

# 长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 2 月 22 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	61
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	61

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	61
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	63
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>64</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>65</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4 基金投资策略的改变 .....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8 其他重大事件 .....	68
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>72</b>
12.1 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 .....	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>73</b>
13.1 备查文件目录 .....	73
13.2 存放地点 .....	73
13.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长盛量化多策略
基金主代码	003658
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年2月22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	141,878,574.63份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对多种策略超额收益进行历史有效性验证和持续监控，深度挖掘具备阶段性成长机会的上市公司，满足投资人长期稳健的投资收益需求。
投资策略	<p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>本基金将通过宏观、微观经济指标，市场指标，政策因素等，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>1、量化策略相关子策略</p> <p>基金管理人主要根据上市公司基本面数据、二级市场交易价格特征、分析师预期信息和行为特征、上市公司行为等数据和信息构建多个量化选股策略，并对组合中的相关策略，定期采用等权重配置进行再平衡，并在此基础上进行优化和调整。</p> <p>(1) 基于基本面的多因子选股策略</p> <p>基金管理人 对上市公司基本面数据进行因子化，并进行了历史回测，选择长期表现稳定的因子作为选股标准，主要选择盈利水平因子、成长性因子、盈利质量因子和估值因子等长期表现较好的因子。</p> <p>(2) 基于二级市场交易特征的多因子选股策略</p> <p>基金管理人 对二级市场交易特征数据进行因子化，并进行了历史回测，选择长期表现稳定的因子作为选股标准，主要选择股价冲击成本因子、价格弹性因子、价格动量因子、非线性市值等长期表现较好的因子。</p> <p>(3) 分析师羊群行为事件驱动策略</p> <p>分析师对股票的推荐行为存在明显的羊群行为特征，会对股价形成持续的推动作用，基金管理人利用这一效应构建了与之相对应的事件驱动策略。</p> <p>(4) 上市公司盈利持续高增长事件驱动策略</p>

	<p>上市公司业绩持续增长是上市公司二级市场价格上涨的最主要原因，基金管理人也基于上述效应构建了相应的事件驱动策略，对发布业绩预增等相关公告的上市公司进行重点跟踪分析和评估。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>本基金在实际的投资管理运作中，将运用利率配置策略、类属配置策略、信用配置策略、相对价值策略及单个债券选择策略等多种策略，以获取债券市场的长期稳定收益。</p> <p>（四）权证投资策略</p> <p>本基金投资权证的原则是有利于基金资产增值和投资风险控制。</p> <p>（五）股指期货投资策略</p> <p>本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。</p> <p>（六）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%
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	陈四清

## 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年2月22日(基金合同生效日)-2017年12月31日
本期已实现收益	22,000,012.69
本期利润	27,083,539.48
加权平均基金份额本期利润	0.0689
本期加权平均净值利润率	6.87%
本期基金份额净值增长率	8.90%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末
期末可供分配利润	12,669,183.65
期末可供分配基金份额利润	0.0893
期末基金资产净值	154,547,758.28
期末基金份额净值	1.089
3.1.3 累计期末指标	2017年末
基金份额累计净值增长率	8.90%

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

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

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

4、本基金基金合同生效日为2017年2月22日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

### 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
过去三个月	5.22%	0.89%	2.31%	0.41%	2.91%	0.48%
过去六个月	10.00%	0.80%	5.01%	0.35%	4.99%	0.45%
自基金合同生效起至今	8.90%	0.68%	8.04%	0.33%	0.86%	0.35%

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：沪深300指数收益率\*50%+中证综合债指数收益率\*50%

