

长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金
2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 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 8 月 24 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。本半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 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛国企改革混合
基金主代码	001239
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 4 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,370,457,405.66 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标在于把握中国国企改革所蕴含的投资机会，分享国企改革带给上市公司的投资收益，在严格控制投资风险的基础上，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>（一）大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>（二）国企改革主题上市公司的界定</p> <p>本基金投资的国企改革主题公司，主要分为两类： 一是直接或间接受益于已经公告的国企改革方案（含预案，下同）的上市公司。国企改革方案包括但不限于资产重组方案、股权激励方案及纳入国有资本投资运营平台方案等。该类上市公司包括通过改革将使经营状况和盈利能力获得提升的国有企业，参与国有企业改革并使经营状况和盈利能力获得提升的上市公司，以及其他在国企改革进程中获得发展机遇或利润增长点的上市公司。 二是处于国企改革的重点区域、行业，且改革预期较确定的国有企业，或与上述国有企业有较大业务关联的上市公司。</p> <p>（三）股票投资策略</p> <p>本基金将考察改革对央企和地方国企不同的影响、改革对各个行业的不同影响，筛选出具有投资机会的上市公司股票，构建并动态调整国企改革主题股票精选池。通过对内在价值、相对价值、收购价值等方面的研究，而筛选出估值水平相对合理或低估的上市公司股票，并本着审慎精选的原则，根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。</p>

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-68,972,766.88
本期利润	-39,528,598.71
加权平均基金份额本期利润	-0.0160
本期基金份额净值增长率	-3.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.5695
期末基金资产净值	1,066,563,470.31
期末基金份额净值	0.450

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6月30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
过去一个月	2.27%	0.46%	3.01%	0.34%	-0.74%	0.12%
过去三个月	-5.86%	0.61%	3.16%	0.32%	-9.02%	0.29%
过去六个月	-3.64%	0.55%	5.36%	0.29%	-9.00%	0.26%
过去一年	-2.39%	0.63%	8.32%	0.35%	-10.71%	0.28%
自基金合同生效起至今	-55.00%	2.16%	-10.63%	0.90%	-44.37%	1.26%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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、郑州、杭州、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 2017 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十二只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田间	本基金基金经理。	2015 年 6 月 4 日	-	8 年	田间女士，1978 年 11 月出生。中央财经大学经济学硕士。2008 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任行业研究员，基金经理助理、同盛证券投资基金基金经理等职务。
吴博文	本基金基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（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。	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。

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 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。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。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 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，未发生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，未发现本基金有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

今年一季度，国内宏观经济延续了上一年四季度较好的发展趋势；其次在流动性层面，虽然货币政策呈现中性，但相比固定收益等其他大类资产，股票投资的相对吸引力在提升。整体市场呈现蓝筹大盘股上升的态势。

4 月 1 日雄安新区横空出世，“千年大计”刺激着投资者的神经。然而这个概念的快速到来和快速消退成为了市场情绪转弱的契机。2017 年 4 月至 5 月，整个市场情绪较弱，大多数指数均呈现下跌态势。其中军工，农林牧渔等板块下跌较多。

5 月 27 日最新公布的关于大股东和董监高的减持新规，主要从增加了限制减持范围（将定向增发、股权质押、配股和可交债等方式取得的股份也纳入到限制减持范围）、降低不同期限减持比例（如大股东集合竞价方式连续 90 个交易日减持不能超过 1%+大宗交易连续 90 个交易日减持不能超过 2%，定增解禁后一年内减持份额不能超过持有总份额的 50%等）、对董监高通过离职方式减持进行规范、信息披露等方面完善。这表示证监会在将投资者的关注点向价值蓝筹方向进一步引导。

沿着政策指引的方向，在 6 月份的市场反弹中，白马蓝筹再一次引领市场上涨。在这过程中，板块分化进一步达到极致，在格力电器、美的集团、老板电器等上半年屡创新高的白马股的带领下，家用电器板块成为最牛板块。以上证 50 为代表的白马蓝筹股不断创出新高。以贵州茅台、格力电器等为代表的白马蓝筹一路高歌猛进，纷纷创出历史或阶段新高。Wind 白马股指数上半年累计上涨 35%，位居所有概念板块首位。

