

# 长盛成长价值证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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.....	11
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.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48

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	49
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	49
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
8.12	投资组合报告附注	49
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>50</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>51</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>51</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	51
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	51
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
11.4	基金投资策略的改变	51
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	52
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
11.8	其他重大事件	54
<b>§12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>59</b>
12.1	备查文件目录	59
12.2	存放地点	59
12.3	查阅方式	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛成长价值证券投资基金
基金简称	长盛成长价值
基金主代码	080001
交易代码	080001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002 年 9 月 18 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	610,767,505.40 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为平衡型基金，通过管理人的积极管理，在控制风险的前提下挖掘价值、分享成长，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略为主动性投资，在战略性资产、战术性资产、股票和债券选择三个层面进行积极配置，力争获得超过投资基准的业绩回报。在资产配置方面，股票资产比例为 35%-75%，债券资产比例为 20%-60%，现金资产比例不低于 5%。
业绩比较基准	标普中国 A 股综合指数收益率×80%+中证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属平衡型基金，在承担适度风险的前提下，获得长期稳定的收益。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	林葛
	联系电话	010-82019988	010-66060069
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-62350088	95599
传真		010-82255988	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京西城区复兴门内大街 28 号 凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		100088	100031
法定代表人		高新	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## 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
本期已实现收益	64,109,751.71	687,386,546.96	89,948,536.51
本期利润	-24,665,605.99	522,010,944.26	318,411,751.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0518	1.1512	0.3361
本期加权平均净值利润率	-4.46%	73.93%	32.18%
本期基金份额净值增长率	-8.29%	51.37%	32.43%
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	18,528,916.58	182,278,549.67	248,377,512.77
期末可供分配基金份额利润	0.0303	0.8013	0.2167
期末基金资产净值	629,296,421.98	409,764,348.88	1,394,341,528.61
期末基金份额净值	1.030	1.801	1.217
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	618.59%	683.55%	417.65%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

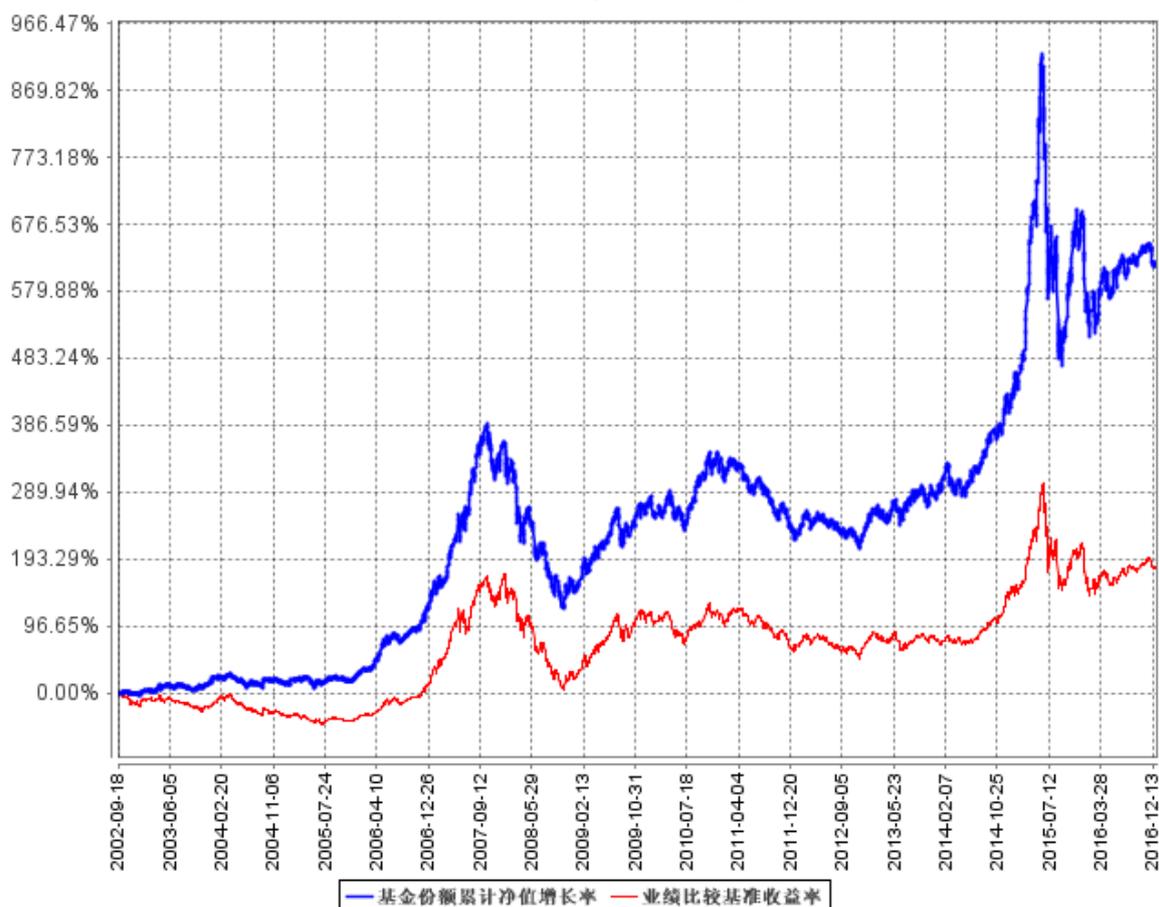
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.68%	0.57%	1.14%	0.59%	-1.82%	-0.02%
过去六个月	0.29%	0.61%	4.50%	0.64%	-4.21%	-0.03%
过去一年	-8.29%	1.27%	-8.78%	1.29%	0.49%	-0.02%
过去三年	83.83%	1.56%	58.34%	1.47%	25.49%	0.09%
过去五年	113.31%	1.35%	71.44%	1.33%	41.87%	0.02%
自基金合同生效起至今	618.59%	1.29%	181.23%	1.44%	437.36%	-0.15%

