

# 长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告

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：徽商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 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。

基金托管人徽商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 7 月 13 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
4.9 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.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>21</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
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.....	21
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>22</b>
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>23</b>
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
8.7 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.....	56
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.....	56

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.....	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
8.12 投资组合报告附注.....	56
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	58
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
11.4 基金投资策略的改变.....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
11.8 其他重大事件.....	61
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长盛盛鑫混合	
基金主代码	002089	
交易代码	002089	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 7 月 13 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	徽商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	549,805,555.46 份	
下属分级基金的基金简称:	长盛盛鑫混合 A	长盛盛鑫混合 C
下属分级基金的交易代码:	002089	002090
报告期末下属分级基金的份额总额	548,979,015.02 份	826,540.44 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在有效控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	<p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑：（1）宏观经济指标；（2）微观经济指标；（3）市场指标；（4）政策因素。</p> <p>本基金将通过深入分析上述指标与因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>1. 行业配置策略</p> <p>本基金通过对国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展的根本性因素进行分析，对处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置。</p> <p>2. 个股配置策略</p> <p>在行业配置的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的办法，挑选具备较大投资价值的上市公司。</p> <p>3. 动态调整和组合优化策略</p> <p>本基金管理将根据经济发展状况、产业结构升级、技术发展状况及国家相关政策因素对配置的行业和上市公司进行动态调整。此外，基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对投资组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化。</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向，综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券投资组合。在实际的投资运作中，本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略策略、类别选择</p>

	<p>策略、个券选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。</p> <p>(四) 股指期货投资策略</p> <p>本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。</p> <p>(五) 权证投资策略</p> <p>本基金的权证投资是以权证的市值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。</p> <p>(六) 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p>
业绩比较基准	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	徽商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	徐建国
	联系电话	010-82019988	0551-62690979
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	xujianguo@hsbank.com.cn
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	40088-96588
传真		010-82255988	0551-65970453
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	安徽省合肥市安庆路 79 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	安徽省合肥市安庆路 79 号
邮政编码		100088	230001
法定代表人		高新	李宏鸣

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
----	----	------

会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、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 7 月 13 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	长盛盛鑫混合 A	长盛盛鑫混合 C
本期已实现收益	2,695,325.17	239,389.84
本期利润	3,652,119.66	261,967.68
加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0053
本期加权平均净值利润率	0.87%	0.53%
本期基金份额净值增长率	0.90%	8.00%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	
期末可供分配利润	3,773,595.34	64,481.49
期末可供分配基金份额利润	0.0069	0.0780
期末基金资产净值	553,778,640.88	892,678.55
期末基金份额净值	1.009	1.080
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	
基金份额累计净值增长率	0.90%	8.00%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛盛鑫混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	0.80%	0.12%	0.19%	0.38%	0.61%	-0.26%
自基金合同生效起至今	0.90%	0.09%	0.72%	0.38%	0.18%	-0.29%

长盛盛鑫混合 C

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	0.75%	0.11%	0.19%	0.38%	0.56%	-0.27%
自基金合同生效起至今	8.00%	0.67%	0.72%	0.38%	7.28%	0.29%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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

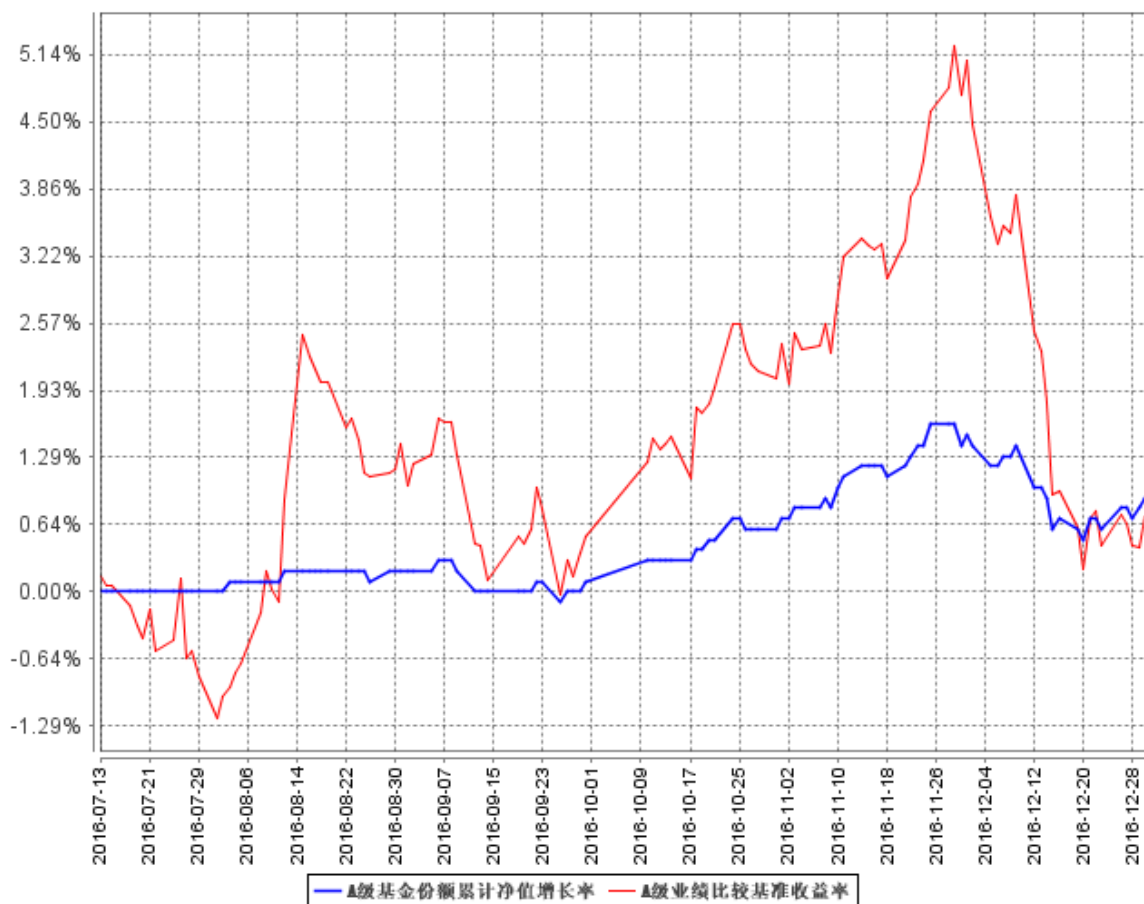
基准指数的构建考虑了三个原则：

- 1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债指数。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的市场代表性；中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，该指数可以较为全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。
- 2、可比性。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可使业绩比较更具有合理性。
- 3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 50%、50% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