1-3 月份我们按照绝对收益思路逐渐兑现 2016 年底我们布局的工程机械，LED，石油机械等板块的收益，一季度整体表现较好。在 3 月底我们充分预计到了市场调整的可能性，延续一季度的绝对收益投资思路，在 4 月上旬对组合进行换仓。然而我们还是对于整体投资环境的惯性估计较差，认为白马行情要休息较长的时间，选择很长时间没有引起投资者关注的国企改革相关领域板块进行布局，重点投资了包括军工，一带一路，环保等行业。这几个错误的方向选择给二季度组合的净值带来了较大的损失。经过 6 月份的调整，我们重新对组合的方向进行了梳理，对组合的投资方向进行了分散，对国企改革动作比较频繁的民航，能源，电力，通信，铁路等领域都进行了布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.450 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.64%，业绩比较基准收益率为 5.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

按库存周期平均时间跨度推算，本轮库存周期已进入后期。以每轮库存周期的波峰为起点，自 1998 年以来中国经济经历了五轮完整的库存周期，平均库存周期为 40 个月（见图 1，表 1）。目前正处于第六轮库存周期，按库存周期四阶段划分，2014 年 9 月-2016 年 2 月为主动去库存阶段，2016 年 3 月-2016 年 5 月处于被动去库存阶段，2016 年 6 月开始进入主动补库存阶段，至 2017 年 6 月，本轮周期已有 34 个月，目前正进入被动补库存阶段。

房地产销售增速持续趋缓，一、二线城市房价涨幅回落。2009 年以来中国房地产经历了两轮时间跨度为 3 年的短周期，分别是 2009 年 1 月-2012 年 2 月、2012 年 3 月-2015 年 2 月。本轮房地产小周期起始于 2015 年 3 月，房地产销售面积累计增速见底后于当年 6 月份由负转正，2016 年 4 月份回升至 36.5%后开始趋缓，2017 年 5 月份累计增速已回调至 14.3%。2016 年 10 月份实施房地产调控后，一、二线城市房价涨幅开始出现回落（见图 5）。到今年 6 月份本轮房地产小周期已运行 28 个月，目前正处在周期顶部区域，房价涨幅和销售增速开始出现同步回调。按周期长度 36 个月推算，本轮周期将持续到 2018 年 2 月。

长期来看，我们正处在牛熊转换的第三阶段，震荡市，结构市，典型特征为分化与抱团取暖，这一阶段目前还没结束。我们看目前盈利虽缓慢回落，但经济远没有跌出政策底线。同时制造业投资中设备周期逐步开启，本轮设备更替需求占据很大一部分，尤其在工程机械板块表现明显。金融强监管延续的态势下，阶段性会有监管放松的窗口打开。市场的共识集中在经济增长一定是逐级下降的过程，对于经济悲观的预期已经反映在大家对超大市值白马蓝筹的一致追逐中，这些有限的公司是最具备长期确定性的公司。然而市场无论是对于周期板块继续缓慢复苏或者是成长性行业龙头公司业绩持续增长都不认同，对于稳定类板块由于国企改革带来的制度红利更是基本上没有预期了。我们在这个时点，认为短期来看，未来半年，市场上有超预期可能的板块集中在国企改革受益类公司，周期类板块，成长性行业龙头公司等。我们对于价值类白马蓝筹公司保持密切的关注，但我们认为短期内这些白马蓝筹公司需要调整来消化过于一致的市场预期。

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（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截至 2017 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-1,350,017,511.81 元，其中，未分配利润已实现部分为-1,350,017,511.81 元，未分配利润未实现部分为 46,123,576.46 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长盛基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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 托管人对本半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半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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	196,168,864.48	337,411,622.43
结算备付金	10,447,375.21	2,824,969.62
存出保证金	1,152,573.23	1,552,537.10
交易性金融资产	885,948,690.48	886,792,166.28
其中：股票投资	885,948,690.48	886,792,166.28
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	107,233.22	155,839.91
应收股利	-	-
应收申购款	36,078.15	90,343.35
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,093,860,814.77	1,228,827,478.69
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	19,636,327.75	23,928,844.76
应付赎回款	1,285,759.66	925,005.38
应付管理人报酬	1,303,541.87	1,542,375.72
应付托管费	217,256.95	257,062.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,674,899.35	2,897,274.08

