

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告

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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 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.....	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
8.7 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.....	52

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	52
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	52
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.12	投资组合报告附注	53
§9	基金份额持有人信息	54
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§10	开放式基金份额变动	55
§11	重大事件揭示	55
11.1	基金份额持有人大会决议	55
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	55
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
11.4	基金投资策略的改变	56
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
11.8	其他重大事件	57
§12	备查文件目录	65
12.1	备查文件目录	65
12.2	存放地点	65
12.3	查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金
基金简称	长盛同鑫行业混合
基金主代码	080007
交易代码	080007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月27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	124,831,608.38份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会，在控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	（1）本基金在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挖掘预期具有良好增长前景的优势行业，以谋求行业配置的超额收益。（2）在资产配置层面，本基金管理人对宏观经济的经济周期进行预测，在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在各类别资产间的分配比例。具体操作中，采用经济周期资产配置模型，通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析，对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测，然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。（3）在行业配置层面，通过宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机，据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业，把握行业景气轮换带来的投资机会；（4）在股票选择层面，本基金综合运用长盛行业股票研究分析方法和其它投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合，前述优势行业中股票优先入选。
业绩比较基准	60%*沪深300指数+40%*中证全债指数
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、	95566

	010-62350088	
传真	010-82255988	010-66594942
注册地址	深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100088	100818
法定代表人	高新	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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	基金管理人的办公地址和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、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	2014 年 5 月 27 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-22,103,958.99	21,093,135.69	27,873,275.49
本期利润	-34,237,089.09	15,964,622.63	41,941,679.46
加权平均基金份额本期利润	-0.5788	0.2068	0.2507
本期加权平均净值利润率	-58.93%	14.13%	22.31%
本期基金份额净值增长率	-37.94%	7.01%	27.38%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	-13,726,154.05	25,375,484.39	32,287,635.24
期末可供分配基金份额利润	-0.1100	0.4218	0.2652
期末基金资产净值	111,105,454.33	86,260,266.03	163,111,703.17
期末基金份额净值	0.890	1.434	1.340
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末

基金份额累计净值增长率	-15.40%	36.31%	27.38%
-------------	---------	--------	--------

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	-2.52%	0.44%	0.35%	0.45%	-2.87%	-0.01%
过去六个月	-8.34%	0.71%	3.18%	0.47%	-11.52%	0.24%
过去一年	-37.94%	1.68%	-5.64%	0.84%	-32.30%	0.84%
自基金合同生效起至今	-15.40%	2.15%	41.75%	1.12%	-57.15%	1.03%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准：60%×沪深 300 指数+40%×中证全债指数

基准指数的构建考虑了三个原则：

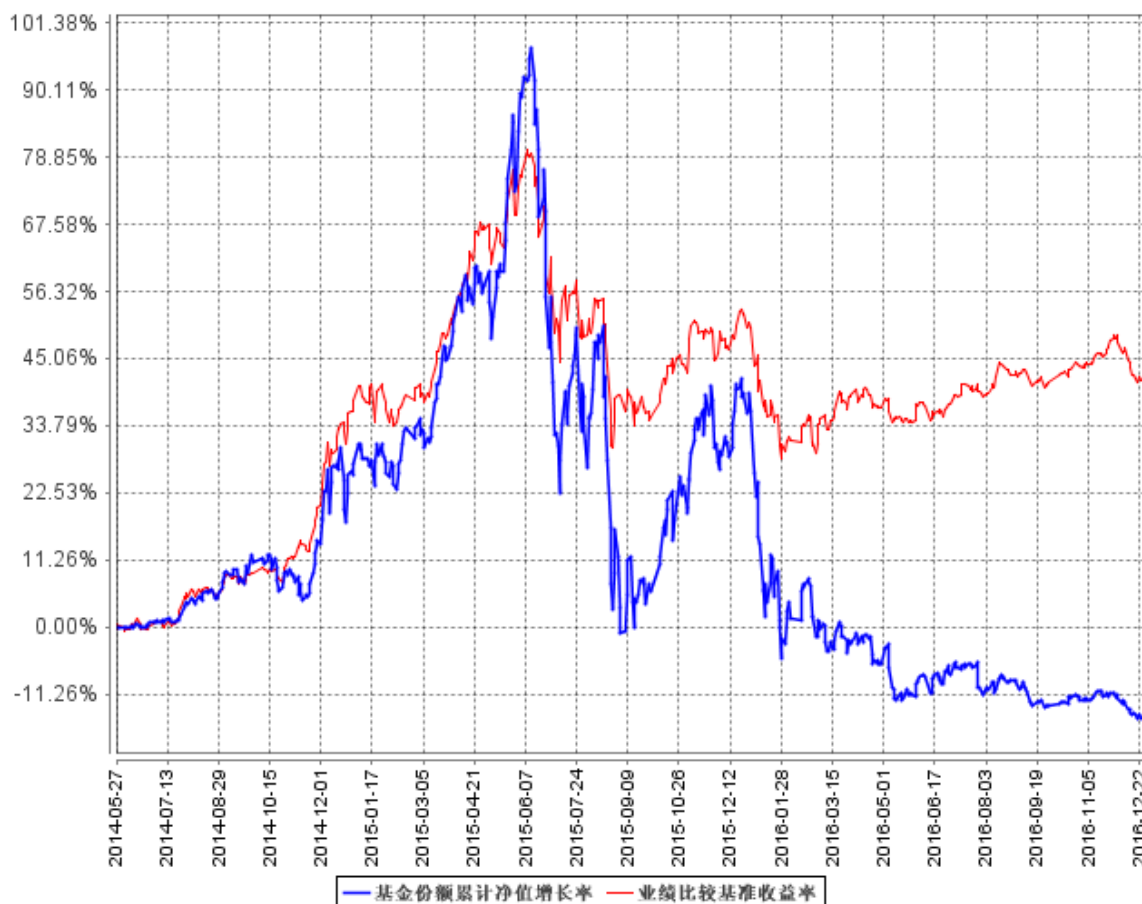
1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证全债指数。目前沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准较为合适。

2、可比性。本基金在运作过程中将维持 40%-95%的股票、权证等权益类资产，根据本基金投资策略，业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 60%、40%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 自基金转型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

