

长盛生态环境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

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 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..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 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..... | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| §5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 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..... | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表..... | 13 |
| 6.2 利润表..... | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 15 |
| 6.4 报表附注..... | 16 |
| §7 投资组合报告 | 31 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 31 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 31 |
| 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..... | 32 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 33 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 35 |
| 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..... | 35 |
| 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..... | 35 |
| 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..... | 35 |
| 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..... | 35 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 36 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 36 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 36 |

| | |
|--|-----------|
| §8 基金份额持有人信息 | 37 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 37 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 37 |
| 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..... | 37 |
| §9 开放式基金份额变动 | 37 |
| §10 重大事件揭示 | 38 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 38 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 38 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 39 |
| 10.8 其他重大事件..... | 40 |
| §11 备查文件目录 | 45 |
| 11.1 备查文件目录..... | 45 |
| 11.2 存放地点..... | 45 |
| 11.3 查阅方式..... | 45 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------------|
| 基金名称 | 长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 长盛生态环境混合 |
| 基金主代码 | 000598 |
| 交易代码 | 000598 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年9月10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 | 278,896,757.51份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金主要投资于从事或受益于生态环境主题的上市公司，通过精选个股和风险控制，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 | 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，灵活配置国内生态环境主题行业的上市公司股票和债券，谋求基金资产的长期稳定增长。本基金对生态环境主题上市公司股票的界定是：公司主营业务中从事与生态环境主题相关的业务，或者直接或间接受益于生态环境投资主题所带来的较高回报，相关股票具体包括：节能技术和装备；节能产品、节能建材和节能服务；环保技术和设备；环保服务及环保受益相关行业；清洁生产技术和清洁产品；资源回收及循环利用产业；与有效利用土地等自然资源、形成生态与经济良性循环主题相关的行业以及城市园林等相关行业上市公司。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，选择生态环境主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。 |
| 业绩比较基准 | 50%*中证环保产业指数收益率+50%*中证综合债指数收益率 |
| 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 |
| 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 | 北京市西城区复兴门内大街 1 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 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 邮政编码 | | 100088 | 100818 |
| 法定代表人 | | 高新 | 田国立 |

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 | http://www.csfunds.com.cn |
| 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 |

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 | -52,887,372.71 |
| 本期利润 | -80,532,264.02 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2759 |
| 本期加权平均净值利润率 | -20.19% |
| 本期基金份额净值增长率 | -15.87% |
| 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 | 103,978,252.14 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3728 |
| 期末基金资产净值 | 382,875,009.65 |
| 期末基金份额净值 | 1.373 |
| 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 | 37.30% |

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。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 | 1.03% | 0.94% | 2.75% | 0.74% | -1.72% | 0.20% |
| 过去三个月 | -1.58% | 0.80% | 0.89% | 0.79% | -2.47% | 0.01% |
| 过去六个月 | -15.87% | 1.62% | -8.27% | 1.28% | -7.60% | 0.34% |
| 过去一年 | -25.26% | 2.22% | -10.43% | 1.45% | -14.83% | 0.77% |
| 自基金合同生效起至今 | 37.30% | 2.08% | 21.81% | 1.29% | 15.49% | 0.79% |

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{中证环保产业指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

基准指数的构建考虑了三个原则：

1、公允性。本基金为主题混合型基金，在综合比较目前市场上各主要行业指数的编制特点后，本基金选择以中证环保产业指数作为股票投资的业绩比较基准。中证环保产业指数是由中证指数有限公司编制，根据联合国环境与发展综合核算体系对于环保产业的界定方法，将符合资源管理、清洁技术和产品、污染管理的公司纳入环保产业主题，采用等权重加权方式，反映上海和深圳市场环保产业公司表现的指数。本基金主要投资于生态环境主题相关上市公司股票，因此中证环保产业指数适合作为本基金的业绩比较基准。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于生态环境主题的股票和债券不低于非现金基金资产的 80%；根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可使业绩比较更具有合理性。

3、再平衡。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：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。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十二部分“二、投资范围”和“四、投资限制”的有关约定。

