

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 25 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
7.7 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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息	41

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	41
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	44
§11 备查文件目录.....	48
11.1 备查文件目录.....	48
11.2 存放地点.....	49
11.3 查阅方式.....	49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金
基金简称	长盛同鑫行业混合
基金主代码	080007
交易代码	080007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 5 月 27 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	50,940,030.87 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100088	100818
法定代表人		高新	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金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	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-18,953,283.22
本期利润	-28,138,059.00
加权平均基金份额本期利润	-0.4828
本期加权平均净值利润率	-46.56%
本期基金份额净值增长率	-32.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,492,777.64
期末可供分配基金份额利润	-0.0293
期末基金资产净值	49,447,253.23
期末基金份额净值	0.971

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-7.70%

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	1.89%	1.25%	0.01%	0.59%	1.88%	0.66%
过去三个月	-5.45%	1.33%	-0.98%	0.61%	-4.47%	0.72%
过去六个月	-32.29%	2.28%	-8.55%	1.11%	-23.74%	1.17%
过去一年	-40.65%	2.92%	-15.31%	1.38%	-25.34%	1.54%
自基金转型起至今	-7.70%	2.37%	37.39%	1.23%	-45.09%	1.14%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准：60%×沪深 300 指数+40%×中证全债指数

基准指数的构建考虑了三个原则：

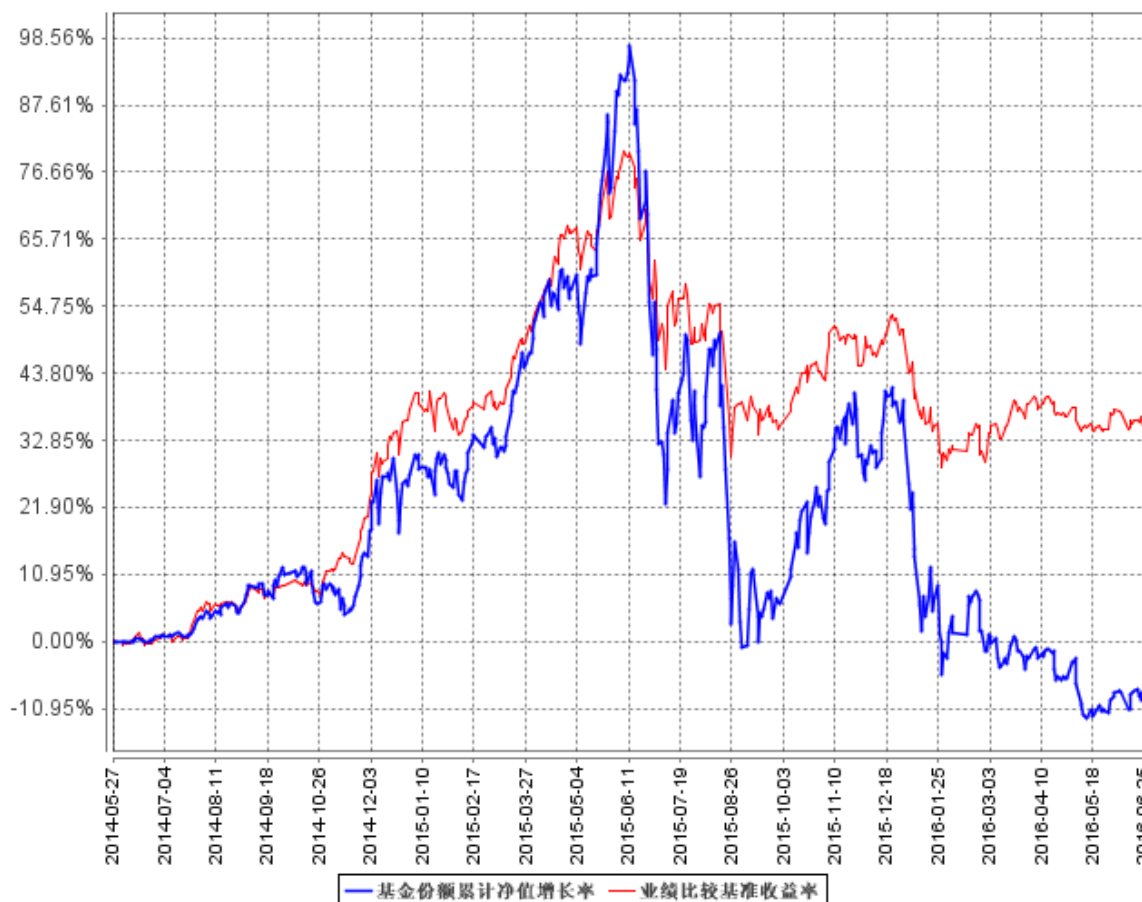
1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证全债指数。目前沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准较为合适。