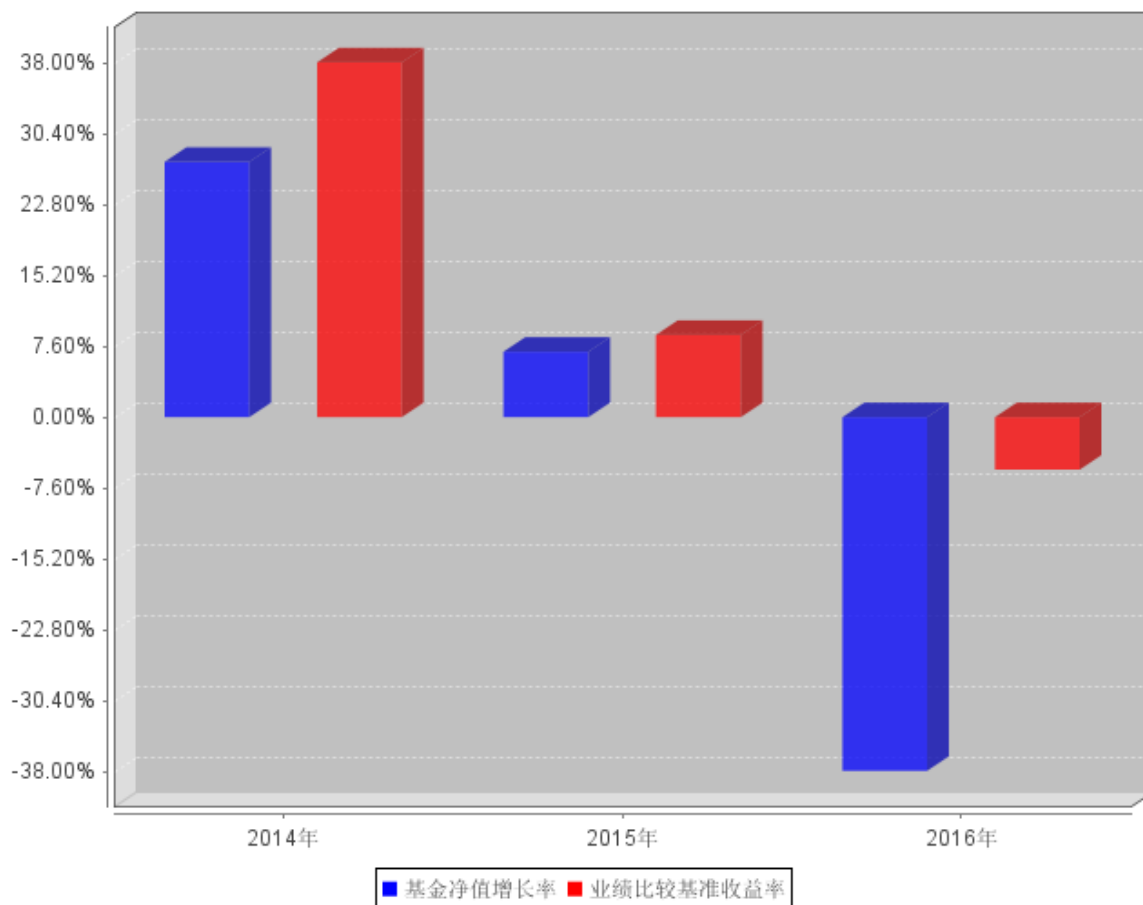


注：1、长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金由长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来，变更日期为 2014 年 5 月 27 日（即基金合同生效日）。

2、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三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告日，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。

3.2.3 自基金转型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：长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金由长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来，变更日期为 2014 年 5 月 27 日（即基金合同生效日）。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金由长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来，变更日期为 2014 年 5 月 27 日（即基金合同生效日），本基金于 2016 年度、2015 年度和 2014 年度均未进行利润分配。

§ 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投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴博文	本基金基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	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，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。
乔培涛	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助理，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助理，研究部副总监。	2016年8月24日	-	7年	乔培涛先生，1979年12月出生。清华大学硕士。曾任长城证券研究员、行业研究部经理。2011年8月加入长盛基金管理有限公司。
田间	本基金基金经理，长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2014年9月9日	2016年2月17日	7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。

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 年初 A 股市场经历了剧烈的熔断式下跌，由于本基金在 2015 年年末保持了高仓位因此 2016 年开年受损严重，之后又把仓位控制偏低导致错过了 2-3 月份最主要的超跌反弹，给本基金 2016 年业绩造成了较大的损失。之后市场基本处于大箱体震荡行情，震荡下轨 2800 上轨 3300，本基金大部分时间保持了较低仓位，阶段性参与了部分热点板块投资，但由于前期造成的亏损较大无法弥补，最终全年业绩较差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，长盛同鑫行业混合份额净值为 0.890 元，本报告期份额净值增长率为-37.94%，同期业绩比较基准增长率为-5.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观环境来看，2017 年将是不确定性最大的一年，外有特朗普上台后其执政思路与前任的重大不确定性改变，内有十九大即将召开的一系列不确定性改革，落实到中观则是地产投资、财政及货币政策、周边局势等一系列不确定性因素。众多不确定因素容易造成市场的过度反应，也需要投资者保持更高的警惕性和市场敏感度。

从企业盈利角度看，大概率到二季度会见到本轮小周期的盈利高点，尤其是周期品行业，需警惕该预期在市场中的提前反应。成长板块继续消化估值泡沫，部分真成长个股逐渐进入估值可观察阶段。

从市场交易层面看，国家队的维稳力量仍在，保险和委外资金仍有加大权益投资的意向但其投资策略更加务实和理性，未形成明显赚钱效应前散户入市较为缓慢；另一方面 2017 年解禁市值较前两年扩大接近 1 倍，新股发行预期会适度提速。综上所述，初步判断 2107 年 A 股市场总体延续宽体震荡行情，出现暴涨或暴跌的概率较小，但其中不乏阶段性行情和结构性机会，基金会减小仓位波动，以结构偏离的方式参与一些确定性较大的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合规运作，保障资产委托人利益出发，结合监管要求、市场形势及自身业务发展需要，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时督促有关部门改进、完善，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

1、强调合规宣导与培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种方式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，强化员工合规理念，深化员工合规意识，提高员工合规工作技能，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、持续推动公司完善制度/流程建设，扎实公司内控制度基础。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，保证公司制度/流程的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司新订、修订了包括《长盛基金管理有限公司风险准备金管理办法》、《长盛基金管理有限公司固有资金投资管理制度》、《公司信用品种备选库管理办法》、《公司银行间一级市场债券交易流程》、《长盛基金管理有限公司国债期货投资管理办法》、《公司投资者教育工作制度》、《业务运营部登记结算中心客户款项支付及退回流程》等多部制度和流程。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，严肃制度/流程执行力，合理保障公司运营及委托资产投资运作合规。报告期内，监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核 40 余项，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、登记注册、产品开发、员工行为等；此外，根据业务发展需要，以及日常监督中发现问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，合理保障公司及委托资产合规、稳健运作。

5、积极参与新产品设计、新业务拓展工作，对相关的合规问题提供意见和建议。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

4.7 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。

4.8 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《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》第十六部分中对基金收益分配原则的约定，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金于报告期内未进行利润分配。

