

# 长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
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.....	44
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
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>51</b>

11.1 备查文件目录.....	51
11.2 存放地点.....	51
11.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金		
基金简称	长盛同辉深 100 等权重分级		
场内简称	长盛同辉		
基金主代码	160809		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 9 月 13 日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	25,453,324.50 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	2012 年 9 月 26 日		
下属分级基金的基金简称	长盛同辉深 100 等权重 A	长盛同辉深 100 等权重 B	长盛同辉深 100 等权重分级
下属分级基金场内简称:	同辉 100A	同辉 100B	长盛同辉
下属分级基金的交易代码	150108	150109	160809
报告期末下属分级基金份额总额	7,688,416.00 份	7,688,416.00 份	10,076,492.50 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现跟踪深证 100 等权重指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用完全复制法，按照成份股在深证 100 等权重指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪深证 100 等权重指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪深证 100 等权重指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×深证 100 等权重指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市

	<p>场基金、债券型基金和混合型基金。</p> <p>从投资者具体持有的基金份额来看，在分级运作期内，由于基金收益分配的安排，长盛同辉深 100 等权重 A 份额将表现出低风险、收益稳定的明显特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；长盛同辉深 100 等权重 B 份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。</p>		
下属分级基金的风险收益特征	长盛同辉深 100 等权重 A：低风险、收益相对稳定。	长盛同辉深 100 等权重 B：高风险、高预期收益。	长盛同辉深 100 等权重分级：较高风险、较高预期收益。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-62350088	010-67595096
传真		010-82255988	010-66275853
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100088	100033
法定代表人		周兵	王洪章

### 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》
登载基金半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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-103,080.58
本期利润	1,733,812.25
加权平均基金份额本期利润	0.0670
本期加权平均净值利润率	6.79%
本期基金份额净值增长率	6.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	7,353,252.97
期末可供分配基金份额利润	0.2889
期末基金资产净值	26,364,904.44
期末基金份额净值	1.036
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	40.09%

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	7.25%	0.83%	6.81%	0.82%	0.44%	0.01%
过去三个月	4.02%	0.91%	1.82%	0.89%	2.20%	0.02%
过去六个月	6.91%	0.83%	4.93%	0.84%	1.98%	-0.01%
过去一年	4.70%	0.88%	2.74%	0.88%	1.96%	0.00%
过去三年	39.88%	1.93%	58.43%	1.84%	-18.55%	0.09%
自基金合同生效起至今	40.09%	1.72%	46.94%	1.67%	-6.85%	0.05%

注：本基金业绩比较基准=95%×深证 100 等权重指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税