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

3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 60%、40%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金转型起以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

§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 2016 年 6 月 30 日，基金管理人共管理四十六只开放式基金，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		
吴博文	本基金基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016 年 2 月 17 日	-	8 年	男，1983 年 6 月出生，中国国籍。毕业于北京大学，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，现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
田间	本基金基金经理，长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2014 年 9 月 9 日	2016 年 2 月 17 日	7 年	女，1978 年 11 月出生，中国国籍。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。现任长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。自 2016 年 2 月 17 日起不再担任长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理。

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

2016 年 3 月份的两会，李克强总理明确我国经济目标守住 6.5%，受困于债务过高，落后产能过剩和房地产库存的制约，经济仍然面临较大的下行压力。民企固定资产投资从二季度开始出现明显的下滑。政府加大财政政策力度，维持宽松货币政策，目标是在企业端去杠杆的同时，加大政府投资力度，从而能在艰难的去杠杆的过程中取得总体的平衡，维持社会稳定。

5 月份的大事是“权威人士讲话”，这个讲话奠定了未来一段时间政府经济工作的基调，是将过渡泛滥到大量虚拟资产里的流动性挤到实体资产领域。这个基调的制定是目前发展阶段的必然选择，我们必须意识到这个重大拐点的来临，对大类资产的配置的影响是深远的，也预示着未来相当长时间内我们面临的经济形势。经济下行+CPI 稳定（隐形通缩）已经暂时告一段落，经济下行+通胀将重新回到我们的经济生活中，也就是“滞胀”。我们预计未来三年内滞胀与通缩将交替出现。因此，对未来滞胀还是通缩的判断，将是决定我们组合净值表现的核心驱动要素，它决定了中观层面对行业的配置。

6 月份的大事件是英国“脱欧”的黑天鹅事件。在脱欧公投之前，基于我们对未来滞胀的判断，黄金将长期受益。如果英国留欧，避险情绪消退，美国加息概率就会提升；在黄金短暂的因美国加息而走低后，必然会有其他国家因为美国流动性的收缩而面临新的危机，会重新激发类似于英国脱欧这样的黑天鹅事件。如果英国脱欧，那么避险情绪大升，黄金，美元，美债，日元（逆套利交易）都会升值。总之英国脱欧只是在全球经济走向衰退中的一个事件，此后这样的事件会层出不穷。因此在六月份调仓的时候我们布局了贵金属行业的公司。

回顾我们二季度的操作，我们对于今年宏观环境的变化没有及时反应，在持仓品种的选择上还是更多的延续了我们自下而上的产业判断，忽略了在宏观环境由通缩向通胀转变的过程中，虚拟资产的估值将会面临阶梯式下降的趋势，导致净值表现落后。此后我们将更多地把由自上而下宏观环境的变化判断中观层面行业配置的方法融合到我们以往主要看重产业成长的投资方式中。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，长盛同鑫行业混合份额净值为 0.971 元，本报告期份额净值增长率为-32.29%，同期业绩比较基准增长率为-8.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年一季度 CPI 超预期上行，虽然在二季度通胀有所缓和，我们的整体判断是今年通胀会缓慢上行。大宗商品在油价的带领下开始回升，国内在供给收缩的环境下，有色金属等矿产资

