

长盛新兴成长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	长盛新兴成长混合
基金主代码	001892
交易代码	001892
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 6 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	730,584,059.10 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经济转型时期新兴产业和传统产业升级快速发展所带来的投资机遇，深度挖掘具备阶段性成长机会的上市公司，满足投资人长期稳健的投资收益需求。
投资策略	<p>本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，运用科学严谨、规范化的资产配置方法，灵活配置新兴成长主题的上市公司股票和债券，谋求基金资产的长期稳定增长。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑：（1）宏观经济指标；（2）微观经济指标；（3）市场指标；（4）政策因素。</p> <p>本基金将通过深入分析上述指标与因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>1、新兴成长主题的界定</p> <p>本基金所界定的新兴成长主题不仅包括随着新的科研成果和新兴技术的发明应用而出现，代表未来科技与创新的方向的新兴产业，也包括目前传统产业中依托于新技术和新的商业模式进行产业升级换代并快速成长的行业和上市公司。</p> <p>2、子行业成长性评估</p> <p>在本基金管理人界定的新兴行业中，将重点对行业的成长性进行评估，挑选成长性较好的新兴行业进行投资。</p> <p>3、个股选择</p> <p>本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，选择具有长期持续成长能力的公司。</p>

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

## 2.4 信息披露方式

登载基金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>
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

## § 3 主要财务指标、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 11 月 6 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	149,741.05	-67,842.11
本期利润	-49,332,316.31	-67,842.11
加权平均基金份额本期利润	-0.0525	-0.0001
本期基金份额净值增长率	-0.80%	0.00%
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	-0.0076	-0.0001
期末基金资产净值	725,056,503.14	561,493,149.63
期末基金份额净值	0.992	1.000

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

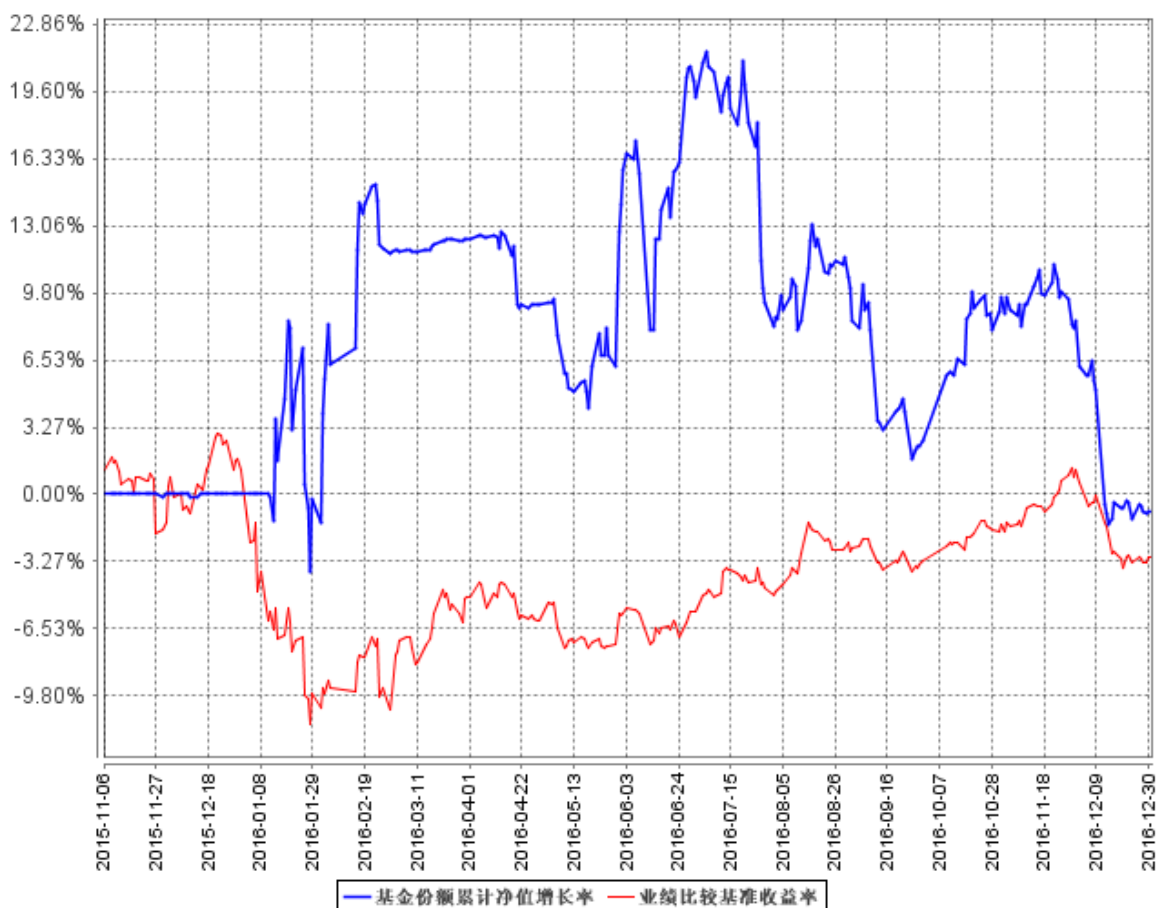
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.31%	1.04%	0.19%	0.38%	-3.50%	0.66%
过去六个月	-17.40%	1.15%	2.80%	0.39%	-20.20%	0.76%
过去一年	-0.80%	1.48%	-4.24%	0.70%	3.44%	0.78%
自基金合同生效起至今	-0.80%	1.38%	-3.06%	0.71%	2.26%	0.67%