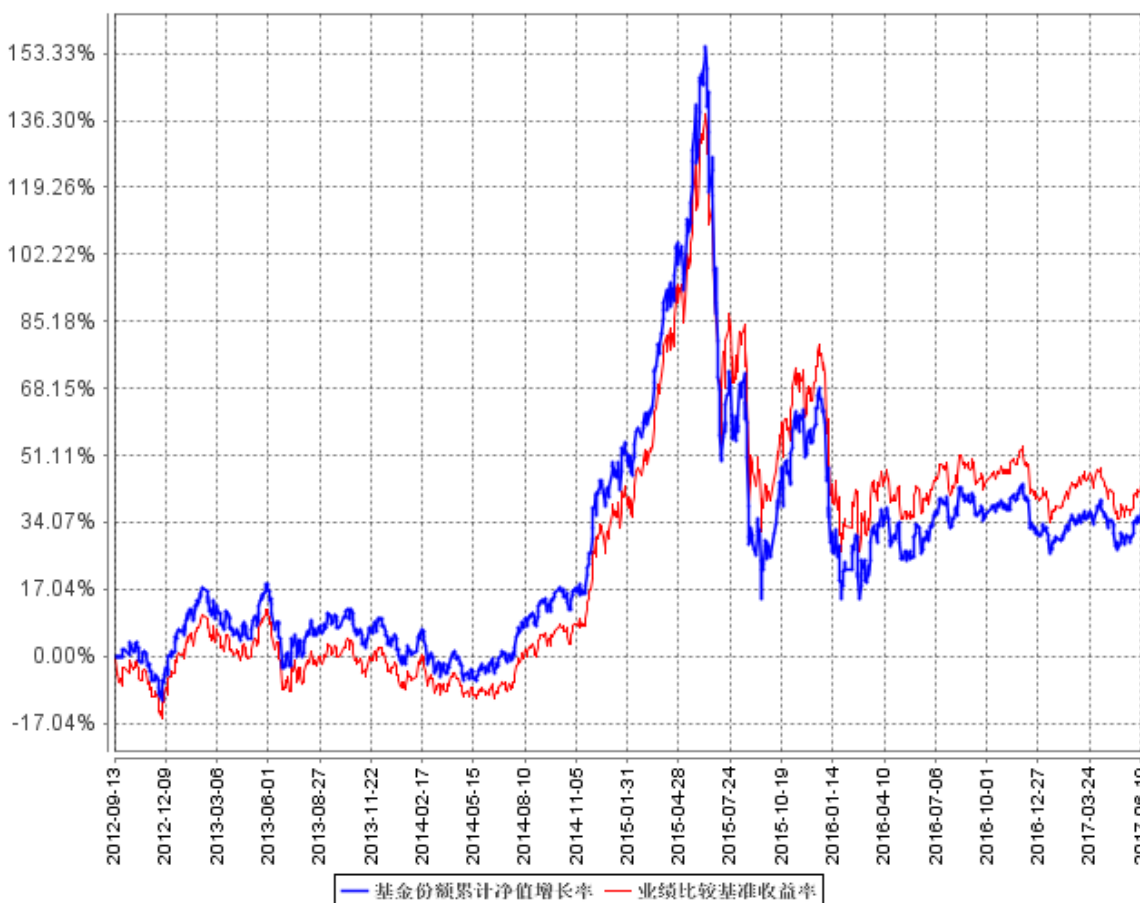
后)。

基准指数：深证 100 等权重指数

本基金的业绩比较基准深证 100 等权重指数由深圳证券交易所和深圳证券信息有限公司构建和发布。具体的编制规则和再平衡过程请参见深证 100 等权重指数编制细则。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，业绩比较基准中深证 100 等权重指数、一年期银行定期存款每日按照 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 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十六条“（二）投资范围”、“（八）投资限制”的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2017 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十二只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王超	本基金基金经理，长盛同瑞中证 200 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，长盛盛鑫灵活配置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，长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金，长盛中小盘精选混合型证券投资基金	2013 年 1 月 5 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），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。

	金经理，长盛医疗行业 量化配置股票型证券 投资基金基金经理。				
--	--------------------------------------	--	--	--	--

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金合同》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

在报告期内，我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略，尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响，将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.036 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.91%，业绩比较基准收益率为 4.93%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为 0.11%，控制在 0.35% 之内；年化跟踪误差为 2.41%，控制在 4% 之内。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2017 年上半年的市场行情，虽然我们成功预测一季度会有“春季攻势”，应当灵活参与市场机会，并且认为一季度末有可能成为阶段高点，因为基本面因素将高位回落，应当保持谨慎。但是二季度开始的调整，白马股和“中小创”之间的分化还是大大超出我们的预料。监管机构之间的“监管收紧竞赛”是导致这一分化的催化剂，一方面，基金持仓集中的白马股成为抱团取暖的对象，股价屡创新高；另一方面，相对估值较高的“中小创”呈现出低位暴跌的态势，而不是大家之前普遍预期的重新回归成长的节奏。

展望未来的行情，外部因素对国内市场的影响似乎偏弱，二季度的联储加息和欧洲大选都没有对市场产生显著影响，未来外部的重要事件趋于平静，将不会对国内市场造成明显冲击。国内的经济基本面将会继续维持回落态势，稳增长的压力逐步加大，金融监管趋严的竞赛是否会继续，流动性紧平衡的局面是否会维持，这些都将会影响整个市场的情绪。中长期趋势方面，监管机构打击投机炒作、鼓励价值投资的态度十分坚决，对白马股的长期价值投资有可能成为市场主流资金的操作模式。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

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

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第二十条中对基金的收益与分配的约定，在分级运作期内，本基金（包括长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额和长盛同辉深 100 等权重份额）不进行收益分配。

