

长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证 券投资基金 2017 年年度报告摘要

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------|
| 基金简称 | 长盛沪港深混合 |
| 基金主代码 | 002732 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 7 月 5 日 |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 50,015,206.38 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 通过把握国内宏观经济政策和市场发展趋势，深入发掘 A 股和港股两个市场上的高成长上市公司，全面把握中国经济的投资机会。 |
| 投资策略 | <p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑：（1）宏观经济指标；（2）微观经济指标；（3）市场指标；（4）政策因素。</p> <p>本基金将通过深入分析上述指标与因素，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>本基金将适时调整国内 A 股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例及投资策略，主要依据包括但不限于宏观经济因素、政策因素、两地估值折溢价因素、资金利差、市场情绪以及流动性趋势等。</p> <p>1、A 股投资策略</p> <p>在 A 股投资方面，本基金主要突出“自下而上”的个股精选策略，通过定性分析和定量分析相结合的办法，挑选具备较大投资价值的上市公司。</p> <p>2、港股通标的的股票投资策略</p> <p>在对 AH 股溢价水平进行重点分析和趋势预测的前提下，本基金管理人将优选香港市场与国内 A 股在部分行业形成有效互补的行业和上市公司。</p> <p>最后，本基金将利用两地市场在估值水平、投资者群体结构、交易规则等方面的差异，通过估值套利、事件套利等多重策略获取收益。</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向，综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券投资组合。在实际的投资运作中，本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略，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×30%+恒生综合指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×40% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中等风险收益特征的基金品种。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|---------------------------|----------------------|
| 名称 | | 长盛基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 叶金松 | 田青 |
| | 联系电话 | 010-82019988 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | yejs@csfunds.com.cn | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-2666、010-62350088 | 010-67595096 |
| 传真 | | 010-82255988 | 010-66275853 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.csfunds.com.cn |
| 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 |

§ 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 | 2016 年 7 月 5 日(基金合同生效日) -2016 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------|--|
| 本期已实现收益 | 4,516,425.16 | -1,076,965.83 |
| 本期利润 | 6,921,100.52 | -1,867,391.63 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1867 | -0.0141 |
| 本期基金份额净值增长率 | 20.64% | -3.60% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末 | 2016 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1434 | -0.0363 |
| 期末基金资产净值 | 58,182,270.20 | 53,581,608.06 |
| 期末基金份额净值 | 1.163 | 0.964 |

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。

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 | 0.09% | 0.79% | 3.74% | 0.45% | -3.65% | 0.34% |
| 过去六个月 | 5.15% | 0.68% | 8.12% | 0.40% | -2.97% | 0.28% |
| 过去一年 | 20.64% | 0.63% | 17.27% | 0.36% | 3.37% | 0.27% |
| 自基金合同生效起至今 | 16.30% | 0.55% | 20.55% | 0.38% | -4.25% | 0.17% |

