

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金 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.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§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.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	55

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金
基金简称	长盛同鑫行业混合
基金主代码	080007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 5 月 27 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	210,935,080.63 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	积极把握行业发展趋势和行业景气轮换中蕴含的投资机会，在控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>(1) 本基金在分析和判断宏观经济周期和市场环境变化趋势的基础上，把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，挖掘预期具有良好增长前景的优势行业，以谋求行业配置的超额收益。(2) 在资产配置层面，本基金管理人对宏观经济的经济周期进行预测，在此基础上形成对不同资产市场表现的预测和判断，确定基金资产在各类别资产间的分配比例。具体操作中，采用经济周期资产配置模型，通过对宏观经济运行指标、利率和货币政策等相关因素的分析，对中国的宏观经济运行情况进行判断和预测，然后利用经济周期理论确定基金资产在各类别资产间的战略配置策略。(3) 在行业配置层面，通过宏观及行业经济变量的变动对不同行业的潜在影响，得出各行业的相对投资价值与投资时机，据此挑选出预期具有良好增长前景的优势行业，把握行业景气轮换带来的投资机会；(4) 在股票选择层面，本基金综合运用长盛行业股票研究分析方法和其它投资分析工具，采用自下而上方式精选具有投资潜力的股票构建股票投资组合，前述优势行业中股票优先入选。</p>
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数+40%×中证全债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942
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》
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	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的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	9,425,837.65
本期利润	19,549,294.17
加权平均基金份额本期利润	0.0937
本期加权平均净值利润率	10.07%
本期基金份额净值增长率	10.79%
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	-2,972,177.38
期末可供分配基金份额利润	-0.0141
期末基金资产净值	207,962,903.25
期末基金份额净值	0.986
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	-6.27%

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。

4、长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金由长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来，变更日期为2014年5月27日（即基金合同生效日）。

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	5.23%	0.52%	3.46%	0.40%	1.77%	0.12%
过去三个月	5.68%	0.50%	3.70%	0.38%	1.98%	0.12%
过去六个月	10.79%	0.47%	6.30%	0.35%	4.49%	0.12%
过去一年	1.54%	0.61%	9.67%	0.41%	-8.13%	0.20%
过去三年	-7.07%	2.01%	49.66%	1.05%	-56.73%	0.96%

自基金转型至今	-6.27%	1.98%	50.68%	1.04%	-56.95%	0.94%
---------	--------	-------	--------	-------	---------	-------