源的价格在过去的二季度里开始有一些表现，以锌价为代表。食品价格二季度上涨速度比较缓和，蔬菜鲜果价格下行，但猪肉价格持续上涨到二季度末，维持高位运行，我们预计 2016 年全年猪肉供给将处于偏紧的状态。二季度末开始的南方洪涝灾害是个预料之中的突发因素，今年雨水较大，将造成农产品整体供给紧张，糖和棉花价格已经有所表现，我们预计在三季度其他农产品也将陆续有所表现。综上虽然二季度通胀形势缓和，但我们预计在经济维持下行通道时，过渡流动性泛滥走到终点，资产价格将缓慢下行，商品的价格将缓慢上行，我们预计三季度通胀预期将重现。

此时英国脱欧热度渐消，旧的一波欧洲风险刚刚散去，新的危机已然埋下伏笔。内部来看，英国带来的模仿效应，可能引来一连串国家的脱欧尝试，尤其是法、意等大国。外部来看，难民危机仍未有效控制，俄罗斯对欧洲的敌意继续加强。亚太方面，南海仲裁在即，新上任的菲律宾总统刚表达对华友好意愿，日本又酝酿鼓动 G7 发表联合声明，迫使新总统按照“国际法”解决问题，同时爆出中日战机海上对峙，为周边海域带来新的不安定因素。因此，当全球失去经济增长引擎，各个国家又先后失去了放松流动性对经济带来刺激的手段，于是对于各国政治家来说，武力争夺存量的蛋糕将取代大家一起合作开发新蛋糕的“全球化”趋势。争端和摩擦，国际组织成立，合作，合作破裂，再联合，将成为我们面对的这个世界的常态。军工板块是我们基于以上的判断得出的长期受益的板块。在 6 月份的调仓中我们已经有所布局。

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

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金截至 2016 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-1,492,777.64 元，其中：未分配利润已实现部分为 5,174,189.44 元，未分配利润未实现部分为-6,666,967.08 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”）在长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	19,949,874.18	9,329,757.77
结算备付金		140,444.24	709,837.47
存出保证金		96,435.56	106,101.45
交易性金融资产	6.4.7.2	31,808,887.39	77,872,388.65
其中：股票投资		31,808,887.39	77,872,286.85
基金投资		-	-
债券投资		-	101.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	787,312.39
应收利息	6.4.7.5	2,050.96	2,497.90
应收股利		-	-
应收申购款		12,663.95	38,933.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		52,010,356.28	88,846,828.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		29,946.80	674,033.91

应付赎回款		1,020,382.26	39,629.78
应付管理人报酬		61,682.27	107,783.07
应付托管费		10,280.36	17,963.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	177,624.02	333,576.02
应交税费		1,175,703.80	1,175,703.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	87,483.54	237,872.55
负债合计		2,563,103.05	2,586,562.96
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	50,940,030.87	60,161,365.31
未分配利润	6.4.7.10	-1,492,777.64	26,098,900.72
所有者权益合计		49,447,253.23	86,260,266.03
负债和所有者权益总计		52,010,356.28	88,846,828.99

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.971 元，基金份额总额 50,940,030.87 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-26,672,419.37	33,697,615.37
1.利息收入		80,414.42	89,624.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	80,413.30	89,621.28
债券利息收入		1.12	2.78
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）		-17,595,793.58	39,763,661.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-17,741,469.86	39,065,713.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1.73	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	145,674.55	697,947.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-9,184,775.78	-6,308,561.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	27,735.57	152,892.14
减：二、费用		1,465,639.63	3,146,457.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	452,742.29	1,075,220.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	75,457.06	179,203.42
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	848,833.04	1,706,491.08
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	88,607.24	185,542.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-28,138,059.00	30,551,157.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-28,138,059.00	30,551,157.91

