

# 长盛盛辉混合型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，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 8 月 16 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长盛盛辉混合	
基金主代码	003169	
交易代码	003169	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 8 月 16 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	800,580,816.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛盛辉混合 A	长盛盛辉混合 C
下属分级基金的交易代码:	003169	003170
报告期末下属分级基金的份额总额	800,474,675.33 份	106,141.30 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在有效控制风险的前提下力争满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	<p>(一) 大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑：(1) 宏观经济指标；(2) 微观经济指标；(3) 市场指标；(4) 政策因素。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>在新股投资方面，本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面，运用基金管理人的研究平台和股票估值体系，深入发掘新股内在价值，结合市场估值水平和股市投资环境，充分考虑中签率、锁定期等因素，有效识别并防范风险，以获取较好收益。</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p>
业绩比较基准	50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债指数收益率
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
	联系电话	010-82019988
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666、010-62350088	95566

传真	010-82255988	010-66594942
----	--------------	--------------

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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及基金托管人住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年 8 月 16 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	长盛盛辉混合 A	长盛盛辉混合 C
本期已实现收益	4,501,647.06	907.92
本期利润	2,405,372.55	557.16
加权平均基金份额本期利润	0.0031	0.0033
本期基金份额净值增长率	0.30%	0.25%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0030	0.0025
期末基金资产净值	802,839,796.72	106,409.81
期末基金份额净值	1.0030	1.0025

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

长盛盛辉混合 A

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	0.26%	0.05%	0.19%	0.38%	0.07%	-0.33%
自基金合同生效起至今	0.30%	0.05%	-1.70%	0.35%	2.00%	-0.30%

长盛盛辉混合 C

阶段	份额净值增	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	------	------	--------	-----	-----

	长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	0.20%	0.05%	0.19%	0.38%	0.01%	-0.33%
自基金合同生效起至今	0.25%	0.05%	-1.70%	0.35%	1.95%	-0.30%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

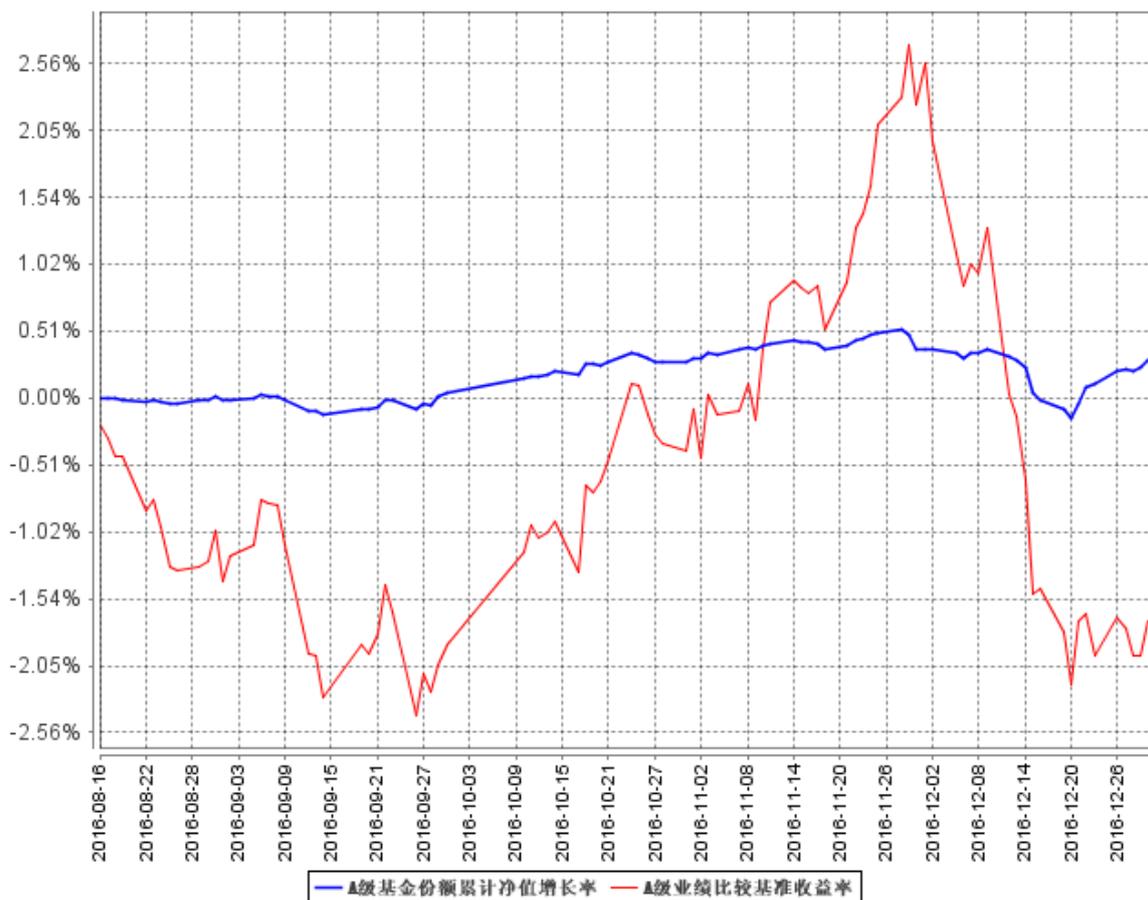
本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