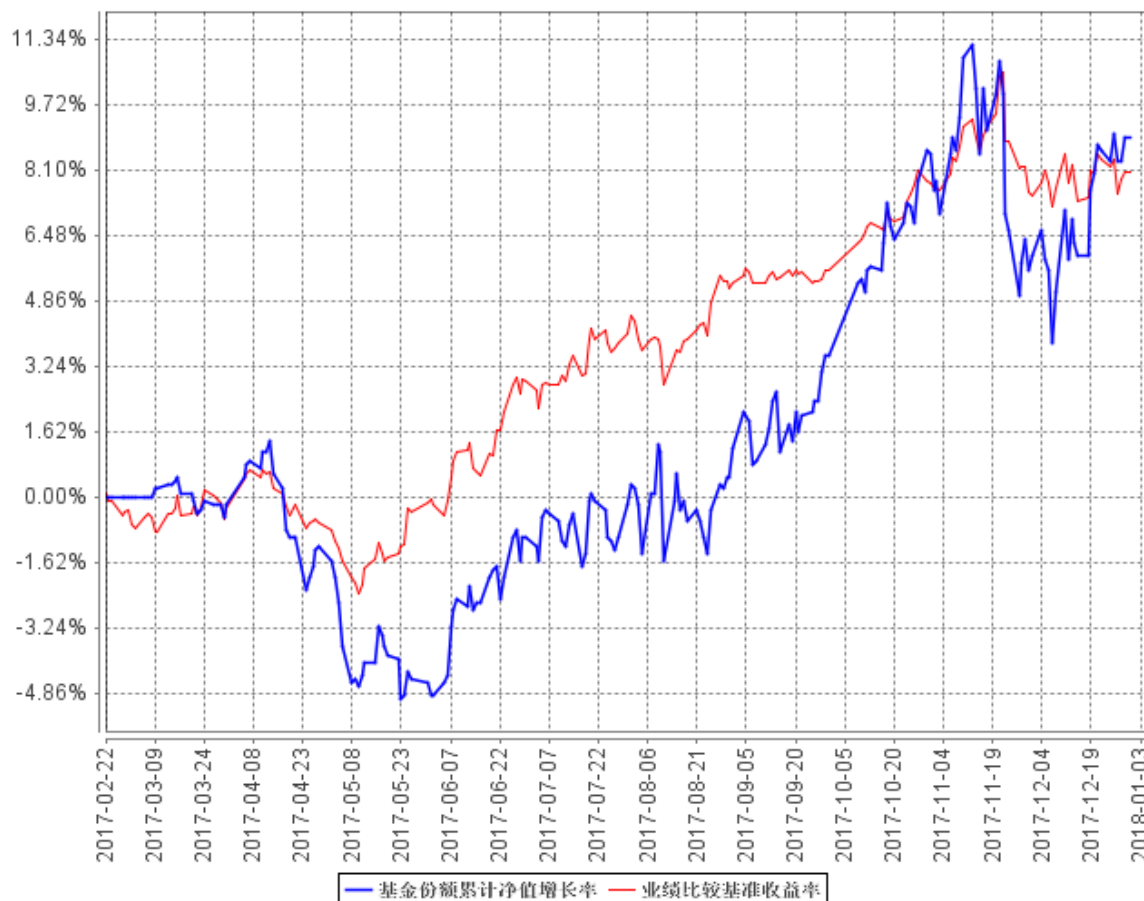


基准指数的构建考虑了三个原则：

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

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

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

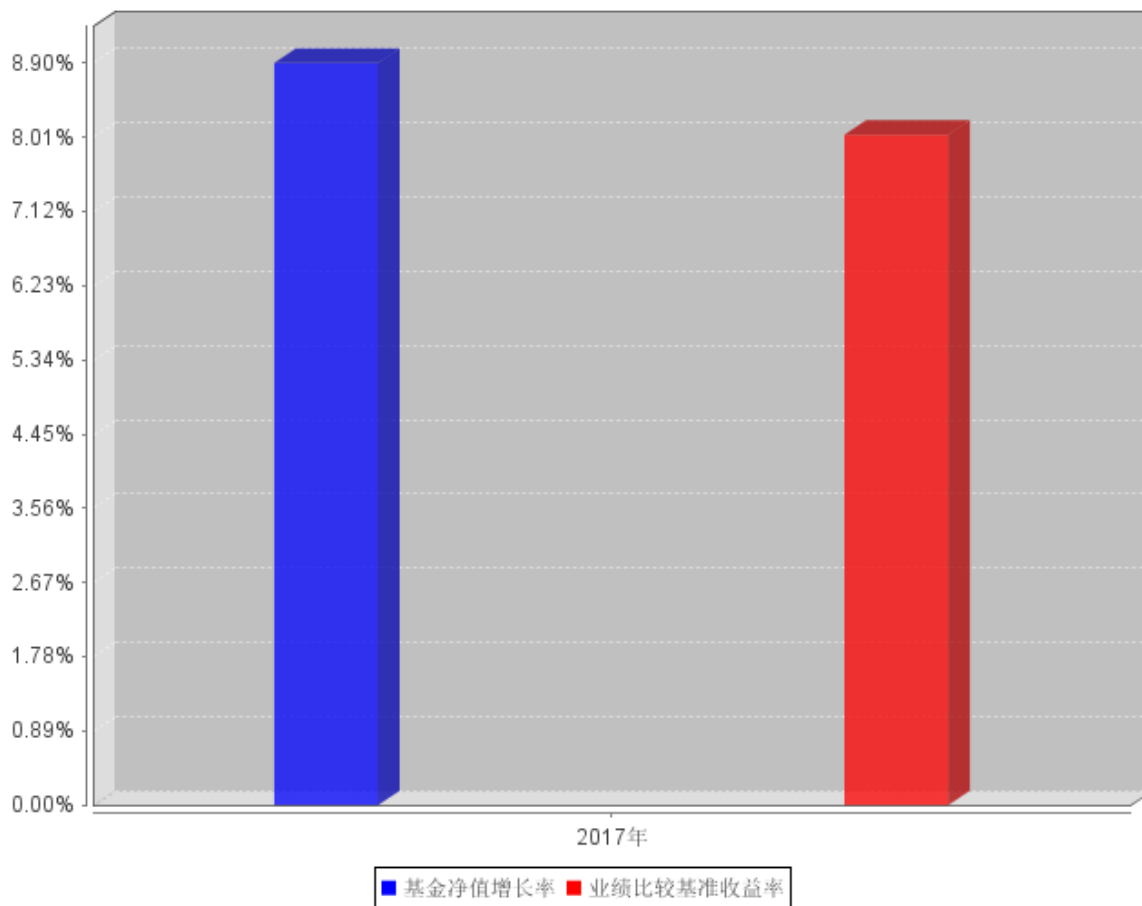


注：1、本基金基金合同生效日为 2017 年 2 月 22 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。截止报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2017 年 2 月 22 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2017 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止会计期间未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 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 12 月 31 日，基金管理人共管理七十四只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王超	本基金基金经理，长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛医疗行业量化配	2017 年 2 月 22 日	-	10 年	王超先生，1981 年 9 月出生。中央财经大学硕士，CFA（特许金融分析师），FRM（金融风险管理师）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。

	置股票型证券投资基金基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数证券投资基金（LOF）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，长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理。				
--	--	--	--	--	--

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。具体如下：

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2017 年的市场行情，白马股和“中小创”之间的分化还是大大超出我们的预料，一方面，基金持仓集中的白马股成为抱团取暖的对象，股价屡创新高；另一方面，相对估值较高的“中小创”呈现出估值持续回落的态势，而不是大家之前普遍预期的重新回归成长的节奏。在此期间，上证综指上涨 6.56%，沪深 300 上涨 21.78%，中小板指上涨 16.73%，创业板指下跌 10.67%。在此期间，本基金处于建仓阶段，主要采用事件驱动策略布局相关个股，较好的控制了净值回撤，最大跌幅为 5%。反思期间的操作，影响业绩的主要原因在于，量化策略虽然配置了市场强势品种，但是采用等权重配置，权重没有相应加大，而此轮白马股上涨对主动型基金的影响更多的体现在重仓股方面。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.089 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.90%，业绩比较基准收益率为 8.04%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来的行情，外部因素对国内市场的影响有待观察，美国税改的影响尚未充分体现，但

是我们预计将不会对国内构成实质性冲击。国内的经济基本面，将会呈现经济稳中趋缓、通胀温和上行、货币政策稳定、宏观审慎加强以及财政政策保持积极的状态，对于股票资产而言，经济、企业盈利中枢稳定从分子端有利于股票资产定价，机构投资者的发展以及监管层防范金融风险的要求，推动股票资产波动率中枢下行，提高其风险调整后的回报率。另外从居民资产配置需求的角度，当房地产在“房住不炒”的政策定位下，以及资管新规对银行理财净值化的约束下，相关资产对居民的吸引力或有下降，有利于资金向权益市场倾斜。基于上述判断，我们将积极运用多种量化策略灵活参与市场，同时在组合权重方面予以灵活调整，平衡集中持股与降低组合波动率两者之间关系，构建价值型量化策略和事件驱动策略的“核心-卫星”组合，在价值型量化策略长期相对市场稳定超额收益的基础上，利用事件驱动策略提供短期的收益跃升。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

2、持续推动公司完善制度/流程建设，扎实公司内控制度基础。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，保证公司制度/流程的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司新订、修订了包括《长盛基金管理有限公司公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理制度》《长盛基金管理有限公司合规管理制度》《公司证券投资基金销售适用性管理制度》《公司反洗钱内部控制管理办法》《公司债券投资管理办法》《公司开放式证券投资基金大额申购赎回管理办法》《公司客户回访工作细则》《公司专职、兼职合规管理人员管理实施办法》等多部制度和流程。

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

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

规。报告期内，监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核 30 余项，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、登记注册、产品开发、员工行为等；此外，根据业务发展需要，以及日常监督中发现问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，合理保障公司及委托资产合规、稳健运作。

5、积极参与新产品设计、新业务拓展工作，对相关的合规问题提供意见和建议。本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金报告期内未实施利润分配。