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	60,161,365.31	26,098,900.72	86,260,266.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-28,138,059.00	-28,138,059.00
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）	-9,221,334.44	546,380.64	-8,674,953.80
其中：1.基金申购款	5,860,458.45	168,850.39	6,029,308.84
2.基金赎回款	-15,081,792.89	377,530.25	-14,704,262.64
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）	50,940,030.87	-1,492,777.64	49,447,253.23

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	121,729,420.57	41,382,282.60	163,111,703.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,551,157.91	30,551,157.91
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)	-53,292,701.61	-28,379,536.89	-81,672,238.50
其中：1.基金申购款	16,262,005.44	11,540,144.29	27,802,149.73
2.基金赎回款	-69,554,707.05	-39,919,681.18	-109,474,388.23
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)	68,436,718.96	43,553,903.62	111,990,622.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定由长盛同鑫保本混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)第一个保本周期届满后变更而来。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 519 号《关于核准长盛同鑫保本混合型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,031,349,989.30 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 190 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 5 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为

3,032,111,617.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 761,628.00 份基金份额。

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

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

6.4.2 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会及中国证券投资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。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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的说明

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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补充政策的通知》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。

(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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	19,949,874.18
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	19,949,874.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	31,155,247.84	31,808,887.39	653,639.55
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	31,155,247.84	31,808,887.39	653,639.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	1,966.73
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	44.73
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.44
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	39.06
合计	2,050.96

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	177,624.02
银行间市场应付交易费用	-
合计	177,624.02

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	52.03
其他	17,814.69
预提费用	69,616.82
合计	87,483.54

6.4.7.9 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 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	60,161,365.31	60,161,365.31
本期申购	5,860,458.45	5,860,458.45
本期赎回(以“-”号填列)	-15,081,792.89	-15,081,792.89
- 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	50,940,030.87	50,940,030.87

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	25,375,484.39	723,416.33	26,098,900.72
本期利润	-18,953,283.22	-9,184,775.78	-28,138,059.00
本期基金份额交易产生的变动数	-1,248,011.73	1,794,392.37	546,380.64
其中：基金申购款	1,289,327.19	-1,120,476.80	168,850.39
基金赎回款	-2,537,338.92	2,914,869.17	377,530.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,174,189.44	-6,666,967.08	-1,492,777.64

6.4.7.11 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 6 月 30 日
活期存款利息收入	75,445.06
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	4,090.02
其他	878.22
合计	80,413.30

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 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 6 月 30 日
卖出股票成交总额	285,678,217.61
减：卖出股票成本总额	303,419,687.47

买卖股票差价收入	-17,741,469.86
----------	----------------

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 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6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1.73
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1.73

6.4.7.13.2 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6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	103.43
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	100.00
减：应收利息总额	1.70
买卖债券差价收入	1.73

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期未取得衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	145,674.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	145,674.55

6.4.7.17 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6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	-9,184,775.78
——股票投资	-9,184,773.98
——债券投资	-1.80
——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	-9,184,775.78

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	25,714.35
转换费收入	2,021.22
基金转换费收入	-
合计	27,735.57

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减。

2、本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费，将全额计入基金财产；对持续持有期长于30日但少于3个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于6个月的投资人，将不低于赎回费总额的25%归入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、基金转换费用由转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用的补差两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费差异情况和转出基金的赎回费而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	848,833.04
银行间市场交易费用	-
合计	848,833.04

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	44,753.80
银行划款费用	3,690.42
其他费用	200.00
帐户维护费	15,100.00
合计	88,607.24

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金并无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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（“长盛基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付	452,742.29	1,075,220.50

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	205,142.70	494,657.86

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 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6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	75,457.06	179,203.42

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.10.4.2 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：除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末未投资本基金。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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
中国银行	19,949,874.18	75,445.06	9,574,893.88	79,127.14

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 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须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期无利润分配情况。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

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
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	511	2,963.80	2,963.80	-