基准指数的构建考虑了三个原则：

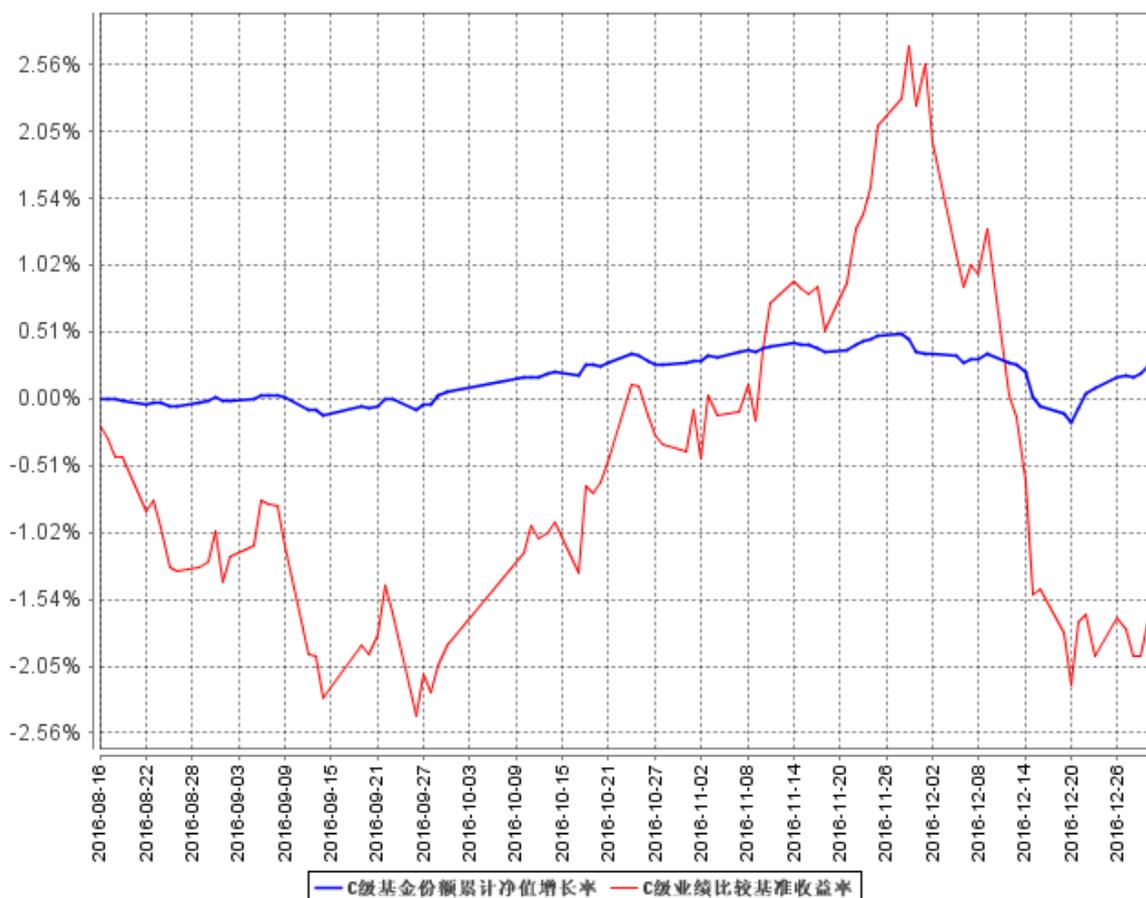
- 1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债指数。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的市场代表性。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，该指数可以较为全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。
- 2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-65%；债券等固定收益类资产投资占基金资产的比例不低于 30%；根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可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 50%、50%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