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，业绩比较基准中沪深 300 指数、中证综合债指数每日按照 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

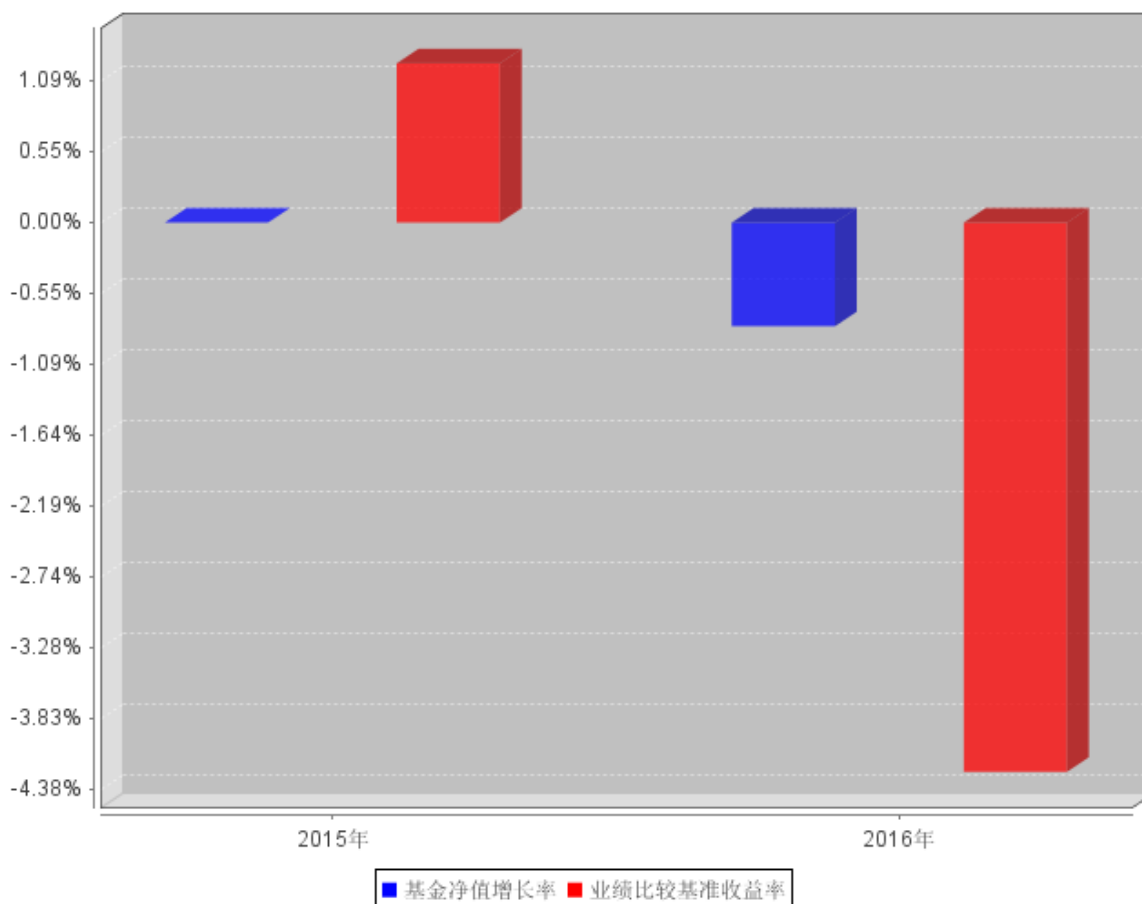
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。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：本基金合同生效日为 2015 年 11 月 6 日，合同生效当年按实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2015 年 11 月 6 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止会计期间未进行利润分配。

