

长盛中证申万一带一路主题指数分级证券 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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	59
§11 备查文件目录.....	62

11.1 备查文件目录.....	62
11.2 存放地点.....	62
11.3 查阅方式.....	62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金		
基金简称	长盛中证申万一带一路指数分级		
场内简称	一带一路		
基金主代码	502013		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,075,798,964.19 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2015 年 6 月 9 日		
下属分级基金的基金简称	长盛一带一 A	长盛一带一 B	长盛中证申万一带一路指数分级
下属分级基金场内简称:	一带一 A	一带一 B	一带一路
下属分级基金的交易代码	502014	502015	502013
报告期末下属分级基金份额总额	210,879,672.00 份	210,879,672.00 份	1,654,039,620.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制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不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对中证申万一带一路主题指数的有效跟踪。
投资策略	1、股票投资策略

	<p>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。</p> <p>2、债券组合管理策略</p> <p>基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。</p> <p>3、金融衍生工具投资策略</p> <p>在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低调仓成本与跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。</p> <p>4、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	<p>中证申万一带一路主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%</p>		
风险收益特征	<p>本基金为股票型指数基金，风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。</p>		
下属分级基金的风险收益特征	长盛一带一 A：低风险、收益相对稳定	长盛一带一 B：高风险、高预期收益	长盛中证申万一带一路指数分级：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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100088	100818
法定代表人		周兵	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》 《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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	-229,958,970.72
本期利润	77,458,908.44
加权平均基金份额本期利润	0.0336
本期加权平均净值利润率	4.04%
本期基金份额净值增长率	6.28%
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	-1,599,448,761.44
期末可供分配基金份额利润	-0.7705
期末基金资产净值	1,756,022,983.10
期末基金份额净值	0.846
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	-47.56%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.19%	0.67%	3.41%	0.65%	0.78%	0.02%
过去三个月	-0.12%	0.92%	-0.62%	0.92%	0.50%	0.00%

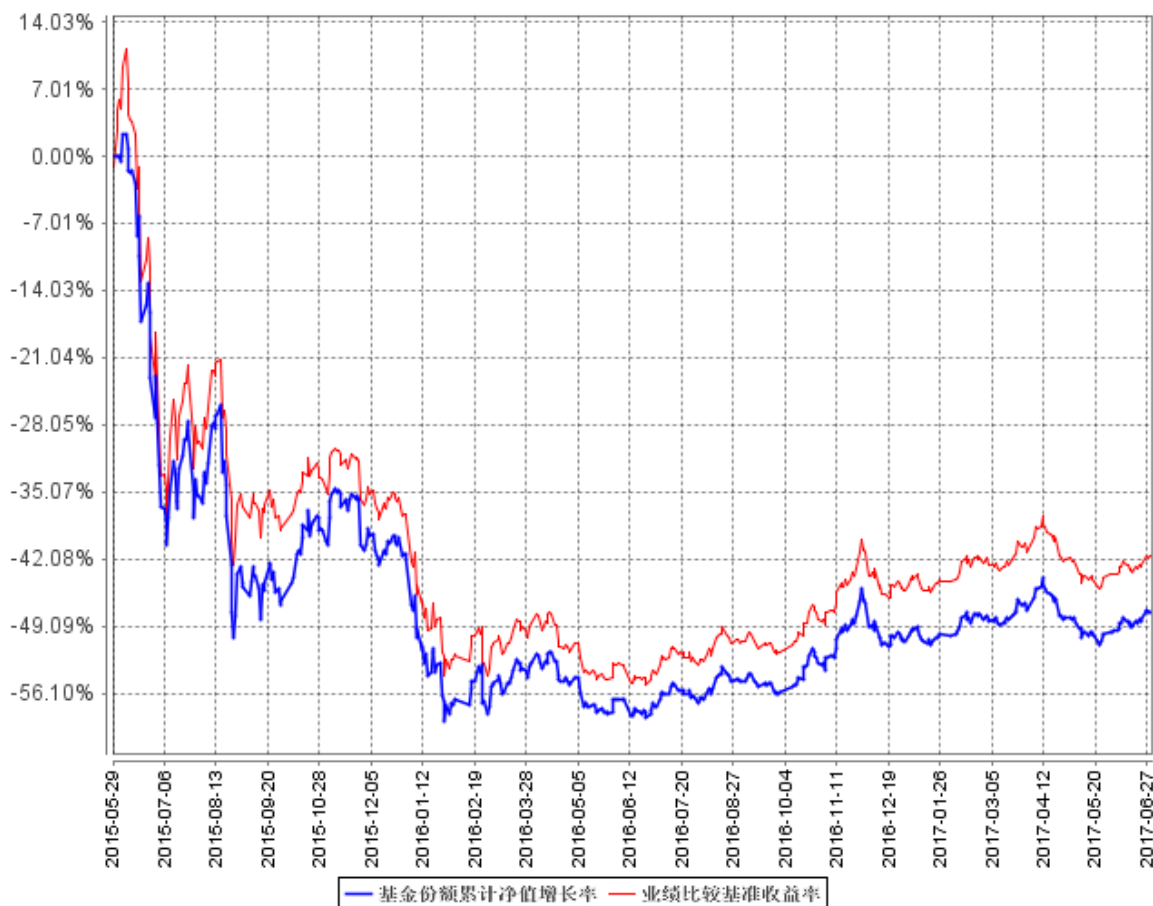
过去六个月	6.28%	0.86%	6.53%	0.86%	-0.25%	0.00%
过去一年	23.29%	1.04%	26.22%	1.02%	-2.93%	0.02%
自基金合同 生效起至今	-47.56%	2.22%	-41.82%	2.10%	-5.74%	0.12%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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，业绩比较基准中中证申万一带一路主题指数、银行活期存款利率每日按照 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，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十五部分（二）投资范围、（七）投资限制的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
冯雨生	本基金基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业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，长盛积极配置债券型证券投资基金	2015 年 5 月 29 日	-	9 年	冯雨生先生，1983 年 11 月出生。毕业于光华管理学院金融系，北京大学经济学硕士，CFA（特许金融分析师）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程研究员，同盛基金经理助理等职务。