A级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



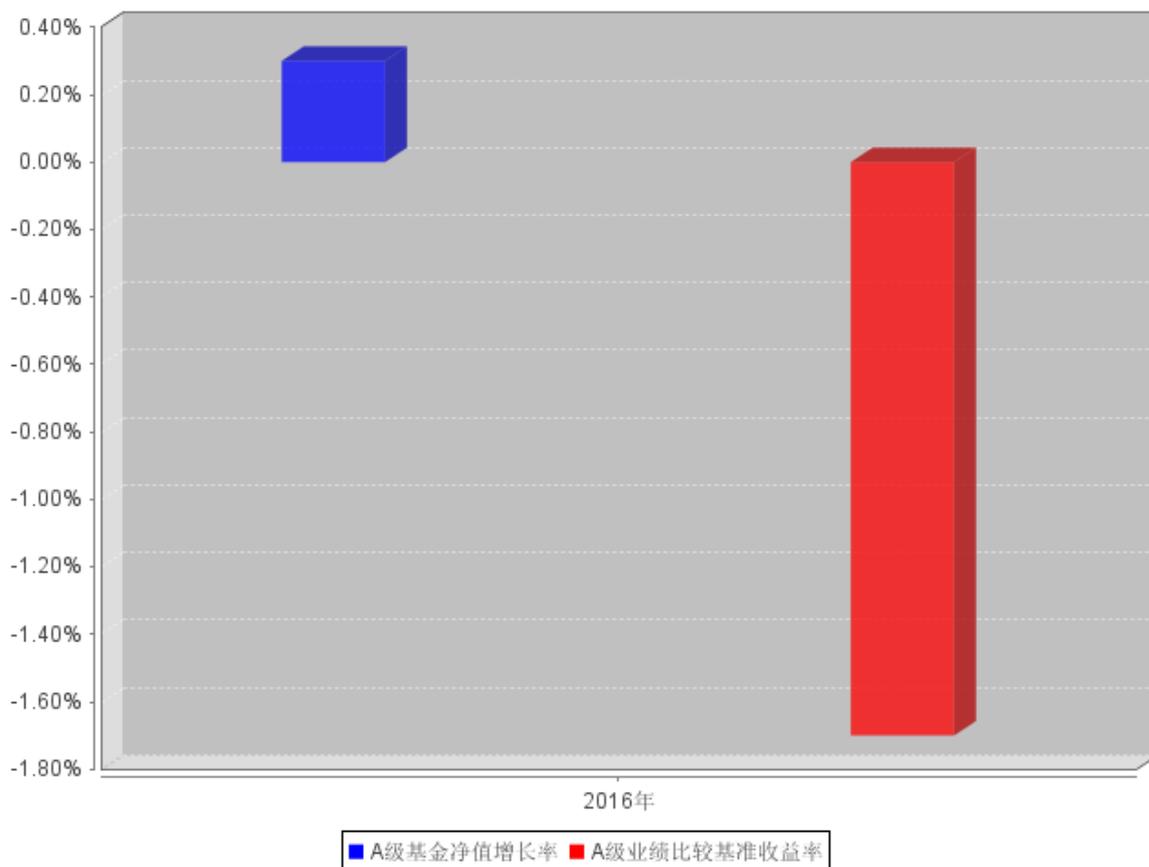
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