#### **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**

本基金自 2016 年 3 月 25 日至 2017 年 6 月 30 日期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,933,893.47	2,003,642.08
结算备付金		-	-
存出保证金		512.11	2,039.79
交易性金融资产	6.4.7.2	24,564,628.89	23,797,097.83
其中：股票投资		24,564,628.89	23,797,097.83
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	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	333.78	402.44
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		26,499,368.25	25,803,182.14
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	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		1.02	-
应付管理人报酬		20,829.69	22,534.74
应付托管费		4,582.55	4,957.63
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	4,597.47
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	109,050.55	140,000.00
负债合计		134,463.81	172,089.84
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	19,011,651.47	19,761,065.48
未分配利润	6.4.7.10	7,353,252.97	5,870,026.82
所有者权益合计		26,364,904.44	25,631,092.30
负债和所有者权益总计		26,499,368.25	25,803,182.14

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，长盛同辉深 100 等权重分级份额净值 1.036 元，长盛同辉深 100 等权重 A 份额参考净值 1.056 元，长盛同辉深 100 等权重 B 份额参考净值 1.016 元；基金份额总额 25,453,324.50 份，其中长盛同辉深 100 等权重 A 份额 7,688,416.00 份，长盛同辉深 100 等权重 B 份额 7,688,416.00 份，长盛同辉深 100 等权重分级份额 10,076,492.50 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,994,790.28	-7,235,662.15
1.利息收入		7,171.18	13,094.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,171.18	13,094.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		149,415.72	191,398.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-11,880.70	-59,855.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	161,296.42	251,253.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,836,892.83	-7,476,213.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-



5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,310.55	36,058.30
<b>减：二、费用</b>		260,978.03	357,533.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	126,448.85	181,304.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	27,818.76	39,886.94
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,168.88	35,893.93
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	104,541.54	100,448.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,733,812.25	-7,593,195.30
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,733,812.25	-7,593,195.30

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	19,761,065.48	5,870,026.82	25,631,092.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,733,812.25	1,733,812.25
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）	-749,414.01	-250,586.10	-1,000,000.11
其中：1.基金申购款	78,199.02	30,187.59	108,386.61
2.基金赎回款	-827,613.03	-280,773.69	-1,108,386.72
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）	19,011,651.47	7,353,252.97	26,364,904.44

项目	上年度可比期间 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）	30,068,899.41	17,375,005.15	47,443,904.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,593,195.30	-7,593,195.30
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）	-4,885,337.04	-1,640,890.39	-6,526,227.43
其中：1.基金申购款	17,055,285.77	5,264,840.94	22,320,126.71
2.基金赎回款	-21,940,622.81	-6,905,731.33	-28,846,354.14
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）	25,183,562.37	8,140,919.46	33,324,481.83

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：

<u>林培富</u>	<u>刁俊东</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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金(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[2012]827 号《关于核准长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金募集的批复》核准，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同辉深证 100 等权重指数分级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基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 844,010,148.73 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(2012)第 356 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金

合同》于 2012 年 9 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 844,062,743.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 52,594.60 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的基金份额包括长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“同辉基金份额”）、长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（以下简称“同辉 A 份额”）及长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金之积极收益类份额（以下简称“同辉 B 份额”）。本基金通过场外、场内两种方式公开发售同辉基金份额。投资人场外认购所得的同辉基金份额，不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的同辉基金份额，将按 1:1 的基金份额配比自动分离为同辉 A 份额和同辉 B 份额。同辉 A 份额和同辉 B 份额的数量保持 1:1 的比例不变。基金合同生效后，同辉基金份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下，同辉 A 份额和同辉 B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内同辉基金份额与同辉 A 份额和同辉 B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 2 份场内同辉基金份额按照 1:1 的份额配比转换成 1 份同辉 A 份额与 1 份同辉 B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 1 份同辉 A 份额与 1 份同辉 B 份额按照 1:1 的基金份额配比转换成 2 份场内同辉基金份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：同辉基金份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为同辉基金份额、同辉 A 份额和同辉 B 份额数量的总和。本基金每 1 份同辉 A 份额与每 1 份同辉 B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 2 份同辉基金份额的基金份额净值之和。同辉 A 份额的约定收益率为 7.0%，同辉 A 份额的份额净值每日按该约定收益率逐日计算，计算出同辉 A 份额的基金份额参考净值后，根据同辉基金份额的基金份额净值与同辉 A 份额、同辉 B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出同辉 B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在分级运作期内，在自分级运作期起始日后满一年、满两年、满三年、满四年的对应日（若该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日），本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算后同辉 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额折算基准日折算前同辉 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为场内同辉基金份额分配给同辉 A 份额持有人。同辉基金份额持有人持有的每 1 份同辉基金份额将按 0.5 份同辉 A 份额获得新增同辉基金份额的分配。持有场外同辉基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得

