

长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金  
2016 年半年度报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 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。

基金托管人中国农业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。

## 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 主要财务指标和基金净值表现</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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
7.7 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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§ 11 备查文件目录</b> .....	<b>48</b>
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	48
11.3 查阅方式.....	49

## § 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	2,805,750,116.39 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。</p>
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、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	北京西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		100088	100031
法定代表人		高新	周慕冰

## 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
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	-354,508,529.47
本期利润	-541,442,152.36
加权平均基金份额本期利润	-0.1851
本期加权平均净值利润率	-38.31%
本期基金份额净值增长率	-28.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,546,376,652.77
期末可供分配基金份额利润	-0.5511
期末基金资产净值	1,293,315,938.58
期末基金份额净值	0.461

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-53.90%

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

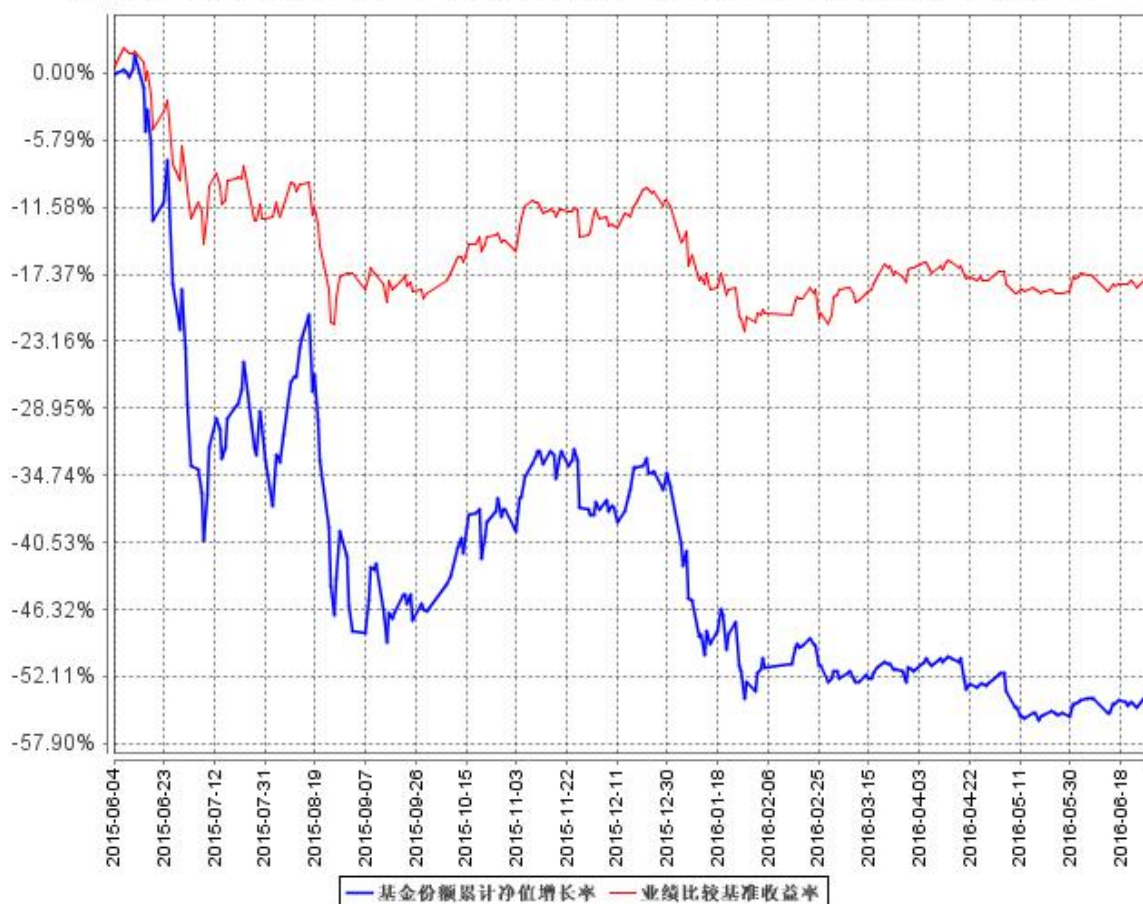
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.32%	0.93%	0.09%	0.49%	1.23%	0.44%
过去三个月	-5.14%	1.14%	-0.72%	0.51%	-4.42%	0.63%
过去六个月	-28.42%	1.99%	-6.85%	0.92%	-21.57%	1.07%
过去一年	-43.30%	2.88%	-11.93%	1.15%	-31.37%	1.73%
自基金合同生效起至今	-53.90%	2.93%	-17.49%	1.20%	-36.41%	1.73%