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

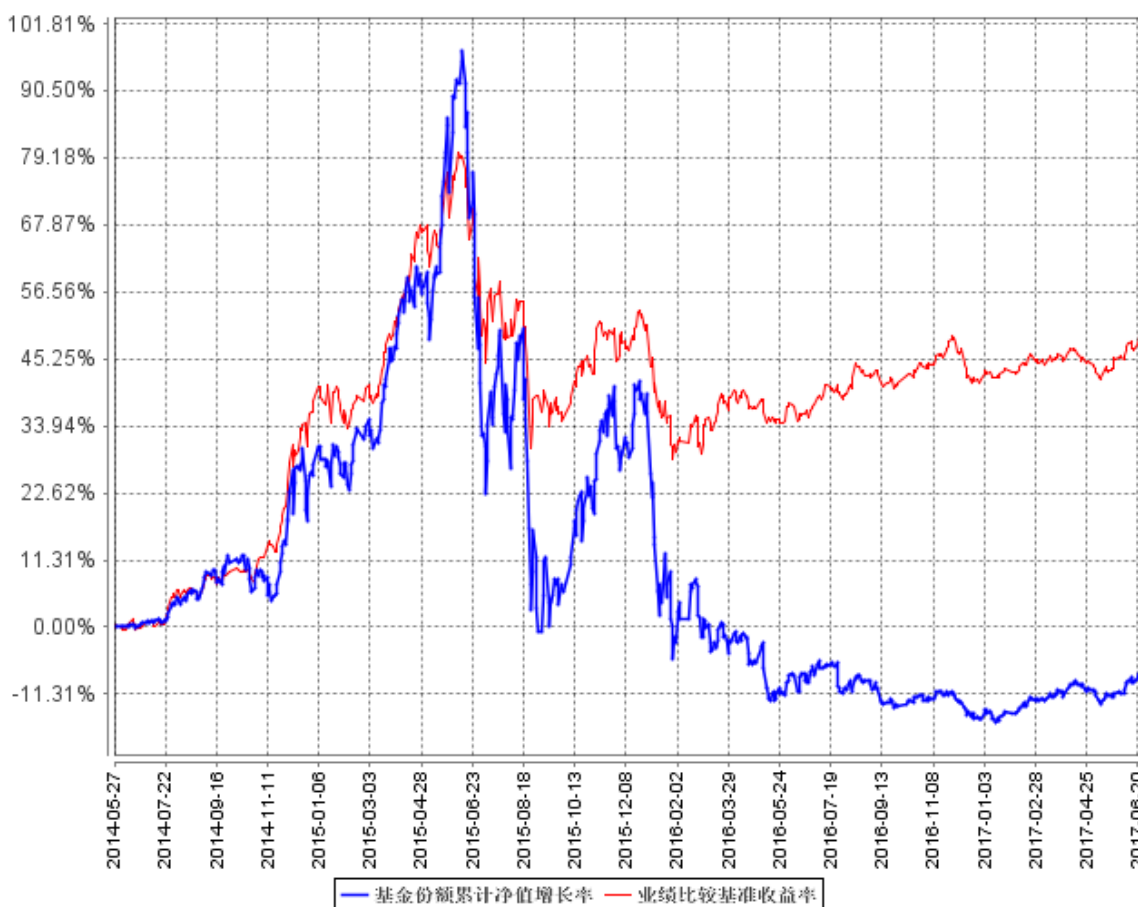
本基金业绩比较基准：60%×沪深 300 指数+40%×中证全债指数

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全债指数。目前沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准较为合适。
- 2、可比性。本基金在运作过程中将维持 40%-95%的股票、权证等权益类资产，根据本基金投资策略，业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。
- 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 60%、40%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 自基金转型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：1、长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金由长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期届满后变更而来，变更日期为 2014 年 5 月 27 日（即基金合同生效日）。

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三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）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		
乔培涛	本基金基金经理，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛城镇化主题混合型证券投资基金，研究部副总监。	2016 年 8 月 24 日	-	7 年	乔培涛先生，1979 年 12 月出生。清华大学硕士。曾任长城证券研究员、行业研究部经理。2011 年 8 月加入长盛基金管理有限公司。
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，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证	2017 年 3 月 17 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。

	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。				
吴博文	本基金基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016年 2月 17日	2017年 3月 17日	9年	吴博文先生，1983年6月出生。北京大学金融学硕士。历任雷曼兄弟证券股份有限公司分析师助理，野村证券股份有限公司分析师助理，诺安基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。2015年8月加入长盛基金管理有限公司。

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。

组合操作上，上半年坚持组合一贯的风格，主要配置在估值比较合理的成长股上。超配的因素包括价值、成长、盈利质量和公司治理，并获得了相对于基准的差额收益。

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 0.986 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.79%，业绩比较基准收益率为 6.30%。

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。下半年选股会兼顾估值和成长性，并着重考虑盈利质量、公司治理和财务杠杆因子对股票收益率的影响，利用量化的方法精选个股。

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《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》第十六部分中对基金收益分配原则的约定，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金于报告期内未进行利润分配。

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金截至 2017 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-2,972,177.38 元，其中：未分配利润已实现部分为 21,930,086.64 元，未分配利润未实现部分为-24,902,264.02 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛同鑫行业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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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：长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金

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	39,912,223.02	20,126,269.70
结算备付金		26,824.61	130,858.81
存出保证金		79,657.49	38,731.96
交易性金融资产	6.4.7.2	169,387,293.89	92,336,962.73
其中：股票投资		130,264,478.69	92,336,962.73
基金投资		-	-
债券投资		39,122,815.20	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		322,422.18	-
应收利息	6.4.7.5	174,425.82	4,134.68
应收股利		-	-
应收申购款		7,722.38	1,498.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		209,910,569.39	112,638,456.08
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		270,862.15	14,680.57
应付管理人报酬		249,653.05	109,598.30
应付托管费		41,608.82	18,266.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	28,328.57	150,908.67

应交税费		1,175,703.80	1,175,703.80
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	181,509.75	63,844.03
负债合计		1,947,666.14	1,533,001.75
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	210,935,080.63	124,831,608.38
未分配利润	6.4.7.10	-2,972,177.38	-13,726,154.05
所有者权益合计		207,962,903.25	111,105,454.33
负债和所有者权益总计		209,910,569.39	112,638,456.08

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.986 元，基金份额总额 210,935,080.63 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金

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		21,643,244.42	-26,672,419.37
1.利息收入		589,734.67	80,414.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	94,095.61	80,413.30
债券利息收入		495,639.06	1.12
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）		10,924,599.52	-17,595,793.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,911,957.40	-17,741,469.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-116,706.56	1.73
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,129,348.68	145,674.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,123,456.52	-9,184,775.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,453.71	27,735.57
减：二、费用		2,093,950.25	1,465,639.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,436,593.39	452,742.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	239,432.18	75,457.06
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	240,554.13	848,833.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	177,370.55	88,607.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,549,294.17	-28,138,059.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,549,294.17	-28,138,059.00

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金

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）	124,831,608.38	-13,726,154.05	111,105,454.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,549,294.17	19,549,294.17
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）	86,103,472.25	-8,795,317.50	77,308,154.75
其中：1.基金申购款	91,670,369.47	-9,141,290.17	82,529,079.30
2.基金赎回款	-5,566,897.22	345,972.67	-5,220,924.55
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	210,935,080.63	-2,972,177.38	207,962,903.25

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
	(基金净值)		
一、期初所有者权益 (基金净值)	60,161,365.31	26,098,900.72	86,260,266.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-28,138,059.00	-28,138,059.00
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)	-9,221,334.44	546,380.64	-8,674,953.80
其中：1.基金申购款	5,860,458.45	168,850.39	6,029,308.84
2.基金赎回款	-15,081,792.89	377,530.25	-14,704,262.64
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)	50,940,030.87	-1,492,777.64	49,447,253.23

