

# 长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资 基金 2015 年年度报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国农业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。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（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 6 月 4 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 11        |
| 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.....             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 12        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 13        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 14        |
| 4.9 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.....       | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 14        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 15        |
| 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.....      | 15        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>15</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 15        |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 15        |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>16</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 16        |
| 7.2 利润表.....                                 | 17        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 18        |
| 7.4 报表附注.....                                | 19        |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>38</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 38        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 39        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 39        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 42        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 48        |
| 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.....      | 48        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 49        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 49        |
| 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 .....    | 49        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 49        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 49        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 49        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>50</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 50        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 51        |
| 9.3 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 .....     | 51        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>51</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>51</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 51        |
| 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 .....      | 51        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 52        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 52        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 52        |
| 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 .....         | 52        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 52        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 54        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                     | <b>59</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 59        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 59        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 59        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                       |
|------------|-----------------------|
| 基金名称       | 长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 长盛国企改革混合              |
| 基金主代码      | 001239                |
| 交易代码       | 001239                |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                |
| 基金合同生效日    | 2015年6月4日             |
| 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          |
| 报告期末基金份额总额 | 2,973,749,932.59份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                   |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金的投资目标在于把握中国国企改革所蕴含的投资机会，分享国企改革带给上市公司的投资收益，在严格控制投资风险的基础上，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 | <p>（一）大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>（二）国企改革主题上市公司的界定</p> <p>本基金投资的国企改革主题公司，主要分为两类：</p> <p>一是直接或间接受益于已经公告的国企改革方案（含预案，下同）的上市公司。国企改革方案包括但不限于资产重组方案、股权激励方案及纳入国有资本投资运营平台方案等。该类上市公司包括通过改革将使经营状况和盈利能力获得提升的国有企业，参与国有企业改革并使经营状况和盈利能力获得提升的上市公司，以及其他在国企改革进程中获得发展机遇或利润增长点的上市公司。</p> <p>二是处于国企改革的重点区域、行业，且改革预期较确定的国有企业，或与上述国有企业有较大业务关联的上市公司。</p> <p>（三）股票投资策略</p> <p>本基金将考察改革对央企和地方国企不同的影响、改革对各个行业的不同影响，筛选出具有投资机会的上市公司股票，构建并动态调整国企改革主题股票精选池。通过对内在价值、相对价值、收购价值等方面的研究，而筛选出估值水平相对合理或低估的上市公司</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | 股票，并本着审慎精选的原则，根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。                       |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%                              |
| 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。 |

## 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                    | 中国农业银行股份有限公司                  |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 叶金松                           | 林葛                            |
|         | 联系电话 | 010-82019988                  | 010-66060069                  |
|         | 电子邮箱 | yejs@csfunds.com.cn           | tgxxpl@abchina.com            |
| 客户服务电话  |      | 400-888-2666、<br>010-62350088 | 95599                         |
| 传真      |      | 010-82255988                  | 010-68121816                  |
| 注册地址    |      | 深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼10D      | 北京市东城区建国门内大街69号               |
| 办公地址    |      | 北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座20-22层    | 北京复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层世贸中心东座F9 |
| 邮政编码    |      | 100088                        | 100031                        |
| 法定代表人   |      | 高新                            | 刘士余                           |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》  |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的办公场所  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                 | 办公地址                         |
|--------|--------------------|------------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层 |
| 注册登记机构 | 长盛基金管理有限公司         | 北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座20-22层   |

## § 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6月4日(基金合同生效日)-2015年12月31日 |
| 本期已实现收益       | -1,394,824,036.86              |
| 本期利润          | -1,184,336,611.61              |

|                      |                   |
|----------------------|-------------------|
| 加权平均基金份额本期利润         | -0.3720           |
| 本期加权平均净值利润率          | -54.95%           |
| 本期基金份额净值增长率          | -35.60%           |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>2015 年末</b>    |
| 期末可供分配利润             | -1,281,153,090.36 |
| 期末可供分配基金份额利润         | -0.4308           |
| 期末基金资产净值             | 1,913,905,318.64  |
| 期末基金份额净值             | 0.644             |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>2015 年末</b>    |
| 基金份额累计净值增长率          | -35.60%           |

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。

4、本基金基金合同生效日为 2015 年 6 月 4 日，截止本报告期末本基金成立未满一年。

## 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

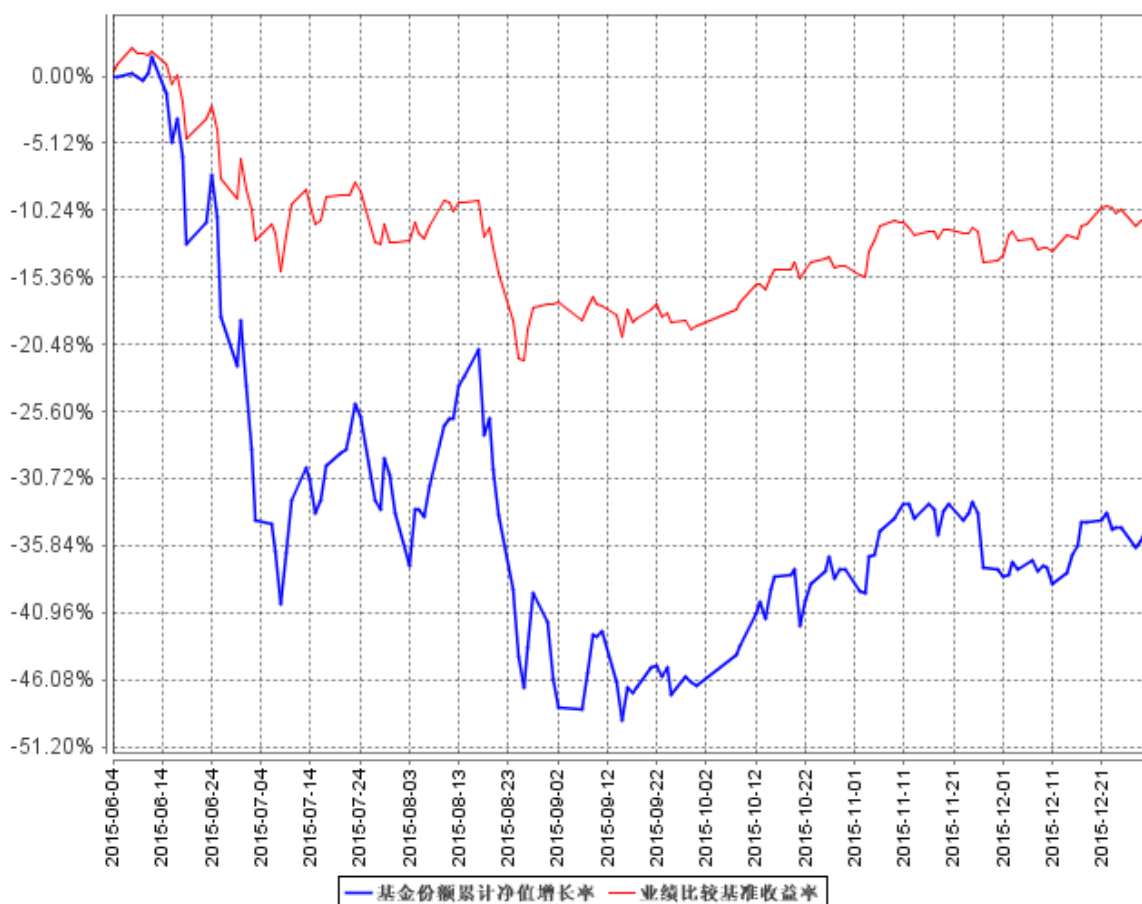
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 20.37%   | 2.18%       | 9.46%      | 0.83%         | 10.91%  | 1.35% |
| 过去六个月      | -20.79%  | 3.54%       | -5.46%     | 1.34%         | -15.33% | 2.20% |
| 自基金合同生效起至今 | -35.60%  | 3.54%       | -11.42%    | 1.39%         | -24.18% | 2.15% |

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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 50%、50%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