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

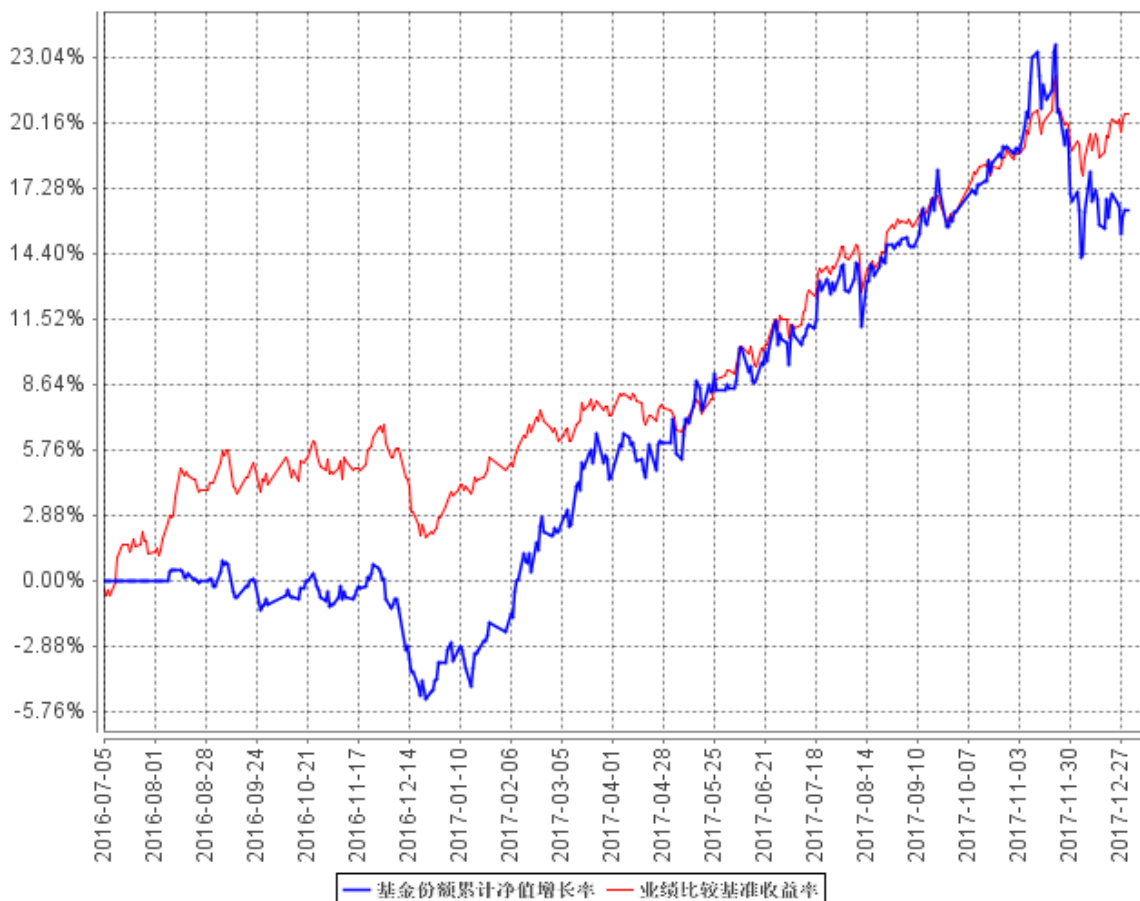
本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×40%

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沪深股票组合以及港股通的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金沪深股票组合的业绩基准；恒生综合指数作为本基金港股通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，由上海和深圳证券交易所中选取 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。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数；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%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 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 40%、30%、30%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

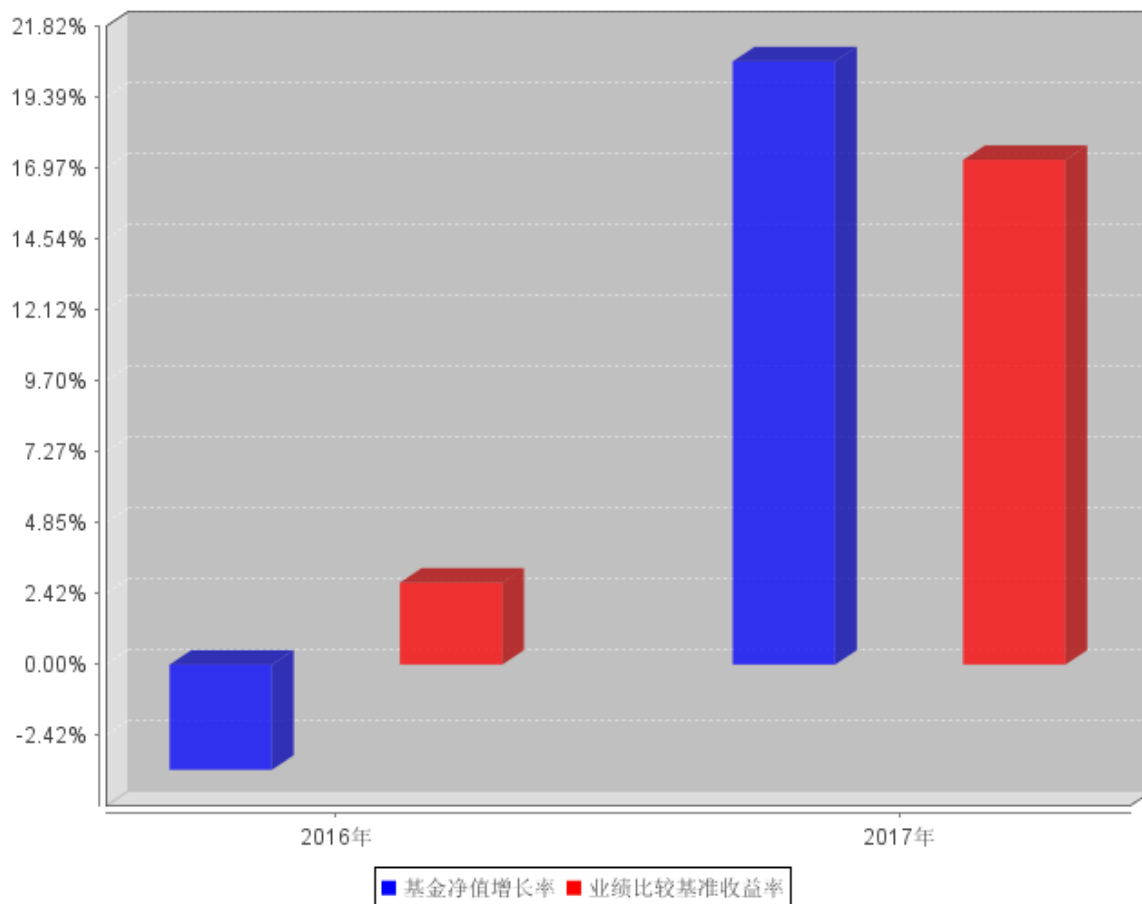
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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。