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。

6.4.12.2 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
000638	万方发展	2016年1月5日	重大事项停牌	23.66	2016年7月25日	24.75	72,300	2,009,131.00	1,710,618.00	-

注：本基金截至2016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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行灵活配置的混合型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.12.5 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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 6 月 30 日本基金未持有债券，2015 年 12 月 31 日本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例均为 0.0001%。

6.4.12.6 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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 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 6 月 30 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。

6.4.12.7 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。

6.4.12.7.1 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、存出保证金及债券投资等。

6.4.12.7.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,949,874.18	-	-	-	19,949,874.18
结算备付金	140,444.24	-	-	-	140,444.24
存出保证金	96,435.56	-	-	-	96,435.56
交易性金融资产	-	-	-	31,808,887.39	31,808,887.39
应收利息	-	-	-	2,050.96	2,050.96
应收申购款	-	-	-	12,663.95	12,663.95
资产总计	20,186,753.98	-	-	31,823,602.30	52,010,356.28
负债					
应付证券清算款	-	-	-	29,946.80	29,946.80
应付赎回款	-	-	-	1,020,382.26	1,020,382.26
应付管理人报酬	-	-	-	61,682.27	61,682.27
应付托管费	-	-	-	10,280.36	10,280.36
应付交易费用	-	-	-	177,624.02	177,624.02
应交税费	-	-	-	1,175,703.80	1,175,703.80
其他负债	-	-	-	87,483.54	87,483.54
负债总计	-	-	-	2,563,103.05	2,563,103.05
利率敏感度缺口	20,186,753.98	-	-	29,260,499.25	49,447,253.23
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,329,757.77	-	-	-	9,329,757.77
结算备付金	709,837.47	-	-	-	709,837.47
存出保证金	106,101.45	-	-	-	106,101.45
交易性金融资产	101.80	-	-	77,872,286.85	77,872,388.65
应收证券清算款	-	-	-	787,312.39	787,312.39
应收利息	-	-	-	2,497.90	2,497.90
应收申购款	-	-	-	38,933.36	38,933.36
资产总计	10,145,798.49	-	-	78,701,030.50	88,846,828.99
负债					
应付证券清算款	-	-	-	674,033.91	674,033.91
应付赎回款	-	-	-	39,629.78	39,629.78
应付管理人报酬	-	-	-	107,783.07	107,783.07
应付托管费	-	-	-	17,963.83	17,963.83
应付交易费用	-	-	-	333,576.02	333,576.02

应交税费	-	-	-	1,175,703.80	1,175,703.80
其他负债	-	-	-	237,872.55	237,872.55
负债总计	-	-	-	2,586,562.96	2,586,562.96
利率敏感度缺口	10,145,798.49	-	-	76,114,467.54	86,260,266.03

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.7.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 6 月 30 日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%，2015 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0001%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值均无重大影响。

6.4.12.7.2 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。

6.4.12.7.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票、权证等权益类资产占基金资产的 40%-95%；投资于债券、货币市场工具、资产支持证券等其他证券品种占基金资产的 0%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.12.7.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	31,808,887.39	64.33	77,872,286.85	90.28
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	31,808,887.39	64.33	77,872,286.85	90.28

6.4.12.7.3.2 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 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	4,516,835.31	7,000,236.24
2. 业绩比较基准下降 5%	-4,516,835.31	-7,000,236.24	

6.4.13 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 6 月 30 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 30,098,269.39 元，属于第二层次的余额为 1,710,618.00 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次 70,303,802.84 元，第二层次 7,568,585.81 元，无第三层次）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(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 6 月 30 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。

§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	31,808,887.39	61.16
	其中：股票	31,808,887.39	61.16
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	20,090,318.42	38.63
7	其他各项资产	111,150.47	0.21
8	合计	52,010,356.28	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,362,421.94	53.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,710,618.00	3.46
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,667.25	0.02
J	金融业	26,266.50	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	935,300.46	1.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,765,613.24	5.59
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	31,808,887.39	64.33