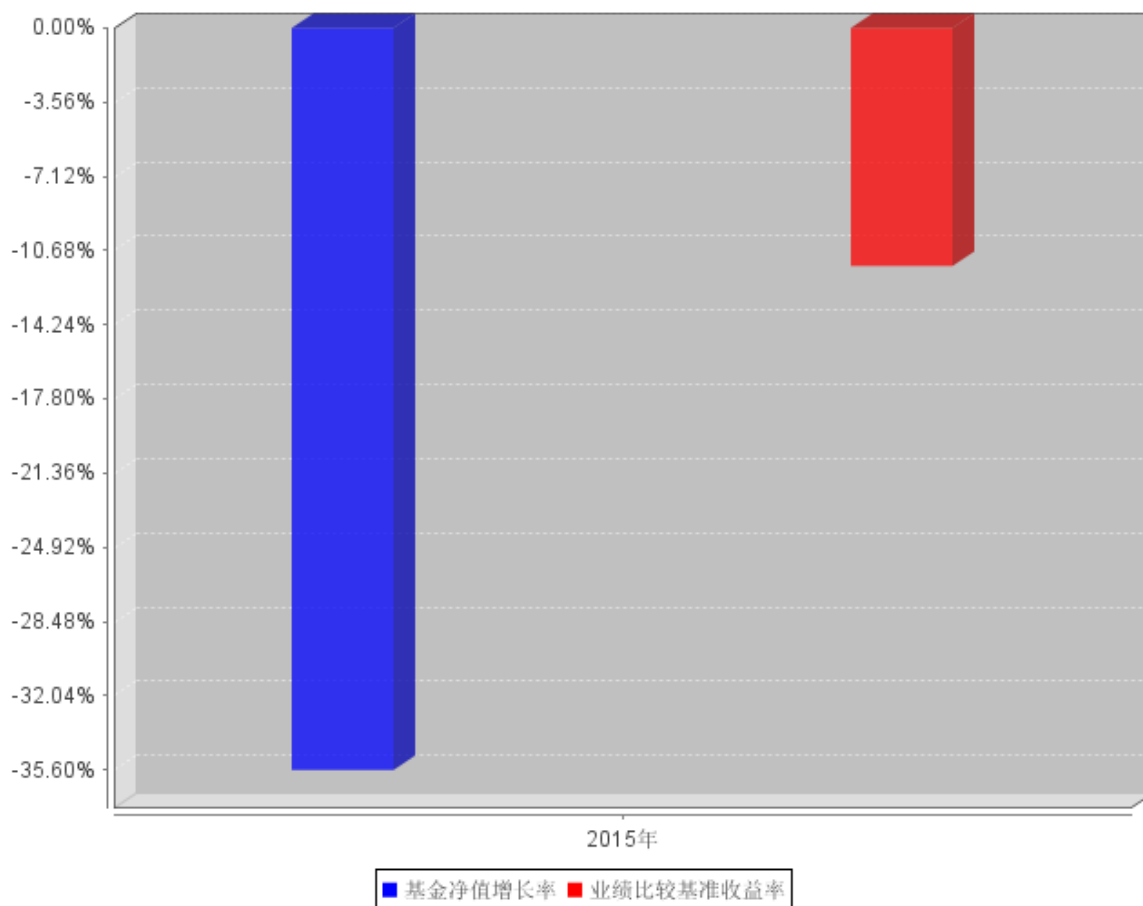
注：1、本基金合同生效日为 2015 年 6 月 4 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六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十二条（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。截止报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。



### 3.2.3 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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



注：本基金合同于 2015 年 6 月 4 日生效，合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止会计期间未进行利润分配。

## § 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 18900 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 |        |  |
| 田间 | 本基金基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。 | 2015年6月4日       | -    | 7年     | 女，1978年11月出生，中国国籍。中央财经大学经济学硕士。2008年7月加入长盛基金管理有限公司，曾任行业研究员，基金经理助理、同盛证券投资基金基金经理等职务。现任长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金（本基金）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。

3、报经中国证券投资基金业协会同意，自 2016 年 2 月 17 日起，吴博文同志兼任长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理。

#### 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 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

2015 年，国内宏观经济增速逐季放缓，无论是供给端还是需求端均面临较大的下行压力。全

年流动性保持持续宽松，人民币贷款增速和 M2 增速保持平稳增长。海外经济中，美国经济持续复苏，日本经济复苏中有反复，欧洲国家温和复苏，新兴经济体加快结构调整。

2015 年 1-5 月，A 股市场在“杠杆牛、改革牛、转型牛”的推动下，演绎出了波澜壮阔的上涨行情。在“周期搭台成长唱戏”的结构下，一系列题材概念板块快速交替上涨，其中以互联网+、中国制造 2025、工业 4.0、新能源汽车、一带一路、国企改革等主题带动下的计算机、通信、传媒、电子、电力设备、机械等行业成为市场领涨行业。传统行业则在上涨的后期出现了一定程度的估值修复行情。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，市场恐慌情绪极度蔓延，上证综指在去杠杆的连续负反馈下持续快速暴跌，大小盘股泥沙俱下，杠杆市极涨极跌的典型特征表现得淋漓尽致。整个三季度，伴随着一系列政府救市组合拳的推出，资本市场经历了去杠杆、清配资、挤泡沫的反复而激烈的震荡过程，进入三季度末，风险偏好逐步修复，市场逐步企稳。四季度伴随着资金的小增量行情，A 股市场迎来了近一个季度的反弹行情。其中以网络安全、互联网金融、体育娱乐、文化教育、虚拟现实、量子通信、无人驾驶、汽车电子、军工电子等一系列新兴题材作为催化剂引领市场，计算机、传媒、通信、电子等行业为反弹龙头，期间交织着券商和地产的阶段性脉冲行情。

长盛国企改革主题基金成立于 2015 年 6 月 4 日，在成立的半年中伴随着市场的暴涨暴跌。长盛国企改革基金对于国企改革主题的布局主要从四个维度（央企-地方国企-试点集团-行业龙头）出发，坚持自上而下与自下而上相结合的思路。在主题之外阶段性参与了新能源、娱乐传媒、电子信息等方向的投资机会，在一定的市场阶段取得了较好的收益。而在 6-8 月的系统性下跌中仍然未能避免受到损失。未来在投资策略和风格上，坚持自上而下与自下而上相结合，兼顾长期景气与中短期催化，成长与蓝筹的均衡，以避免短期新因素造成风格切换带来的净值波动。

#### 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 0.644 元，本报告期份额净值增长率为-35.60%，同期业绩比较基准增长率为-11.42%。

#### 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，国内经济内生性下行压力仍然较大，尽管存在资产荒与货币相对宽松，但市场风险偏好难以提升，进入股市的中长期资金有限。大小非解禁、注册制加快推出即其他扩容手段（如战略新兴板、中概股回归）均将导致股票供给增加，其中新兴行业的高估值将面临分化。

鉴于市场不确定性，2016 年将重点关注结构性机会，兼顾均衡。重点关注十三五规划的投资

机会、国企改革进一步落地形成的投资机会、供给侧改革带来的传统行业收缩和结构改善、新一轮的微刺激所带来的投资机会、新兴行业中符合政策导向的新题材。在操作上会在集中和分散、成长和蓝筹之间寻求均衡。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作，保障资产委托人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时敦促有关部门改进、完善，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

1、强调合规培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训等多种方式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，强化员工合规理念，深化员工合规意识，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、强调制度/流程建设，扎实公司内控制度建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，保证公司制度/流程的合法合规、全面、适时、有效。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，确保制度/流程严肃性与执行力。报告期内，监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核工作，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、登记注册、产品开发等等；并根据业务发展需要，以及日常监督中发现问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，以保障公司制度/流程的严肃性与执行力。

5、加强员工行为合规的检查监督。报告期内，监察稽核部借助信息技术系统，通过完善员工投资报备系统、建设员工合规档案系统等，提高员工行为合规管理水平，督促员工自觉合规。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

#### 4.7 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。

#### **4.8 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十六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-1,281,153,090.36 元，其中，未分配利润已实现部分为-1,281,153,090.36 元，未分配利润未实现部分为 221,308,476.41 元。

#### **4.9 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**

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长盛基金管理

有限公司 2015 年 6 月 4 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

|            |                              |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                            |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                      |
| 审计报告编号     | 安永华明（2016）审字第 60468688_A16 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题       | 审计报告  |
|--------------|---|
| 审计报告收件人      | 长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 引言段          | 我们审计了后附的长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表和 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间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。 |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是基金管理人长盛基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。                     |
| 注册会计师的责任段    | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错                         |

|           |   |     |
|-----------|---|-----|
|           | <p>报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |     |
| 审计意见段     | <p>我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>   |     |
| 注册会计师的姓名  | 汤骏  | 马剑英 |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）  |     |
| 会计师事务所的地址 | 中国 北京   |     |
| 审计报告日期    | 2016 年 3 月 22 日   |     |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 206,079,483.61          |
| 结算备付金      |         | 8,459,236.66            |
| 存出保证金      |         | 6,242,329.29            |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 1,695,445,851.44        |
| 其中：股票投资    |         | 1,695,445,851.44        |
| 基金投资       |         | -                       |
| 债券投资       |         | -                       |
| 资产支持证券投资   |         | -                       |
| 贵金属投资      |         | -                       |
| 衍生金融资产     | 7.4.7.3 | -                       |
| 买入返售金融资产   | 7.4.7.4 | -                       |
| 应收证券清算款    |         | 20,349,635.79           |



|                 |            |                            |
|-----------------|------------|----------------------------|
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 103,739.41                 |
| 应收股利            |            | -                          |
| 应收申购款           |            | 491,020.71                 |
| 递延所得税资产         |            | -                          |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          |
| 资产总计            |            | 1,937,171,296.91           |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                            |
| 短期借款            |            | -                          |
| 交易性金融负债         |            | -                          |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                          |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                          |
| 应付证券清算款         |            | 7,678,056.45               |
| 应付赎回款           |            | 6,424,531.00               |
| 应付管理人报酬         |            | 2,453,882.80               |
| 应付托管费           |            | 408,980.50                 |
| 应付销售服务费         |            | -                          |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 6,126,999.14               |
| 应交税费            |            | -                          |
| 应付利息            |            | -                          |
| 应付利润            |            | -                          |
| 递延所得税负债         |            | -                          |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 173,528.38                 |
| 负债合计            |            | 23,265,978.27              |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 2,973,749,932.59           |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | -1,059,844,613.95          |
| 所有者权益合计         |            | 1,913,905,318.64           |
| 负债和所有者权益总计      |            | 1,937,171,296.91           |