§ 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 | | |
| 刘旭明 | 本基金基金经理，长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。 | 2014 年 9 月 11 日 | - | 14 年 | 男，1977 年 5 月出生，中国国籍。清华大学管理学硕士。曾任中信证券研究部首席分析师、国信证券经济研究所首席分析师。2013 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，现任研究部总监，现任长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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

上半年市场波动较大，上证指数下跌 17.22%，创业板指数下跌 17.92%。跌幅主要发生在一月份，市场受到减持、熔断和汇率的影响大幅下跌，多次出现千股跌停，二月份市场开始筑底反弹，期间震荡反复，各种投资逻辑均有所表现，先是在货币放水和周期品涨价带动下周期行业率先反弹，带动市场筑底企稳，两会期间政策暖风频吹，市场风险偏好有所增加，先是房地产行业大幅

上涨，随后创业板接力，大幅反弹，带动市场活跃度提高。进入二季度，市场前期憧憬的货币放水逐步得到证伪，通胀的担忧逐步缓解，周期股的表现略显疲弱，市场开始寻找新的主题，锂电池、OLED、芯片国产化、物联网、次新股等主题表现较为活跃，带动市场情绪。上半年，行业表现较好的为金融、食品饮料、有色、煤炭等估值较低的个股。

2016 年上半年基于对市场熊市调整的判断，整体仓位水平控制在中低水平，有效避免了 1 月及 4 月份的市场系统性风险。在市场大跌后，2 月初及 5 月底及时提高仓位，获取一定收益。在有效调整仓位的同时，注重对持仓结构的优化。在经济环境不稳，熊市震荡期间，注重自下而上挖掘个股价值，及时跟踪公司动态。因而基金业绩略好于市场整体情况。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.373 元，本报告期份额净值增长率为-15.87%，同期业绩比较基准增长率为-8.27%。

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 年下半年国内经济环境更为复杂。脱欧导致全球经济不确定程度增加，国内“稳增长和调结构”的经济寻底过程将继续。房地产刺激政策效果逐步消退，销量下滑将导致投资、新开工等数据回落，对经济造成压力。预计下半年货币政策仍将保持宽松，财政政策继续发力，经济将呈 L 型。近期改革落地有所加速，未来经济前景乐观。

A 股市场经历年初下跌后，震荡调整近 5 个月。虽然流动性及参与各方对股市影响因素复杂，国际资本市场动荡的外溢性值得谨慎关注，A 股市场仍将演绎震荡格局，但经济见底及改革推进，为市场结构性行情展开奠定基础。机构主体持股信心增强，有利于投资价值显著、基本面扎实的行业及个股走出独立向上行情。

