

# 长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年半年度报告 摘要

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 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。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长盛互联网+混合
基金主代码	002085
交易代码	002085
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 28 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	273, 110, 628. 40 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互联网行业发展以及传统产业与互联网融合发展过程中所蕴含的投资机会，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>本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，运用科学严谨、规范化的资产配置方法，灵活配置互联网+主题的上市公司股票和债券，谋求基金资产的长期稳定增长。</p> <p>（一）大类资产配置策略</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。本基金将通过深入分析上述指标与因素，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）股票投资策略</p> <p>1、互联网+主题的界定</p> <p>本基金所投资的互联网+主题包括互联网产业链相关行业以及与互联网发生融合发展的传统产业的股票。</p> <p>2、个股选择</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，在互联网+主题界定的上市公司中选择具有长期持续成长能力的公司。</p> <p>本基金筛选股票的程序为：</p> <p>第一，将将样本空间中过去一年日均成交金额排名在后 20%的股票剔除。</p> <p>第二，根据本基金对互联网+主题上市公司的界定挑选基金备选股票池。</p>

	第三, 对备选互联网+主题相关上市公司, 具体从公司基本状况、成长性评估和股票估值三个方面进行筛选。
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

## 2.4 信息披露方式

登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 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	报告期(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	44,620,873.94
本期利润	76,850,605.54
加权平均基金份额本期利润	0.1754
本期基金份额净值增长率	17.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0812
期末基金资产净值	319,777,926.61
期末基金份额净值	1.171

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 6 月 30 日。

## 3.2 基金净值表现

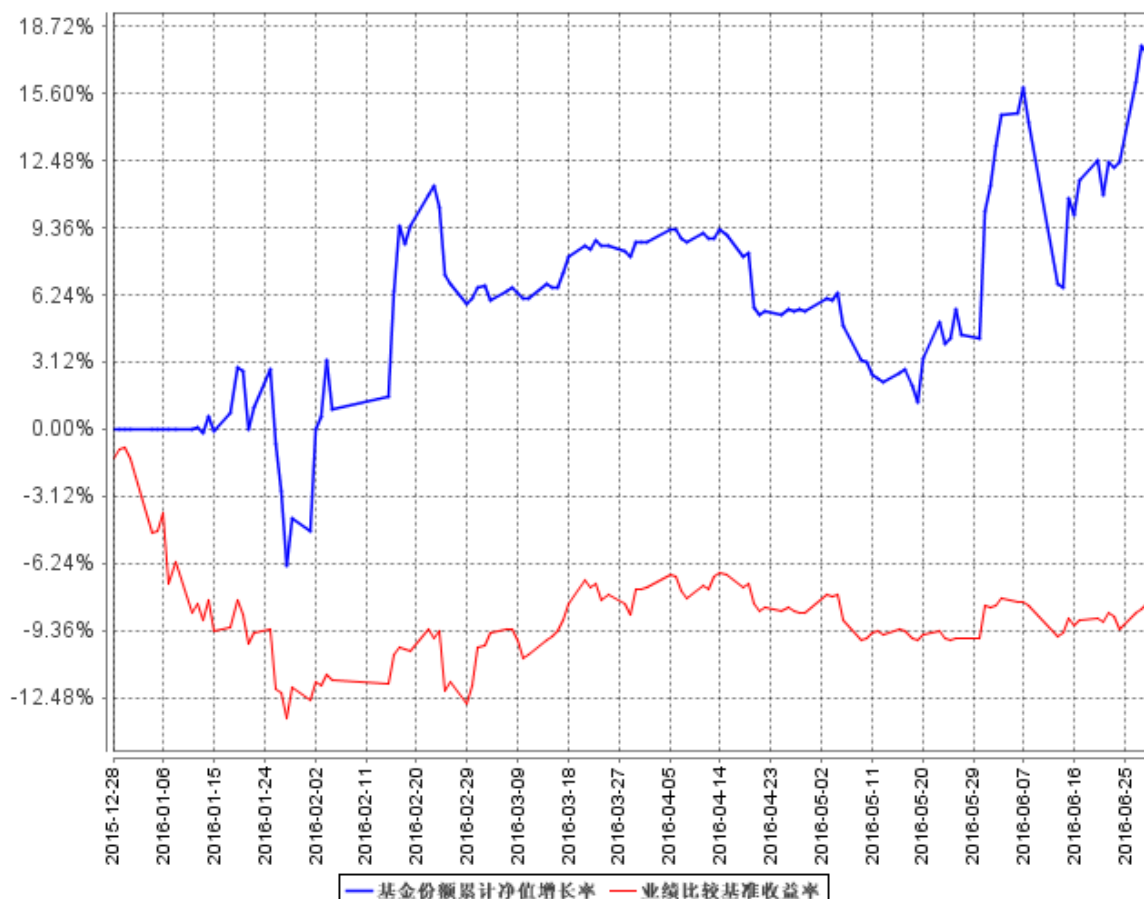
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	6.36%	2.11%	0.09%	0.49%	6.27%	1.62%
过去三个月	7.73%	1.54%	-0.72%	0.51%	8.45%	1.03%
过去六个月	17.10%	1.53%	-6.85%	0.92%	23.95%	0.61%
自基金合同生效起至今	17.10%	1.50%	-8.09%	0.92%	25.19%	0.58%