新增场外同辉基金份额的分配；持有场内同辉基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内同辉基金份额的分配。经过上述份额折算后，同辉 A 份额的参考净值和同辉基金份额的净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，同辉 A 份额和同辉 B 份额的份额配比保持 1:1 的比例。同辉 B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变同辉 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当同辉基金份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时，或当同辉 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，本基金将以该日后的次一交易日为本基金不定期折算基准日，进行不定期份额折算：份额折算后本基金将确保同辉 A 份额和同辉 B 份额的比例为 1:1，份额折算后同辉 A 份额的基金份额参考净值、同辉 B 份额的基金份额参考净值和同辉基金份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当同辉基金份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时，基金份额折算基准日折算前同辉基金份额的基金份额净值及同辉 A 份额、同辉 B 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分均将折算为同辉基金份额分别分配给同辉基金份额、同辉 A 份额和同辉 B 份额的持有人。当同辉 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，同辉基金份额、同辉 A 份额和同辉 B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]319 号核准，本基金同辉 A 份额 295,025,570.00 份基金份额与同辉 B 份额 295,025,571.00 份基金份额于 2012 年 9 月 26 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的同辉基金份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为同辉 A 份额和同辉 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的同辉基金份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为同辉 A 份额和同辉 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金股票投资占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资于深证 100 指数成份股票、备选成份股票的资产占基金资产的比例不低于 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0-3%，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%。本基金通过被动的指数化投资管理，实现对深证 100 指数的有效跟踪，力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的跟踪误差控制在限定的范围以内。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{深证 100 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率}$ (税

后)。

#### **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》、《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金合同》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、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关

于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》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。

## 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	1,933,893.47
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	1,933,893.47

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,836,707.07	24,564,628.89	727,921.82

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	23,836,707.07	24,564,628.89	727,921.82

#### 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 2017年6月30日
应收活期存款利息	333.60
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.18
合计	333.78

#### 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

注：本基金本报告期末无应付交易费用。

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.01
其他	4,914.00
预提费用	104,136.54
合计	109,050.55

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,456,575.20	19,761,065.48
本期申购	104,674.61	78,199.02
本期赎回(以“-”号填列)	-1,107,925.31	-827,613.03
- 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	25,453,324.50	19,011,651.47

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、截至 2017 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 15,376,832.00 份（其中长盛同辉深 100 等权重 A 份额为 7,688,416.00 份，长盛同辉深 100 等权重 B 份额为 7,688,416.00 份）；本基金于场内未上市交易的基金份额为 6,464,475.00 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 3,612,017.50 份，均为长盛同辉深 100 等权重份额。场内的基金份额登记在证券登记结算系统，场外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	15,638,479.26	-9,768,452.44	5,870,026.82
本期利润	-103,080.58	1,836,892.83	1,733,812.25
本期基金份额交易产生的变动数	-588,944.61	338,358.51	-250,586.10



其中：基金申购款	61,417.69	-31,230.10	30,187.59
基金赎回款	-650,362.30	369,588.61	-280,773.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,946,454.07	-7,593,201.10	7,353,252.97

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	7,160.93
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	-
其他	10.25
合计	7,171.18

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	1,073,550.00
减：卖出股票成本总额	1,085,430.70
买卖股票差价收入	-11,880.70

#### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期未取得债券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期未取得衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	161,296.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	161,296.42

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,836,892.83
——股票投资	1,836,892.83
——债券投资	-
——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	1,836,892.83

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,310.55
基金转换费收入	-
合计	1,310.55

注：1、本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，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。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,168.88
银行间市场交易费用	-
合计	2,168.88

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	29,752.78
信息披露费	44,630.98
深交所上市年费	29,752.78
银行划款费用	405.00
账户维护费	-
合计	104,541.54

#### 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（“长盛基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

##### 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

注：本基金无关联方交易单元，未发生通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	126,448.85	181,304.19
其中：支付销售机构的客	9,350.53	10,417.05