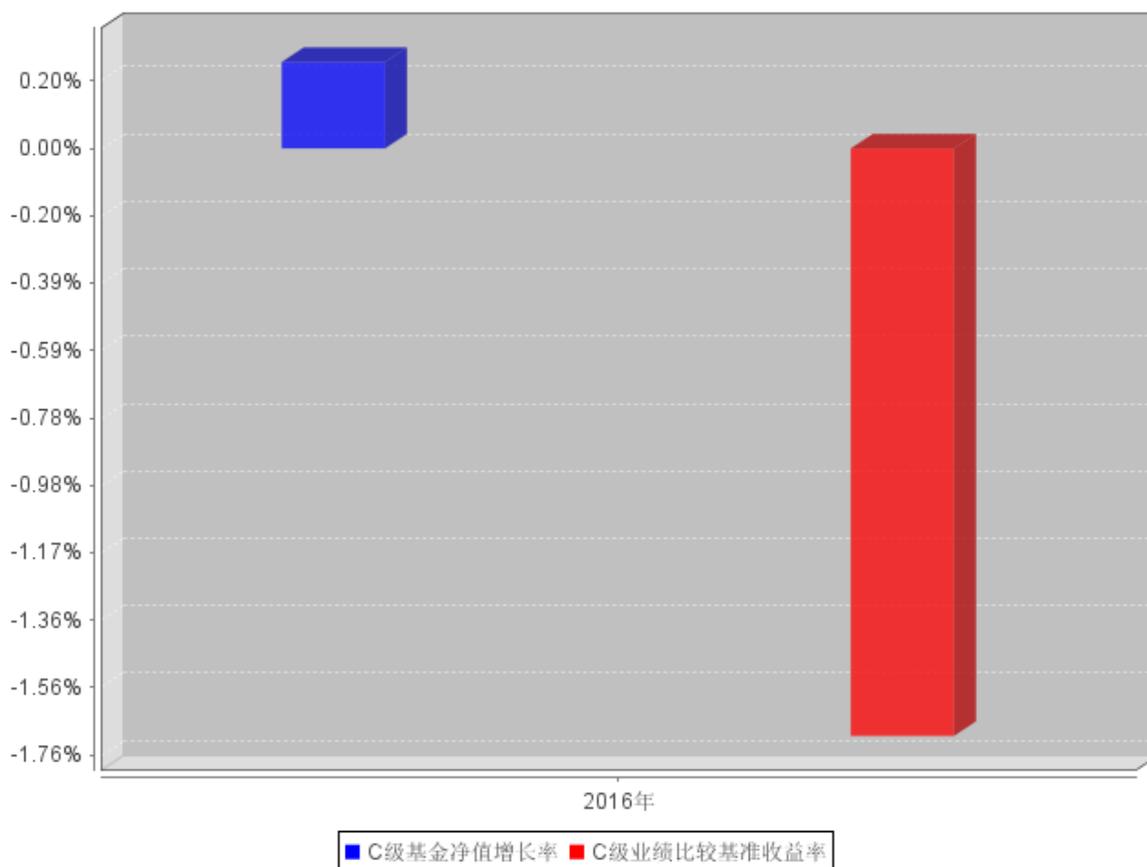
- 注：1、本基金基金合同生效日为 2016 年 8 月 16 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。
- 2、按照基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告期末本基金仍处于建仓期。
- 3、本基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资占基金资产的比例为 0%-65%；债券等固定收益类资产投资占基金资产的比例不低于 30%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；在每个交易日日终，扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

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

**A级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**



### C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2016 年 8 月 16 日，合同生效当年按实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2016 年 8 月 16 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止会计期间未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安

徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2016 年 12 月 31 日，基金管理人共管理五十七只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨衡	本基金基金经理，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，长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016 年 8 月 16 日	-	11 年	杨衡先生，1975 年 10 月出生。中国科学院数学与系统科学研究院博士、博士后。2007 年 7 月进入长盛基金管理公司，历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理、长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。
李琪	本基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券型投资基金基金经理，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，长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2016 年 8 月 16 日	-	11 年	李琪先生，1975 年 2 月出生。天津大学管理学博士。历任大公国际资信评估有限公司信用分析师、信用评审委员会委员，泰康资产管理有限责任公司信用研究员。2011 年 3 月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。

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

###### 1、报告期内行情回顾

回顾 2016 年，在基建和地产的传统引擎拉动下，宏观经济弱势企稳。全年通胀水平总体处于低位，但国内供给侧改革及国际大宗商品价格反弹推动 PPI 持续上行，叠加产油国达成减产协议推动油价快速上涨，年末通胀预期有所上升。强美元下，汇率层面持续面临较大贬值压力，外汇占款持续流出；受汇率、资产价格以及去杠杆、防风险等因素制约，下半年货币政策更趋于稳健，央行主要通过逆回购、MLF 等方式投放流动性，尤其是 8 月以来央行操作上锁短放长，导致流动性较上半年有所收紧。

