

# 长盛城镇化主题混合型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长盛城镇化主题混合
基金主代码	000354
交易代码	000354
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 12 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	118,160,235.87 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于城镇化主题上市公司股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>(1) 本基金将通过分析宏、微观经济指标、市场指标和政策走向等因素，动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>(2) 股票投资上，本基金投资于城镇化主题上市公司股票的比例将不低于非现金基金资产的 80%。本基金将充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，从公司基本状况和股票估值两个方面筛选具有长期持续增长能力的公司，组建并动态调整城镇化主题优选股票库，并根据市场波动情况精选个股，进而构建股票投资组合。</p>
业绩比较基准	80%*沪深 300 指数收益率+20%*中证综合债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	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

## 2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-5,838,892.01	231,999,762.81	175,575,275.39
本期利润	-13,577,597.71	189,630,041.20	225,324,526.57
加权平均基金份额本期利润	-0.0632	0.9695	0.2113
本期基金份额净值增长率	-3.38%	53.35%	31.55%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2861	0.3308	0.2070
期末基金资产净值	151,967,404.43	285,833,992.25	551,259,284.08
期末基金份额净值	1.286	1.331	1.246

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.62%	0.73%	1.13%	0.58%	-1.75%	0.15%
过去六个月	1.42%	0.71%	4.11%	0.61%	-2.69%	0.10%
过去一年	-3.38%	1.41%	-8.39%	1.12%	5.01%	0.29%
过去三年	94.91%	1.67%	40.23%	1.43%	54.68%	0.24%
自基金合同生效起至今	96.08%	1.63%	40.79%	1.41%	55.29%	0.22%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

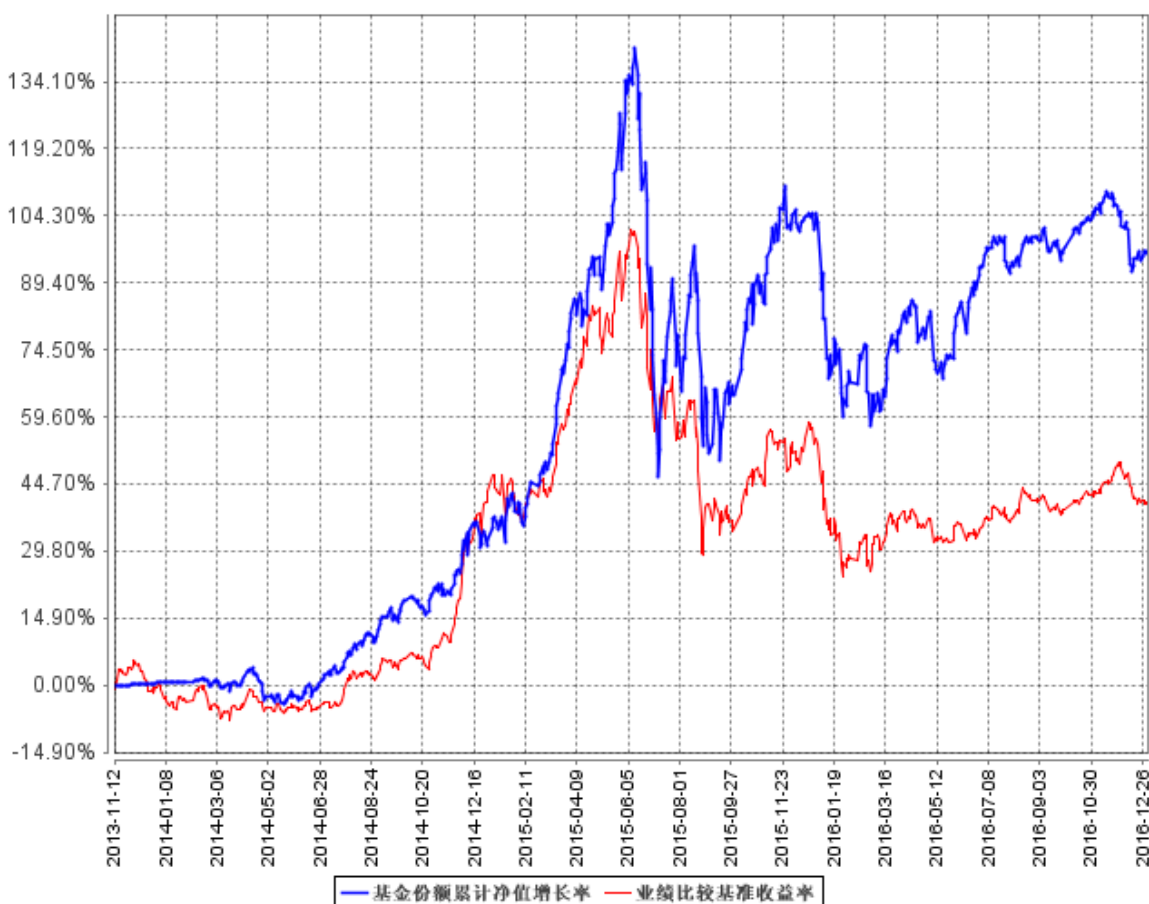
本基金业绩比较基准：80%\*沪深 300 指数收益率+20%\*中证综合债指数收益率

