

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	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.....	9
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.....	10
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.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
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.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43

§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.4 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.....	45
§9 开放式基金份额变动	45
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	48
§11 备查文件目录	49
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	49
11.3 查阅方式.....	50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	长盛沪深 300 指数 (LOF)
场内简称	长盛 300
基金主代码	160807
交易代码	160807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 8 月 4 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	49,329,177.36 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010-09-06

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资，跟踪沪深 300 指数，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%，以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是股票指数型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	张燕
	联系电话	010-82019988	0755-83199084
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-	95555

	62350088	
传真	010-82255988	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100088	518040
法定代表人	高新	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》
登载基金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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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	-1,991,168.76
本期利润	-14,230,368.56
加权平均基金份额本期利润	-0.2563
本期加权平均净值利润率	-24.85%
本期基金份额净值增长率	-15.47%
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	2,170,558.20
期末可供分配基金份额利润	0.0440
期末基金资产净值	51,499,735.56
期末基金份额净值	1.044
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	9.65%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。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	0.58%	0.97%	-0.46%	0.93%	1.04%	0.04%
过去三个月	-1.60%	1.07%	-1.86%	0.96%	0.26%	0.11%
过去六个月	-15.47%	1.89%	-14.64%	1.75%	-0.83%	0.14%
过去一年	-28.35%	2.38%	-27.96%	2.19%	-0.39%	0.19%
过去三年	41.66%	1.84%	42.13%	1.75%	-0.47%	0.09%
自基金合同生效起至今	9.65%	1.58%	11.44%	1.54%	-1.79%	0.04%

注：本基金业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

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 95%、5%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



注：按照本基金合同规定，本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约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十三条（二）投资范围、（七）投资限制的有关约定。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
冯雨生	本基金基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理。	2011 年 12 月 20 日	-	9 年	男，1983 年 11 月出生，中国国籍。北京大学金融学硕士。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。现任长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF，本基金）基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理。

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，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

上半年一季度股票市场整体大幅下跌，基因检测、传感器和大数据板块大幅下跌，装饰园林、黄金珠宝和充电桩概念板块跌幅较少。行业上，计算机、通信和传媒等行业跌幅靠前，食品饮料、银行和采掘跑赢市场。二季度股票市场整体上平盘震荡，新材料、锂电池、黄金珠宝和传感器等概念板块涨幅居前，自贸区、高铁和网络游戏概念板块大幅下跌。行业上，食品饮料、有色金属

和电子等行业涨幅靠前，传媒、建筑和休闲服务等行业跑输市场。风格上，整个上半年大盘股跑赢小盘股。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.044 元，本报告期份额净值增长率为-15.47%，同期业绩比较基准增长率为-14.64%。本报告期内日均跟踪误差为 0.1542%，年度化跟踪误差为 2.4381%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济仍然面临稳增长和调结构的双重压力，美国经济数据好转和中国企业债务风险使得资金外流的压力也在增加，但宽松的货币供给有利于提升估值。我们维持之前的看法，认为股市仍会出现大幅震荡。下半年选股会兼顾估值和成长性，利用量化的方法精选个股。

作为指数基金，我们将继续秉承指数化投资策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，控制基金的跟踪误差。

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十七条中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期末未实施利润分配。

本基金截至 2016 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 2,170,558.20 元，其中，未分配利润已实现部分为 25,858,490.68 元，未分配利润未实现部分为 -23,687,932.48 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

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	4,591,637.08	5,870,938.52
结算备付金		-	-
存出保证金		7,238.59	30,646.54
交易性金融资产	6.4.7.2	47,243,532.84	82,287,923.69
其中：股票投资		47,243,532.84	82,219,108.49
基金投资		-	-
债券投资		-	68,815.20
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	922.84	1,205.97
应收股利		-	-
应收申购款		2,880.99	44,322.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		51,846,212.34	88,235,037.61
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		-	-
应付赎回款		112,612.07	65,356.47
应付管理人报酬		31,444.68	56,151.76
应付托管费		6,288.95	11,230.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,959.08	10,968.49
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	194,172.00	230,159.23
负债合计		346,476.78	373,866.30
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	49,329,177.36	71,166,050.02
未分配利润	6.4.7.10	2,170,558.20	16,695,121.29
所有者权益合计		51,499,735.56	87,861,171.31
负债和所有者权益总计		51,846,212.34	88,235,037.61

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.044 元，基金份额总额 49,329,177.36 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)