## § 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		
赵楠	本基金基金经理，长盛电子信息产业混合型证券投资基金基金经理，长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015 年 11 月 6 日	-	10 年	赵楠先生，1980 年 3 月出生。经济学学士，北京大学光华 MBA 在读。历任安信证券研究中心研究员，光大永明资产管理股份有限公司权益投资部高级股票投资经理、资深股票投资经理、权益创新业务负责人、投行总部执行董事等职务。2015 年 2 月加入长盛基金管理有限公司。

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 年股票市场整体来讲表现并不理想，上证指数下跌 12.31%，沪深 300 指数下跌 11.28%，创业板下跌 27.71%，但指数最主要的跌幅发生在 1 月份，其中上证指数下跌 22.65%，沪深 300 指数下跌 21.04%，创业板下跌 26.53%，2 月之后股票市场的走势逐步震荡向上，但分化严重，创业板表现非常弱，低估值价值股受到投资者的偏好。在行业方面，食品饮料、建筑材料、建筑装饰、家用电器、银行板块涨幅居前，传媒、计算机板块最弱，全年跌幅超过 30%。

本产品 2016 年净值下跌 0.8%，净值表现大大超越指数，全年来看表现较好。具体来讲，通过空仓有效的躲避了 1 月份市场的下跌，通过几次加仓取得了不错的绝对收益；下半年表现较差，主要配置的成长股，因行业表现的分化导致净值回撤。

#### 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 0.992 元，本报告期份额净值增长率为-0.80%，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

2016 年股票市场属于震荡市，受益于盈利的回升和机构投资偏好的变化，周期、低估值价值股表现更佳，指数层面 2 月以后系统性风险较小，市场处于底部蓄势阶段。

2017 年预计指数会有较大幅度涨幅，有可能超过市场普遍预期。2016 年大宗商品的大幅上涨带来 PPI 由负转正，结束 2011 年以来的通缩趋势，最重要的行业房地产、汽车销售数据创了历史新高，库存处于非常低的水平。中国经济最危险的阶段已经过去，制造业投资在 16 年三季度处于周期性的拐点，17 年上游中游行业整体盈利偏乐观，同时通胀并不会成为市场主要矛盾，货币政策明显转向的概率较小。从盈利和流动性的角度，对股票市场都是非常积极。

从结构方面，周期与成长的分化来自于宏观经济短期、长期力量的交织与对抗。站在长期经济转型的视角，不能对成长股过于谨慎。成长股在市场的悲观和质疑中，最困难的阶段已经过去。

2017 年看好三条投资主线：一、受益于股票市场上涨的证券、保险；二、盈利改善的上游中游行业；三、超跌或优质的成长股。

#### 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，本基金报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2016 年 12 月 31 日期末可供分配利润为-5,527,555.96 元，其中：未分配利润已实现部分为 8,338,662.26 元，未分配利润未实现部分为-13,866,218.22 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”）在对长盛新兴成长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**

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）、投资组合报告中的数据真实、准确和完整。

## § 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 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注出具了安永华明（2017）审字第 60468688\_A18 号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：长盛新兴成长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
<b>资产：</b>		
银行存款	89,722,992.93	10,787,650.04
结算备付金	4,458,049.43	21,428,571.43
存出保证金	599,772.43	-
交易性金融资产	634,102,376.09	-
其中：股票投资	634,102,376.09	-
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	-	530,000,000.00
应收证券清算款	-	103,865.16
应收利息	51,014.51	22,358.89
应收股利	-	-
应收申购款	224,939.31	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	729,159,144.70	562,342,445.52

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
<b>负 债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	618,900.76	-
应付管理人报酬	1,115,257.48	715,110.78
应付托管费	185,876.26	119,185.11
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,910,970.04	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	271,637.02	15,000.00
负债合计	4,102,641.56	849,295.89
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	730,584,059.10	561,560,991.74
未分配利润	-5,527,555.96	-67,842.11
所有者权益合计	725,056,503.14	561,493,149.63
负债和所有者权益总计	729,159,144.70	562,342,445.52

