

# 长盛量化红利策略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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	5
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	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
<b>§5 托管人报告</b>	<b>12</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
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
<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	33
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	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	37
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	37
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	38
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	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12 投资组合报告附注	38

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
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.....	39
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>40</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>40</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 其他重大事件.....	42
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>47</b>
11.1 备查文件目录.....	47
11.2 存放地点.....	47
11.3 查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛量化红利策略混合型证券投资基金
基金简称	长盛量化红利混合
基金主代码	080005
交易代码	080005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 11 月 25 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	156,214,627.14 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标，并追求风险调整后的收益最大化，满足投资人长期稳健的投资收益需求。
投资策略	本基金通过严格的数量化股票选择方法生成红利风格股票池，在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合，从而形成基于核心-卫星投资策略的股票资产组合。其中，大类资产配置策略综合考虑宏观经济、政策导向和市场环境（市场估值水平、资金供求）等因素，股票投资中将以红利股票投资为主导，以价值型企业及分红能力作为选择投资对象的核心标准。
业绩比较基准	75%×中证红利指数+25%×中证综合债指数
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	赵会军
	联系电话	010-82019988	010-66105799
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666、 010-62350088	95588
传真		010-82255988	010-66105798

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 55 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 55 号
邮政编码	100088	100140
法定代表人	高新	姜建清

## 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地址

## 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	-5,827,441.03
本期利润	-32,561,870.28
加权平均基金份额本期利润	-0.2025
本期加权平均净值利润率	-10.94%
本期基金份额净值增长率	-8.83%
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	151,660,996.51
期末可供分配基金份额利润	0.9709
期末基金资产净值	307,875,623.65
期末基金份额净值	1.971
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	105.25%

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	3.25%	1.14%	-0.23%	0.71%	3.48%	0.43%
过去三个月	4.73%	1.10%	-1.46%	0.77%	6.19%	0.33%
过去六个月	-8.83%	1.84%	-10.91%	1.41%	2.08%	0.43%
过去一年	-8.79%	2.48%	-19.54%	1.85%	10.75%	0.63%
过去三年	131.88%	2.06%	57.77%	1.43%	74.11%	0.63%
自基金合同生效起至今	105.25%	1.61%	16.46%	1.24%	88.79%	0.37%