户维护费		
------	--	--

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 1.00%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×1.00%/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
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,818.76	39,886.94

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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×0.22%/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自有资金投资本基金的情况

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

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

注：除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末未投资本基金。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,933,893.47	7,160.93	4,590,384.36	12,636.44

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期无利润分配情况。

#### 6.4.12 期末（2017 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：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事项停牌	10.22	-	-	34,000	406,222.86	347,480.00	-
000100	TCL 集团	2017 年 4 月 21 日	重大事项停牌	3.48	2017 年 7 月 26 日	3.72	85,200	326,202.90	296,496.00	-
002252	上海莱士	2017 年 4 月 21 日	重大事项停牌	20.34	-	-	10,780	230,123.42	219,265.20	-
000629	*ST 钒钛	2017 年 4 月 20 日	重大事项停牌	3.00	-	-	63,200	208,760.50	189,600.00	-
000061	农产品	2017 年 6 月 28 日	重大事项停牌	9.06	-	-	18,200	241,779.39	164,892.00	-
300085	银之杰	2017 年 6 月 30 日	重大事项停牌	18.50	2017 年 7 月 7 日	18.88	7,900	236,210.00	146,150.00	-
000503	海虹控股	2017 年 5 月 11 日	重大事项停牌	24.93	-	-	5,800	192,457.11	144,594.00	-
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大事项停牌	28.62	-	-	4,981	221,716.73	142,556.22	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日持有以上因公布的重大事项可能产生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押的债券。

### 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押的债券。

### 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

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，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。

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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

#### **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。

于 2017 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、结算备付金、存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	1,933,893.47	-	-	-	1,933,893.47
存出保证金	512.11	-	-	-	512.11
交易性金融资产	-	-	-	24,564,628.89	24,564,628.89
应收利息	-	-	-	333.78	333.78
资产总计	1,934,405.58	-	-	24,564,962.67	26,499,368.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	1.02	1.02
应付管理人报酬	-	-	-	20,829.69	20,829.69
应付托管费	-	-	-	4,582.55	4,582.55
其他负债	-	-	-	109,050.55	109,050.55
负债总计	-	-	-	134,463.81	134,463.81
利率敏感度缺口	1,934,405.58	-	-	24,430,498.86	26,364,904.44
上年度末 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	2,003,642.08	-	-	-	2,003,642.08
存出保证金	2,039.79	-	-	-	2,039.79
交易性金融资产	-	-	-	23,797,097.83	23,797,097.83
应收利息	-	-	-	402.44	402.44
资产总计	2,005,681.87	-	-	23,797,500.27	25,803,182.14
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	22,534.74	22,534.74
应付托管费	-	-	-	4,957.63	4,957.63



应付交易费用	-	-	4,597.47	4,597.47
其他负债	-	-	140,000.00	140,000.00
负债总计	-	-	172,089.84	172,089.84
利率敏感度缺口	2,005,681.87	-	23,625,410.43	25,631,092.30

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 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有的交易性债券投资（2016 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016 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。

本基金原则上采用复制指数投资策略，股票资产跟踪的标的指数为深证 100 等权重指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中包括深证 100 等权重指数成份股、备选成份股、新股（如一级市场初次发行或增发）等，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%。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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	24,564,628.89	93.17	23,797,097.83	92.84

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	24,564,628.89	93.17	23,797,097.83	92.84

#### 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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	1,274,488.13	1,353,992.66
	业绩比较基准下降5%	-1,274,488.13	-1,353,992.66

#### 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2017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22,913,595.47元，属于第二层次的余额为1,651,033.42元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次22,594,229.53元，第二层次1,202,868.30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 2017 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(2016 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	24,564,628.89	92.70
	其中：股票	24,564,628.89	92.70
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	1,933,893.47	7.30
7	其他各项资产	845.89	0.00
8	合计	26,499,368.25	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	156,391.68	0.59
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,140,007.63	49.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	243,207.00	0.92
F	批发和零售业	232,875.00	0.88
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,615,432.69	9.92
J	金融业	1,946,624.25	7.38
K	房地产业	1,779,122.70	6.75
L	租赁和商务服务业	228,546.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	885,964.08	3.36
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	709,353.27	2.69
S	综合	161,217.52	0.61
	合计	22,098,741.82	83.82