本基金截至 2017 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 12,669,183.65 元，其中：未分配利润已实现部分为 20,316,133.48 元，未分配利润未实现部分为-7,646,949.83 元。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

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

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 22118 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“长盛量化多策略”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了长盛量化多策略 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于长盛量化多策略,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>长盛量化多策略的基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估长盛量化多策略的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算长盛量化多策略、终止</p>

	<p>运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长盛量化多策略的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长盛量化多策略持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛量化多策略不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计</p>

	发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	顾卓毅
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2018年3月27日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	9,087,596.29
结算备付金		370,817.88
存出保证金		233,186.38
交易性金融资产	7.4.7.2	147,837,843.26
其中：股票投资		138,599,727.26
基金投资		-
债券投资		9,238,116.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		219,231.85
应收利息	7.4.7.5	214,677.27
应收股利		-
应收申购款		197,575.97
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		158,160,928.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		2,930,648.98
应付管理人报酬		206,414.99
应付托管费		34,402.49
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	295,667.52
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	146,036.64
负债合计		3,613,170.62
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	141,878,574.63
未分配利润	7.4.7.10	12,669,183.65
所有者权益合计		154,547,758.28
负债和所有者权益总计		158,160,928.90

注：1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.089 元，基金份额总额 141,878,574.63 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		36,883,654.17
1. 利息收入		1,534,714.86
其中：存款利息收入	7.4.7.11	998,203.13
债券利息收入		76,534.70
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		459,977.03
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,832,159.19
其中：股票投资收益	7.4.7.12	24,741,955.94
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	43,382.12
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	3,046,821.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,083,526.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,433,253.33
<b>减：二、费用</b>		9,800,114.69

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,041,644.29
2. 托管费	7.4.10.2.2	840,274.09
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	3,751,961.50
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	166,234.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>27,083,539.48</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>27,083,539.48</b>

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 2 月 22 日，无上年度可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益（基金净值）	747,266,452.70	-	747,266,452.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,083,539.48	27,083,539.48
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）	-605,387,878.07	-14,414,355.83	-619,802,233.90
其中：1. 基金申购款	10,252,742.47	381,244.02	10,633,986.49
2. 基金赎回款	-615,640,620.54	-14,795,599.85	-630,436,220.39
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）	141,878,574.63	12,669,183.65	154,547,758.28

注：本基金基金合同生效日为 2017 年 2 月 22 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。



本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 2738 号《关于准予长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 747,013,215.48 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 149 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 2 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 747,266,452.70 份基金份额,其中认购资金利息折合 253,237.22 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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。本基金类别资产配置比例为:股票投资占基金资产的比例为 0%-95%;权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%;本基金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,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金业绩比较基准:沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2018 年 3 月 27 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称

“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易所产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 9 月 4 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部

分确认为估值增值。自 2017 年 9 月 4 日起,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

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

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	9,087,596.29
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	9,087,596.29

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	133,521,336.47	138,599,727.26	5,078,390.79
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,232,980.00	9,238,116.00
	银行间市场	-	-
	合计	9,232,980.00	9,238,116.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	142,754,316.47	147,837,843.26	5,083,526.79

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：无。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

注：无。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
应收活期存款利息	1,782.61
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	166.80
应收债券利息	212,622.96
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	104.90
合计	214,677.27

**7.4.7.6 其他资产**

注：无余额。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	295,667.52
银行间市场应付交易费用	-
合计	295,667.52

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11,036.64
预提费用	135,000.00
合计	146,036.64



## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	747,266,452.70	747,266,452.70
本期申购	10,252,742.47	10,252,742.47
本期赎回(以“-”号填列)	-615,640,620.54	-615,640,620.54
- 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	141,878,574.63	141,878,574.63

注：1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2016 年 12 月 26 日至 2017 年 2 月 17 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 747,013,215.48 元。根据《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 253,237.22 元在本基金成立后，折算为 253,237.22 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2017 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 3 月 7 日止期间暂不向投资人开放基金交易。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	22,000,012.69	5,083,526.79	27,083,539.48
本期基金份额交易产生的变动数	-1,683,879.21	-12,730,476.62	-14,414,355.83
其中：基金申购款	295,871.83	85,372.19	381,244.02
基金赎回款	-1,979,751.04	-12,815,848.81	-14,795,599.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,316,133.48	-7,646,949.83	12,669,183.65

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日

活期存款利息收入	966,141.28
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	28,781.94
其他	3,279.91
合计	998,203.13

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日
卖出股票成交总额	1,297,014,957.21
减：卖出股票成本总额	1,272,273,001.27
买卖股票差价收入	24,741,955.94

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	43,382.12
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	43,382.12

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	11,298,810.84
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,049,120.00
减：应收利息总额	206,308.72
买卖债券差价收入	43,382.12

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

注：无。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

注：无。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,046,821.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,046,821.13

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	5,083,526.79
——股票投资	5,078,390.79
——债券投资	5,136.00
——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	5,083,526.79

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日
基金赎回费收入	2,427,850.80
基金转换费收入	5,402.53
合计	2,433,253.33

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	3,751,961.50
银行间市场交易费用	-
合计	3,751,961.50

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00
信息披露费	75,000.00
银行划款费用	23,734.81
帐户维护费	7,500.00
合计	166,234.81

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

无。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**7.4.9 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

注：无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
当期发生的基金应支付的管理费	5,041,644.29	
其中：支付销售机构的客户维护费	2,766,377.84	

注：支付基金管理人长盛基金的管理人报酬按前一日基金资产净值的 1.5% 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 × 1.5% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2017年2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	840,274.09	

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的 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。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

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

注：无。

### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2017年2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入

中国银行	9,087,596.29	966,141.28
------	--------------	------------

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128024	宁行转债	2017年12月5日	2018年1月12日	新债流通受限	100.00	100.00	6,901	690,100.00	690,100.00	-

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项停牌	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项停牌	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
600903	贵州燃气	2017年12月28日	重大事项停牌	16.86	2018年1月2日	16.01	715	1,580.15	12,054.90	-
600328	兰太实业	2017年7月18日	重大事项停牌	12.59	2018年1月9日	13.79	91	1,128.46	1,145.69	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，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。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.45%。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2017 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。



注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制），本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	9,087,596.29	-	-	-	9,087,596.29
结算备付金	370,817.88	-	-	-	370,817.88
存出保证金	233,186.38	-	-	-	233,186.38
交易性金融资产	8,548,016.00	-	690,100.00	138,599,727.26	147,837,843.26
应收证券清算款	-	-	-	219,231.85	219,231.85
应收利息	-	-	-	214,677.27	214,677.27
应收申购款	-	-	-	197,575.97	197,575.97
资产总计	18,239,616.55	-	690,100.00	139,231,212.35	158,160,928.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,930,648.98	2,930,648.98
应付管理人报酬	-	-	-	206,414.99	206,414.99
应付托管费	-	-	-	34,402.49	34,402.49
应付交易费用	-	-	-	295,667.52	295,667.52
其他负债	-	-	-	146,036.64	146,036.64
负债总计	-	-	-	3,613,170.62	3,613,170.62
利率敏感度缺口	18,239,616.55	-	690,100.00	135,618,041.73	154,547,758.28