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金截至 2016 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 -13,726,154.05 元，其中：未分配利润已实现部分为 7,425,961.69 元，未分配利润未实现部分为 -21,152,115.74 元。

4.9 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

本基金自 2016 年 7 月 27 日至 2016 年 10 月 25 日、自 2016 年 11 月 04 日至 2016 年 12 月 09 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、

基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字（2017）审字第 20950 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金（以下简称“长盛同鑫行业混合”）的财务报表，包括 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。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是长盛同鑫行业混合 的基金管理人长盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映； (2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

	<p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	<p>我们认为，上述长盛同鑫行业混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了长盛同鑫行业混合 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>	
注册会计师的姓名	陈玲	沈兆杰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2017 年 3 月 22 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛同鑫行业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	附注号	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	7.4.7.1	20,126,269.70	9,329,757.77
结算备付金		130,858.81	709,837.47
存出保证金		38,731.96	106,101.45
交易性金融资产	7.4.7.2	92,336,962.73	77,872,388.65
其中：股票投资		92,336,962.73	77,872,286.85
基金投资		-	-
债券投资		-	101.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	787,312.39

应收利息	7.4.7.5	4,134.68	2,497.90
应收股利		-	-
应收申购款		1,498.20	38,933.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		112,638,456.08	88,846,828.99
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	674,033.91
应付赎回款		14,680.57	39,629.78
应付管理人报酬		109,598.30	107,783.07
应付托管费		18,266.38	17,963.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	150,908.67	333,576.02
应交税费		1,175,703.80	1,175,703.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	63,844.03	237,872.55
负债合计		1,533,001.75	2,586,562.96
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	124,831,608.38	60,161,365.31
未分配利润	7.4.7.10	-13,726,154.05	26,098,900.72
所有者权益合计		111,105,454.33	86,260,266.03
负债和所有者权益总计		112,638,456.08	88,846,828.99

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.890 元，基金份额总额 124,831,608.38 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛同鑫行业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	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
一、收入		-31,750,822.61	21,255,894.33
1. 利息收入		156,001.81	138,071.65
其中：存款利息收入	7.4.7.11	156,000.69	138,064.65

债券利息收入		1.12	7.00
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）		-19,854,905.96	26,037,628.61
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-20,027,867.89	25,121,626.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1.73	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	172,960.20	916,001.78
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-12,133,130.10	-5,128,513.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	81,211.64	208,707.13
减：二、费用		2,486,266.48	5,291,271.70
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	864,902.25	1,695,891.53
2. 托管费	7.4.10.2.2	144,150.36	282,648.66
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,309,531.73	2,951,608.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	167,682.14	361,122.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-34,237,089.09	15,964,622.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-34,237,089.09	15,964,622.63

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同鑫行业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）	60,161,365.31	26,098,900.72	86,260,266.03
二、本期经营活动产生的	-	-34,237,089.09	-34,237,089.09

基金净值变动数（本期利润）			
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）	64,670,243.07	-5,587,965.68	59,082,277.39
其中：1. 基金申购款	92,479,528.07	-6,829,013.94	85,650,514.13
2. 基金赎回款	-27,809,285.00	1,241,048.26	-26,568,236.74
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）	124,831,608.38	-13,726,154.05	111,105,454.33
项目	上年度可比期间 2015年1月1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）	121,729,420.57	41,382,282.60	163,111,703.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,964,622.63	15,964,622.63
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）	-61,568,055.26	-31,248,004.51	-92,816,059.77
其中：1. 基金申购款	22,021,629.95	13,638,806.10	35,660,436.05
2. 基金赎回款	-83,589,685.21	-44,886,810.61	-128,476,495.82
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）	60,161,365.31	26,098,900.72	86,260,266.03

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
基金管理人负责人

杨思乐
主管会计工作负责人

龚珉
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据《长盛同鑫保本混合型

证券投资基金基金合同》的约定由长盛同鑫保本混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)第一个保本周期届满后变更而来。原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[2011]第 519 号《关于核准长盛同鑫保本混合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《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原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人民币 3,031,349,989.30 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(2011)第 190 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 5 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,032,111,617.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 761,628.00 份基金份额。

根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,原基金的保本期一般每三年为一个周期;如保本周期到期后,原基金未能符合保本基金存续条件,则原基金将按基金合同的约定变更为非保本的混合型基金。在原基金募集期内认购原基金的基金份额持有人,若继续持有转型后的本基金基金份额,而可赎回金额(可赎回金额以原保本周期届满日的原基金基金份额净值为基准进行计算)加上原保本周期期间的累计分红金额低于其投资净额,基金管理人或担保人应补足该金额差额。原基金的担保人将保证向符合上述条件的原基金份额持有人承担上述差额部分的偿付并及时清偿,担保额度为人民币 51 亿元。根据《关于长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后变更为长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金及相关业务安排的公告》,原基金在第一个保本周期届满日次日,即 2014 年 5 月 27 日起变更为本基金,变更后基金的投资及基金费率等按照《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同鑫行业配置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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资组合中股票、权证等权益类资产占基金资产的 40%-95%,其中,持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%;债券、货币市场工具(包括一年以内的短期国债、回购协议等)、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证券品种占基金资产的 0%-40%,其中基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:60%X 沪深 300 指数+40%X 中证全债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2017 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 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》、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，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。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	20,126,269.70	9,329,757.77
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	20,126,269.70	9,329,757.77

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	94,631,677.50	92,336,962.73	-2,294,714.77
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	94,631,677.50	92,336,962.73	-2,294,714.77
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	68,033,873.32	77,872,286.85	9,838,413.53
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	100.00	101.80
	银行间市场	-	-
	合计	100.00	101.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	68,033,973.32	77,872,388.65	9,838,415.33

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	4,058.26	2,129.92
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	58.90	319.40
应收债券利息	-	0.58
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.02	0.30
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	17.50	47.70
合计	4,134.68	2,497.90

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	150,908.67	333,576.02
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	150,908.67	333,576.02

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
预提费用	46,000.00	220,000.00
其他	17,814.69	17,814.69

应付赎回费	29.34	57.86
合计	63,844.03	237,872.55

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,161,365.31	60,161,365.31
本期申购	92,479,528.07	92,479,528.07
本期赎回（以“-”号填列）	-27,809,285.00	-27,809,285.00
本期末	124,831,608.38	124,831,608.38

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	25,375,484.39	723,416.33	26,098,900.72
本期利润	-22,103,958.99	-12,133,130.10	-34,237,089.09
本期基金份额交易产生的变动数	4,154,436.29	-9,742,401.97	-5,587,965.68
其中：基金申购款	7,655,885.55	-14,484,899.49	-6,829,013.94
基金赎回款	-3,501,449.26	4,742,497.52	1,241,048.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,425,961.69	-21,152,115.74	-13,726,154.05