2016 年，债券市场走势波折，全年来看债券收益率有所上行。1 月至 4 月，受经济企稳、MPA 考核扰动资金面及信用事件频发等因素影响，债券收益率震荡上行；4 月末至 10 月中旬，先后受稳增长预期调整、CPI 温和回落、违约风险担忧下降、英国脱欧、房地产调控政策频出等因素影响，各债券品种收益率持续下行，10 月中旬十年期国债收益率降至 2.64% 的年内低点；10 月下旬至 12 月中旬，受表外理财纳入 MPA 考核、美国加息预期、中美利差收窄、国内通胀预期上升、年末流动性偏紧以及机构赎回踩踏等多因素影响，叠加代持风险事件对债市交易信用的冲击，导致债市大跌；12 月下旬以来，随着央行适度加大投放力度，并引导大行向非银金融机构融出，资金紧张状况有所改善，同时代持事件逐步协调解决，债市止跌反弹。

2016 年，A 股市场整体下跌，上证综指下跌 12.31%，创业板指数下跌 27.71%。1 月份，受人民币贬值预期、股东减持、新股注册制改革加速等因素影响，叠加指数熔断机制的“磁吸效应”，股市连续快速下跌，上证综指最低下探至 2638 点；2 月份，受人民币汇率趋稳、指数熔断机制暂停、经济小幅改善、“两会”的召开以及注册制改革和战略新三板放缓等因素影响，恐慌情绪修复，股市开始筑底反弹。二季度，货币进一步宽松预期落空，通胀的担忧缓解，周期股的表现略显疲弱，市热点主题涣散，股市震荡调整。进入三季度，在房地产市场高涨、供给侧改革、PPP 项目推进等因素影响下，市场风险偏好略有回升，房地产、建材、家电、钢铁等行业表现较好。进入四季度，受宏观经济企稳、部分行业盈利改善及混改预期增强等因素影响，股市整体上涨，上证综指一度涨至 3300，创出熔断冲击以来的高点；12 月以来股指有所回落。

2016 年以来执行 IPO 取消新股申购预缴款、2000 万股以下新股全部网上发行的新规。2016 年上半年新股发行节奏有所放缓，下半年逐渐加速。2016 年全年公告发行新股 26 批，其中上半年公告发行 9 批约 70 家，发行节奏平均约 12 只/月，下半年公告发行 16 批，11 月后发行节奏明

显加快到每周一批、单月超过 50 只。2016 全年上市 227 只，其中网下 167 只，网下占比 73.6%。新股申购参与者数量持续大幅增加，新股申购中签率持续大幅降低，其中网下配售比例降至 0.008%（除老股转让），网上中签率降至 0.03~0.06%，新股上市涨幅平均仍在 4 倍以上。2016 年 8 月后，新股网下申购股票底仓要求普遍提升，越来越多新股网下申购底仓要求 5000 万元。此外，新股网下申购上限有所下调，对部分超报 C 类投资者形成抑制。整体而言，新股发行加速、网下申报上限下调及分配额度向 A 类的公募基金社保基金倾斜，有利于增厚公募基金新股网下申购收益。

## 2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金坚持稳健操作思路，在信用风险可控的前提下重点配置高信用评级的中短期信用债，保持组合流动性和安全性，适度参与利率品种的投资机会，通过不同期限品种逆回购等货币类工具的组合操作，提升资金使用效率和灵活性。权益资产方面，根据市场行情变化，灵活调整权益资产比重，以避免净值大幅波动和回撤。此外，本基金紧密跟踪新股发行，积极准备新股网下申购底仓配置，通过参与新股申购，以提升组合收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，长盛盛辉混合 A 的基金份额净值为 1.0030 元，本报告期份额净值增长率为 0.30%，同期业绩比较基准增长率为-1.70%。