	<p>基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛信息安全主题量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，量化投资部负责人。</p>				
--	---	--	--	--	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下：

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

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

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

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

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，

使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年一季度股票市场整体震荡上行，4 月份大幅下跌，之后温和反弹。MSCI 概念、白马股和雄安概念板块大幅上涨，次新股、小市值和区块链概念板块大幅下跌。行业上，家用电器、食品饮料和非银金融等行业涨幅靠前，传媒、农林牧渔和纺织服装跑输市场。风格上，整个上半年大盘价值股跑赢小盘成长股。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.846 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.28%，业绩比较基准收益率为 6.53%。本报告期内日均跟踪误差为 0.1701%，年度化跟踪误差为 2.6895%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预期宏观经济仍将平稳运行，美国和欧洲经济数据好转将有利于出口增长。货币政策大概率中性偏紧，财政政策偏积极。我们维持之前的看法，认为股市仍会出现大幅震荡。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、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十九部分中对基金利润分配原则的约定，在存续期内，本基金（包括长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路 A 份额、长盛中证申万一带一路 B 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

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛中证申万一带一路主题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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	131,898,592.27	83,214,482.28
结算备付金		15,013.90	4,047,051.51
存出保证金		316,031.21	378,577.00
交易性金融资产	6.4.7.2	1,654,664,667.38	1,459,026,795.70
其中：股票投资		1,654,664,667.38	1,459,026,795.70
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		14,692,060.16	-
应收利息	6.4.7.5	27,718.82	18,597.81
应收股利		-	-
应收申购款		787,783.20	3,057,909.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,802,401,866.94	1,549,743,413.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		42,857,348.30	8,301,735.45
应付管理人报酬		1,617,966.67	1,320,935.05
应付托管费		355,952.65	290,605.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,046,547.14	1,556,467.60
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	501,069.08	351,652.57
负债合计		46,378,883.84	11,821,396.36
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,348,658,652.17	3,116,333,862.74
未分配利润	6.4.7.10	-1,592,635,669.07	-1,578,411,845.41
所有者权益合计		1,756,022,983.10	1,537,922,017.33
负债和所有者权益总计		1,802,401,866.94	1,549,743,413.69