注：(1) 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.644 元，基金份额总额为 2,973,749,932.59 份。

(2) 本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本 期 |
|-----|-----|-----|
|-----|-----|-----|

|                            |            | 2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
|----------------------------|------------|--------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |            | -1,126,244,456.07              |
| 1. 利息收入                    |            | 2,605,794.59                   |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11   | 2,605,794.59                   |
| 债券利息收入                     |            | -                              |
| 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）          |            | -1,341,269,224.66              |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12   | -1,352,495,764.82              |
| 基金投资收益                     |            | -                              |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13   | -                              |
| 资产支持证券投资                   |            | -                              |
| 贵金属投资收益                    |            | -                              |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.14   | -                              |
| 股利收益                       | 7.4.7.15   | 11,226,540.16                  |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.16   | 210,487,425.25                 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -                              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.17   | 1,931,548.75                   |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 58,092,155.54                  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 18,424,917.90                  |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 3,070,819.70                   |
| 3. 销售服务费                   |            | -                              |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.18   | 36,365,445.37                  |
| 5. 利息支出                    |            | -                              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -                              |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.19   | 230,972.57                     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -1,184,336,611.61              |
| 减：所得税费用                    |            | -                              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -1,184,336,611.61              |

注：本基金合同于 2015 年 6 月 4 日生效，无上年度可比期间。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |                   |                   |
|--|--------------------------------------|-------------------|-------------------|
|  | 实收基金                                 | 未分配利润             | 所有者权益合计           |
| 一、基金合同生效日所有者权益(基金净值)                   | 3,250,867,544.91                     | -                 | 3,250,867,544.91  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                    | -1,184,336,611.61 | -1,184,336,611.61 |
| 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)      | -277,117,612.32                      | 124,491,997.66    | -152,625,614.66   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 435,327,278.89                       | -143,899,977.13   | 291,427,301.76    |
| 2. 基金赎回款                               | -712,444,891.21                      | 268,391,974.79    | -444,052,916.42   |
| 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)                        | 2,973,749,932.59                     | -1,059,844,613.95 | 1,913,905,318.64  |

注：本基金合同于 2015 年 6 月 4 日生效，无上年度可比期间。

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

长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]568号《关于准予长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由长盛基金管理有限公司于2015年5月13日至2015年6月2日向社会公开募集，基金合同于2015年6月4日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。截至2015年6月4日止，本基金已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币3,249,504,878.03元，折合3,249,504,878.03份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币1,362,666.88元，折合1,362,666.88份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币3,250,867,544.91元，折合3,250,867,544.91份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行、上市的股票）、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的 0%-95%；其中投资于国企改革主题的股票和债券不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准：50%\*沪深 300 指数收益率+50%\*中证综合债指数收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民

币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要

意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回

基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；



(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 20%，若基金合同生效不满三个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 投资者的现金红利保留到小数点后第 2 位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### **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**

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### **7.4.6 税项**

#### **7.4.6.1 印花税**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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。

#### 7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2015年12月31日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 206,079,483.61     |
| 定期存款         | -                  |
| 其中：存款期限1-3个月 | -                  |
| 其他存款         | -                  |
| 合计：          | 206,079,483.61     |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2015年12月31日 |                  |                |
|---------------|--------------------|------------------|----------------|
|               | 成本                 | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            | 1,484,958,426.19   | 1,695,445,851.44 | 210,487,425.25 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场              | -                | -              |
|               | 银行间市场              | -                | -              |
|               | 合计                 | -                | -              |
| 资产支持证券        | -                  | -                | -              |
| 基金            | -                  | -                | -              |
| 其他            | -                  | -                | -              |
| 合计            | 1,484,958,426.19   | 1,695,445,851.44 | 210,487,425.25 |

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015年12月31日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 97,123.61          |
| 应收定期存款利息   | -                  |
| 应收其他存款利息   | -                  |
| 应收结算备付金利息  | 3,806.70           |
| 应收债券利息     | -                  |
| 应收买入返售证券利息 | -                  |
| 应收申购款利息    | -                  |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  |
| 其他         | 2,809.10           |
| 合计         | 103,739.41         |

**7.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 6,126,999.14       |
| 银行间市场应付交易费用 | -                  |
| 合计          | 6,126,999.14       |

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 13,528.38          |
| 预提信息披露费     | 90,000.00          |
| 预提审计费       | 70,000.00          |
| 合计          | 173,528.38         |

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |                  |
|---------|--------------------------------------|------------------|
|         | 基金份额(份)                              | 账面金额             |
| 基金合同生效日 | 3,250,867,544.91                     | 3,250,867,544.91 |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 本期申购          | 435,327,278.89   | 435,327,278.89   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -712,444,891.21  | -712,444,891.21  |
| 本期末           | 2,973,749,932.59 | 2,973,749,932.59 |

注：(1) 申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

(2) 本基金合同生效日为 2015 年 6 月 4 日。

(3) 本基金设立时，已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 3,249,504,878.03 元，折合 3,249,504,878.03 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 1,362,666.88 元，折合 1,362,666.88 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 3,250,867,544.91 元，折合 3,250,867,544.91 份基金份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分             | 未实现部分          | 未分配利润合计           |
|----------------|-------------------|----------------|-------------------|
| 基金合同生效日        | -                 | -              | -                 |
| 本期利润           | -1,394,824,036.86 | 210,487,425.25 | -1,184,336,611.61 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 113,670,946.50    | 10,821,051.16  | 124,491,997.66    |
| 其中：基金申购款       | -141,440,363.55   | -2,459,613.58  | -143,899,977.13   |
| 基金赎回款          | 255,111,310.05    | 13,280,664.74  | 268,391,974.79    |
| 本期已分配利润        | -                 | -              | -                 |
| 本期末            | -1,281,153,090.36 | 221,308,476.41 | -1,059,844,613.95 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------|---|
| 活期存款利息收入  | 2,420,660.60                                    |
| 定期存款利息收入  | -   |
| 其他存款利息收入  | -   |
| 结算备付金利息收入 | 159,004.69                                      |
| 其他        | 26,129.30                                       |
| 合计        | 2,605,794.59                                    |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|----------|---|
| 卖出股票成交总额 | 11,036,087,417.59                               |

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 减：卖出股票成本总额 | 12,388,583,182.41 |
| 买卖股票差价收入   | -1,352,495,764.82 |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

注：本基金于 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间无债券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金于 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期  |
|-------------|---|
|             | 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 11,226,540.16                             |
| 基金投资产生的股利收益 | -   |
| 合计          | 11,226,540.16                             |

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期  |
|------------|---|
|            | 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 1. 交易性金融资产 | 210,487,425.25                            |
| ——股票投资     | 210,487,425.25                            |
| ——债券投资     | -   |
| ——资产支持证券投资 | -   |
| ——贵金属投资    | -   |
| ——其他       | -   |
| 2. 衍生工具    | -   |
| ——权证投资     | -   |
| 3. 其他      | -   |
| 合计         | 210,487,425.25                            |

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期  |
|---------|---|
|         | 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 基金赎回费收入 | 1,849,884.39                              |
| 转换费收入   | 81,664.36                                 |
| 合计      | 1,931,548.75                              |

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|           | 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------|---|
| 交易所市场交易费用 | 36,365,445.37                             |
| 银行间市场交易费用 | -   |
| 合计        | 36,365,445.37                             |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期  |
|-------|---|
|       | 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
| 审计费用  | 70,000.00                                 |
| 信息披露费 | 135,000.00                                |
| 帐户维护费 | 580.00                                    |
| 银行费用  | 25,392.57                                 |
| 合计    | 230,972.57                                |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 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             | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”） | 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”）     | 基金管理人股东             |
| 新加坡星展银行有限公司            | 基金管理人股东             |
| 安徽省信用担保集团有限公司          | 基金管理人股东             |
| 安徽省投资集团控股有限公司          | 基金管理人股东             |
| 长盛创富资产管理有限公司           | 基金管理人子公司            |
| 长盛基金（香港）有限公司           | 基金管理人子公司            |

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金于 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间未通过关联方交易单元进行交易。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                             |
|-----------------|--------------------------------|
|                 | 2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 18,424,917.90                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 8,158,105.09                   |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                             |
|----------------|--------------------------------|
|                | 2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,070,819.70                   |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人于 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.4.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。