注：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、长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效日 2015 年 12 月 28 日，截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。本基金已经完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截至报告日，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。

3、本基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于互联网+主题的证券不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

## § 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 2016 年 6 月 30 日，基金管理人共管理四十六只开放式基金，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		
赵楠	本基金基金经理，长盛电子信息产业混合型证券投资基金基金经理，	2015年12月28日	-	10年	男，1980年3月出生，中国国籍。经济学学士，北京大学光华 MBA 在读。历任安信证券研究中心研究员，光大永明资产管理股份有限公司权益投资部高级股票投

	长盛新兴成长主题混合型证券投资基金基金经理，社保组合组合经理。			资经理、资深股票投资经理、权益创新业务负责人、投行总部执行董事等职务。2015年2月加入长盛基金管理有限公司，现任社保组合组合经理，长盛电子信息产业混合型证券投资基金基金经理，长盛新兴成长主题混合型证券投资基金基金经理，长盛互联网+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。

## 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 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》

的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 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

2016 年上半年，股票市场总体上表现欠佳，年初市场出现快速而猛烈的下跌，从 2 月到 6 月，市场基本处于小幅区间震荡，行业出现明显的分化，分化最根本的驱动力来自于盈利的改善，比如养殖、新能源汽车、白酒、有色、钢铁等领域。

在账户操作方面，始终坚持长期、稳健的操作策略，努力争取绝对回报，降低净值回撤。

在投资运作方面，有得有失。得的方面，产品年初以来回撤控制较好，获取了比较明显的择时收益，但对行业的分化估计不足，配置较为分散，导致在市场反弹时，净值上涨动力不足。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.171 元，本报告期份额净值增长率为 17.10%，同期业绩比较基准增长率为-6.85%。

### 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 年下半年的宏观经济，经济向下的动力在加大，房地产本轮周期景气的高点已过，私人投资低迷，CPI 和 PPI 有望继续下行，经济通缩的压力在加大。目前股票市场仍处于底部区域，指数继续下行的概率不高，系统性风险不大，随着无风险利率的下行，流动性的边际改善，投资者信心的逐步恢复，预计下半年股票市场将出现比较明显的上涨，但全年来看，今年大概率是个震荡市，指数全年来看上涨下跌空间都不大，更多的机会来自于行业和个股的把握。投资机会主要有三条线：第一，盈利持续上升、业绩超预期的行业，比如新能源汽车产业链等，这条主线是今年最重要的方面；第二，超跌反弹的机会，比如行业指数跌幅比较靠前的传媒、计算机、医药等行业，寻找自下而上的个股机会；第三、把握新的技术方向、新的主题性投资机会，但短



期来看这类投资主线更多是交易性机会。

#### 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十六条中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2016 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 22,182,189.67 元，其中：未分配利润已实现部分为 22,182,189.67 元，未分配利润未实现部分为 24,485,108.54 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	74,117,185.80	44,544,857.16
结算备付金	2,515,106.75	-
存出保证金	460,434.28	-
交易性金融资产	270,062,274.24	-
其中：股票投资	270,062,274.24	-
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	-	-
买入返售金融资产	-	710,000,000.00
应收证券清算款	-	139,116.11
应收利息	10,115.68	91,428.23
应收股利	-	-
应收申购款	1,953,097.80	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	349,118,214.55	754,775,401.50
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016年6月30日</b>	<b>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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	16,876,091.71	-
应付赎回款	11,210,599.17	-
应付管理人报酬	406,901.42	93,026.20
应付托管费	67,816.90	15,504.37
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	575,358.38	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	203,520.36	-
负债合计	29,340,287.94	108,530.57
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	273,110,628.40	754,487,433.12
未分配利润	46,667,298.21	179,437.81
所有者权益合计	319,777,926.61	754,666,870.93
负债和所有者权益总计	349,118,214.55	754,775,401.50