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，长盛中证申万一带一路份额净值人民币 0.846 元，长盛中证申万一带一路 A 份额参考净值人民币 1.029 元，长盛中证申万一带一路 B 份额参考净值人民币 0.663 元；基金份额总额 2,075,798,964.19 份，其中，长盛中证申万一带一路份额总额 1,654,039,620.19 份，长盛中证申万一带一路 A 份额总额 210,879,672.00 份，长盛中证申万一带一路 B 份额总额 210,879,672.00 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛中证申万一带一路主题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
一、收入		92,169,968.33	-392,135,571.56
1.利息收入		495,603.40	320,727.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	495,603.40	319,750.30
债券利息收入		-	976.96
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）		-217,279,209.52	-34,745,919.22
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-228,408,375.84	-43,447,964.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	333,559.34
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	11,129,166.32	8,368,485.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	307,417,879.16	-357,887,439.85
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	1,535,695.29	177,060.25
减：二、费用		14,711,059.89	7,552,743.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,490,098.76	5,780,537.94
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,087,821.77	1,271,718.34

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,693,267.00	146,422.22
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	439,872.36	354,064.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		77,458,908.44	-399,688,315.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		77,458,908.44	-399,688,315.05

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛中证申万一带一路主题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）	3,116,333,862.74	-1,578,411,845.41	1,537,922,017.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	77,458,908.44	77,458,908.44
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）	232,324,789.43	-91,682,732.10	140,642,057.33
其中：1.基金申购款	2,693,703,553.00	-1,287,418,354.61	1,406,285,198.39
2.基金赎回款	-2,461,378,763.57	1,195,735,622.51	-1,265,643,141.06

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）	3,348,658,652.17	-1,592,635,669.07	1,756,022,983.10
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）	2,628,755,958.72	-1,105,624,441.56	1,523,131,517.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-399,688,315.05	-399,688,315.05
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）	93,724,044.94	-58,485,974.21	35,238,070.73
其中：1.基金申购款	421,026,779.72	-237,235,700.08	183,791,079.64
2.基金赎回款	-327,302,734.78	178,749,725.87	-148,553,008.91
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）	2,722,480,003.66	-1,563,798,730.82	1,158,681,272.84

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

长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2015]758号文《关于准予长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金注册的批复》的注册，由长盛基金管理有限公司向社会公开募集。基金合同于2015年5月29日正式生效，于基金合同生效日，本基金规模为4,155,784,758.57份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

本基金的基金份额包括长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金的基础份额（简称“长盛中证申万一带一路份额”）、长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金的稳健收益类份额（简称“长盛中证申万一带一路A份额”）和长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金的积极收益类份额（简称“长盛中证申万一带一路B份额”）。其中，长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。基金合同生效后，长盛中证申万一带一路份额设置单独的基金代码，可以进行场内与场外的申购和赎回。长盛中证申万一带一路份额、长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额交易代码不同，在上海证券交易所上市交易，但是长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额不接受申购或赎回。

在本基金存续期内，每个会计年度（基金合同生效不足六个月的除外）11月份的最后一个交易日，本基金将根据基金合同的规定进行基金的定期份额折算。在折算基准日，本基金将按照以下规则进行基金的折算：长盛中证申万一带一路份额和长盛中证申万一带一路A份额按基金合同规定的份额参考净值计算规则进行计算；对于长盛中证申万一带一路A份额参考净值超出人民币1.000元部分，将折算为场内长盛中证申万一带一路份额。每两份长盛中证申万一带一路份额将按一份长盛中证申万一带一路A份额获得新增长盛中证申万一带一路份额的分配，场内长盛中证申万一带一路份额持有人折算后获得新增场内长盛中证申万一带一路份额，场外长盛中证申万一带一路份额持有人折算后获得新增场外长盛中证申万一带一路份额。折算后长盛中证申万一带一路A份额和长盛中证申万一带一路B份额的比例仍为1:1，长盛中证申万一带一路A份额参考