**7.4.10.5 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<br>2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年12月31日 |              |
|--------|--------------------------------------|--------------|
|        | 期末余额                                 | 当期利息收入       |
| 中国农业银行 | 206,079,483.61                       | 2,420,660.60 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金于2015年6月4日（基金合同生效日）至2015年12月31日止期间未在承销期内参与关联方承销证券。

**7.4.11 利润分配情况****7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：本基金于2015年6月4日（基金合同生效日）至2015年12月31日止期间未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

**7.4.12.2 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 |
|--------|------|-------------|--------|--------|------------|--------|---------|---------------|---------------|----|
| 300336 | 新文化  | 2015年12月24日 | 重大资产重组 | 42.00  | -          | -      | 971,377 | 23,980,739.37 | 40,797,834.00 | -  |
| 300063 | 天龙集团 | 2015年12月22日 | 重大资产重组 | 43.33  | -          | -      | 695,823 | 19,392,947.20 | 30,150,010.59 | -  |
| 603010 | 万盛股份 | 2015年12月29日 | 重大资产重组 | 55.70  | -          | -      | 357,876 | 19,631,665.34 | 19,933,693.20 | -  |
| 600420 | 现代制药 | 2015年10月21日 | 重大资产重组 | 41.76  | 2016年3月23日 | 33.44  | 125,911 | 5,263,661.67  | 5,258,043.36  | -  |
| 000028 | 国药一致 | 2015年10月21日 | 重大资产重组 | 69.67  | 2016年3月25日 | 63.05  | 59,522  | 4,592,973.92  | 4,146,897.74  | -  |
| 000833 | 贵糖股份 | 2015年10月19日 | 重大资产重组 | 11.03  | 2016年1月19日 | 9.18   | 92,336  | 1,227,080.04  | 1,018,466.08  | -  |

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，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会风险控制管理委员会、督察长、公司风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司监察稽核部和风险管理部构成，监察稽核部负责对公司业务的法律合规风险和运作风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险控制委员会构成，公司管理层通过风险控制委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，在公司督察长的指导下，监察稽核部和风险管理部对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门总监、风险控制委员会、公司总经理、风险控制管理委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会及其下设风险控制管理委员会构成，风险控制管理委员会通过督察长、监察稽核部和风险管理部的工作，掌握整体风险状况并进行决策。风险控制管理委员会负责审查公司风险控制体系及其有效性、公司内控制度的实施情况。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级的债券投资。

#### **7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级的债券投资。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金

所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2015年12月31日 | 1个月以内          | 1-3个月 | 3个月<br>-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息               | 合计               |
|--------------------|----------------|-------|------------|------|------|-------------------|------------------|
| 资产                 |                |       |            |      |      |                   |                  |
| 银行存款               | 206,079,483.61 | -     | -          | -    | -    | -                 | 206,079,483.61   |
| 结算备付金              | 8,459,236.66   | -     | -          | -    | -    | -                 | 8,459,236.66     |
| 存出保证金              | 6,242,329.29   | -     | -          | -    | -    | -                 | 6,242,329.29     |
| 交易性金融资产            | -              | -     | -          | -    | -    | 1,695,445,851.44  | 1,695,445,851.44 |
| 应收证券清算款            | -              | -     | -          | -    | -    | 20,349,635.79     | 20,349,635.79    |
| 应收利息               | -              | -     | -          | -    | -    | 103,739.41        | 103,739.41       |
| 应收申购款              | -              | -     | -          | -    | -    | 491,020.71        | 491,020.71       |
| 资产总计               | 220,781,049.56 | -     | -          | -    | -    | 1,716,390,247.35  | 1,937,171,296.91 |
| 负债                 |                |       |            |      |      |                   |                  |
| 应付证券清算款            | -              | -     | -          | -    | -    | 7,678,056.45      | 7,678,056.45     |
| 应付赎回款              | -              | -     | -          | -    | -    | 6,424,531.00      | 6,424,531.00     |
| 应付管理人报酬            | -              | -     | -          | -    | -    | 2,453,882.80      | 2,453,882.80     |
| 应付托管费              | -              | -     | -          | -    | -    | 408,980.50        | 408,980.50       |
| 应付交易费用             | -              | -     | -          | -    | -    | 6,126,999.14      | 6,126,999.14     |
| 其他负债               | -              | -     | -          | -    | -    | 173,528.38        | 173,528.38       |
| 负债总计               | -              | -     | -          | -    | -    | 23,265,978.27     | 23,265,978.27    |
| 利率敏感度缺口            | 220,781,049.56 | -     | -          | -    | -    | -1,693,124,269.08 | 1,913,905,318.64 |

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末未持有交易性金融资产债券投资，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来

现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2015年12月31日 |              |
|---------------|--------------------|--------------|
|               | 公允价值               | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 1,695,445,851.44   | 88.59        |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                  | -            |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -                  | -            |
| 衍生金融资产-权证投资   | -                  | -            |
| 其他            | -                  | -            |
| 合计            | 1,695,445,851.44   | 88.59        |

本基金投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的 0%-95%；其中投资于国企改革主题的股票和债券不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于 2015 年 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如上表。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |   |  |
|----|---|--|
| 假设 | 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；   |  |
|    | 用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；                                |  |
|    | Beta 系数是根据自基金合同生效日起至 2015 年 12 月 31 日的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。 |  |
| 分析 | 相关风险变量的变动   | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）<br>本期末（2015 年 12 月 31 日） |
|    | +5%   | 213,440,635.04                                       |
|    | -5%   | -213,440,635.04                                      |

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金、应付证券清算款等，因其剩余期限不长，公允价值与

账面价值相若。

#### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 1,594,140,906.47 元，属于第二层次的余额为人民币 101,304,944.97 元，属于第三层次的余额为人民币零元。

#### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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              | 1,695,445,851.44 | 87.52         |
|    | 其中：股票             | 1,695,445,851.44 | 87.52         |
| 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      | 214,538,720.27   | 11.07         |
| 7  | 其他各项资产            | 27,186,725.20    | 1.40          |
| 8  | 合计                | 1,937,171,296.91 | 100.00        |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末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         | 3,723,081.60     | 0.19         |
| B  | 采矿业              | -                | -            |
| C  | 制造业              | 1,045,386,460.92 | 54.62        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,598,607.00    | 1.02         |
| E  | 建筑业              | 28,061,714.10    | 1.47         |
| F  | 批发和零售业           | 154,241,389.65   | 8.06         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 59,392,566.96    | 3.10         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 95,899,713.93    | 5.01         |
| J  | 金融业              | -                | -            |
| K  | 房地产业             | 136,390,411.13   | 7.13         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 7,841,799.60     | 0.41         |
| 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        | 144,910,106.55   | 7.57         |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 1,695,445,851.44 | 88.59        |

### 8.2.2 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所有股票投资明细

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  | 000068 | *ST 华赛 | 4,475,484 | 56,704,382.28 | 2.96         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 2  | 002460 | 赣锋锂业 | 823,700   | 51,835,441.00 | 2.71 |
| 3  | 300065 | 海兰信  | 1,238,288 | 47,302,601.60 | 2.47 |
| 4  | 002292 | 奥飞动漫 | 892,200   | 46,135,662.00 | 2.41 |
| 5  | 002583 | 海能达  | 3,658,809 | 45,698,524.41 | 2.39 |
| 6  | 002407 | 多氟多  | 589,990   | 44,992,637.40 | 2.35 |
| 7  | 002074 | 国轩高科 | 1,139,163 | 42,262,947.30 | 2.21 |
| 8  | 300291 | 华录百纳 | 1,175,060 | 41,832,136.00 | 2.19 |
| 9  | 000705 | 浙江震元 | 2,219,648 | 41,640,596.48 | 2.18 |
| 10 | 300336 | 新文化  | 971,377   | 40,797,834.00 | 2.13 |
| 11 | 300207 | 欣旺达  | 1,400,379 | 39,350,649.90 | 2.06 |
| 12 | 000920 | 南方汇通 | 1,603,923 | 38,542,269.69 | 2.01 |
| 13 | 300098 | 高新兴  | 1,793,341 | 37,642,227.59 | 1.97 |
| 14 | 600826 | 兰生股份 | 1,081,774 | 37,256,296.56 | 1.95 |
| 15 | 300458 | 全志科技 | 309,290   | 36,805,510.00 | 1.92 |
| 16 | 600662 | 强生控股 | 2,203,329 | 36,421,028.37 | 1.90 |
| 17 | 002133 | 广宇集团 | 3,735,103 | 36,043,743.95 | 1.88 |
| 18 | 002273 | 水晶光电 | 882,600   | 35,833,560.00 | 1.87 |
| 19 | 600433 | 冠豪高新 | 3,090,890 | 35,421,599.40 | 1.85 |
| 20 | 300119 | 瑞普生物 | 1,759,628 | 35,368,522.80 | 1.85 |
| 21 | 002739 | 万达院线 | 294,210   | 35,305,200.00 | 1.84 |
| 22 | 000988 | 华工科技 | 1,638,886 | 34,711,605.48 | 1.81 |
| 23 | 300368 | 汇金股份 | 587,693   | 33,333,946.96 | 1.74 |
| 24 | 300063 | 天龙集团 | 695,823   | 30,150,010.59 | 1.58 |
| 25 | 002717 | 岭南园林 | 639,219   | 28,061,714.10 | 1.47 |
| 26 | 002280 | 联络互动 | 455,814   | 27,986,979.60 | 1.46 |
| 27 | 000638 | 万方发展 | 906,006   | 27,678,483.30 | 1.45 |
| 28 | 300089 | 文化长城 | 699,887   | 27,666,533.11 | 1.45 |
| 29 | 603678 | 火炬电子 | 302,419   | 25,944,526.01 | 1.36 |
| 30 | 002123 | 荣信股份 | 954,922   | 24,493,749.30 | 1.28 |
| 31 | 600896 | 中海海盛 | 1,420,627 | 22,971,538.59 | 1.20 |
| 32 | 002508 | 老板电器 | 509,887   | 22,919,420.65 | 1.20 |
| 33 | 002466 | 天齐锂业 | 157,306   | 22,140,819.50 | 1.16 |
| 34 | 300160 | 秀强股份 | 550,687   | 22,055,014.35 | 1.15 |
| 35 | 000802 | 北京文化 | 627,740   | 21,267,831.20 | 1.11 |
| 36 | 600466 | 蓝光发展 | 1,419,774 | 20,331,163.68 | 1.06 |
| 37 | 603010 | 万盛股份 | 357,876   | 19,933,693.20 | 1.04 |
| 38 | 600900 | 长江电力 | 1,445,325 | 19,598,607.00 | 1.02 |
| 39 | 600963 | 岳阳林纸 | 2,319,800 | 19,091,954.00 | 1.00 |
| 40 | 600486 | 扬农化工 | 642,700   | 18,856,818.00 | 0.99 |