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		-13,738,863.22	53,862,478.05
1.利息收入		16,010.45	50,364.93
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,972.56	50,359.93
债券利息收入		37.89	5.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,533,695.50	66,802,731.35
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,016,554.88	65,514,681.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,011.02	-
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	476,848.36	1,288,049.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-12,239,199.80	-13,194,961.83
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	18,021.63	204,343.60
减：二、费用		491,505.34	1,634,425.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	215,782.79	815,651.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	43,156.56	163,130.24

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	42,131.31	462,026.05
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	190,434.68	193,617.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,230,368.56	52,228,052.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,230,368.56	52,228,052.89

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

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）	71,166,050.02	16,695,121.29	87,861,171.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-14,230,368.56	-14,230,368.56
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）	-21,836,872.66	-294,194.53	-22,131,067.19
其中：1.基金申购款	4,655,122.52	139,672.44	4,794,794.96
2.基金赎回款	-26,491,995.18	-433,866.97	-26,925,862.15
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）	49,329,177.36	2,170,558.20	51,499,735.56
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	192,732,025.26	32,917,776.24	225,649,801.50

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	52,228,052.89	52,228,052.89
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)	-92,265,722.09	-39,190,785.78	-131,456,507.87
其中:1.基金申购款	83,705,452.70	20,177,339.29	103,882,791.99
2.基金赎回款	-175,971,174.79	-59,368,125.07	-235,339,299.86
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)	100,466,303.17	45,955,043.35	146,421,346.52

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

长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2010]第 646 号《关于核准长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)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《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)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募集人民币 898,648,405.80 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(2010)第 193 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2010 年 8 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 898,915,869.33 份基金份额,其中认购资金利息折合 267,463.53 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第 276 号文审核同意,本基金 112,932,582 份基金份额于 2010 年 9 月 6 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)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、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票资产投资比例不低于基金资产净值的 90%,其中,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%;保持不低于基金资产净值 5%的现金以及到期日在一年以内的政府债券。本基金力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%,且年化跟踪误差小于 4%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 95%+一年期银行定期存款利率(税后) \times 5%。本基金标的指数使用费由基金管理人长盛基金管理有限公司承担,不计入本基金费用。

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(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》、《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会、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。

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、完整的反映了本基金 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

本基金本报告期不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期不存在会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期不存在会计差错更正。

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	4,591,637.08
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-

其他存款	-
合计:	4,591,637.08

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	47,772,909.77	47,243,532.84	-529,376.93
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	47,772,909.77	47,243,532.84	-529,376.93

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

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注: 本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注: 本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

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	917.96
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	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1.68
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3.20

合计	922.84
----	--------

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	1,959.08
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,959.08

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	271.32
其他	4,941.00
预提费用	188,959.68
合计	194,172.00

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	71,166,050.02	71,166,050.02
本期申购	4,655,122.52	4,655,122.52
本期赎回(以“-”号填列)	-26,491,995.18	-26,491,995.18
本期末	49,329,177.36	49,329,177.36

注：截至 2016 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 2,401,300.00 份（2015 年 12 月 31 日：2,870,471.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 46,927,877.36 份（2015 年 12 月 31 日：68,295,579.02 份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

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	40,045,828.56	-23,350,707.27	16,695,121.29
本期利润	-1,991,168.76	-12,239,199.80	-14,230,368.56
本期基金份额交易产生的变动数	-12,196,169.12	11,901,974.59	-294,194.53
其中：基金申购款	2,508,836.36	-2,369,163.92	139,672.44
基金赎回款	-14,705,005.48	14,271,138.51	-433,866.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,858,490.68	-23,687,932.48	2,170,558.20

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	15,843.69
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	45.46
其他	83.41
合计	15,972.56

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	20,853,441.56
减：卖出股票成本总额	22,869,996.44
买卖股票差价收入	-2,016,554.88

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	6,011.02
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	6,011.02

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	81,478.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	75,381.93
减：应收利息总额	85.05
买卖债券差价收入	6,011.02

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	476,848.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	476,848.36

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	-12,239,199.80
——股票投资	-12,225,766.53
——债券投资	-13,433.27
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-12,239,199.80

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	16,981.15

转换费	1,040.48
基金转换费收入	-
其他	-
合计	18,021.63

注：1、本基金的场内赎回费率为 0.5%，场外赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

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	42,131.31
银行间市场交易费用	-
合计	42,131.31

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	134,261.40
上市费	29,835.26
银行汇划费	1,475.00
合计	190,434.68

