

长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金
2016 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2017 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	2,569,250,774.84 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</p>

	建股票组合并进行动态调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	林葛
	联系电话	010-82019988	010-66060069
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-62350088	95599
传真		010-82255988	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-324,435,820.16	-1,394,824,036.86
本期利润	-524,146,143.24	-1,184,336,611.61
加权平均基金份额本期利润	-0.1869	-0.3720
本期基金份额净值增长率	-27.48%	-35.60%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.5405	-0.4308
期末基金资产净值	1,199,005,345.03	1,913,905,318.64
期末基金份额净值	0.467	0.644

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

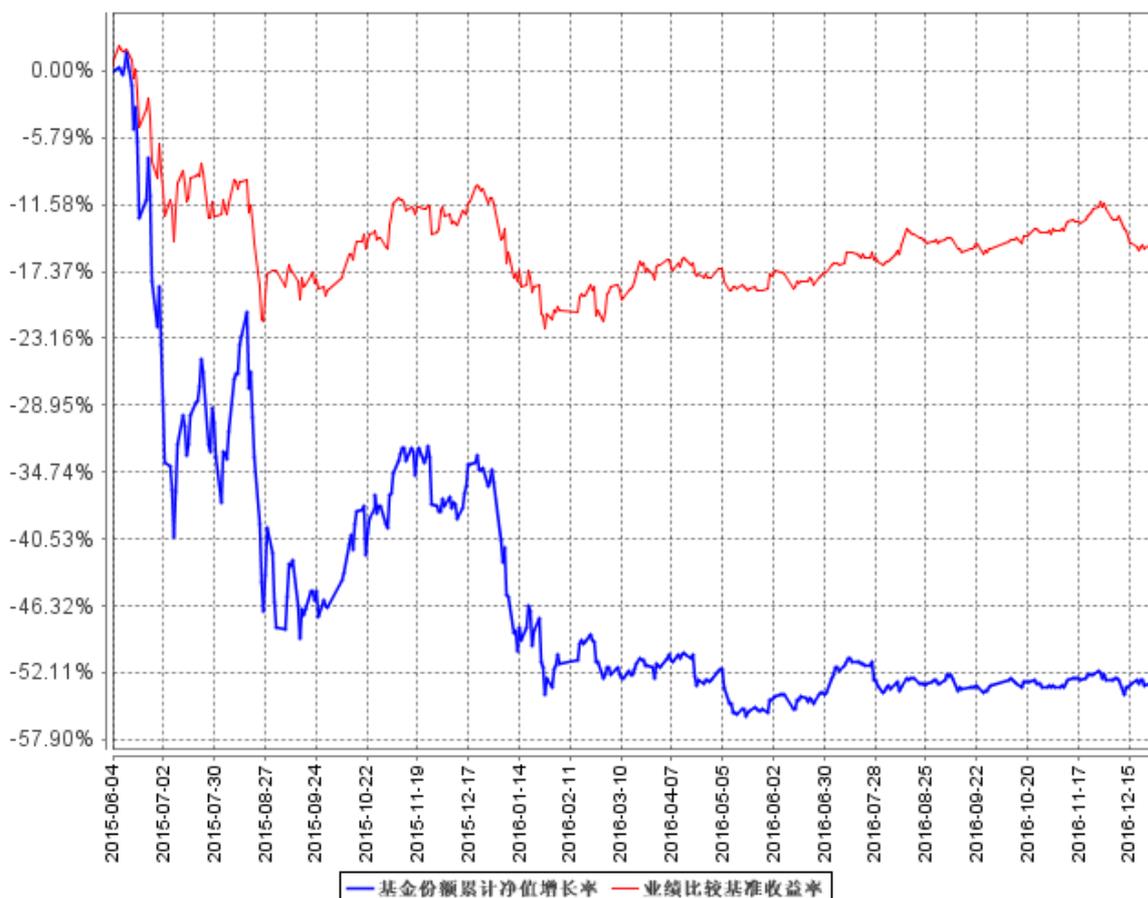
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.21%	0.57%	0.19%	0.38%	-0.40%	0.19%
过去六个月	1.30%	0.71%	2.80%	0.39%	-1.50%	0.32%
过去一年	-27.48%	1.49%	-4.24%	0.70%	-23.24%	0.79%
自基金合同生效起至今	-53.30%	2.45%	-15.18%	1.01%	-38.12%	1.44%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 50%、50%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