7.2.2 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。

7.3 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	002007	华兰生物	133,320	4,186,248.00	8.47
2	300015	爱尔眼科	75,708	2,765,613.24	5.59
3	002590	万安科技	84,004	2,615,044.52	5.29
4	002138	顺络电子	143,300	2,598,029.00	5.25
5	002460	赣锋锂业	74,200	2,481,990.00	5.02
6	002407	多氟多	58,100	2,474,479.00	5.00
7	300224	正海磁材	105,900	2,400,753.00	4.86

8	300068	南都电源	105,000	2,295,300.00	4.64
9	600884	杉杉股份	114,740	1,974,675.40	3.99
10	000638	万方发展	72,300	1,710,618.00	3.46
11	300474	景嘉微	9,591	1,446,994.17	2.93
12	002436	兴森科技	47,700	1,087,083.00	2.20
13	600518	康美药业	66,900	1,016,211.00	2.06
14	300373	扬杰科技	40,900	986,099.00	1.99
15	300063	天龙集团	31,407	935,300.46	1.89
16	600699	均胜电子	13,600	520,880.00	1.05
17	300294	博雅生物	1,400	88,004.00	0.18
18	603023	威帝股份	4,500	86,670.00	0.18
19	002798	帝王洁具	398	34,506.60	0.07
20	002797	第一创业	650	26,266.50	0.05
21	300512	中亚股份	231	23,081.52	0.05
22	300515	三德科技	479	22,450.73	0.05
23	002799	环球印务	216	9,426.24	0.02
24	300518	盛讯达	185	8,667.25	0.02
25	002802	洪汇新材	462	6,966.96	0.01
26	000938	紫光股份	75	4,566.00	0.01
27	002805	丰元股份	511	2,963.80	0.01

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	300496	中科创达	7,756,459.00	8.99
2	002007	华兰生物	5,880,603.40	6.82
3	300315	掌趣科技	5,010,950.00	5.81
4	002292	奥飞娱乐	4,652,448.72	5.39
5	002468	艾迪西	4,636,911.70	5.38
6	002701	奥瑞金	4,458,907.70	5.17
7	601088	中国神华	4,376,165.50	5.07
8	002030	达安基因	3,747,061.40	4.34
9	300253	卫宁健康	3,633,493.80	4.21
10	002400	省广股份	3,559,271.00	4.13
11	600718	东软集团	3,311,578.86	3.84
12	000938	紫光股份	3,305,752.73	3.83

13	002439	启明星辰	3,143,868.00	3.64
14	300168	万达信息	3,138,115.00	3.64
15	002285	世联行	3,136,157.00	3.64
16	300467	迅游科技	3,135,021.00	3.63
17	300009	安科生物	3,134,597.00	3.63
18	300418	昆仑万维	3,134,411.50	3.63
19	300001	特锐德	3,134,053.00	3.63
20	300302	同有科技	3,132,177.00	3.63
21	300188	美亚柏科	3,131,872.00	3.63
22	300017	网宿科技	3,131,367.72	3.63
23	002236	大华股份	3,130,535.56	3.63
24	600028	中国石化	3,126,692.10	3.62
25	002590	万安科技	3,102,723.32	3.60
26	300133	华策影视	3,034,822.00	3.52
27	600661	新南洋	2,980,152.00	3.45
28	000687	华讯方舟	2,977,751.22	3.45
29	000558	莱茵体育	2,968,130.61	3.44
30	002624	完美环球	2,947,374.25	3.42
31	600570	恒生电子	2,813,353.00	3.26
32	300267	尔康制药	2,721,942.20	3.16
33	603598	引力传媒	2,702,941.75	3.13
34	603023	威帝股份	2,665,868.00	3.09
35	600074	保千里	2,628,431.00	3.05
36	000547	航天发展	2,606,771.00	3.02
37	600519	贵州茅台	2,518,518.92	2.92
38	300015	爱尔眼科	2,518,113.21	2.92
39	002304	洋河股份	2,516,272.40	2.92
40	002138	顺络电子	2,507,351.00	2.91
41	600348	阳泉煤业	2,484,728.00	2.88
42	601699	潞安环能	2,473,150.01	2.87
43	300224	正海磁材	2,466,433.45	2.86
44	300068	南都电源	2,465,701.00	2.86
45	002407	多氟多	2,463,780.00	2.86
46	002460	赣锋锂业	2,462,988.00	2.86
47	600535	天士力	2,435,674.96	2.82
48	002594	比亚迪	2,423,424.00	2.81