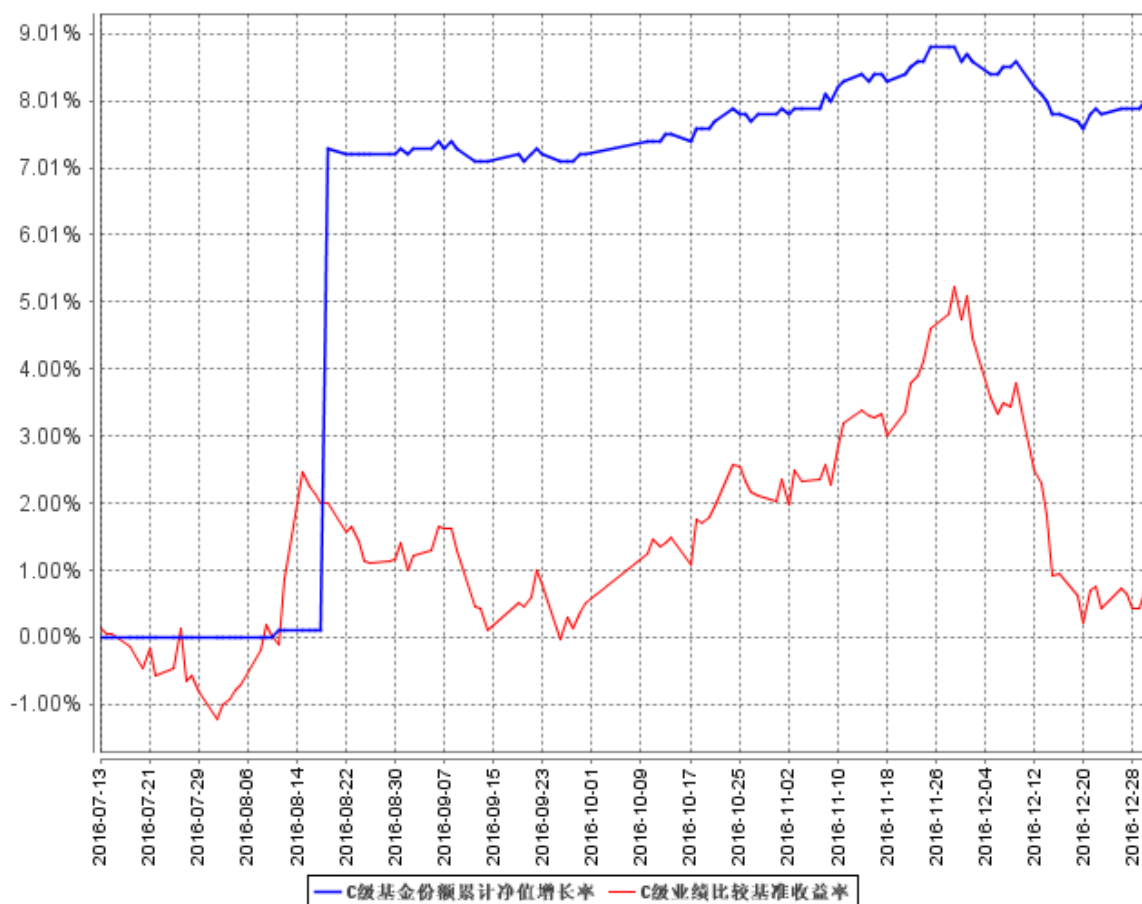


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



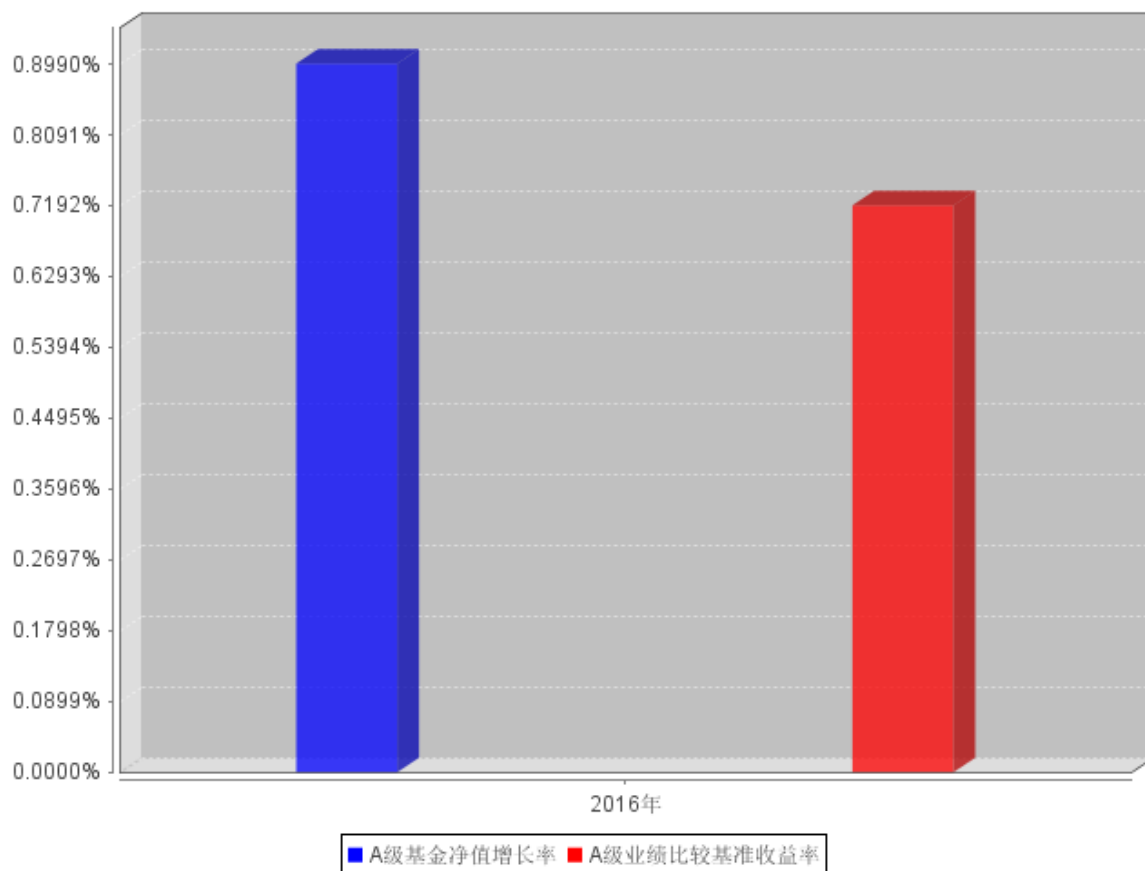
注：1、长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效日 2016 年 7 月 13 日，截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末仍处于建仓期。