截止报告期末，长盛盛辉混合 C 的基金份额净值为 1.0025 元，本报告期份额净值增长率为 0.25%，同期业绩比较基准增长率为-1.70%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，虽然宏观经济暂时企稳，但是产能过剩和过低的投资回报导致企业投资意愿走弱，制造业与民间投资难有大幅改善；叠加房地产销量和投资增速见顶回落、汽车消费增速放缓、美国贸易保护主义抬头等因素影响，预计 2017 年经济仍面临较大下行压力。通胀方面，尽管 PPI 向 CPI 的传导路径并不顺畅，但上中游价格大幅上涨，仍可能一定程度上推升 CPI，引发市场通胀预期变化。受汇率、资产价格以及政策防风险等因素制约，货币政策更趋于稳健中性。

债券市场方面，在海内外经济和政策等多重因素影响下，预计债市波动将加大，稳健货币政策和积极财政政策将对市场形成较大压力，但同时经济基本面再次转弱、人民币贬值压力暂缓等因素也会带来交易性机会。信用债配置方面，继续严控信用风险，规避盈利恶化的行业、低评级信用债以及财政实力偏弱地区的城投债。

股市方面，对中长期经济前景的隐忧使得股市风险偏好难有显著回升，震荡市中需把握市场

结构性机会，比如涨价带动盈利改善的行业、低估值高分红的金融板块、对冲经济下行压力的基建板块以及改革深化、供给侧改革、消费升级等主题机会。但也需警惕国内经济增长低于预期、人民币汇率贬值及资本流出压力加大、特朗普政策不确定性等多重因素对资本市场的扰动。

在企业高杠杆率背景下，监管层通过定好规则、强化监管，在整顿股市秩序的基础上，恢复市场融资功能，并大力发展直接融资将是未来一段时期工作重点。预计 2017 年 A 股融资结构将发生较大变化，监管层将严格监管再融资市场，将引导更多资金转向 IPO 市场，未来新上市企业数量有望快速上升。我们认为受新股发行加速、单个网下投资者申购上限下调、A 类投资者配额比例普遍提升等因素的综合影响，A 类公募社保基金的打新收益率较之前有所提升。综合考虑目前的新股发行节奏、中签率、新股表现、新增投资者和门槛提升影响，未来一段时期仍是公募基金和社保基金较好的网下参与打新时段。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本基金报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2016 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 2,365,389.90 元，其中：长盛盛辉混合 A 期末可供分配利润为 2,365,121.39 元，（未分配利润已实现部分为 4,637,365.27 元，未分配利润未实现部分为-2,272,243.88 元），长盛盛辉混合 C 期末可供分配利润为 268.51 元，（未分配利润已实现部分为 569.71 元，未分配利润未实现部分为-301.20 元）。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛盛辉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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师陈玲、张振波 2017 年 3 月 22 日对本基金 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 8 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31

日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2017)第 20930 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:长盛盛辉混合型证券投资基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2016 年 12 月 31 日
<b>资 产:</b>	
银行存款	3,284,309.34
结算备付金	1,723,263.19
存出保证金	34,294.27
交易性金融资产	773,327,886.98
其中:股票投资	35,407,616.98
基金投资	-
债券投资	737,920,270.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	20,045,150.07
应收证券清算款	-
应收利息	5,171,116.11
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	803,586,019.96
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 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	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	300.57
应付管理人报酬	407,714.67

应付托管费	135,904.88
应付销售服务费	18.85
应付交易费用	35,874.46
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	60,000.00
负债合计	639,813.43
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	800,580,816.63
未分配利润	2,365,389.90
所有者权益合计	802,946,206.53
负债和所有者权益总计	803,586,019.96

注：1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 800,580,816.63 份。其中 A 类基金份额净值 1.0030 元，A 类基金份额总额 800,474,675.33 份；C 类基金份额净值 1.0025 元，C 类基金份额总额 106,141.30 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 8 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛盛辉混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 8 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 8 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	4,958,059.57
1.利息收入	6,702,098.44
其中：存款利息收入	124,421.08
债券利息收入	4,636,755.86
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,940,921.50
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	352,474.48
其中：股票投资收益	329,289.33
基金投资收益	-
债券投资收益	-63,538.77
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-