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



## § 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		
吴博文	本基金基金经理，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，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理。	2016年2月17日	-	8年	男，1983年6月出生，中国国籍。毕业于北京大学，金融学硕士。历任雷曼兄弟证券股份有限公司分析师助理，野村证券股份有限公司分析师助理，诺安基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。2015年8月加入长盛基金管理有限公司，现任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，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，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。
田间	本基金基金经理。	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。

#### 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 3 月份的两会，李克强总理明确我国经济目标守住 6.5%，受困于债务过高，落后产能过剩和房地产库存的制约，经济仍然面临较大的下行压力。民企固定资产投资从二季度开始出现了明显的下滑。政府加大财政政策力度，维持宽松货币政策，目标是在企业端去杠杆的同时，加大政府投资力度，从而能在艰难的去杠杆的过程中取得总体的平衡，维持社会稳定。

5 月份的大事是“权威人士讲话”，这个讲话奠定了未来一段时间政府经济工作的基调，是将过渡泛滥到大量虚拟资产里的流动性挤到实体资产领域。这个基调的制定是目前发展阶段的必然选择，我们必须意识到这个重大拐点的来临，对大类资产的配置的影响是深远的，也预示着未来相当长时间内我们面临的经济形势。经济下行+CPI 稳定（隐形通缩）已经暂时告一段落，经济下行+通胀将重新回到我们的经济生活中，也就是“滞胀”。我们预计未来三年内滞胀与通缩将交替出现。因此，对未来滞胀还是通缩的判断，将是决定我们组合净值表现的核心驱动要素，它决定了中观层面对行业的配置。

6 月份的大事件是英国“脱欧”的黑天鹅事件。在脱欧公投之前，基于我们对未来滞胀的判断，黄金将长期受益。如果英国留欧，避险情绪消退，美国加息概率就会提升；在黄金短暂的因美国加息而走低后，必然会有其他国家因为美国流动性的收缩而面临新的危机，会重新激发类似于英国脱欧这样的黑天鹅事件。如果英国脱欧，那么避险情绪大升，黄金，美元，美债，日元（逆套利交易）都会升值。总之英国脱欧只是在全球经济走向衰退中的一个事件，此后这样的事件会层出不穷。因此在六月份调仓的时候我们布局了贵金属行业的公司。

回顾我们二季度的操作，我们对于今年宏观环境的变化没有及时反应，在持仓品种的选择上还是更多的延续了我们自下而上的产业判断，忽略了在宏观环境由通缩向通胀转变的过程中，虚拟资产的估值将会面临阶梯式下降的趋势，导致净值表现落后。此后我们将更多地由自上而下宏观环境的变化判断中观层面行业配置的方法融合到我们以往主要看重产业成长的投资方式中。

#### 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 0.461 元，本报告期份额净值增长率为-28.42%，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

2016 年一季度 CPI 超预期上行，虽然在二季度通胀有所缓和，我们的整体判断是今年通胀会缓慢上行。大宗商品在油价的带领下开始回升，国内在供给收缩的环境下，有色金属等矿产资源的价格在过去的二季度里开始有一些表现，以锌价为代表。食品价格二季度上涨速度比较缓和，蔬菜鲜果价格下行，但猪肉价格持续上涨到二季度末，维持高位运行，我们预计 2016 年全年猪肉供给将处于偏紧的状态。二季度末开始的南方洪涝灾害是个预料之中的突发因素，今年雨水较大，将造成农产品整体供给紧张，糖和棉花价格已经有所表现，我们预计在三季度其他农产品也将陆续有所表现。综上虽然二季度通胀形势缓和，但我们预计在经济维持下行通道时，过渡流动性泛滥走到终点，资产价格将缓慢下行，商品的价格将缓慢上行，我们预计三季度通胀预期将重现。

此时英国退欧热度渐消，旧的一波欧洲风险刚刚散去，新的危机已然埋下伏笔。内部来看，英国带来的模仿效应，可能引来一连串国家的退欧尝试，尤其是法、意等大国。外部来看，难民危机仍未有效控制，俄罗斯对欧洲的敌意继续加强。亚太方面，南海仲裁在即，新上任的菲律宾总统刚表达对华友好意愿，日本又酝酿鼓动 G7 发表联合声明，迫使新总统按照“国际法”解决问题，同时爆出中日战机海上对峙，为周边海域带来新的不安定因素。因此，当全球失去经济增长引擎，各个国家又先后失去了放松流动性对经济带来刺激的手段，于是对于各国政治家来说，武力争夺存量的蛋糕将取代大家一起合作开发新蛋糕的“全球化”趋势。争端和摩擦，国际组织成立，合作，合作破裂，再联合，将成为我们面对的这个世界的常态。军工板块是我们基于以上的判断得出的长期受益的板块。在 6 月份的调仓中我们已经有所布局。