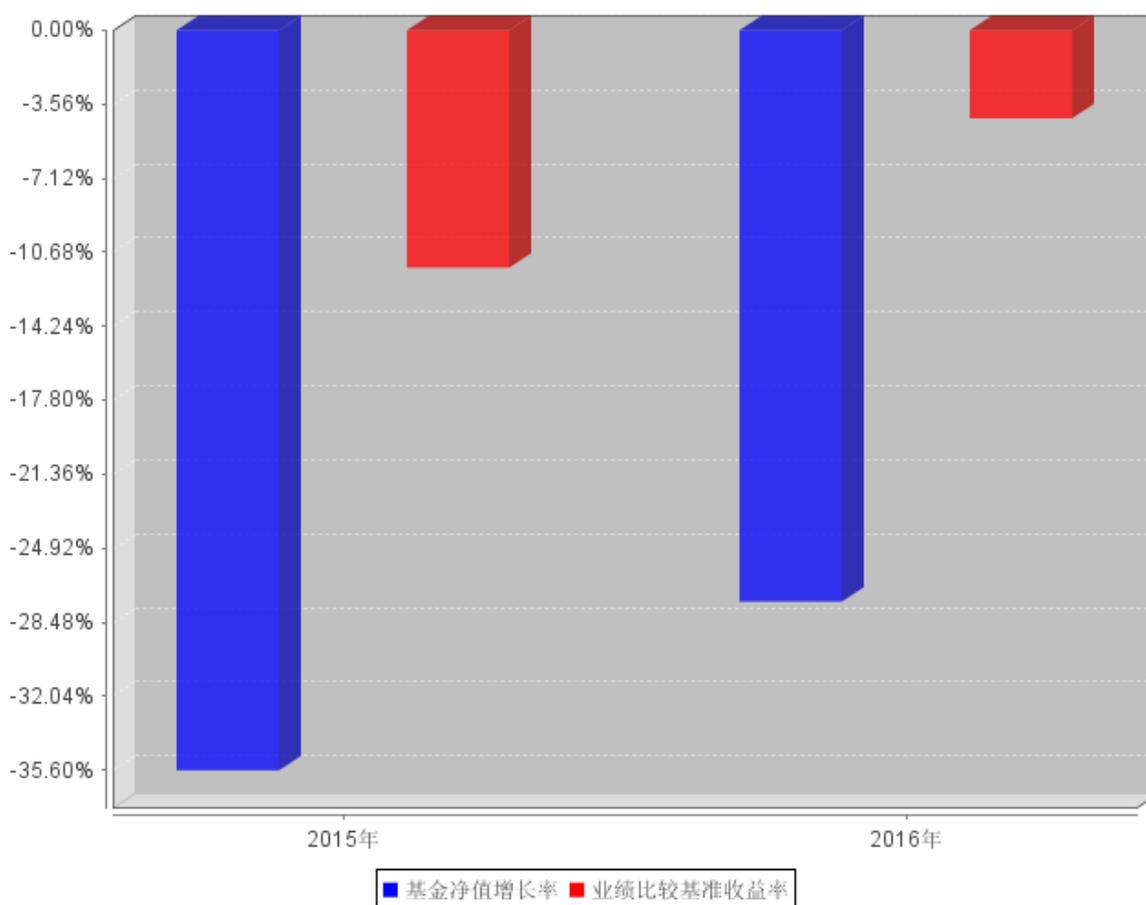
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十二条（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。截止报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	-	-	-	-	注：2016 年度未分配收益
2015	-	-	-	-	注：本基金于 2015 年 6

					月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止未分配收益
合计	-	-	-	-	

§ 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、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 12 月 31 日，基金管理人共管理五十七只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田间	本基金基金经理。	2015 年 6 月 4 日	-	8 年	田间女士，1978 年 11 月出生。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。
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	2016 年 2 月 17 日	-	9 年	吴博文先生，1983 年 6 月出生。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，