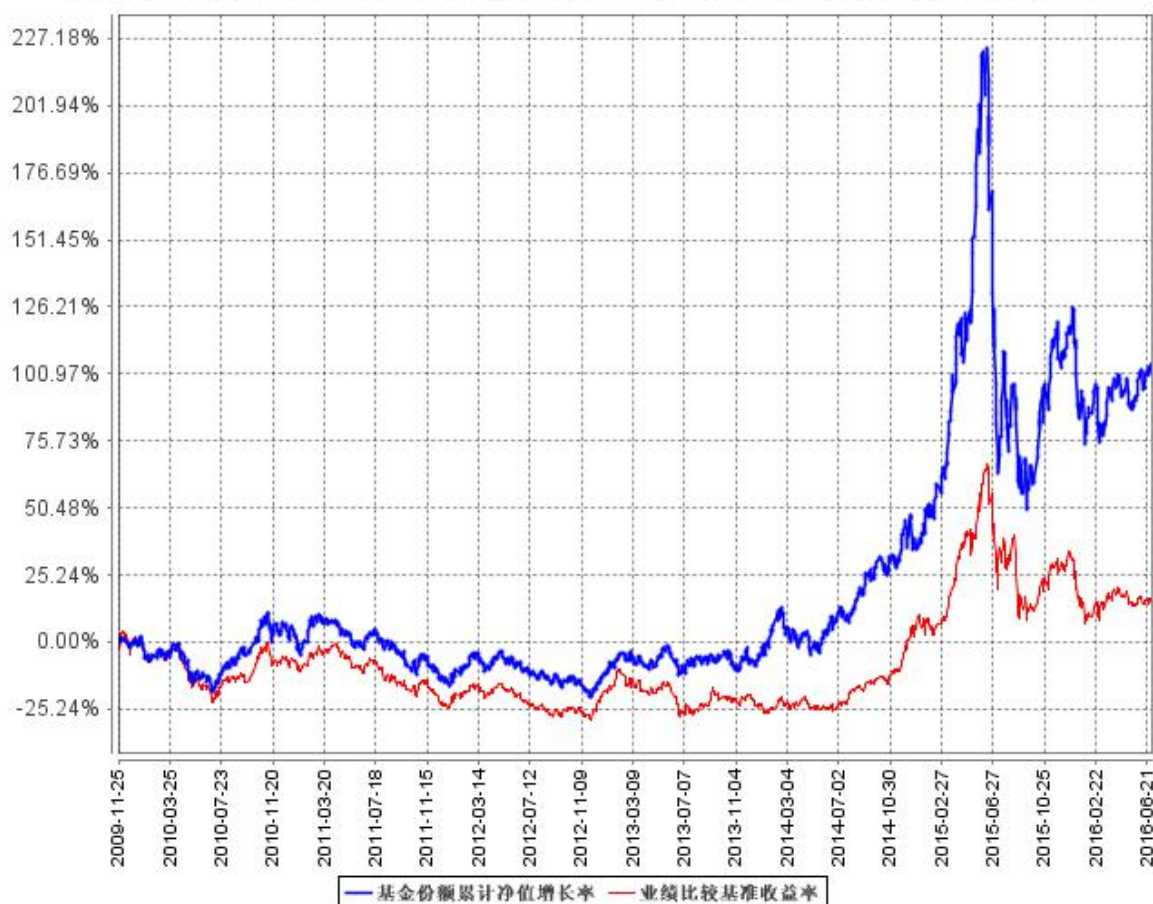
注：本基金业绩比较基准=75%×中证红利指数+25%×中证综合债指数

其中，中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的 100 只股票作为样本，以反映 A 股市场高红利股票的整体状况和走势。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，作为衡量本基金业绩的基准，较为合适。中证综合债指数是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债和企业债，以更加全面地反映中国债券市场整体价格变动趋势。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 75%、25%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本基金成立六个月内，使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十一部分投资范围、投资限制的有关约定。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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		
王超	本基金基金经理，长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF，本基金）基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理。	2015 年 6 月 18 日	-	9 年	男，1981 年 9 月出生，中国国籍。中央财经大学硕士，金融风险管理师（FRM）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员，从事数量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，未发现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 年二季度的市场行情处于低位窄幅振荡之中，一方面，市场经过前期的大幅剧烈下跌，风险得以充分释放；另一方面，宏观经济数据持续在低位徘徊，企业盈利情况不容乐观，小盘股估值处于高位，投资者风险偏好低迷，市场也缺乏自低位大幅反弹的动力。市场出现了成交量持续萎缩、波动率持续降低的状态。期间虽然经历了“权威人士”重申供给侧改革、英国脱欧等事

件冲击,但是市场表现出了很强的韧性,没有出现一季度频现的连续暴跌场景。新能源汽车、OLED、芯片国产化等主题热点层出不穷,市场中结构性机会使得主动型基金能够充分发挥选股优势,净值出现了明显的恢复性增长,偏股混合型基金二季度的净值增长率中位数为 3.13%,本基金在二季度净值增长率为 4.73%,处于同类基金前三分之一的水平。本基金一直贯彻在控制下行风险的前提下追求长期投资收益的投资理念,通过灵活的仓位控制来降低组合下行风险,运用多种量化投资策略构建进攻性投资组合获取收益。

#### 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 1.971 元,本报告期份额净值增长率为-8.83%,同期业绩比较基准增长率为-10.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来的行情,我们仍将维持谨慎的观点,但是会积极参与市场中出现的结构性机会。英国退欧的长期风险还在酝酿,美联储加息仍然悬而未决,外围环境处于高度的不确定环境之中。国内宏观经济将会继续维持“L”型,关于稳增长和调结构的政策摇摆将会影响投资者的长期风险偏好提升。人民币汇率和资产价格之间的平衡关系也将对管理层的调控能力形成巨大的挑战。从积极的视角来看,前几年的新兴产业开始逐步产生真实业绩,这些得到证实的概念将会获得资金的持续买入,新能源汽车就是这方面的典型。处于新兴产业,处于技术优势低位,盈利能力强,具备持续成长能力的标的将是我们进行量化选股时的重要考虑因素。