我国目前面临的产能过剩、企业成本过高和国企效率低下、政府管制严格等较多的问题，其实并不是我国特有的问题，西方国家历史上也曾经出现过我国类似的社会阶段。英国在 80 年代的经验应该能给予我们一定的借鉴意义。未来供给侧改革措施的进展很大程度影响我国经济发展的长期走势，供给侧改革对我国产业结构调整继而保持经济长期稳定高速增长意义重大。

英国在 50-60 年代实施凯恩斯主义的需求刺激，实现了快速增长，但后期却无法继续起到增加需求的作用，最终造成通胀；福利国家制度，政府靠提高税率和借债度日，在此情况下不得不通过增发国债和扩大货币供应量缓解债务问题；实体经济缺乏增长点，劳动生产率停滞不前；国企效率低下，冗员严重，人浮于事；工会的势力过大，劳动市场僵化，企业成本负担重；政府对市场的过度管制压制了竞争，造成了垄断，市场缺乏活力；上世纪 70 年代两次石油危机使得石油价格剧烈上涨，加剧了通胀。通胀这一关键问题，是对当今中国与当时英国对比讨论出现分歧的症结所在。我国目前还没有出现严重的通货膨胀，但正如我们前面讨论的，现在已经出现了通胀的苗头。其他方面具有惊人的相似之处。

在西欧的国企改革大潮中，英国保守党政府推动国企私有化改革一直是标杆，而其推动者撒切尔夫人也被誉为自由市场的忠实捍卫者。1979 年，保守党在英国大选获胜后，撒切尔夫人出任首相。俄罗斯等东欧国家在上世纪八九十年代的国企改革的背景则有明显差异。后者很大程度上是国家解体和政权崩溃之下，新的执政者为应对经济问题的无奈和仓促之举。不过，尽管西欧和东欧不同时期国企改革的背景各异，但改革手段都是一致的，即私有化。私有化的主要方式包括协议出售和公开上市两种，前者是指政府通过谈判，将手中国企股权出售给投资者，这些投资者可能是国内外的私人资本，也可以是国企的管理层或者职工。公开上市的方式则主要适用于大型国企的改革，因为这类国企私有化所需要的资金量太大，一般的私人资本无法满足，唯有资本市场一条路。这种方式主要适用于公用事业公司、石油等资金密集型企业，如英国电信、英国天然气

公司、苏格兰电力公司等。通过在证券交易所挂牌上市，还可以使这些企业的股东相对分散，有利于促进竞争和资本市场的发展。与此同时，上市也有利于国有资产价格的上升，可以增加国库收入。

私有化的方式相同，但两国的私有化结果却走向了截然相反的方向。英国的私有化极大地提高了企业的经营效率。撒切尔夫人执政期间，私有化涉及了英国 2/3 的国企，其中近 40 家曾严重亏损的大国企扭亏为盈。还有数据显示，1979 年启动国企改革之后的近 10 年时间内，体现技术实力的制造业劳动生产率年均增长率方面，英国超过了美国、日本和德国。相比而言，俄罗斯的私有化则几乎让经济走向崩溃，并一度形成了独步全球的“寡头经济”模式，普通人生活水平长期低于前苏联。直至今日，尽管普京政府不断加强中央集权，并限制寡头，但俄罗斯的贫富分化仍极其严重。统计数据显示，俄罗斯超过 80% 的财富仍掌握在不到 10% 的人手中。

我们坚定的相信我国不会重蹈俄罗斯的覆辙。综上，提升国企效率是我国处于目前经济发展阶段的必然选择。提升国企效率，国企资产私有化，是必然的路径。

#### 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，本基金本报告期末未实施利润分配。

本基金截至 2016 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-1,546,376,652.77 元，期末未分配利润为-1,512,434,177.81 元，其中，未分配利润已实现部分为-1,546,376,652.77 元，未分配利润未实现部分为 33,942,474.96 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