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
活期存款利息收入	147,183.32	121,739.61
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	6,058.83	14,115.35
其他	2,758.54	2,209.69
合计	156,000.69	138,064.65

7.4.7.12 股票投资收益

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1月1日至 2015年12月31日
卖出股票成交总额	419,179,433.88	988,870,101.89
减：卖出股票成本总额	439,207,301.77	963,748,475.06
买卖股票差价收入	-20,027,867.89	25,121,626.83

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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1月1日至 2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1.73	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1.73	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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1月1日至 2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	103.43	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	100.00	-
减：应收利息总额	1.70	-
买卖债券差价收入	1.73	-

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	172,960.20	916,001.78
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	172,960.20	916,001.78

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-12,133,130.10	-5,128,513.06
——股票投资	-12,133,128.30	-5,128,512.96
——债券投资	-1.80	-0.10
——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	-12,133,130.10	-5,128,513.06

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
基金赎回费收入	78,747.70	146,802.48
转换费收入	2,463.94	61,904.65
合计	81,211.64	208,707.13

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
交易所市场交易费用	1,309,531.73	2,951,608.79
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,309,531.73	2,951,608.79

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日

信息披露费	90,000.00	270,000.00
审计费用	46,000.00	40,000.00
帐户维护费	24,700.00	36,000.00
银行划款费用	6,782.14	14,922.72
其他费用	200.00	200.00
合计	167,682.14	361,122.72

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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》(财税[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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(“长盛基金”)	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、基金销售机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1 关联方报酬

7.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	864,902.25	1,695,891.53
其中：支付销售机构的客户维护费	367,051.31	756,462.17

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.1.2 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1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	144,150.36	282,648.66

注：支付基金托管人中国银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

7.4.10.4 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1月1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	20,126,269.70	147,183.32	9,329,757.77	121,739.61

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。

7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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
300150	世纪瑞尔	2016年11月8日	重大资产重组	9.15	2017年3月21日	10.97	180,000	1,804,264.90	1,647,000.00	-
000166	申万宏源	2016年12月21日	重大事项	6.25	2017年1月26日	6.29	125,000	794,340.00	781,250.00	-
300005	探路者	2016年11月28日	重大资产重组	16.41	2017年2月6日	15.02	40,000	629,348.00	656,400.00	-
600406	国电南瑞	2016年12月28日	重大事项未公告	16.63	-	-	26,800	421,637.00	445,684.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项未公告	14.60	-	-	24,000	386,967.00	350,400.00	-

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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行灵活配置的混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资等。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“风险和收益相匹配”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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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银行，因而与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。

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 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例小于 0.01%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 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 12 月 31 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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	20,126,269.70	-	-	-	20,126,269.70
结算备付金	130,858.81	-	-	-	130,858.81
存出保证金	38,731.96	-	-	-	38,731.96
交易性金融资产	-	-	-	92,336,962.73	92,336,962.73
应收利息	-	-	-	4,134.68	4,134.68
应收申购款	-	-	-	1,498.20	1,498.20
资产总计	20,295,860.47	-	-	92,342,595.61	112,638,456.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,680.57	14,680.57
应付管理人报酬	-	-	-	109,598.30	109,598.30
应付托管费	-	-	-	18,266.38	18,266.38
应付交易费用	-	-	-	150,908.67	150,908.67
应交税费	-	-	-	1,175,703.80	1,175,703.80
其他负债	-	-	-	63,844.03	63,844.03
负债总计	-	-	-	1,533,001.75	1,533,001.75
利率敏感度缺口	20,295,860.47	-	-	90,809,593.86	111,105,454.33
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	9,329,757.77	-	-	-	9,329,757.77
结算备付金	709,837.47	-	-	-	709,837.47
存出保证金	106,101.45	-	-	-	106,101.45
交易性金融资产	101.80	-	-	77,872,286.85	77,872,388.65
应收证券清算款	-	-	-	787,312.39	787,312.39
应收利息	-	-	-	2,497.90	2,497.90
应收申购款	-	-	-	38,933.36	38,933.36
资产总计	10,145,798.49	-	-	78,701,030.50	88,846,828.99
负债					

应付证券清算款	-	-	-	674,033.91	674,033.91
应付赎回款	-	-	-	39,629.78	39,629.78
应付管理人报酬	-	-	-	107,783.07	107,783.07
应付托管费	-	-	-	17,963.83	17,963.83
应付交易费用	-	-	-	333,576.02	333,576.02
应交税费	-	-	-	1,175,703.80	1,175,703.80
其他负债	-	-	-	237,872.55	237,872.55
负债总计	-	-	-	2,586,562.96	2,586,562.96
利率敏感度缺口	10,145,798.49	-	-	76,114,467.54	86,260,266.03

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2015 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例小于 0.01%），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）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 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、权证等权益类资产占基金资产的 40%-95%；投资于债券、货币市场工具、资产支持证券等其他证券品种占基金资产的 0%-40%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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	92,336,962.73	83.11	77,872,286.85	90.28
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	92,336,962.73	83.11	77,872,286.85	90.28

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日)	上年度末(2015年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	9,524,650.72	7,000,236.24
2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-9,524,650.72	-7,000,236.24	

7.4.14 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 12 月 31 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 88,456,228.73 元, 第二层次的余额为 3,880,734.00 元, 无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日: 第一层次 70,303,802.84 元, 第二层次 7,568,585.81 元, 无属于及第三层次的余额)。

(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和债券, 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 12 月 31 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。

§ 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	92,336,962.73	81.98
	其中: 股票	92,336,962.73	81.98
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	20,257,128.51	17.98
7	其他各项资产	44,364.84	0.04
8	合计	112,638,456.08	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	2,614,901.00	2.35
C	制造业	41,996,571.93	37.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,402,043.00	5.76
E	建筑业	1,917,123.00	1.73
F	批发和零售业	3,189,370.00	2.87
G	交通运输、仓储和邮政业	3,735,125.00	3.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,597,578.00	7.74
J	金融业	11,728,710.00	10.56
K	房地产业	6,875,911.00	6.19
L	租赁和商务服务业	1,651,100.00	1.49
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,368,307.00	1.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	200,330.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	1,622,542.80	1.46
S	综合	437,350.00	0.39
	合计	92,336,962.73	83.11