净值调整为人民币 1.000 元。

除以上的定期份额折算外，本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算，即：当长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值大于或等于人民币 1.500 元时；当长盛中证申万一带一路 B 份额的基金份额参考净值达到或跌破人民币 0.250 元时。当长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值大于或等于人民币 1.500 元时，本基金将对长盛中证申万一带一路 B 份额和长盛中证申万一带一路份额进行份额折算，份额折算后长盛中证申万一带一路 B 份额与长盛中证申万一带一路 A 份额的份额数保持 1:1 配比；将长盛中证申万一带一路 B 份额的基金份额参考净值超过长盛中证申万一带一路 A 份额的基金份额参考净值的部分，折算成场内的长盛中证申万一带一路份额；份额折算后长盛中证申万一带一路份额的基金份额净值、长盛中证申万一带一路 B 份额的基金份额参考净值与折算基准日长盛中证申万一带一路 A 份额的基金份额参考净值三者相等；份额折算前长盛中证申万一带一路 B 份额的持有人在份额折算后将持有长盛中证申万一带一路 B 份额与新增场内长盛中证申万一带一路份额。场外长盛中证申万一带一路份额持有人份额折算后获得新增场外长盛中证申万一带一路份额，场内长盛中证申万一带一路份额持有人份额折算后获得新增场内长盛中证申万一带一路份额。当长盛中证申万一带一路 B 份额的参考净值跌至人民币 0.250 元以下（含人民币 0.250 元）时，本基金将分别对长盛中证申万一带一路 A 份额、长盛中证申万一带一路 B 份额和长盛中证申万一带一路份额进行折算，折算后本基金将确保长盛中证申万一带一路 A 份额和长盛中证申万一带一路 B 份额的比例为 1:1；折算后长盛中证申万一带一路份额的净值以及长盛中证申万一带一路 A 份额、长盛中证申万一带一路 B 份额的参考净值均调整为人民币 1.00 元；折算后，长盛中证申万一带一路 A 份额持有人获得新增的场内长盛中证申万一带一路份额；折算后场外长盛中证申万一带一路份额持有人获得新增的场外长盛中证申万一带一路份额、场内长盛中证申万一带一路份额持有人获得新增场内长盛中证申万一带一路份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、权证、股指期货、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具，（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 85%以上，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，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占基金资产比例为 5%-10%，其中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后，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%，权证投资不高于基金资产净值的 3%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证申万一带一路主题指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按

证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	131,898,592.27
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	131,898,592.27

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	1,893,851,534.32	1,654,664,667.38	-239,186,866.94
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	1,893,851,534.32	1,654,664,667.38	-239,186,866.94

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。

6.4.7.5 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	24,176.26
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	3.21
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	3,411.37
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	127.98
合计	27,718.82

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,046,547.14
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,046,547.14

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	156,460.36
其他	4,914.00
预提费用	233,070.08
指数使用费	106,624.64
合计	501,069.08

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	1,931,900,928.64	3,116,333,862.74
本期申购	1,669,952,688.18	2,693,703,553.00
本期赎回(以“-”号填列)	-1,526,054,652.63	-2,461,378,763.57
- 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	2,075,798,964.19	3,348,658,652.17

注：(1) 本期申购中含转换入份额及金额，本期赎回中含转换出份额及金额。

(2) 根据本基金基金合同规定，投资者可申购、赎回长盛中证申万一带一路份额，长盛中证申万一带一路 A 份额和长盛中证申万一带一路 B 份额只可在上海证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露长盛中证申万一带一路 A 份额和长盛中证申万一带一路 B 份额的情况。

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	-1,305,658,846.17	-272,752,999.24	-1,578,411,845.41
本期利润	-229,958,970.72	307,417,879.16	77,458,908.44
本期基金份额交易产生的变动数	-63,830,944.55	-27,851,787.55	-91,682,732.10
其中：基金申购款	-1,165,129,542.22	-122,288,812.39	-1,287,418,354.61
基金赎回款	1,101,298,597.67	94,437,024.84	1,195,735,622.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,599,448,761.44	6,813,092.37	-1,592,635,669.07

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	457,231.40
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	16,820.65
其他	21,551.35
合计	495,603.40

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	848,564,242.93
减：卖出股票成本总额	1,076,972,618.77
买卖股票差价收入	-228,408,375.84

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	11,129,166.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,129,166.32

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	307,417,879.16
——股票投资	307,417,879.16
——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	307,417,879.16

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	1,533,783.95
基金转换费收入	1,911.34
合计	1,535,695.29

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	2,693,267.00
银行间市场交易费用	-
合计	2,693,267.00

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	44,630.98
信息披露费	158,686.32
上市费	29,752.78
银行汇划费	17,000.33
指数使用费	189,801.95
合计	439,872.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	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	9,490,098.76	5,780,537.94
其中：支付销售机构的客户维护费	2,219,274.31	1,831,876.85

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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	2,087,821.77	1,271,718.34

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方本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
中国银行	131,898,592.27	457,231.40	124,065,586.14	312,520.18