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

**7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2017年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	2,604.37
市场利率上升 25 个基点	-2,604.37	

**7.4.13.4.2 外汇风险**

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

**7.4.13.4.3 其他价格风险**

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金股票资产投资占基金资产的比例为 0%-65%，债券等固定收益类资产投资占基金资产的比例不低于 30%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%，在每个交易日日终，扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

**7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	138,599,727.26	89.68
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	138,599,727.26	89.68

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：运营期小于一年，无足够的经验数据进行分析。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 138,438,018.47 元，属于第二层次的余额为 9,399,824.79 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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

## (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	138,599,727.26	87.63
	其中：股票	138,599,727.26	87.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,238,116.00	5.84
	其中：债券	9,238,116.00	5.84
	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	9,458,414.17	5.98
8	其他各项资产	864,671.47	0.55
9	合计	158,160,928.90	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	261,960.00	0.17
B	采矿业	16,453,968.22	10.65
C	制造业	43,388,230.51	28.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,010,785.93	1.95
E	建筑业	4,591,892.00	2.97
F	批发和零售业	4,554,598.78	2.95
G	交通运输、仓储和邮政业	2,883,095.93	1.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,236,410.25	7.27
J	金融业	40,750,814.45	26.37
K	房地产业	7,509,004.00	4.86
L	租赁和商务服务业	1,952,607.96	1.26
M	科学研究和技术服务业	70,297.77	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	34,086.20	0.02

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,739.65	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,900,235.61	1.23
S	综合	-	-
	合计	138,599,727.26	89.68

### 8.2.2 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港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601336	新华保险	215,039	15,095,737.80	9.77
2	000968	蓝焰控股	837,300	14,058,267.00	9.10
3	601939	建设银行	830,570	6,378,777.60	4.13
4	300098	高新兴	472,027	6,277,959.10	4.06
5	601398	工商银行	1,009,200	6,257,040.00	4.05
6	002142	宁波银行	349,885	6,231,451.85	4.03
7	601628	中国人寿	200,000	6,090,000.00	3.94
8	000895	双汇发展	172,400	4,568,600.00	2.96
9	000651	格力电器	101,600	4,439,920.00	2.87
10	002690	美亚光电	200,000	3,854,000.00	2.49
11	002410	广联达	165,100	3,235,960.00	2.09
12	600104	上汽集团	72,014	2,307,328.56	1.49
13	601668	中国建筑	253,900	2,290,178.00	1.48
14	600208	新潮中宝	357,700	1,867,194.00	1.21
15	600383	金地集团	142,100	1,794,723.00	1.16
16	600522	中天科技	124,500	1,735,530.00	1.12
17	002001	新和成	43,600	1,659,416.00	1.07
18	601006	大秦铁路	176,800	1,603,576.00	1.04
19	600183	生益科技	89,550	1,545,633.00	1.00
20	601186	中国铁建	136,100	1,516,154.00	0.98
21	600900	长江电力	94,200	1,468,578.00	0.95
22	002027	分众传媒	102,500	1,443,200.00	0.93
23	601088	中国神华	56,400	1,306,788.00	0.85
24	000848	承德露露	134,800	1,275,208.00	0.83
25	002146	荣盛发展	129,800	1,236,994.00	0.80
26	600019	宝钢股份	142,300	1,229,472.00	0.80

27	300017	网宿科技	115,100	1,224,664.00	0.79
28	600060	海信电器	79,500	1,194,090.00	0.77
29	000402	金融街	107,300	1,192,103.00	0.77
30	603198	迎驾贡酒	63,900	1,124,001.00	0.73
31	600741	华域汽车	37,000	1,098,530.00	0.71
32	000541	佛山照明	115,100	1,058,920.00	0.69
33	601607	上海医药	43,200	1,045,008.00	0.68
34	000963	华东医药	19,100	1,029,108.00	0.67
35	600219	南山铝业	276,900	1,018,992.00	0.66
36	603328	依顿电子	69,000	990,150.00	0.64
37	600271	航天信息	45,200	973,608.00	0.63
38	600563	法拉电子	18,728	951,569.68	0.62
39	600835	上海机电	36,900	904,050.00	0.58
40	600325	华发股份	106,900	786,784.00	0.51
41	600068	葛洲坝	95,800	785,560.00	0.51
42	600153	建发股份	68,300	759,496.00	0.49
43	600350	山东高速	125,300	750,547.00	0.49
44	600674	川投能源	72,700	740,086.00	0.48
45	000623	吉林敖东	31,800	715,500.00	0.46
46	600651	飞乐音响	77,600	710,040.00	0.46
47	000513	丽珠集团	10,300	684,435.00	0.44
48	600089	特变电工	68,000	673,880.00	0.44
49	000001	平安银行	50,000	665,000.00	0.43
50	601098	中南传媒	47,800	663,942.00	0.43
51	600161	天坛生物	23,000	662,170.00	0.43
52	601233	桐昆股份	28,600	643,214.00	0.42
53	600688	上海石化	98,700	624,771.00	0.40
54	600755	厦门国贸	59,800	603,980.00	0.39
55	600079	人福医药	33,500	597,640.00	0.39
56	600352	浙江龙盛	49,300	577,303.00	0.37
57	000612	焦作万方	60,800	571,520.00	0.37
58	601225	陕西煤业	69,900	570,384.00	0.37
59	600380	健康元	50,800	568,452.00	0.37
60	600642	申能股份	94,000	550,840.00	0.36
61	600761	安徽合力	51,700	543,884.00	0.35
62	600633	浙数文化	34,300	521,360.00	0.34
63	600338	西藏珠峰	12,200	508,130.00	0.33
64	601888	中国国旅	11,700	507,663.00	0.33
65	600585	海螺水泥	16,700	489,811.00	0.32