基准指数的构建考虑了三个原则：

- 1、公允性。本基金主要投资于城镇化主题上市公司股票，投资标的与沪深 300 指数成分股重合度较高。因此，沪深 300 指数适合作为本基金的业绩比较基准。
- 2、可比性。本基金是混合型基金，基金在运作过程中将维持 60%-95%的权益类资产，其余资产投资于债券及其他具有高流动性的短期金融工具。本基金将业绩比较基准中股票指数与债券指数的权重确定为 80%和 20%，并用中证综合债指数收益率代表债券资产收益率。因此，“80% \* 沪深 300 指数收益率 + 20% \* 中证综合债指数收益率”是衡量本基金投资业绩的理想基准。
- 3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

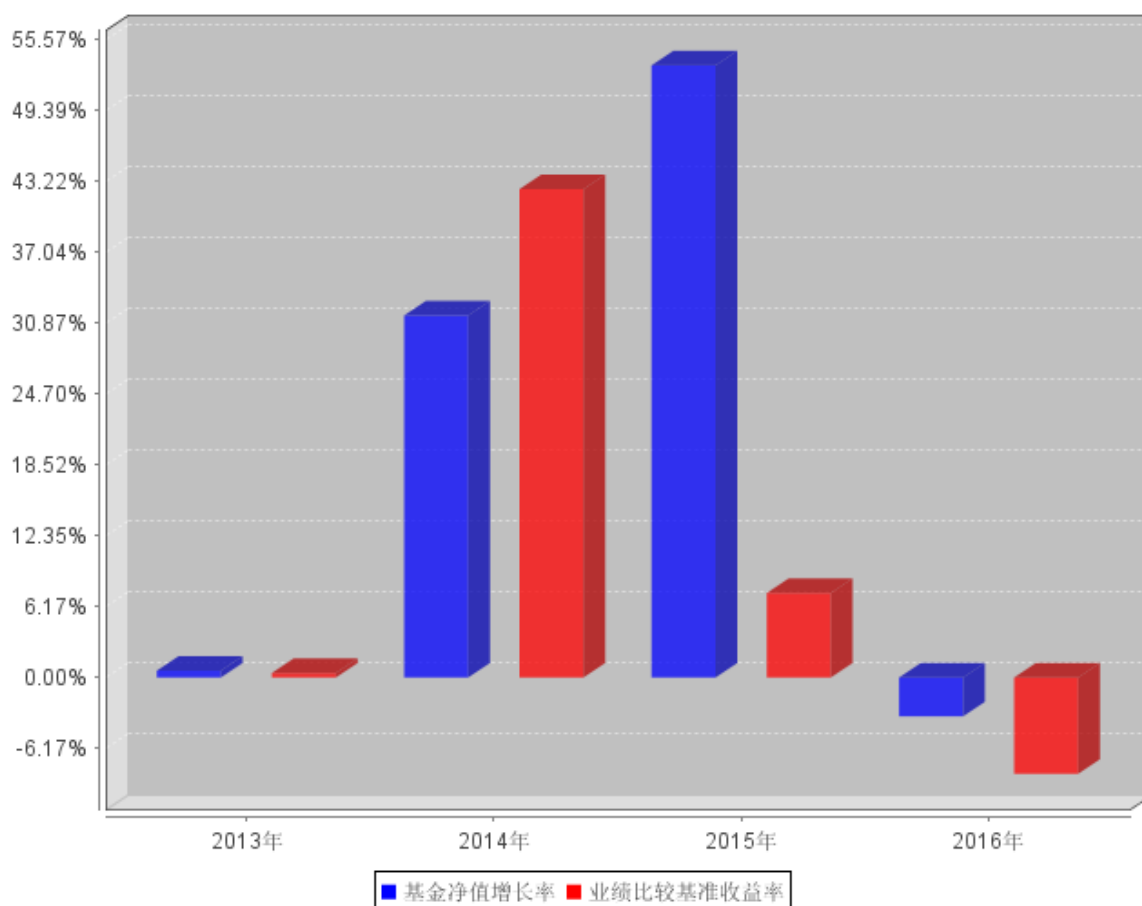
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十二部分“二、投资范围”和“四、投资限制”的有关约定。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：长盛城镇化主题股票型证券投资基金合同于 2013 年 11 月 12 日生效，合同生效当年按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10份基金份 额分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2016	-	-	-	-	
2015	5.8100	413,732,583.03	6,920,415.85	420,652,998.88	
2014	0.6700	40,164,021.20	2,738,126.56	42,902,147.76	
合计	6.4800	453,896,604.23	9,658,542.41	463,555,146.64	