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进行利润分配。

本基金截至 2016 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 103,978,252.14 元，其中：未分配利润已实现部分为 219,980,725.41 元，未分配利润未实现部分为-116,002,473.27 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛生态环境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：长盛生态环境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 |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 124,185,065.22 | 193,481,462.13 |
| 结算备付金 | | 932,243.91 | 1,757,284.66 |
| 存出保证金 | | 244,682.46 | 805,550.63 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 258,760,732.79 | 318,737,841.54 |
| 其中：股票投资 | | 258,760,732.79 | 318,737,841.54 |
| 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 | | 364,343.62 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 25,293.28 | 41,448.51 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 14,497.45 | 83,290.52 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 384,526,858.73 | 514,906,877.99 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 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 | | - | 9,616,220.81 |
| 应付赎回款 | | 605,123.87 | 949,073.07 |
| 应付管理人报酬 | | 466,379.15 | 657,792.81 |
| 应付托管费 | | 77,729.84 | 109,632.11 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 332,393.66 | 657,914.49 |
| 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 | 170,222.56 | 273,173.37 |
| 负债合计 | | 1,651,849.08 | 12,263,806.66 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 278,896,757.51 | 308,059,257.52 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 103,978,252.14 | 194,583,813.81 |
| 所有者权益合计 | | 382,875,009.65 | 502,643,071.33 |
| 负债和所有者权益总计 | | 384,526,858.73 | 514,906,877.99 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.373 元，基金份额总额为 278,896,757.51 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛生态环境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 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | -75,594,467.10 | 662,950,160.80 |
| 1.利息收入 | | 613,110.77 | 935,716.18 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 613,110.77 | 935,716.18 |
| 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） | | -48,637,117.20 | 654,669,334.10 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -50,241,465.50 | 646,652,960.56 |
| 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 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 1,604,348.30 | 8,016,373.54 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -27,644,891.31 | -8,466,668.67 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 74,430.64 | 15,811,779.19 |
| 减：二、费用 | | 4,937,796.92 | 22,020,025.26 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,982,923.77 | 12,057,982.42 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 497,153.97 | 2,009,663.75 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 1,276,218.15 | 7,747,350.56 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.20 | 181,501.03 | 205,028.53 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -80,532,264.02 | 640,930,135.54 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -80,532,264.02 | 640,930,135.54 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛生态环境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） | 308,059,257.52 | 194,583,813.81 | 502,643,071.33 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -80,532,264.02 | -80,532,264.02 |
| 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） | -29,162,500.01 | -10,073,297.65 | -39,235,797.66 |
| 其中：1.基金申购款 | 13,996,092.64 | 5,169,181.75 | 19,165,274.39 |
| 2.基金赎回款 | -43,158,592.65 | -15,242,479.40 | -58,401,072.05 |
| 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) | 278,896,757.51 | 103,978,252.14 | 382,875,009.65 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015年1月1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、期初所有者权益(基金净值) | 1,016,568,452.31 | 309,662,491.17 | 1,326,230,943.48 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 640,930,135.54 | 640,930,135.54 |
| 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) | -452,958,905.05 | -478,770,742.82 | -931,729,647.87 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,632,681,067.78 | 903,524,916.82 | 2,536,205,984.60 |
| 2.基金赎回款 | -2,085,639,972.83 | -1,382,295,659.64 | -3,467,935,632.47 |
| 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) | 563,609,547.26 | 471,821,883.89 | 1,035,431,431.15 |

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

杨思乐

龚珉

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

长盛生态环境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[2014]303号文《关于核准长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的注册，由长盛基金管理有限公司于2014年8月11日至2014年9月5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）验证并出具（2014）验字第60468688_A10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2014年9月10日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期间不定。本基金设立时，收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币2,908,701,817.10元，折合2,908,701,817.10份基金份额；募集资金在募集期间产生的利息为人民币1,388,104.22元，折

合 1,388,104.22 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 2,910,089,921.32 元，折合 2,910,089,921.32 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均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。本基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的 0%-95%；其中投资于生态环境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%。本基金业绩比较标准为：50%*中证环保产业指数收益率+50%*中证综合债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会及中国证券投资基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

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 | 124,185,065.22 |

| | |
|----------------|----------------|
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 124,185,065.22 |

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 | 254,696,393.80 | 258,760,732.79 | 4,064,338.99 |
| 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 | 254,696,393.80 | 258,760,732.79 | 4,064,338.99 |

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 | 24,813.75 |
| 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 | 378.85 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 1.50 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 99.18 |
| 合计 | 25,293.28 |

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 | 332,393.66 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 332,393.66 |

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 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 1,151.84 |
| 预提费用 | 169,070.72 |
| 合计 | 170,222.56 |

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 | 308,059,257.52 | 308,059,257.52 |
| 本期申购 | 13,996,092.64 | 13,996,092.64 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -43,158,592.65 | -43,158,592.65 |
| 本期末 | 278,896,757.51 | 278,896,757.51 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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 | 297,050,299.36 | -102,466,485.55 | 194,583,813.81 |
| 本期利润 | -52,887,372.71 | -27,644,891.31 | -80,532,264.02 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -24,182,201.24 | 14,108,903.59 | -10,073,297.65 |
| 其中：基金申购款 | 12,153,554.36 | -6,984,372.61 | 5,169,181.75 |
| 基金赎回款 | -36,335,755.60 | 21,093,276.20 | -15,242,479.40 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 219,980,725.41 | -116,002,473.27 | 103,978,252.14 |

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 | 604,201.31 |
| 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 | 5,811.78 |
| 其他 | 3,097.68 |
| 合计 | 613,110.77 |