注：鉴于标普道琼斯指数有限公司已于 2015 年 11 月 2 日将“中信标普 A 股综合指数”名称变更为“标普中国 A 股综合指数”，指数编制方法、计算发布时间、指数历史均无变化，指数点位也将延续之前历史。自 2016 年 3 月 5 日起，本基金的业绩比较基准由原约定的“中信标普 A 股综合指数收益率×80%+中证国债指数收益率×20%”变更为：“标普中国 A 股综合指数收益率×80%+中证国债指数收益率×20%”。详见基金管理人 2016 年 3 月 5 日的《关于长盛成长价值证券投资基金业绩比较基准变更的公告》

- 1、公允性。选择市场认同度比较高的中信标普 A 股综合指数和中证国债指数作为计算的基础指数。中信标普 A 股综合指数作为按流通股本加权的综合指数，其指数选股样本覆盖了上交所和深交所上市的所有 A 股，具有较强的指代作用。
- 2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金持有的股票资产比例为 35%-75%，债券资产比例为 20%-60%，现金资产比例不低于 5%。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。
- 3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 80%、20%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。

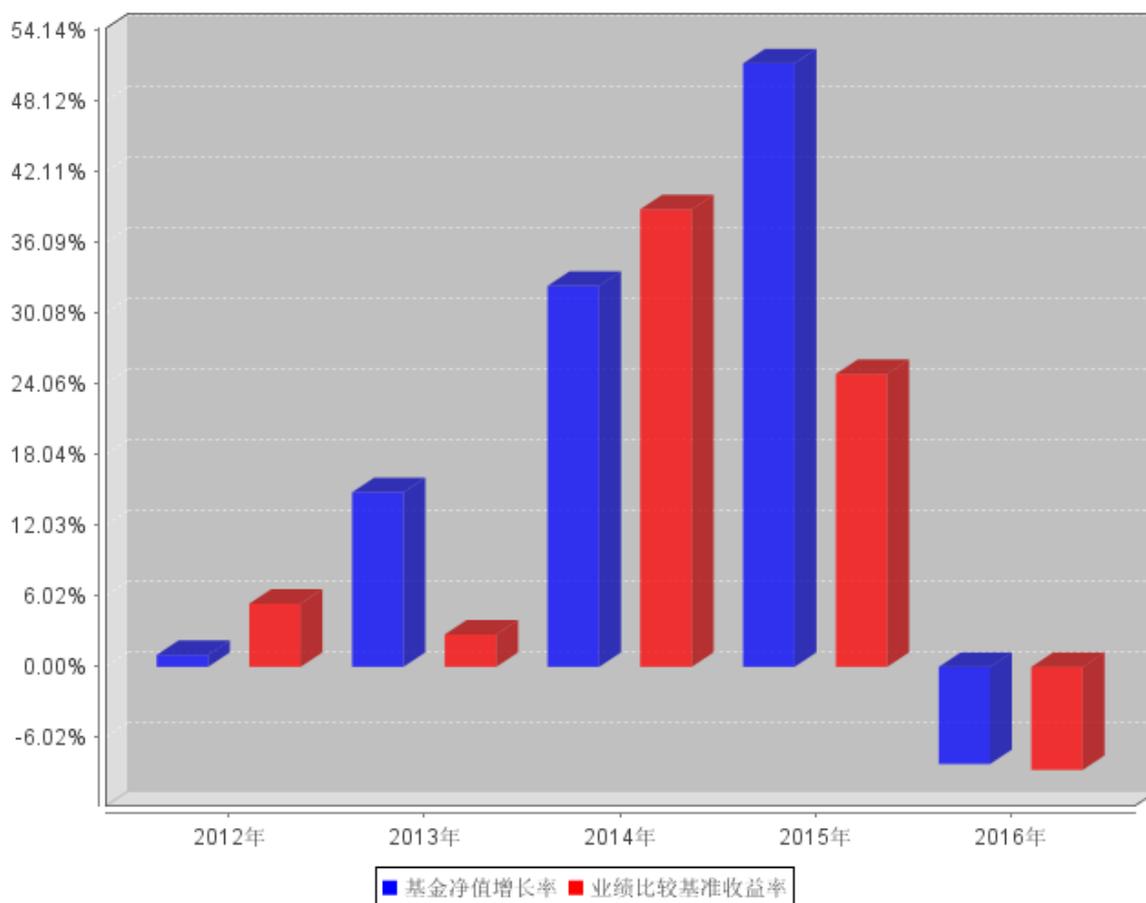
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 3.2.3 过去五年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