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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遵规守信、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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：长盛国企改革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	附注号	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	6.4.7.1	316,976,953.43	206,079,483.61
结算备付金		5,421,762.82	8,459,236.66
存出保证金		2,779,637.98	6,242,329.29
交易性金融资产	6.4.7.2	976,964,716.92	1,695,445,851.44
其中：股票投资		976,964,716.92	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	20,349,635.79
应收利息	6.4.7.5	138,091.51	103,739.41
应收股利		-	-
应收申购款		285,197.98	491,020.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,302,566,360.64	1,937,171,296.91
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		459,272.00	7,678,056.45
应付赎回款		2,710,649.48	6,424,531.00
应付管理人报酬		1,599,918.23	2,453,882.80
应付托管费		266,653.04	408,980.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,029,642.24	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	6.4.7.8	184,287.07	173,528.38
负债合计		9,250,422.06	23,265,978.27
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,805,750,116.39	2,973,749,932.59
未分配利润	6.4.7.10	-1,512,434,177.81	-1,059,844,613.95
所有者权益合计		1,293,315,938.58	1,913,905,318.64
负债和所有者权益总计		1,302,566,360.64	1,937,171,296.91

注：(1) 报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 0.461 元，基金份额总额为 2,805,750,116.39 份。

(2) 上年度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。

## 6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基 金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-514,753,035.43	-594,066,487.11
1. 利息收入		4,569,076.77	526,062.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,569,076.77	526,062.09
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）		-332,673,338.01	-189,828,677.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-338,462,893.97	-194,370,132.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	5,789,555.96	4,541,455.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-186,933,622.89	-404,763,872.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	284,848.70	-



减：二、费用		26,689,116.93	12,986,938.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,578,259.42	3,248,040.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,763,043.24	541,340.16
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	14,146,284.88	9,168,913.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	201,529.39	28,644.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-541,442,152.36	-607,053,425.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-541,442,152.36	-607,053,425.73

### 6.3 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：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）	2,973,749,932.59	-1,059,844,613.95	1,913,905,318.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-541,442,152.36	-541,442,152.36
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）	-167,999,816.20	88,852,588.50	-79,147,227.70
其中：1. 基金申购款	156,996,321.83	-79,159,330.41	77,836,991.42
2. 基金赎回款	-324,996,138.03	168,011,918.91	-156,984,219.12
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）	2,805,750,116.39	-1,512,434,177.81	1,293,315,938.58
项目	上年度可比期间 2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年6月30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）	-	-607,053,425.73	-607,053,425.73
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	3,250,867,544.91	-607,053,425.73	2,643,814,119.18

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：

周兵

基金管理人负责人

杨思乐

主管会计工作负责人

龚珉

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

#### 6.4.2 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。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	316,976,953.43

定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	316,976,953.43

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	953,410,914.56	976,964,716.92	23,553,802.36
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	953,410,914.56	976,964,716.92	23,553,802.36

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	134,769.88
应收结算备付金利息	2,195.82
其他	1,125.81
合计	138,091.51

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
----	------------------------

交易所市场应付交易费用	4,029,642.24
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,029,642.24

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付赎回费	5,271.87
预提费用	179,015.20
合计	184,287.07

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,973,749,932.59	2,973,749,932.59
本期申购	156,996,321.83	156,996,321.83
本期赎回（以“-”号填列）	-324,996,138.03	-324,996,138.03
本期末	2,805,750,116.39	2,805,750,116.39

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.10 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
上年度末	-1,281,153,090.36	221,308,476.41	-1,059,844,613.95
本期利润	-354,508,529.47	-186,933,622.89	-541,442,152.36
本期基金份额交易产生的变动数	89,284,967.06	-432,378.56	88,852,588.50
其中：基金申购款	-76,685,791.72	-2,473,538.69	-79,159,330.41
基金赎回款	165,970,758.78	2,041,160.13	168,011,918.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,546,376,652.77	33,942,474.96	-1,512,434,177.81

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	4,464,832.23
结算备付金利息收入	66,183.57
其他	38,060.97
合计	4,569,076.77

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	4,835,488,909.91
减：卖出股票成本总额	5,173,951,803.88
买卖股票差价收入	-338,462,893.97

**6.4.7.13 债券投资收益**

注：本基金本报告期间无债券投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

注：本基金本报告期间未取得衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,789,555.96
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,789,555.96

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-186,933,622.89
——股票投资	-186,933,622.89
——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	-186,933,622.89

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------



基金赎回费收入	220,866.45
转换费收入	63,982.25
合计	284,848.70

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	14,146,284.88
银行间市场交易费用	-
合计	14,146,284.88

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	134,261.40
帐户维护费[付国债登记公司]	9,000.00
汇划手续费	13,514.19
合计	201,529.39

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 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	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

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 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	上年度可比期间 2015年6月4日(基金合同生效日)至 2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,578,259.42	3,248,040.94
其中：支付销售机构的客户维护费	4,878,252.91	-