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 | 414,127,125.84 |
| 减：卖出股票成本总额 | 464,368,591.34 |
| 买卖股票差价收入 | -50,241,465.50 |

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期末未取得债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本本基金本报告期末未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本本基金本报告期末未取得衍生工具收益。

6.4.7.16 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 | 1,604,348.30 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 1,604,348.30 |

6.4.7.17 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 | -27,644,891.31 |

| | |
|------------|----------------|
| ——股票投资 | -27,644,891.31 |
| ——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 | -27,644,891.31 |

6.4.7.18 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 | 68,132.89 |
| 转换费收入 | 6,297.75 |
| 合计 | 74,430.64 |

6.4.7.19 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 | 1,276,218.15 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 1,276,218.15 |

6.4.7.20 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 | 34,809.32 |
| 信息披露费 | 134,261.40 |
| 银行间账户维护费 | 4,500.00 |
| 银行费用 | 7,930.31 |
| 合计 | 181,501.03 |

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

截至资产负债表日，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

本基金无须作披露的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、基金注册登记机构、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 |
| 国元证券股份有限公司（“国元证券”） | 基金管理人股东、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 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,982,923.77 | 12,057,982.42 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 924,606.08 | 3,915,723.30 |

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 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 497,153.97 | 2,009,663.75 |

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

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固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未运用固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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|----------------------|------------|----------------------|------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 2015年1月1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 |
| 中国银行 | 124,185,065.22 | 604,201.31 | 119,971,683.21 | 878,891.14 |

注：1. 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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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：本基金本报告期末进行利润分配。

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 | 2,816 | 36,551.68 | 36,551.68 | - |
| 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的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，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 |
|--------|------|------------|--------|--------|-----------|--------|-------|-----------|------------|----|
| 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 | 9,075 | 31,490.25 | 189,849.00 | - |

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银行间市场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合规与审计委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、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专属风险管理部门法律合规部和风险管理部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险和运作风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理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，公司督察长和监察稽核人员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经理、公司总经理、合规与审计委员会、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和合规与审计委员会构成，公司合规与审计委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。合规与审计委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

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。

6.4.13.3 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主要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不计息，因此账面余额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。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出权证保证金及债券投资等。

下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。

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 | 124,185,065.22 | - | - | - | - | - | -124,185,065.22 |
| 结算备付金 | 932,243.91 | - | - | - | - | - | 932,243.91 |
| 存出保证金 | 244,682.46 | - | - | - | - | - | 244,682.46 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -258,760,732.79 | 258,760,732.79 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 364,343.62 | 364,343.62 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 25,293.28 | 25,293.28 |

| | | | | | | | |
|---------------------|----------------|-------|--------|------|------|-----------------|-----------------|
| 应收申购款 | 99.40 | - | - | - | - | 14,398.05 | 14,497.45 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 125,362,090.99 | - | - | - | - | -259,164,767.74 | 384,526,858.73 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 605,123.87 | 605,123.87 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 466,379.15 | 466,379.15 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 77,729.84 | 77,729.84 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 332,393.66 | 332,393.66 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 170,222.56 | 170,222.56 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 1,651,849.08 | 1,651,849.08 |
| 利率敏感度缺口 | 125,362,090.99 | - | - | - | - | -257,512,918.66 | 382,875,009.65 |
| 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 | 193,481,462.13 | - | - | - | - | - | -193,481,462.13 |
| 结算备付金 | 1,757,284.66 | - | - | - | - | - | 1,757,284.66 |
| 存出保证金 | 805,550.63 | - | - | - | - | - | 805,550.63 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | -318,737,841.54 | 318,737,841.54 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 41,448.51 | 41,448.51 |
| 应收申购款 | 99.40 | - | - | - | - | 83,191.12 | 83,290.52 |
| 资产总计 | 196,044,396.82 | - | - | - | - | -318,862,481.17 | 514,906,877.99 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 9,616,220.81 | 9,616,220.81 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 949,073.07 | 949,073.07 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 657,792.81 | 657,792.81 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 109,632.11 | 109,632.11 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 657,914.49 | 657,914.49 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 273,173.37 | 273,173.37 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 12,263,806.66 | 12,263,806.66 |
| 利率敏感度缺口 | 196,044,396.82 | - | - | - | - | -306,598,674.51 | 502,643,071.33 |