49	600804	鹏博士	2,422,102.00	2.81
50	300451	创业软件	2,381,766.00	2.76
51	600884	杉杉股份	2,200,827.38	2.55
52	002183	怡亚通	2,040,506.00	2.37
53	300296	利亚德	2,040,498.32	2.37
54	002311	海大集团	2,040,351.14	2.37
55	300229	拓尔思	1,976,025.30	2.29
56	600037	歌华有线	1,972,442.00	2.29
57	600387	海越股份	1,960,274.99	2.27
58	600482	中国动力	1,894,197.50	2.20
59	000983	西山煤电	1,875,572.62	2.17
60	000959	首钢股份	1,856,209.00	2.15
61	000070	特发信息	1,854,088.96	2.15
62	000892	星美联合	1,853,870.00	2.15
63	300024	机器人	1,853,115.00	2.15
64	600201	生物股份	1,852,626.00	2.15
65	300144	宋城演艺	1,852,049.00	2.15
66	600990	四创电子	1,850,834.00	2.15
67	000933	*ST 神火	1,845,400.86	2.14
68	000733	振华科技	1,840,389.00	2.13
69	002281	光迅科技	1,817,390.00	2.11
70	002049	紫光国芯	1,789,563.00	2.07
71	002123	荣信股份	1,759,762.00	2.04

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300496	中科创达	7,891,200.00	9.15
2	002292	奥飞娱乐	6,585,931.61	7.63
3	300315	掌趣科技	4,591,445.90	5.32
4	601088	中国神华	4,389,458.50	5.09
5	002701	奥瑞金	4,100,001.72	4.75
6	002468	艾迪西	4,015,803.57	4.66
7	300001	特锐德	3,819,601.00	4.43
8	300302	同有科技	3,726,201.00	4.32
9	300253	卫宁健康	3,602,689.00	4.18

10	002030	达安基因	3,588,868.14	4.16
11	600718	东软集团	3,526,578.00	4.09
12	002400	省广股份	3,363,308.00	3.90
13	600028	中国石化	3,302,232.00	3.83
14	000687	华讯方舟	3,270,660.65	3.79
15	002236	大华股份	3,232,356.77	3.75
16	300467	迅游科技	3,129,950.00	3.63
17	300017	网宿科技	3,078,494.00	3.57
18	002439	启明星辰	3,054,956.40	3.54
19	300418	昆仑万维	2,968,215.08	3.44
20	000938	紫光股份	2,967,223.90	3.44
21	002285	世联行	2,959,512.26	3.43
22	300168	万达信息	2,933,640.93	3.40
23	600570	恒生电子	2,917,801.06	3.38
24	002123	荣信股份	2,873,728.44	3.33
25	300009	安科生物	2,869,917.00	3.33
26	000558	莱茵体育	2,825,840.62	3.28
27	300133	华策影视	2,790,331.60	3.23
28	603023	威帝股份	2,782,211.00	3.23
29	600661	新南洋	2,773,314.00	3.22
30	000547	航天发展	2,725,058.36	3.16
31	002624	完美环球	2,604,493.00	3.02
32	600519	贵州茅台	2,600,625.00	3.01
33	600074	保千里	2,576,578.20	2.99
34	300188	美亚柏科	2,512,110.94	2.91
35	600804	鹏博士	2,486,005.54	2.88
36	002594	比亚迪	2,476,950.00	2.87
37	002304	洋河股份	2,442,858.70	2.83
38	601699	潞安环能	2,375,355.00	2.75
39	300267	尔康制药	2,366,901.02	2.74
40	600535	天士力	2,356,438.00	2.73
41	002311	海大集团	2,325,922.00	2.70
42	600348	阳泉煤业	2,324,984.00	2.70
43	000068	华控赛格	2,254,265.78	2.61
44	300368	汇金股份	2,208,688.42	2.56
45	002074	国轩高科	2,202,955.50	2.55
46	000567	海德股份	2,147,882.46	2.49
47	300451	创业软件	2,112,089.00	2.45

