农银汇理14天理财债券型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	农银14天理财债券	
交易代码	000322	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年12月18日	
报告期末基金份额总额	492,204,915.44份	
投资目标	在严格控制风险和保持组合资产高流动性的基础上,力争实现超越业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	久期调整策略、类属选择策略、信用策略、息差放大策略、衍生品策略	
业绩比较基准	人民币7天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品,其风险收益水平高于货币市场基金,但低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	农银14天理财债券A	农银14天理财债券B
下属分级基金的交易代码	000322	000323
报告期末下属分级基金的份额总额	153,062,021.11份	339,142,894.33份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日 - 2016年6月30日)	
	农银14天理财债券A	农银14天理财债券B
1. 本期已实现收益	1,160,301.22	2,520,608.98
2.本期利润	1,160,301.22	2,520,608.98
3.期末基金资产净值	153,062,021.11	339,142,894.33

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

农银14天理财债券A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6594%	0.0035%	0.3413%	0.0000%	0.3181%	0.0035%

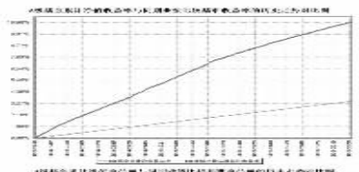
本基金收益分配是按日结转份额。

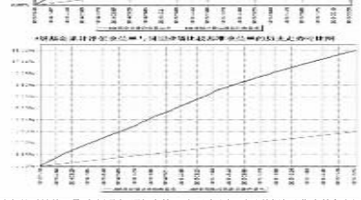
农银14天理财债券B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7196%	0.0035%	0.3413%	0.0000%	0.3783%	0.0035%

本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





本基金主要投资于具有良好流动性的工具,包括现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397)的债券、资产支持证券、中期票据;期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券,及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金不直接在二级市场上买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。本基金建仓期为基金合同生效日(2013年12月18日)起六个月,建仓期满时,本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许妮	本基金基金经理	2013年12月18日	-	8	金融学硕士。历任中国国际金融有限公司销售交易部助理、国信证券经济研究所销售人员、中海基金管理有限公司交易员、农银汇理基金管理有限公司债券交易员。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行,确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行,确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

4.3.3 公平交易专项说明

4.3.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行,确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

4.3.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、本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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

2016年二季度,国内经济未能延续改善,工业企业利润增速较一季度有所下滑;通胀方面,食品价格下降带动CPI温和回落,大宗商品价格反弹带动PPI跌幅收窄,货币政策更趋于稳健,资金面总体保持相对宽松局面,债市呈现先跌后涨的震荡走势,利率债收益率曲线平坦化,中短端利率略有上行,而长端利率小幅下行,期限利差有所收窄;信用债方面,收益率曲线整体上行,中高评级信用利差压缩至历史低位,而低评级债券信用利差仍保持在较高位置,主要是违约风险频发所致。

货币市场方面,央行运用回购及MLF等多种工具调节流动性,市场流动性整体保持相对宽松局面,各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率维持在较低水平。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,鉴于信用风险超预期爆发,本基金坚持稳健操作思路,以利率债为主要配置标的,把握交易机会,提升组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,长盛同裕纯债债券A的基金份额净值为1.006元,本报告期份额净值增长率为0.60%,同期业绩比较基准增长率为-0.52%。

截止报告期末,长盛同裕纯债债券C的基金份额净值为1.005元,本报告期份额净值增长率为0.50%,同期业绩比较基准增长率为-0.52%。

截止报告期末,长盛同裕纯债债券E的基金份额净值为1.005元,本报告期份额净值增长率为0.50%,同期业绩比较基准增长率为-0.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	234,805,800.00	96.17
	其中:债券	234,805,800.00	96.17
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,684,730.32	1.10
8	其他资产	6,664,412.03	2.73
9	合计	244,154,942.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末持有沪港通投资股票。

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

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,142,800.00	1.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	230,663,000.00	104.45
	其中:政策性金融债	230,663,000.00	104.45
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	-	-
10	合计	234,805,800.00	106.33

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130228	13国开28	500,000	50,030,000.00	22.66
2	150419	15农发19	500,000	50,010,000.00	22.65
3	150416	15农发16	500,000	50,000,000.00	22.64
4	150215	15国开15	300,000	30,000,000.00	13.58
5	150207	15国开07	200,000	20,452,000.00	9.26

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,696.95
2	应收证券清算款	1,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	5,662,715.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,664,412.03