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”)	基金管理人、基金销售机构
招商银行	基金托管人、基金代销机构
国元证券	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国元证券	14,172,073.36	67.96%	193,215,227.81	73.61%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	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 成交总额的 比例
国元证券	81,478.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间内未通过关联方交易单元发生权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国元证券	13,197.23	67.96%	1,223.10	62.43%

关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国元证券	175,901.91	73.61%	84,090.03	72.24%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	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管理费	215,782.79	815,651.33
其中：支付销售机构的客户维护费	103,663.57	257,722.59

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.75% 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：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.75% / 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	43,156.56	163,130.24

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 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：本基金本报告期及上年度可比期间内均无与关联方进行的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**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2010 年 8 月 4 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	20,375,426.62	11,375,426.62
期间申购/买入总份额	-	9,000,000.00
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	20,375,426.62	-
期末持有的基金份额	-	20,375,426.62
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	20.2800%

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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
招商银行	4,591,637.08	15,843.69	36,496,540.12	48,456.56

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期无利润分配事项。

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

注：本基金本期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

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
000002	万科 A	2015 年 12 月 18 日	重大事项停牌	18.20	2016 年 7 月 4 日	21.99	66,148	680,536.59	1,203,893.60	-
000651	格力电器	2016 年 2 月 22 日	重大事项停牌	22.07	-	-	25,618	352,134.57	565,389.26	-
600649	城投控股	2016 年 6 月 20 日	重大事项停牌	14.36	-	-	11,916	88,459.08	171,113.76	-
002065	东华软件	2015 年 12 月 22 日	重大事项停牌	18.72	2016 年 7 月 4 日	22.59	7,941	165,639.68	148,655.52	-
002465	海格通信	2016 年 6 月 13 日	重大事项停牌	12.44	-	-	10,876	106,451.72	135,297.44	-
600019	宝钢股份	2016 年 6 月 27 日	重大事项停牌	4.90	-	-	26,041	156,860.77	127,600.90	-
000415	渤海金控	2016 年 2 月 1 日	重大事项停牌	6.99	2016 年 8 月 11 日	7.50	9,900	86,625.00	69,201.00	-
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项停牌	9.07	-	-	7,286	75,684.92	66,084.02	-

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵债的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵债的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为抽样复制的指数型基金，采用抽样复制指数的投资策略，跟踪沪深 300 指数。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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行招商银行，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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2015 年 12 月 31 日，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为 0.08 %），因此不存在重大信用风险（2015 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 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	4,591,637.08	-	-	-	4,591,637.08
存出保证金	7,238.59	-	-	-	7,238.59
交易性金融资产	-	-	-	47,243,532.84	47,243,532.84
应收利息	-	-	-	922.84	922.84
应收申购款	-	-	-	2,880.99	2,880.99
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,598,875.67	-	-	47,247,336.67	51,846,212.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	112,612.07	112,612.07
应付管理人报酬	-	-	-	31,444.68	31,444.68
应付托管费	-	-	-	6,288.95	6,288.95
应付交易费用	-	-	-	1,959.08	1,959.08
其他负债	-	-	-	194,172.00	194,172.00
负债总计	-	-	-	346,476.78	346,476.78
利率敏感度缺口	4,598,875.67	-	-	46,900,859.89	51,499,735.56
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	5,870,938.52	-	-	-	5,870,938.52
存出保证金	30,646.54	-	-	-	30,646.54
交易性金融资产	-	-	68,815.20	82,219,108.49	82,287,923.69
应收利息	-	-	-	1,205.97	1,205.97
应收申购款	842.63	-	-	43,480.26	44,322.89
资产总计	5,902,427.69	-	68,815.20	82,263,794.72	88,235,037.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	65,356.47	65,356.47
应付管理人报酬	-	-	-	56,151.76	56,151.76
应付托管费	-	-	-	11,230.35	11,230.35
应付交易费用	-	-	-	10,968.49	10,968.49
其他负债	-	-	-	230,159.23	230,159.23
负债总计	-	-	-	373,866.30	373,866.30
利率敏感度缺口	5,902,427.69	-	68,815.20	81,889,928.42	87,861,171.31

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.08%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用抽样复制指数的投资策略，股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例占基金资产净值的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 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	47,243,532.84	91.74	82,219,108.49	93.58
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	47,243,532.84	91.74	82,219,108.49	93.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,770,413.09	4,670,699.87
	业绩比较基准下降 5%	-2,770,413.09	-4,670,699.87