#### 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十五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 151,660,996.51 元，其中：未分配利润已实现部分为 239,427,122.51 元，未分配利润未实现部分为-87,766,126.00 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，本基金托管人在对长盛量化红利策略混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### **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，长盛量化红利策略混合型证券投资基金的管理人——长盛基金管理有限公司在长盛量化红利策略混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，长盛量化红利策略混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的长盛量化红利策略混合型证券投资基金 2013 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：长盛量化红利策略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	89,710,750.21	85,034,784.56
结算备付金		198,375.48	2,097,837.24
存出保证金		272,268.37	798,803.20
交易性金融资产	6.4.7.2	219,377,172.28	213,265,452.49
其中：股票投资		219,377,172.28	213,265,452.49
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		-	32,076,157.73
应收利息	6.4.7.5	16,295.53	14,393.90
应收股利		-	-
应收申购款		8,407.68	584,322.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		309,583,269.55	333,871,751.26
<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		-	-

应付赎回款		664,272.66	728,656.07
应付管理人报酬		372,961.63	417,385.45
应付托管费		62,160.26	69,564.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	436,688.36	1,597,227.92
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	171,562.99	292,934.32
负债合计		1,707,645.90	3,105,768.00
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	156,214,627.14	152,993,255.60
未分配利润	6.4.7.10	151,660,996.51	177,772,727.66
所有者权益合计		307,875,623.65	330,765,983.26
负债和所有者权益总计		309,583,269.55	333,871,751.26

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值：1.971 元，基金份额总额：156,214,627.14 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛量化红利策略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
<b>一、收入</b>		-28,113,415.17	646,571,154.01
1.利息收入		363,334.63	586,354.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	363,334.63	586,354.44
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,851,233.87	364,135,080.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,384,676.99	360,786,682.82
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	1,533,443.12	3,348,397.85
3.公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.17	-26,734,429.25	279,101,477.07

号填列)			
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	108,913.32	2,748,241.83
<b>减：二、费用</b>		4,448,455.11	13,625,546.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,231,724.43	9,258,104.00
2. 托管费	6.4.10.2.2	371,954.12	1,543,017.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,683,890.14	2,648,956.16
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	160,886.42	175,468.56
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-32,561,870.28	632,945,607.94
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		-32,561,870.28	632,945,607.94

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛量化红利策略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)	152,993,255.60	177,772,727.66	330,765,983.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-32,561,870.28	-32,561,870.28
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)	3,221,371.54	6,450,139.13	9,671,510.67
其中：1.基金申购款	54,096,423.66	46,188,707.38	100,285,131.04
2.基金赎回款	-50,875,052.12	-39,738,568.25	-90,613,620.37
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	156,214,627.14	151,660,996.51	307,875,623.65

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
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	537,284,644.27	164,121,284.53	701,405,928.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	632,945,607.94	632,945,607.94
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)	-83,820,262.36	-270,676,306.44	-354,496,568.80
其中：1.基金申购款	984,176,597.26	965,487,075.06	1,949,663,672.32
2.基金赎回款	-1,067,996,859.62	-1,236,163,381.50	-2,304,160,241.12
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)	453,464,381.91	526,390,586.03	979,854,967.94

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

长盛量化红利策略混合型证券投资基金(原长盛量化红利策略股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]927号《关于核准长盛量化红利策略股票型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,251,673,981.96元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第248号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》



于 2009 年 11 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,251,832,665.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 158,683.54 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，长盛量化红利策略股票型证券投资基金证券投资基金于 2015 年 7 月 16 日公告后更名为长盛量化红利策略混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市 的股票、债券、短期金融工具、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。股票投资占基金资产净值的比例为 60-95%，其中投资于红利股票的比例不低于股票类资产的 80%。债券投资占基金资产净值的比例为 0-40%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。本基金的业绩比较基准为：中证红利指数×75%+中证综合债指数×25%

#### 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛量化红利策略混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本报告期不存在会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期不存在会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期不存在差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