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	000002	万科A	172,700	3,548,985.00	3.19
2	000651	格力电器	111,200	2,737,744.00	2.46
3	000333	美的集团	64,100	1,805,697.00	1.63
4	300150	世纪瑞尔	180,000	1,647,000.00	1.48
5	600900	长江电力	128,100	1,621,746.00	1.46
6	000778	新兴铸管	304,200	1,572,714.00	1.42
7	600886	国投电力	218,200	1,455,394.00	1.31
8	000725	京东方A	459,100	1,313,026.00	1.18
9	000858	五粮液	36,700	1,265,416.00	1.14
10	600276	恒瑞医药	26,300	1,196,650.00	1.08
11	600015	华夏银行	101,300	1,099,105.00	0.99
12	002353	杰瑞股份	50,000	1,015,000.00	0.91
13	600027	华电国际	200,000	990,000.00	0.89
14	000001	平安银行	105,500	960,050.00	0.86
15	603800	道森股份	30,000	905,100.00	0.81
16	600674	川投能源	103,300	898,710.00	0.81
17	601018	宁波港	176,100	891,066.00	0.80
18	002415	海康威视	36,600	871,446.00	0.78
19	001979	招商蛇口	51,800	849,002.00	0.76
20	601099	太平洋	163,000	839,450.00	0.76
21	002450	康得新	43,700	835,107.00	0.75
22	300059	东方财富	48,800	826,184.00	0.74
23	002024	苏宁云商	71,600	819,820.00	0.74
24	002304	洋河股份	11,500	811,900.00	0.73
25	002736	国信证券	52,200	811,710.00	0.73
26	000063	中兴通讯	50,800	810,260.00	0.73
27	601939	建设银行	145,200	789,888.00	0.71
28	000166	申万宏源	125,000	781,250.00	0.70
29	601009	南京银行	71,100	770,724.00	0.69
30	000783	长江证券	74,100	758,043.00	0.68
31	000503	海虹控股	16,500	693,825.00	0.62
32	000625	长安汽车	45,600	681,264.00	0.61
33	600585	海螺水泥	39,300	666,528.00	0.60
34	300005	探路者	40,000	656,400.00	0.59

35	002673	西部证券	30,700	637,639.00	0.57
36	600383	金地集团	47,700	618,192.00	0.56
37	002142	宁波银行	37,000	615,680.00	0.55
38	600690	青岛海尔	61,800	610,584.00	0.55
39	601555	东吴证券	44,500	590,515.00	0.53
40	600011	华能国际	83,300	587,265.00	0.53
41	000423	东阿阿胶	10,800	581,796.00	0.52
42	002202	金风科技	33,100	566,341.00	0.51
43	600115	东方航空	79,800	564,186.00	0.51
44	600705	中航资本	92,100	563,652.00	0.51
45	002594	比亚迪	11,300	561,384.00	0.51
46	600019	宝钢股份	88,100	559,435.00	0.50
47	300070	碧水源	31,200	546,624.00	0.49
48	600703	三安光电	40,200	538,278.00	0.48
49	600068	葛洲坝	58,500	537,615.00	0.48
50	600660	福耀玻璃	28,600	532,818.00	0.48
51	600547	山东黄金	14,500	529,395.00	0.48
52	300017	网宿科技	9,800	525,378.00	0.47
53	000839	中信国安	56,000	514,080.00	0.46
54	000338	潍柴动力	51,200	509,952.00	0.46
55	002456	欧菲光	14,800	507,344.00	0.46
56	600535	天士力	12,100	502,029.00	0.45
57	600739	辽宁成大	27,800	499,288.00	0.45
58	600100	同方股份	36,000	498,600.00	0.45
59	600009	上海机场	18,700	495,924.00	0.45
60	000623	吉林敖东	16,000	495,840.00	0.45
61	600804	鹏博士	22,600	495,618.00	0.45
62	600089	特变电工	54,200	494,846.00	0.45
63	002241	歌尔股份	18,600	493,272.00	0.44
64	000768	中航飞机	23,200	493,232.00	0.44
65	000069	华侨城 A	70,300	488,585.00	0.44
66	300024	机器人	22,700	485,326.00	0.44
67	601618	中国中冶	103,600	482,776.00	0.43
68	601600	中国铝业	113,600	479,392.00	0.43
69	601198	东兴证券	23,500	471,410.00	0.42
70	000793	华闻传媒	41,000	462,890.00	0.42
71	300027	华谊兄弟	41,700	458,700.00	0.41
72	600031	三一重工	75,000	457,500.00	0.41
73	000413	东旭光电	40,500	456,030.00	0.41

74	000568	泸州老窖	13,800	455,400.00	0.41
75	600309	万华化学	21,100	454,283.00	0.41
76	600415	小商品城	51,800	448,070.00	0.40
77	600406	国电南瑞	26,800	445,684.00	0.40
78	002252	上海莱士	19,177	442,796.93	0.40
79	600196	复星医药	19,100	441,974.00	0.40
80	600271	航天信息	22,000	438,900.00	0.40
81	600023	浙能电力	80,800	438,744.00	0.39
82	600489	中金黄金	36,100	436,449.00	0.39
83	601607	上海医药	22,100	432,276.00	0.39
84	600177	雅戈尔	30,600	427,788.00	0.39
85	601888	中国国旅	9,800	425,320.00	0.38
86	600221	海南航空	129,600	422,496.00	0.38
87	600570	恒生电子	8,900	419,546.00	0.38
88	600867	通化东宝	19,100	418,863.00	0.38
89	600369	西南证券	58,200	414,966.00	0.37
90	000895	双汇发展	19,800	414,414.00	0.37
91	600352	浙江龙盛	44,800	412,608.00	0.37
92	000157	中联重科	90,200	409,508.00	0.37
93	600066	宇通客车	20,900	409,431.00	0.37
94	600340	华夏幸福	17,100	408,690.00	0.37
95	600816	安信信托	17,300	408,626.00	0.37
96	300124	汇川技术	19,800	402,534.00	0.36
97	002008	大族激光	17,700	400,020.00	0.36
98	600741	华域汽车	25,000	398,750.00	0.36
99	000630	铜陵有色	128,300	395,164.00	0.36
100	002236	大华股份	28,700	392,616.00	0.35
101	601808	中海油服	30,000	384,900.00	0.35
102	601111	中国国航	52,800	380,160.00	0.34
103	300315	掌趣科技	41,000	378,840.00	0.34
104	600153	建发股份	35,200	376,640.00	0.34
105	600061	国投安信	23,800	371,518.00	0.33
106	600118	中国卫星	11,700	365,508.00	0.33
107	600085	同仁堂	11,600	364,008.00	0.33
108	000686	东北证券	29,200	360,912.00	0.32
109	600718	东软集团	18,100	355,846.00	0.32
110	002465	海格通信	30,500	355,325.00	0.32
111	002065	东华软件	15,200	354,160.00	0.32
112	600485	信威集团	24,000	350,400.00	0.32