|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 41 | 600345 | 长江通信 | 776,508   | 18,574,071.36 | 0.97 |
| 42 | 300001 | 特锐德  | 635,300   | 18,423,700.00 | 0.96 |
| 43 | 300113 | 顺网科技 | 180,554   | 18,302,758.98 | 0.96 |
| 44 | 000567 | 海德股份 | 558,700   | 16,202,300.00 | 0.85 |
| 45 | 600511 | 国药股份 | 424,436   | 16,094,613.12 | 0.84 |
| 46 | 000042 | 中洲控股 | 746,597   | 15,611,343.27 | 0.82 |
| 47 | 000652 | 泰达股份 | 2,100,149 | 14,974,062.37 | 0.78 |
| 48 | 600179 | 黑化股份 | 850,004   | 14,543,568.44 | 0.76 |
| 49 | 000609 | 绵世股份 | 942,400   | 14,333,904.00 | 0.75 |
| 50 | 600500 | 中化国际 | 1,069,700 | 13,702,857.00 | 0.72 |
| 51 | 300297 | 蓝盾股份 | 575,096   | 11,967,747.76 | 0.63 |
| 52 | 603308 | 应流股份 | 378,303   | 11,848,449.96 | 0.62 |
| 53 | 000668 | 荣丰控股 | 392,683   | 11,525,246.05 | 0.60 |
| 54 | 600581 | 八一钢铁 | 994,400   | 9,794,840.00  | 0.51 |
| 55 | 000786 | 北新建材 | 762,009   | 9,067,907.10  | 0.47 |
| 56 | 000636 | 风华高科 | 790,300   | 9,017,323.00  | 0.47 |
| 57 | 000800 | 一汽轿车 | 542,775   | 8,885,226.75  | 0.46 |
| 58 | 600176 | 中国巨石 | 347,663   | 8,834,116.83  | 0.46 |
| 59 | 000662 | 索芙特  | 319,148   | 8,163,805.84  | 0.43 |
| 60 | 000526 | 银润投资 | 122,122   | 8,144,316.18  | 0.43 |
| 61 | 600057 | 象屿股份 | 601,365   | 7,841,799.60  | 0.41 |
| 62 | 000631 | 顺发恒业 | 729,700   | 7,238,624.00  | 0.38 |
| 63 | 600113 | 浙江东日 | 444,872   | 6,593,003.04  | 0.34 |
| 64 | 600161 | 天坛生物 | 188,494   | 6,584,095.42  | 0.34 |
| 65 | 002066 | 瑞泰科技 | 296,700   | 6,028,944.00  | 0.32 |
| 66 | 000151 | 中成股份 | 239,666   | 5,857,437.04  | 0.31 |
| 67 | 600961 | 株冶集团 | 432,500   | 5,782,525.00  | 0.30 |
| 68 | 000607 | 华媒控股 | 403,329   | 5,707,105.35  | 0.30 |
| 69 | 000930 | 中粮生化 | 383,445   | 5,667,317.10  | 0.30 |
| 70 | 600737 | 中粮屯河 | 391,877   | 5,662,622.65  | 0.30 |
| 71 | 600552 | 方兴科技 | 249,800   | 5,652,974.00  | 0.30 |
| 72 | 000031 | 中粮地产 | 401,500   | 5,641,075.00  | 0.29 |
| 73 | 300140 | 启源装备 | 225,629   | 5,618,162.10  | 0.29 |
| 74 | 600876 | 洛阳玻璃 | 174,200   | 5,595,304.00  | 0.29 |
| 75 | 600420 | 现代制药 | 125,911   | 5,258,043.36  | 0.27 |
| 76 | 000028 | 国药一致 | 59,522    | 4,146,897.74  | 0.22 |
| 77 | 002643 | 万润股份 | 101,400   | 4,109,742.00  | 0.21 |
| 78 | 000798 | 中水渔业 | 273,756   | 3,723,081.60  | 0.19 |
| 79 | 002077 | 大港股份 | 66,100    | 1,318,695.00  | 0.07 |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 80 | 000833 | 贵糖股份 | 92,336 | 1,018,466.08 | 0.05 |
|----|--------|------|--------|--------------|------|

## 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末基金资产净值 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       | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1  | 000838 | 国兴地产 | 139,820,430.39 | 7.31            |
| 2  | 600176 | 中国巨石 | 137,288,585.89 | 7.17            |
| 3  | 600005 | 武钢股份 | 127,739,053.77 | 6.67            |
| 4  | 600343 | 航天动力 | 124,940,913.00 | 6.53            |
| 5  | 002074 | 国轩高科 | 118,899,226.90 | 6.21            |
| 6  | 600332 | 白云山  | 114,807,213.78 | 6.00            |
| 7  | 000958 | 东方能源 | 111,941,978.60 | 5.85            |
| 8  | 600118 | 中国卫星 | 110,085,514.71 | 5.75            |
| 9  | 600662 | 强生控股 | 101,021,433.49 | 5.28            |
| 10 | 600019 | 宝钢股份 | 98,228,913.55  | 5.13            |
| 11 | 000768 | 中航飞机 | 97,737,374.20  | 5.11            |
| 12 | 002739 | 万达院线 | 97,431,576.84  | 5.09            |
| 13 | 601988 | 中国银行 | 97,280,963.46  | 5.08            |
| 14 | 000039 | 中集集团 | 96,297,574.02  | 5.03            |
| 15 | 600552 | 方兴科技 | 94,690,059.26  | 4.95            |
| 16 | 600391 | 成发科技 | 92,669,086.99  | 4.84            |
| 17 | 600000 | 浦发银行 | 89,915,830.29  | 4.70            |
| 18 | 002152 | 广电运通 | 89,676,426.08  | 4.69            |
| 19 | 601989 | 中国重工 | 88,526,294.87  | 4.63            |
| 20 | 600420 | 现代制药 | 85,606,311.85  | 4.47            |
| 21 | 601818 | 光大银行 | 81,417,166.00  | 4.25            |
| 22 | 600958 | 东方证券 | 80,186,144.80  | 4.19            |
| 23 | 000625 | 长安汽车 | 79,251,596.47  | 4.14            |
| 24 | 300063 | 天龙集团 | 78,263,284.19  | 4.09            |
| 25 | 002179 | 中航光电 | 78,143,606.40  | 4.08            |
| 26 | 600150 | 中国船舶 | 77,497,042.08  | 4.05            |
| 27 | 601766 | 中国中车 | 76,182,648.46  | 3.98            |
| 28 | 601390 | 中国中铁 | 73,869,906.15  | 3.86            |
| 29 | 601998 | 中信银行 | 72,329,762.58  | 3.78            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 30 | 600511 | 国药股份 | 72,085,752.75 | 3.77 |
| 31 | 300113 | 顺网科技 | 71,443,798.57 | 3.73 |
| 32 | 600006 | 东风汽车 | 70,733,124.26 | 3.70 |
| 33 | 300059 | 东方财富 | 70,714,034.13 | 3.69 |
| 34 | 600009 | 上海机场 | 70,416,905.80 | 3.68 |
| 35 | 601318 | 中国平安 | 70,123,464.58 | 3.66 |
| 36 | 000973 | 佛塑科技 | 69,919,702.95 | 3.65 |
| 37 | 002184 | 海得控制 | 69,878,646.25 | 3.65 |
| 38 | 600963 | 岳阳林纸 | 69,528,381.88 | 3.63 |
| 39 | 000524 | 岭南控股 | 69,488,679.91 | 3.63 |
| 40 | 600737 | 中粮屯河 | 68,618,113.16 | 3.59 |
| 41 | 000523 | 广州浪奇 | 67,837,306.86 | 3.54 |
| 42 | 600855 | 航天长峰 | 67,808,368.53 | 3.54 |
| 43 | 600629 | 华建集团 | 67,468,970.14 | 3.53 |
| 44 | 601336 | 新华保险 | 67,247,246.46 | 3.51 |
| 45 | 600115 | 东方航空 | 66,275,415.95 | 3.46 |
| 46 | 600015 | 华夏银行 | 65,255,710.99 | 3.41 |
| 47 | 002358 | 森源电气 | 64,651,111.64 | 3.38 |
| 48 | 600894 | 广日股份 | 64,241,159.71 | 3.36 |
| 49 | 000652 | 泰达股份 | 64,140,833.37 | 3.35 |
| 50 | 000151 | 中成股份 | 63,898,096.37 | 3.34 |
| 51 | 600893 | 中航动力 | 63,734,356.49 | 3.33 |
| 52 | 600787 | 中储股份 | 63,648,199.14 | 3.33 |
| 53 | 002678 | 珠江钢琴 | 63,209,140.79 | 3.30 |
| 54 | 601328 | 交通银行 | 63,105,121.67 | 3.30 |
| 55 | 601618 | 中国中冶 | 62,326,607.86 | 3.26 |
| 56 | 600835 | 上海机电 | 62,248,954.83 | 3.25 |
| 57 | 000858 | 五粮液  | 61,709,020.81 | 3.22 |
| 58 | 300207 | 欣旺达  | 61,635,487.60 | 3.22 |
| 59 | 601898 | 中煤能源 | 61,547,965.16 | 3.22 |
| 60 | 600481 | 双良节能 | 60,700,213.63 | 3.17 |
| 61 | 000930 | 中粮生化 | 60,106,686.63 | 3.14 |
| 62 | 601919 | 中国远洋 | 60,017,990.78 | 3.14 |
| 63 | 603308 | 应流股份 | 59,982,375.92 | 3.13 |
| 64 | 600726 | 华电能源 | 59,545,226.50 | 3.11 |
| 65 | 600839 | 四川长虹 | 59,131,998.08 | 3.09 |