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 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 44,756,297.34 元，属于第二层次的余额为 2,487,235.50 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日，第一层次的余额为 76,920,138.04 元第二层次的余额为

5,367,785.65 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层级间的重大变动

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	47,243,532.84	91.12
	其中：股票	47,243,532.84	91.12
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	4,591,637.08	8.86
7	其他各项资产	11,042.42	0.02
8	合计	51,846,212.34	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	45,524.96	0.09
B	采矿业	1,502,143.81	2.92
C	制造业	15,803,526.75	30.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,614,049.90	3.13
E	建筑业	1,440,277.00	2.80
F	批发和零售业	1,312,530.29	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	1,528,795.62	2.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,110,250.18	6.04
J	金融业	16,042,948.21	31.15
K	房地产业	2,906,534.51	5.64
L	租赁和商务服务业	464,275.31	0.90
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	398,157.24	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	112,621.99	0.22
R	文化、体育和娱乐业	767,987.85	1.49
S	综合	193,909.22	0.38
	合计	47,243,532.84	91.74

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	59,000	1,890,360.00	3.67
2	600016	民生银行	173,052	1,545,354.36	3.00

3	600000	浦发银行	99,178	1,544,201.46	3.00
4	601166	兴业银行	83,533	1,273,042.92	2.47
5	000002	万科A	66,148	1,203,893.60	2.34
6	600837	海通证券	53,002	817,290.84	1.59
7	600519	贵州茅台	2,782	812,121.44	1.58
8	601328	交通银行	127,803	719,530.89	1.40
9	600030	中信证券	42,807	694,757.61	1.35
10	601288	农业银行	179,140	573,248.00	1.11
11	000651	格力电器	25,618	565,389.26	1.10
12	601169	北京银行	51,122	530,135.14	1.03
13	601398	工商银行	117,751	522,814.44	1.02
14	600887	伊利股份	31,342	522,471.14	1.01
15	000333	美的集团	20,391	483,674.52	0.94
16	002450	康得新	28,012	479,005.20	0.93
17	300104	乐视网	8,800	465,608.00	0.90
18	601601	中国太保	16,044	433,829.76	0.84
19	601766	中国中车	44,931	412,017.27	0.80
20	601668	中国建筑	73,523	391,142.36	0.76
21	601818	光大银行	99,499	374,116.24	0.73
22	601988	中国银行	115,388	370,395.48	0.72
23	600276	恒瑞医药	8,794	352,727.34	0.68
24	600104	上汽集团	17,043	345,802.47	0.67
25	600900	长江电力	27,263	340,514.87	0.66
26	000001	平安银行	37,579	326,937.30	0.63
27	601989	中国重工	50,234	317,981.22	0.62
28	000858	五粮液	9,603	312,385.59	0.61
29	001979	招商蛇口	21,568	307,344.00	0.60
30	600153	建发股份	25,521	306,252.00	0.59
31	300059	东方财富	13,680	303,696.00	0.59
32	601688	华泰证券	15,962	302,001.04	0.59
33	000725	京东方A	128,788	297,500.28	0.58
34	000776	广发证券	17,465	292,713.40	0.57
35	002415	海康威视	13,260	284,559.60	0.55
36	600271	航天信息	11,832	281,601.60	0.55
37	600048	保利地产	32,274	278,524.62	0.54
38	600518	康美药业	17,576	266,979.44	0.52
39	600015	华夏银行	26,881	265,853.09	0.52
40	002024	苏宁云商	24,264	263,507.04	0.51
41	600028	中国石化	53,264	251,406.08	0.49