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：

_____ 林培富 _____ 刁俊东 _____ 龚珉
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的约定由长盛同鑫保本混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)第一个保本周期届满后变更而来。原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[2011]第 519 号《关于核准长盛同鑫保本混合型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资

金利息共募集人民币 3,031,349,989.30 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(2011)第 190 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 5 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,032,111,617.30 份基金份额，其中认购资金利息折合 761,628.00 份基金份额。

根据《长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，原基金的保本期一般每三年为一个周期；如保本周期到期后，原基金未能符合保本基金存续条件，则原基金将按基金合同的约定变更为非保本的混合型基金。在原基金募集期内认购原基金的基金份额持有人，若继续持有转型后的本基金基金份额，而可赎回金额(可赎回金额以原保本周期届满日的原基金基金份额净值为基准进行计算)加上原保本周期期间的累计分红金额低于其投资净额，基金管理人或担保人应补足该金额差额。原基金的担保人将保证向符合上述条件的原基金份额持有人承担上述差额部分的偿付并及时清偿，担保额度为人民币 51 亿元。根据《关于长盛同鑫保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后变更为长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金及相关业务安排的公告》，原基金在第一个保本周期届满日次日，即 2014 年 5 月 27 日起变更为本基金，变更后基金的投资及基金费率等按照《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同鑫行业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)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合中股票、权证等权益类资产占基金资产的 40%-95%，其中，持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；债券、货币市场工具(包括一年以内的短期国债、回购协议等)、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证券品种占基金资产的 0%-40%，其中基金保留的现金或者投资于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： $60\% \times \text{沪深 300 指数} + 40\% \times \text{中证全债指数}$ 。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》和

中国证监会及中国证券投资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 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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	39,912,223.02
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	39,912,223.02

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	122,026,326.70	130,264,478.69	8,238,151.99	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	39,532,225.44	39,122,815.20	-409,410.24
	银行间市场	-	-	-
	合计	39,532,225.44	39,122,815.20	-409,410.24
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	161,558,552.14	169,387,293.89	7,828,741.75	

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

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	5,606.36
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	7.47
应收债券利息	168,779.72
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.05
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	32.22
合计	174,425.82

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	28,328.57
银行间市场应付交易费用	-
合计	28,328.57

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	-
预提费用	163,645.72
应付赎回费	49.34
其他	17,814.69
合计	181,509.75

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	124,831,608.38	124,831,608.38
本期申购	91,670,369.47	91,670,369.47
本期赎回(以“-”号填列)	-5,566,897.22	-5,566,897.22
- 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	210,935,080.63	210,935,080.63

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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	7,425,961.69	-21,152,115.74	-13,726,154.05
本期利润	9,425,837.65	10,123,456.52	19,549,294.17
本期基金份额交易产生的变动数	5,078,287.30	-13,873,604.80	-8,795,317.50
其中：基金申购款	5,487,843.34	-14,629,133.51	-9,141,290.17
基金赎回款	-409,556.04	755,528.71	345,972.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,930,086.64	-24,902,264.02	-2,972,177.38

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
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	2,789.57
其他	2,335.85
合计	94,095.61

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	82,521,205.50
减：卖出股票成本总额	72,609,248.10
买卖股票差价收入	9,911,957.40

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-116,706.56
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	-116,706.56

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,803,849.27
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,898,874.56
减：应收利息总额	21,681.27
买卖债券差价收入	-116,706.56

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期未取得衍生工具收益。

6.4.7.16 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	1,129,348.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,129,348.68

6.4.7.17 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	10,123,456.52
——股票投资	10,532,866.76
——债券投资	-409,410.24
——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	10,123,456.52

6.4.7.18 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	5,367.48
转换费收入	86.23
合计	5,453.71

6.4.7.19 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	240,554.13
银行间市场交易费用	-
合计	240,554.13

6.4.7.20 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	133,892.94
银行划款费用	3,924.83
帐户维护费	9,300.00
其他费用	500.00
合计	177,370.55

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

本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金并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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构

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

注：本基金未开立关联方交易单元。

6.4.10.1 关联方报酬

6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	1,436,593.39	452,742.29
其中：支付销售机构的客户维护费	151,002.94	205,142.70

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.10.1.2 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	239,432.18	75,457.06

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 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。

6.4.10.3.2 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。

6.4.10.4 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	39,912,223.02	88,970.19	19,949,874.18	75,445.06
合计	39,912,223.02	88,970.19	19,949,874.18	75,445.06

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。

6.4.10.5 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。

6.4.10.6 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：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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满	2017年	2017	新股流	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

	电子	6 月 27 日	年 7 月 5 日	通受限						
603617	君禾 股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流 通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