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。

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未持有交易性金融资产债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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，所面临的最大的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

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 | 258,760,732.79 | 67.58 | 318,737,841.54 | 63.41 |
| 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 | 258,760,732.79 | 67.58 | 318,737,841.54 | 63.41 |

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 系数是根据组合在过去一个年度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） | |
| | | 本期末（2016年6月30日） | 上年度末（2015年12月31日） |
| | 业绩比较基准上升 5% | 22,856,666.86 | 40,887,751.96 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -22,856,666.86 | -40,887,751.96 |

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、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 258,570,883.79 元，属于第二层次的余额为人民币 189,849.00 元，属于第三层次的余额为人民币零元（2015 年 12 月 31 日：第一层次人民币 311,771,508.54 元，第二层次人民币 6,966,333.00 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 | 258,760,732.79 | 67.29 |
| | 其中：股票 | 258,760,732.79 | 67.29 |
| 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 | 125,117,309.13 | 32.54 |
| 7 | 其他各项资产 | 648,816.81 | 0.17 |
| 8 | 合计 | 384,526,858.73 | 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 | 4,517,219.00 | 1.18 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 168,731,599.13 | 44.07 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,123,960.02 | 1.86 |
| E | 建筑业 | 189,849.00 | 0.05 |
| F | 批发和零售业 | 20,843,331.00 | 5.44 |
| 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 | 12,410,961.51 | 3.24 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,885,891.30 | 1.01 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,842,863.10 | 0.48 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 29,289,107.52 | 7.65 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,843,524.52 | 0.48 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 8,082,426.69 | 2.11 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 258,760,732.79 | 67.58 |