注：（1）报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.171 元，基金份额总额为 273,110,628.40 份。

（2）本财务报表比较期间的实际编制期间系 2015 年 12 月 28 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
<b>一、收入</b>	83,772,214.20	
1.利息收入	1,766,441.39	
其中：存款利息收入	749,009.29	
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	1,017,432.10	
其他利息收入	-	
2.投资收益（损失以“-”填列）	46,966,879.45	
其中：股票投资收益	46,449,621.17	
基金投资收益	-	
债券投资收益	-	
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	517,258.28	
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	32,229,731.60	
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,809,161.76	
<b>减：二、费用</b>	6,921,608.66	
1. 管理人报酬	3,476,559.17	
2. 托管费	579,426.54	
3. 销售服务费	-	
4. 交易费用	2,681,670.43	
5. 利息支出	-	
其中：卖出回购金融资产支出	-	
6. 其他费用	183,952.52	
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	76,850,605.54	
减：所得税费用	-	
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	76,850,605.54	

注：本基金合同于 2015 年 12 月 28 日生效，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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)	754,487,433.12	179,437.81	754,666,870.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	76,850,605.54	76,850,605.54
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)	-481,376,804.72	-30,362,745.14	-511,739,549.86
其中：1.基金申购款	216,847,514.11	19,293,553.42	236,141,067.53
2.基金赎回款	-698,224,318.83	-49,656,298.56	-747,880,617.39
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)	273,110,628.40	46,667,298.21	319,777,926.61

注：本基金合同于 2015 年 12 月 28 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 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长盛互联网+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]1999 号《关于准予长盛互联网+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 11 月 25 日至 2015 年 12 月 22 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具（2015）验字 60468688\_A08 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015 年 12 月 28 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。截至 2015 年 12 月 24 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 754,295,570.80 元，折合 754,295,570.80 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 191,862.32 元，折合 191,862.32 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 754,487,433.12 元，折合 754,487,433.12 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金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上市的股票)、权证、股指期货、债券、货币市场工具、资产支持证券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比例为 0%-95%,其中投资于互联网+主题的证券不低于非现金基金资产的 80%;权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%;本基金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,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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。

#### 6.4.3 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 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。

### 6.4.4.3 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。

### 6.4.4.4 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。

### 6.4.4.5 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方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，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。

#### **6.4.4.6 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。

#### **6.4.4.7 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。

#### **6.4.4.8 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)”。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 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。

#### 6.4.4.12 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。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 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。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 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。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 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。

#### 6.4.6.2 营业税、增值税

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本期未通过关联方交易单元进行交易。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的管理费	3,476,559.17	
其中：支付销售机构的客户维护费	1,183,239.55	

注：本基金合同于 2015 年 12 月 28 日生效，无上年度可比期间。

支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.5%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	579,426.54	

注：本基金合同于 2015 年 12 月 28 日生效，无上年度可比期间。

支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金份额。

#### 6.4.8.4.2 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

注：除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末未投资本基金。

### 6.4.8.5 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	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入

中国银行	74,117,185.80	653,727.21
------	---------------	------------

注：本基金合同于 2015 年 12 月 28 日生效，无上年度可比期间。

本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新股流通受限	12.98	12.98	2,191	28,439.18	28,439.18	-
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

注：基金可使用以基金名义开设股票账户，选择网下或者网上一方式进行新股申购。从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

##### 6.4.9.2 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
300246	宝莱特	2016 年 6 月 27 日	重大事项停牌	30.31	2016 年 7 月 1 日	32.20	87,700	2,522,549.97	2,658,187.00	-
002432	九安医疗	2016 年 6 月 20 日	重大事项停牌	18.14	2016 年 7 月 13 日	19.95	146,300	2,559,312.00	2,653,882.00	-
000948	南天	2016	重大	19.31	2016	21.00	130,650	2,177,782.60	2,522,851.50	-

	信息	年 6 月 28 日	事项 停牌		年 7 月 12 日				
--	----	---------------	----------	--	---------------	--	--	--	--

注：本基金截至 2016 年 6 月 30 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。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金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。

### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 6.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、应收证券清算款、应收申购款、应付交易费用等，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 262,227,353.74 元，属于第二层次的余额为人民币 7,834,920.50 元，属于第三层次的余额为人民币零元（2015 年 12 月 31 日：无）。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

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。

#### 6.4.14.2 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。

#### 6.4.14.3 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 投资组合报告

### 7.1 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	270,062,274.24	77.36
	其中：股票	270,062,274.24	77.36
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	76,632,292.55	21.95
7	其他各项资产	2,423,647.76	0.69
8	合计	349,118,214.55	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	143,281,766.33	44.81
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	119,777,489.01	37.46
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	20,126.10	0.01
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	6,982,892.80	2.18