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：本基金合同生效日为 2016 年 7 月 5 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 年度、2016 年 7 月 5 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日未进行利润分配。

§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 | | |
| 吴达 | 本基金基金经理，长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理，国际业务部总监，长盛基金（香港）有限公司副总经理，长盛创富资产管理有限公司董事。 | 2016 年 7 月 5 日 | - | 15 年 | 吴达先生，1979 年 8 月出生。伦敦政治经济学院金融经济学硕士，CFA（特许金融分析师）。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊瑚全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理，专户投资组合经理；新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理，资产配置委员会成员；华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理；2007 年 8 月起加入长盛基金管理有限公司，曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。 |

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

2017 年中国经济增长好于预期目标。前三季度，中国 GDP 同比增长 6.9%，比全年预期目标高 0.4 个百分点左右。其中，三季度经济增长 6.8%，连续 9 个季度运行在 6.7%—6.9% 的区间。四季度中国经济如期有所放缓，但供给侧改革的效应继续发挥，从 PMI 指数显示的水平看大企业优于中、小型企业。海外主要经济体增长良好，体现为国内新出口订单指数创年内新高，短期内出口景气或仍维持高位。综合考虑先行指标的小幅回落，国内经济增长整体上存在支撑，短期风险不大。

年底召开的中央经济工作会议延续了十九大会议的精神，强调对经济增长质量的看重，对经济的整体信心增强。在稳中求进的基调下，预计整体经济保持平稳。财政政策维持积极，调整优化财政支出结构，有保有压，确保对重点领域和项目的支持力度，压缩一般性支出，切实加强地方政府债务管理。货币政策维持稳健中性不变。

国际货币金融条件方面，美联储 12 月例会加息，符合市场预期，后续在等待新任美联储主席上任的过程中，整体上全球货币收紧的态势预计将维持，但会比较温和。国内货币政策继续稳健，金融去杠杆的推进导致 M2 增速继续下滑。

期内国内市场与港股市场均表现为结构化向上市场行情，沪港深优势精选基金全年在沪深股市与港股市场均衡布局，并根据两地市场的相对交易量与估值动态调整，主要配置了制造业，金融环保，科技、电子等板块，全年取得了较好回报。

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 1.163 元；本报告期基金份额净值增长率为 20.64%，业绩比较基准收益率为 17.27%。

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 2018 年，特朗普税改方案已经成功通过国会审议并签署，预计对美国经济有一定的提振作用，对全球股票市场信心与风险偏好度的影响偏正面。然而，美元汇率的走势相对不明朗，源于经济向上、货币收紧的正向作用与减税带来的财政压力并存，人民币汇率在此背景下相对贬值压力不大，趋于区间波动。

经历过去一年半的周期复苏后，企业杠杆压力有所减轻，预计国内经济在制造业投资回暖的

背景下维持稳健增长。从上市公司角度看，上一年度业绩表现较好的多属于价格敏感型中上游周期性行业，随着涨价趋势接近尾声，今年国内上市公司的盈利增速预计表现为稳中有降，上、中、下游之间利润分配更趋均衡。

国内金融去杠杆与债务化解持续进行中，本年 6 月 A 股将正式纳入 MSCI 新兴市场指数，人民币汇率保持相对稳定，这些因素预计将进一步提升海外投资者参与中国资本市场的信心与规模。同时，境内机构持续南下参与香港股票市场是长期趋势，在此背景下两地市场追寻价值与成长性兼备标的结构性行情大概率继续演绎。在两地市场整体估值在过去一年已经恢复到平均水平的环境下，主要的机会可能来自于主要权重板块龙头公司市占率与盈利能力强化带来的机会，包括金融、消费、科技等行业。