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

###### 6.4.10.2.2 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	上年度可比期间 2015年6月4日(基金合同生效日) 至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,763,043.24	541,340.16

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

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金份额。

##### 6.4.10.4.2 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及上年度末未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年6月4日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	316,976,953.43	4,464,832.23	205,213,176.97	526,062.09

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期间未进行利润分配。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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	9,643	125,166.14	125,166.14	-
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。

#### 6.4.12.2 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
000638	万方发展	2016年1月5日	重大事项停牌	23.66	2016年7月25日	24.75	906,006	25,699,396.89	21,436,101.96	-
600581	八一钢铁	2016年2月1日	重大事项停牌	5.89	2016年7月5日	5.76	616,763	5,095,048.21	3,632,734.07	-
601611	中国核建	2016年6月30日	重大事项停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	30,252	104,974.44	632,871.84	-

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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 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。

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

#### **6.4.13.2 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。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

#### **6.4.13.3 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 6.4.12 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	316,976,953.43	-	-	-	-	-	316,976,953.43
结算备付金	5,421,762.82	-	-	-	-	-	5,421,762.82
存出保证金	2,779,637.98	-	-	-	-	-	2,779,637.98
交易性金融资产	-	-	-	-	-	976,964,716.92	976,964,716.92
应收利息	-	-	-	-	-	138,091.51	138,091.51
应收申购款	-	-	-	-	-	285,197.98	285,197.98
资产总计	325,178,354.23	-	-	-	-	977,388,006.41	1,302,566,360.64
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	459,272.00	459,272.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,710,649.48	2,710,649.48
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,599,918.23	1,599,918.23

应付托管费	-	-	-	-	-	266,653.04	266,653.04
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,029,642.24	4,029,642.24
其他负债	-	-	-	-	-	184,287.07	184,287.07
负债总计	-	-	-	-	-	9,250,422.06	9,250,422.06
利率敏感度缺口	325,178,354.23	-	-	-	-	968,137,584.35	1,293,315,938.58
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-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	0.00	0.00	0.00	0.00	1,693,124,269.08	1,913,905,318.64

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末及上年度末均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。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下表。

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	976,964,716.92	75.54	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	976,964,716.92	75.54	1,695,445,851.44	88.59

#### 6.4.13.4.3.2 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 2016 年 6 月 30 日的基金资产净值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）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准（附注 6.4.1）上升 5%	123,511,672.13	213,440,635.04
2. 业绩比较基准（附注 6.4.1）下降 5%	-123,511,672.13	-213,440,635.04	

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下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。

#### 6.4.14 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、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 951,263,009.05 元，属于第二层次的余额为人民币 25,701,707.87 元，属于第三层次的余额为人民币零元（2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,594,140,906.47 元，第二层次 101,304,944.97 元，无属于第三层次的余额）。

#### (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。

#### 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	976,964,716.92	75.00
	其中：股票	976,964,716.92	75.00
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	322,398,716.25	24.75
7	其他各项资产	3,202,927.47	0.25
8	合计	1,302,566,360.64	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	26,931,766.94	2.08
B	采矿业	60,579,718.00	4.68
C	制造业	615,240,839.69	47.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,224,918.75	1.18
E	建筑业	13,538,123.94	1.05
F	批发和零售业	28,049,735.61	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	35,548,069.68	2.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,837,496.95	4.86
J	金融业	56,221,652.82	4.35
K	房地产业	26,800,332.32	2.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	136,807.85	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	35,855,254.37	2.77
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	976,964,716.92	75.54

### 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	002025	航天电器	1,717,175	42,397,050.75	3.28
2	002013	中航机电	2,835,421	38,221,475.08	2.96