S	综合	-	-
	合计	270,062,274.24	84.45

## 7.2.2 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。

## 7.3 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

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	002354	天神娱乐	275,978	24,087,359.84	7.53
2	002599	盛通股份	334,001	11,963,915.82	3.74
3	300373	扬杰科技	471,382	11,365,020.02	3.55
4	300168	万达信息	371,550	9,656,584.50	3.02
5	300452	山河药辅	197,372	9,615,963.84	3.01
6	300377	赢时胜	170,000	8,413,300.00	2.63
7	002402	和而泰	300,000	8,115,000.00	2.54
8	300253	卫宁健康	298,186	7,365,194.20	2.30
9	300245	天玑科技	256,000	5,683,200.00	1.78
10	300479	神思电子	129,500	5,551,665.00	1.74

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.csfund.com.cn> 网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	002292	奥飞动漫	63,969,417.62	8.48
2	002354	天神娱乐	52,983,189.26	7.02
3	002376	新北洋	47,376,232.62	6.28
4	300083	劲胜精密	42,682,735.00	5.66
5	002236	大华股份	26,261,385.34	3.48
6	600061	国投安信	22,848,093.51	3.03
7	300085	银之杰	20,689,298.84	2.74
8	002280	联络互动	19,846,880.98	2.63
9	300168	万达信息	19,184,926.36	2.54

10	600775	南京熊猫	18,544,155.60	2.46
11	601198	东兴证券	18,216,575.10	2.41
12	300148	天舟文化	16,923,452.32	2.24
13	300078	思创医惠	16,775,052.15	2.22
14	600715	文投控股	16,043,214.28	2.13
15	002045	国光电器	15,806,404.16	2.09
16	300077	国民技术	15,771,970.23	2.09
17	300452	山河药辅	14,243,858.00	1.89
18	300359	全通教育	14,001,745.18	1.86
19	300352	北信源	13,006,807.73	1.72
20	300312	邦讯技术	12,666,785.05	1.68

#### 7.4.2 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	002292	奥飞动漫	68,356,680.02	9.06
2	300083	劲胜精密	52,709,355.09	6.98
3	002376	新北洋	40,066,302.40	5.31
4	002354	天神娱乐	33,947,410.45	4.50
5	002236	大华股份	25,473,667.96	3.38
6	002280	联络互动	22,997,949.72	3.05
7	300078	思创医惠	21,625,944.16	2.87
8	600061	国投安信	21,554,668.69	2.86
9	300085	银之杰	20,939,152.79	2.77
10	600775	南京熊猫	18,891,094.40	2.50
11	300077	国民技术	18,216,378.67	2.41
12	600715	文投控股	17,818,941.28	2.36
13	601198	东兴证券	17,757,043.42	2.35
14	300312	邦讯技术	14,915,945.80	1.98
15	002045	国光电器	14,597,059.58	1.93
16	300352	北信源	14,489,501.06	1.92
17	300148	天舟文化	14,386,631.66	1.91
18	002055	得润电子	13,299,473.15	1.76
19	300168	万达信息	12,849,078.87	1.70
20	600563	法拉电子	12,811,453.78	1.70

**7.4.3 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	1,008,945,769.58
卖出股票收入（成交）总额	818,080,112.07

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 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。

**7.5 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。

**7.6 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。

**7.7 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。

**7.8 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。

**7.9 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。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 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。

**7.10.2 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。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 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。

**7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 7.12.3 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	460,434.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,115.68
5	应收申购款	1,953,097.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,423,647.76

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
5,239	52,130.30	26,517,334.95	9.71%	246,593,293.45	90.29%

### 8.2 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	11,769.31	0.0043%

### 8.3 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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年12月28日）基金份额总额	754,487,433.12
本报告期期初基金份额总额	754,487,433.12
本报告期基金总申购份额	216,847,514.11
减：本报告期基金总赎回份额	698,224,318.83
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	273,110,628.40

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

#### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本报告期内本基金管理人的高级管理人员无重大人事变动。

#### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 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基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

### 10.5 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。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	563,859,582.32	30.86%	525,122.49	30.86%	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	617,799,677.10	33.81%	575,358.38	33.81%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	645,366,622.23	35.32%	601,030.98	35.32%	-

### 10.7.2 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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	6,305,000,000.00	58.14%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	4,540,000,000.00	41.86%	-	-

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情况：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

长盛基金管理有限公司  
2016年8月25日