66	000876	新希望	65,500	487,975.00	0.32
67	600270	外运发展	28,200	487,296.00	0.32
68	600894	广日股份	51,400	480,590.00	0.31
69	002152	广电运通	64,500	479,880.00	0.31
70	000501	鄂武商A	28,900	461,244.00	0.30
71	002195	二三四五	78,300	457,272.00	0.30
72	600757	长江传媒	52,800	366,960.00	0.24
73	600282	南钢股份	73,100	353,804.00	0.23
74	600312	平高电气	34,600	345,654.00	0.22
75	600053	九鼎投资	14,100	336,849.00	0.22
76	600628	新世界	32,400	329,508.00	0.21
77	600704	物产中大	47,000	320,540.00	0.21
78	000719	中原传媒	33,900	307,134.00	0.20
79	600177	雅戈尔	32,100	294,357.00	0.19
80	002477	雏鹰农牧	59,000	261,960.00	0.17
81	600025	华能水电	35,081	185,929.30	0.12
82	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.12
83	600801	华新水泥	11,200	158,256.00	0.10
84	002916	深南电路	552	48,150.96	0.03
85	300735	光弘科技	3,105	44,680.95	0.03
86	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02
87	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
88	603711	香飘飘	1,318	35,019.26	0.02
89	300730	科创信息	821	34,112.55	0.02
90	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.02
91	300676	华大基因	149	30,992.00	0.02
92	300731	科创新源	808	30,914.08	0.02
93	002893	华通热力	1,176	30,646.56	0.02
94	300729	乐歌股份	941	30,187.28	0.02
95	002898	赛隆药业	1,464	29,426.40	0.02
96	603917	合力科技	1,022	29,014.58	0.02
97	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.02
98	300727	润禾材料	870	28,701.30	0.02
99	603963	大理药业	999	28,531.44	0.02
100	300705	九典制药	1,073	28,048.22	0.02
101	601108	财通证券	1,507	27,698.66	0.02
102	603183	建研院	701	27,514.25	0.02
103	603386	广东骏亚	1,644	27,076.68	0.02
104	603500	祥和实业	1,004	25,953.40	0.02

105	300654	世纪天鸿	865	25,526.15	0.02
106	603725	天安新材	1,203	24,384.81	0.02
107	603813	原尚股份	741	22,682.01	0.01
108	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
109	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
110	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.01
111	603260	合盛硅业	331	18,780.94	0.01
112	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.01
113	002923	润都股份	954	16,227.54	0.01
114	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01
115	002701	奥瑞金	2,100	13,125.00	0.01
116	603466	风语筑	227	12,307.94	0.01
117	600903	贵州燃气	715	12,054.90	0.01
118	000488	晨鸣纸业	700	11,669.00	0.01
119	300684	中石科技	827	11,528.38	0.01
120	300699	光威复材	169	11,076.26	0.01
121	603619	中曼石油	299	10,399.22	0.01
122	603106	恒银金融	420	10,395.00	0.01
123	300723	一品红	281	10,082.28	0.01
124	603605	珀莱雅	347	9,965.84	0.01
125	002913	奥士康	193	9,258.21	0.01
126	300719	安达维尔	346	9,072.12	0.01
127	603367	辰欣药业	433	8,582.06	0.01
128	002918	蒙娜丽莎	152	8,466.40	0.01
129	603507	振江股份	199	7,999.80	0.01
130	300718	长盛轴承	185	7,449.95	0.00
131	300709	精研科技	102	7,377.66	0.00
132	603083	剑桥科技	144	6,809.76	0.00
133	002903	宇环数控	169	6,763.38	0.00
134	002911	佛燃股份	239	6,507.97	0.00
135	603278	大业股份	264	6,095.76	0.00
136	300675	建科院	213	6,008.73	0.00
137	603607	京华激光	134	5,453.80	0.00
138	601318	中国平安	73	5,108.54	0.00
139	603848	好太太	210	4,764.90	0.00
140	002906	华阳集团	210	4,729.20	0.00
141	603916	苏博特	274	4,701.84	0.00
142	603661	恒林股份	67	4,589.50	0.00
143	603856	东宏股份	223	4,587.11	0.00

144	600702	舍得酒业	98	4,572.68	0.00
145	300700	岱勒新材	70	4,543.00	0.00
146	603937	丽岛新材	172	4,513.28	0.00
147	601086	国芳集团	547	4,474.46	0.00
148	002907	华森制药	235	4,427.40	0.00
149	300711	广哈通信	160	4,302.40	0.00
150	300712	永福股份	173	4,283.48	0.00
151	603829	洛凯股份	234	4,230.72	0.00
152	603157	拉夏贝尔	235	4,180.65	0.00
153	603922	金鸿顺	136	3,812.08	0.00
154	300124	汇川技术	130	3,772.60	0.00
155	300708	聚灿光电	121	3,695.34	0.00
156	002910	庄园牧场	179	3,687.40	0.00
157	300678	中科信息	64	3,684.48	0.00
158	002897	意华股份	90	3,493.80	0.00
159	603277	银都股份	179	3,325.82	0.00
160	603055	台华新材	190	3,176.80	0.00
161	002900	哈三联	109	3,126.12	0.00
162	002901	大博医疗	83	3,112.50	0.00
163	002905	金逸影视	84	3,005.52	0.00
164	603722	阿科力	76	3,005.04	0.00
165	603365	水星家纺	129	2,981.19	0.00
166	002895	川恒股份	105	2,887.50	0.00
167	300726	宏达电子	98	2,832.20	0.00
168	600872	中炬高新	106	2,624.56	0.00
169	603683	晶华新材	126	2,620.80	0.00
170	603110	东方材料	96	2,541.12	0.00
171	000063	中兴通讯	68	2,472.48	0.00
172	002917	金奥博	72	2,354.40	0.00
173	603809	豪能股份	64	2,306.56	0.00
174	603378	亚士创能	96	2,196.48	0.00
175	603363	傲农生物	129	2,131.08	0.00
176	300697	电工合金	84	2,129.40	0.00
177	002908	德生科技	68	1,966.56	0.00
178	300014	亿纬锂能	96	1,882.56	0.00
179	300692	中环环保	41	1,763.00	0.00
180	603648	畅联股份	82	1,744.96	0.00
181	603882	金城医学	55	1,739.65	0.00
182	002899	英派斯	57	1,616.52	0.00

183	603321	梅轮电梯	133	1,596.00	0.00
184	300713	英可瑞	18	1,528.20	0.00
185	603127	昭衍新药	27	1,499.31	0.00
186	603499	翔港科技	60	1,485.00	0.00
187	600933	爱柯迪	90	1,383.30	0.00
188	002909	集泰股份	62	1,362.14	0.00
189	002864	盘龙药业	44	1,260.60	0.00
190	603970	中农立华	38	1,240.32	0.00
191	603890	春秋电子	29	1,221.77	0.00
192	600328	兰太实业	91	1,145.69	0.00
193	603912	佳力图	40	1,129.20	0.00
194	300702	天宇股份	27	1,109.70	0.00
195	002468	申通快递	42	1,036.98	0.00
196	300721	怡达股份	27	1,032.75	0.00
197	300716	国立科技	36	933.12	0.00
198	300603	立昂技术	22	791.56	0.00
199	603685	晨丰科技	19	668.04	0.00
200	002902	铭普光磁	15	637.80	0.00
201	300021	大禹节水	27	176.85	0.00
202	600110	诺德股份	1	9.44	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	24,597,475.00	15.92
2	601628	中国人寿	24,570,141.56	15.90
3	601336	新华保险	24,240,864.44	15.69
4	000686	东北证券	20,670,982.50	13.38
5	600089	特变电工	20,561,017.22	13.30
6	300021	大禹节水	20,532,176.42	13.29
7	000858	五粮液	20,450,310.54	13.23
8	600109	国金证券	20,246,534.36	13.10
9	600872	中炬高新	20,226,003.72	13.09
10	000786	北新建材	20,029,955.76	12.96
11	002108	沧州明珠	19,982,763.63	12.93
12	600801	华新水泥	19,975,202.00	12.92