注：基金可使用以基金名义开设股票账户，选择网下或者网上一种方式进行新股申购。从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
600795	国电 电力	2017/6 /5	重大事项 停牌	3.60	-	-	273,300	879,115.00	983,880.00	-
300104	乐视 网	2017/4 /17	重大事项 停牌	28.62	-	-	27,600	872,522.00	789,912.00	-
000100	TCL 集团	2017/4 /21	重大事项 停牌	3.48	2017/7 /26	3.72	170,100	595,884.00	591,948.00	-
002252	上海 莱士	2017/4 /21	重大事项 停牌	20.34	-	-	27,877	603,517.78	567,018.18	-
000503	海虹 控股	2017/5 /11	重大事项 停牌	24.93	-	-	21,000	996,110.15	523,530.00	-
601919	中远 海控	2017/5 /17	重大事项 停牌	5.41	2017/7 /26	5.89	84,500	451,146.00	457,145.00	-
600485	信威 集团	2016/1 2/26	重大事项 停牌	14.59	-	-	24,000	386,967.00	350,160.00	-
600959	江苏 有线	2017/6 /19	重大事项 停牌	10.57	-	-	30,000	331,646.80	317,100.00	-
601872	招商 轮船	2017/5 /2	重大事项 停牌	5.19	-	-	36,600	189,750.00	189,954.00	-
000061	农产 品	2017/6 /28	重大事项 停牌	9.06	-	-	14,300	177,763.00	129,558.00	-
300085	银之 杰	2017/6 /30	重大事项 停牌	18.50	2017/7 /7	18.88	4,400	86,331.00	81,400.00	-

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

本基金本期末无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

本基金是一只进行灵活配置的混合型证券投资基金。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。

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。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	39,122,815.20	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	39,122,815.20	-

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性

比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 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、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	39,912,223.02	-	-	-	39,912,223.02
结算备付金	26,824.61	-	-	-	26,824.61
存出保证金	79,657.49	-	-	-	79,657.49

交易性金融资产	-	39,122,815.20	-	130,264,478.69	169,387,293.89
应收证券清算款	-	-	-	322,422.18	322,422.18
应收利息	-	-	-	174,425.82	174,425.82
应收申购款	-	-	-	7,722.38	7,722.38
资产总计	40,018,705.12	39,122,815.20	-	130,769,049.07	209,910,569.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	270,862.15	270,862.15
应付管理人报酬	-	-	-	249,653.05	249,653.05
应付托管费	-	-	-	41,608.82	41,608.82
应付交易费用	-	-	-	28,328.57	28,328.57
应交税费	-	-	-	1,175,703.80	1,175,703.80
其他负债	-	-	-	181,509.75	181,509.75
负债总计	-	-	-	1,947,666.14	1,947,666.14
利率敏感度缺口	40,018,705.12	39,122,815.20	-	128,821,382.93	207,962,903.25
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	20,126,269.70	-	-	-	20,126,269.70
结算备付金	130,858.81	-	-	-	130,858.81
存出保证金	38,731.96	-	-	-	38,731.96
交易性金融资产	-	-	-	92,336,962.73	92,336,962.73
应收利息	-	-	-	4,134.68	4,134.68
应收申购款	-	-	-	1,498.20	1,498.20
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	20,295,860.47	-	-	92,342,595.61	112,638,456.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,680.57	14,680.57
应付管理人报酬	-	-	-	109,598.30	109,598.30
应付托管费	-	-	-	18,266.38	18,266.38
应付交易费用	-	-	-	150,908.67	150,908.67
应交税费	-	-	-	1,175,703.80	1,175,703.80
其他负债	-	-	-	63,844.03	63,844.03
负债总计	-	-	-	1,533,001.75	1,533,001.75
利率敏感度缺口	20,295,860.47	-	-	90,809,593.86	111,105,454.33

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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例均为 18.81%（2016 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资），因此市场利率的变动对于本基

金资产净值均无重大影响。

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。本基金投资组合中股票、权证等权益类资产占基金资产的 40%-95%；投资于债券、货币市场工具、资产支持证券等其他证券品种占基金资产的 0%-40%。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	130,264,478.69	62.64	92,336,962.73	83.11
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	130,264,478.69	62.64	92,336,962.73	83.11

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）
	1. 业绩比较基准上升 5%	12,612,846.10	9,524,650.72
2. 业绩比较基准下降 5%	-12,612,846.10	-9,524,650.72	

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 125,282,873.51 元，属于第二层次的余额为 44,104,420.38 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 88,456,228.73 元，第二层次 3,880,734.00 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 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	130,264,478.69	62.06
	其中：股票	130,264,478.69	62.06
2	固定收益投资	39,122,815.20	18.64
	其中：债券	39,122,815.20	18.64
	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	39,939,047.63	19.03
7	其他各项资产	584,227.87	0.28
8	合计	209,910,569.39	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	278,720.00	0.13
B	采矿业	4,682,608.98	2.25
C	制造业	63,071,604.77	30.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,823,958.00	2.80
E	建筑业	3,777,106.00	1.82
F	批发和零售业	5,905,195.20	2.84
G	交通运输、仓储和邮政业	6,518,279.00	3.13
H	住宿和餐饮业	70,460.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,996,703.27	5.29
J	金融业	12,354,950.56	5.94
K	房地产业	8,634,119.00	4.15
L	租赁和商务服务业	2,328,416.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,032,489.72	0.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	233,763.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	3,200,905.19	1.54
S	综合	355,200.00	0.17
	合计	130,264,478.69	62.64