113	000876	新希望	42,700	343,735.00	0.31
114	000402	金融街	33,100	340,930.00	0.31
115	600820	隧道股份	30,800	339,108.00	0.31
116	600959	江苏有线	30,000	339,000.00	0.31
117	601933	永辉超市	68,700	337,317.00	0.30
118	600150	中国船舶	12,200	336,842.00	0.30
119	000917	电广传媒	23,200	333,848.00	0.30
120	000826	启迪桑德	10,100	333,098.00	0.30
121	002081	金螳螂	34,000	332,860.00	0.30
122	000963	华东医药	4,600	331,522.00	0.30
123	600018	上港集团	64,300	329,216.00	0.30
124	600839	四川长虹	78,600	328,548.00	0.30
125	600588	用友网络	15,700	326,874.00	0.29
126	000060	中金岭南	29,300	326,695.00	0.29
127	002007	华兰生物	9,004	321,893.00	0.29
128	300058	蓝色光标	31,100	316,287.00	0.28
129	600583	海油工程	42,600	314,388.00	0.28
130	000559	万向钱潮	23,600	312,936.00	0.28
131	002500	山西证券	25,800	310,116.00	0.28
132	300168	万达信息	15,300	309,366.00	0.28
133	601106	中国一重	57,100	308,911.00	0.28
134	600157	永泰能源	76,700	307,567.00	0.28
135	603993	洛阳钼业	80,200	298,344.00	0.27
136	600208	新湖中宝	71,500	297,440.00	0.27
137	600362	江西铜业	17,300	289,429.00	0.26
138	002183	怡亚通	26,200	284,532.00	0.26
139	600446	金证股份	11,300	283,969.00	0.26
140	000425	徐工机械	81,300	274,794.00	0.25
141	601333	广深铁路	49,900	252,993.00	0.23
142	000792	盐湖股份	12,200	232,654.00	0.21
143	600074	保千里	17,400	230,376.00	0.21
144	002385	大北农	31,700	225,070.00	0.20
145	601117	中国化学	33,200	224,764.00	0.20
146	600398	海澜之家	20,600	222,274.00	0.20
147	600642	申能股份	37,600	220,712.00	0.20
148	600895	张江高科	12,400	219,728.00	0.20
149	000709	河钢股份	65,400	218,436.00	0.20
150	601866	中海集运	53,500	218,280.00	0.20
151	600256	广汇能源	46,600	217,622.00	0.20

152	600060	海信电器	12,700	217,424.00	0.20
153	600688	上海石化	33,600	216,384.00	0.19
154	601718	际华集团	23,000	211,830.00	0.19
155	600376	首开股份	17,900	211,399.00	0.19
156	300144	宋城演艺	10,000	209,400.00	0.19
157	600873	梅花生物	32,100	209,292.00	0.19
158	002292	奥飞动漫	9,200	208,840.00	0.19
159	600252	中恒集团	45,400	207,932.00	0.19
160	601216	君正集团	44,500	206,925.00	0.19
161	601633	长城汽车	18,600	205,716.00	0.19
162	000977	浪潮信息	9,700	205,640.00	0.19
163	601258	庞大集团	74,200	205,534.00	0.18
164	600737	中粮屯河	16,200	201,852.00	0.18
165	601098	中南传媒	12,100	201,586.00	0.18
166	300015	爱尔眼科	6,700	200,330.00	0.18
167	600005	武钢股份	56,200	191,642.00	0.17
168	601179	中国西电	34,300	191,394.00	0.17
169	601991	大唐发电	49,600	189,472.00	0.17
170	600373	中文传媒	9,269	187,233.80	0.17
171	600704	物产中大	18,100	186,973.00	0.17
172	000738	中航动控	7,500	185,550.00	0.17
173	601992	金隅股份	41,300	184,198.00	0.17
174	002152	广电运通	13,700	181,936.00	0.16
175	601872	招商轮船	36,600	180,804.00	0.16
176	000061	农产品	14,300	176,891.00	0.16
177	000039	中集集团	12,000	175,440.00	0.16
178	600037	歌华有线	11,400	174,648.00	0.16
179	300002	神州泰岳	18,800	173,712.00	0.16
180	002146	荣盛发展	22,100	173,485.00	0.16
181	000712	锦龙股份	7,400	173,456.00	0.16
182	601898	中煤能源	29,800	173,138.00	0.16
183	601225	陕西煤业	35,200	170,720.00	0.15
184	002739	万达院线	1,900	102,733.00	0.09
185	002475	立讯精密	3,300	68,475.00	0.06
186	300003	乐普医疗	3,500	62,755.00	0.06

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	300496	中科创达	7,756,459.00	8.99
2	002007	华兰生物	6,189,409.52	7.18
3	002439	启明星辰	6,148,216.24	7.13
4	300315	掌趣科技	5,413,677.00	6.28
5	002458	益生股份	5,031,138.00	5.83
6	002292	奥飞动漫	4,872,797.72	5.65
7	002468	艾迪西	4,636,911.70	5.38
8	002701	奥瑞金	4,458,907.70	5.17
9	601088	中国神华	4,376,165.50	5.07
10	300418	昆仑万维	4,214,184.50	4.89
11	000002	万科A	3,967,087.00	4.60
12	002073	软控股份	3,922,613.00	4.55
13	002030	达安基因	3,747,061.40	4.34
14	600718	东软集团	3,678,005.86	4.26
15	300017	网宿科技	3,663,901.72	4.25
16	300253	卫宁健康	3,633,493.80	4.21
17	002400	省广股份	3,559,271.00	4.13
18	002236	大华股份	3,515,240.56	4.08
19	300168	万达信息	3,462,060.00	4.01
20	002304	洋河股份	3,344,409.40	3.88
21	000938	紫光股份	3,305,752.73	3.83
22	600570	恒生电子	3,232,478.00	3.75
23	002285	世联行	3,136,157.00	3.64
24	300467	迅游科技	3,135,021.00	3.63
25	300009	安科生物	3,134,597.00	3.63
26	300001	特锐德	3,134,053.00	3.63
27	300302	同有科技	3,132,177.00	3.63
28	300188	美亚柏科	3,131,872.00	3.63
29	600028	中国石化	3,126,692.10	3.62
30	002590	万安科技	3,102,723.32	3.60
31	300133	华策影视	3,034,822.00	3.52