	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。				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。
--	---	--	--	--	---

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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。具体如下：

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

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

隔离墙制度。

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

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年年初我们经历了熔断，整体市场有了比较大的估值折让，因此在一季度制定投资计划的时候我们并不悲观，操作中比较积极。一季度中我们整体观点看多周期复苏，配置了部分的原油产业链公司，对净值提升有一定的帮助，但整体仓位有限，没有坚持下来，在二季度就减仓了，是我们值得反思的错误。在二季度的操作中我们仍然延续了我们长期看好的产业进行投资，重点持有电子等新兴行业的公司，但是这两个季度的操作事后证明发生了方向性的偏误，我们错过了经济复苏主线下带来的低估值蓝筹的行情和财政投入加大趋势下带来的 PPP 投资相关板块的行情，使我们二季度的操作极为被动。我们在三季度末进行了反思和调整，加大了周期复苏思路下的相对后周期的板块的布局，在四季度布局了 LED 芯片，工程机械，农业，等预期继续将在 2017 年复苏的行业，同时看好财政投入持续加大的方向，布局了建筑板块。2016 年四季度在 10 月份走出加速上涨的态势后从 11 月份至今一直在下跌，市场波动性较大，我们在四季度保持了组合净值相对稳健的表现，用组合的均衡配置控制了组合的波动性。

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 0.467 元，本报告期份额净值增长率为-27.48%，同期业绩比较基准增长率为-4.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从 2016 年延续至今的 IPO 加速发行，控制再融资节奏，今后将成为常态，这是来自于监管层最重要的态度，表明加快利用资本市场转型升级的决心。在政府金融去杠杆的大背景下，这样的结果将是市场的整体估值中枢持续下挫。市场整体的投资情绪将愈加保守，交投量也将比较小。在这样的市场环境中，我们判断业绩的真实提升对于投资的重要性会更加显现，在集中持有具备真实商业运营好转的公司时，要注意减少交易，避免在交投清淡的市场中花费交易成本。

结构方面，我们看好周期复苏下受益的行业，同时它们也是在之前的若干年里产能去化程度较高的行业，具备最高的安全边际。包括但不限于资源品，农产品。

在人民币兑美元贬值的大趋势下，我们整体看好海外业务收入占比较高的公司，也就是业务全球布局的公司。汇率的变化将有利于产品与服务的出口。

国企改革将继续成为经济中发生的重要变化，我们将持续将国企改革作为重要的一条投资线索去寻找投资标的。

在整体操作策略上，我们将按照给客户贡献绝对收益的目标，在标的选择上注重安全边际，仓位保持中性，等待合适的市场机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执

行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六条中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至 2016 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为-1,388,555,181.39 元，其中，未分配利润已实现部分为-1,388,555,181.39 元，未分配利润未实现部分为 18,309,751.58 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 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办

法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师汤骏、马剑英 2017 年 3 月 22 日对本基金 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注出具了安永华明（2017）审字第 60468688_A16 号标准无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	337,411,622.43	206,079,483.61
结算备付金	2,824,969.62	8,459,236.66
存出保证金	1,552,537.10	6,242,329.29
交易性金融资产	886,792,166.28	1,695,445,851.44
其中：股票投资	886,792,166.28	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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	20,349,635.79
应收利息	155,839.91	103,739.41
应收股利	-	-
应收申购款	90,343.35	491,020.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,228,827,478.69	1,937,171,296.91

负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	23,928,844.76	7,678,056.45
应付赎回款	925,005.38	6,424,531.00
应付管理人报酬	1,542,375.72	2,453,882.80
应付托管费	257,062.60	408,980.50
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,897,274.08	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	271,571.12	173,528.38
负债合计	29,822,133.66	23,265,978.27
所有者权益:		
实收基金	2,569,250,774.84	2,973,749,932.59
未分配利润	-1,370,245,429.81	-1,059,844,613.95
所有者权益合计	1,199,005,345.03	1,913,905,318.64
负债和所有者权益总计	1,228,827,478.69	1,937,171,296.91

注：(1) 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.467 元，基金份额总额为 2,569,250,774.84 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。