7.2.2 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

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	000651	格力电器	109,900	4,524,583.00	2.18
2	000002	万科A	160,700	4,012,679.00	1.93
3	000333	美的集团	67,000	2,883,680.00	1.39
4	600690	青岛海尔	113,100	1,702,155.00	0.82
5	600066	宇通客车	74,400	1,634,568.00	0.79
6	600886	国投电力	201,300	1,590,270.00	0.76
7	002415	海康威视	47,250	1,526,175.00	0.73
8	600009	上海机场	37,200	1,387,932.00	0.67
9	600276	恒瑞医药	26,580	1,344,682.20	0.65
10	600585	海螺水泥	57,252	1,301,337.96	0.63
11	000858	五粮液	22,800	1,269,048.00	0.61
12	600900	长江电力	80,600	1,239,628.00	0.60
13	000725	京东方A	292,000	1,214,720.00	0.58
14	600109	国金证券	100,000	1,172,000.00	0.56
15	600015	华夏银行	117,120	1,079,846.40	0.52
16	600019	宝钢股份	154,872	1,039,191.12	0.50
17	600674	川投能源	104,400	1,025,208.00	0.49
18	600196	复星医药	32,800	1,016,472.00	0.49
19	000001	平安银行	107,600	1,010,364.00	0.49
20	002241	歌尔股份	51,600	994,848.00	0.48
21	000568	泸州老窖	19,500	986,310.00	0.47
22	600795	国电电力	273,300	983,880.00	0.47
23	600089	特变电工	95,161	983,013.13	0.47
24	002304	洋河股份	11,100	963,591.00	0.46
25	002450	康得新	42,400	954,848.00	0.46
26	002456	欧菲光	52,000	944,840.00	0.45
27	603993	洛阳钼业	185,700	939,642.00	0.45

28	601939	建设银行	152,000	934,800.00	0.45
29	002142	宁波银行	48,400	934,120.00	0.45
30	000338	潍柴动力	70,400	929,280.00	0.45
31	002008	大族激光	26,700	924,888.00	0.44
32	600031	三一重工	113,600	923,568.00	0.44
33	600309	万华化学	32,160	921,062.40	0.44
34	600660	福耀玻璃	35,200	916,608.00	0.44
35	000538	云南白药	9,700	910,345.00	0.44
36	601018	宁波港	157,300	888,745.00	0.43
37	601899	紫金矿业	256,400	879,452.00	0.42
38	601600	中国铝业	193,700	875,524.00	0.42
39	300059	东方财富	72,600	872,652.00	0.42
40	600703	三安光电	43,300	853,010.00	0.41
41	000625	长安汽车	58,500	843,570.00	0.41
42	600271	航天信息	40,800	842,112.00	0.40
43	000063	中兴通讯	35,300	838,022.00	0.40
44	601607	上海医药	28,800	831,744.00	0.40
45	600489	中金黄金	79,300	795,379.00	0.38
46	600068	葛洲坝	70,500	792,420.00	0.38
47	300104	乐视网	27,600	789,912.00	0.38
48	300070	碧水源	42,300	788,895.00	0.38
49	000778	新兴铸管	117,100	784,570.00	0.38
50	601888	中国国旅	26,000	783,640.00	0.38
51	002024	苏宁云商	69,100	777,375.00	0.37
52	000839	中信国安	77,600	775,224.00	0.37
53	002466	天齐锂业	14,100	766,335.00	0.37
54	002594	比亚迪	15,200	759,240.00	0.37
55	300124	汇川技术	29,700	758,538.00	0.36
56	601669	中国电建	95,700	757,944.00	0.36
57	000166	申万宏源	134,800	754,880.00	0.36
58	300017	网宿科技	61,707	744,803.49	0.36
59	001979	招商蛇口	34,400	734,784.00	0.35
60	000963	华东医药	14,600	725,620.00	0.35
61	601009	南京银行	64,700	725,287.00	0.35
62	000768	中航飞机	39,000	719,160.00	0.35
63	000423	东阿阿胶	10,000	718,900.00	0.35
64	601618	中国中冶	140,600	704,406.00	0.34
65	000783	长江证券	74,100	701,727.00	0.34
66	600352	浙江龙盛	73,400	699,502.00	0.34

