348.19	16,824,509.79	53,194.76

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总 额	期末估值总 额	备注
000002	万 科 A	2015 年 12 月 18 日	重大事 项停牌	24.43	-	-	66,148	680,536.59	1,615,995.64	-
600649	城投控 股	2015 年 12 月 30 日	重大事 项停牌	23.16	2016 年 1 月 7 日	20.84	17,016	126,319.21	394,090.56	-
601377	兴业证 券	2015 年 12 月 29 日	重大事 项停牌	11.00	2016 年 1 月 7 日	9.40	31,441	304,086.90	345,851.00	-
002465	海格通 信	2015 年 12 月 30 日	重大事 项停牌	16.69	2016 年 2 月 4 日	15.02	15,676	153,432.98	261,632.44	-
002065	东华软 件	2015 年 12 月 22 日	重大事 项停牌	25.10	-	-	7,941	165,639.68	199,319.10	-
000712	锦龙股 份	2015 年 12 月 25 日	重大事 项停牌	29.12	2016 年 1 月 4 日	28.00	4,600	201,378.11	133,952.00	-
600873	梅花生 物	2015 年 12 月 17 日	重大事 项停牌	9.14	-	-	14,612	161,333.94	133,553.68	-
600783	鲁信创 投	2015 年 12 月 31 日	重大事 项停牌	39.07	2016 年 1 月 4 日	37.60	2,992	63,639.81	116,897.44	-
600153	建发股	2015 年 6 月 29 日	重大事	14.69	-	-	25,521	230,076.62	374,903.49	-

	份		项停牌							
600271	航天信息	2015 年 10 月 12 日	重大事项停牌	71.47	-	-	6,116	194,024.73	437,110.52	-
600578	京能电力	2015 年 11 月 5 日	重大事项停牌	5.96	2016 年 2 月 24 日	5.49	10,665	58,476.69	63,563.40	-
600690	青岛海尔	2015 年 10 月 19 日	重大事项停牌	11.65	2016 年 2 月 1 日	8.93	24,492	206,260.36	285,331.80	-
601018	宁波港	2015 年 8 月 4 日	重大事项停牌	7.63	2016 年 2 月 22 日	7.34	28,897	103,928.93	220,484.11	-
000876	新希望	2015 年 8 月 17 日	重大事项停牌	17.61	2016 年 3 月 2 日	17.09	10,607	198,977.11	186,789.27	-
300104	乐视网	2015 年 12 月 7 日	重大事项停牌	60.17	-	-	8,800	580,592.93	529,496.00	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 76,920,138.04 元，属于第二层次的余额为 5,367,785.65 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 205,751,761.13 元，第二层次 4,624,726.87，无

属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	其他各项资产	76,175.40	0.09
8	合计	88,235,037.61	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	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

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

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

8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 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

8.3.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.csfunds.com.cn> 网站的年度报告正文。

8.3.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601328	交通银行	2,582,242.20	1.14
2	601766	中国中车	2,578,598.05	1.14
3	601318	中国平安	2,116,220.07	0.94
4	601398	工商银行	1,992,246.00	0.88
5	600016	民生银行	1,954,750.00	0.87
6	600030	中信证券	1,861,053.41	0.82
7	601288	农业银行	1,804,554.00	0.80
8	601166	兴业银行	1,403,041.00	0.62
9	300059	东方财富	1,346,709.00	0.60
10	601939	建设银行	1,263,078.41	0.56
11	000333	美的集团	1,260,059.00	0.56
12	600887	伊利股份	1,087,527.00	0.48
13	600837	海通证券	1,031,136.00	0.46
14	600000	浦发银行	1,026,091.00	0.45
15	600637	东方明珠	996,380.90	0.44
16	601988	中国银行	961,469.00	0.43
17	300104	乐视网	957,463.00	0.42

18	001979	招商蛇口	876,739.20	0.39
19	000338	潍柴动力	868,823.00	0.39
20	000166	申万宏源	866,542.84	0.38

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	10,176,806.67	4.51
2	600030	中信证券	7,916,457.19	3.51
3	600016	民生银行	7,742,269.90	3.43
4	601166	兴业银行	6,193,601.72	2.74
5	601988	中国银行	4,707,647.73	2.09
6	600837	海通证券	4,515,772.29	2.00
7	600000	浦发银行	4,206,699.07	1.86
8	601328	交通银行	3,963,677.57	1.76
9	601939	建设银行	3,756,861.87	1.66
10	000002	万科A	3,334,926.57	1.48
11	601398	工商银行	3,291,928.77	1.46
12	601169	北京银行	3,256,758.31	1.44
13	601288	农业银行	3,211,034.25	1.42
14	601668	中国建筑	2,661,701.71	1.18
15	000651	格力电器	2,561,796.49	1.14
16	601601	中国太保	2,542,035.97	1.13
17	600519	贵州茅台	2,445,100.65	1.08
18	000001	平安银行	2,423,925.95	1.07
19	601818	光大银行	2,377,146.87	1.05
20	600887	伊利股份	2,343,322.89	1.04

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	85,796,841.22
卖出股票收入（成交）总额	243,766,556.62

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费

用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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（可交换债）	68,815.20	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	68,815.20	0.08

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110031	航信转债	530	68,815.20	0.08

注：本基金本报告期仅持有上述 1 支债券。

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，配置了沪深 300 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。

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，配置了沪深 300 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。

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，配置了沪深 300 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。

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110031	航信转债	68,815.20	0.08

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	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

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,293	21,611.31	23,299,780.27	32.74%	47,866,269.75	67.26%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	杨静芳	990,049.00	34.49%
2	陈放	158,443.00	5.52%
3	深圳市点通数据有限公司	147,600.00	5.14%
4	李素升	134,746.00	4.69%
5	王改琪	120,008.00	4.18%
6	陈梅芳	100,005.00	3.48%
7	马曦琴	70,000.00	2.44%
8	曲秋霞	67,010.00	2.33%
9	李泽华	66,007.00	2.30%
10	缪晏	60,000.00	2.09%

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	1,204,550.07	1.6926%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年8月4日）基金份额总额	898,915,869.33
本报告期期初基金份额总额	192,732,025.26
本报告期基金总申购份额	103,795,375.51
减：本报告期基金总赎回份额	225,361,350.75
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	71,166,050.02

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司第六届董事会第七次会议决议，公司聘任林培富、王宁、蔡宾担任公司副总经理；聘任孙杰、刁俊东为公司高管人员。以上三名副总经理于2015年4月22日通过中国证券投资基金业协会（以下简称基金业协会）组织的高级管理人员证券投资法律知识考试，公司已及时向基金业协会进行备案。

11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未发生变动。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应付给该会计师事务所的报酬 50,000.00 元，已连续为本基金提供审计服务 6 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国元证券	1	237,168,083.72	73.65%	216,359.14	73.64%	-
招商证券	1	84,859,070.90	26.35%	77,456.71	26.36%	-
华泰联合证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国元证券	20,610.10	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

- (2) 资力雄厚，信誉良好。
- (3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。
- (5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需 要，并能为本公司基金提供全面的信息服 务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；
- (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；
- (3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；
- (4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；
- (5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；
- (6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无。

长盛基金管理有限公司
2016 年 3 月 26 日