过去五年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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	6.160	749,913,801.04	53,011,482.82	802,925,283.86	
2015	0.280	20,260,442.05	8,189,982.11	28,450,424.16	
2014	-	-	-	-	
合计	6.440	770,174,243.09	61,201,464.93	831,375,708.02	

## § 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		
冯雨生	本基金基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资	2015 年 6 月 18 日	-	9 年	冯雨生先生，1983 年 11 月出生。北京大学金融学硕士，CFA（特许金融分析师）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。

	基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，量化投资部负责人。				
--	--	--	--	--	--

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 年股票市场整体大幅下跌，水利水电建设、环保和国企混改板块大幅上涨，网络安全、动漫和大数据概念板块跌幅较大。行业上，计算机、国防军工和传媒等行业跌幅靠前，食品饮料、银行和家电跑赢市场。风格上，2016 年大盘价值股跑赢小盘成长股。

组合操作上，2016 年主要配置在估值比较合理的成长股。减持了部分业绩不到预期的个股，并增配了处于行业景气周期的个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.030 元，本报告期份额净值增长率为-8.29%，同期业绩比较基准增长率为-8.78%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年经济环境和政策环境将以稳为主，宽松的货币供给有利于提升整体估值，IPO 的监管放松会让投资者更加看重上市公司的基本面价值。我们维持之前的看法，认为股市行情的主基调是震荡，相对低估的股票会获得阶段性超额收益，高估值个股全年的下行压力会增大。2017 年选股会兼顾估值和成长性，利用量化的方法精选个股。

#### 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》的规定以及本基金基金合同第二十条中对基金利润分配

原则的约定，本基金分别于 2016 年 1 月 15 日、2016 年 6 月 29 日进行了利润分配，分配总金额为 802,925,283.86 元。

本基金截至 2016 年 12 月 31 日期末可供分配利润为 18,528,916.58 元，其中：未分配利润已实现部分为 777,474,822.01 元，未分配利润未实现部分为-758,945,905.43 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

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长盛基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 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)第 20948 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	长盛成长价值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成长价值证券投资基金(以下简称“长盛成长价值基金”)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	<p>编制和公允列报财务报表是长盛成长价值基金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:</p> <p>(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;</p> <p>(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。</p>	
注册会计师的责任段	<p>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> <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	我们认为,上述长盛成长价值基金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,公允反映了长盛成长价值基金 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。	
注册会计师的姓名	陈玲	张振波
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·上海市	
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：长盛成长价值证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	39,526,411.08	23,229,869.83
结算备付金		515,375.65	36,740.29
存出保证金		212,385.44	220,284.79
交易性金融资产	7.4.7.2	587,757,320.70	385,746,495.14
其中：股票投资		444,992,500.70	296,950,965.14
基金投资		-	-
债券投资		142,764,820.00	88,795,530.00
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,322,791.08	2,370,607.09
应收股利		-	-
应收申购款		7,412.85	100,995.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		631,341,696.80	411,704,993.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		275,787.70	693,584.56
应付管理人报酬		860,862.03	522,193.63
应付托管费		143,477.00	87,032.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	206,965.52	73,076.52
应交税费		2,600.00	2,600.00

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	555,582.57	562,157.21
负债合计		2,045,274.82	1,940,644.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	610,767,505.40	227,485,799.21
未分配利润	7.4.7.10	18,528,916.58	182,278,549.67
所有者权益合计		629,296,421.98	409,764,348.88
负债和所有者权益总计		631,341,696.80	411,704,993.10

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值：1.030 元，基金份额总额：610,767,505.40 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛成长价值证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		-13,457,974.04	537,687,192.94
1. 利息收入		4,909,856.26	7,434,848.71
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,279,461.35	809,049.35
债券利息收入		3,630,394.91	6,625,799.36
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）		69,083,376.00	693,308,425.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	65,817,871.13	690,339,841.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-850,777.10	292,618.90
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	4,116,281.97	2,675,964.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-88,775,357.70	-165,375,602.70
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	1,324,151.40	2,319,521.55
<b>减：二、费用</b>		11,207,631.95	15,676,248.68
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,200,218.49	10,671,835.20

2. 托管费	7.4.10.2.2	1,366,703.10	1,778,639.23
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,262,501.23	2,842,658.89
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	378,209.13	383,115.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-24,665,605.99	522,010,944.26
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-24,665,605.99	522,010,944.26