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本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：根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金份额、长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金 A 份额与长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金 B 份额）不进行收益分配。

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：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

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
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	重大事项 停牌	6.85	2017 年 8 月 21 日	8.22	13,419,238	95,764,047.03	91,921,780.30	-
601989	中国重工	2017 年 5 月 31 日	重大事项 停牌	6.46	-	-	13,298,685	95,613,069.28	85,909,505.10	-
601919	中远海控	2017 年 5 月 17 日	重大事项 停牌	5.41	2017 年 7 月 26 日	5.89	6,078,458	56,395,304.04	32,884,457.78	-
601872	招商轮船	2017 年 5 月 2 日	重大事项 停牌	5.19	-	-	3,403,799	26,351,612.23	17,665,716.81	-
000610	西安旅游	2017 年 5 月 22 日	重大事项 停牌	11.68	2017 年 7 月 24 日	10.71	251,715	3,703,976.92	2,940,031.20	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会合规与审计委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。

同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司监察稽核部和风险管理部构成，监察稽核部负责对公司业务的法律合规风险和运作风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险控制委员会构成，公司管理层通过风险控制委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，在公司督察长的指导下，监察稽核部和风险管理部对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门总监、风险控制委员会、公司总经理、风险控制管理委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会及其下设风险控制管理委员会构成，风险控制管理委员会通过督察长、监察稽核部和风险管理部的工作，掌握整体风险状况并进行决策。风险控制管理委员会负责审查公司风险控制体系及其有效性、公司内控制度的实施情况。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持证券在证券交易所上市，因此，除在附注 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，其余均能及时变现。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资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

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

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因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

所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款等。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。

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	131,898,592.27	-	-	-	131,898,592.27
结算备付金	15,013.90	-	-	-	15,013.90
存出保证金	316,031.21	-	-	-	316,031.21
交易性金融资产	-	-	-	1,654,664,667.38	1,654,664,667.38
应收证券清算款	-	-	-	14,692,060.16	14,692,060.16
应收利息	-	-	-	27,718.82	27,718.82
应收申购款	-	-	-	787,783.20	787,783.20
资产总计	132,229,637.38	-	-	1,670,172,229.56	1,802,401,866.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	42,857,348.30	42,857,348.30
应付管理人报酬	-	-	-	1,617,966.67	1,617,966.67
应付托管费	-	-	-	355,952.65	355,952.65
应付交易费用	-	-	-	1,046,547.14	1,046,547.14
其他负债	-	-	-	501,069.08	501,069.08
负债总计	-	-	-	46,378,883.84	46,378,883.84
利率敏感度缺口	132,229,637.38	-	-	1,623,793,345.72	1,756,022,983.10
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	83,214,482.28	-	-	-	83,214,482.28
结算备付金	4,047,051.51	-	-	-	4,047,051.51

存出保证金	378,577.00	-	-	-	378,577.00
交易性金融资产	-	-	-	1,459,026,795.70	1,459,026,795.70
应收利息	-	-	-	18,597.81	18,597.81
应收申购款	1,826.81	-	-	3,056,082.58	3,057,909.39
资产总计	87,641,937.60	-	-	1,462,101,476.09	1,549,743,413.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,301,735.45	8,301,735.45
应付管理人报酬	-	-	-	1,320,935.05	1,320,935.05
应付托管费	-	-	-	290,605.69	290,605.69
应付交易费用	-	-	-	1,556,467.60	1,556,467.60
其他负债	-	-	-	351,652.57	351,652.57
负债总计	-	-	-	11,821,396.36	11,821,396.36
利率敏感度缺口	87,641,937.60	-	-	1,450,280,079.73	1,537,922,017.33

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有交易性金融资产债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 85%以上，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他

证券品种占基金资产比例为 5%-10%，其中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后，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%，权证投资不高于基金资产净值的 3%。于 2017 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

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	1,654,664,667.38	94.23	1,459,026,795.70	94.87
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,654,664,667.38	94.23	1,459,026,795.70	94.87

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合在过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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%	86,492,259.73	82,014,478.97
	业绩比较基准下降 5%	-86,492,259.73	-82,014,478.97