股利收益	86,723.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,096,625.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	111.92
<b>减：二、费用</b>	<b>2,552,129.86</b>
1. 管理人报酬	1,755,031.34
2. 托管费	585,010.45
3. 销售服务费	127.63
4. 交易费用	111,314.93
5. 利息支出	1,420.89
其中：卖出回购金融资产支出	1,420.89
6. 其他费用	99,224.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>2,405,929.71</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>2,405,929.71</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛盛辉混合型证券投资基金

本报告期：2016年8月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年8月16日(基金合同生效日)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）	600,232,422.22	-	600,232,422.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,405,929.71	2,405,929.71
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）	200,348,394.41	-40,539.81	200,307,854.60
其中：1. 基金申购款	200,493,367.68	-40,228.67	200,453,139.01
2. 基金赎回款	-144,973.27	-311.14	-145,284.41
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）	800,580,816.63	2,365,389.90	802,946,206.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 周兵	_____ 杨思乐	_____ 龚珉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛盛辉混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第 1693 号《关于准予长盛盛辉混合型证券投资基金注册的批复》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《长盛盛辉混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共 600,232,393.75 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1091 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛盛辉混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 8 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 600,232,422.22 份基金份额,其中认购资金利息折合 28.47 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《长盛盛辉混合型证券投资基金基金合同》和《长盛盛辉混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。A 类基金份额与 C 类基金份额分别设置基金代码,并且由于基金费用的不同,分别计算和公告基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛辉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(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具、同业存单、银行存款、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。本基金股票资产投资占基金资产的比例为 0%-65%;债券等固定收益类资产投资占基金资产的比例不低于 30%;权证投资占基金资产净值的 0%-3%;在每个交易日日终,扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的

业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

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》、《长盛盛辉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 8 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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 8 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 8 月 16 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

##### 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、买入返售金融资产和其他各类

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卖出回购金融资产款和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、托管费和销售服务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

本基金每一类别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、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) 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 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
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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年8月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,755,031.34
其中：支付销售机构的客户维护费	436.01

注：支付基金管理人长盛基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 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 X 0.60% / 当年天数。

###### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年8月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	585,010.45

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 0.20% 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 X 0.20% / 当年天数。

**7.4.8.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年8月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛辉混合 A	长盛盛辉混合 C	合计
中国银行	-	32.85	32.85
合计	-	32.85	32.85

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给长盛基金，再由长盛基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

**7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金的管理人于本报告期末未运用固有资金投资本基金。

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

注：除基金管理人之外的其他关联方本期末未投资本基金。

**7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年8月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	3,284,309.34	92,281.27

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

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

### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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

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。

### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000166	申万宏源	2016 年 12 月 21 日	重大事项停牌	6.25	2017 年 1 月 26 日	6.29	2,200	14,669.27	13,750.00	-

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。

### 7.4.9.3 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从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.10 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 35,287,086.98 元，属于第二层次的余额为 738,040,800.00 元，无属于第三层次的余额。

(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。

(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	35,407,616.98	4.41
	其中：股票	35,407,616.98	4.41
2	固定收益投资	737,920,270.00	91.83
	其中：债券	737,920,270.00	91.83
	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	20,045,150.07	2.49
	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	5,007,572.53	0.62
7	其他各项资产	5,205,410.38	0.65
8	合计	803,586,019.96	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	5,389,051.00	0.67
C	制造业	8,227,867.15	1.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,774,592.00	0.72
E	建筑业	418,600.00	0.05
F	批发和零售业	324,785.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	2,722,242.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	729,568.46	0.09
J	金融业	10,968,245.00	1.37
K	房地产业	760,917.00	0.09
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	77,849.37	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	13,900.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	35,407,616.98	4.41

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600028	中国石化	470,000	2,542,700.00	0.32
2	600036	招商银行	126,800	2,231,680.00	0.28

3	601857	中国石油	223,300	1,775,235.00	0.22
4	601985	中国核电	240,000	1,694,400.00	0.21
5	600795	国电电力	450,000	1,426,500.00	0.18
6	600027	华电国际	270,000	1,336,500.00	0.17
7	601398	工商银行	260,600	1,149,246.00	0.14
8	601009	南京银行	100,000	1,084,000.00	0.14
9	601088	中国神华	66,200	1,071,116.00	0.13
10	600089	特变电工	110,000	1,004,300.00	0.13