应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	179,558.88	271,571.12
负债合计	27,297,344.46	29,822,133.66
所有者权益：		
实收基金	2,370,457,405.66	2,569,250,774.84
未分配利润	-1,303,893,935.35	-1,370,245,429.81
所有者权益合计	1,066,563,470.31	1,199,005,345.03
负债和所有者权益总计	1,093,860,814.77	1,228,827,478.69

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 0.450 元，基金份额总额为 2,370,457,405.66 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	-18,314,526.01	-514,753,035.43
1.利息收入	3,603,714.47	4,569,076.77
其中：存款利息收入	3,603,714.47	4,569,076.77
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-51,446,059.06	-332,673,338.01
其中：股票投资收益	-57,923,153.07	-338,462,893.97
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	6,477,094.01	5,789,555.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	29,444,168.17	-186,933,622.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	83,650.41	284,848.70
减：二、费用	21,214,072.70	26,689,116.93

1. 管理人报酬	8,553,670.33	10,578,259.42
2. 托管费	1,425,611.70	1,763,043.24
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	11,029,229.24	14,146,284.88
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	205,561.43	201,529.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-39,528,598.71	-541,442,152.36
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-39,528,598.71	-541,442,152.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,569,250,774.84	-1,370,245,429.81	1,199,005,345.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-39,528,598.71	-39,528,598.71
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）	-198,793,369.18	105,880,093.17	-92,913,276.01
其中：1.基金申购款	33,993,115.63	-18,259,289.67	15,733,825.96
2.基金赎回款	-232,786,484.81	124,139,382.84	-108,647,101.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,370,457,405.66	-1,303,893,935.35	1,066,563,470.31
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		

权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的 0%-95%；其中投资于国企改革主题的股票和债券不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准：50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,553,670.33	10,578,259.42
其中：支付销售机构的客户维护费	4,076,425.65	4,878,252.91

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

计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,425,611.70	1,763,043.24

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

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人于本报告期及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金份额。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年可比期末未持有本基金份额。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30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	196,168,864.48	3,547,155.88	316,976,953.43	4,464,832.23

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期及上年可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

注：基金可使用以基金名义开设股票账户，选择网下或者网上一种方式进行新股申购。从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.9.2 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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	-------	--------	--------	----

600795	国电电力	2017年6月5日	重大事项停牌	3.60	-	-	6,358,600	21,362,812.00	22,890,960.00	-
600358	国旅联合	2017年6月5日	重大事项停牌	7.00	-	-	500,000	3,622,181.00	3,500,000.00	-
000099	中信海直	2017年5月4日	重大事项停牌	11.26	-	-	75,134	952,827.37	846,008.84	-
603238	诺邦股份	2017年5月15日	重大事项停牌	29.38	2017年8月23日	31.99	1,750	23,292.50	51,415.00	-
002856	美芝股份	2017年6月19日	重大事项停牌	31.86	-	-	1,230	14,280.30	39,187.80	-
300582	英飞特	2017年6月5日	重大事项停牌	18.92	2017年8月2日	17.50	2,038	20,181.15	38,558.96	-
603501	韦尔股份	2017年6月5日	重大事项停牌	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55	-
002025	航天	2016年9月	重大	23.65	2017年7月	22.46	75	1,696.42	1,773.75	-

	电 器	月 12 日	事 项 停 牌		月 4 日				
--	--------	-----------	------------------	--	----------	--	--	--	--

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金、应付证券清算款等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 858,434,373.84 元，属于第二层次的余额为人民币 27,514,316.64 元，属于第三层次的余额为人民币零元（2016 年 12 月 31 日：第一层次人民币 886,097,275.95 元，第二层次人民币 694,890.33 元，无属于第三层次的余额）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	885,948,690.48	80.99
	其中：股票	885,948,690.48	80.99
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	206,616,239.69	18.89
7	其他各项资产	1,295,884.60	0.12
8	合计	1,093,860,814.77	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	10,966,224.24	1.03
B	采矿业	71,760,320.63	6.73
C	制造业	460,670,142.85	43.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	59,370,895.90	5.57
E	建筑业	6,708,069.13	0.63
F	批发和零售业	15,871,705.28	1.49
G	交通运输、仓储和邮政业	128,670,534.68	12.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	216,653.30	0.02
J	金融业	64,345,060.17	6.03
K	房地产业	40,281,347.28	3.78
L	租赁和商务服务业	16,040,262.14	1.50
M	科学研究和技术服务业	86,652.88	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	244,561.29	0.02
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	10,716,260.71	1.00
S	综合	-	-
	合计	885,948,690.48	83.07