42	000783	长江证券	21,594	250,490.40	0.49
43	600637	东方明珠	10,187	247,238.49	0.48
44	000063	中兴通讯	16,588	237,871.92	0.46
45	601390	中国中铁	33,557	233,892.29	0.45
46	601939	建设银行	49,103	233,239.25	0.45
47	600570	恒生电子	3,128	208,856.56	0.41
48	601006	大秦铁路	31,598	203,491.12	0.40
49	601377	兴业证券	27,073	200,069.47	0.39
50	002594	比亚迪	3,203	195,415.03	0.38
51	002304	洋河股份	2,697	193,968.24	0.38
52	300017	网宿科技	2,879	193,468.80	0.38
53	000166	申万宏源	22,911	192,681.51	0.37
54	000839	中信国安	8,964	191,022.84	0.37
55	601628	中国人寿	9,099	189,441.18	0.37
56	601336	新华保险	4,673	188,789.20	0.37
57	600739	辽宁成大	12,094	188,303.58	0.37
58	002230	科大讯飞	5,706	187,442.10	0.36
59	002673	西部证券	7,156	185,054.16	0.36
60	601857	中国石油	25,365	183,388.95	0.36
61	601985	中国核电	26,500	180,995.00	0.35
62	300003	乐普医疗	9,800	178,752.00	0.35
63	600109	国金证券	13,239	178,461.72	0.35
64	600485	信威集团	9,943	177,383.12	0.34
65	000538	云南白药	2,748	176,696.40	0.34
66	000876	新希望	21,214	176,500.48	0.34
67	600100	同方股份	11,653	174,328.88	0.34
68	000100	TCL 集团	52,635	173,169.15	0.34
69	300027	华谊兄弟	12,711	172,106.94	0.33
70	600649	城投控股	11,916	171,113.76	0.33
71	600050	中国联通	44,548	169,727.88	0.33
72	300024	机器人	6,618	168,031.02	0.33
73	600340	华夏幸福	6,888	167,929.44	0.33
74	601009	南京银行	17,845	167,564.55	0.33
75	601899	紫金矿业	49,609	167,182.33	0.32
76	600066	宇通客车	8,398	166,280.40	0.32
77	601088	中国神华	11,778	165,716.46	0.32
78	600011	华能国际	21,594	162,386.88	0.32
79	000625	长安汽车	11,838	161,825.46	0.31
80	600703	三安光电	8,066	161,078.02	0.31

81	601211	国泰君安	8,900	158,331.00	0.31
82	000963	华东医药	2,333	157,244.20	0.31
83	600111	北方稀土	11,770	156,658.70	0.30
84	601186	中国铁建	15,681	156,182.76	0.30
85	000768	中航飞机	7,865	154,861.85	0.30
86	600547	山东黄金	3,976	154,706.16	0.30
87	000423	东阿阿胶	2,917	154,105.11	0.30
88	002142	宁波银行	10,413	153,904.14	0.30
89	002241	歌尔股份	5,352	153,495.36	0.30
90	000069	华侨城 A	23,899	152,953.60	0.30
91	600029	南方航空	21,599	152,488.94	0.30
92	600690	青岛海尔	16,992	150,888.96	0.29
93	000917	电广传媒	9,072	149,960.16	0.29
94	002065	东华软件	7,941	148,655.52	0.29
95	600705	中航资本	25,216	148,270.08	0.29
96	600585	海螺水泥	10,189	148,148.06	0.29
97	600177	雅戈尔	10,702	147,580.58	0.29
98	601901	方正证券	19,239	147,370.74	0.29
99	002456	欧菲光	4,995	147,352.50	0.29
100	002202	金风科技	9,703	146,806.39	0.29
101	600010	包钢股份	50,998	145,854.28	0.28
102	600663	陆家嘴	6,403	145,668.25	0.28
103	600795	国电电力	49,628	145,410.04	0.28
104	002236	大华股份	11,022	144,388.20	0.28
105	600085	同仁堂	4,774	142,217.46	0.28
106	600867	通化东宝	6,798	140,650.62	0.27
107	601018	宁波港	28,397	140,565.15	0.27
108	600115	东方航空	21,031	139,014.91	0.27
109	002500	山西证券	8,300	137,448.00	0.27
110	600369	西南证券	18,798	136,473.48	0.26
111	601111	中国国航	20,096	135,848.96	0.26
112	002465	海格通信	10,876	135,297.44	0.26
113	600009	上海机场	5,153	134,235.65	0.26
114	600118	中国卫星	3,994	134,198.40	0.26
115	600804	鹏博士	7,339	133,789.97	0.26
116	300070	碧水源	8,948	133,146.24	0.26
117	002252	上海莱士	3,522	132,708.96	0.26
118	600886	国投电力	19,863	131,095.80	0.25
119	600893	中航动力	3,741	129,625.65	0.25