5.10.2 报告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。

5.10.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长盛同裕纯债A	长盛同裕纯债C	长盛同裕纯债E
报告期期初基金份额总额	203,431,313.09	286,862,782.18	65,312.98
报告期期间基金总申购份额	167,232.85	77,974.42	8,436.37
减:报告期期间基金总赎回份额	46,368,578.67	224,607,963.68	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-	-
报告期期末基金份额总额	157,229,967.27	62,332,792.92	73,749.35

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准长盛基金募集的文件;

2、《长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛同裕纯债债券型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛同裕纯债债券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。

8.2 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。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及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
2016年7月20日

农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:农银汇理基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	农银主题轮动混合	
交易代码	000462	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年4月10日	
报告期末基金份额总额	678,769,654.48份	
投资目标	运用主题投资策略,把握中国经济发展和结构转型过程中各种投资主题的轮动效应,在严格控制风险和保持良好流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金采用"主题投资策略"(Thematic Investment Approach),综合运用定量和定性的分析方法,自上而下,针对经济发展和结构转型的驱动因素进行前瞻性的分析,挖掘市场的长期性和阶段性主题投资机会,结合价值投资理念,精选投资主题下的受益个股,力争获取市场超额收益,实现基金资产的长期稳定增值。 1、大类资产配置策略。本基金基于对宏观经济、政策面、市场面等因素的综合分析,结合对股票、债券、现金等大类资产的收益特征的前瞻性研究,形成对各类别资产未来表现的预判,在严格控制投资组合风险的前提下,确定和调整基金资产中股票、债券、货币市场工具以及其他金融工具的配置比例。 2、股票投资策略。本基金的股票投资将运用主题投资策略从主题发掘、主题配置和个股精选三个层面构建投资组合。 3、债券投资策略。本基金债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标,同时根据需要进行积极操作,以提高基金收益。 4、权证投资策略。本基金将从权证标的证券基本面、权证定价合理性、权证隐含波动率等多个角度对拟投资的权证进行分析,以有利于资产增值为原则,加强风险控制,谨慎参与投资。	
业绩比较基准	沪深300指数×65%+中证全债指数×35%。	
风险收益特征	本基金为中高风险、中高预期收益的混合型基金产品,其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。	
基金管理人	农银汇理基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日 - 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	47,440,967.70
2.本期利润	24,748,698.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.0352
4.期末基金资产净值	715,526,392.03
5.期末基金份额净值	1.0542

注:1、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。

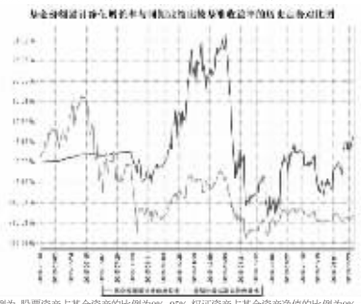
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.44%	1.61%	-1.11%	0.66%	4.55%	0.95%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0%-95%,权证资产占基金资产净值的比例为0%-3%,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金建仓期为基金合同生效日(2015年4月10日)起六个月,建仓期满时,本基金各项投资比例已达到基金合同规定的投资比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈富权	本基金基金经理	2015年4月10日	-	8	金融学硕士。历任香港上海汇丰银行管理培训生、香港上海汇丰银行客户经理,农银汇理基金管理有限公司助理研究员、研究员。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。
史向明	本基金基金经理、公司固定收益部总经理	2015年5月26日	-	16	理学硕士,具有基金从业资格。 历任中国银河证券公司上海总部债券研究员、天治基金管理公司债券研究员及天治天利货币市场基金经理、上投摩根基金管理公司固定收益部投资经理、农银汇理恒久增利债券型基金基金经 理助理。现任农银汇理基金管理有限公司固定收益部总经理、基金经理。
颜伟鹏	本基金基金经理	2015年5月26日	-	5	工学硕士。历任交银施罗德基金公司研究员、农银汇理基金管理有限公司基金经理助理。现任农银汇理基金管理有限公司基金经理。

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,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾本基金二季度操作,本基金二季度坚持了至下而上的投资风格,深度研究基本面,在分化的行情中,挖掘个股,业绩逐渐好转;未来的配置重点依然是优质的成长股,在深度研究优秀上市公司的基础上进行配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为3.44%,业绩比较基准收益率为-1.11%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定,报告期内,本基金未出现上述情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	629,369,301.53	82.26
	其中:股票	629,369,301.53	82.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	103,027,665.26	13.47
8	其他资产	32,708,980.06	4.28
9	合计	765,105,946.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,971.45	0.00
B	采矿业	21,368,406.00	2.99
C	制造业	521,229,468.15	72.85
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	36,313,901.35	5.08
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	13,327,437.56	1.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	24,037,049.52	3.36
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,132,697.00	1.00
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	5,958,370.50	0.83
S	综合	-	-
	合计	629,369,301.53	87.96