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛成长价值证券投资基金

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）	227,485,799.21	182,278,549.67	409,764,348.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-24,665,605.99	-24,665,605.99
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）	383,281,706.19	663,841,256.76	1,047,122,962.95
其中：1. 基金申购款	1,401,084,947.60	705,351,378.39	2,106,436,325.99
2. 基金赎回款	-1,017,803,241.41	-41,510,121.63	-1,059,313,363.04
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）	-	-802,925,283.86	-802,925,283.86
五、期末所有者权益（基金净值）	610,767,505.40	18,528,916.58	629,296,421.98
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）	1,145,964,015.84	248,377,512.77	1,394,341,528.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	522,010,944.26	522,010,944.26
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）	-918,478,216.63	-559,659,483.20	-1,478,137,699.83
其中：1. 基金申购款	214,783,495.07	162,657,289.44	377,440,784.51
2. 基金赎回款	-1,133,261,711.70	-722,316,772.64	-1,855,578,484.34
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）	-	-28,450,424.16	-28,450,424.16
五、期末所有者权益（基金净值）	227,485,799.21	182,278,549.67	409,764,348.88

注：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：

<u>周兵</u>	<u>杨思乐</u>	<u>龚珉</u>
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

长盛成长价值证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2002]第 57 号《关于同意长盛成长价值证券投资基金设立的批复》核准，由长盛基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《长盛成长价值证券投资基金基金契约》（后更名为《长盛成长价值证券投资基金基金合同》）发起，并于 2002 年 9 月 18 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,166,886,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第 95 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛成长价值证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在股票资产中，本基金投资于成长类股票和价值类股票。本基金投资组合中股票资产比例为 35%-75%，债券资产比例为 20%-60%，现金资产比例不低于 5%。本基金持有的成长类股票和价值类股票资产的比例均不低于股票资产的 30%，不高于股票资产的 70%；投资于国

家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%；在交易日买入权证的总金额不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：标普 A 股综合指数收益率×80%+中证国债指数收益率×20%。

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》、《长盛成长价值证券投资基金 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) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 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

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

所得税。

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

## 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	39,526,411.08	23,229,869.83
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	39,526,411.08	23,229,869.83

### 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	423,767,223.02	444,992,500.70	21,225,277.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	12,778,870.70	12,587,820.00
	银行间市场	130,266,189.09	130,177,000.00
	合计	143,045,059.79	142,764,820.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	566,812,282.81	587,757,320.70	20,945,037.89
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	187,895,117.46	296,950,965.14	109,055,847.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,612,391.00	7,733,530.00
	银行间市场	80,518,591.09	81,062,000.00
	合计	88,130,982.09	88,795,530.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	276,026,099.55	385,746,495.14	109,720,395.59

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：本基金本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	17,749.63	9,745.22
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	232.00	16.50
应收债券利息	3,304,713.82	2,360,746.16
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.03	0.11
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	95.60	99.10
合计	3,322,791.08	2,370,607.09

**7.4.7.6 其他资产**

注：本基金本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	206,515.52	72,601.52
银行间市场应付交易费用	450.00	475.00
合计	206,965.52	73,076.52

**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
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	1,039.32	2,613.96
预提费用	260,000.00	265,000.00
证管费退还	44,543.25	44,543.25
合计	555,582.57	562,157.21

### 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	227,485,799.21	227,485,799.21
本期申购	1,401,084,947.60	1,401,084,947.60
本期赎回（以“-”号填列）	-1,017,803,241.41	-1,017,803,241.41
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	610,767,505.40	610,767,505.40

注：申购含红利再投、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	389,867,480.11	-207,588,930.44	182,278,549.67
本期利润	64,109,751.71	-88,775,357.70	-24,665,605.99
本期基金份额交易产生的变动数	1,126,422,874.05	-462,581,617.29	663,841,256.76
其中：基金申购款	2,383,343,611.62	-1,677,992,233.23	705,351,378.39
基金赎回款	-1,256,920,737.57	1,215,410,615.94	-41,510,121.63
本期已分配利润	-802,925,283.86	-	-802,925,283.86
本期末	777,474,822.01	-758,945,905.43	18,528,916.58

### 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	1,233,301.12
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	6,702.54	2,624.54
其他	39,457.69	4,686.60
合计	1,279,461.35	809,049.35

### 7.4.7.12 股票投资收益

#### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
卖出股票成交总额	358,799,961.14	1,368,569,948.53
减：卖出股票成本总额	292,982,090.01	678,230,106.82
买卖股票差价收入	65,817,871.13	690,339,841.71

#### 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	-850,777.10	292,618.90
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	-850,777.10	292,618.90

##### 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	157,727,557.73	333,479,642.25
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	153,823,405.00	320,605,681.10
减：应收利息总额	4,754,929.83	12,581,342.25
买卖债券差价收入	-850,777.10	292,618.90