|     |        |        |               |      |
|-----|--------|--------|---------------|------|
| 66  | 600820 | 隧道股份   | 58,652,242.66 | 3.06 |
| 67  | 000957 | 中通客车   | 58,513,058.88 | 3.06 |
| 68  | 600992 | 贵绳股份   | 58,328,030.26 | 3.05 |
| 69  | 002714 | 牧原股份   | 57,940,498.69 | 3.03 |
| 70  | 600036 | 招商银行   | 57,048,797.81 | 2.98 |
| 71  | 300159 | 新研股份   | 56,163,586.15 | 2.93 |
| 72  | 600350 | 山东高速   | 55,969,651.36 | 2.92 |
| 73  | 600876 | 洛阳玻璃   | 55,233,326.65 | 2.89 |
| 74  | 002573 | 清新环境   | 55,045,956.69 | 2.88 |
| 75  | 600875 | 东方电气   | 54,888,568.88 | 2.87 |
| 76  | 000100 | TCL 集团 | 54,808,884.99 | 2.86 |
| 77  | 000987 | 广州友谊   | 53,829,034.45 | 2.81 |
| 78  | 601628 | 中国人寿   | 53,433,206.08 | 2.79 |
| 79  | 000031 | 中粮地产   | 52,933,421.68 | 2.77 |
| 80  | 600900 | 长江电力   | 52,775,971.40 | 2.76 |
| 81  | 000800 | 一汽轿车   | 52,745,899.21 | 2.76 |
| 82  | 000006 | 深振业A   | 52,471,366.35 | 2.74 |
| 83  | 601668 | 中国建筑   | 52,026,876.08 | 2.72 |
| 84  | 300103 | 达刚路机   | 51,512,504.28 | 2.69 |
| 85  | 601991 | 大唐发电   | 51,511,910.53 | 2.69 |
| 86  | 600850 | 华东电脑   | 51,365,669.41 | 2.68 |
| 87  | 300065 | 海兰信    | 51,073,125.90 | 2.67 |
| 88  | 600895 | 张江高科   | 51,047,554.31 | 2.67 |
| 89  | 601169 | 北京银行   | 50,953,045.52 | 2.66 |
| 90  | 601166 | 兴业银行   | 50,679,037.93 | 2.65 |
| 91  | 002020 | 京新药业   | 50,498,163.50 | 2.64 |
| 92  | 300368 | 汇金股份   | 50,306,658.89 | 2.63 |
| 93  | 601009 | 南京银行   | 50,295,044.56 | 2.63 |
| 94  | 002055 | 得润电子   | 50,269,078.00 | 2.63 |
| 95  | 002500 | 山西证券   | 49,991,049.12 | 2.61 |
| 96  | 600663 | 陆家嘴    | 49,726,896.72 | 2.60 |
| 97  | 300291 | 华录百纳   | 49,665,236.59 | 2.59 |
| 98  | 002060 | 粤水电    | 49,201,362.46 | 2.57 |
| 99  | 600581 | 八一钢铁   | 48,877,014.86 | 2.55 |
| 100 | 601006 | 大秦铁路   | 48,776,207.10 | 2.55 |
| 101 | 000920 | 南方汇通   | 48,539,329.61 | 2.54 |

|     |        |        |               |      |
|-----|--------|--------|---------------|------|
| 102 | 002407 | 多氟多    | 48,437,516.47 | 2.53 |
| 103 | 300066 | 三川股份   | 48,425,595.31 | 2.53 |
| 104 | 601718 | 际华集团   | 48,286,374.41 | 2.52 |
| 105 | 600373 | 中文传媒   | 48,190,653.71 | 2.52 |
| 106 | 600179 | 黑化股份   | 47,087,551.13 | 2.46 |
| 107 | 600050 | 中国联通   | 46,706,340.01 | 2.44 |
| 108 | 000801 | 四川九洲   | 45,536,102.34 | 2.38 |
| 109 | 600170 | 上海建工   | 45,389,312.75 | 2.37 |
| 110 | 600068 | 葛洲坝    | 45,296,095.76 | 2.37 |
| 111 | 300297 | 蓝盾股份   | 45,033,785.30 | 2.35 |
| 112 | 000786 | 北新建材   | 44,899,190.57 | 2.35 |
| 113 | 000592 | 平潭发展   | 44,711,966.02 | 2.34 |
| 114 | 002567 | 唐人神    | 44,297,154.34 | 2.31 |
| 115 | 002299 | 圣农发展   | 43,889,278.35 | 2.29 |
| 116 | 600406 | 国电南瑞   | 43,574,726.97 | 2.28 |
| 117 | 300259 | 新天科技   | 43,297,518.10 | 2.26 |
| 118 | 600848 | 上海临港   | 43,179,432.05 | 2.26 |
| 119 | 000068 | *ST 华赛 | 43,096,564.35 | 2.25 |
| 120 | 000988 | 华工科技   | 42,566,563.96 | 2.22 |
| 121 | 000705 | 浙江震元   | 42,562,184.80 | 2.22 |
| 122 | 002124 | 天邦股份   | 42,550,342.44 | 2.22 |
| 123 | 300105 | 龙源技术   | 42,382,419.94 | 2.21 |
| 124 | 600268 | 国电南自   | 42,032,934.00 | 2.20 |
| 125 | 300160 | 秀强股份   | 41,797,324.20 | 2.18 |
| 126 | 601918 | 国投新集   | 41,109,827.04 | 2.15 |
| 127 | 601866 | 中海集运   | 41,036,095.60 | 2.14 |
| 128 | 600284 | 浦东建设   | 40,957,370.58 | 2.14 |
| 129 | 000966 | 长源电力   | 40,950,922.16 | 2.14 |
| 130 | 002066 | 瑞泰科技   | 40,502,279.83 | 2.12 |
| 131 | 000798 | 中水渔业   | 40,323,736.56 | 2.11 |
| 132 | 002116 | 中国海诚   | 39,624,934.91 | 2.07 |
| 133 | 600826 | 兰生股份   | 39,587,672.48 | 2.07 |
| 134 | 601158 | 重庆水务   | 39,337,834.62 | 2.06 |
| 135 | 600999 | 招商证券   | 39,268,050.40 | 2.05 |
| 136 | 601600 | 中国铝业   | 39,242,002.53 | 2.05 |
| 137 | 000638 | 万方发展   | 39,172,434.89 | 2.05 |

|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 138 | 300098 | 高新兴  | 38,783,186.28 | 2.03 |
| 139 | 600056 | 中国医药 | 38,696,772.60 | 2.02 |
| 140 | 300458 | 全志科技 | 38,673,893.85 | 2.02 |
| 141 | 002292 | 奥飞动漫 | 38,377,444.00 | 2.01 |
| 142 | 000529 | 广弘控股 | 38,338,861.22 | 2.00 |