67	000895	双汇发展	29,400	698,250.00	0.34
68	600023	浙能电力	127,800	697,788.00	0.34
69	600010	包钢股份	317,100	694,449.00	0.33
70	002202	金风科技	44,800	693,056.00	0.33
71	000069	华侨城 A	68,700	691,122.00	0.33
72	002236	大华股份	30,200	688,862.00	0.33
73	000623	吉林敖东	29,380	672,508.20	0.32
74	601111	中国国航	68,900	671,775.00	0.32
75	600816	安信信托	49,280	669,715.20	0.32
76	601258	庞大集团	233,800	654,640.00	0.31
77	600570	恒生电子	14,017	654,313.56	0.31
78	600118	中国卫星	23,400	651,456.00	0.31
79	601099	太平洋	161,800	650,436.00	0.31
80	000413	东旭光电	57,900	649,638.00	0.31
81	601933	永辉超市	90,000	637,200.00	0.31
82	600705	中航资本	112,500	635,625.00	0.31
83	600061	国投安信	40,800	634,440.00	0.31
84	601998	中信银行	100,000	629,000.00	0.30
85	600383	金地集团	54,800	628,556.00	0.30
86	600535	天士力	15,100	627,254.00	0.30
87	300024	机器人	32,000	624,000.00	0.30
88	000402	金融街	52,000	609,440.00	0.29
89	601555	东吴证券	54,100	607,543.00	0.29
90	600153	建发股份	46,400	599,952.00	0.29
91	000157	中联重科	133,400	598,966.00	0.29
92	600804	鹏博士	33,700	598,175.00	0.29
93	600739	辽宁成大	32,900	593,187.00	0.29
94	000100	TCL 集团	170,100	591,948.00	0.28
95	000793	华闻传媒	58,400	591,008.00	0.28
96	002081	金螳螂	53,800	590,724.00	0.28
97	601866	中海集运	163,000	586,800.00	0.28
98	600018	上港集团	91,300	578,842.00	0.28
99	600741	华域汽车	23,600	572,064.00	0.28
100	002252	上海莱士	27,877	567,018.18	0.27
101	600177	雅戈尔	56,000	566,720.00	0.27
102	000876	新希望	67,300	553,206.00	0.27
103	000826	启迪桑德	15,731	552,472.72	0.27
104	600637	东方明珠	24,968	541,056.56	0.26
105	600221	海南航空	166,600	536,452.00	0.26

106	000425	徐工机械	140,100	525,375.00	0.25
107	002007	华兰生物	14,379	524,833.50	0.25
108	600085	同仁堂	15,000	524,400.00	0.25
109	000503	海虹控股	21,000	523,530.00	0.25
110	000060	中金岭南	46,700	523,040.00	0.25
111	002065	东华软件	23,900	520,781.00	0.25
112	002475	立讯精密	17,600	514,624.00	0.25
113	600297	广汇汽车	67,990	511,964.70	0.25
114	300315	掌趣科技	62,600	510,816.00	0.25
115	002465	海格通信	46,700	501,558.00	0.24
116	000977	浪潮信息	28,400	491,888.00	0.24
117	000559	万向钱潮	45,960	488,095.20	0.23
118	300027	华谊兄弟	59,700	482,973.00	0.23
119	600718	东软集团	30,900	480,495.00	0.23
120	600583	海油工程	76,700	478,608.00	0.23
121	600406	国电南瑞	26,800	473,020.00	0.23
122	002739	万达院线	9,000	458,730.00	0.22
123	601919	中国远洋	84,500	457,145.00	0.22
124	000686	东北证券	45,400	456,270.00	0.22
125	300146	汤臣倍健	33,100	454,794.00	0.22
126	600208	新潮中宝	100,600	452,700.00	0.22
127	600588	用友网络	25,242	432,143.04	0.21
128	000917	电广传媒	37,300	421,490.00	0.20
129	600820	隧道股份	41,300	417,130.00	0.20
130	002310	东方园林	24,900	416,328.00	0.20
131	601928	凤凰传媒	42,600	415,776.00	0.20
132	601958	金钼股份	57,794	414,382.98	0.20
133	600893	中航动力	15,000	409,500.00	0.20
134	600372	中航电子	23,400	406,458.00	0.20
135	600362	江西铜业	24,100	406,326.00	0.20
136	300058	蓝色光标	51,800	405,076.00	0.19
137	603885	吉祥航空	26,600	403,788.00	0.19
138	300072	三聚环保	10,700	396,435.00	0.19
139	600839	四川长虹	108,000	390,960.00	0.19
140	002673	西部证券	27,468	390,594.96	0.19
141	300133	华策影视	34,500	386,400.00	0.19
142	600332	白云山	13,200	383,328.00	0.18
143	002183	怡亚通	44,200	381,446.00	0.18
144	600115	东方航空	55,400	376,720.00	0.18