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本期及上年度可比期间未取得衍生工具收益。

#### 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	4,116,281.97	2,675,964.77
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,116,281.97	2,675,964.77

**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	-88,775,357.70	-165,375,602.70
——股票投资	-87,830,570.00	-165,263,332.80
——债券投资	-944,787.70	-112,269.90
——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	-88,775,357.70	-165,375,602.70

**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	955,052.14	1,831,006.29
基金转换费收入	369,099.26	488,515.26
合计	1,324,151.40	2,319,521.55

注：1. 本基金的赎回费率为赎回金额的 0.5%，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	1,260,401.23	2,839,851.22
银行间市场交易费用	2,100.00	2,807.67
合计	1,262,501.23	2,842,658.89

**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
----	---------------------------------	--------------------------------------

审计费用	80,000.00	85,000.00
信息披露费	270,000.00	270,000.00
帐户维护费	22,500.00	13,500.00
银行费用	5,709.13	14,615.36
合计	378,209.13	383,115.36

## 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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年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	8,200,218.49	10,671,835.20
其中：支付销售机构的客户维护费	1,458,539.02	1,214,327.03

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 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% ÷ 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年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	1,366,703.10	1,778,639.23

注：支付基金托管人中国农业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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金合同生效日（2002年	-	-

9 月 18 日 ) 持有的基金份额		
期初持有的基金份额	-	14,109,387.26
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减: 期间赎回/卖出总份额	-	14,109,387.26
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注: 基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注: 本基金本期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	39,526,411.08	1,233,301.12	23,229,869.83	801,738.21

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管, 按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期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

金额单位: 人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年 6 月 29 日	-	2016 年 6 月 29 日	5.560	741,236,107.68	48,043,842.84	789,279,950.52	
2	2016 年 1 月 15 日	-	2016 年 1 月 15 日	0.600	8,677,693.36	4,967,639.98	13,645,333.34	

合计	-	-	6.160	749,913,801.04	53,011,482.82	802,925,283.86	
----	---	---	-------	----------------	---------------	----------------	--

#### 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
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	-
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	2,597	60,146.52	60,146.52	-
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	2016年	2017年	新股流	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-

	新材	12月26日	1月4日	通受限						
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	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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
002635	安洁科技	2016年11月8日	重大事项停牌	33.74	2017年2月8日	33.50	235,171	7,355,297.83	7,934,669.54	-
300150	世纪瑞尔	2016年11月8日	重大事项停牌	9.15	2017年3月21日	10.97	778,684	8,056,733.21	7,124,958.60	-
002165	红宝丽	2016年10月10日	重大事项停牌	8.88	2017年1月5日	9.43	456,500	4,143,608.99	4,053,720.00	-
002396	星网锐捷	2016年9月12日	重大事项停牌	18.27	2017年2月21日	18.35	209,200	4,148,149.02	3,822,084.00	-
600151	航天机电	2016年11月11日	重大事项停牌	10.04	-	-	368,300	4,154,398.72	3,697,732.00	-
600406	国电南瑞	2016年12月29日	重大事项停牌	16.63	-	-	215,800	3,423,128.00	3,588,754.00	-

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

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

### 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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可

能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2015 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	79,955,000.00	-
合计	79,955,000.00	-

注：未评级部分为政策性金融债。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	62,809,820.00	-
合计	62,809,820.00	-

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

#### 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公司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、结算备付金和债券投资等。

##### 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	39,526,411.08	-	-	-	39,526,411.08
结算备付金	515,375.65	-	-	-	515,375.65
存出保证金	212,385.44	-	-	-	212,385.44
交易性金融资产	79,955,000.00	59,052,840.00	3,756,980.00	444,992,500.70	587,757,320.70
应收利息	-	-	-	3,322,791.08	3,322,791.08
应收申购款	-	-	-	7,412.85	7,412.85
资产总计	120,209,172.17	59,052,840.00	3,756,980.00	448,322,704.63	631,341,696.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	275,787.70	275,787.70
应付管理人报酬	-	-	-	860,862.03	860,862.03
应付托管费	-	-	-	143,477.00	143,477.00
应付交易费用	-	-	-	206,965.52	206,965.52
应交税费	-	-	-	2,600.00	2,600.00
其他负债	-	-	-	555,582.57	555,582.57
负债总计	-	-	-	2,045,274.82	2,045,274.82
利率敏感度缺口	120,209,172.17	59,052,840.00	3,756,980.00	446,277,429.81	629,296,421.98
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	23,229,869.83	-	-	-	23,229,869.83
结算备付金	36,740.29	-	-	-	36,740.29
存出保证金	220,284.79	-	-	-	220,284.79
交易性金融资产	72,776,650.00	10,989,980.00	5,028,900.00	296,950,965.14	385,746,495.14
应收利息	-	-	-	2,370,607.09	2,370,607.09
应收申购款	-	-	-	100,995.96	100,995.96
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	96,263,544.91	10,989,980.00	5,028,900.00	299,422,568.19	411,704,993.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	693,584.56	693,584.56
应付管理人报酬	-	-	-	522,193.63	522,193.63
应付托管费	-	-	-	87,032.30	87,032.30
应付交易费用	-	-	-	73,076.52	73,076.52
应交税费	-	-	-	2,600.00	2,600.00
其他负债	-	-	-	562,157.21	562,157.21
负债总计	-	-	-	1,940,644.22	1,940,644.22
利率敏感度缺口	96,263,544.91	10,989,980.00	5,028,900.00	297,481,923.97	409,764,348.88