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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人民币 1,423,343,176.19 元，属于第二层次的余额为人民币 231,321,491.19 元，无属于第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次人民币 1,377,706,653.93 元，第二层次人民币 81,320,141.77 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	1,654,664,667.38	91.80
	其中：股票	1,654,664,667.38	91.80
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	131,913,606.17	7.32
7	其他各项资产	15,823,593.39	0.88
8	合计	1,802,401,866.94	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	2,939,220.90	0.17
B	采矿业	70,894,948.08	4.04
C	制造业	724,614,245.62	41.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	484,804,930.74	27.61
F	批发和零售业	15,024,638.97	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	182,366,994.47	10.39

H	住宿和餐饮业	3,644,190.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	22,995,321.66	1.31
K	房地产业	50,052,098.14	2.85
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,466,267.30	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	2,940,031.20	0.17
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	1,562,742,887.08	88.99

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	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	91,921,780.30	5.23
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	91,921,780.30	5.23

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	601668	中国建筑	16,091,089	155,761,741.52	8.87
2	601766	中国中车	12,307,726	124,554,187.12	7.09
3	601989	中国重工	13,298,685	85,909,505.10	4.89
4	601390	中国中铁	9,230,126	80,025,192.42	4.56
5	000063	中兴通讯	2,944,259	69,896,708.66	3.98
6	601186	中国铁建	5,698,743	68,555,878.29	3.90
7	600690	青岛海尔	3,777,630	56,853,331.50	3.24
8	600340	华夏幸福	1,490,533	50,052,098.14	2.85

9	600089	特变电工	4,642,950	47,961,673.50	2.73
10	601857	中国石油	6,011,724	46,230,157.56	2.63
11	601669	中国电建	5,680,153	44,986,811.76	2.56
12	600031	三一重工	4,744,884	38,575,906.92	2.20
13	000338	潍柴动力	2,890,585	38,155,722.00	2.17
14	600068	葛洲坝	3,293,983	37,024,368.92	2.11
15	600029	南方航空	4,185,928	36,417,573.60	2.07
16	601919	中远海控	6,078,458	32,884,457.78	1.87
17	601618	中国中冶	6,383,708	31,982,377.08	1.82
18	600487	亨通光电	1,039,339	29,153,458.95	1.66
19	601800	中国交建	1,825,561	29,008,164.29	1.65
20	601018	宁波港	4,711,061	26,617,494.65	1.52
21	000157	中联重科	5,240,882	23,531,560.18	1.34
22	601111	中国国航	2,376,030	23,166,292.50	1.32
23	601998	中信银行	3,655,854	22,995,321.66	1.31
24	600584	长电科技	1,292,017	20,736,872.85	1.18
25	600150	中国船舶	825,091	18,869,831.17	1.07
26	601872	招商轮船	3,403,799	17,665,716.81	1.01
27	600583	海油工程	2,638,135	16,461,962.40	0.94
28	000039	中集集团	903,565	16,291,276.95	0.93
29	600704	物产中大	2,060,993	15,024,638.97	0.86
30	601718	际华集团	1,577,077	13,862,506.83	0.79
31	600875	东方电气	1,439,924	13,794,471.92	0.79
32	600500	中化国际	1,246,288	11,914,513.28	0.68
33	601880	大连港	3,823,443	11,317,391.28	0.64
34	600312	平高电气	812,171	11,159,229.54	0.64
35	002051	中工国际	532,615	11,041,108.95	0.63
36	600970	中材国际	1,264,551	10,988,948.19	0.63

37	600026	中远海能	1,642,867	10,892,208.21	0.62
38	300208	恒顺众昇	666,780	10,648,476.60	0.61
39	002444	巨星科技	668,827	10,420,324.66	0.59
40	600017	日照港	2,197,200	9,887,400.00	0.56
41	600125	铁龙物流	1,095,734	9,817,776.64	0.56
42	002047	宝鹰股份	979,719	8,464,772.16	0.48
43	000807	云铝股份	1,155,375	8,341,807.50	0.48
44	600759	洲际油气	1,353,602	8,202,828.12	0.47
45	002630	华西能源	706,367	8,186,793.53	0.47
46	000528	柳工	941,723	8,136,486.72	0.46
47	002018	华信国际	1,077,016	7,377,559.60	0.42
48	000018	神州长城	884,015	6,691,993.55	0.38
49	002120	韵达股份	113,460	5,854,536.00	0.33
50	000065	北方国际	243,900	5,799,942.00	0.33
51	600338	西藏珠峰	150,865	5,731,361.35	0.33
52	600130	波导股份	954,335	5,659,206.55	0.32
53	600105	永鼎股份	678,786	5,477,803.02	0.31
54	002307	北新路桥	302,636	5,462,579.80	0.31
55	002151	北斗星通	193,300	5,402,735.00	0.31
56	000055	方大集团	614,495	4,473,523.60	0.25
57	601700	风范股份	683,999	4,097,154.01	0.23
58	600798	宁波海运	704,892	3,700,683.00	0.21
59	000721	西安饮食	449,900	3,644,190.00	0.21
60	000610	西安旅游	251,715	2,940,031.20	0.17
61	300094	国联水产	399,894	2,939,220.90	0.17
62	603703	盛洋科技	144,506	2,596,772.82	0.15
63	002738	中矿资源	121,491	2,466,267.30	0.14