3	000733	振华科技	1,694,597	38,128,432.50	2.95
4	600988	赤峰黄金	1,996,600	37,236,590.00	2.88
5	002548	金新农	2,070,524	36,358,401.44	2.81
6	300015	爱尔眼科	981,529	35,855,254.37	2.77
7	002311	海大集团	2,262,868	35,685,428.36	2.76
8	600562	国睿科技	940,527	32,250,670.83	2.49
9	300136	信维通信	1,309,635	27,449,949.60	2.12
10	600271	航天信息	1,140,379	27,141,020.20	2.10
11	000060	中金岭南	2,498,310	26,057,373.30	2.01
12	600399	抚顺特钢	3,999,959	25,879,734.73	2.00
13	002413	雷科防务	1,854,570	25,463,246.10	1.97
14	002385	大北农	3,159,096	25,462,313.76	1.97
15	600066	宇通客车	1,279,476	25,333,624.80	1.96
16	000638	万方发展	906,006	21,436,101.96	1.66
17	002368	太极股份	599,440	21,298,103.20	1.65
18	600718	东软集团	1,123,995	20,591,588.40	1.59
19	600176	中国巨石	2,111,552	20,207,552.64	1.56
20	002142	宁波银行	1,346,468	19,900,797.04	1.54
21	600376	首开股份	1,713,481	19,053,908.72	1.47
22	000876	新希望	2,229,232	18,547,210.24	1.43
23	600547	山东黄金	442,800	17,229,348.00	1.33
24	002716	金贵银业	912,540	16,973,244.00	1.31
25	600359	新农开发	1,386,098	14,595,611.94	1.13
26	002627	宜昌交运	669,824	14,173,475.84	1.10
27	600012	皖通高速	980,886	14,016,860.94	1.08
28	000977	浪潮信息	578,807	13,573,024.15	1.05
29	600498	烽火通信	543,500	13,196,180.00	1.02
30	002007	华兰生物	417,907	13,122,279.80	1.01
31	000049	德赛电池	312,600	13,110,444.00	1.01
32	601169	北京银行	1,245,214	12,912,869.18	1.00
33	601800	中国交建	1,225,570	12,905,252.10	1.00
34	002179	中航光电	296,402	12,840,134.64	0.99
35	600727	鲁北化工	1,394,600	12,662,968.00	0.98
36	600000	浦发银行	795,740	12,389,671.80	0.96
37	600506	香梨股份	561,500	12,336,155.00	0.95
38	300474	景嘉微	62,774	9,470,713.38	0.73
39	000958	东方能源	623,467	8,635,017.95	0.67
40	000711	京蓝科技	348,938	7,746,423.60	0.60
41	600548	深高速	944,510	7,357,732.90	0.57

42	000892	星美联合	509,880	7,214,802.00	0.56
43	300330	华虹计通	404,841	7,210,218.21	0.56
44	600148	长春一东	326,942	7,202,532.26	0.56
45	600990	四创电子	82,590	7,159,727.10	0.55
46	600099	林海股份	583,028	6,862,239.56	0.53
47	002265	西仪股份	454,782	6,835,373.46	0.53
48	000999	华润三九	279,516	6,769,877.52	0.52
49	002066	瑞泰科技	397,647	6,740,116.65	0.52
50	000785	武汉中商	593,151	6,613,633.65	0.51
51	000695	滨海能源	414,720	6,589,900.80	0.51
52	600476	湘邮科技	229,216	6,461,599.04	0.50
53	601009	南京银行	677,800	6,364,542.00	0.49
54	600980	北矿磁材	214,920	6,211,188.00	0.48
55	002136	安纳达	392,157	6,164,708.04	0.48
56	603993	洛阳钼业	1,473,200	6,113,780.00	0.47
57	002473	圣莱达	234,278	5,470,391.30	0.42
58	600036	招商银行	231,108	4,044,390.00	0.31
59	600581	八一钢铁	616,763	3,632,734.07	0.28
60	603023	威帝股份	57,030	1,098,397.80	0.08
61	601611	中国核建	30,252	632,871.84	0.05
62	002797	第一创业	15,080	609,382.80	0.05
63	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.02
64	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.02
65	300512	中亚股份	1,873	187,150.16	0.01
66	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
67	603339	四方冷链	2,793	151,995.06	0.01
68	601966	玲珑轮胎	9,643	125,166.14	0.01
69	603779	威龙股份	2,808	117,823.68	0.01
70	603959	百利科技	2,815	116,681.75	0.01
71	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.01
72	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
73	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
74	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
75	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
76	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
77	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
78	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
79	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
80	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