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.992 元，基金份额总额为 730,584,059.10 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛新兴成长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 11 月 6 日(基金合 同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-20,228,796.06	1,428,675.44
1. 利息收入	4,447,482.21	1,428,675.44
其中：存款利息收入	2,799,652.81	275,994.94
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,647,829.40	1,152,680.50

其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	16,111,045.27	-
其中：股票投资收益	14,706,156.63	-
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	1,404,888.64	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-49,482,057.36	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	8,694,733.82	-
<b>减：二、费用</b>	29,103,520.25	1,496,517.55
1. 管理人报酬	15,418,460.47	1,268,822.23
2. 托管费	2,569,743.42	211,470.32
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	10,716,378.67	-
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	398,937.69	16,225.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	-49,332,316.31	-67,842.11
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	-49,332,316.31	-67,842.11

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛新兴成长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）	561,560,991.74	-67,842.11	561,493,149.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-49,332,316.31	-49,332,316.31
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）	169,023,067.36	43,872,602.46	212,895,669.82

其中：1. 基金申购款	2,248,415,313.34	244,436,481.51	2,492,851,794.85
2. 基金赎回款	-2,079,392,245.98	-200,563,879.05	-2,279,956,125.03
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）	730,584,059.10	-5,527,555.96	725,056,503.14
项目	上年度可比期间 2015年11月6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）	561,560,991.74	-	561,560,991.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-67,842.11	-67,842.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	561,560,991.74	-67,842.11	561,493,149.63

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

长盛新兴成长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]1825号《关于准予长盛新兴成长主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由长盛基金管理有限公司于2015年10月8日至2015年11月4日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验

资并出具（2015）验字 60468688\_A07 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015 年 11 月 6 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。截至 2015 年 11 月 6 日止，本基金已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 561,453,006.54 元，折合 561,453,006.54 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 107,985.20 元，折合 107,985.20 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 561,560,991.74 元，折合 561,560,991.74 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金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）、权证、股指期货、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 0%–95%，其中投资于新兴成长主题的证券不低于非现金基金资产的 80%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。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

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。



### 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 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### （1）股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### （2）债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### （3）权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### （4）分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### （5）回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差

异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以

相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公

司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 投资者的现金红利保留到小数点后第 2 位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### **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
关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“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
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
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司
长盛基金（香港）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 11 月 6 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日至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 11 月 6 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	15,418,460.47	1,268,822.23
其中：支付销售机构的客户维护费	3,380,682.38	358,154.90

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%的年费率计提。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 11 月 6 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	2,569,743.42	211,470.32

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% 的年费率计提。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：本基金于本报告期及上年度可比期间 2015 年 11 月 6 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：本基金于本报告期及上年度可比期间 2015 年 11 月 6 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间均未运用固定资金投资本基金。

#### 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可比期间 2015 年 11 月 6 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间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 11 月 6 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
中国银行	89,722,992.93	2,475,394.64	10,787,650.04	248,030.61

注：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。

### 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 11 月 6 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

7.4.9.1.1 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
300496	中科创达	2016年10月11日	重大事项停牌	47.08	2017年1月6日	47.49	709,767	42,312,294.72	33,415,830.36	-
300479	神思电子	2016年12月13日	重大事项停牌	25.57	-	-	374,114	11,195,330.61	9,566,094.98	-
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	-

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

##### 7.4.10.1 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

590,477,274.88 元，属于第二层次的余额为人民币 43,625,101.21 元，属于第三层次的余额为人民币零元。（2015 年 12 月 31 日：无属于第一层次、第二层次及第三层次的余额）

#### (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，未发生第一层次与第二层次之间的重大转换。（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）。

#### 7.4.10.2 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。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 财务报表的批准

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	634,102,376.09	86.96
	其中：股票	634,102,376.09	86.96
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	94,181,042.36	12.92
7	其他各项资产	875,726.25	0.12
8	合计	729,159,144.70	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	-	-
B	采矿业	19,161,595.60	2.64
C	制造业	257,197,947.85	35.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	-	-
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	145,705,940.81	20.10
J	金融业	178,883,677.18	24.67
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,548,800.00	0.63
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	28,579,363.74	3.94
S	综合	-	-
	合计	634,102,376.09	87.46

### 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	300496	中科创达	709,767	33,415,830.36	4.61

2	002484	江海股份	1,537,915	25,267,943.45	3.48
3	601211	国泰君安	1,229,600	22,858,264.00	3.15
4	300373	扬杰科技	1,132,074	22,279,216.32	3.07
5	300236	上海新阳	562,582	21,659,407.00	2.99
6	300346	南大光电	709,146	21,586,404.24	2.98
7	300130	新国都	794,753	19,733,716.99	2.72
8	300369	绿盟科技	555,907	18,884,160.79	2.60
9	000948	南天信息	1,051,695	18,615,001.50	2.57
10	601628	中国人寿	759,769	18,302,835.21	2.52