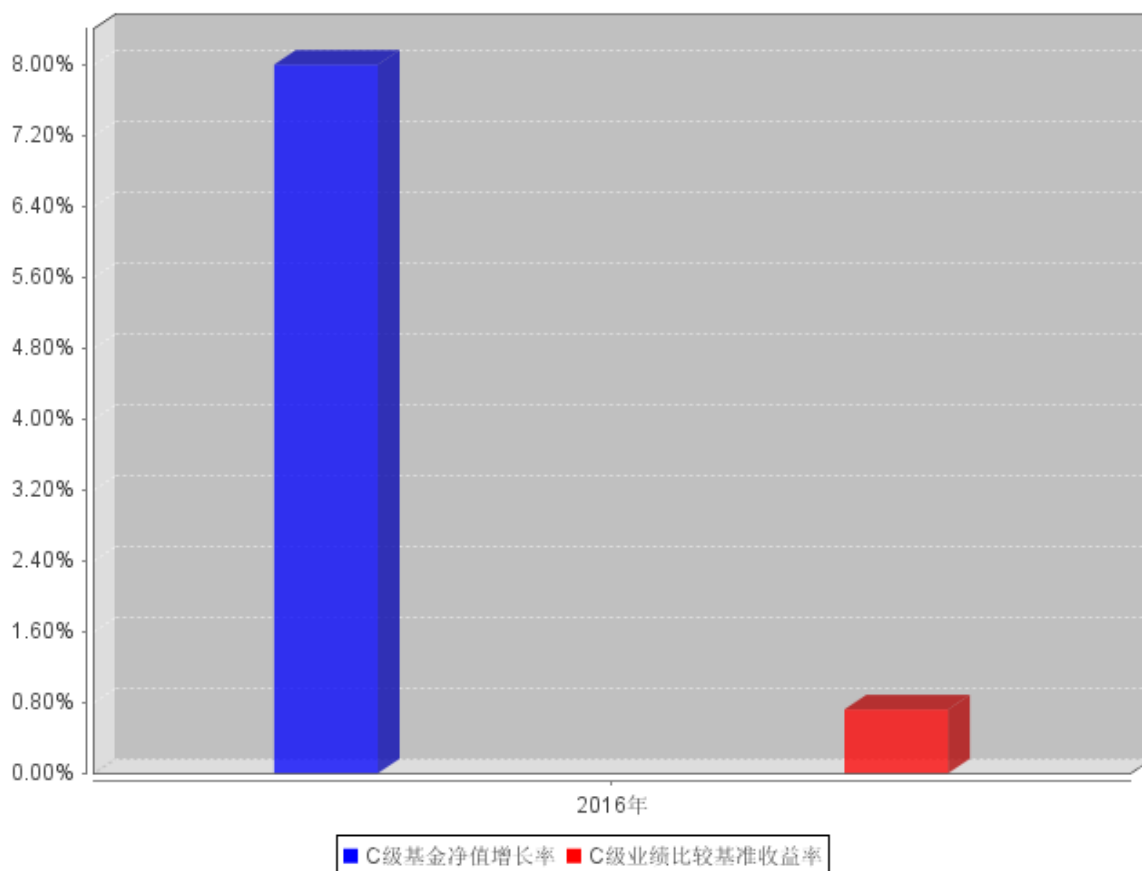
3、本基金的投资组合比例为：本基金股票等权益类资产投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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

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



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



注：长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金合同于 2016 年 7 月 13 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

注：本基金于 2016 年度会计期间未进行利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马文祥	本基金基金经理，长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛同泰债券型证券投资基金基金经理，长盛可转债债券型证券投资基金基金经理，固定收益部副总监。	2016 年 9 月 12 日	-	14 年	马文祥先生，1977 年 7 月出生。清华大学经济管理学院经济学硕士。历任中国农业银行主任科员，工银瑞信企业年金基金经理、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2013 年 8 月加入长盛基金管理有限公司。
王超	本基金基金经理，长盛同瑞中证	2016 年 9 月 12 日	-	10 年	王超先生，1981 年 9 月出生。中央财经大学硕士，CFA（特许金融分析师），

	<p>200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>				FRM（金融风险管理师）。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。
杨衡	本基金基金经理，长盛战略新兴产业	2016 年 7 月 13 日	-	11 年	杨衡先生，1975 年 10 月出生。中国科学院数学与系统科学研究院博士、博士后。

	灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理，长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。				2007年7月进入长盛基金管理公司，历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理、长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。
--	--	--	--	--	--

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

#### 1、报告期内行情回顾

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

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

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

2016 年以来执行 IPO 取消新股申购预缴款、2000 万股以下新股全部网上发行的新规。2016 年上半年新股发行节奏有所放缓，下半年逐渐加速。2016 年全年公告发行新股 26 批，其中上半年公告发行 9 批约 70 家，发行节奏平均约 12 只/月，下半年公告发行 16 批，11 月后发行节奏明显加快到每周一批、单月超过 50 只。2016 年全年上市 227 只，其中网下 167 只，网下占比

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

## 2、报告期内本基金投资策略分析

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，长盛盛鑫混合 A 的基金份额净值为 1.009 元，本报告期份额净值增长率为 0.90%，同期业绩比较基准增长率为 0.72%。