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

假设	除市场利率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）
	市场利率下降 25 个基点	375,899.77	212,665.81
市场利率上升 25 个基点	-375,899.77	-212,665.81	

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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产比例为基金总资产的 35%-75%，债券资产比例为 20%-60%。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	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日		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	444,992,500.70	70.71	296,950,965.14	72.47
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	444,992,500.70	70.71	296,950,965.14	72.47

#### 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. 业绩比较基准上升 5%	30,287,263.76	20,192,572.47
2. 业绩比较基准下降 5%	-30,287,263.76	-20,192,572.47	

#### 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 414,339,520.75 元，第二层次 173,417,799.95 元，无属于第三层次的余额 (2015 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 255,427,432.52 元，第二层次 130,319,062.62 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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	444,992,500.70	70.48
	其中：股票	444,992,500.70	70.48
2	固定收益投资	142,764,820.00	22.61
	其中：债券	142,764,820.00	22.61
	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	40,041,786.73	6.34
7	其他各项资产	3,542,589.37	0.56
8	合计	631,341,696.80	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	9,987,177.20	1.59
B	采矿业	-	-
C	制造业	291,141,257.29	46.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,332,665.70	0.69
E	建筑业	5,778,242.55	0.92
F	批发和零售业	8,069,415.12	1.28
G	交通运输、仓储和邮政业	7,919,192.20	1.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,035,806.93	4.46
J	金融业	56,835,539.57	9.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,900,478.50	1.10
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,008,000.00	1.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	9,870,465.00	1.57
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	9,114,260.64	1.45
S	综合	-	-
	合计	444,992,500.70	70.71

### 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	002580	圣阳股份	792,155	14,187,496.05	2.25

2	300182	捷成股份	1, 226, 463	12, 644, 833. 53	2. 01
3	002138	顺络电子	692, 295	11, 983, 626. 45	1. 90
4	300115	长盈精密	448, 703	11, 693, 200. 18	1. 86
5	300232	洲明科技	782, 920	11, 681, 166. 40	1. 86
6	300303	聚飞光电	1, 238, 519	10, 923, 737. 58	1. 74
7	600276	恒瑞医药	223, 482	10, 168, 431. 00	1. 62
8	600108	亚盛集团	1, 746, 010	9, 987, 177. 20	1. 59
9	000001	平安银行	1, 093, 268	9, 948, 738. 80	1. 58
10	603377	东方时尚	244, 500	9, 870, 465. 00	1. 57
11	601939	建设银行	1, 807, 233	9, 831, 347. 52	1. 56
12	600690	青岛海尔	991, 319	9, 794, 231. 72	1. 56
13	600015	华夏银行	896, 558	9, 727, 654. 30	1. 55
14	600000	浦发银行	599, 011	9, 709, 968. 31	1. 54
15	600036	招商银行	547, 611	9, 637, 953. 60	1. 53
16	300144	宋城演艺	435, 256	9, 114, 260. 64	1. 45
17	300255	常山药业	1, 137, 753	8, 988, 248. 70	1. 43
18	300018	中元华电	725, 352	8, 544, 646. 56	1. 36
19	600893	中航动力	259, 941	8, 510, 468. 34	1. 35
20	000768	中航飞机	400, 043	8, 504, 914. 18	1. 35
21	002449	国星光电	629, 352	8, 357, 794. 56	1. 33
22	600741	华域汽车	515, 512	8, 222, 416. 40	1. 31
23	600858	银座股份	862, 117	8, 069, 415. 12	1. 28
24	002635	安洁科技	235, 171	7, 934, 669. 54	1. 26
25	601006	大秦铁路	1, 117, 194	7, 909, 733. 52	1. 26
26	601988	中国银行	2, 288, 691	7, 873, 097. 04	1. 25
27	002056	横店东磁	528, 476	7, 351, 101. 16	1. 17
28	300150	世纪瑞尔	778, 684	7, 124, 958. 60	1. 13
29	300070	碧水源	400, 000	7, 008, 000. 00	1. 11
30	300351	永贵电器	269, 429	6, 916, 242. 43	1. 10
31	002188	巴士在线	235, 110	6, 900, 478. 50	1. 10
32	300165	天瑞仪器	664, 176	6, 641, 760. 00	1. 06
33	002643	万润股份	178, 179	6, 467, 897. 70	1. 03
34	000733	振华科技	349, 408	6, 236, 932. 80	0. 99
35	600183	生益科技	547, 600	6, 023, 600. 00	0. 96
36	000400	许继电气	328, 500	5, 962, 275. 00	0. 95
37	000836	鑫茂科技	811, 677	5, 811, 607. 32	0. 92
38	601390	中国中铁	650, 412	5, 762, 650. 32	0. 92
39	600584	长电科技	326, 477	5, 762, 319. 05	0. 92
40	000880	潍柴重机	402, 041	5, 632, 594. 41	0. 90