## §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 12 月 31 日，基金管理人共管理五十七只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王宁	本基金基金经理，长盛基金管理有限公司副总经理，权益投资部总监，社保组合组合经理。	2013 年 11 月 12 日	-	19 年	王宁先生，1971 年 10 月出生。毕业于北京大学光华管理学院，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005 年 8 月加盟长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理、长盛动态精选证券投资基金基金经理，长盛同庆可分离交易股票型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，长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金经理，公司总经理助理等职务。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基

金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。



## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年行情先抑后扬。自 1 月初熔断以后，2015 年 6 月以来的几轮股灾告一段落。春节后，特别是 3 月份开始，在基本面修复的催化下，市场迎来几波脉冲式行情。

3 月份到 7 月中旬，锂电池、OLED 为代表的少数成长行业，黄金、稀土、禽畜养殖等周期行业，以及白酒龙头的复苏行情较为明显。6 月下旬脱欧事件结束后，风险偏好得到进一步释放。7 月中旬到 9 月市场热点较少，PPP 板块较为突出。4 季度以来，经济复苏迹象明显，通胀有所升温。国庆假期密集的地产调控政策之后，部分增量资金进场。央企为代表的 PPP 基建板块，大宗商品涨价带动下的煤炭、钢铁等大宗周期品板块盈利改善，表现突出。在保险资金举牌带动市场情绪进一步升温之时，险资监管政策的出台，叠加债市去杠杆，流动性及盈利预期迅速降温，行情戛然而止，没有能够延续到年末。实际上，防范金融风险、抑制资产泡沫的政策监管思路，3 季度之后已逐步显性化，从房地产调控、险资举牌监管、债市去杠杆，一脉相承。市场在债市去杠杆之后对流动性、人民币汇率预期转为悲观。