81	300456	耐威科技	46	3,116.50	0.00
----	--------	------	----	----------	------

#### 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	600498	烽火通信	107,993,332.91	5.64
2	002400	省广股份	86,864,090.81	4.54
3	601336	新华保险	80,603,857.97	4.21
4	002508	老板电器	75,292,843.78	3.93
5	300315	掌趣科技	73,174,847.70	3.82
6	600372	中航电子	69,976,357.41	3.66
7	002624	完美环球	69,948,638.32	3.65
8	300024	机器人	64,256,827.47	3.36
9	300136	信维通信	57,832,654.74	3.02
10	002007	华兰生物	56,166,842.14	2.93
11	002281	光迅科技	56,084,993.29	2.93
12	000733	振华科技	56,016,805.20	2.93
13	002179	中航光电	55,785,482.43	2.91
14	600990	四创电子	49,439,673.05	2.58
15	600547	山东黄金	48,693,184.49	2.54
16	603019	中科曙光	48,539,875.59	2.54
17	600487	亨通光电	46,390,772.43	2.42
18	300009	安科生物	43,510,351.51	2.27
19	000892	星美联合	43,002,610.87	2.25
20	300133	华策影视	42,993,668.43	2.25
21	600074	保千里	42,992,474.04	2.25
22	300144	宋城演艺	42,991,433.05	2.25
23	600201	生物股份	42,991,216.11	2.25
24	000070	特发信息	42,705,158.47	2.23
25	600028	中国石化	42,697,428.70	2.23
26	300369	绿盟科技	42,491,495.59	2.22
27	300188	美亚柏科	42,225,003.40	2.21
28	000687	华讯方舟	42,158,307.29	2.20
29	000558	莱茵体育	42,104,637.55	2.20

30	002049	紫光国芯	41,464,636.39	2.17
31	300101	振芯科技	40,684,431.52	2.13
32	600036	招商银行	39,679,177.46	2.07
33	002268	卫士通	39,548,829.00	2.07
34	600562	国睿科技	39,346,339.90	2.06
35	002013	中航机电	39,020,889.17	2.04
36	002025	航天电器	38,840,809.00	2.03
37	002311	海大集团	38,625,646.67	2.02
38	002548	金新农	38,550,461.66	2.01
39	600183	生益科技	38,502,646.66	2.01
40	000999	华润三九	38,502,244.94	2.01
41	601607	上海医药	38,501,283.54	2.01
42	600060	海信电器	38,500,635.88	2.01
43	000423	东阿阿胶	38,489,867.17	2.01
44	600563	法拉电子	38,325,088.88	2.00
45	600674	川投能源	38,280,227.00	2.00

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002508	老板电器	101,562,601.84	5.31
2	002400	省广股份	94,888,838.23	4.96
3	600498	烽火通信	92,312,107.63	4.82
4	601336	新华保险	80,261,147.38	4.19
5	600372	中航电子	66,681,875.96	3.48
6	300315	掌趣科技	63,668,304.69	3.33
7	002624	完美环球	60,838,411.35	3.18
8	002074	国轩高科	60,288,457.03	3.15
9	300024	机器人	58,255,575.55	3.04
10	002292	奥飞动漫	54,572,315.23	2.85
11	002123	荣信股份	51,473,240.94	2.69
12	600487	亨通光电	50,113,662.27	2.62
13	600028	中国石化	48,377,744.50	2.53
14	603019	中科曙光	48,070,213.70	2.51
15	002281	光迅科技	47,577,757.02	2.49
16	300101	振芯科技	47,108,524.46	2.46

17	002007	华兰生物	47,068,109.24	2.46
18	002179	中航光电	43,876,169.95	2.29
19	000567	海德股份	42,316,106.26	2.21
20	600563	法拉电子	41,446,074.28	2.17
21	000423	东阿阿胶	41,444,160.74	2.17
22	000558	莱茵体育	40,889,085.17	2.14
23	000068	*ST 华赛	40,047,168.35	2.09
24	600990	四创电子	39,624,977.00	2.07
25	000070	特发信息	39,560,246.96	2.07
26	300369	绿盟科技	39,050,054.18	2.04
27	300188	美亚柏科	38,909,233.11	2.03
28	600201	生物股份	38,822,489.05	2.03

#### 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	4,642,404,292.25
卖出股票收入（成交）总额	4,835,488,909.91

注：本项中 7.4.1、7.4.2 和 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。

#### 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

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 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：本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 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

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	2,779,637.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	138,091.51
5	应收申购款	285,197.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,202,927.47

#### 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：本基金本报告期末投资前十名股票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，分项之和与和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
57,791	48,549.95	6,690,429.86	0.24%	2,799,059,686.53	99.76%

### 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	11,046.46	0.0004%

### 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	2,973,749,932.59
本报告期基金总申购份额	156,996,321.83
减：本报告期基金总赎回份额	324,996,138.03
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2,805,750,116.39

## § 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

本报告期本基金管理人的高级管理人员未有重大人事变动情况。

#### 10.2.2 基金经理变动情况

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基金经理。

#### 10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 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。

### 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
国泰君安	2	2,091,449,279.19	22.07%	1,947,766.11	23.00%	-
申银万国	1	538,827,104.47	5.69%	501,810.48	5.92%	-
国信证券	1	1,060,005,117.43	11.19%	987,180.67	11.65%	-
齐鲁证券	1	835,800,220.66	8.82%	778,379.45	9.19%	-
光大证券	1	2,622,471,162.89	27.67%	2,442,310.57	28.83%	-
东北证券	1	552,079,384.11	5.83%	514,150.87	6.07%	-
方正证券	1	1,775,675,415.92	18.74%	1,298,554.18	15.33%	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	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	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	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	-	-	-	-	-