120	600352	浙江龙盛	15,012	129,403.44	0.25
121	601888	中国国旅	2,914	128,157.72	0.25
122	600019	宝钢股份	26,041	127,600.90	0.25
123	600535	天士力	3,543	126,697.68	0.25
124	000559	万向钱潮	8,104	126,422.40	0.25
125	601099	太平洋	20,380	124,929.40	0.24
126	002008	大族激光	5,301	121,074.84	0.24
127	000686	东北证券	9,378	121,069.98	0.24
128	600089	特变电工	14,199	120,975.48	0.23
129	601555	东吴证券	9,018	120,841.20	0.23
130	601727	上海电气	15,905	120,241.80	0.23
131	600060	海信电器	6,795	120,135.60	0.23
132	000402	金融街	12,230	118,875.60	0.23
133	600196	复星医药	6,191	117,752.82	0.23
134	600383	金地集团	11,345	117,534.20	0.23
135	601669	中国电建	20,369	116,306.99	0.23
136	600415	小商品城	18,622	115,083.96	0.22
137	002736	国信证券	6,600	113,850.00	0.22
138	300124	汇川技术	5,824	112,985.60	0.22
139	002007	华兰生物	3,595	112,883.00	0.22
140	300015	爱尔眼科	3,083	112,621.99	0.22
141	000826	启迪桑德	3,668	112,057.40	0.22
142	000568	泸州老窖	3,756	111,553.20	0.22
143	600398	海澜之家	9,837	111,158.10	0.22
144	002081	金螳螂	11,040	110,620.80	0.21
145	600718	东软集团	5,994	109,810.08	0.21
146	601618	中国中冶	29,659	109,441.71	0.21
147	600362	江西铜业	8,007	107,934.36	0.21
148	000009	中国宝安	7,793	106,764.10	0.21
149	002475	立讯精密	5,401	106,129.65	0.21
150	601021	春秋航空	2,200	105,468.00	0.20
151	002153	石基信息	3,981	105,018.78	0.20
152	000793	华闻传媒	10,582	104,550.16	0.20
153	000623	吉林敖东	4,185	104,415.75	0.20
154	600309	万华化学	6,022	104,180.60	0.20
155	600406	国电南瑞	7,788	104,125.56	0.20
156	600660	福耀玻璃	7,363	103,082.00	0.20
157	600031	三一重工	20,478	102,799.56	0.20
158	000778	新兴铸管	22,000	102,080.00	0.20

159	000750	国海证券	13,717	101,368.63	0.20
160	000792	盐湖股份	4,787	101,005.70	0.20
161	600588	用友网络	5,150	100,837.00	0.20
162	601998	中信银行	17,645	100,047.15	0.19
163	002385	大北农	12,406	99,992.36	0.19
164	600674	川投能源	12,066	99,665.16	0.19
165	600958	东方证券	5,900	99,179.00	0.19
166	000338	潍柴动力	12,696	99,155.76	0.19
167	600221	海南航空	31,268	99,119.56	0.19
168	000425	徐工机械	32,326	98,917.56	0.19
169	000413	东旭光电	11,492	98,716.28	0.19
170	601633	长城汽车	11,680	98,579.20	0.19
171	000157	中联重科	23,808	98,327.04	0.19
172	300058	蓝色光标	10,109	98,158.39	0.19
173	601607	上海医药	5,399	97,451.95	0.19
174	600688	上海石化	15,898	96,977.80	0.19
175	000709	河钢股份	34,675	96,049.75	0.19
176	601600	中国铝业	25,463	95,995.51	0.19
177	000060	中金岭南	9,192	95,872.56	0.19
178	000712	锦龙股份	4,600	95,496.00	0.19
179	002292	奥飞娱乐	3,110	93,144.50	0.18
180	000895	双汇发展	4,447	92,853.36	0.18
181	600873	梅花生物	14,612	90,740.52	0.18
182	601933	永辉超市	21,934	90,587.42	0.18
183	600150	中国船舶	4,052	90,197.52	0.18
184	600256	广汇能源	21,696	88,953.60	0.17
185	000039	中集集团	6,162	87,315.54	0.17
186	300002	神州泰岳	8,200	87,248.00	0.17
187	000738	中航动控	3,300	87,120.00	0.17
188	600489	中金黄金	7,701	86,559.24	0.17
189	601919	中国远洋	17,000	86,360.00	0.17
190	002470	金正大	10,692	86,070.60	0.17
191	600068	葛洲坝	14,732	85,740.24	0.17
192	601800	中国交建	8,033	84,587.49	0.16
193	600583	海油工程	12,032	83,141.12	0.16
194	600741	华域汽车	5,929	83,065.29	0.16
195	600252	中恒集团	19,049	82,672.66	0.16
196	600038	中直股份	1,924	79,807.52	0.15
197	601333	广深铁路	20,317	79,439.47	0.15