截止报告期末，长盛盛鑫混合 C 的基金份额净值为 1.080 元，本报告期份额净值增长率为 8.00%，同期业绩比较基准增长率为 0.72%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

股市方面，对中长期经济前景的隐忧使得股市风险偏好难有显著回升，震荡市中需把握市场结构性机会，比如涨价带动盈利改善的行业、低估值高分红的金融板块、对冲经济下行压力的基

建板块以及改革深化、供给侧改革、消费升级等主题机会。但也需警惕国内经济增长低于预期、人民币汇率贬值及资本流出压力加大、特朗普政策不确定性等多重因素对资本市场的扰动。

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合规运作，保障资产委托人利益出发，结合监管要求、市场形势及自身业务发展需要，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时督促有关部门改进、完善，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

1、强调合规宣导与培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种方式，有重点、有针对性地展开合规培训工作，强化员工合规理念，深化员工合规意识，提高员工合规工作技能，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、持续推动公司完善制度/流程建设，扎实公司内控制度基础。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，保证公司制度/流程的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司新订、修订了包括《长盛基金管理有限公司风险准备金管理办法》、《长盛基金管理有限公司固有资金投资管理制度》、《公司信用品种备选库管理办法》、《公司银行间一级市场债券交易流程》、《长盛基金管理有限公司国债期货投资管理办法》、《公司投资者教育工作制度》、《业务运营部登记结算中心客户款项支付及退回流程》等多部制度和流程。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，严肃制度/流程执行力，合理保障公司运营及委托资产投资运作

合规。报告期内，监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核 40 余项，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、登记注册、产品开发、员工行为等；此外，根据业务发展需要，以及日常监督中发现问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，合理保障公司及委托资产合规、稳健运作。

5、积极参与新产品设计、新业务拓展工作，对相关的合规问题提供意见和建议。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本基金 2016 年度未实施利润分配。

本基金截至 2016 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 3,838,076.83 元，其中：长盛盛鑫混合 A 期末可供分配利润为 3,773,595.34 元（长盛盛鑫混合 A 的未分配利润已实现部分为 3,773,595.34 元，未分配利润未实现部分为 1,026,030.52 元），长盛盛鑫混合 C 期末可供分配利润为 64,481.49 元（长盛盛鑫混合 C 的未分配利润已实现部分为 64,481.49 元，未分配利润未实现部分为 1,656.62 元）。

#### 4.9 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，徽商银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛盛鑫灵活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

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 20943 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“长盛盛鑫混合型基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是长盛盛鑫混合型基金 的基金管理人长盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述长盛盛鑫混合型基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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,公允反映了长盛盛鑫混合型基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年

	12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	陈玲	张振波
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2017 年 3 月 22 日	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛盛鑫灵活配置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	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	451,581.94
结算备付金		1,706,554.90
存出保证金		0.99
交易性金融资产	7.4.7.2	508,980,150.11
其中：股票投资		81,175,322.75
基金投资		-
债券投资		427,804,827.36
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	39,000,000.00
应收证券清算款		14,605.50
应收利息	7.4.7.5	5,021,293.55
应收股利		-
应收申购款		299.55
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		555,174,486.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-

卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		208.34
应付管理人报酬		282,235.94
应付托管费		94,078.64
应付销售服务费		164.57
应付交易费用	7.4.7.7	28,979.37
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	97,500.25
负债合计		503,167.11
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	549,805,555.46
未分配利润	7.4.7.10	4,865,763.97
所有者权益合计		554,671,319.43
负债和所有者权益总计		555,174,486.54

注：1. 报告截止日 2016 年 12 月 31 日，长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金份额总额 549,805,555.46 份。其中长盛盛鑫混合 A 的份额净值 1.009 元，基金份额总额 548,979,015.02 份；长盛盛鑫混合 C 的份额净值 1.080 元，基金份额总额 826,540.44 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		5,943,931.54
1.利息收入		4,878,990.37
其中：存款利息收入	7.4.7.11	169,344.02
债券利息收入		3,846,443.59
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		863,202.76
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		81,933.95
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-97,194.78



基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	45,036.16
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	134,092.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	979,372.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,634.89
<b>减：二、费用</b>		2,029,844.20
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,330,241.41
2. 托管费	7.4.10.2.2	443,413.80
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	41,735.41
4. 交易费用	7.4.7.18	104,374.94
5. 利息支出		7,223.85
其中：卖出回购金融资产支出		7,223.85
6. 其他费用	7.4.7.19	102,854.79
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,914,087.34
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,914,087.34

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年7月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	200,797,066.85	-	200,797,066.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,914,087.34	3,914,087.34
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）	349,008,488.61	951,676.63	349,960,165.24
其中：1. 基金申购款	551,166,506.85	1,308,148.55	552,474,655.40

2. 基金赎回款	-202,158,018.24	-356,471.92	-202,514,490.16
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）	549,805,555.46	4,865,763.97	554,671,319.43

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2015]第 2119 号《关于准予长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 200,788,050.15 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 955 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 7 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,797,066.85 份基金份额,其中认购资金利息折合 9,016.70 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,基金托管人为徽商银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛鑫灵活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)、股指期货、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。本基金投资组

合中对股票等权益类资产的投资占基金资产的比例为 0-95%，权证投资占基金资产净值的 0-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，保持现金或者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沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

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

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛盛鑫灵活配置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 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，

参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券

投资基金执行《企业会计准则》估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

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

(1) 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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	451,581.94
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	451,581.94

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	77,794,138.82	81,175,322.75	3,381,183.93	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	29,847,382.52	28,883,827.36	-963,555.16
	银行间市场	400,359,256.44	398,921,000.00	-1,438,256.44
	合计	430,206,638.96	427,804,827.36	-2,401,811.60
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	508,000,777.78	508,980,150.11	979,372.33	

### 7.4.7.3 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。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日
----	-------------------------



	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	39,000,000.00	-
合计	39,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应收活期存款利息	35.54
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	1,113.28
应收债券利息	5,018,852.58
应收买入返售证券利息	1,292.15
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	5,021,293.55