13	600015	华夏银行	19,286,621.35	12.48
14	600392	盛和资源	19,088,977.00	12.35
15	000783	长江证券	18,951,578.31	12.26
16	600977	中国电影	18,800,394.04	12.16
17	600111	北方稀土	18,318,572.00	11.85
18	600104	上汽集团	18,296,637.99	11.84
19	600546	山煤国际	18,034,873.01	11.67
20	600068	葛洲坝	18,019,224.17	11.66
21	600999	招商证券	17,479,552.80	11.31
22	601555	东吴证券	17,319,628.16	11.21
23	601398	工商银行	17,140,816.83	11.09
24	601939	建设银行	16,722,500.00	10.82
25	002142	宁波银行	16,521,662.52	10.69
26	600702	舍得酒业	16,485,323.00	10.67
27	600259	广晟有色	15,378,460.50	9.95
28	601699	潞安环能	14,852,349.43	9.61
29	601888	中国国旅	14,124,711.25	9.14
30	000968	蓝焰控股	14,095,431.00	9.12
31	002074	国轩高科	13,983,517.20	9.05
32	600029	南方航空	13,551,666.00	8.77
33	600030	中信证券	13,100,247.00	8.48
34	300588	熙菱信息	13,036,399.39	8.44
35	300070	碧水源	12,205,007.20	7.90
36	603366	日出东方	11,809,138.97	7.64
37	000001	平安银行	11,637,678.21	7.53
38	600066	宇通客车	11,476,199.13	7.43
39	000822	山东海化	11,349,610.40	7.34
40	300197	铁汉生态	11,291,495.66	7.31
41	000513	丽珠集团	11,282,775.20	7.30
42	600418	江淮汽车	10,855,896.00	7.02
43	601601	中国太保	10,779,185.36	6.97
44	300073	当升科技	10,721,305.27	6.94
45	002456	欧菲科技	10,490,070.40	6.79
46	000895	双汇发展	10,280,180.11	6.65
47	300098	高新兴	10,165,540.19	6.58
48	002341	新纶科技	9,980,262.44	6.46

49	603338	浙江鼎力	9,714,651.50	6.29
50	300124	汇川技术	9,710,018.34	6.28
51	000970	中科三环	9,652,581.00	6.25
52	601127	小康股份	9,582,049.53	6.20
53	300102	乾照光电	8,770,944.00	5.68
54	600258	首旅酒店	8,545,016.52	5.53
55	600110	诺德股份	8,450,182.29	5.47
56	300456	耐威科技	8,404,912.00	5.44
57	000888	峨眉山 A	8,165,647.00	5.28
58	600325	华发股份	7,700,140.29	4.98
59	600835	上海机电	7,463,438.75	4.83
60	000768	中航飞机	7,455,205.00	4.82
61	002386	天原集团	7,215,423.00	4.67
62	601225	陕西煤业	7,056,141.00	4.57
63	600808	马钢股份	6,958,508.00	4.50
64	601818	光大银行	6,846,032.00	4.43
65	600075	新疆天业	6,733,689.00	4.36
66	601318	中国平安	6,653,055.69	4.30
67	600629	华建集团	6,642,597.64	4.30
68	300323	华灿光电	6,590,745.00	4.26
69	600138	中青旅	6,408,822.08	4.15
70	600816	安信信托	6,404,984.44	4.14
71	601009	南京银行	6,395,640.00	4.14
72	000002	万科 A	6,241,532.21	4.04
73	600507	方大特钢	6,176,949.40	4.00
74	300424	航新科技	6,126,204.06	3.96
75	002449	国星光电	6,056,197.00	3.92
76	000538	云南白药	6,017,279.00	3.89
77	000823	超声电子	6,011,718.80	3.89
78	600160	巨化股份	5,914,752.00	3.83
79	002583	海能达	5,905,753.00	3.82
80	601985	中国核电	5,800,000.00	3.75
81	300296	利亚德	5,775,332.27	3.74
82	600036	招商银行	5,736,510.17	3.71
83	000709	河钢股份	5,732,241.70	3.71
84	300055	万邦达	5,667,646.44	3.67

85	600188	兖州煤业	5,667,295.09	3.67
86	000022	深赤湾A	5,635,983.64	3.65
87	000999	华润三九	5,592,669.06	3.62
88	600643	爱建集团	5,577,812.39	3.61
89	300462	华铭智能	5,413,509.00	3.50
90	000429	粤高速A	5,383,870.00	3.48
91	600390	五矿资本	5,380,691.00	3.48
92	600420	现代制药	5,320,804.98	3.44
93	002510	天汽模	5,309,359.00	3.44
94	600569	安阳钢铁	5,240,181.00	3.39
95	002365	永安药业	5,210,489.00	3.37
96	000063	中兴通讯	5,186,981.04	3.36
97	002850	科达利	5,129,760.00	3.32
98	001979	招商蛇口	5,106,128.00	3.30
99	002236	大华股份	5,068,179.72	3.28
100	002311	海大集团	5,004,865.65	3.24
101	002352	顺丰控股	4,988,538.00	3.23
102	300498	温氏股份	4,973,494.96	3.22
103	600328	兰太实业	4,960,141.94	3.21
104	601636	旗滨集团	4,959,776.00	3.21
105	300255	常山药业	4,928,315.00	3.19
106	600782	新钢股份	4,919,722.00	3.18
107	300450	先导智能	4,865,823.00	3.15
108	600270	外运发展	4,823,110.25	3.12
109	000625	长安汽车	4,765,481.00	3.08
110	603868	飞科电器	4,752,129.36	3.07
111	300014	亿纬锂能	4,625,601.40	2.99
112	600009	上海机场	4,589,785.57	2.97
113	600132	重庆啤酒	4,577,558.00	2.96
114	603355	莱克电气	4,565,064.44	2.95
115	002450	康得新	4,552,580.50	2.95
116	002332	仙琚制药	4,541,592.00	2.94
117	300294	博雅生物	4,536,475.50	2.94
118	600971	恒源煤电	4,513,094.85	2.92
119	600809	山西汾酒	4,502,180.94	2.91
120	000661	长春高新	4,500,386.57	2.91