7.2 利润表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生 效日)至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-478,711,364.70	-1,126,244,456.07
1. 利息收入	8,187,934.99	2,605,794.59
其中：存款利息收入	8,187,934.99	2,605,794.59
债券利息收入	-	-

资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-287,624,347.20	-1,341,269,224.66
其中：股票投资收益	-295,305,947.26	-1,352,495,764.82
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	7,681,600.06	11,226,540.16
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-199,710,323.08	210,487,425.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	435,370.59	1,931,548.75
减：二、费用	45,434,778.54	58,092,155.54
1. 管理人报酬	20,143,266.83	18,424,917.90
2. 托管费	3,357,211.11	3,070,819.70
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	21,525,442.84	36,365,445.37
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	408,857.76	230,972.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-524,146,143.24	-1,184,336,611.61
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-524,146,143.24	-1,184,336,611.61

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	-	-524,146,143.24	-524,146,143.24

润)			
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)	-404,499,157.75	213,745,327.38	-190,753,830.37
其中: 1. 基金申购款	219,866,195.99	-112,246,055.65	107,620,140.34
2. 基金赎回款	-624,365,353.74	325,991,383.03	-298,373,970.71
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)	2,569,250,774.84	-1,370,245,429.81	1,199,005,345.03
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12月31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)	3,250,867,544.91	-	3,250,867,544.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,184,336,611.61	-1,184,336,611.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-277,117,612.32	124,491,997.66	-152,625,614.66
其中: 1. 基金申购款	435,327,278.89	-143,899,977.13	291,427,301.76
2. 基金赎回款	-712,444,891.21	268,391,974.79	-444,052,916.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,973,749,932.59	-1,059,844,613.95	1,913,905,318.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]568号《关于准予长盛国企改革主题灵活

配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由长盛基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2015 年 6 月 4 日生效，于基金合同生效日，本基金规模为 3,250,867,544.91 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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： $50% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50% \times \text{中证综合债指数收益率}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

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

7.4.6.2 营业税、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以及金融同业往来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，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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 号文《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；

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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人股东
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛基金（香港）有限公司	基金管理人子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 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 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	20,143,266.83	18,424,917.90
其中：支付销售机构的客户维护费	9,302,852.69	8,158,105.09

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

计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.2 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 12 月 31 日	2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,357,211.11	3,070,819.70

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

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：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均未持有本基金份额。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	337,411,622.43	8,027,377.13	206,079,483.61	2,420,660.60

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间 2015 年 6 月 4 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月

31 日止期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603228	景旺电子	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-

		日	日							
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603986	兆易创新	2016年9月19日	重大事项停牌	168.94	2017年3月13日	195.77	1,133	26,353.58	191,409.02	-
300537	广信材料	2016年10月12日	重大事项停牌	48.79	2017年1月13日	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-
002025	航天电器	2016年9月12日	重大事项停牌	23.38	-	-	75	1,696.42	1,753.50	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、应收证券清算款、应收申购款等，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 886,097,275.95 元，属于第二层次的余额为人民币 694,890.33 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 1,594,140,906.47 元，第二层次人民币 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级之间无重大转移（2015 年度：无）。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（2015 年度：无）。

7.4.14.2 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2017 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	886,792,166.28	72.17
	其中：股票	886,792,166.28	72.17
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	340,236,592.05	27.69
7	其他各项资产	1,798,720.36	0.15
8	合计	1,228,827,478.69	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	98,872,543.19	8.25
B	采矿业	10,944,175.42	0.91
C	制造业	620,839,043.06	51.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,348,046.80	1.70
E	建筑业	34,832,710.17	2.91
F	批发和零售业	38,305,656.91	3.19
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,140,796.83	0.10
J	金融业	2,393,833.86	0.20
K	房地产业	12,961,246.90	1.08
L	租赁和商务服务业	24,199,728.30	2.02
M	科学研究和技术服务业	137,744.40	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	21,375,860.56	1.78
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	431,321.20	0.04
S	综合	-	-
	合计	886,792,166.28	73.96