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	300364	中文在线	110,954,004.86	19.76
2	002292	奥飞娱乐	104,283,285.58	18.57
3	002376	新北洋	84,799,108.83	15.10
4	002253	川大智胜	72,829,817.92	12.97
5	000948	南天信息	72,715,117.04	12.95
6	300479	神思电子	62,165,749.07	11.07
7	300494	盛天网络	61,994,894.18	11.04
8	300075	数字政通	61,634,969.40	10.98
9	300148	天舟文化	60,946,961.12	10.85
10	300373	扬杰科技	54,535,514.45	9.71
11	300016	北陆药业	53,971,442.16	9.61
12	300467	迅游科技	53,577,386.60	9.54
13	002354	天神娱乐	52,973,918.74	9.43
14	600730	中国高科	52,217,917.46	9.30
15	300327	中颖电子	51,334,149.39	9.14
16	300520	科大国创	49,633,152.34	8.84
17	300130	新国都	49,270,536.64	8.77
18	300458	全志科技	48,731,117.66	8.68
19	002308	威创股份	45,910,908.62	8.18

20	300448	浩云科技	45,840,774.33	8.16
21	300236	上海新阳	43,885,023.49	7.82
22	300037	新宙邦	43,567,159.20	7.76
23	300030	阳普医疗	43,538,835.70	7.75
24	300340	科恒股份	43,474,711.40	7.74
25	000937	冀中能源	42,589,315.91	7.59
26	300496	中科创达	42,312,294.72	7.54
27	300010	立思辰	42,296,802.42	7.53
28	300452	山河药辅	41,733,129.48	7.43
29	300404	博济医药	40,916,205.98	7.29
30	002709	天赐材料	39,601,352.49	7.05
31	300231	银信科技	38,749,188.62	6.90
32	300227	光韵达	38,201,938.12	6.80
33	300474	景嘉微	37,853,549.74	6.74
34	300226	上海钢联	37,809,927.27	6.73
35	002484	江海股份	36,552,401.65	6.51
36	600362	江西铜业	32,631,394.00	5.81
37	300367	东方网力	31,466,523.56	5.60
38	300168	万达信息	31,290,137.70	5.57
39	603678	火炬电子	31,146,032.31	5.55
40	300518	盛讯达	30,051,244.47	5.35
41	002402	和而泰	29,451,064.10	5.25
42	300160	秀强股份	27,960,503.33	4.98
43	002280	联络互动	27,490,126.44	4.90
44	300113	顺网科技	26,234,467.09	4.67
45	300369	绿盟科技	25,124,903.16	4.47
46	300287	飞利信	24,938,343.19	4.44
47	600497	驰宏锌锗	24,438,731.68	4.35
48	300213	佳讯飞鸿	24,371,944.30	4.34
49	002599	盛通股份	24,310,147.14	4.33
50	601211	国泰君安	24,285,148.21	4.33
51	300036	超图软件	23,956,297.33	4.27
52	300302	同有科技	23,502,205.86	4.19
53	300346	南大光电	23,397,992.47	4.17
54	603598	引力传媒	22,786,377.81	4.06
55	002537	海立美达	22,725,604.00	4.05

56	002108	沧州明珠	22,598,672.90	4.02
57	300059	东方财富	22,453,308.00	4.00
58	000532	力合股份	22,151,610.14	3.95
59	000630	铜陵有色	21,824,273.00	3.89
60	300073	当升科技	21,773,289.08	3.88
61	300453	三鑫医疗	21,764,941.55	3.88
62	600363	联创光电	21,415,351.52	3.81
63	300418	昆仑万维	21,255,016.28	3.79
64	300068	南都电源	20,846,720.78	3.71
65	300339	润和软件	20,394,622.96	3.63
66	002315	焦点科技	19,793,722.98	3.53
67	601628	中国人寿	19,514,969.94	3.48
68	300136	信维通信	19,457,618.76	3.47
69	300394	天孚通信	19,183,954.00	3.42
70	600571	信雅达	18,973,328.91	3.38
71	600055	万东医疗	18,792,185.86	3.35
72	002148	北纬通信	18,750,756.96	3.34
73	600958	东方证券	18,284,271.88	3.26
74	300083	劲胜精密	18,224,017.76	3.25
75	300481	濮阳惠成	18,171,864.79	3.24
76	300155	安居宝	17,770,244.94	3.16
77	600386	北巴传媒	17,534,849.87	3.12
78	300097	智云股份	17,453,611.25	3.11
79	000783	长江证券	17,424,263.61	3.10
80	300253	卫宁健康	17,112,144.01	3.05
81	000158	常山股份	17,020,821.00	3.03
82	600435	北方导航	16,761,598.69	2.99
83	300312	邦讯技术	16,714,595.99	2.98
84	300377	赢时胜	16,517,488.96	2.94
85	002432	九安医疗	16,090,792.34	2.87
86	002500	山西证券	16,007,840.52	2.85
87	601336	新华保险	15,967,058.48	2.84
88	300085	银之杰	15,947,088.47	2.84
89	300314	戴维医疗	15,885,107.84	2.83
90	000776	广发证券	15,708,428.00	2.80
91	601555	东吴证券	15,631,868.64	2.78