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	28,308.37
银行间市场应付交易费用	671.00
合计	28,979.37

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.25
预提费用	97,500.00
合计	97,500.25

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛鑫混合 A		
项目	本期 2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	135,122.14	135,122.14
本期申购	548,930,548.77	548,930,548.77
本期赎回 (以“-”号填列)	-86,655.89	-86,655.89
- 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	548,979,015.02	548,979,015.02

金额单位：人民币元

长盛盛鑫混合 C		
项目	本期 2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	200,661,944.71	200,661,944.71
本期申购	2,235,958.08	2,235,958.08
本期赎回 (以“-”号填列)	-202,071,362.35	-202,071,362.35
- 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	826,540.44	826,540.44

注：1. 本基金自 2016 年 7 月 8 日至 2016 年 7 月 11 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 200,788,050.15 元。根据《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 9,016.70 元在本基金成立后，折算为 9,016.70 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日) 至 2016 年 7 月 21 日止期间暂不向投资人开放基金交易。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长盛盛鑫混合 A
----------

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,695,325.17	956,794.49	3,652,119.66
本期基金份额交易产生的变动数	1,078,270.17	69,236.03	1,147,506.20
其中：基金申购款	1,078,664.63	69,424.91	1,148,089.54
基金赎回款	-394.46	-188.88	-583.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,773,595.34	1,026,030.52	4,799,625.86

单位：人民币元

长盛盛鑫混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	239,389.84	22,577.84	261,967.68
本期基金份额交易产生的变动数	-174,908.35	-20,921.22	-195,829.57
其中：基金申购款	160,883.27	-824.26	160,059.01
基金赎回款	-335,791.62	-20,096.96	-355,888.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,481.49	1,656.62	66,138.11

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月13日(基金合同生效日)至2016年 12月31日
活期存款利息收入	72,074.31
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	86,269.25
其他	11,000.46
合计	169,344.02

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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7月13日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
卖出股票成交总额	8,187,820.29
减：卖出股票成本总额	8,285,015.07
买卖股票差价收入	-97,194.78

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月13日(基金合同生效日) 至2016年12月31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	45,036.16
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	45,036.16

**7.4.7.13.2 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7月13日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	61,298,517.97
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	60,660,647.64
减：应收利息总额	592,834.17
买卖债券差价收入	45,036.16

**7.4.7.14 衍生工具收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月13日(基金合同生效日)至2016年 12月31日
股票投资产生的股利收益	134,092.57
基金投资产生的股利收益	-
合计	134,092.57

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年7月13日(基金合同生效日)至 2016年12月31日
1. 交易性金融资产	979,372.33
——股票投资	3,381,183.93
——债券投资	-2,401,811.60

——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	979,372.33

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月13日(基金合同生效日)至 2016年12月31日
基金赎回费收入	3,634.89
合计	3,634.89

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中不低于赎回费用的 25% 的部分归入基金财产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月13日(基金合同生效日)至 2016年12月31日
交易所市场交易费用	101,999.94
银行间市场交易费用	2,375.00
合计	104,374.94

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年7月13日(基金合同生效日)至 2016年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	37,500.00
银行汇划费	1,854.79
其他	400.00
上清所帐户维护费	1,600.00
银行间账户维护费	1,500.00
合计	102,854.79

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## 7.4.9 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
徽商银行股份有限公司(“徽商银行”)	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,330,241.41
其中:支付销售机构的客户维护费	4,342.32

注:支付基金管理人长盛基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.60% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

	本期 2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	443,413.80

注:支付基金托管人徽商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2016 年 7 月 13 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛鑫混合 A	长盛盛鑫混合 C	合计
长盛基金管理有限公司	-	40,574.13	40,574.13
徽商银行	-	466.89	466.89
合计	-	41,041.02	41,041.02

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

日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金的管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。

**7.4.10.4.2 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期末未投资本基金。

**7.4.10.5 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 2016年7月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
徽商银行股份有限公司	451,581.94	72,074.31

注：本基金的部分银行存款由基金托管人徽商银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况****7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

注：本基金本报告期内无利润分配。

**7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 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

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
603660	苏州科达	2016年11月21日	2017年11月21日	新股流通受限	8.03	32.22	26,007	208,836.21	837,945.54	
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	-
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	-
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26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
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	-

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。

#### 7.4.12.2 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
000166	申万宏源	2016年12月21日	重大事项停牌	6.25	2017年1月26日	6.29	110,000	711,708.00	687,500.00	-
600485	信威集团	2016年12月26日	重大事项停牌	14.60	-	-	17,600	313,123.00	256,960.00	-
002491	通鼎互联	2016年12月22日	重大事项停牌	15.54	2017年1月3日	15.89	9,900	160,812.00	153,846.00	-
601727	上海电气	2016年8月31日	重大事项停牌	8.49	-	-	17,000	144,256.00	144,330.00	-

300104	乐视网	2016 年 12 月 7 日	重大事 项停牌	35.80	2017 年 1 月 16 日	36.88	2,300	106,251.00	82,340.00	-
--------	-----	-----------------------	------------	-------	--------------------	-------	-------	------------	-----------	---

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

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只混合型证券投资基金，具有较高风险。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。

### 7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行徽商银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	209,270,000.00	-
A-1 以下	-	-
未评级	189,651,000.00	-
合计	398,921,000.00	-

注：未评级部分为超短期融资券和政策性金融债

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
AAA	28,593,100.00	-
AAA 以下	290,727.36	-
未评级	-	-
合计	28,883,827.36	-

### 7.4.13.3 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%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 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、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产等。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	451,581.94	-	-	-	451,581.94
结算备付金	1,706,554.90	-	-	-	1,706,554.90
存出保证金	0.99	-	-	-	0.99
交易性金融资产	405,458,900.00	22,055,200.00	290,727.36	81,175,322.75	508,980,150.11
买入返售金融资产	39,000,000.00	-	-	-	39,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	14,605.50	14,605.50
应收利息	-	-	-	5,021,293.55	5,021,293.55
应收申购款	-	-	-	299.55	299.55
资产总计	446,617,037.83	22,055,200.00	290,727.36	86,211,521.35	555,174,486.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	208.34	208.34
应付管理人报酬	-	-	-	282,235.94	282,235.94
应付托管费	-	-	-	94,078.64	94,078.64
应付销售服务费	-	-	-	164.57	164.57
应付交易费用	-	-	-	28,979.37	28,979.37
其他负债	-	-	-	97,500.25	97,500.25
负债总计	-	-	-	503,167.11	503,167.11
利率敏感度缺口	446,617,037.83	22,055,200.00	290,727.36	85,708,354.24	554,671,319.43