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600703	三安光电	6,277,327	84,053,408.53	7.01
2	000425	徐工机械	19,726,698	66,676,239.24	5.56
3	600031	三一重工	8,817,897	53,789,171.70	4.49
4	000998	隆平高科	2,265,533	48,550,372.19	4.05
5	600737	中粮屯河	3,032,426	37,784,027.96	3.15

6	000930	中粮生化	2,707,125	36,383,760.00	3.03
7	600873	梅花生物	5,549,700	36,184,044.00	3.02
8	002353	杰瑞股份	1,475,978	29,962,353.40	2.50
9	000860	顺鑫农业	1,148,392	25,264,624.00	2.11
10	603718	海利生物	1,395,262	24,863,568.84	2.07

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.csfunds.com.cn> 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	300315	掌趣科技	127,824,710.65	6.68
2	600498	烽火通信	107,993,332.91	5.64
3	600703	三安光电	87,597,512.76	4.58
4	002400	省广股份	86,864,090.81	4.54
5	601336	新华保险	80,603,857.97	4.21
6	000738	中航动控	76,673,266.96	4.01
7	002508	老板电器	75,292,843.78	3.93
8	600718	东软集团	74,739,643.80	3.91
9	600372	中航电子	69,976,357.41	3.66
10	002624	完美环球	69,948,638.32	3.65
11	000425	徐工机械	66,340,351.76	3.47
12	300136	信维通信	64,385,339.58	3.36
13	300024	机器人	64,256,827.47	3.36
14	002179	中航光电	61,949,954.39	3.24
15	600028	中国石化	61,574,182.70	3.22
16	002281	光迅科技	59,916,635.73	3.13
17	002007	华兰生物	56,166,842.14	2.93
18	600715	文投控股	56,046,316.48	2.93
19	000733	振华科技	56,016,805.20	2.93
20	600031	三一重工	51,503,709.65	2.69
21	600990	四创电子	49,439,673.05	2.58
22	600547	山东黄金	48,693,184.49	2.54
23	603019	中科曙光	48,539,875.59	2.54

24	600487	亨通光电	46,390,772.43	2.42
25	000687	华讯方舟	45,925,418.79	2.40
26	601118	海南橡胶	45,531,742.65	2.38
27	000998	隆平高科	45,015,520.11	2.35
28	300009	安科生物	43,510,351.51	2.27
29	000892	星美联合	43,002,610.87	2.25
30	300133	华策影视	42,993,668.43	2.25
31	600074	保千里	42,992,474.04	2.25
32	300144	宋城演艺	42,991,433.05	2.25
33	600201	生物股份	42,991,216.11	2.25
34	000070	特发信息	42,705,158.47	2.23
35	300369	绿盟科技	42,491,495.59	2.22
36	002714	牧原股份	42,323,007.24	2.21
37	300188	美亚柏科	42,225,003.40	2.21
38	601607	上海医药	42,212,744.09	2.21
39	000558	莱茵体育	42,104,637.55	2.20
40	002049	紫光国芯	41,464,636.39	2.17
41	002311	海大集团	41,199,356.67	2.15
42	002439	启明星辰	40,978,411.31	2.14
43	300101	振芯科技	40,684,431.52	2.13
44	600036	招商银行	39,679,177.46	2.07
45	002268	卫士通	39,548,829.00	2.07
46	600562	国睿科技	39,346,339.90	2.06
47	000876	新希望	39,343,552.72	2.06
48	002085	万丰奥威	39,330,890.64	2.06
49	002353	杰瑞股份	39,224,537.61	2.05
50	002013	中航机电	39,020,889.17	2.04
51	002025	航天电器	38,840,809.00	2.03
52	600612	老凤祥	38,823,837.86	2.03
53	600570	恒生电子	38,745,242.50	2.02
54	002548	金新农	38,550,461.66	2.01
55	600183	生益科技	38,502,646.66	2.01
56	000999	华润三九	38,502,244.94	2.01
57	600060	海信电器	38,500,635.88	2.01
58	000423	东阿阿胶	38,489,867.17	2.01
59	600563	法拉电子	38,325,088.88	2.00