### 7.2.2 期末积极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	-	-
B	采矿业	189,600.00	0.72
C	制造业	1,006,264.65	3.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	238,952.00	0.91
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	180,070.00	0.68
K	房地产业	507,030.42	1.92
L	租赁和商务服务业	343,970.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,465,887.07	9.35

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 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	000002	万科A	29,914	746,952.58	2.83
2	000651	格力电器	15,300	629,901.00	2.39

3	002415	海康威视	16,126	520,869.80	1.98
4	000538	云南白药	4,632	434,713.20	1.65
5	000333	美的集团	9,850	423,944.00	1.61
6	000858	五粮液	7,300	406,318.00	1.54
7	000725	京东方 A	95,879	398,856.64	1.51
8	000568	泸州老窖	7,865	397,811.70	1.51
9	002236	大华股份	17,200	392,332.00	1.49
10	000338	潍柴动力	28,400	374,880.00	1.42
11	000063	中兴通讯	15,739	373,643.86	1.42
12	000069	华侨城 A	34,832	350,409.92	1.33
13	002129	中环股份	34,000	347,480.00	1.32
14	002456	欧菲光	18,725	340,233.25	1.29
15	002475	立讯精密	11,596	339,067.04	1.29
16	001979	招商蛇口	15,696	335,266.56	1.27
17	000709	河钢股份	79,539	333,268.41	1.26
18	000423	东阿阿胶	4,601	330,765.89	1.25
19	002460	赣锋锂业	6,900	319,125.00	1.21
20	002241	歌尔股份	16,400	316,192.00	1.20
21	000413	东旭光电	28,134	315,663.48	1.20
22	002008	大族激光	9,000	311,760.00	1.18
23	002466	天齐锂业	5,600	304,360.00	1.15
24	000100	TCL 集团	85,200	296,496.00	1.12
25	002304	洋河股份	3,401	295,240.81	1.12
26	002142	宁波银行	15,200	293,360.00	1.11
27	002230	科大讯飞	7,330	292,467.00	1.11
28	002450	康得新	12,786	287,940.72	1.09
29	300070	碧水源	15,152	282,584.80	1.07
30	000839	中信国安	27,920	278,920.80	1.06
31	002065	东华软件	12,060	262,787.40	1.00
32	000540	中天金融	37,700	262,015.00	0.99
33	000895	双汇发展	11,028	261,915.00	0.99
34	300124	汇川技术	10,243	261,606.22	0.99
35	000826	启迪桑德	7,203	252,969.36	0.96
36	000630	铜陵有色	86,635	246,043.40	0.93
37	002081	金螳螂	22,150	243,207.00	0.92
38	000060	中金岭南	21,600	241,920.00	0.92
39	000001	平安银行	25,699	241,313.61	0.92
40	000625	长安汽车	16,700	240,814.00	0.91
41	000157	中联重科	53,600	240,664.00	0.91

42	000876	新希望	29,100	239,202.00	0.91
43	000776	广发证券	13,721	236,687.25	0.90
44	000623	吉林敖东	10,270	235,080.30	0.89
45	002024	苏宁云商	20,700	232,875.00	0.88
46	000793	华闻传媒	22,891	231,656.92	0.88
47	000402	金融街	19,724	231,165.28	0.88
48	000768	中航飞机	11,900	219,436.00	0.83
49	002252	上海莱士	10,780	219,265.20	0.83
50	002202	金风科技	13,900	215,033.00	0.82
51	000046	泛海控股	23,336	203,723.28	0.77
52	000166	申万宏源	36,350	203,560.00	0.77
53	002594	比亚迪	4,001	199,849.95	0.76
54	002465	海格通信	17,732	190,441.68	0.72
55	300418	昆仑万维	8,100	185,247.00	0.70
56	000783	长江证券	19,500	184,665.00	0.70
57	300315	掌趣科技	22,600	184,416.00	0.70
58	000559	万向钱潮	17,280	183,513.60	0.70
59	002030	达安基因	8,360	182,164.40	0.69
60	002405	四维图新	9,105	179,914.80	0.68
61	000738	航发控制	8,900	174,173.00	0.66
62	002736	国信证券	13,125	173,906.25	0.66
63	002385	大北农	27,203	171,106.87	0.65
64	000977	浪潮信息	9,778	169,354.96	0.64
65	000792	盐湖股份	16,089	168,130.05	0.64
66	300027	华谊兄弟	20,449	165,432.41	0.63
67	000750	国海证券	29,900	164,450.00	0.62
68	000988	华工科技	11,200	163,408.00	0.62
69	002739	万达电影	3,202	163,205.94	0.62
70	300024	机器人	8,289	161,635.50	0.61
71	000009	中国宝安	19,928	161,217.52	0.61
72	002673	西部证券	11,337	161,212.14	0.61
73	000917	电广传媒	14,100	159,330.00	0.60
74	000686	东北证券	15,640	157,182.00	0.60
75	300498	温氏股份	6,672	156,391.68	0.59
76	300059	东方财富	12,593	151,367.86	0.57
77	300251	光线传媒	18,200	149,058.00	0.57
78	300085	银之杰	7,900	146,150.00	0.55
79	000503	海虹控股	5,800	144,594.00	0.55
80	300104	乐视网	4,981	142,556.22	0.54