198	600373	中文传媒	3,749	77,791.75	0.15
199	600875	东方电气	7,842	77,008.44	0.15
200	601098	中南传媒	4,154	75,228.94	0.15
201	000046	泛海控股	7,400	74,814.00	0.15
202	300133	华策影视	4,803	74,782.71	0.15
203	601216	君正集团	10,004	74,729.88	0.15
204	600157	永泰能源	18,880	74,387.20	0.14
205	600023	浙能电力	14,588	74,252.92	0.14
206	600600	青岛啤酒	2,538	73,779.66	0.14
207	600332	白云山	2,963	73,008.32	0.14
208	600018	上港集团	14,191	72,374.10	0.14
209	601106	中国一重	13,800	71,898.00	0.14
210	300251	光线传媒	6,110	70,631.60	0.14
211	600642	申能股份	12,233	70,217.42	0.14
212	002422	科伦药业	4,550	70,115.50	0.14
213	601718	际华集团	9,100	69,524.00	0.13
214	600208	新湖中宝	16,418	69,448.14	0.13
215	000415	渤海金控	9,900	69,201.00	0.13
216	002146	荣盛发展	10,256	68,920.32	0.13
217	601866	中海集运	16,856	66,749.76	0.13
218	002294	信立泰	2,449	66,612.80	0.13
219	603000	人民网	4,004	66,506.44	0.13
220	002129	中环股份	7,286	66,084.02	0.13
221	600372	中航电子	3,362	65,458.14	0.13
222	600827	百联股份	5,316	64,217.28	0.12
223	002739	万达院线	800	63,920.00	0.12
224	601991	大唐发电	15,700	61,073.00	0.12
225	300146	汤臣倍健	4,476	60,605.04	0.12
226	000800	一汽轿车	5,514	59,992.32	0.12
227	601117	中国化学	10,841	59,950.73	0.12
228	000999	华润三九	2,456	59,484.32	0.12
229	601258	庞大集团	21,246	58,426.50	0.11
230	601872	招商轮船	12,400	58,032.00	0.11
231	000630	铜陵有色	22,250	56,515.00	0.11
232	000729	燕京啤酒	7,389	56,082.51	0.11
233	601225	陕西煤业	10,617	54,889.89	0.11
234	300144	宋城演艺	2,200	54,802.00	0.11
235	601992	金隅股份	7,071	54,800.25	0.11
236	600863	内蒙华电	18,061	54,544.22	0.11

237	600027	华电国际	11,015	54,524.25	0.11
238	002195	二三四五	4,400	54,076.00	0.11
239	000061	农产品	4,414	53,674.24	0.10
240	601928	凤凰传媒	5,075	53,490.50	0.10
241	601898	中煤能源	10,267	52,977.72	0.10
242	002399	海普瑞	3,009	52,537.14	0.10
243	300315	掌趣科技	5,000	52,450.00	0.10
244	601179	中国西电	10,331	52,378.17	0.10
245	600021	上海电力	5,000	51,350.00	0.10
246	000883	湖北能源	10,818	50,087.34	0.10
247	600648	外高桥	2,470	48,683.70	0.09
248	600783	鲁信创投	2,192	47,369.12	0.09
249	600820	隧道股份	5,600	46,984.00	0.09
250	601118	海南橡胶	8,144	45,524.96	0.09
251	600170	上海建工	11,861	45,427.63	0.09
252	600578	京能电力	10,465	44,790.20	0.09
253	601808	中海油服	3,550	43,132.50	0.08
254	600008	首创股份	10,974	42,688.86	0.08
255	000027	深圳能源	6,663	42,509.94	0.08
256	601958	金钼股份	4,983	40,611.45	0.08
257	600895	张江高科	2,200	39,776.00	0.08
258	600998	九州通	2,162	37,856.62	0.07
259	000540	中天城投	5,600	34,888.00	0.07
260	600317	营口港	10,300	34,608.00	0.07
261	600959	江苏有线	2,200	30,712.00	0.06
262	600188	兖州煤业	2,644	28,925.36	0.06
263	603993	洛阳钼业	6,305	26,165.75	0.05
264	601198	东兴证券	900	21,996.00	0.04
265	603885	吉祥航空	800	21,000.00	0.04
266	000156	华数传媒	1,115	20,683.25	0.04
267	601608	中信重工	1,500	8,055.00	0.02
268	601016	节能风电	800	7,944.00	0.02

7.3.2 期末积极投资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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	601377	兴业证券	77,248.08	0.09
2	601099	太平洋	28,747.20	0.03
3	000686	东北证券	14,192.04	0.02