48	000988	华工科技	2,092,365.93	2.43
49	000050	深天马 A	2,056,667.60	2.38
50	002007	华兰生物	2,025,243.00	2.35
51	600387	海越股份	2,015,641.00	2.34
52	600037	歌华有线	2,004,478.00	2.32
53	603598	引力传媒	1,972,523.61	2.29
54	300291	华录百纳	1,933,694.56	2.24
55	300229	拓尔思	1,901,418.70	2.20
56	300207	欣旺达	1,890,819.88	2.19
57	300065	海兰信	1,882,990.65	2.18
58	002280	联络互动	1,870,964.54	2.17
59	300101	振芯科技	1,835,496.00	2.13
60	300136	信维通信	1,746,230.03	2.02
61	000070	特发信息	1,731,617.29	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	266,541,061.99
卖出股票收入（成交）总额	285,678,217.61

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。

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。

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未超出基金合同规定的备选股票库。

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	96,435.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,050.96
5	应收申购款	12,663.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	111,150.47

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	000638	万方发展	1,710,618.00	3.46	重大事项停牌

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
2,375	21,448.43	447,501.87	0.88%	50,492,529.00	99.12%

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	355.14	0.0007%

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（2014年5月27日）基金份额总额	351,679,073.44
本报告期期初基金份额总额	60,161,365.31
本报告期基金总申购份额	5,860,458.45
减：本报告期基金总赎回份额	15,081,792.89
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	50,940,030.87

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未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

本报告期本基金管理人的高级管理人员未有重大人事变动情况。

10.2.2 基金经理变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自2016年2月17日起，吴博文同志兼任长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，田间同志不再担任长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内本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。

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	
华泰联合	1	129,356,624.55	23.43%	120,469.51	23.43%	-
光大证券	1	422,748,092.73	76.57%	393,706.51	76.57%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰联合	-	-	-	-	-	-
光大证券	103.43	100.00%	-	-	-	-

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必要，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：无。

10.8 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项如下：

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	《证券日报》及本公司网站	2016年6月22日
2	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
3	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
4	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

5	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
6	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
7	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
8	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
9	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行基金通优惠活动的公告	同上	2016年5月17日
10	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
11	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
12	长盛基金管理有限公司关于增加	同上	2016年4月26日

	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		
13	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	同上	2016 年 4 月 22 日
14	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
15	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
16	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
17	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2015 年度报告摘要	同上	2016 年 3 月 26 日
18	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2015 年度报告	同上	2016 年 3 月 26 日
19	长盛基金管理有限公司关于联讯证券开通旗下部分开放式基金定投业务的公告	同上	2016 年 3 月 25 日
20	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
21	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	同上	2016 年 3 月 23 日

	投资基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告		
22	长盛基金管理有限公司关于增加长盛互联网+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
23	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
24	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
25	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
26	长盛基金管理有限公司关于增加平安证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投 转换业务并推出申购费率优惠活动的公告	同上	2016年2月25日
27	长盛基金管理有限公司关于调整长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理的公告	同上	2016年2月19日
28	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

29	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
30	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
31	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
32	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	同上	2016 年 1 月 20 日
33	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
34	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
35	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
36	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
37	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

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；

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

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司
2016年8月25日