121	002242	九阳股份	4,480,168.81	2.90
122	300401	花园生物	4,458,847.00	2.89
123	000997	新大陆	4,452,758.32	2.88
124	000826	启迪桑德	4,452,221.00	2.88
125	601238	广汽集团	4,441,828.05	2.87
126	002060	粤水电	4,434,096.03	2.87
127	002543	万和电气	4,428,154.00	2.87
128	300371	汇中股份	4,426,210.00	2.86
129	000651	格力电器	4,421,505.00	2.86
130	600000	浦发银行	4,417,646.00	2.86
131	002821	凯莱英	4,414,013.00	2.86
132	600637	东方明珠	4,411,883.23	2.85
133	002468	申通快递	4,400,116.36	2.85
134	300383	光环新网	4,394,019.24	2.84
135	300178	腾邦国际	4,390,250.03	2.84
136	603686	龙马环卫	4,366,665.50	2.83
137	002616	长青集团	4,357,738.00	2.82
138	000915	山大华特	4,345,564.08	2.81
139	300603	立昂技术	4,335,871.00	2.81
140	300316	晶盛机电	4,331,680.00	2.80
141	600233	圆通速递	4,258,104.00	2.76
142	300279	和晶科技	4,223,429.37	2.73
143	002747	埃斯顿	4,214,379.00	2.73
144	600771	广誉远	4,203,142.30	2.72
145	600198	大唐电信	4,192,620.90	2.71
146	002690	美亚光电	4,057,975.02	2.63
147	000932	华菱钢铁	3,655,015.00	2.36
148	600754	锦江股份	3,460,750.00	2.24
149	002410	广联达	3,458,412.77	2.24

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000786	北新建材	26,591,881.96	17.21
2	600872	中炬高新	24,251,191.62	15.69
3	600392	盛和资源	24,118,572.50	15.61



4	601166	兴业银行	23,505,563.00	15.21
5	600801	华新水泥	21,258,612.95	13.76
6	000686	东北证券	20,307,074.82	13.14
7	002108	沧州明珠	20,051,318.32	12.97
8	600702	舍得酒业	19,835,675.37	12.83
9	600015	华夏银行	19,510,439.20	12.62
10	600089	特变电工	19,277,787.89	12.47
11	000783	长江证券	18,810,095.64	12.17
12	000858	五粮液	18,676,591.00	12.08
13	601628	中国人寿	18,656,997.50	12.07
14	300021	大禹节水	17,653,270.79	11.42
15	600999	招商证券	17,494,652.00	11.32
16	600104	上汽集团	17,349,154.58	11.23
17	600109	国金证券	17,211,482.36	11.14
18	601555	东吴证券	17,147,755.00	11.10
19	600546	山煤国际	16,742,680.26	10.83
20	600111	北方稀土	16,723,204.96	10.82
21	600977	中国电影	16,084,646.94	10.41
22	600259	广晟有色	15,907,893.45	10.29
23	600068	葛洲坝	15,646,464.07	10.12
24	601888	中国国旅	15,382,370.62	9.95
25	601699	潞安环能	14,760,309.00	9.55
26	601336	新华保险	13,910,936.80	9.00
27	601601	中国太保	13,778,867.00	8.92
28	002341	新纶科技	13,442,167.64	8.70
29	600030	中信证券	13,242,091.11	8.57
30	600029	南方航空	12,770,174.00	8.26
31	601398	工商银行	12,476,039.00	8.07
32	600066	宇通客车	12,433,308.16	8.04
33	002074	国轩高科	12,412,915.13	8.03
34	000822	山东海化	12,014,392.75	7.77
35	601939	建设银行	11,622,195.80	7.52
36	002142	宁波银行	11,423,581.84	7.39
37	002456	欧菲科技	11,399,719.26	7.38
38	300070	碧水源	11,178,371.69	7.23
39	300124	汇川技术	11,031,321.60	7.14
40	000001	平安银行	10,964,080.13	7.09
41	000063	中兴通讯	10,546,088.16	6.82

42	000513	丽珠集团	10,481,800.85	6.78
43	600418	江淮汽车	10,468,813.00	6.77
44	300197	铁汉生态	10,409,501.00	6.74
45	300588	熙菱信息	9,900,178.10	6.41
46	603366	日出东方	9,566,022.26	6.19
47	300073	当升科技	9,521,033.80	6.16
48	601318	中国平安	9,138,119.00	5.91
49	603338	浙江鼎力	9,056,641.95	5.86
50	300102	乾照光电	9,055,267.00	5.86
51	000709	河钢股份	9,000,000.00	5.82
52	601127	小康股份	8,514,883.26	5.51
53	000970	中科三环	8,496,163.00	5.50
54	600110	诺德股份	8,293,911.93	5.37
55	600258	首旅酒店	7,923,593.63	5.13
56	300450	先导智能	7,849,780.00	5.08
57	601225	陕西煤业	7,823,823.00	5.06
58	002365	永安药业	7,731,798.00	5.00
59	002386	天原集团	7,709,248.20	4.99
60	000888	峨眉山 A	7,628,380.00	4.94
61	600075	新疆天业	7,433,915.99	4.81
62	600325	华发股份	7,350,628.45	4.76
63	300456	耐威科技	7,340,966.00	4.75
64	000768	中航飞机	7,149,418.00	4.63
65	300014	亿纬锂能	7,002,127.78	4.53
66	300323	华灿光电	6,932,229.00	4.49
67	600971	恒源煤电	6,894,030.68	4.46
68	600808	马钢股份	6,793,363.50	4.40
69	600188	兖州煤业	6,430,276.00	4.16
70	600036	招商银行	6,365,516.20	4.12
71	601818	光大银行	6,313,760.00	4.09
72	002236	大华股份	6,299,804.00	4.08
73	000661	长春高新	6,197,241.50	4.01
74	002449	国星光电	6,127,986.32	3.97
75	600835	上海机电	6,096,895.90	3.94
76	601985	中国核电	6,090,841.00	3.94
77	600816	安信信托	6,079,130.05	3.93
78	600160	巨化股份	6,024,860.40	3.90
79	601009	南京银行	5,971,572.91	3.86