81	002183	怡亚通	15,800	136,354.00	0.52
82	300017	网宿科技	11,146	134,532.22	0.51
83	002292	奥飞娱乐	7,853	132,715.70	0.50
84	300168	万达信息	9,112	132,579.60	0.50
85	002176	江特电机	15,100	131,672.00	0.50
86	002500	山西证券	13,600	130,288.00	0.49
87	300253	卫宁健康	16,150	126,131.50	0.48
88	300431	暴风集团	3,963	94,438.29	0.36
89	002027	分众传媒	6,700	92,192.00	0.35

### 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

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	002146	荣盛发展	33,366	329,322.42	1.25
2	000778	新兴铸管	47,547	318,564.90	1.21
3	000039	中集集团	16,000	288,480.00	1.09
4	000425	徐工机械	75,785	284,193.75	1.08
5	000883	湖北能源	47,600	238,952.00	0.91
6	000629	*ST 钒钛	63,200	189,600.00	0.72
7	000712	锦龙股份	11,000	180,070.00	0.68
8	300058	蓝色光标	22,900	179,078.00	0.68
9	000031	中粮地产	23,600	177,708.00	0.67
10	000061	农产品	18,200	164,892.00	0.63
11	002276	万马股份	11,400	115,026.00	0.44

### 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	002673	西部证券	16,068.93	0.06

#### 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	000002	万科A	30,281.00	0.12
2	000651	格力电器	21,730.00	0.08
3	000338	潍柴动力	17,153.00	0.07



4	000725	京东方 A	17,042.00	0.07
5	000100	TCL 集团	16,779.00	0.07
6	000709	河钢股份	16,131.00	0.06
7	000425	徐工机械	16,046.00	0.06
8	000839	中信国安	15,861.00	0.06
9	000333	美的集团	15,719.00	0.06
10	002146	荣盛发展	15,441.00	0.06
11	000538	云南白药	15,231.00	0.06
12	000630	铜陵有色	15,127.00	0.06
13	000625	长安汽车	14,553.00	0.06
14	002142	宁波银行	14,547.00	0.06
15	000768	中航飞机	14,377.00	0.06
16	000778	新兴铸管	14,266.00	0.06
17	000157	中联重科	13,971.00	0.05
18	002236	大华股份	13,828.00	0.05
19	001979	招商蛇口	13,784.00	0.05
20	002456	欧菲光	13,400.00	0.05

#### 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	16,068.93
卖出股票收入（成交）总额	1,073,550.00

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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

### 7.12.2

基金投资的前十名股票，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	512.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	333.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	845.89

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 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：本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
长盛同辉深 100 等权重 A	117	65,712.96	6,770,681.00	88.06%	917,735.00	11.94%
长盛同辉深 100 等权重 B	950	8,093.07	2,174,670.00	28.29%	5,513,746.00	71.71%
长盛同辉深 100 等权重分级	541	18,625.68	5,603,361.78	55.61%	4,473,130.72	44.39%
合计	1,608	15,829.18	14,548,712.78	57.16%	10,904,611.72	42.84%

注：1、以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

2、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。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