## 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	89,710,750.21
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	89,710,750.21

### 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	213,054,048.38	219,377,172.28	6,323,123.90
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	213,054,048.38	219,377,172.28	6,323,123.90

### 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

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

### 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	16,104.82
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	80.37
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	110.34
合计	16,295.53

#### 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	436,688.36
银行间市场应付交易费用	-
合计	436,688.36

#### 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	2,040.19
其他	10,398.38
预提费用	159,124.42
合计	171,562.99

#### 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	152,993,255.60	152,993,255.60
本期申购	54,096,423.66	54,096,423.66
本期赎回(以“-”号填列)	-50,875,052.12	-50,875,052.12
本期末	156,214,627.14	156,214,627.14

注：申购含转换入份额；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	239,687,930.30	-61,915,202.64	177,772,727.66
本期利润	-5,827,441.03	-26,734,429.25	-32,561,870.28
本期基金份额交易产生的变动数	5,566,633.24	883,505.89	6,450,139.13
其中：基金申购款	81,695,003.31	-35,506,295.93	46,188,707.38
基金赎回款	-76,128,370.07	36,389,801.82	-39,738,568.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	239,427,122.51	-87,766,126.00	151,660,996.51

#### 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	349,477.02
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	9,595.73
其他	4,261.88
合计	363,334.63

#### 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	589,545,877.32
减：卖出股票成本总额	592,930,554.31
买卖股票差价收入	-3,384,676.99

#### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内未取得债券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内未取得贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内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	1,533,443.12
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,533,443.12

**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	-26,734,429.25
——股票投资	-26,734,429.25
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-26,734,429.25

**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	101,254.96
转换费收入	7,658.36
合计	108,913.32

注：1、本基金的赎回费按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

**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	1,683,890.14
银行间市场交易费用	-
合计	1,683,890.14

**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	24,863.02	
信息披露费	134,261.40	
银行划款费用	1,762.00	
帐户维护费	-	
合计	160,886.42	

**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**

本基金并无需作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

本基金无需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（“长盛基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国元证券	-	-	400,231,666.76	24.66%

**6.4.10.1.2 债券交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	364,371.24	24.66%	364,371.24	24.66%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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

**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	2,231,724.43
其中：支付销售机构的客户维护费	469,651.62	695,931.94

注：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：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。



**6.4.10.2 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	371,954.12		1,543,017.35	

注：支付基金托管人中国工商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。

**6.4.10.3 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**

份额单位：份

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	
基金合同生效日（2009年11月25日）持有的基金份额	-		-	
期初持有的基金份额	-		30,000,050.00	
期间申购/买入总份额	-		-	
期间因拆分变动份额	-		-	
减：期间赎回/卖出总份额	-		30,000,050.00	
期末持有的基金份额	-		-	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-		-	

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

**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：除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

**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
中国工商银行	89,710,750.21	349,477.02	58,216,773.17	571,357.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金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：本基金本报告期无利润分配事项。

#### 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	2,224	28,867.52	28,867.52	-
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	-

##### 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
300038	梅泰诺	2015年12月16日	重大事项停牌	50.58	-	-	99,919	3,990,448.00	5,053,903.02	-
300035	中科电气	2016年5月23日	重大事项停牌	15.29	-	-	303,294	3,831,638.22	4,637,365.26	-
300334	津膜	2016	重大	20.30	-	-	217,263	3,912,776.00	4,410,438.90	-

	科技	年 5 月 20 日	事项 停牌								
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	90,862	2,634,372.13	2,754,027.22	-	
002283	天润 曲轴	2016 年 3 月 23 日	重大 事项 停牌	18.20	-	-	129,900	1,845,506.89	2,364,180.00	-	
300184	力源 信息	2016 年 3 月 4 日	重大 事项 停牌	11.65	-	-	179,711	2,220,805.56	2,093,633.15	-	
002611	东方 精工	2016 年 3 月 29 日	重大 事项 停牌	11.38	2016 年 8 月 18 日	11.92	173,915	1,638,751.79	1,979,152.70	-	
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	5,157	17,894.79	107,884.44	-	

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。

### 6.4.12.4 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，属于风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于货币型基金与债券型基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管