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。

## 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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12月31日）
	市场利率下降25个基点	496,895.31
	市场利率上升25个基点	-496,895.31

## 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

本基金投资组合中对股票等权益类资产的投资占基金资产的比例为 0-95%，权证投资占基金资产净值的 0-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，保持现金或者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%。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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	81,175,322.75	14.63
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	81,175,322.75	14.63

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 14.63%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响

#### 7.4.14 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 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 79,065,433.56 元，属于第二层次的余额为 429,914,716.55 元，无属于第三层次的余额。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	81,175,322.75	14.62
	其中：股票	81,175,322.75	14.62
2	固定收益投资	427,804,827.36	77.06
	其中：债券	427,804,827.36	77.06
	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	39,000,000.00	7.03
	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	2,158,136.84	0.39
7	其他各项资产	5,036,199.59	0.91
8	合计	555,174,486.54	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	281,760.00	0.05
B	采矿业	2,613,372.16	0.47
C	制造业	30,872,132.16	5.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,314,935.00	0.42
E	建筑业	3,409,899.23	0.61
F	批发和零售业	1,005,211.01	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	1,950,616.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,767,817.49	0.32
J	金融业	31,221,679.30	5.63
K	房地产业	2,107,117.00	0.38
L	租赁和商务服务业	1,254,379.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	137,744.40	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	296,708.00	0.05
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	1,941,952.00	0.35
S	综合	-	-
	合计	81,175,322.75	14.63

### 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	129,600	4,591,728.00	0.83
2	000001	平安银行	489,100	4,450,810.00	0.80
3	000623	吉林敖东	120,000	3,718,800.00	0.67
4	600030	中信证券	200,000	3,212,000.00	0.58
5	600999	招商证券	144,400	2,358,052.00	0.43
6	601166	兴业银行	140,000	2,259,600.00	0.41
7	000063	中兴通讯	117,100	1,867,745.00	0.34
8	002142	宁波银行	110,200	1,833,728.00	0.33
9	600519	贵州茅台	4,900	1,637,335.00	0.30
10	000333	美的集团	55,200	1,554,984.00	0.28
11	002304	洋河股份	21,810	1,539,786.00	0.28
12	002415	海康威视	61,100	1,454,791.00	0.26
13	601766	中国中车	133,600	1,305,272.00	0.24
14	601601	中国太保	46,700	1,296,859.00	0.23
15	601818	光大银行	321,700	1,257,847.00	0.23
16	601390	中国中铁	133,600	1,183,696.00	0.21
17	600011	华能国际	166,100	1,171,005.00	0.21
18	600000	浦发银行	70,500	1,142,805.00	0.21
19	600028	中国石化	210,600	1,139,346.00	0.21
20	601991	大唐发电	290,900	1,111,238.00	0.20
21	000725	京东方A	365,500	1,045,330.00	0.19
22	600104	上汽集团	41,200	966,140.00	0.17
23	601997	贵阳银行	60,000	946,800.00	0.17
24	601998	中信银行	144,600	926,886.00	0.17
25	601800	中国交建	60,500	918,995.00	0.17
26	601611	中国核建	50,000	859,500.00	0.15

27	603660	苏州科达	26,007	837,945.54	0.15
28	600048	保利地产	82,500	753,225.00	0.14
29	601229	上海银行	31,545	734,367.60	0.13
30	600415	小商品城	81,900	708,435.00	0.13
31	000166	申万宏源	110,000	687,500.00	0.12
32	601398	工商银行	153,700	677,817.00	0.12
33	000686	东北证券	54,800	677,328.00	0.12
34	002782	可立克	24,400	666,364.00	0.12
35	000783	长江证券	63,800	652,674.00	0.12
36	601288	农业银行	209,000	647,900.00	0.12
37	002736	国信证券	40,800	634,440.00	0.11
38	601607	上海医药	30,800	602,448.00	0.11
39	601336	新华保险	13,700	599,786.00	0.11
40	002437	誉衡药业	68,000	562,360.00	0.10
41	600690	青岛海尔	53,300	526,604.00	0.09
42	601111	中国国航	73,100	526,320.00	0.09
43	600196	复星医药	22,500	520,650.00	0.09
44	601633	长城汽车	46,700	516,502.00	0.09
45	600909	华安证券	39,964	501,548.20	0.09
46	600637	东方明珠	21,400	498,620.00	0.09
47	600547	山东黄金	13,000	474,630.00	0.09
48	601088	中国神华	28,600	462,748.00	0.08
49	000002	万 科 A	21,800	447,990.00	0.08
50	600372	中航电子	23,600	438,016.00	0.08
51	603858	步长医药	4,370	416,461.00	0.08
52	002152	广电运通	31,000	411,680.00	0.07
53	002241	歌尔声学	15,400	408,408.00	0.07
54	000768	中航飞机	18,500	393,310.00	0.07
55	601169	北京银行	39,600	386,496.00	0.07
56	601238	广汽集团	16,500	382,305.00	0.07
57	002252	上海莱士	16,000	369,440.00	0.07
58	600398	海澜之家	33,000	356,070.00	0.06
59	600583	海油工程	47,300	349,074.00	0.06
60	601098	中南传媒	20,300	338,198.00	0.06
61	300267	尔康制药	25,800	336,690.00	0.06
62	300462	华铭智能	9,700	335,135.00	0.06
63	600115	东方航空	47,300	334,411.00	0.06
64	600383	金地集团	25,800	334,368.00	0.06
65	600018	上港集团	65,300	334,336.00	0.06