60	600674	川投能源	38,280,227.00	2.00
----	--------	------	---------------	------

8.4.2 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	300315	掌趣科技	113,752,754.96	5.94
2	600498	烽火通信	106,634,050.21	5.57
3	002508	老板电器	101,562,601.84	5.31
4	002400	省广股份	94,888,838.23	4.96
5	601336	新华保险	80,261,147.38	4.19
6	000738	中航动控	76,475,670.23	4.00
7	600718	东软集团	71,448,985.71	3.73
8	300136	信维通信	67,231,330.38	3.51
9	600028	中国石化	67,077,902.88	3.50
10	600715	文投控股	66,881,629.96	3.49
11	600372	中航电子	66,681,875.96	3.48
12	002007	华兰生物	62,078,733.58	3.24
13	002179	中航光电	61,032,115.69	3.19
14	002624	完美环球	60,838,411.35	3.18
15	002074	国轩高科	60,288,457.03	3.15
16	300024	机器人	58,255,575.55	3.04
17	002292	奥飞动漫	54,572,315.23	2.85
18	002281	光迅科技	51,504,887.98	2.69
19	002123	荣信股份	51,473,240.94	2.69
20	600487	亨通光电	50,113,662.27	2.62
21	600547	山东黄金	49,523,733.66	2.59
22	603019	中科曙光	48,070,213.70	2.51
23	300101	振芯科技	47,108,524.46	2.46
24	002013	中航机电	47,093,262.08	2.46
25	600990	四创电子	45,621,134.78	2.38
26	000733	振华科技	45,568,824.16	2.38
27	600988	赤峰黄金	44,934,134.50	2.35
28	002025	航天电器	43,852,891.98	2.29
29	000567	海德股份	42,316,106.26	2.21
30	600563	法拉电子	41,446,074.28	2.17
31	000423	东阿阿胶	41,444,160.74	2.17
32	002085	万丰奥威	41,414,546.87	2.16

33	000558	莱茵体育	40,889,085.17	2.14
34	000068	*ST 华赛	40,047,168.35	2.09
35	600570	恒生电子	40,030,323.76	2.09
36	000999	华润三九	39,737,696.78	2.08
37	000687	华讯方舟	39,586,109.49	2.07
38	000070	特发信息	39,560,246.96	2.07
39	600036	招商银行	39,090,782.84	2.04
40	300369	绿盟科技	39,050,054.18	2.04
41	300188	美亚柏科	38,909,233.11	2.03
42	600038	中直股份	38,898,545.12	2.03
43	600201	生物股份	38,822,489.05	2.03

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,017,557,798.43
卖出股票收入（成交）总额	7,331,195,213.25

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,552,537.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	155,839.91
5	应收申购款	90,343.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,798,720.36

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与和项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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
53,789	47,765.36	5,652,371.95	0.22%	2,563,598,402.89	99.78%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	11,046.46	0.0004%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月4日）基金份额总额	3,250,867,544.91
本报告期期初基金份额总额	2,973,749,932.59
本报告期基金总申购份额	219,866,195.99
减：本报告期基金总赎回份额	624,365,353.74
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,569,250,774.84

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

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。

11.2.2 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。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 90,000.00 元，已连续提供审计服务 2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
光大证券	1	3,090,135,473.82	21.55%	2,877,846.63	22.27%	-
国泰君安	2	2,633,957,290.92	18.37%	2,453,004.33	18.98%	-
东北证券	1	2,479,639,645.59	17.29%	2,309,285.67	17.87%	-
方正证券	1	1,775,675,415.92	12.38%	1,298,554.18	10.05%	-
上海证券	1	1,131,944,412.65	7.89%	1,054,180.94	8.16%	-
国信证券	1	1,072,489,100.41	7.48%	998,807.16	7.73%	-
齐鲁证券	1	835,800,220.66	5.83%	778,379.45	6.02%	-
申银万国	1	538,827,104.47	3.76%	501,810.48	3.88%	-
宏源证券	2	391,456,437.46	2.73%	364,564.84	2.82%	-
东方证券	2	390,628,037.89	2.72%	285,666.11	2.21%	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	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	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-

中投证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	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：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	东方证券	上海	1
2	天风证券	深圳	1

3	东方证券	深圳	1
---	------	----	---

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况:

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	长城证券	深圳	1

长盛基金管理有限公司
2017年3月27日