跳出对宏观层面及行业微观的细究，市场本身来看，存量资金博弈的情况一直没有明显改善，每一次的脉冲行情需要对短线热点的浮盈进行兑现，转换结构，寻找下一个价值洼地。

基于对市场各种因素的判断，本基金今年操作相对稳健，保持中性仓位，个股分布分散，但仍不失弹性，因此较产品基准取得了可观的收益。

### 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 1.286 元，本报告期份额净值增长率为-3.38%，同期业绩比较基准收益率为-8.39%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年我国将继续实施积极的财政政策，PPP 项目继续落地，经济有望继续保持平稳。

中性偏冷的经济环境，有利于供给侧改革及行业的优胜劣汰，经济运行效率提升。

中观层面的改善机会主要体现在以下几个方面：传统周期行业的供给侧改革继续深化，新兴成长行业的坐实与分化，制造业龙头的国际化，混改为代表的国企改革进入密集施工期。一批行业龙头公司的市场份额与国内外竞争力将明显提升，产业结构更加优化，也是资本市场的机会所在。

投资主线主要体现在以下几个方面。

一、供给侧改革的继续深化。库存周期力量、去过剩行业杠杆、环保需求的存在，落后产能

将得到进一步的关停，行业龙头的份额与盈利能力得到加强。

二、新兴行业的调整与分化，龙头胜出。经历了前几年的粗放快速发展，新兴行业增速减慢，出现分化不可避免。坚持长期创新、成本控制优秀的龙头企业将胜出。

三、制造业龙头的国际化。经过多年的发展，国内初步出现一批制造业龙头，但是需要改变大而不强的局面。行业龙头提升产品竞争力走向国际市场的同时，也可通过海外并购来实现弯道超车的转型升级。例如精密制造、航空部件、半导体芯片、医疗设备等关键领域。

四、国企改革步入实施期。特别是混合所有制改革作为国企改革的重要突破口，将在电力、石油、天然气、铁路、民航、电信、军工等领域有实质性推进。

五、房地产开工可能放缓的情况下，积极的中央财政政策将加大基建投资，有助于对冲经济下行压力。泛基建产业链特别是龙头建筑公司业绩将明显受益。

从基本面微观的改善上，市场存在结构性机会。但仍需防范几方面的不确定因素。一、滞胀风险。国内大宗价格的强势，叠加原油、农产品等可能的输入型通胀，将压制下游行业的盈利。二、美国经济及货币政策的不确定性。特朗普上台之后的财政政策、贸易政策、货币政策的预期差将对国内实业及金融都有一定的影响。三、抑制资产泡沫、防范金融风险的监管思路下，其后续去杠杆力度、利率的上升程度对实体经济的影响。

市场层面本身，在监管趋严、IPO 发行节奏常态化的情况下，市场进一步去伪存真，回归本源，有利于长期价值型品种的发掘和显现，资本效率提升。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

本基金截至 2016 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 33,807,168.56 元，其中：未分配利润已实现部分为 61,558,196.89 元，未分配利润未实现部分为-27,751,028.33 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”）在对长盛城镇化主题混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的

“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师陈玲、张振波于 2017 年 3 月 22 对本基金 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附出具了普华永道中天审字(2017)第 20924 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛城镇化主题混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	18,209,943.12	113,202,613.96
结算备付金	4,308,302.55	583,295.87
存出保证金	58,544.13	241,394.06
交易性金融资产	123,500,119.05	170,571,155.01
其中：股票投资	123,500,119.05	170,571,155.01
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	30,799,082.35	2,292,655.07
应收利息	18,288.81	78,021.13
应收股利	-	-
应收申购款	29,663.02	224,820.76
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	176,923,943.03	287,193,955.86
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	23,295,870.85	-
应付赎回款	418,417.95	158,046.16
应付管理人报酬	360,565.87	475,914.21
应付托管费	60,094.29	79,319.05
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	570,256.03	416,138.07
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	251,333.61	230,546.12
负债合计	24,956,538.60	1,359,963.61
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	118,160,235.87	214,787,362.89
未分配利润	33,807,168.56	71,046,629.36
所有者权益合计	151,967,404.43	285,833,992.25
负债和所有者权益总计	176,923,943.03	287,193,955.86