92	601699	潞安环能	15,507,730.09	2.76
93	000625	长安汽车	15,261,089.48	2.72
94	300264	佳创视讯	15,181,030.61	2.70
95	002736	国信证券	14,913,653.68	2.66
96	000049	德赛电池	14,607,296.00	2.60
97	600030	中信证券	14,606,014.83	2.60
98	600109	国金证券	14,600,485.00	2.60
99	002717	岭南园林	14,596,293.00	2.60
100	600563	法拉电子	14,354,094.80	2.56
101	002777	久远银海	14,324,352.92	2.55
102	000733	振华科技	14,131,526.81	2.52
103	300063	天龙集团	13,869,017.82	2.47
104	000918	嘉凯城	13,691,314.00	2.44
105	000060	中金岭南	13,689,318.00	2.44
106	002614	蒙发利	13,642,620.00	2.43
107	300014	亿纬锂能	13,557,282.27	2.41
108	300353	东土科技	13,417,980.81	2.39
109	002236	大华股份	13,271,358.56	2.36
110	002268	卫士通	13,186,601.17	2.35
111	002467	二六三	12,779,502.64	2.28
112	002296	辉煌科技	12,715,046.00	2.26
113	603118	共进股份	12,697,070.88	2.26
114	300047	天源迪科	12,279,890.96	2.19
115	300024	机器人	12,264,657.92	2.18
116	300065	海兰信	12,261,853.98	2.18
117	300299	富春通信	12,064,778.61	2.15
118	300077	国民技术	12,058,690.56	2.15
119	603019	中科曙光	11,921,373.00	2.12
120	002188	巴士在线	11,744,875.00	2.09
121	300303	聚飞光电	11,742,303.10	2.09
122	601901	方正证券	11,518,715.86	2.05
123	002782	可立克	11,514,500.04	2.05
124	600715	文投控股	11,420,600.48	2.03
125	002586	围海股份	11,359,592.00	2.02
126	000807	云铝股份	11,254,663.35	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	002292	奥飞娱乐	106,997,546.85	19.06
2	300364	中文在线	83,178,192.44	14.81
3	002376	新北洋	79,783,529.95	14.21
4	002253	川大智胜	74,802,418.71	13.32
5	300148	天舟文化	58,813,219.42	10.47
6	300075	数字政通	58,057,056.73	10.34
7	000948	南天信息	54,398,110.11	9.69
8	002354	天神娱乐	53,229,701.54	9.48
9	300448	浩云科技	52,129,255.86	9.28
10	300016	北陆药业	49,839,466.92	8.88
11	300494	盛天网络	49,817,262.38	8.87
12	300467	迅游科技	49,505,201.62	8.82
13	600730	中国高科	48,809,772.45	8.69
14	300479	神思电子	47,516,345.00	8.46
15	300327	中颖电子	46,230,089.40	8.23
16	300010	立思辰	43,925,588.06	7.82
17	300520	科大国创	43,090,420.51	7.67
18	300404	博济医药	41,654,114.08	7.42
19	300227	光韵达	40,873,461.13	7.28
20	300037	新宙邦	40,561,892.28	7.22
21	300458	全志科技	40,031,579.32	7.13
22	300231	银信科技	37,182,811.02	6.62
23	300452	山河药辅	36,182,455.08	6.44
24	300226	上海钢联	35,218,134.11	6.27
25	300340	科恒股份	34,510,770.62	6.15
26	300474	景嘉微	33,871,550.06	6.03
27	300130	新国都	33,679,964.62	6.00
28	002280	联络互动	33,557,569.02	5.98
29	300030	阳普医疗	32,818,337.38	5.84
30	300168	万达信息	32,743,899.68	5.83
31	300373	扬杰科技	32,334,011.64	5.76
32	600362	江西铜业	31,832,712.15	5.67
33	002709	天赐材料	31,008,795.73	5.52
34	603678	火炬电子	30,898,994.55	5.50