7.2.2 报告期末按行业分类的港股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。

7.3 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	600029	南方航空	3,895,900	33,894,330.00	3.18
2	600115	东方航空	4,898,067	33,306,855.60	3.12
3	000060	中金岭南	2,832,160	31,720,192.00	2.97
4	000338	潍柴动力	2,130,000	28,116,000.00	2.64
5	600270	外运发展	1,451,430	27,475,569.90	2.58
6	000983	西山煤电	2,999,950	26,309,561.50	2.47
7	000895	双汇发展	1,036,201	24,609,773.75	2.31
8	600795	国电电力	6,358,600	22,890,960.00	2.15
9	002179	中航光电	731,022	22,800,576.18	2.14
10	600642	申能股份	3,602,193	22,693,815.90	2.13

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> 网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600085	同仁堂	65,058,108.19	5.43
2	600021	上海电力	63,656,750.80	5.31
3	000018	神州长城	59,977,942.85	5.00
4	600498	烽火通信	58,865,758.54	4.91
5	600019	宝钢股份	54,952,156.24	4.58
6	601988	中国银行	53,101,114.00	4.43
7	600507	方大特钢	49,641,587.27	4.14
8	600267	海正药业	48,486,682.69	4.04

9	002465	海格通信	48,052,533.54	4.01
10	601328	交通银行	42,495,373.99	3.54
11	600893	航发动力	39,164,535.84	3.27
12	600990	四创电子	38,325,170.82	3.20
13	300070	碧水源	37,139,663.75	3.10
14	600048	保利地产	37,029,608.59	3.09
15	300015	爱尔眼科	36,039,398.04	3.01
16	002739	万达院线	36,013,552.36	3.00
17	000063	中兴通讯	35,879,340.95	2.99
18	002179	中航光电	35,394,498.01	2.95
19	601390	中国中铁	34,904,224.30	2.91
20	600027	华电国际	34,591,667.17	2.89
21	000547	航天发展	34,445,134.82	2.87
22	600138	中青旅	34,108,100.66	2.84
23	600795	国电电力	33,320,388.00	2.78
24	600028	中国石化	32,076,721.72	2.68
25	600115	东方航空	32,049,171.57	2.67
26	601601	中国太保	32,040,685.00	2.67
27	600029	南方航空	32,005,753.00	2.67
28	600208	新湖中宝	31,631,654.00	2.64
29	601899	紫金矿业	30,758,257.99	2.57
30	000060	中金岭南	30,588,913.80	2.55
31	000908	景峰医药	30,574,890.35	2.55
32	300498	温氏股份	30,072,061.13	2.51
33	000050	深天马 A	29,874,386.95	2.49
34	600340	华夏幸福	27,849,530.00	2.32
35	600270	外运发展	26,728,078.83	2.23
36	600428	中远海特	26,600,573.82	2.22
37	600188	兖州煤业	26,438,993.94	2.21
38	000563	陕国投 A	26,318,677.98	2.20
39	300284	苏交科	25,971,731.80	2.17
40	600583	海油工程	25,115,098.20	2.09
41	000983	西山煤电	24,817,686.78	2.07
42	000338	潍柴动力	24,448,789.64	2.04
43	000601	韶能股份	24,341,445.14	2.03
44	600993	马应龙	24,048,155.06	2.01