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:无

## 10.8 其他重大事件

除上述事项之外,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	长盛基金管理有限公司关于增加汇成基金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	《中国证券报》《上海证券报》《证券	2016年6月22日

		时报》及本 公司网站	
2	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加联泰资产费率优惠活动的公告	同上	2016 年 6 月 20 日
3	长盛基金管理有限公司关于增加广源达信为旗下基金销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 6 月 15 日
4	长盛基金管理有限公司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	2016 年 6 月 8 日
5	长盛基金管理有限公司关于增加晟视天下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	2016 年 6 月 6 日
6	长盛基金管理有限公司关于增加金斧子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	2016 年 6 月 3 日
7	长盛基金管理有限公司关于增加中证金牛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	2016 年 5 月 27 日
8	长盛基金管理有限公司关于增加大泰金石为旗下基金销售机构并推出转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 5 月 25 日
9	长盛基金管理有限公司关于增加浦发银行为长盛同裕纯债债券型证券投资基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	同上	2016 年 5 月 23 日
10	长盛基金管理有限公司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参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 5 月 9 日
11	长盛基金管理有限公司关于大连网金金融	同上	2016 年 4 月 27 日

	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		
12	长盛基金管理有限公司关于增加北京格上富信为旗下部分基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 4 月 26 日
13	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	同上	2016 年 4 月 21 日
14	长盛基金管理有限公司关于增加中信期货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	2016 年 4 月 19 日
15	长盛基金管理有限公司关于增加中国农业银行为长盛新兴成长主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构以及开通定投 转换业务并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2016 年 4 月 14 日
16	长盛基金管理有限公司关于增加新兰德为部分基金销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 4 月 5 日
17	长盛基金管理有限公司关于参加泰信财富费率优惠活动的公告	同上	2016 年 4 月 5 日
18	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2015 年度报告摘要	同上	2016 年 3 月 26 日
19	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2015 年度报告	同上	2016 年 3 月 26 日
20	长盛基金管理有限公司关于联讯证券开通旗下部分开放式基金定投业务的公告	同上	2016 年 3 月 25 日
21	长盛基金管理有限公司关于在包商银行开通旗下部分基金转换业务的公告	同上	2016 年 3 月 25 日
22	长盛基金管理有限公司关于增加长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金代销	同上	2016 年 3 月 17 日

	机构并开通基金定投及转换业务的公告		
23	长盛基金管理有限公司关于增加奕丰金融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	2016 年 3 月 17 日
24	长盛基金管理有限公司关于增加君德汇富为旗下部分基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 3 月 17 日
25	长盛基金管理有限公司关于增加浦发银行为长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	同上	2016 年 3 月 11 日
26	长盛基金管理有限公司关于调整长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	同上	2016 年 2 月 19 日
27	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加诺亚正行和金观诚基金费率优惠活动的公告	同上	2016 年 1 月 29 日
28	关于暂停旗下部分基金在恒宇天泽的基金销售业务的公告	同上	2016 年 1 月 26 日
29	关于增加恒宇天泽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	2016 年 1 月 21 日
30	关于增加泰信财富为旗下部分基金销售机构并开通转换业务的公告	同上	2016 年 1 月 21 日
31	长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	同上	2016 年 1 月 20 日
32	关于旗下部分开放式基金参加包商银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2016 年 1 月 20 日
33	长盛国企改革主题灵活配置混合证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2016 年 1 月 15 日

34	长盛国企改革主题灵活配置混合证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2016 年 1 月 15 日
35	长盛新兴成长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	2016 年 1 月 8 日
36	关于交易所指数熔断后相关基金业务办理时间调整的公告	同上	2016 年 1 月 7 日
37	长盛盛世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	2016 年 1 月 7 日
38	关于增加包商银行为旗下部分基金代销机构以及开通基金定投业务的公告	同上	2016 年 1 月 6 日
39	长盛基金关于旗下开放式基金指数熔断发生后相关业务处理规则的公告	同上	2016 年 1 月 4 日
40	长盛基金关于交易所指数熔断后相关基金业务办理时间调整的公告	同上	2016 年 1 月 4 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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。

### 11.2 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。



### 11.3 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8月25日