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	600050	中国联通	13,419,238	91,921,780.30	5.23

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	601668	中国建筑	76,701,566.25	4.99
2	601766	中国中车	75,295,479.18	4.90
3	601390	中国中铁	44,571,113.41	2.90
4	601989	中国重工	44,125,982.71	2.87
5	601186	中国铁建	40,408,385.96	2.63
6	600340	华夏幸福	33,431,307.54	2.17
7	600050	中国联通	29,390,397.00	1.91
8	600089	特变电工	28,190,460.57	1.83
9	601857	中国石油	26,467,182.39	1.72
10	601669	中国电建	25,201,737.44	1.64
11	000063	中兴通讯	24,486,860.20	1.59
12	600690	青岛海尔	24,145,667.20	1.57
13	600584	长电科技	23,224,047.00	1.51
14	600068	葛洲坝	19,722,547.39	1.28
15	600031	三一重工	19,520,441.46	1.27
16	601618	中国中冶	18,943,977.00	1.23
17	601800	中国交建	17,300,566.37	1.12
18	600029	南方航空	16,813,358.81	1.09

19	000338	潍柴动力	16,249,726.48	1.06
20	002202	金风科技	14,376,469.56	0.93

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	601668	中国建筑	72,004,470.13	4.68
2	601766	中国中车	56,481,644.67	3.67
3	601727	上海电气	44,288,201.68	2.88
4	002202	金风科技	40,983,392.29	2.66
5	601390	中国中铁	39,445,104.59	2.56
6	601186	中国铁建	33,691,693.93	2.19
7	000063	中兴通讯	24,989,035.82	1.62
8	600690	青岛海尔	24,488,512.35	1.59
9	600256	广汇能源	23,060,825.48	1.50
10	601857	中国石油	22,678,375.70	1.47
11	600089	特变电工	21,154,922.69	1.38
12	600528	中铁工业	20,613,386.60	1.34
13	601669	中国电建	19,958,553.14	1.30
14	600340	华夏幸福	19,241,546.40	1.25
15	600068	葛洲坝	18,703,336.48	1.22
16	600031	三一重工	18,591,813.23	1.21
17	600029	南方航空	16,781,593.24	1.09
18	601989	中国重工	16,382,284.88	1.07
19	601618	中国中冶	16,300,008.00	1.06
20	000338	潍柴动力	15,730,724.31	1.02

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	965,192,611.29
卖出股票收入（成交）总额	848,564,242.93

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	316,031.21
2	应收证券清算款	14,692,060.16
3	应收股利	-
4	应收利息	27,718.82
5	应收申购款	787,783.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,823,593.39

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601989	中国重工	85,909,505.10	4.89	重大事项停牌

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600050	中国联通	91,921,780.30	5.23	重大事项停牌

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
长盛一带一 A	1,956	107,811.69	186,006,333.00	88.20%	24,873,339.00	11.80%
长盛一带一 B	7,895	26,710.53	5,816,664.00	2.76%	205,063,008.00	97.24%
长盛中证申万 一带一路指数 分级	70,195	23,563.50	234,899,601.40	14.20%	1,419,140,018.79	85.80%
合计	80,046	25,932.58	426,722,598.40	20.56%	1,649,076,365.79	79.44%

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

长盛一带一 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	鹏华基金—民生银行—万家共赢资产管理 产管理有限公司	25,678,781.00	12.18%
2	上海千象资产管理有限公司—千象 子基金 4 号	14,402,923.00	6.83%
3	方正证券—招商银行—方正证券量 化稳宝 CPPI5 号集合资产管理计划	12,744,257.00	6.04%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司 —传统—普通保险产品	12,054,351.00	5.72%