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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       | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|-----------------|
| 1  | 000838 | 国兴地产 | 137,100,459.02 | 7.16            |
| 2  | 600176 | 中国巨石 | 111,172,975.80 | 5.81            |
| 3  | 600343 | 航天动力 | 107,348,299.52 | 5.61            |
| 4  | 600332 | 白云山  | 104,823,906.02 | 5.48            |
| 5  | 600005 | 武钢股份 | 104,662,907.99 | 5.47            |
| 6  | 600118 | 中国卫星 | 100,430,473.11 | 5.25            |
| 7  | 000958 | 东方能源 | 98,704,798.95  | 5.16            |
| 8  | 000768 | 中航飞机 | 98,408,782.50  | 5.14            |
| 9  | 601988 | 中国银行 | 97,667,887.32  | 5.10            |
| 10 | 002074 | 国轩高科 | 96,444,985.48  | 5.04            |
| 11 | 600391 | 成发科技 | 90,456,109.84  | 4.73            |
| 12 | 600000 | 浦发银行 | 84,725,343.00  | 4.43            |
| 13 | 600552 | 方兴科技 | 83,975,310.42  | 4.39            |
| 14 | 000039 | 中集集团 | 82,333,642.36  | 4.30            |
| 15 | 600893 | 中航动力 | 81,393,680.81  | 4.25            |
| 16 | 300063 | 天龙集团 | 80,375,908.20  | 4.20            |
| 17 | 600958 | 东方证券 | 77,811,226.34  | 4.07            |
| 18 | 600019 | 宝钢股份 | 76,987,817.95  | 4.02            |
| 19 | 002152 | 广电运通 | 76,682,840.42  | 4.01            |
| 20 | 601390 | 中国中铁 | 74,341,337.49  | 3.88            |
| 21 | 601766 | 中国中车 | 73,510,572.05  | 3.84            |
| 22 | 601818 | 光大银行 | 73,502,483.80  | 3.84            |
| 23 | 000625 | 长安汽车 | 72,404,255.41  | 3.78            |
| 24 | 601998 | 中信银行 | 71,414,768.54  | 3.73            |
| 25 | 601318 | 中国平安 | 70,991,871.29  | 3.71            |
| 26 | 600855 | 航天长峰 | 70,955,450.36  | 3.71            |
| 27 | 600420 | 现代制药 | 69,901,377.33  | 3.65            |
| 28 | 601989 | 中国重工 | 69,793,890.29  | 3.65            |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 29 | 002179 | 中航光电   | 68,252,381.72 | 3.57 |
| 30 | 300059 | 东方财富   | 67,460,981.08 | 3.52 |
| 31 | 600006 | 东风汽车   | 67,282,251.55 | 3.52 |
| 32 | 002739 | 万达院线   | 65,053,123.18 | 3.40 |
| 33 | 600015 | 华夏银行   | 64,209,813.47 | 3.35 |
| 34 | 601336 | 新华保险   | 63,109,846.00 | 3.30 |
| 35 | 000957 | 中通客车   | 63,070,357.09 | 3.30 |
| 36 | 002358 | 森源电气   | 62,887,945.89 | 3.29 |
| 37 | 600150 | 中国船舶   | 61,430,693.29 | 3.21 |
| 38 | 600115 | 东方航空   | 60,904,109.03 | 3.18 |
| 39 | 600481 | 双良节能   | 59,810,909.02 | 3.13 |
| 40 | 300113 | 顺网科技   | 59,490,488.23 | 3.11 |
| 41 | 600662 | 强生控股   | 57,665,617.32 | 3.01 |
| 42 | 601668 | 中国建筑   | 56,074,964.69 | 2.93 |
| 43 | 601618 | 中国中冶   | 55,998,623.60 | 2.93 |
| 44 | 600036 | 招商银行   | 55,269,938.53 | 2.89 |
| 45 | 600787 | 中储股份   | 54,392,858.47 | 2.84 |
| 46 | 600009 | 上海机场   | 54,252,055.55 | 2.83 |
| 47 | 000100 | TCL 集团 | 54,196,931.08 | 2.83 |
| 48 | 002020 | 京新药业   | 53,589,367.27 | 2.80 |
| 49 | 600876 | 洛阳玻璃   | 53,228,502.36 | 2.78 |
| 50 | 600737 | 中粮屯河   | 52,983,295.80 | 2.77 |
| 51 | 000973 | 佛塑科技   | 52,739,010.80 | 2.76 |
| 52 | 600875 | 东方电气   | 52,303,823.14 | 2.73 |
| 53 | 000592 | 平潭发展   | 52,215,248.51 | 2.73 |
| 54 | 601628 | 中国人寿   | 52,131,910.71 | 2.72 |
| 55 | 601328 | 交通银行   | 51,797,911.87 | 2.71 |
| 56 | 600350 | 山东高速   | 51,009,610.99 | 2.67 |
| 57 | 000858 | 五粮液    | 50,726,275.21 | 2.65 |
| 58 | 601006 | 大秦铁路   | 49,749,363.14 | 2.60 |
| 59 | 600373 | 中文传媒   | 49,285,760.41 | 2.58 |
| 60 | 000652 | 泰达股份   | 49,043,981.94 | 2.56 |
| 61 | 000151 | 中成股份   | 48,924,589.51 | 2.56 |
| 62 | 002714 | 牧原股份   | 48,365,711.97 | 2.53 |
| 63 | 002500 | 山西证券   | 47,793,286.38 | 2.50 |
| 64 | 000524 | 岭南控股   | 47,518,305.07 | 2.48 |
| 65 | 000006 | 深振业 A  | 47,408,731.10 | 2.48 |
| 66 | 600511 | 国药股份   | 47,344,038.87 | 2.47 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 67 | 603308 | 应流股份 | 46,621,462.84 | 2.44 |
| 68 | 600839 | 四川长虹 | 46,284,246.72 | 2.42 |
| 69 | 600726 | 华电能源 | 46,034,312.65 | 2.41 |
| 70 | 000523 | 广州浪奇 | 45,977,697.22 | 2.40 |
| 71 | 000031 | 中粮地产 | 45,670,909.34 | 2.39 |
| 72 | 300103 | 达刚路机 | 45,535,286.97 | 2.38 |
| 73 | 601898 | 中煤能源 | 45,446,882.94 | 2.37 |
| 74 | 600068 | 葛洲坝  | 44,389,959.13 | 2.32 |
| 75 | 601886 | 江河创建 | 44,190,585.63 | 2.31 |
| 76 | 002407 | 多氟多  | 44,074,563.35 | 2.30 |
| 77 | 600963 | 岳阳林纸 | 43,534,430.54 | 2.27 |
| 78 | 601919 | 中国远洋 | 43,274,472.00 | 2.26 |
| 79 | 600850 | 华东电脑 | 43,253,718.25 | 2.26 |
| 80 | 002567 | 唐人神  | 43,019,282.40 | 2.25 |
| 81 | 600820 | 隧道股份 | 42,790,512.60 | 2.24 |
| 82 | 300066 | 三川股份 | 42,788,491.58 | 2.24 |
| 83 | 002055 | 得润电子 | 42,677,468.95 | 2.23 |
| 84 | 601009 | 南京银行 | 42,530,758.77 | 2.22 |
| 85 | 600894 | 广日股份 | 42,405,588.68 | 2.22 |
| 86 | 300259 | 新天科技 | 42,224,533.68 | 2.21 |
| 87 | 600050 | 中国联通 | 41,868,816.91 | 2.19 |
| 88 | 600835 | 上海机电 | 41,569,913.76 | 2.17 |
| 89 | 601166 | 兴业银行 | 40,203,316.58 | 2.10 |
| 90 | 601991 | 大唐发电 | 39,821,402.95 | 2.08 |
| 91 | 601169 | 北京银行 | 39,481,189.51 | 2.06 |

#### 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 | 13,873,541,608.60 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 11,036,087,417.59 |

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。



## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 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

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

多氟多化工股份有限公司（以下简称“公司”）2015年7月22日公告：中国证券监督管理委员会河南监管局（以下简称“河南证监局”）对公司下达行政监管措施决定书，分别为对董事长李世江、总经理侯红军、董事会秘书陈相举、财务总监程立静的《关于对李世江、侯红军、陈相举、程立静实施监管谈话措施的决定》（[2015]19号）和对公司的《关于对多氟多化工股份有限公司实施出具警示函措施的决定》（[2015]20号）。本基金做出如下说明：多氟多是国内锂电池产业链上最优秀的六氟磷酸锂供应商。公司设立焦作新能源公司和收购红星汽车，切入电池生产及整车产业环节。新能源汽车受国家产业政策扶持，符合节能环保发展方向。公司已与新大洋公司签订动力电池供应合同，和金龙客车公司达成战略合作协议。今后，我们将继续加强与该公司