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 | 002236 | 大华股份 | 2,686,193 | 35,189,128.30 | 9.19 |
| 2 | 002085 | 万丰奥威 | 2,003,686 | 34,443,362.34 | 9.00 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 1,451,382 | 31,146,657.72 | 8.13 |
| 4 | 300070 | 碧水源 | 1,968,354 | 29,289,107.52 | 7.65 |
| 5 | 600406 | 国电南瑞 | 923,693 | 12,349,775.41 | 3.23 |
| 6 | 300267 | 尔康制药 | 791,863 | 11,339,478.16 | 2.96 |
| 7 | 600703 | 三安光电 | 563,409 | 11,251,277.73 | 2.94 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|---------------|------|
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 620,622 | 10,345,768.74 | 2.70 |
| 9 | 300148 | 天舟文化 | 531,389 | 8,082,426.69 | 2.11 |
| 10 | 600104 | 上汽集团 | 390,200 | 7,917,158.00 | 2.07 |
| 11 | 002454 | 松芝股份 | 420,000 | 7,635,600.00 | 1.99 |
| 12 | 600617 | 国新能源 | 621,637 | 7,123,960.02 | 1.86 |
| 13 | 603766 | 隆鑫通用 | 266,700 | 5,392,674.00 | 1.41 |
| 14 | 601607 | 上海医药 | 284,800 | 5,140,640.00 | 1.34 |
| 15 | 002299 | 圣农发展 | 174,410 | 4,517,219.00 | 1.18 |
| 16 | 002589 | 瑞康医药 | 139,600 | 4,287,116.00 | 1.12 |
| 17 | 002223 | 鱼跃医疗 | 125,290 | 3,974,198.80 | 1.04 |
| 18 | 002462 | 嘉事堂 | 105,300 | 3,922,425.00 | 1.02 |
| 19 | 002400 | 省广股份 | 275,010 | 3,885,891.30 | 1.01 |
| 20 | 002727 | 一心堂 | 152,600 | 3,815,000.00 | 1.00 |
| 21 | 000028 | 国药一致 | 56,500 | 3,678,150.00 | 0.96 |
| 22 | 600741 | 华域汽车 | 259,146 | 3,630,635.46 | 0.95 |
| 23 | 002294 | 信立泰 | 98,868 | 2,689,209.60 | 0.70 |
| 24 | 002547 | 春兴精工 | 174,200 | 1,926,652.00 | 0.50 |
| 25 | 300347 | 泰格医药 | 63,526 | 1,843,524.52 | 0.48 |
| 26 | 300404 | 博济医药 | 51,100 | 1,822,737.00 | 0.48 |
| 27 | 600721 | *ST 百花 | 63,300 | 1,134,969.00 | 0.30 |
| 28 | 300011 | 鼎汉技术 | 12,600 | 295,722.00 | 0.08 |
| 29 | 601611 | 中国核建 | 9,075 | 189,849.00 | 0.05 |
| 30 | 601127 | 小康股份 | 4,906 | 117,106.22 | 0.03 |
| 31 | 603131 | 上海沪工 | 1,263 | 76,664.10 | 0.02 |
| 32 | 300515 | 三德科技 | 1,354 | 63,461.98 | 0.02 |
| 33 | 300518 | 盛讯达 | 1,306 | 61,186.10 | 0.02 |
| 34 | 002799 | 环球印务 | 1,080 | 47,131.20 | 0.01 |
| 35 | 601966 | 玲珑轮胎 | 2,816 | 36,551.68 | 0.01 |
| 36 | 603958 | 哈森股份 | 2,372 | 34,394.00 | 0.01 |
| 37 | 002802 | 洪汇新材 | 1,629 | 24,565.32 | 0.01 |
| 38 | 603909 | 合诚股份 | 1,095 | 20,126.10 | 0.01 |
| 39 | 603016 | 新宏泰 | 1,602 | 13,600.98 | 0.00 |
| 40 | 002805 | 丰元股份 | 971 | 5,631.80 | 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 | 002415 | 海康威视 | 30,097,873.45 | 5.99 |
| 2 | 300148 | 天舟文化 | 20,164,813.57 | 4.01 |
| 3 | 600104 | 上汽集团 | 12,259,221.00 | 2.44 |
| 4 | 300267 | 尔康制药 | 11,516,521.04 | 2.29 |
| 5 | 600703 | 三安光电 | 11,475,468.95 | 2.28 |
| 6 | 000049 | 德赛电池 | 11,474,042.31 | 2.28 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 10,109,794.36 | 2.01 |
| 8 | 600340 | 华夏幸福 | 9,705,048.33 | 1.93 |
| 9 | 300070 | 碧水源 | 8,948,629.12 | 1.78 |
| 10 | 002400 | 省广股份 | 7,830,059.17 | 1.56 |
| 11 | 002051 | 中工国际 | 7,801,412.00 | 1.55 |
| 12 | 600048 | 保利地产 | 7,363,935.00 | 1.47 |
| 13 | 000722 | 湖南发展 | 7,134,598.00 | 1.42 |
| 14 | 002589 | 瑞康医药 | 6,740,669.48 | 1.34 |
| 15 | 600079 | 人福医药 | 6,381,337.11 | 1.27 |
| 16 | 002376 | 新北洋 | 6,307,611.54 | 1.25 |
| 17 | 600585 | 海螺水泥 | 5,978,031.00 | 1.19 |
| 18 | 002454 | 松芝股份 | 5,955,835.00 | 1.18 |
| 19 | 002364 | 中恒电气 | 5,878,201.60 | 1.17 |
| 20 | 600271 | 航天信息 | 5,868,506.30 | 1.17 |