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.286 元，基金份额总额 118,160,235.87 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛城镇化主题混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-5,376,340.46	199,708,025.71
1. 利息收入	1,064,252.62	735,047.42
其中：存款利息收入	688,801.47	695,675.70
债券利息收入	-	4,065.28
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	375,451.15	35,306.44
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,067,315.52	239,615,145.20
其中：股票投资收益	16,426.16	238,215,976.04

基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-82,496.25
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	1,050,889.36	1,481,665.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-7,738,705.70	-42,369,721.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	230,797.10	1,727,554.70
<b>减：二、费用</b>	<b>8,201,257.25</b>	<b>10,077,984.51</b>
1. 管理人报酬	3,979,957.96	4,582,316.63
2. 托管费	663,326.29	763,719.49
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,190,214.31	4,390,680.41
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	367,758.69	341,267.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-13,577,597.71</b>	<b>189,630,041.20</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-13,577,597.71</b>	<b>189,630,041.20</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛城镇化主题混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	214,787,362.89	71,046,629.36	285,833,992.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,577,597.71	-13,577,597.71
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）	-96,627,127.02	-23,661,863.09	-120,288,990.11
其中：1. 基金申购款	114,984,968.37	33,373,329.69	148,358,298.06

2. 基金赎回款	-211,612,095.39	-57,035,192.78	-268,647,288.17
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）	118,160,235.87	33,807,168.56	151,967,404.43
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	442,494,956.82	108,764,327.26	551,259,284.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	189,630,041.20	189,630,041.20
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）	-227,707,593.93	193,305,259.78	-34,402,334.15
其中：1. 基金申购款	785,333,991.78	659,798,624.42	1,445,132,616.20
2. 基金赎回款	-1,013,041,585.71	-466,493,364.64	-1,479,534,950.35
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）	-	-420,652,998.88	-420,652,998.88
五、期末所有者权益（基金净值）	214,787,362.89	71,046,629.36	285,833,992.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵

杨思乐

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛城镇化主题混合型证券投资基金(原长盛城镇化主题股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]311号《关于核准长盛城镇化主题股票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《长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金合同》负责公

开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,010,555,287.23 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 697 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛城镇化主题股票型证券投资基金基金合同》于 2013 年 11 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,011,529,249.85 份基金份额，其中认购资金利息折合 973,962.62 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，长盛城镇化主题股票型证券投资基金证券投资基金于 2015 年 7 月 16 日公告后更名为长盛城镇化主题混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛城镇化主题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)、权证、债券、货币市场工具、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投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于城镇化主题上市公司股票不低于非现金资产的 80%；债券投资占基金资产的 0%-40%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。按照申银万国研究所有限公司行业分类标准，城镇化主题上市公司股票主要涉及建筑建材、房地产、交运设备、机械设备、商业贸易、交通运输、公用事业以及家用电器等申万一级行业。本基金的业绩比较基准为：80% X 沪深 300 指数收益率 + 20% X 中证综合债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2017 年 3 月 22 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。



### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年期年度报告相一致。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其

股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,979,957.96	4,582,316.63
其中：支付销售机构的客户维护费	631,809.93	1,105,625.04

注：支付基金管理人长盛基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 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。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	663,326.29	763,719.49

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。

**7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金合同生效日（ 2013 年 11 月 12 日）持有的 基金份额	-	-
期初持有的基金份额	19,291,043.47	38,539,359.16
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	19,291,043.47	19,248,315.69
期末持有的基金份额	-	19,291,043.47
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	8.98%