80	600138	中青旅	5,930,148.63	3.84
81	000538	云南白药	5,920,470.00	3.83
82	600507	方大特钢	5,757,893.00	3.73
83	600643	爱建集团	5,744,128.20	3.72
84	002583	海能达	5,743,970.00	3.72
85	000002	万科A	5,728,744.36	3.71
86	000999	华润三九	5,577,415.02	3.61
87	300296	利亚德	5,558,955.00	3.60
88	000823	超声电子	5,531,117.00	3.58
89	600629	华建集团	5,442,468.00	3.52
90	002850	科达利	5,438,732.00	3.52
91	000895	双汇发展	5,431,623.00	3.51
92	000022	深赤湾A	5,425,464.78	3.51
93	300055	万邦达	5,377,324.00	3.48
94	300462	华铭智能	5,275,474.00	3.41
95	001979	招商蛇口	5,172,937.00	3.35
96	600420	现代制药	5,167,545.64	3.34
97	601636	旗滨集团	5,145,393.00	3.33
98	002311	海大集团	5,127,035.82	3.32
99	000997	新大陆	5,066,302.44	3.28
100	300424	航新科技	5,042,326.64	3.26
101	600569	安阳钢铁	5,036,596.00	3.26
102	000429	粤高速A	4,994,855.00	3.23
103	002510	天汽模	4,902,228.00	3.17
104	002352	顺丰控股	4,861,942.00	3.15
105	300498	温氏股份	4,765,215.52	3.08
106	300316	晶盛机电	4,709,236.00	3.05
107	300098	高新兴	4,675,951.50	3.03
108	600000	浦发银行	4,640,442.00	3.00
109	603868	飞科电器	4,638,274.27	3.00
110	600009	上海机场	4,591,020.43	2.97
111	600132	重庆啤酒	4,546,827.56	2.94
112	600328	兰太实业	4,521,404.00	2.93
113	300255	常山药业	4,513,184.00	2.92
114	002468	申通快递	4,500,270.74	2.91
115	300401	花园生物	4,499,665.02	2.91
116	600782	新钢股份	4,452,000.00	2.88
117	300294	博雅生物	4,450,315.50	2.88

118	002332	仙琚制药	4,437,746.00	2.87
119	600270	外运发展	4,357,971.50	2.82
120	300178	腾邦国际	4,328,135.20	2.80
121	600637	东方明珠	4,300,204.77	2.78
122	000826	启迪桑德	4,270,848.00	2.76
123	002242	九阳股份	4,231,844.00	2.74
124	000625	长安汽车	4,213,767.73	2.73
125	002060	粤水电	4,184,681.00	2.71
126	603686	龙马环卫	4,180,425.13	2.70
127	600809	山西汾酒	4,167,472.25	2.70
128	002450	康得新	4,154,511.44	2.69
129	601238	广汽集团	4,150,138.45	2.69
130	600233	圆通速递	4,137,683.55	2.68
131	600390	五矿资本	4,119,871.07	2.67
132	603355	莱克电气	4,106,240.14	2.66
133	300371	汇中股份	4,094,324.00	2.65
134	002616	长青集团	4,091,475.00	2.65
135	002821	凯莱英	4,020,605.00	2.60
136	000915	山大华特	4,017,330.39	2.60
137	300383	光环新网	3,984,534.88	2.58
138	002747	埃斯顿	3,980,460.00	2.58
139	600771	广誉远	3,977,666.02	2.57
140	300279	和晶科技	3,882,025.85	2.51
141	002543	万和电气	3,719,452.00	2.41
142	600198	大唐电信	3,622,622.99	2.34
143	600754	锦江股份	3,393,308.00	2.20
144	000932	华菱钢铁	3,292,480.00	2.13
145	300603	立昂技术	3,170,063.06	2.05

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,405,794,337.74
卖出股票收入（成交）总额	1,297,014,957.21

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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

1	国家债券	8,548,016.00	5.53
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）	690,100.00	0.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,238,116.00	5.98

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019557	17 国债 03	85,600	8,548,016.00	5.53
2	128024	宁行转债	6,901	690,100.00	0.45

注：本基金本报告期末仅持有上述两只债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	233,186.38
2	应收证券清算款	219,231.85
3	应收股利	-
4	应收利息	214,677.27
5	应收申购款	197,575.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	864,671.47

### 8.12.4 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处于转股期的可转换债券（可交换债券）。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2,660	53,337.81	993,323.49	0.70%	140,885,251.14	99.30%

### 9.2 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	168,113.52	0.1185%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2017年2月22日）基金份额总额	747,266,452.70
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	10,252,742.47
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	615,640,620.54
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	141,878,574.63



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

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。

根据公司 2017 年第一次临时股东会议决议，同意张良庆先生不再担任公司第七届董事会独立董事职务，选举朱慈蕴女士担任公司第七届董事会独立董事。以上独立董事人员变更，已于 2018 年 1 月 9 日向中国证监会北京监管局报备。

#### 11.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

**11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	2	1,193,249,572.58	44.22%	872,627.12	39.39%	-
国金证券	2	1,077,701,433.48	39.93%	1,003,655.65	45.30%	-
长江证券	2	169,831,832.25	6.29%	124,199.26	5.61%	-
平安证券	1	132,269,444.07	4.90%	123,183.17	5.56%	-
恒泰证券	1	125,592,067.79	4.65%	91,846.04	4.15%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例
东兴证券	25,626,845.04	85.13%	-	-	-	-
国金证券	1,168,515.00	3.88%	1,900,000,000.00	90.48%	-	-
长江证券	3,308,847.78	10.99%	-	-	-	-
平安证券	-	-	200,000,000.00	9.52%	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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：无。

## 11.8 其他重大事件

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

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于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	《中国证券报》及本公司网站	2017年12月30日
2	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行基金交易优惠活动的公告	同上	2017年12月27日
3	长盛基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司销售旗下部分基金并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2017年11月25日

4	长盛基金管理有限公司关于撤销杭州分公司的公告	同上	2017年11月17日
5	长盛基金管理有限公司关于增加国元证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	同上	2017年11月3日
6	长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	同上	2017年10月27日
7	长盛基金管理有限公司关于增加挖财金融为旗下部分基金销售机构并推出定投业务和参加费率优惠活动的公告	同上	2017年10月20日
8	长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2017年9月26日
9	长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2017年9月26日
10	长盛基金管理有限公司关于部分代销机构开通旗下部分基金转换业务的公告	同上	2017年9月14日
11	长盛基金管理有限公司关于旗下基金在上海大智慧财富管理有限公司开通定投业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2017年9月12日
12	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加和讯信息为销售机构并推出转换的公告	同上	2017年8月31日
13	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中泰证券申购（含定投）费率优惠活动的公告	同上	2017年8月29日
14	长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告	同上	2017年8月24日
15	长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告 摘要	同上	2017年8月24日

16	长盛基金管理有限公司关于增加金惠家为旗下部分基金销售机构并推出定投和转换业务及参加手续费率优惠活动的公告	同上	2017 年 8 月 11 日
17	长盛基金管理有限公司关于降低旗下开放式基金申购、定期定额申购业务单笔最低金额要求的公告	同上	2017 年 7 月 27 日
18	长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	同上	2017 年 7 月 19 日
19	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行网上银行渠道基金申购投资手续费率优惠活动的公告	同上	2017 年 7 月 4 日
20	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 7 月 1 日
21	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	同上	2017 年 6 月 29 日
22	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
23	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
24	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
25	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	同上	2017 年 4 月 1 日

	申购优惠活动的公告		
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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
31	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
32	长盛基金管理有限公司关于旗下长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金中国农业银行基金费率优惠活动的公告	同上	2017年3月13日
33	长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购 赎回 转换及定期定额投资业务的公告	同上	2017年3月3日
34	长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	同上	2017年2月23日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 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。



## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 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。

### 13.3 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

2018年3月31日