32	300291	华录百纳	3,003,082.82	3.48
33	002594	比亚迪	2,991,517.00	3.47
34	600661	新南洋	2,980,152.00	3.45
35	000687	华讯方舟	2,977,751.22	3.45
36	000558	莱茵体育	2,968,130.61	3.44
37	002624	完美环球	2,947,374.25	3.42
38	600535	天士力	2,933,451.31	3.40
39	600804	鹏博士	2,930,977.00	3.40
40	600886	国投电力	2,877,752.39	3.34
41	600074	保千里	2,866,655.00	3.32
42	000651	格力电器	2,828,019.09	3.28
43	000876	新希望	2,805,788.00	3.25
44	300474	景嘉微	2,726,543.24	3.16
45	300015	爱尔眼科	2,724,039.21	3.16
46	300267	尔康制药	2,721,942.20	3.16
47	603598	引力传媒	2,702,941.75	3.13
48	603023	威帝股份	2,665,868.00	3.09
49	000547	航天发展	2,606,771.00	3.02
50	600519	贵州茅台	2,518,518.92	2.92
51	601118	海南橡胶	2,515,678.50	2.92
52	002138	顺络电子	2,507,351.00	2.91
53	300373	扬杰科技	2,506,382.99	2.91
54	002174	游族网络	2,504,120.00	2.90
55	600348	阳泉煤业	2,484,728.00	2.88
56	000801	四川九洲	2,479,834.96	2.87
57	600562	国睿科技	2,479,561.30	2.87
58	601699	潞安环能	2,473,150.01	2.87
59	300224	正海磁材	2,466,433.45	2.86
60	300068	南都电源	2,465,701.00	2.86
61	002407	多氟多	2,463,780.00	2.86
62	002460	赣锋锂业	2,462,988.00	2.86
63	300271	华宇软件	2,457,501.01	2.85
64	300451	创业软件	2,381,766.00	2.76
65	300024	机器人	2,345,429.00	2.72
66	000603	盛达矿业	2,335,650.00	2.71
67	002183	怡亚通	2,331,629.00	2.70

68	600884	杉杉股份	2,200,827.38	2.55
69	002074	国轩高科	2,187,409.96	2.54
70	601155	新城控股	2,177,104.00	2.52
71	002414	高德红外	2,174,576.01	2.52
72	600708	光明地产	2,151,888.00	2.49
73	600037	歌华有线	2,148,319.00	2.49
74	300199	翰宇药业	2,102,804.40	2.44
75	300144	宋城演艺	2,060,091.00	2.39
76	300296	利亚德	2,040,498.32	2.37
77	002311	海大集团	2,040,351.14	2.37
78	603019	中科曙光	2,000,414.00	2.32
79	000519	江南红箭	1,983,967.00	2.30
80	300229	拓尔思	1,976,025.30	2.29
81	603800	道森股份	1,965,554.00	2.28
82	600387	海越股份	1,960,274.99	2.27
83	600482	中国动力	1,894,197.50	2.20
84	000983	西山煤电	1,875,572.62	2.17
85	002065	东华软件	1,865,731.21	2.16
86	000959	首钢股份	1,856,209.00	2.15
87	000070	特发信息	1,854,088.96	2.15
88	000892	欢瑞世纪	1,853,870.00	2.15
89	600201	生物股份	1,852,626.00	2.15
90	600990	四创电子	1,850,834.00	2.15
91	000333	美的集团	1,849,071.00	2.14
92	000933	神火股份	1,845,400.86	2.14
93	000733	振华科技	1,840,389.00	2.13
94	002281	光迅科技	1,817,390.00	2.11
95	300150	世纪瑞尔	1,804,264.90	2.09
96	002049	紫光国芯	1,789,563.00	2.07
97	600739	辽宁成大	1,764,056.00	2.05
98	002123	荣信股份	1,759,762.00	2.04
99	300007	汉威电子	1,732,563.00	2.01

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	300496	中科创达	7,891,200.00	9.15
2	002007	华兰生物	7,080,644.12	8.21
3	002292	奥飞动漫	6,585,931.61	7.63
4	002439	启明星辰	5,578,263.24	6.47
5	300291	华录百纳	4,945,404.63	5.73
6	300315	掌趣科技	4,591,445.90	5.32
7	002458	益生股份	4,563,932.32	5.29
8	601088	中国神华	4,389,458.50	5.09
9	002701	奥瑞金	4,100,001.72	4.75
10	002073	软控股份	4,017,303.10	4.66
11	002468	艾迪西	4,015,803.57	4.66
12	300418	昆仑万维	3,832,285.08	4.44
13	300001	特锐德	3,819,601.00	4.43
14	300302	同有科技	3,726,201.00	4.32
15	002407	多氟多	3,707,528.59	4.30
16	300253	卫宁健康	3,602,689.00	4.18
17	002030	达安基因	3,588,868.14	4.16
18	002460	赣锋锂业	3,541,938.60	4.11
19	600718	东软集团	3,526,578.00	4.09
20	002400	省广股份	3,363,308.00	3.90
21	600028	中国石化	3,302,232.00	3.83
22	000687	华讯方舟	3,270,660.65	3.79
23	002074	国轩高科	3,260,265.50	3.78
24	002236	大华股份	3,232,356.77	3.75
25	300467	迅游科技	3,129,950.00	3.63
26	002590	万安科技	3,079,798.20	3.57
27	300017	网宿科技	3,078,494.00	3.57
28	000938	紫光股份	2,971,962.40	3.45
29	002285	世联行	2,959,512.26	3.43
30	300168	万达信息	2,933,640.93	3.40
31	600570	恒生电子	2,917,801.06	3.38
32	002123	荣信股份	2,873,728.44	3.33
33	300009	安科生物	2,869,917.00	3.33
34	603023	威帝股份	2,856,686.00	3.31
35	000876	新希望	2,843,561.10	3.30
36	000558	莱茵体育	2,825,840.62	3.28

37	300065	海兰信	2,808,207.06	3.26
38	300133	华策影视	2,790,331.60	3.23
39	300474	景嘉微	2,780,460.60	3.22
40	600661	新南洋	2,773,314.00	3.22
41	000547	航天发展	2,725,058.36	3.16
42	002138	顺络电子	2,618,315.35	3.04
43	002624	完美环球	2,604,493.00	3.02
44	600519	贵州茅台	2,600,625.00	3.01
45	300015	爱尔眼科	2,597,240.64	3.01
46	002174	游族网络	2,589,692.00	3.00
47	600074	保千里	2,576,578.20	2.99
48	300188	美亚柏科	2,512,110.94	2.91
49	300224	正海磁材	2,490,389.00	2.89
50	600804	鹏博士	2,486,005.54	2.88
51	002594	比亚迪	2,476,950.00	2.87
52	300271	华宇软件	2,460,628.86	2.85
53	002304	洋河股份	2,442,858.70	2.83
54	601118	海南橡胶	2,433,385.00	2.82
55	300068	南都电源	2,393,926.00	2.78
56	601699	潞安环能	2,375,355.00	2.75
57	300267	尔康制药	2,366,901.02	2.74
58	600535	天士力	2,356,438.00	2.73
59	600562	国睿科技	2,354,737.00	2.73
60	300336	新文化	2,345,224.00	2.72
61	002311	海大集团	2,325,922.00	2.70
62	600348	阳泉煤业	2,324,984.00	2.70
63	300373	扬杰科技	2,298,169.76	2.66
64	000068	*ST 华赛	2,254,265.78	2.61
65	000801	四川九洲	2,235,536.00	2.59
66	300368	汇金股份	2,208,688.42	2.56
67	600884	杉杉股份	2,184,406.80	2.53
68	002414	高德红外	2,176,315.62	2.52
69	000567	海德股份	2,147,882.46	2.49
70	600708	光明地产	2,143,384.78	2.48
71	300451	创业软件	2,112,089.00	2.45
72	601155	新城控股	2,101,867.50	2.44
73	000988	华工科技	2,092,365.93	2.43
74	000050	深天马 A	2,056,667.60	2.38