66	600820	隧道股份	30,000	330,300.00	0.06
67	300251	光线传媒	32,500	317,200.00	0.06
68	000876	新希望	38,100	306,705.00	0.06
69	300058	蓝色光标	29,200	296,964.00	0.05
70	300498	温氏股份	8,000	281,760.00	0.05
71	601928	凤凰传媒	26,400	276,408.00	0.05
72	300115	长盈精密	10,400	271,024.00	0.05
73	600585	海螺水泥	15,900	269,664.00	0.05
74	600816	安信信托	11,000	259,820.00	0.05
75	000793	华闻传媒	22,800	257,412.00	0.05
76	600485	信威集团	17,600	256,960.00	0.05
77	601989	中国重工	35,700	253,113.00	0.05
78	601801	皖新传媒	14,300	251,251.00	0.05
79	002202	金风科技	14,600	249,806.00	0.05
80	601006	大秦铁路	35,100	248,508.00	0.04
81	600340	华夏幸福	10,300	246,170.00	0.04
82	603160	N 汇顶	2,358	242,260.92	0.04
83	601018	宁波港	47,800	241,868.00	0.04
84	601231	环旭电子	22,500	240,975.00	0.04
85	002475	立讯精密	11,300	234,475.00	0.04
86	601877	正泰电器	11,500	230,000.00	0.04
87	000062	深圳华强	8,000	227,280.00	0.04
88	000069	华侨城 A	31,600	219,620.00	0.04
89	300144	宋城演艺	10,400	217,776.00	0.04
90	300431	暴风科技	4,700	216,200.00	0.04
91	600060	海信电器	12,600	215,712.00	0.04
92	000729	燕京啤酒	29,500	205,025.00	0.04
93	600703	三安光电	15,300	204,867.00	0.04
94	300003	乐普医疗	11,300	202,609.00	0.04
95	600595	中孚实业	35,700	200,634.00	0.04
96	600466	蓝光发展	20,300	196,301.00	0.04
97	600338	西藏珠峰	6,600	191,268.00	0.03
98	000807	云铝股份	27,600	184,920.00	0.03
99	603888	新华网	2,014	170,948.32	0.03
100	000895	双汇发展	8,000	167,440.00	0.03
101	603258	电魂网络	2,705	161,488.50	0.03
102	603900	通灵珠宝	4,064	156,464.00	0.03
103	002491	通鼎互联	9,900	153,846.00	0.03
104	002831	裕同科技	2,219	153,554.80	0.03

105	000960	锡业股份	11,400	149,568.00	0.03
106	603777	来伊份	2,789	148,068.01	0.03
107	300331	苏大维格	4,500	147,780.00	0.03
108	601727	上海电气	17,000	144,330.00	0.03
109	000673	当代东方	9,700	134,442.00	0.02
110	300465	高伟达	7,360	133,363.20	0.02
111	600705	中航资本	21,400	130,968.00	0.02
112	002466	天齐锂业	3,900	126,555.00	0.02
113	600026	中海发展	18,100	123,261.00	0.02
114	603556	海兴电力	2,737	123,055.52	0.02
115	603313	恒康家居	2,996	115,016.44	0.02
116	002311	海大集团	7,100	106,855.00	0.02
117	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.02
118	002081	金螳螂	10,400	101,816.00	0.02
119	603727	博迈科	2,132	101,333.96	0.02
120	603323	吴江银行	6,475	100,103.50	0.02
121	300570	太辰光	1,810	100,093.00	0.02
122	600350	山东高速	15,400	99,792.00	0.02
123	600606	绿地控股	11,000	95,810.00	0.02
124	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.02
125	002815	崇达科技	1,949	88,250.72	0.02
126	603816	顾家家居	1,831	86,679.54	0.02
127	603977	国泰集团	3,010	82,624.50	0.01
128	300182	捷成股份	8,000	82,480.00	0.01
129	300104	乐视网	2,300	82,340.00	0.01
130	300168	万达信息	4,000	80,880.00	0.01
131	603987	康德莱	2,504	80,854.16	0.01
132	603878	武进不锈	2,000	80,000.00	0.01
133	600517	置信电气	8,200	79,786.00	0.01
134	603667	五洲新春	2,404	79,548.36	0.01
135	603738	泰晶科技	1,000	77,850.00	0.01
136	603060	国检集团	2,201	77,849.37	0.01
137	300070	碧水源	4,400	77,088.00	0.01
138	300556	丝路视觉	1,226	76,453.36	0.01
139	601009	南京银行	6,900	74,796.00	0.01
140	600535	天士力	1,800	74,682.00	0.01
141	603928	兴业股份	2,670	74,359.50	0.01
142	300133	华策影视	6,500	73,775.00	0.01
143	000971	高升控股	3,100	73,315.00	0.01

144	600276	恒瑞医药	1,600	72,800.00	0.01
145	603585	苏利股份	1,041	72,578.52	0.01
146	601988	中国银行	21,000	72,240.00	0.01
147	600085	同仁堂	2,300	72,174.00	0.01
148	600010	包钢股份	25,800	71,982.00	0.01
149	600089	特变电工	7,800	71,214.00	0.01
150	600600	青岛啤酒	2,400	70,656.00	0.01
151	603336	宏辉果蔬	1,471	69,239.97	0.01
152	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.01
153	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.01
154	603819	神力股份	1,698	67,580.40	0.01
155	600373	中文传媒	3,300	66,660.00	0.01
156	603203	快克股份	1,048	65,929.68	0.01
157	300548	博创科技	754	63,773.32	0.01
158	300113	顺网科技	2,300	61,847.00	0.01
159	002827	高争民爆	2,059	60,905.22	0.01
160	603859	能科股份	1,121	59,895.03	0.01
161	603033	三维股份	1,160	59,821.20	0.01
162	600280	中央商场	6,600	56,826.00	0.01
163	300456	耐威科技	1,100	56,023.00	0.01
164	601882	海天精工	2,148	54,215.52	0.01
165	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.01
166	603036	如通股份	2,114	51,771.86	0.01
167	603633	徕木股份	1,258	51,590.58	0.01
168	002110	三钢闽光	3,900	51,480.00	0.01
169	603559	中通国脉	899	48,447.11	0.01
170	000703	恒逸石化	3,200	48,096.00	0.01
171	603389	亚振家居	1,963	47,327.93	0.01
172	300222	科大智能	2,300	46,000.00	0.01
173	002439	启明星辰	2,200	45,738.00	0.01
174	600688	上海石化	7,100	45,724.00	0.01
175	300207	欣旺达	3,200	44,480.00	0.01
176	600029	南方航空	6,000	42,120.00	0.01
177	600828	茂业商业	4,900	41,405.00	0.01
178	300288	朗玛信息	1,500	41,025.00	0.01
179	603319	湘油泵	721	40,736.50	0.01
180	002563	森马服饰	3,900	40,053.00	0.01
181	002828	贝肯能源	1,037	40,028.20	0.01
182	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.01