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 | 601877 | 正泰电器 | 22,909,812.57 | 4.56 |
| 2 | 600969 | 郴电国际 | 17,615,788.41 | 3.50 |
| 3 | 000049 | 德赛电池 | 17,303,448.92 | 3.44 |
| 4 | 601222 | 林洋能源 | 13,800,100.08 | 2.75 |
| 5 | 601126 | 四方股份 | 13,750,283.25 | 2.74 |
| 6 | 300148 | 天舟文化 | 12,172,700.52 | 2.42 |
| 7 | 002085 | 万丰奥威 | 10,067,254.12 | 2.00 |
| 8 | 600340 | 华夏幸福 | 10,015,653.40 | 1.99 |
| 9 | 600617 | 国新能源 | 8,128,158.00 | 1.62 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 10 | 002309 | 中利科技 | 8,092,062.43 | 1.61 |
| 11 | 600048 | 保利地产 | 7,568,869.00 | 1.51 |
| 12 | 002051 | 中工国际 | 7,463,182.42 | 1.48 |
| 13 | 600271 | 航天信息 | 7,233,211.36 | 1.44 |
| 14 | 600979 | 广安爱众 | 6,558,387.00 | 1.30 |
| 15 | 000722 | 湖南发展 | 5,841,301.25 | 1.16 |
| 16 | 000400 | 许继电气 | 5,683,619.25 | 1.13 |
| 17 | 002376 | 新北洋 | 5,677,630.65 | 1.13 |
| 18 | 600079 | 人福医药 | 5,562,440.00 | 1.11 |
| 19 | 000601 | 韶能股份 | 5,548,243.12 | 1.10 |
| 20 | 002364 | 中恒电气 | 5,471,503.00 | 1.09 |

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 | 432,036,373.90 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 414,127,125.84 |

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

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 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 | 244,682.46 |
| 2 | 应收证券清算款 | 364,343.62 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 25,293.28 |
| 5 | 应收申购款 | 14,497.45 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 648,816.81 |

7.12.3 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。

7.12.4 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。

7.12.5 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 |
| 12, 535 | 22, 249. 44 | 62, 900, 579. 98 | 22. 55% | 215, 996, 177. 53 | 77. 45% |

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 | 7, 033. 53 | 0. 0025% |

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（2014年9月10日）基金份额总额 | 2, 910, 089, 921. 32 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 308, 059, 257. 52 |
| 本报告期基金总申购份额 | 13, 996, 092. 64 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 43, 158, 592. 65 |
| 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 | 278,896,757.51 |
|-------------|----------------|

§ 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

本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动情况。

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 | 45,888,353.66 | 5.43% | 42,736.05 | 5.43% | - |
| 联讯证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | 758,077,381.67 | 89.69% | 705,999.32 | 89.69% | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中航证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 川财证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中原证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 日信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 齐鲁证券 | 1 | 41,212,450.22 | 4.88% | 38,381.29 | 4.88% | - |

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：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》《证券时报》及本公司网站 | 2016年6月22日 |
| 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 | 同上 | 2016年6月8日 |

| | | | |
|----|---|----|------------|
| | 代销机构以及开通基金定投业务及转换业务的公告 | | |
| 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为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率 | 同上 | 2016年4月27日 |

| | | | |
|----|---|----|-----------------|
| | 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 | 长盛生态环境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 22 日 |
| 14 | 长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要 | 同上 | 2016 年 4 月 20 日 |
| 15 | 长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新） | 同上 | 2016 年 4 月 20 日 |
| 16 | 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 |
| 17 | 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 |
| 18 | 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 |
| 19 | 长盛基金管理有限公司关于参加 | 同上 | 2016 年 4 月 5 日 |

| | | | |
|----|---|----|-----------------|
| | 泰信财富费率优惠活动的公告 | | |
| 20 | 长盛生态环境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 |
| 21 | 长盛生态环境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 |
| 22 | 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 |
| 23 | 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 |
| 24 | 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机构并开通基金定投及转换业务的公告 | 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 |
| 26 | 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 |
| 27 | 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 |
| 28 | 长盛基金管理有限公司关于旗下 | 同上 | 2016 年 1 月 29 日 |

| | | | |
|----|--|----|-----------------|
| | 基金参加诺亚正行和金观诚基金费率优惠活动的公告 | | |
| 29 | 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 |
| 30 | 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 |
| 31 | 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 |
| 32 | 长盛生态环境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 |
| 33 | 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 |
| 34 | 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 |
| 35 | 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 |
| 36 | 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 |
| 37 | 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 |
| 38 | 长盛基金关于旗下开放式基金指 | 同上 | 2016 年 1 月 4 日 |

| | | | |
|----|-------------------------------|----|----------------|
| | 数熔断发生后相关业务处理规则的公告 | | |
| 39 | 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、《长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛生态环境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的办公地址和/或基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司
2016 年 8 月 25 日