41	000625	长安汽车	373,800	5,584,572.00	0.89
42	601766	中国中车	568,894	5,558,094.38	0.88
43	002662	京威股份	335,050	5,511,572.50	0.88
44	002372	伟星新材	348,799	5,381,968.57	0.86
45	300045	华力创通	393,202	5,217,790.54	0.83
46	002475	立讯精密	249,013	5,167,019.75	0.82
47	000786	北新建材	492,898	5,071,920.42	0.81
48	002595	豪迈科技	240,263	5,057,536.15	0.80
49	600487	亨通光电	265,800	4,959,828.00	0.79
50	000848	承德露露	437,598	4,896,721.62	0.78
51	300290	荣科科技	318,190	4,435,568.60	0.70
52	600027	华电国际	875,286	4,332,665.70	0.69
53	002085	万丰奥威	213,037	4,209,611.12	0.67
54	002165	红宝丽	456,500	4,053,720.00	0.64
55	002383	合众思壮	78,352	3,878,424.00	0.62
56	300196	长海股份	102,100	3,841,002.00	0.61
57	002396	星网锐捷	209,200	3,822,084.00	0.61
58	002450	康得新	200,000	3,822,000.00	0.61
59	600151	航天机电	368,300	3,697,732.00	0.59
60	600406	国电南瑞	215,800	3,588,754.00	0.57
61	002080	中材科技	175,001	3,066,017.52	0.49
62	600585	海螺水泥	166,700	2,827,232.00	0.45
63	600699	均胜电子	66,900	2,213,721.00	0.35
64	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.04
65	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.02
66	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.02
67	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.01
68	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.01
69	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.01
70	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
71	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
72	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.01
73	603228	景旺电子	2,597	60,146.52	0.01
74	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.01
75	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.01
76	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.01
77	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.01
78	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
79	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00

80	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
81	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
82	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
83	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
84	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
85	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
86	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
87	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
88	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
89	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
90	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
91	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

## 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	300144	宋城演艺	12,868,637.95	3.14
2	603377	东方时尚	10,671,315.00	2.60
3	601688	华泰证券	9,852,062.11	2.40
4	000880	潍柴重机	9,773,202.49	2.39
5	600741	华域汽车	9,743,311.93	2.38
6	002056	横店东磁	9,697,337.90	2.37
7	600036	招商银行	9,693,681.63	2.37
8	600108	亚盛集团	9,613,020.37	2.35
9	300182	捷成股份	9,343,682.49	2.28
10	000001	平安银行	9,329,205.73	2.28
11	002580	圣阳股份	9,326,689.04	2.28
12	300232	洲明科技	9,276,158.27	2.26
13	600858	银座股份	9,256,427.32	2.26
14	300018	中元华电	9,226,774.75	2.25
15	600893	中航动力	9,146,849.12	2.23
16	601939	建设银行	9,037,012.00	2.21
17	601766	中国中车	9,036,229.75	2.21
18	601390	中国中铁	9,002,292.99	2.20
19	600015	华夏银行	8,958,872.49	2.19

20	601186	中国铁建	8,942,648.02	2.18
21	300255	常山药业	8,936,542.26	2.18
22	601006	大秦铁路	8,874,235.50	2.17
23	600000	浦发银行	8,807,577.73	2.15
24	000768	中航飞机	8,787,723.24	2.14
25	300165	天瑞仪器	8,769,003.59	2.14
26	002085	万丰奥威	8,759,695.19	2.14
27	002643	万润股份	8,626,143.89	2.11
28	600690	青岛海尔	8,501,559.91	2.07
29	300115	长盈精密	8,477,313.62	2.07
30	600276	恒瑞医药	8,454,858.95	2.06
31	000625	长安汽车	8,452,868.15	2.06
32	601988	中国银行	8,404,773.00	2.05
33	300150	世纪瑞尔	8,350,710.39	2.04
34	002449	国星光电	8,305,815.87	2.03
35	002138	顺络电子	8,225,106.04	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	300081	恒信移动	19,071,394.34	4.65
2	000733	振华科技	18,563,216.64	4.53
3	300155	安居宝	14,703,923.99	3.59
4	601186	中国铁建	14,465,493.83	3.53
5	601688	华泰证券	13,303,175.72	3.25
6	002241	歌尔声学	11,025,262.84	2.69
7	002138	顺络电子	10,977,964.56	2.68
8	300182	捷成股份	10,945,409.16	2.67
9	002063	远光软件	10,550,777.32	2.57
10	300115	长盈精密	9,974,435.45	2.43
11	300303	聚飞光电	9,695,726.80	2.37
12	000880	潍柴重机	8,715,997.84	2.13
13	002085	万丰奥威	8,483,721.36	2.07
14	002580	圣阳股份	8,405,676.58	2.05
15	601766	中国中车	8,225,176.00	2.01
16	300232	洲明科技	7,932,047.19	1.94