183	000738	中航动控	1,600	39,584.00	0.01
184	002153	石基信息	1,600	38,992.00	0.01
185	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
186	601158	重庆水务	4,400	32,692.00	0.01
187	002786	银宝山新	1,500	31,215.00	0.01
188	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.01
189	300324	旋极信息	1,500	28,995.00	0.01
190	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
191	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
192	600188	兖州煤业	2,200	23,892.00	0.00
193	300083	劲胜精密	3,200	23,520.00	0.00
194	603993	洛阳钼业	6,000	22,320.00	0.00
195	601888	中国国旅	500	21,700.00	0.00
196	000863	三湘股份	2,200	18,678.00	0.00
197	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
198	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
199	600663	陆家嘴	500	11,065.00	0.00
200	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
201	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
202	600633	浙报传媒	500	8,830.00	0.00
203	600887	伊利股份	500	8,800.00	0.00
204	002027	大众传媒	600	8,562.00	0.00
205	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
206	600823	世茂股份	500	3,510.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	4,558,915.00	0.82
2	000001	平安银行	4,550,333.00	0.82
3	000623	吉林敖东	3,614,318.05	0.65
4	000776	广发证券	3,422,484.84	0.62
5	600030	中信证券	3,223,746.00	0.58
6	600999	招商证券	2,540,290.00	0.46
7	601166	兴业银行	2,310,000.00	0.42
8	002142	宁波银行	1,792,253.22	0.32

9	000063	中兴通讯	1,739,883.00	0.31
10	002415	海康威视	1,565,818.86	0.28
11	002304	洋河股份	1,528,438.92	0.28
12	600519	贵州茅台	1,506,003.40	0.27
13	000333	美的集团	1,496,446.34	0.27
14	600036	招商银行	1,321,335.26	0.24
15	601818	光大银行	1,275,398.00	0.23
16	601766	中国中车	1,253,186.00	0.23
17	601601	中国太保	1,241,200.96	0.22
18	600016	民生银行	1,212,886.00	0.22
19	600011	华能国际	1,202,846.00	0.22
20	601328	交通银行	1,182,653.51	0.21

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000776	广发证券	3,416,705.00	0.62
2	600036	招商银行	1,304,223.00	0.24
3	600016	民生银行	1,221,816.00	0.22
4	601328	交通银行	1,187,280.00	0.21
5	601688	华泰证券	735,814.29	0.13
6	600837	海通证券	184,460.00	0.03
7	600377	宁沪高速	137,522.00	0.02

#### 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	86,079,153.89
卖出股票收入（成交）总额	8,187,820.29

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,955,000.00	5.40
	其中：政策性金融债	29,955,000.00	5.40
4	企业债券	28,593,100.00	5.15
5	企业短期融资券	368,966,000.00	66.52
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	290,727.36	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	427,804,827.36	77.13

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	041651023	16 大装备 CP001	400,000	40,088,000.00	7.23
2	011698378	16 苏国资 SCP002	400,000	39,988,000.00	7.21
3	011698134	16 厦门航空 SCP007	400,000	39,948,000.00	7.20
4	011698372	16 京二商 SCP002	400,000	39,884,000.00	7.19
5	011698319	16 雅砻江 SCP004	400,000	39,876,000.00	7.19

### 8.7 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。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。



### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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	0.99
2	应收证券清算款	14,605.50
3	应收股利	-
4	应收利息	5,021,293.55
5	应收申购款	299.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,036,199.59

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末投资前十名股票不存在流通受限情况。

#### 8.12.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长盛盛鑫混合 A	76	7,223,408.09	548,850,449.65	99.98%	128,565.37	0.02%
长盛盛鑫混合 C	179	4,617.54	0.00	0.00%	826,540.44	100.00%
合计	255	2,156,100.22	548,850,449.65	99.83%	955,105.81	0.17%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛盛鑫混合 A	99.88	0.0000%
	长盛盛鑫混合 C	91.90	0.0111%
	合计	191.78	0.0000%

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	长盛盛鑫混合 A	0
	长盛盛鑫混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛盛鑫混合 A	0
	长盛盛鑫混合 C	0
	合计	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛鑫混合 A	长盛盛鑫混合 C
基金合同生效日（2016 年 7 月 13 日）基金 份额总额	135,122.14	200,661,944.71
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	548,930,548.77	2,235,958.08
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回 份额	86,655.89	202,071,362.35
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	548,979,015.02	826,540.44

## §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 基金经理的变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2016 年 9 月 12 日起，马文祥同志兼任长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 9 月 12 日起，王超同志兼任长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元，已连续提供审计服务 1 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	91,572,039.16	100.00%	76,925.61	100.00%	-

#### 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
招商证券	55,538,103.86	100.00%	3,465,300,000.00	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) 财力雄厚，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情况：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

## 11.8 其他重大事件

除上述事项外，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部分基金销售机构及参加费率优惠活动的公告	《证券时报》及本公司网站	2016年12月26日
2	长盛基金管理有限公司关于子公司高管变更情况的公告	同上	2016年12月16日
3	长盛基金管理有限公司关于开通通联支付业务的公告	同上	2016年10月27日
4	长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度	同上	2016年10月24日

	报告		
5	长盛基金管理有限公司关于调整长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	同上	2016年9月14日
6	长盛基金管理有限公司关于撤销郑州分公司的公告	同上	2016年9月10日
7	长盛基金管理有限公司关于提醒广大投资者完善身份信息公告	同上	2016年8月31日
8	长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	同上	2016年7月19日
9	长盛盛鑫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7月19日
10	长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	同上	2016年7月14日

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛鑫灵活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。

### 12.2 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。

### 12.3 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及/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  
2017年3月27日