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

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600028	中国石化	2,472,200.00	0.31
2	600036	招商银行	2,310,632.00	0.29
3	000625	长安汽车	1,783,954.24	0.22
4	601985	中国核电	1,722,900.00	0.21
5	601857	中国石油	1,686,349.00	0.21
6	000001	平安银行	1,678,012.00	0.21
7	002304	洋河股份	1,627,730.00	0.20
8	000333	美的集团	1,625,601.00	0.20
9	000063	中兴通讯	1,622,960.43	0.20
10	000725	京东方 A	1,621,275.00	0.20
11	001979	招商蛇口	1,592,635.00	0.20
12	000858	五粮液	1,501,250.84	0.19
13	600795	国电电力	1,444,500.00	0.18
14	600027	华电国际	1,386,600.00	0.17
15	002594	比亚迪	1,273,099.00	0.16
16	601398	工商银行	1,174,912.00	0.15
17	002736	国信证券	1,130,861.00	0.14
18	601009	南京银行	1,121,000.00	0.14
19	600900	长江电力	1,024,093.72	0.13
20	600089	特变电工	1,016,834.00	0.13

## 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000625	长安汽车	1,708,333.00	0.21
2	000725	京东方 A	1,698,735.00	0.21
3	000063	中兴通讯	1,695,236.00	0.21
4	001979	招商蛇口	1,596,934.30	0.20
5	000001	平安银行	1,593,500.00	0.20
6	000333	美的集团	1,560,876.22	0.19
7	002304	洋河股份	1,538,859.00	0.19
8	000858	五粮液	1,489,354.11	0.19
9	002594	比亚迪	1,136,309.43	0.14
10	002736	国信证券	1,110,843.00	0.14
11	002673	西部证券	964,619.00	0.12
12	002415	海康威视	957,136.80	0.12
13	000895	双汇发展	947,393.00	0.12
14	601688	华泰证券	704,640.00	0.09
15	002142	宁波银行	661,920.00	0.08
16	000776	广发证券	611,616.00	0.08
17	002024	苏宁云商	607,837.00	0.08
18	000166	申万宏源	598,885.91	0.07
19	000069	华侨城 A	582,876.00	0.07
20	600909	华安证券	563,492.40	0.07

## 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	58,222,385.35
卖出股票收入（成交）总额	23,559,606.09

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,940,000.00	4.97

	其中：政策性金融债	39,940,000.00	4.97
4	企业债券	10,523,270.00	1.31
5	企业短期融资券	687,457,000.00	85.62
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	737,920,270.00	91.90

## 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	160414	16 农发 14	400,000	39,940,000.00	4.97
2	041653012	16 广州汽车 CP001	300,000	30,123,000.00	3.75
3	011698463	16 华电江苏 SCP002	300,000	29,970,000.00	3.73
4	011698511	16 澜沧江 SCP006	300,000	29,928,000.00	3.73
5	011698461	16 中电投 SCP012	300,000	29,916,000.00	3.73

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1** 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	34,294.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,171,116.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,205,410.38

**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**

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

份额级别	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
长盛盛辉混合 A	8	100,059,334.42	800,038,007.80	99.95%	436,667.53	0.05%
长盛盛辉混合 C	325	326.59	0.00	0.00%	106,141.30	100.00%
合计	333	2,404,146.60	800,038,007.80	99.93%	542,808.83	0.07%

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。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长盛盛辉混合 A	99.41	0.0000%
	长盛盛辉混合 C	300.03	0.2827%
	合计	399.44	0.0000%

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	份额级别	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	长盛盛辉混合 A	0
	长盛盛辉混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛盛辉混合 A	0
	长盛盛辉混合 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛辉混合 A	长盛盛辉混合 C
基金合同生效日(2016年8月16日)基金份额总额	600,011,826.12	220,596.10

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	200,472,296.31	21,071.37
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	9,447.10	135,526.17
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	800,474,675.33	106,141.30

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本报告期内本基金管理人的高级管理人员无重大人事变动。

#### 11.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

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

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、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60,000.00元,已连续提供审计服务1年。

**11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	81,290,458.86	100.00%	75,704.20	100.00%	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	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
长江证券	848,309.68	100.00%	4,275,576,000.00	100.00%	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并

撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：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	川财证券	深圳	1
2	中航证券	上海	1

长盛基金管理有限公司  
2017年3月27日