17	601390	中国中铁	7,826,425.51	1.91
18	600584	长电科技	7,671,917.55	1.87
19	600741	华域汽车	6,848,587.40	1.67
20	002056	横店东磁	6,836,317.20	1.67

#### 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	528,854,195.57
卖出股票收入（成交）总额	358,799,961.14

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	12,587,820.00	2.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	130,177,000.00	20.69
	其中：政策性金融债	130,177,000.00	20.69
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	142,764,820.00	22.69

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	160204	16 国开 04	500,000	49,985,000.00	7.94
2	160209	16 国开 09	300,000	29,970,000.00	4.76
3	150207	15 国开 07	200,000	20,182,000.00	3.21
4	160208	16 国开 08	200,000	19,672,000.00	3.13
5	140418	14 农发 18	100,000	10,368,000.00	1.65

#### 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**

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	212,385.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,322,791.08

5	应收申购款	7,412.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,542,589.37

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与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
28,168	21,683.03	330,879,551.66	54.17%	279,887,953.74	45.83%

### 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	154,686.59	0.0253%

### 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	0~10
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（2002年9月18日）基金份额总额	3,166,886,000.00
本报告期期初基金份额总额	227,485,799.21
本报告期基金总申购份额	1,401,084,947.60
减：本报告期基金总赎回份额	1,017,803,241.41
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	610,767,505.40

## § 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 基金经理的变动情况

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

本报告期本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为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 80,000.00 元，已连续为本

基金提供审计服务 12 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	
银河证券	1	439,632,186.75	49.74%	409,431.12	49.74%	-
上海证券	1	319,133,979.20	36.10%	297,210.68	36.10%	-
中信建投	1	125,141,593.69	14.16%	116,544.87	14.16%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	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
银河证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	8,375,770.60	100.00%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

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：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	华泰证券	深圳	1
2	民生证券	上海	1
3	中信证券	上海	1

## 11.8 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事件如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于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	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》及本公司网站	2016年12月22日
2	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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	长盛成长价值证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2016年10月26日
9	长盛成长价值证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2016年10月26日
10	长盛成长价值证券投资基金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优惠活动的公告	同上	2016年9月21日
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	同上	2016年9月19日

	购（含定投）费率优惠活动的公告		
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公告	同上	2016年8月31日
18	长盛成长价值证券投资基金2016年半年度报告摘要	同上	2016年8月25日
19	长盛成长价值证券投资基金2016年半年度报告	同上	2016年8月25日
20	长盛基金管理有限公司关于增加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	同上	2016年8月22日
21	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
22	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
23	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
24	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
25	长盛成长价值证券投资基金2016年第2季度报告	同上	2016年7月20日
26	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
27	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

28	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
29	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加星展银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2016年7月1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	长盛成长价值证券投资基金收益分配公告	同上	2016年6月28日
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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
37	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
38	长盛基金管理有限公司关于增加中证金牛为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016年5月27日
39	长盛基金管理有限公司关于增加大泰金石为旗下基金销售机构并推出转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016年5月25日

40	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
41	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 12 日
42	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
43	长盛成长价值证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2016 年 4 月 30 日
44	长盛成长价值证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2016 年 4 月 30 日
45	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
46	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
47	长盛成长价值证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	同上	2016 年 4 月 22 日
48	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
49	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
50	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
51	长盛成长价值证券投资基金 2015 年度报告摘要	同上	2016 年 3 月 26 日
52	长盛成长价值证券投资基金 2015 年度报告	同上	2016 年 3 月 26 日
53	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	同上	2016 年 3 月 25 日

	投业务的公告		
54	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
55	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
56	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
57	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
58	长盛基金管理有限公司关于增加君德汇富为旗下部分基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 3 月 17 日
59	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
60	关于长盛成长价值证券投资基金业绩比较基准变更的公告	同上	2016 年 3 月 5 日
61	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
62	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
63	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
64	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
65	长盛成长价值证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	同上	2016 年 1 月 20 日
66	关于旗下部分开放式基金参加包商银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2016 年 1 月 20 日
67	长盛成长价值证券投资基金收益分配公告	同上	2016 年 1 月 13 日

68	长盛新兴成长主题灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购赎回 转换及定期定额投资业务的公告	同上	2016 年 1 月 8 日
69	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
70	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
71	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
72	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、《长盛成长价值证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛成长价值证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛成长价值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和/或基金托管人的办公地址。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所/或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