145	600157	永泰能源	104,500	373,065.00	0.18
146	000540	中天城投	53,500	371,825.00	0.18
147	300168	万达信息	25,200	366,660.00	0.18
148	600446	金证股份	20,000	351,600.00	0.17
149	600485	信威集团	24,000	350,160.00	0.17
150	600867	通化东宝	18,240	332,697.60	0.16
151	601633	长城汽车	25,000	332,250.00	0.16
152	002085	万丰奥威	17,040	331,428.00	0.16
153	603000	人民网	25,100	330,567.00	0.16
154	000156	华数传媒	22,000	328,020.00	0.16
155	600959	江苏有线	30,000	317,100.00	0.15
156	600663	陆家嘴	13,300	314,412.00	0.15
157	601333	广深铁路	69,100	312,332.00	0.15
158	600415	小商品城	42,200	305,528.00	0.15
159	000039	中集集团	15,800	284,874.00	0.14
160	600150	中国船舶	12,200	279,014.00	0.13
161	601718	际华集团	31,600	277,764.00	0.13
162	600895	张江高科	16,200	273,456.00	0.13
163	000709	河钢股份	64,900	271,931.00	0.13
164	600256	广汇能源	64,200	265,788.00	0.13
165	601155	新城控股	14,200	263,268.00	0.13
166	600704	物产中大	35,850	261,346.50	0.13
167	600688	上海石化	39,400	260,434.00	0.13
168	600060	海信电器	16,500	250,305.00	0.12
169	601225	陕西煤业	35,200	248,864.00	0.12
170	002500	山西证券	25,800	247,164.00	0.12
171	600252	中恒集团	58,400	235,936.00	0.11
172	300015	爱尔眼科	10,050	233,763.00	0.11
173	002385	大北农	37,100	233,359.00	0.11
174	300002	神州泰岳	27,600	230,184.00	0.11
175	600074	保千里	17,400	222,894.00	0.11
176	002146	荣盛发展	22,100	218,127.00	0.10
177	600373	中文传媒	9,269	217,914.19	0.10
178	601216	君正集团	44,500	217,605.00	0.10
179	002074	国轩高科	6,800	214,540.00	0.10
180	000983	西山煤电	24,400	213,988.00	0.10
181	300144	宋城演艺	10,000	208,700.00	0.10
182	600498	烽火通信	8,200	207,870.00	0.10
183	600376	首开股份	17,900	204,776.00	0.10

184	600827	百联股份	12,600	204,750.00	0.10
185	000415	渤海金控	28,800	193,824.00	0.09
186	601872	招商轮船	36,600	189,954.00	0.09
187	002470	金正大	24,400	183,732.00	0.09
188	002195	二三四五	25,500	182,325.00	0.09
189	600873	梅花生物	32,100	182,007.00	0.09
190	002714	牧原股份	6,400	174,208.00	0.08
191	600038	中直股份	3,800	173,926.00	0.08
192	002174	游族网络	5,400	171,504.00	0.08
193	002152	广电运通	20,550	170,770.50	0.08
194	600037	歌华有线	11,400	165,984.00	0.08
195	600021	上海电力	13,400	162,006.00	0.08
196	002292	奥飞动漫	9,200	155,480.00	0.07
197	600737	中粮屯河	16,200	152,928.00	0.07
198	300182	捷成股份	15,800	151,048.00	0.07
199	000738	中航动控	7,500	146,775.00	0.07
200	000671	阳光城	25,200	146,664.00	0.07
201	600549	厦门钨业	6,800	146,132.00	0.07
202	600685	中船防务	5,200	142,376.00	0.07
203	600482	中国动力	5,400	136,566.00	0.07
204	601877	正泰电器	6,600	132,594.00	0.06
205	000061	农产品	14,300	129,558.00	0.06
206	002027	分众传媒	9,400	129,344.00	0.06
207	000800	一汽轿车	12,600	128,142.00	0.06
208	601021	春秋航空	3,800	127,794.00	0.06
209	000027	深圳能源	18,600	125,178.00	0.06
210	002424	贵州百灵	6,600	124,476.00	0.06
211	000712	锦龙股份	7,400	121,138.00	0.06
212	600582	天地科技	25,600	117,504.00	0.06
213	002131	利欧股份	35,000	115,150.00	0.06
214	002153	石基信息	5,000	113,650.00	0.05
215	300251	光线传媒	13,600	111,384.00	0.05
216	000718	苏宁环球	18,800	110,168.00	0.05
217	600648	外高桥	5,800	107,416.00	0.05
218	601118	海南橡胶	18,400	104,512.00	0.05
219	601611	中国核建	8,200	98,154.00	0.05
220	000008	神州高铁	12,800	93,184.00	0.04
221	600783	鲁信创投	4,800	81,744.00	0.04
222	300085	银之杰	4,400	81,400.00	0.04

223	000555	神州信息	4,400	73,480.00	0.04
224	600188	兖州煤业	6,000	73,440.00	0.04
225	600754	锦江股份	2,600	70,460.00	0.03
226	601127	小康股份	2,800	55,860.00	0.03
227	002568	百润股份	2,800	46,536.00	0.02
228	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
229	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
230	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.02
231	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.01
232	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
233	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
234	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
235	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
236	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
237	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
238	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
239	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
240	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
241	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
242	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
243	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
244	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
245	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
246	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	000333	美的集团	2,345,871.00	2.11
2	000002	万科A	2,052,982.00	1.85
3	600585	海螺水泥	1,672,059.00	1.50
4	600066	宇通客车	1,656,569.00	1.49
5	600690	青岛海尔	1,651,636.00	1.49
6	600009	上海机场	1,638,443.22	1.47
7	002415	海康威视	1,205,334.00	1.08
8	600109	国金证券	1,182,063.00	1.06

9	000651	格力电器	1,181,576.00	1.06
10	601899	紫金矿业	1,147,567.00	1.03
11	603993	洛阳钼业	1,139,757.00	1.03
12	601600	中国铝业	1,126,316.00	1.01
13	000538	云南白药	1,042,003.95	0.94
14	600415	小商品城	983,877.00	0.89
15	600637	东方明珠	971,003.08	0.87
16	600019	宝钢股份	888,500.00	0.80
17	600795	国电电力	879,115.00	0.79
18	300104	乐视网	872,522.00	0.79
19	300072	三聚环保	860,696.92	0.77
20	000001	平安银行	859,857.00	0.77