45	300055	万邦达	24,044,010.13	2.01
----	--------	-----	---------------	------

7.4.2 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	600703	三安光电	94,838,223.55	7.91
2	000425	徐工机械	68,434,110.24	5.71
3	600031	三一重工	62,789,372.28	5.24
4	600021	上海电力	60,580,653.52	5.05
5	600085	同仁堂	55,764,713.05	4.65
6	601390	中国中铁	53,791,236.54	4.49
7	601988	中国银行	52,784,082.81	4.40
8	000930	中粮生化	52,098,855.17	4.35
9	000018	神州长城	47,543,721.02	3.97
10	300070	碧水源	46,080,489.13	3.84
11	600873	梅花生物	45,697,049.08	3.81
12	000998	隆平高科	44,649,812.16	3.72
13	002465	海格通信	42,968,044.19	3.58
14	601328	交通银行	42,838,475.23	3.57
15	600019	宝钢股份	42,746,309.73	3.57
16	600498	烽火通信	42,508,499.90	3.55
17	000063	中兴通讯	41,438,157.41	3.46
18	600267	海正药业	41,407,774.09	3.45
19	002353	杰瑞股份	39,914,706.48	3.33
20	300015	爱尔眼科	37,445,134.82	3.12
21	600507	方大特钢	37,158,063.52	3.10
22	600737	中粮糖业	35,904,293.38	2.99
23	600027	华电国际	34,391,423.86	2.87
24	600340	华夏幸福	34,372,568.06	2.87
25	002739	万达院线	33,852,139.90	2.82
26	601601	中国太保	32,639,926.49	2.72
27	600028	中国石化	32,382,427.20	2.70
28	601766	中国中车	32,210,065.05	2.69
29	600893	航发动力	31,886,050.34	2.66
30	601899	紫金矿业	31,731,539.00	2.65
31	600583	海油工程	30,919,809.93	2.58
32	000050	深天马 A	30,534,472.40	2.55

33	600208	新湖中宝	30,468,066.40	2.54
34	600428	中远海特	30,431,541.92	2.54
35	000547	航天发展	28,031,591.93	2.34
36	000908	景峰医药	27,732,284.98	2.31
37	600990	四创电子	27,550,668.39	2.30
38	601088	中国神华	27,314,903.90	2.28
39	000563	陕国投 A	26,801,032.80	2.24
40	300498	温氏股份	26,732,031.66	2.23
41	000848	承德露露	26,225,248.57	2.19
42	300055	万邦达	24,723,319.11	2.06
43	600993	马应龙	24,665,721.02	2.06
44	600108	亚盛集团	24,150,350.65	2.01
45	000860	顺鑫农业	24,115,671.37	2.01
46	600600	青岛啤酒	24,086,306.26	2.01
47	600426	华鲁恒升	24,081,090.72	2.01

7.4.3 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	3,797,333,445.44
卖出股票收入（成交）总额	3,769,697,936.34

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,152,573.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	107,233.22
5	应收申购款	36,078.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,295,884.60

7.12.4 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。

7.12.5 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	600795	国电电力	22,890,960.00	2.15	重大事项停牌

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
50,065	47,347.60	5,652,371.95	0.24%	2,364,805,033.71	99.76%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	11,046.46	0.0005%

8.3 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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月4日）基金份额总额	3,250,867,544.91
本报告期期初基金份额总额	2,569,250,774.84
本报告期基金总申购份额	33,993,115.63
减：本报告期基金总赎回份额	232,786,484.81
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	2,370,457,405.66

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 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

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

由于任期届满，高新不再担任公司董事长，周放生不再担任公司独立董事。根据公司 2016 年度股东会议决议，选举林培富为公司董事，选举张良庆为公司独立董事；根据公司第七届董事会第一次会议决议，选举周兵担任公司董事长；根据公司第七届董事会第二次会议决议，聘任林培富担任公司总经理，周兵不再担任公司总经理，同时林培富不再担任公司副总经理。以上公司高级管理人员变更，已于 2017 年 3 月 30 日向中国证监会北京监管局报备。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动情况。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
齐鲁证券	12,097,509,804.91	27.74%	1,953,410.99	29.65%	-	
兴业证券	11,429,220,603.03	18.90%	1,331,034.62	20.20%	-	
天风证券	11,138,478,908.67	15.05%	832,571.43	12.64%	-	

东北证券	2	1,115,711,211.26	14.75%	845,084.27	12.83%	-
中信证券	1	846,465,018.93	11.19%	788,314.14	11.96%	-
光大证券	1	771,916,472.39	10.21%	718,888.59	10.91%	-
东方证券	2	163,214,580.36	2.16%	119,359.37	1.81%	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资力雄厚，信誉良好。

- (3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。
- (5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需
要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；
- (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；
- (3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；
- (4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；
- (5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；
- (6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：

序号 证券公司名称 交易单元所属市场 数量

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	东北证券	深圳	1

- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	国金证券	上海	1
2	华创证券	深圳	1

长盛基金管理有限公司

2017年8月24日