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末持有沪港通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300278	华昌达	3,294,270	56,299,074.30	7.87
2	300326	凯利泰	2,160,749	53,997,117.51	7.55
3	600459	贵研铂业	1,752,900	52,376,652.00	7.32
4	300219	鸿利光电	3,156,549	49,179,033.42	6.87
5	000700	模塑科技	4,071,800	41,247,334.00	5.76
6	002167	东方锆业	3,553,050	38,905,897.50	5.44
7	000851	高鸿股份	2,817,215	36,313,901.35	5.08
8	300233	金城医药	1,391,815	36,034,090.35	5.04
9	002733	雄韬股份	1,103,300	32,492,185.00	4.54
10	002048	宁波华翔	1,272,570	29,103,675.90	4.07

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

广东方锆业科技股份有限公司(以下简称"公司"或"东方锆业")公司2016年1月23日收到了中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《行政处罚决定书》([2016]6号),决定书指出东方锆业其项目建设过程中,其控股股东在未经董事会及股东大会批准的情况下,擅自挪用募集资金,改变募集资金用途,未按照有关规定在2012年年报、2013年年报、2014年年报和各次关于募集资金使用和管理的情况说明的公告中披露,中国证监会决定对东方锆业给予警告、罚款的处分。就上述事实,东方锆业又于2016年5月3日受到了深圳证券交易所的通报批评。

对东方锆业股票投资决策程序的说明:该股票经过研究推荐、审批后进入公司股票备选库,由研究员跟踪分析。本基金管理人进行了研究判断,按照相关投资决策流程投资了该股票。

其余九名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,539,185.99
2	应收证券清算款	29,753,211.45
3	应收股利	-
4	应收利息	18,097.99
5	应收申购款	1,398,484.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,708,980.06

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	715,048,630.46
报告期期间基金总申购份额	48,591,186.35
减:报告期期间基金总赎回份额	84,870,162.33
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	678,769,654.48

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

截至本季度末,基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

截至本季度末,基金管理人无运用固有资金投资本基金情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2、《农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《农银汇理主题轮动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、基金管理人业务资格批件、营业执照;

5、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址:上海市浦东新区银城路9号农银大厦50层。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及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。

农银汇理基金管理有限公司
2016年7月20日

长盛同裕纯债债券型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016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
报告送出日期:2016年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2016年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同裕纯债		
基金主代码	002283		
交易代码	002283		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016年3月29日		
报告期末基金份额总额	219,636,509.54份		
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳健增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。		
投资策略	(一)大类资产配置策略 本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上,结合政策分析,确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估,及时调整资产组合比例,保持资产配置风险、收益平衡,以稳健提升投资组合回报。 (二)债券组合管理策略 1、利率策略 利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。通过全面研究国民经济运行状况,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构,在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜率变化趋势。 结合久期是反映利率风险最重要的指标,根据对市场利率水平的变化趋势的预期,可以制定出组合的目标久期,预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。 利用收益率曲线斜度变化可以制定相应的债券组合期限结构策略,例如:子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。 2、类属配置策略 债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况,货币市场及资本市场资金供求关系,以及不同时期市场投资热点,分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利差水平,评定不同债券类属的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。 3、信用策略 信用品种的选择采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方式,在对宏观经济、利率走势、发行人经营及财务状况进行分析的基础上,结合信用品种的发行条款,建立信用债备选库,并以此为基础和定信用品种的投资方法。 ①宏观环境和行业分析 主要关注宏观经济状况和经济增长速度、宏观经济政策及法律制度对企业信用级别的影响;行业分析主要关注企业所处的行业类型(成长型、周期型、防御型)、产业链结构及行业在产业链中的位置、行业的竞争程度和行业政策对企业信用级别的影响。 ②发债主体基本面分析 主要包括定性分析和定量分析两个方面: 定性分析主要包括对企业性质和内部治理情况、企业财务管理的风格、企业的盈利模式、企业在产业链中的位置、产品竞争力和核心优势的分析,以及企业的股东背景、政府对企业的支持、银企关系、企业对国家或地方的重要程度等企业的外部支持分析。 定量分析主要包括资本结构分析、现金获取能力分析、盈利能力分析以及偿债能力分析四部分,定量分析的重点是选取适当的财务指标并把握其中蕴含的深层含义及互动关系,定量地实现企业信用水平的区分和预测。 ③内部信用评级定量分析体系。 经过广泛的调研,基于我国目前实际情况,考虑到国内外评级、以及专业的发行评级与投资评级的差异,从投资角度建立内部的公司债评级体系,其分析过程包括如下几大部分: 1)行业内财务数据指标筛选。基于可比原则,采用因子分析对行业内各公司多个具有信息冗余的财