理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.12.5 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

#### **6.4.12.6 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变

现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 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，其余均能以合理的价格适时变现。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投资的公允价值。

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。

#### 6.4.12.7 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。

##### 6.4.12.7.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受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。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

##### 6.4.12.7.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	89,710,750.21	-	-	-	89,710,750.21
结算备付金	198,375.48	-	-	-	198,375.48
存出保证金	272,268.37	-	-	-	272,268.37
交易性金融资产	-	-	-	219,377,172.28	219,377,172.28
应收利息	-	-	-	16,295.53	16,295.53

应收申购款	4,970.18	-	-	3,437.50	8,407.68
资产总计	90,186,364.24	-	-	219,396,905.31	309,583,269.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	664,272.66	664,272.66
应付管理人报酬	-	-	-	372,961.63	372,961.63
应付托管费	-	-	-	62,160.26	62,160.26
应付交易费用	-	-	-	436,688.36	436,688.36
其他负债	-	-	-	171,562.99	171,562.99
负债总计	-	-	-	1,707,645.90	1,707,645.90
利率敏感度缺口	90,186,364.24	-	-	217,689,259.41	307,875,623.65
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	85,034,784.56	-	-	-	85,034,784.56
结算备付金	2,097,837.24	-	-	-	2,097,837.24
存出保证金	798,803.20	-	-	-	798,803.20
交易性金融资产	-	-	-	213,265,452.49	213,265,452.49
应收证券清算款	-	-	-	32,076,157.73	32,076,157.73
应收利息	-	-	-	14,393.90	14,393.90
应收申购款	1,988.07	-	-	582,334.07	584,322.14
资产总计	87,933,413.07	-	-	245,938,338.19	333,871,751.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	728,656.07	728,656.07
应付管理人报酬	-	-	-	417,385.45	417,385.45
应付托管费	-	-	-	69,564.24	69,564.24
应付交易费用	-	-	-	1,597,227.92	1,597,227.92
其他负债	-	-	-	292,934.32	292,934.32
负债总计	-	-	-	3,105,768.00	3,105,768.00
利率敏感度缺口	87,933,413.07	-	-	242,832,570.19	330,765,983.26

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.12.7.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2016年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2015年12月31日：同），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）。

#### 6.4.12.7.2 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。

### 6.4.12.7.3 其他价格风险

其他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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 60-95%，债券、现金及其它短期金融工具为 0-40%，权证投资占基金资产净值的净值的比例为 0-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.12.7.3.1 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	219,377,172.28	71.26	213,265,452.49	64.48
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	219,377,172.28	71.26	213,265,452.49	64.48

#### 6.4.12.7.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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	上年度末（2015 年 12 月

		30 日 )	31 日 )
	1. 业绩比较基准上升 5%	18,768,579.62	19,211,219.07
	2. 业绩比较基准下降 5%	-18,768,579.62	-19,211,219.07

#### 6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 198,838,499.25 元，属于第二层次的余额为 20,538,673.03 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 180,983,187.12 元，第二层次 32,282,265.37 元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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



(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	219,377,172.28	70.86
	其中：股票	219,377,172.28	70.86
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	89,909,125.69	29.04
7	其他各项资产	296,971.58	0.10
8	合计	309,583,269.55	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	148,825,763.11	48.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	107,884.44	0.04
F	批发和零售业	13,744,667.15	4.46
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	2,643,593.05	0.86
J	金融业	49,435,441.99	16.06
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	1,876,000.00	0.61
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	2,723,696.44	0.88
S	综合	-	-
	合计	219,377,172.28	71.26