的沟通，密切关注其制度建设与执行、信息披露等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。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。

除上述情况外，本基金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收到公开谴责、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   | 6,242,329.29  |
| 2  | 应收证券清算款 | 20,349,635.79 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 103,739.41    |
| 5  | 应收申购款   | 491,020.71    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 27,186,725.20 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末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  | 300336 | 新文化  | 40,797,834.00 | 2.13          | 重大事项停牌   |

### 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，分项之和与和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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
|--------|-----------|---------------|------------|------------------|------------|
| 60,912 | 48,820.43 | 26,985,994.05 | 0.91%      | 2,946,763,938.54 | 99.09%     |

## 9.2 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 | 11,046.46 | 0.0004%  |

## 9.3 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<br>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（2015年6月4日）基金份额总额               | 3,250,867,544.91 |
| 本报告期期初基金份额总额                           | -                |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额                  | 435,327,278.89   |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额                | 712,444,891.21   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份<br>额减少以“-”填列） | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 2,973,749,932.59 |

## § 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曾变动。

**11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况**

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 70,000.00 元，已连续提供审计服务 1 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 |    |
| 国泰君安 | 2      | 3,094,250,687.34 | 12.42%       | 2,830,141.91 | 12.41%     | -  |
| 联讯证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 国信证券 | 1      | 361,573,328.49   | 1.45%        | 336,733.53   | 1.48%      | -  |
| 齐鲁证券 | 1      | 3,662,143,045.14 | 14.70%       | 3,334,003.43 | 14.62%     | -  |
| 东海证券 | 1      | 2,862,328,380.10 | 11.49%       | 2,605,864.56 | 11.43%     | -  |
| 国金证券 | 1      | 5,365,117,521.81 | 21.54%       | 4,928,315.93 | 21.61%     | -  |
| 湘财证券 | 1      | 1,820,628,989.84 | 7.31%        | 1,667,845.84 | 7.31%      | -  |
| 光大证券 | 1      | 4,943,414,356.48 | 19.85%       | 4,603,805.97 | 20.19%     | -  |

|        |    |                  |       |              |       |   |
|--------|----|------------------|-------|--------------|-------|---|
| 方正证券   | 1  | 556,912,488.90   | 2.24% | 407,270.49   | 1.79% | - |
| 中投证券   | 2  | -                | -     | -            | -     | - |
| 东北证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 华鑫证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 中银国际   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 华泰证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 第一创业   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 中原证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 兴业证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 瑞银证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 华福证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 海通证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 华西证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 银河证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 长城证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 宏源证券   | 2  | -                | -     | -            | -     | - |
| 西南证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 国元证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 上海证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 安信证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 中信建投证券 | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 广发证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 中金公司   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 中信证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 华创证券   | 1  | -                | -     | -            | -     | - |
| 申银万国   | 12 | 2,243,260,228.09 | 9.01% | 2,089,142.67 | 9.16% | - |

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、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、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

| 序号 | 证券公司名称 | 交易单元所属市场 | 数量 |
|----|--------|----------|----|
| 1  | 联讯证券   | 深圳       | 1  |
| 2  | 银河证券   | 深圳       | 1  |
| 3  | 方正证券   | 深圳       | 1  |

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元

| 序号 | 证券公司名称 | 交易单元所属市场 | 数量 |
|----|--------|----------|----|
| 1  | 华宝证券   | 深圳       | 1  |

## 11.8 其他重大事件

除上述事项外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下：

| 序号 | 公告事项                       | 法定披露方式                     | 法定披露日期      |
|----|----------------------------|----------------------------|-------------|
| 1  | 关于长盛基金指数熔断机制实施后基金配套工作安排的公告 | 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》及本公司网站 | 2015年12月31日 |
| 2  | 关于增加平安银行为长盛电子信             | 同上                         | 2015年12月16日 |

|    |   |    |                  |
|----|---|----|------------------|
|    | 息主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务并参与基金申购费率优惠活动的公告       |    |                  |
| 3  | 关于增加金观诚为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告                    | 同上 | 2015 年 12 月 15 日 |
| 4  | 关于增加国信证券为旗下部分开放式基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务的公告                  | 同上 | 2015 年 12 月 15 日 |
| 5  | 长盛基金管理有限公司关于参加长量基金费率优惠活动并开通转换业务的公告                        | 同上 | 2015 年 11 月 30 日 |
| 6  | 关于增加盈米财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及费率优惠活动的公告                     | 同上 | 2015 年 11 月 24 日 |
| 7  | 关于增加凯石财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及费率优惠活动的公告                     | 同上 | 2015 年 11 月 24 日 |
| 8  | 关于增加富济财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及费率优惠活动的公告                     | 同上 | 2015 年 11 月 24 日 |
| 9  | 关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定投及转换业务的公告                | 同上 | 2015 年 11 月 16 日 |
| 10 | 关于增加工商银行作为长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构以及开通基金转换业务并参加个人电子银行基金申 | 同上 | 2015 年 11 月 2 日  |

|    |   |    |                  |
|----|---|----|------------------|
|    | 购费率优惠活动的公告  |    |                  |
| 11 | 关于增加中国农业银行为旗下部分开放式基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务并参加基金申购费率优惠活动的公告   | 同上 | 2015 年 10 月 29 日 |
| 12 | 长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告                      | 同上 | 2015 年 10 月 26 日 |
| 13 | 关于增加建设银行为长盛电子信息主题混合型基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告                 | 同上 | 2015 年 10 月 23 日 |
| 14 | 关于增加交通银行为长盛电子信息主题混合型基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务并参与基金申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015 年 10 月 22 日 |
| 15 | 关于旗下基金参加好买基金费率优惠活动的公告                                     | 同上 | 2015 年 10 月 20 日 |
| 16 | 关于旗下部分开放式基金参加平安证券申购（含定投）费率优惠活动的公告                         | 同上 | 2015 年 10 月 20 日 |
| 17 | 关于增加微动利为旗下部分基金代销机构并开通定投业务及转换业务的公告                         | 同上 | 2015 年 10 月 19 日 |
| 18 | 关于增加利得基金为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠活动的公告                      | 同上 | 2015 年 10 月 8 日  |
| 19 | 关于旗下部分开放式基金参加中金公司网上交易 电话委托及柜                              | 同上 | 2015 年 9 月 24 日  |



|    |  |    |                 |
|----|--|----|-----------------|
|    | 台委托申购（不含定投）费率优惠活动的公告                               |    |                 |
| 20 | 关于增加泰诚财富为旗下部分基金代销机构并开通定投及转换业务的公告                   | 同上 | 2015 年 9 月 23 日 |
| 21 | 关于在直销柜台开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告                        | 同上 | 2015 年 9 月 16 日 |
| 22 | 关于增加大连银行为旗下部分基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务并参与基金申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015 年 9 月 7 日  |
| 23 | 关于中信证券（浙江）有限责任公司整体迁移并入中信证券股份有限公司涉及相关基金业务影响的公告      | 同上 | 2015 年 9 月 1 日  |
| 24 | 关于增加陆金所为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告                     | 同上 | 2015 年 9 月 1 日  |
| 25 | 关于参加天天基金费率优惠活动的公告                                  | 同上 | 2015 年 8 月 26 日 |
| 26 | 长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购赎回 转换及定期定额投资业务的公告       | 同上 | 2015 年 7 月 31 日 |
| 27 | 关于旗下部分开放式基金参加上海浦东发展银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告        | 同上 | 2015 年 7 月 31 日 |
| 28 | 关于开展网上直销金算盘转换费                                     | 同上 | 2015 年 7 月 29 日 |

|    |   |    |            |
|----|---|----|------------|
|    | 率优惠活动的公告                                  |    |            |
| 29 | 关于增加首创证券为旗下部分开放式基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务的公告  | 同上 | 2015年7月15日 |
| 30 | 关于旗下部分基金参加一路财富和同花顺费率优惠活动的公告               | 同上 | 2015年6月26日 |
| 31 | 关于增加汇付金融和增财基金为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015年6月19日 |
| 32 | 关于增加中经北证和品今财富为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015年6月19日 |
| 33 | 长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告             | 同上 | 2015年6月5日  |
| 34 | 关于增加浦发银行为长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告     | 同上 | 2015年5月28日 |
| 35 | 关于增加长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告          | 同上 | 2015年5月18日 |
| 36 | 长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告             | 同上 | 2015年5月9日  |
| 37 | 长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议                 | 同上 | 2015年5月9日  |
| 38 | 长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要             | 同上 | 2015年5月9日  |

|    |                            |    |                |
|----|----------------------------|----|----------------|
| 39 | 长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同  | 同上 | 2015 年 5 月 9 日 |
| 40 | 长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 | 同上 | 2015 年 5 月 8 日 |

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛国企改革主题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。

### 12.2 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。

### 12.3 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和/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。

长盛基金管理有限公司  
2016 年 3 月 26 日