注：基金管理人长盛基金在本年度赎回本基金的交易由直销柜台办理，赎回费用按照市场公开的交易费率计算并支付。

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

注：于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

**7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

关联方	本期	上年度可比期间
-----	----	---------

名称	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	18,209,943.12	664,603.95	113,202,613.96	648,419.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 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。

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

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 9 日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603035	常熟汽饰	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016 年 12 月	2017 年 1 月	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-

		26 日	4 日							
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	新股流 通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱 信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股流 通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

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

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日 期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
600202	哈空调	2016 年 12 月 30 日	重大事 项停牌	12.10	2017 年 1 月 18 日	12.10	409,500	5,070,563.78	4,954,950.00	-
300213	佳讯飞 鸿	2016 年 11 月 4 日	重大事 项停牌	28.00	2017 年 2 月 17 日	25.48	127,260	3,263,551.12	3,563,280.00	-
300123	太阳鸟	2016 年 9 月 28 日	重大事 项停牌	15.08	2017 年 2 月 15 日	16.59	207,754	3,165,030.93	3,132,930.32	-
601727	上海电 气	2016 年 8 月 31 日	重大事 项停牌	8.49	-	-	366,600	2,911,574.07	3,112,434.00	-
002745	木林森	2016 年 7 月 15 日	重大事 项停牌	33.50	-	-	85,349	2,612,799.08	2,859,191.50	-
300367	东方网 力	2016 年 12 月 15 日	重大事 项停牌	20.04	-	-	138,100	3,327,853.34	2,767,524.00	-

注：1. 本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 102,781,268.06 元，属于第二层次的余额为 20,718,850.99 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 158,364,344.03 元，第二层次 12,206,810.98 元，无属于第三层次的余额)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	123,500,119.05	69.80
	其中：股票	123,500,119.05	69.80
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	22,518,245.67	12.73
7	其他各项资产	30,905,578.31	17.47
8	合计	176,923,943.03	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,187,939.62	47.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,838,996.00	3.84
E	建筑业	646,344.43	0.43
F	批发和零售业	1,460,833.00	0.96
G	交通运输、仓储和邮政业	1,399,542.00	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,202,820.45	7.37
J	金融业	25,784,420.00	16.97
K	房地产业	702,851.10	0.46
L	租赁和商务服务业	723,580.00	0.48

M	科学研究和技术服务业	679,637.70	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	802,381.00	0.53
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	2,070,773.75	1.36
S	综合	-	-
	合计	123,500,119.05	81.27

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600900	长江电力	404,800	5,124,768.00	3.37
2	600080	金花股份	395,600	4,968,736.00	3.27
3	600202	哈空调	409,500	4,954,950.00	3.26
4	600099	林海股份	225,921	4,276,684.53	2.81
5	300213	佳讯飞鸿	127,260	3,563,280.00	2.34
6	000538	云南白药	42,660	3,248,559.00	2.14
7	300123	太阳鸟	207,754	3,132,930.32	2.06
8	601727	上海电气	366,600	3,112,434.00	2.05
9	002745	木林森	85,349	2,859,191.50	1.88
10	300367	东方网力	138,100	2,767,524.00	1.82

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.csfunds.com.cn>网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	603939	益丰药房	13,035,756.41	4.56
2	300404	博济医药	10,719,500.22	3.75