### 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	002007	华兰生物	499,912	15,697,236.80	5.10
2	601988	中国银行	4,500,000	14,445,000.00	4.69
3	601939	建设银行	3,000,000	14,250,000.00	4.63
4	000686	东北证券	881,119	11,375,246.29	3.69
5	000158	常山股份	728,301	10,116,100.89	3.29
6	601998	中信银行	1,651,710	9,365,195.70	3.04
7	002353	杰瑞股份	475,441	9,166,502.48	2.98
8	600120	浙江东方	406,800	8,831,628.00	2.87
9	000333	美的集团	331,650	7,866,738.00	2.56
10	002418	康盛股份	600,000	6,336,000.00	2.06
11	002588	史丹利	499,902	6,173,789.70	2.01
12	300038	梅泰诺	99,919	5,053,903.02	1.64
13	300035	中科电气	303,294	4,637,365.26	1.51
14	300334	津膜科技	217,263	4,410,438.90	1.43
15	300309	吉艾科技	331,427	4,401,350.56	1.43
16	002415	海康威视	199,100	4,272,686.00	1.39
17	000587	金叶珠宝	266,500	4,112,095.00	1.34
18	600104	上汽集团	199,400	4,045,826.00	1.31
19	002236	大华股份	298,621	3,911,935.10	1.27
20	603566	普莱柯	149,946	3,297,312.54	1.07
21	601311	骆驼股份	156,200	3,100,570.00	1.01

22	300389	艾比森	126,141	3,099,284.37	1.01
23	300112	万讯自控	186,150	3,060,306.00	0.99
24	300232	洲明科技	181,475	2,876,378.75	0.93
25	300202	聚龙股份	116,602	2,822,934.42	0.92
26	000593	大通燃气	224,475	2,819,406.00	0.92
27	300246	宝莱特	90,862	2,754,027.22	0.89
28	600088	中视传媒	114,827	2,723,696.44	0.88
29	002376	新北洋	197,500	2,638,600.00	0.86
30	002111	威海广泰	100,000	2,629,000.00	0.85
31	300154	瑞凌股份	254,500	2,628,985.00	0.85
32	600850	华东电脑	90,610	2,599,600.90	0.84
33	002429	兆驰股份	298,700	2,503,106.00	0.81
34	002017	东信和平	173,477	2,498,068.80	0.81
35	300064	豫金刚石	245,300	2,497,154.00	0.81
36	600580	卧龙电气	221,105	2,478,587.05	0.81
37	600148	长春一东	111,274	2,451,366.22	0.80
38	002158	汉钟精机	198,640	2,449,231.20	0.80
39	002283	天润曲轴	129,900	2,364,180.00	0.77
40	002037	久联发展	134,000	2,168,120.00	0.70
41	300184	力源信息	179,711	2,093,633.15	0.68
42	300019	硅宝科技	111,449	2,004,967.51	0.65
43	002611	东方精工	173,915	1,979,152.70	0.64
44	300187	永清环保	140,000	1,876,000.00	0.61
45	300114	中航电测	40,057	1,193,698.60	0.39
46	002184	海得控制	39,900	1,049,769.00	0.34
47	002090	金智科技	34,500	1,013,265.00	0.33
48	300103	达刚路机	49,948	934,027.60	0.30
49	600562	国睿科技	21,950	752,665.50	0.24
50	603555	贵人鸟	21,789	543,199.77	0.18
51	300516	久之洋	741	129,800.97	0.04
52	603737	三棵树	1,027	119,214.16	0.04
53	601611	中国核建	5,157	107,884.44	0.04
54	603779	威龙股份	2,308	96,843.68	0.03
55	300512	中亚股份	963	96,222.96	0.03
56	002798	帝王洁具	856	74,215.20	0.02
57	601127	小康股份	2,894	69,079.78	0.02
58	603131	上海沪工	963	58,454.10	0.02
59	300515	三德科技	1,054	49,400.98	0.02
60	300518	盛讯达	939	43,992.15	0.01

61	002799	环球印务	880	38,403.20	0.01
62	603958	哈森股份	2,175	31,537.50	0.01
63	601966	玲珑轮胎	2,224	28,867.52	0.01
64	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
65	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
66	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
67	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	601988	中国银行	28,670,000.00	8.67
2	601318	中国平安	26,166,029.81	7.91
3	601169	北京银行	21,999,107.00	6.65
4	000686	东北证券	15,586,579.59	4.71
5	002007	华兰生物	15,440,468.16	4.67
6	002353	杰瑞股份	14,962,485.25	4.52
7	601939	建设银行	14,940,000.00	4.52
8	601288	农业银行	14,536,000.00	4.39
9	000158	常山股份	14,447,604.56	4.37
10	601998	中信银行	13,715,021.38	4.15
11	600038	中直股份	11,676,118.80	3.53
12	000333	美的集团	11,470,930.17	3.47
13	600893	中航动力	11,405,362.50	3.45
14	600118	中国卫星	11,387,561.78	3.44
15	600372	中航电子	11,095,421.02	3.35
16	300263	隆华节能	7,840,471.68	2.37
17	002690	美亚光电	7,266,019.88	2.20
18	600088	中视传媒	6,833,532.86	2.07
19	000768	中航飞机	6,378,832.00	1.93
20	002415	海康威视	6,326,364.98	1.91