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	2,628,735.00	2.37
2	000333	美的集团	2,568,906.00	2.31
3	300150	世纪瑞尔	1,936,849.00	1.74
4	002415	海康威视	1,781,122.00	1.60
5	600340	华夏幸福	1,538,746.00	1.38
6	600900	长江电力	1,379,676.00	1.24
7	600585	海螺水泥	1,358,879.12	1.22
8	000651	格力电器	1,311,553.00	1.18
9	600011	华能国际	1,306,471.00	1.18
10	000778	新兴铸管	1,285,734.00	1.16
11	600690	青岛海尔	1,186,191.00	1.07
12	600009	上海机场	1,165,121.00	1.05
13	600100	同方股份	1,156,255.58	1.04
14	600547	山东黄金	1,155,882.00	1.04
15	603800	道森股份	1,102,736.00	0.99
16	002353	杰瑞股份	1,100,000.00	0.99
17	601198	东兴证券	1,090,005.00	0.98
18	600415	小商品城	1,037,887.00	0.93
19	600027	华电国际	1,008,000.00	0.91
20	600276	恒瑞医药	1,006,501.00	0.91

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	100,042,836.46
卖出股票收入（成交）总额	82,521,205.50

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

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	39,122,815.20	18.81
10	合计	39,122,815.20	18.81

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

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	140096	16 福建 01	100,000	9,800,000.00	4.71
2	130815	16 重庆 01	100,000	9,784,000.00	4.70
3	130852	16 四川 01	100,000	9,768,000.00	4.70
4	140034	16 湖北 11	100,000	9,763,000.00	4.69
5	130807	16 江苏 01	80	7,815.20	0.00

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

根据 2016 年 7 月 14 日民航华东地区管理局发布对该公司的《民用航空行政处罚决定书》，决定对上海机场处以 8 万元的行政处罚。本基金做出如下说明：上海机场是中国最具商业价值的国际枢纽机场之一，基本面良好。基于相关研究，本基金判断，上海机场受到处罚，对上海机场的影响较小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其安全保卫制度建设与执行等公司基础性建设问题的完善性以及企业的经营状况。

网宿科技股份有限公司于 2017 年 6 月 23 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对网宿科技股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（沪证监决[2017]52 号），该函具体内容如下：“经查，我局发现你公司存在未及时披露购买理财产品事项。2016 年 1 月 1 日至 2 月 3 日，公司以自有资金购买理财产品累计达 2.5 亿元，占最近一期（2014 年）经审计净资产的 15.28%，公司未在购买理财产品金额累计达到公司最近一期经审计净资产 10%时及时披露该等事项，仅在 2016 年 4 月 27 日披露的一季报中对自有资金购买理财产品额度、收益情况进行了披露。本基金做出如下说明：网宿科技是 CDN 行业龙头公司，公司基本面良好，行业规模成长较快。公司在接到证监会的警示函后，与 7 月 5 日披露了《关于自有资金购买理财产

品的进展公告》，保荐机构 7 月 13 日也做出了核查意见。基于对公司的相关研究，本基金判断，此次购买理财产品，是为了提高资金利用效率，披露不及时的问题已经得到整改，对公司经营没有不良影响。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

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

7.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	79,657.49
2	应收证券清算款	322,422.18
3	应收股利	-
4	应收利息	174,425.82
5	应收申购款	7,722.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	584,227.87

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

注：本基金本报告期末前十名股票中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

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
2,307	91,432.63	165,768,941.06	78.59%	45,166,139.57	21.41%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	355.14	0.0002%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年5月27日）基金份额总额	351,679,073.44
本报告期期初基金份额总额	124,831,608.38
本报告期基金总申购份额	91,670,369.47
减：本报告期基金总赎回份额	5,566,897.22
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	210,935,080.63

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2017 年 3 月 17 日起，冯雨生同志兼任长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 3 月 17 日起，吴博文同志不再担任长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动情况。

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

本报告期内本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	
川财证券	1	121,910,109.88	68.11%	89,149.99	62.65%	-
光大证券	2	57,069,019.70	31.89%	53,148.76	37.35%	-
华泰联合	1	-	-	-	-	-

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
川财证券	9,782,168.00	16.52%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	49,431,100.00	83.48%	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

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

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研

究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、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

注：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》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	长盛同鑫行业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
4	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的公告	同上	2017年4月 22日
5	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
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
8	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

9	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
10	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
11	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金2016年度报告	同上	2017年3月 27日
12	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金2016年度报告摘要	同上	2017年3月 27日
13	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
14	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
15	长盛基金管理有限公司关于调整长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理的公告	同上	2017年3月 18日
16	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宜信普泽费率优惠活动的公告	同上	2017年3月 17日
17	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的公告	同上	2017年2月 23日
18	长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金2016年第4季度报告	同上	2017年1月 21日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/1/1/~ 2017/6/30	76,334,787.35	88,986,651.84	0.00	165,321,439.19	78.38%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§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、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同鑫行业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的办公地址和/或基金托管人的住所。

12.3 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