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	601318	中国平安	899,732.00	1.02
2	600016	民生银行	877,142.00	1.00
3	601166	兴业银行	622,317.00	0.71
4	601288	农业银行	396,845.00	0.45
5	600837	海通证券	347,296.00	0.40
6	601328	交通银行	342,486.00	0.39
7	600030	中信证券	330,042.00	0.38
8	600519	贵州茅台	266,521.00	0.30
9	601169	北京银行	246,327.00	0.28
10	601398	工商银行	242,641.00	0.28
11	601766	中国中车	227,873.00	0.26
12	600887	伊利股份	212,946.00	0.24
13	000651	格力电器	201,420.00	0.23
14	601668	中国建筑	199,145.00	0.23
15	000503	海虹控股	190,811.30	0.22
16	601601	中国太保	190,408.00	0.22
17	601988	中国银行	189,695.00	0.22
18	000333	美的集团	187,876.00	0.21
19	601818	光大银行	180,556.00	0.21
20	000725	京东方 A	170,576.00	0.19

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	120,187.32
卖出股票收入（成交）总额	20,853,441.56

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

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，配置了沪深 300 指数成分股海通证券。2015 年 9 月 10 日，海通证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书（处罚字【2015】73 号），海通证券涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案，对海通证券责令改正，给予警告，没收违法所得 28,653,000 元，并处以 85,959,000 元罚款。本基金做出如下说明：海通证券是中国最大、最优秀的证券公司之一，综合实力强，竞争优势明显，本次处罚对海通证券的影响较小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，配置了沪深 300 指数成分股中信证券。根据 2015 年 1 月 16 日中国证券监督管理委员会 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，对中信证券采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。2015 年 8 月 25 日，公司有几名高级管理人员和员工被公安机关要求协助调查有关问题，调查工作尚在进行之中。2015 年 9 月 15 日，公司总经理程博明、经纪业务发展与管理委员会运营管理部负责人于新利、信息技术中心汪锦岭等人因涉嫌内幕交易、泄露内幕信息被公安机关依法要求接受调查。本基金做出如下说明：上述事件尚未有最终结论，我们将密切跟踪事件进展，避免潜在风险。

除上述事项外，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。

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	7,238.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	922.84
5	应收申购款	2,880.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	11,042.42
---	----	-----------

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资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	000002	万 科 A	1,203,893.60	2.34	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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
3,222	15,310.11	2,924,353.65	5.93%	46,404,823.71	94.07%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	杨静芳	990,049.00	41.23%
2	深圳市点通数据有限公司	147,600.00	6.15%
3	陈梅芳	100,005.00	4.16%
4	马曦琴	70,000.00	2.92%
5	曲秋霞	67,010.00	2.79%
6	师永梅	66,172.00	2.76%
7	李泽华	66,007.00	2.75%
8	缪晏	60,000.00	2.50%
9	程栋	50,011.00	2.08%

10	吴辉	50,003.00	2.08%
----	----	-----------	-------

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 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	889,307.14	1.8028%

8.4 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年8月4日）基金份额总额	898,915,869.33
本报告期期初基金份额总额	71,166,050.02
本报告期基金总申购份额	4,655,122.52
减：本报告期基金总赎回份额	26,491,995.18
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	49,329,177.36

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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	
国元证券	1	14,172,073.36	67.96%	13,197.23	67.96%	-
招商证券	1	6,681,368.20	32.04%	6,222.38	32.04%	-

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
国元证券	81,478.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	华泰证券	上海	1

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旗下基金参加联泰资产费率优惠活动的公告	《中国证券报》 《上海证券报》 《证券时报》及本公司网站	2016 年 6 月 20 日

2	长盛基金管理有限公司关于增加中证金牛为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 5 月 27 日
3	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
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 5 月 13 日
5	长盛基金管理有限公司关于增加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 5 月 9 日
6	长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2016 年第 1 季度报告	同上	2016 年 4 月 22 日
7	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
8	长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2015 年度报告摘要	同上	2016 年 3 月 26 日
9	长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2015 年度报告	同上	2016 年 3 月 26 日
10	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
11	长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)招募说明书更新摘要	同上	2016 年 3 月 19 日
12	长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)招募说明书更新	同上	2016 年 3 月 19 日
13	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
14	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
15	长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)2015 年第 4 季度报告	同上	2016 年 1 月 20 日
16	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

17	关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	同上	2016 年 1 月 6 日
18	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
19	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、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）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和/或基金托管人的办公地址。

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司
2016 年 8 月 25 日