### 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	601288	农业银行	29,066,952.00	8.79
2	601318	中国平安	27,935,874.79	8.45
3	300342	天银机电	23,823,313.00	7.20
4	601169	北京银行	22,795,878.40	6.89
5	601988	中国银行	14,362,000.00	4.34
6	601939	建设银行	12,875,291.00	3.89
7	600038	中直股份	11,788,230.33	3.56
8	600118	中国卫星	11,712,110.34	3.54
9	600893	中航动力	11,657,698.98	3.52
10	600372	中航电子	11,209,203.51	3.39
11	002690	美亚光电	8,256,838.17	2.50
12	300351	永贵电器	8,186,637.37	2.48
13	300263	隆华节能	8,001,811.80	2.42
14	300346	南大光电	7,338,162.26	2.22
15	300236	上海新阳	7,127,463.88	2.15
16	002366	台海核电	6,855,409.41	2.07
17	000768	中航飞机	6,576,600.27	1.99
18	002335	科华恒盛	6,201,435.94	1.87
19	002308	威创股份	6,181,121.72	1.87
20	002351	漫步者	5,976,336.60	1.81

### 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	625,776,703.35
卖出股票收入（成交）总额	589,545,877.32

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：本基金报告期末无股指期货持仓。

**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记录，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	272,268.37
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	16,295.53
5	应收申购款	8,407.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	296,971.58

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 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
10,978	14,229.79	20,162,158.12	12.91%	136,052,469.02	87.09%

### 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	334,765.78	0.2143%

### 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（2009年11月25日）基金份额总额	1,251,832,665.50
本报告期期初基金份额总额	152,993,255.60
本报告期基金总申购份额	54,096,423.66
减：本报告期基金总赎回份额	50,875,052.12
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	156,214,627.14

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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曾变动。

#### 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

本报告期本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。



**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	
渤海证券	1	721,783,788.36	59.44%	527,841.11	53.50%	-
光大证券	1	492,607,925.93	40.56%	458,760.53	46.50%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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，并能为本公司基金提供全面的信息服。

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	同上	2016年6月3日

	出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告		
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
9	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行基金通优惠活动的公告	同上	2016 年 5 月 17 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优惠活动的公告	同上	2016 年 4 月 27 日
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	长盛量化红利策略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	长盛基金管理有限公司关于增加	同上	2016 年 4 月 14 日

	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		
15	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
16	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
17	长盛量化红利策略混合型证券投资基金 2015 年度报告摘要	同上	2016 年 3 月 26 日
18	长盛量化红利策略混合型证券投资基金 2015 年度报告	同上	2016 年 3 月 26 日
19	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
20	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
21	长盛基金管理有限公司关于增加民生银行为旗下部分开放式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 23 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

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国泰君安证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投和转换业务并推出申购费率优惠活动的公告	同上	2016 年 3 月 15 日
26	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
27	长盛基金管理有限公司关于增加平安证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投 转换业务并推出申购费率优惠活动的公告	同上	2016 年 2 月 25 日
28	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
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	同上	2016 年 1 月 21 日

	务的公告		
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	长盛量化红利策略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	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
38	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
39	长盛量化红利策略混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要	同上	2016 年 1 月 4 日
40	长盛量化红利策略混合型证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2016 年 1 月 4 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (二) 《长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《长盛量化红利策略混合型证券投资基金托管协议》；
- (四) 《长盛量化红利策略混合型证券投资基金招募说明书》；
- (五) 法律意见书；
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (七) 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及/或管理人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