5	太平资管—建设银行—太平资产乾坤 10 号资管产品	11,062,794.00	5.25%
6	鹏华基金—民生银行—中国民生银行股份有限公司	10,000,000.00	4.74%
7	鹏华基金—宁波银行—百年人寿保险—百年人寿保险股份有限公司	8,399,958.00	3.98%
8	阳光资产—工商银行—积极进取十号资产管理产品	8,000,000.00	3.79%
9	上海千象资产管理有限公司—千象子基金 7 号	6,644,014.00	3.15%
10	上海雁丰投资管理有限公司—乾金 1 号私募投资基金	5,815,900.00	2.76%

长盛一带一 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	戚惠康	4,105,000.00	1.95%
2	区兵	4,066,721.00	1.93%
3	钱志芳	3,500,000.00	1.66%
4	刘文	3,500,000.00	1.66%
5	北京高华丰瑞投资管理有限公司	3,366,224.00	1.60%
6	陈亚辉	3,125,950.00	1.48%
7	王颖实	2,578,506.00	1.22%
8	萧文晶	2,432,834.00	1.15%
9	李绿梅	2,240,000.00	1.06%
10	苏加良	2,000,000.00	0.95%
11	丁扬	1,828,700.00	0.87%

长盛中证申万一带一路指数分级

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

1	工银安盛人寿保险有限公司	35,579,183.00	17.07%
2	北京山通投资咨询有限责任公司	5,745,977.00	2.76%
3	恒安标准人寿保险有限公司—投连 险 05	2,400,672.00	1.15%
4	中国民生银行股份有限公司企业年 金计划—中国民生银行股份有限公司	1,842,200.00	0.88%
5	蔡青	1,575,100.00	0.76%
6	同方全球人寿保险有限公司	1,346,000.00	0.65%
7	肖瑞兰	1,250,000.00	0.60%
8	工银安盛人寿保险有限公司	1,100,000.00	0.53%
9	李英	936,762.00	0.45%
10	谢朝晖	774,596.00	0.37%

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、对于长盛一带一 A、长盛一带一 B 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	长盛一带一 A	17,063.80	0.0010%
	长盛一带一 B	0.00	0.0000%
	长盛中证申万一带 一路指数分级	0.00	0.0000%
	合计	17,063.80	0.0008%

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	长盛一带一 A	0
	长盛一带一 B	0

持有本开放式基金	长盛中证申万一带一路指数分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛一带一 A	0
	长盛一带一 B	0
	长盛中证申万一带一路指数分级	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛一带一 A	长盛一带一 B	长盛中证申万一带 一路指数分级
基金合同生效日（2015 年 5 月 29 日）基金份额总额	-	-	4,155,784,758.57
本报告期期初基金份额总额	252,393,922.00	252,393,922.00	1,427,113,084.64
本报告期基金总申购份额	-	-	1,669,952,688.18
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	1,526,054,652.63
本报告期基金拆分变动份额（份额 减少以“-”填列）	-41,514,250.00	-41,514,250.00	83,028,500.00
本报告期末基金份额总额	210,879,672.00	210,879,672.00	1,654,039,620.19

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§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

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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

报告期内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安永华明会计师事务所（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	
银河证券	2	1,630,307,449.49	90.15%	1,518,305.36	90.15%	-
长江证券	2	178,184,373.35	9.85%	165,943.11	9.85%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-

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	成交金额	占当期债 券回购	成交金额	占当期权证 成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

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

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	日信证券	上海	1

10.8 其他重大事件

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

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司旗下部分基金增加基煜销售并开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、 《上海证券报》、 《证券时报》、 《证券日报》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增加宁波银行为旗下部分基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务的公告	同上	2017年5月26日

3	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
4	长盛中证申万一带一路主题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
5	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
6	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购优惠活动的公告	同上	2017 年 4 月 1 日
7	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
8	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
9	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
10	长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金 2016 年度报告	同上	2017 年 3 月 27 日
11	长盛中证申万一带一路主题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
12	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	同上	2017 年 3 月 24 日

	并参加费率优惠活动的公告		
13	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
14	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
15	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
16	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
17	长盛基金管理有限公司关于增加农业银行为长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	同上	2017 年 2 月 15 日
18	长盛中证申万一带一路主题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

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2017年8月24日