3	600815	厦工股份	9,681,097.68	3.39
4	600845	宝信软件	9,589,582.50	3.35
5	600900	长江电力	9,023,286.29	3.16
6	600099	林海股份	8,852,688.00	3.10
7	300281	金明精机	8,799,466.02	3.08
8	603309	维力医疗	8,039,829.00	2.81
9	603828	柯利达	7,970,039.13	2.79
10	300342	天银机电	7,937,639.20	2.78
11	300348	长亮科技	7,732,255.00	2.71
12	300383	光环新网	7,721,110.20	2.70
13	002414	高德红外	7,695,413.75	2.69
14	300350	华鹏飞	7,691,031.87	2.69
15	603456	九洲药业	7,637,331.25	2.67
16	300283	温州宏丰	7,586,981.29	2.65
17	002611	东方精工	7,575,773.06	2.65
18	300326	凯利泰	7,521,179.79	2.63
19	300114	中航电测	7,462,236.53	2.61
20	002667	鞍重股份	7,437,299.78	2.60
21	300385	雪浪环境	7,414,948.29	2.59
22	300319	麦捷科技	7,411,447.36	2.59
23	300242	明家联合	7,394,502.48	2.59
24	300371	汇中股份	7,340,314.05	2.57
25	002708	光洋股份	7,306,392.65	2.56
26	300112	万讯自控	7,135,518.00	2.50
27	600050	中国联通	7,078,173.00	2.48
28	300354	东华测试	7,075,031.48	2.48
29	300349	金卡股份	7,067,416.35	2.47
30	300103	达刚路机	7,020,996.10	2.46
31	601006	大秦铁路	7,007,131.00	2.45
32	300154	瑞凌股份	6,911,613.94	2.42
33	300406	九强生物	6,909,714.34	2.42
34	300448	浩云科技	6,905,972.16	2.42
35	600345	长江通信	6,870,515.59	2.40
36	300234	开尔新材	6,717,298.10	2.35
37	300373	扬杰科技	6,627,798.04	2.32
38	300431	暴风集团	6,623,119.39	2.32

39	300440	运达科技	6,609,442.90	2.31
40	300007	汉威电子	6,560,683.78	2.30
41	300367	东方网力	6,550,765.50	2.29
42	601018	宁波港	6,481,446.00	2.27
43	300318	博晖创新	6,437,257.16	2.25
44	600276	恒瑞医药	6,431,797.40	2.25
45	600917	重庆燃气	6,392,841.64	2.24
46	300284	苏交科	6,335,200.68	2.22
47	603618	杭电股份	6,168,882.25	2.16
48	603019	中科曙光	6,031,380.82	2.11
49	300261	雅本化学	5,848,293.48	2.05
50	000861	海印股份	5,810,069.60	2.03

#### 8.4.2 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	603939	益丰药房	13,081,052.39	4.58
2	300404	博济医药	11,826,154.62	4.14
3	300281	金明精机	10,079,149.42	3.53
4	002352	鼎泰新材	9,604,802.47	3.36
5	600845	宝信软件	9,601,176.21	3.36
6	300103	达刚路机	9,557,437.86	3.34
7	600815	厦工股份	8,981,881.00	3.14
8	300342	天银机电	8,942,696.58	3.13
9	300348	长亮科技	8,927,032.50	3.12
10	002611	东方精工	8,848,121.23	3.10
11	002708	光洋股份	8,664,732.57	3.03
12	300371	汇中股份	8,644,689.62	3.02
13	300114	中航电测	8,379,562.43	2.93
14	600050	中国联通	8,269,574.00	2.89
15	300319	麦捷科技	8,195,587.68	2.87
16	603828	柯利达	8,173,886.16	2.86
17	300349	金卡股份	8,111,907.73	2.84
18	002414	高德红外	8,042,984.79	2.81
19	000861	海印股份	7,879,401.52	2.76
20	600345	长江通信	7,838,813.78	2.74
21	601006	大秦铁路	7,778,354.00	2.72