35	300367	东方网力	29,855,569.63	5.32
36	300518	盛讯达	29,295,051.06	5.22
37	002599	盛通股份	28,874,473.35	5.14
38	300113	顺网科技	28,482,230.97	5.07
39	000937	冀中能源	27,374,485.61	4.88
40	300287	飞利信	27,276,687.22	4.86
41	603598	引力传媒	26,183,066.07	4.66
42	300236	上海新阳	25,690,949.33	4.58
43	300160	秀强股份	25,243,575.59	4.50
44	002402	和而泰	24,560,304.91	4.37
45	300453	三鑫医疗	24,272,355.28	4.32
46	300059	东方财富	24,092,685.50	4.29
47	300213	佳讯飞鸿	23,784,758.11	4.24
48	300083	劲胜精密	23,407,166.65	4.17
49	002308	威创股份	23,327,425.30	4.15
50	300302	同有科技	23,218,487.47	4.14
51	002537	海立美达	23,113,748.00	4.12
52	002148	北纬通信	22,905,965.51	4.08
53	300339	润和软件	22,520,240.51	4.01
54	300155	安居宝	21,840,784.96	3.89
55	000630	铜陵有色	20,958,986.91	3.73
56	002315	焦点科技	20,229,426.22	3.60
57	300253	卫宁健康	19,929,121.24	3.55
58	300377	赢时胜	19,800,571.22	3.53
59	600055	万东医疗	19,614,566.12	3.49
60	600571	信雅达	19,200,078.69	3.42
61	002432	九安医疗	19,185,082.89	3.42
62	300036	超图软件	19,142,780.18	3.41
63	000532	力合股份	19,106,196.17	3.40
64	300097	智云股份	18,999,352.06	3.38
65	002108	沧州明珠	18,767,078.21	3.34
66	300314	戴维医疗	18,754,732.47	3.34
67	300418	昆仑万维	18,570,443.04	3.31
68	300394	天孚通信	17,980,460.10	3.20
69	600435	北方导航	17,933,004.08	3.19
70	300136	信维通信	17,756,887.14	3.16
71	600386	北巴传媒	17,613,962.57	3.14
72	300068	南都电源	17,317,139.29	3.08

73	300085	银之杰	16,802,456.77	2.99
74	000158	常山股份	16,754,279.12	2.98
75	600497	驰宏锌锗	16,215,006.00	2.89
76	300073	当升科技	15,655,974.76	2.79
77	000918	嘉凯城	15,480,000.00	2.76
78	300299	富春通信	15,175,335.84	2.70
79	002484	江海股份	15,093,267.20	2.69
80	002782	可立克	14,820,092.40	2.64
81	300047	天源迪科	14,690,417.95	2.62
82	300353	东土科技	14,655,667.00	2.61
83	000733	振华科技	14,653,533.36	2.61
84	300077	国民技术	14,572,174.70	2.60
85	601699	潞安环能	14,365,149.32	2.56
86	002717	岭南园林	14,364,830.31	2.56
87	000049	德赛电池	14,185,757.45	2.53
88	002777	久远银海	14,033,469.66	2.50
89	600563	法拉电子	13,976,765.99	2.49
90	000776	广发证券	13,757,222.00	2.45
91	002614	蒙发利	13,683,031.07	2.44
92	300024	机器人	13,585,447.33	2.42
93	002236	大华股份	13,543,424.00	2.41
94	002296	辉煌科技	13,368,769.51	2.38
95	002268	卫士通	13,229,221.54	2.36
96	600715	文投控股	13,045,661.96	2.32
97	300303	聚飞光电	13,044,245.60	2.32
98	600728	佳都科技	12,999,103.00	2.32
99	300065	海兰信	12,978,034.54	2.31
100	000060	中金岭南	12,926,725.60	2.30
101	300063	天龙集团	12,255,698.70	2.18
102	002188	巴士在线	12,040,521.68	2.14
103	603118	共进股份	11,889,963.00	2.12
104	000566	海南海药	11,748,522.40	2.09
105	603019	中科曙光	11,714,461.29	2.09
106	002245	澳洋顺昌	11,666,147.09	2.08
107	300308	中际装备	11,541,773.05	2.06
108	002586	围海股份	11,401,480.50	2.03
109	300359	全通教育	11,252,597.36	2.00