75	600387	海越股份	2,015,641.00	2.34
76	000519	江南红箭	2,014,387.70	2.34
77	600037	歌华有线	2,004,478.00	2.32
78	000603	盛达矿业	1,998,875.45	2.32
79	601800	中国交建	1,981,658.10	2.30
80	603598	引力传媒	1,972,523.61	2.29
81	300199	翰宇药业	1,945,441.00	2.26
82	300229	拓尔思	1,901,418.70	2.20
83	300207	欣旺达	1,890,819.88	2.19
84	002280	联络互动	1,870,964.54	2.17
85	300101	振芯科技	1,835,496.00	2.13
86	603019	中科曙光	1,796,426.00	2.08
87	300136	信维通信	1,746,230.03	2.02
88	000070	特发信息	1,731,617.29	2.01

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	465,805,105.95
卖出股票收入（成交）总额	419,179,433.88

注：本项 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所有资产支持证券投资明细

注：本基金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未超出基金合同规定的备选股票库。

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	38,731.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,134.68
5	应收申购款	1,498.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,364.84

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	300150	世纪瑞尔	1,647,000.00	1.48	重大资产重组

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
2,684	46,509.54	76,782,289.22	61.51%	48,049,319.16	38.49%

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	355.14	0.0003%

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（2014年5月27日）基金份额总额	351,679,073.44
本报告期期初基金份额总额	60,161,365.31
本报告期基金总申购份额	92,479,528.07
减：本报告期基金总赎回份额	27,809,285.00
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	124,831,608.38

§ 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同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，自2016年8月24日起，乔培涛同志兼任长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，自2016年2月17日起，田间同志不再担任长盛同鑫行业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

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，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 46,000.00 元，已连续提供审计服务 6 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	
光大证券	1	628,157,821.06	70.99%	585,005.68	72.06%	-
华泰联合	1	195,819,569.80	22.13%	182,366.56	22.46%	-
川财证券	1	60,831,842.72	6.88%	44,487.53	5.48%	-

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
光大证券	101.73	100.00%	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

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、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	川财证券	深圳	1

- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

11.8 其他重大事件

除上述事项外，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	长盛同鑫行业配置混合型证券投 资基金招募说明书（更新）摘要	《证券日报》及本公 司网站	2016年12月27日

2	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2016 年 12 月 27 日
3	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	同上	2016 年 12 月 22 日
4	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行基金交易优惠活动的公告	同上	2016 年 12 月 19 日
5	长盛基金管理有限公司关于子公司高管变更情况的公告	同上	2016 年 12 月 16 日
6	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	同上	2016 年 11 月 29 日
7	长盛基金管理有限公司关于在银河证券开通旗下部分开放式基金基金转换业务的公告	同上	2016 年 11 月 29 日
8	长盛基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 11 月 4 日
9	长盛基金管理有限公司关于开通通联支付业务的公告	同上	2016 年 10 月 27 日
10	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	同上	2016 年 10 月 24 日
11	长盛基金管理有限公司关于增加上海云湾投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率	同上	2016 年 9 月 21 日

	优惠活动的公告		
12	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	同上	2016 年 9 月 20 日
13	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加首创证券申购（含定投）费率优惠活动的公告	同上	2016 年 9 月 19 日
14	长盛基金管理有限公司关于增加新浪基金为旗下部分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 9 月 14 日
15	长盛基金管理有限公司关于增加凤凰金信为旗下部分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 9 月 14 日
16	长盛基金管理有限公司关于撤销郑州分公司的公告	同上	2016 年 9 月 10 日
17	长盛基金管理有限公司关于提醒广大投资者完善身份信息的公告	同上	2016 年 8 月 31 日
18	长盛基金管理有限公司关于调整长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理的公告	同上	2016 年 8 月 26 日
19	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要	同上	2016 年 8 月 25 日
20	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告	同上	2016 年 8 月 25 日
21	长盛基金管理有限公司关于增加	同上	2016 年 8 月 22 日

	中信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并开通基金定投及转换业务的公告		
22	长盛基金管理有限公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 8 月 19 日
23	长盛基金管理有限公司关于增加天天基金为旗下基金销售机构并推出定投及基金转换业务的公告	同上	2016 年 8 月 17 日
24	长盛基金管理有限公司关于旗下基金在同花顺开通转换业务的公告	同上	2016 年 8 月 17 日
25	长盛基金管理有限公司关于增加懒猫金服为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 8 月 10 日
26	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	同上	2016 年 7 月 20 日
27	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加和讯费率优惠活动的公告	同上	2016 年 7 月 18 日
28	长盛基金管理有限公司关于增加大智慧财富为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 7 月 14 日
29	长盛基金管理有限公司关于增加钱景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 7 月 6 日

30	长盛基金管理有限公司关于旗下基金在陆金所资管开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 7 月 1 日
31	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	同上	2016 年 6 月 22 日
32	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
33	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
34	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
35	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
36	长盛基金管理有限公司关于增加金斧子为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 6 月 3 日
37	长盛基金管理有限公司关于增加大泰金石为旗下基金销售机构并推出转换业务及参加费率优惠活	同上	2016 年 5 月 25 日

	动的公告		
38	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
39	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
40	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
41	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
42	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
43	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	同上	2016 年 4 月 22 日
44	长盛基金管理有限公司关于增加中国农业银行为长盛新兴成长主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构以及开通定投 转换业务并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2016 年 4 月 14 日

45	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
46	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
47	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2015 年度报告摘要	同上	2016 年 3 月 26 日
48	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2015 年度报告	同上	2016 年 3 月 26 日
49	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
50	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
51	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
52	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
53	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
54	长盛基金管理有限公司关于增加	同上	2016 年 3 月 17 日

	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		
55	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
56	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
57	长盛基金管理有限公司关于调整长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理的公告	同上	2016年2月19日
58	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
59	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
60	关于增加恒宇天泽为旗下部分基金销售机构并开通定投及转换业务的公告	同上	2016年1月21日
61	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
62	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	同上	2016年1月20日
63	长盛新兴成长主题灵活配置混合	同上	2016年1月8日

	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		
64	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
65	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
66	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
67	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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2017年3月27日