长盛同辉深 100 等权重 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	太平洋资产管理有限责任公司	5,947,272.00	77.35%
2	天平汽车保险股份有限公司	769,243.00	10.01%
3	欧静虹	150,590.00	1.96%
4	陈朝英	139,100.00	1.81%
5	吴文治	100,000.00	1.30%
6	李富国	96,831.00	1.26%
7	刘亦新	80,000.00	1.04%
8	蒋传和	42,800.00	0.56%
9	崔秀兰	35,885.00	0.47%
10	魏巍	31,081.00	0.40%

长盛同辉深 100 等权重 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
----	-------	---------	----------

1	上海铂绅投资中心(有限合伙)一铂 绅一号证券投资基金(私募)	2,146,421.00	27.92%
2	吴富英	200,000.00	2.60%
3	古广树	156,986.00	2.04%
4	宋晋光	155,000.00	2.02%
5	欧静虹	148,994.00	1.94%
6	贾真	139,000.00	1.81%
7	颜仁华	117,197.00	1.52%
8	阮国伟	108,389.00	1.41%
9	李慧	105,000.00	1.37%
10	石红	102,000.00	1.33%

注：1、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；

2、对于长盛同辉深 100 等权重 A 份额、长盛同辉深 100 等权重 B 份额前十名持有人持有份额比例的分母采用各自级别的份额。

### 8.3 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	长盛同辉深 100 等权重 A	0.00	0.0000%
	长盛同辉深 100 等权重 B	0.00	0.0000%
	长盛同辉深 100 等权重分级	0.00	0.0000%
	合计	0.00	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。

### 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	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 研究部门负责人持有本 开放式基金	长盛同辉深 100 等权重 A	0
	长盛同辉深 100 等权重 B	0
	长盛同辉深 100 等权重分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本 开放式基金	长盛同辉深 100 等权重 A	0
	长盛同辉深 100 等权重 B	0
	长盛同辉深 100 等权重分级	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛同辉深 100 等权重 A	长盛同辉深 100 等权重 B	长盛同辉深 100 等权重分级
基金合同生效日（2012 年 9 月 13 日） 基金份额总额	295,025,570.00	295,025,571.00	254,011,602.33
本报告期期初基金份额总额	7,943,468.00	7,943,468.00	10,569,639.20
本报告期基金总申购份额	-	-	104,674.61
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	1,107,925.31
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-255,052.00	-255,052.00	510,104.00
本报告期末基金份额总额	7,688,416.00	7,688,416.00	10,076,492.50

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

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

#### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内本基金托管人的高级管理人员无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期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	
浙商证券	1	1,073,550.00	98.53%	1,000.19	100.00%	-
国海证券	1	16,068.93	1.47%	-	-	-

### 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
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

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) 资质雄厚，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：无。

## 10.8 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司旗下部分基金增加基煜销售并开通基金转换业务的公告	《证券时报》及本公司网站	2017年6月29日
2	长盛基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》和《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	同上	2017年4月27日
3	长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金招募说明书更新	同上	2017年4月26日
4	长盛同辉深证100等权重指数分级基金基金招募说明书-摘要	同上	2017年4月26日
5	长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金2017年第1季度报告	同上	2017年4月22日
6	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	同上	2017年4月22日
7	长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金2017年第1季度报告	同上	2017年4月22日
8	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加广发证券申购(含定投)费率优惠活动的公告	同上	2017年4月10日
9	长盛基金管理有限公司高级管理人员董事长变更的公告	同上	2017年3月28日

10	长盛基金管理有限公司高级管理人员副总经理变更的公告	同上	2017 年 3 月 28 日
11	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	同上	2017 年 3 月 28 日
12	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金 2016 年度报告	同上	2017 年 3 月 27 日
13	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金 2016 年度报告 摘要	同上	2017 年 3 月 27 日
14	长盛基金管理有限公司关于增加肯特瑞财富为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2017 年 3 月 24 日
15	长盛基金管理有限公司关于增加蛋卷基金为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2017 年 3 月 21 日
16	长盛基金管理有限公司关于增加济安财富为旗下部分基金销售机构及参加费率优惠活动的公告	同上	2017 年 3 月 21 日
17	长盛基金管理有限公司关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投业务及转换业务的公告	同上	2017 年 3 月 21 日
18	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	同上	2017 年 2 月 23 日
19	长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	同上	2017 年 1 月 21 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (二) 《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金合同》；
- (三) 《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金托管协议》；
- (四) 《长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金招募说明书》；
- (五) 法律意见书；
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (七) 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 8 月 24 日