### 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	4,106,769,964.36
卖出股票收入（成交）总额	3,437,891,687.54

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

国泰君安证券股份有限公司（下称“公司”）日前收到中国证券监督管理委员会《关于对国泰君安证券股份有限公司采取责令改正、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告措施的事先告知书》（机构部函[2016]3280号）：经查，我会发现你公司存在以下违规行为：一是在推荐河北润农节水科技股份有限公司（简称企业）进入全国中小企业股份转让系统挂牌过程中，对企业关键业务流程、存货情况的核查不充分；内核机构履职的独立性存在缺陷。二是在持续督导参仙源参业股份有限公司（全国中小企业股份转让系统挂牌公司，简称企业）过程中，企业被立案稽查后，未在规定时间内完成并报送《持续督导现场检查工作报告》。三是在推荐新疆瑞兆源生态农业股份有限公司（简称企业）进入全国中小企业股份转让系统挂牌过程中，对企业关键业务流程、购销情况的核查不充分。你公司在开展推荐业务过程中存在多项违规行为，反映出内部控制制度存在一定缺陷。上述缺陷及行为违反了《非上市公众公司监督管理办法》第六条规定和《证券公司内部控制指引》的相关规定。按照《证券公司监督管理条例》第七十条、《非上市公众公司监督管理办法》第六十二条的规定，我会拟责令你公司改正、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告。整改期限为正式决定作出之日起一个月。本基金做出如下说明：国泰君安证券是中国优秀的证券公司之一，综合实力突出，基本面良好。基于相关研究，本基金判断，这一处罚对国泰君安证券无实质影响。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

2016年6月23日，公司收到《中国保险监督管理委员会行政处罚决定书》（保监罚〔2016〕13号），公司因采取退保金直接冲减退保年度保费收入的方式处理长期险非正常退保业务，违反了《中华人民共和国保险法》相关规定，被罚款40万元。本基金做出如下说明：中国人寿是中国最优秀的保险公司之一，综合实力突出，基本面良好。基于相关研究，本基金判断，这一处罚对公司无实质影响。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，本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。

### 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	599,772.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	51,014.51
5	应收申购款	224,939.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	875,726.25

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300496	中科创达	33,415,830.36	4.61	重大事项停牌

## 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，分项之和与合计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
15,638	46,718.51	237,759,074.50	32.54%	492,824,984.60	67.46%

## 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	1,273,134.32	0.1743%

**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、基金投资和研发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	50~100

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2015年11月6日）基金份额总额	561,560,991.74
本报告期期初基金份额总额	561,560,991.74
本报告期基金总申购份额	2,248,415,313.34
减:本报告期基金总赎回份额	2,079,392,245.98
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	730,584,059.10

**§ 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**

本报告期本基金基金经理未曾变动。

**11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况**

2016年12月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

**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，提供审计服务 1 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	
华泰证券	2	12,903,877,262.96	38.51%	2,704,387.17	40.92%	-
招商证券	2	22,182,923,826.98	28.95%	2,032,954.81	30.76%	-
国金证券	2	1,388,189,318.21	18.41%	1,046,938.70	15.84%	-
国信证券	2	656,594,529.01	8.71%	480,167.52	7.26%	-
东兴证券	2	147,302,789.93	1.95%	107,722.50	1.63%	-
方正证券	2	125,891,819.23	1.67%	117,243.46	1.77%	-
东莞证券	1	107,688,525.38	1.43%	100,290.00	1.52%	-
东北证券	2	27,267,334.89	0.36%	19,941.16	0.30%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	2,550,000,000.00	12.46%	-	-
国信证券	-	-	10,518,000,000.00	51.39%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	7,400,000,000.00	36.15%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-

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	国信证券	深圳	1
2	国信证券	上海	1
3	东北证券	深圳	1
4	东北证券	上海	1
5	恒泰证券	深圳	1
6	东兴证券	深圳	1
7	东兴证券	上海	1
8	方正证券	深圳	1
9	招商证券	深圳	1
10	招商证券	上海	1
11	天风证券	深圳	1
12	天风证券	上海	1
13	长江证券	深圳	1
14	长江证券	上海	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

长盛基金管理有限公司  
2017年3月27日