22	300354	东华测试	7,661,012.71	2.68
23	603309	维力医疗	7,633,734.95	2.67
24	300373	扬杰科技	7,523,742.08	2.63
25	300318	博晖创新	7,442,402.01	2.60
26	300385	雪浪环境	7,414,550.90	2.59
27	300234	开尔新材	7,296,577.76	2.55
28	300007	汉威电子	7,265,726.72	2.54
29	300448	浩云科技	7,246,395.14	2.54
30	300154	瑞凌股份	7,123,571.02	2.49
31	600099	林海股份	7,055,484.52	2.47
32	300406	九强生物	6,915,801.03	2.42
33	300283	温州宏丰	6,837,732.20	2.39
34	600276	恒瑞医药	6,714,730.76	2.35
35	600917	重庆燃气	6,707,323.26	2.35
36	300284	苏交科	6,667,331.56	2.33
37	601989	中国重工	6,666,351.11	2.33
38	300350	华鹏飞	6,648,315.50	2.33
39	300242	明家联合	6,546,698.12	2.29
40	300326	凯利泰	6,512,183.13	2.28
41	603456	九洲药业	6,500,242.70	2.27
42	601018	宁波港	6,445,143.00	2.25
43	600018	上港集团	6,270,517.56	2.19
44	300261	雅本化学	6,223,643.19	2.18
45	002265	西仪股份	6,156,677.00	2.15
46	300112	万讯自控	6,141,152.00	2.15
47	300346	南大光电	6,001,370.93	2.10
48	300295	三六五网	5,992,539.12	2.10
49	300383	光环新网	5,938,540.40	2.08
50	002623	亚玛顿	5,909,479.92	2.07
51	300440	运达科技	5,907,753.91	2.07
52	002119	康强电子	5,856,193.28	2.05

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,023,539,081.15
卖出股票收入（成交）总额	1,062,887,837.57

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费

用。

### **8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

注：本基金本报告期末未持有债券。

### **8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### **8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

### **8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

#### **8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

#### **8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

### **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

#### **8.11.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

#### **8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

#### **8.11.3 本期国债期货投资评价**

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### **8.12 投资组合报告附注**

#### **8.12.1**

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

## 8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

## 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	58,544.13
2	应收证券清算款	30,799,082.35
3	应收股利	-
4	应收利息	18,288.81
5	应收申购款	29,663.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,905,578.31

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600202	哈空调	4,954,950.00	3.26	重大事项停牌
2	300213	佳讯飞鸿	3,563,280.00	2.34	重大事项停牌
3	300123	太阳鸟	3,132,930.32	2.06	重大事项停牌
4	601727	上海电气	3,112,434.00	2.05	重大事项停牌
5	002745	木林森	2,859,191.50	1.88	重大事项停牌
6	300367	东方网力	2,767,524.00	1.82	重大事项停牌

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,283	35,991.54	13,668,366.13	11.57%	104,491,869.74	88.43%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	157.19	0.0001%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年11月12日）基金份额总额	2,011,529,249.85
本报告期期初基金份额总额	214,787,362.89
本报告期基金总申购份额	114,984,968.37
减：本报告期基金总赎回份额	211,612,095.39
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	118,160,235.87

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本报告期内本基金管理人的高级管理人员无重大人事变动。

#### 11.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

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

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 70,000.00 元，已连续为本基金提供审计服务 3 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	485,855,834.03	23.30%	452,479.40	23.30%	-
民族证券	1	463,864,698.58	22.24%	431,997.98	22.24%	-
国信证券	1	457,814,587.70	21.95%	426,363.50	21.95%	-
申银万国	1	248,734,275.23	11.93%	231,647.35	11.93%	-
华融证券	1	190,801,605.56	9.15%	177,693.57	9.15%	-
东北证券	1	178,826,174.11	8.57%	166,540.64	8.57%	-
长江证券	1	53,727,158.61	2.58%	50,036.63	2.58%	-
国泰君安	1	5,958,140.19	0.29%	5,548.77	0.29%	-

英大证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-2,051,200,000.00	100.00%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-



国泰君安	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

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，并能为本公司基金提供全面的信息服。

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
1	西部证券	深圳	1
2	民族证券	深圳	1
3	五矿证券	深圳	1
4	东吴证券	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	华福证券	上海	1

长盛基金管理有限公司  
2017 年 3 月 27 日