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

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金本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 7,171,072.30 元，其中：未分配利润已实现部分为 7,171,072.30 元，未分配利润未实现部分为 995,991.52 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

本基金自 2017 年 2 月 17 日至 2017 年 4 月 27 日、自 2017 年 5 月 3 日至 2017 年 7 月 10 日、自 2017 年 7 月 17 日至 2017 年 9 月 26 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§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，中国建设银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛沪港深优势精选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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师薛竞、顾卓毅于 2018 年 3 月 27 日对本基金 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年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出具了普华永道中天审字(2018)第 22091 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛沪港深优势精选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 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6,322,222.92 | 6,739,050.65 |
| 结算备付金 | 1,911,089.46 | 1,944,524.09 |
| 存出保证金 | 141,016.37 | 164,502.43 |
| 交易性金融资产 | 43,583,228.87 | 38,851,831.60 |
| 其中：股票投资 | 43,583,228.87 | 38,851,831.60 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | - | - |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 10,000,000.00 | 8,000,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | -637.18 | 2,309.66 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 19,330.79 | 49,261.08 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 61,976,251.23 | 55,751,479.51 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 | 上年度末 |
| | 2017 年 12 月 31 日 | 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 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | 3,490,667.19 | 1,849,105.93 |
| 应付赎回款 | 9,203.36 | 111,817.38 |
| 应付管理人报酬 | 74,614.19 | 70,074.35 |
| 应付托管费 | 12,435.70 | 11,679.04 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 67,047.65 | 39,425.82 |
| 应交税费 | - | - |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 140,012.94 | 87,768.93 |
| 负债合计 | 3,793,981.03 | 2,169,871.45 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 50,015,206.38 | 55,599,317.22 |
| 未分配利润 | 8,167,063.82 | -2,017,709.16 |
| 所有者权益合计 | 58,182,270.20 | 53,581,608.06 |
| 负债和所有者权益总计 | 61,976,251.23 | 55,751,479.51 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.163 元，基金份额总额 50,015,206.38 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 7 月 5 日(基金合 同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|------------------------|---|---|
| 一、收入 | 8,187,085.65 | -464,163.09 |
| 1. 利息收入 | 138,078.10 | 1,143,034.17 |
| 其中：存款利息收入 | 101,550.06 | 126,800.41 |
| 债券利息收入 | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 36,528.04 | 1,016,233.76 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 4,663,940.91 | -1,773,926.30 |
| 其中：股票投资收益 | 4,460,463.40 | -1,832,315.07 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 203,477.51 | 58,388.77 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 2,404,675.36 | -790,425.80 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 980,391.28 | 957,154.84 |
| 减：二、费用 | 1,265,985.13 | 1,403,228.54 |

| | | |
|----------------------------|---------------------|----------------------|
| 1. 管理人报酬 | 618,423.60 | 944,782.98 |
| 2. 托管费 | 103,070.64 | 157,463.77 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 396,471.27 | 206,806.64 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 148,019.62 | 94,175.15 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 6,921,100.52 | -1,867,391.63 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 6,921,100.52 | -1,867,391.63 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 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、期初所有者权益（基金净值） | 55,599,317.22 | -2,017,709.16 | 53,581,608.06 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 6,921,100.52 | 6,921,100.52 |
| 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） | -5,584,110.84 | 3,263,672.46 | -2,320,438.38 |
| 其中：1. 基金申购款 | 135,353,829.79 | 17,597,295.55 | 152,951,125.34 |
| 2. 基金赎回款 | -140,937,940.63 | -14,333,623.09 | -155,271,563.72 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 50,015,206.38 | 8,167,063.82 | 58,182,270.20 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 | | |

管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛沪港深优势精选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)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金将基金资产的 0-95%投资于股票资产(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的 0-95%)，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×40%。

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》、《长盛沪港深优势精选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 年度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 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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[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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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) 对于内地投资者持有的基金类别，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。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

7.4.7 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 |
| 中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2016 年 7 月 5 日(基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 618,423.60 | 944,782.98 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 193,188.65 | 270,573.94 |

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 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 X 1.50% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------------------|---|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 103,070.64 | 157,463.77 |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|--------|----------------------------------|-----------|---|-----------|
| | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | | 2016 年 7 月 5 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 6,322,222.92 | 91,276.06 | 6,739,050.65 | 91,357.56 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.10 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 43,583,228.87 元，无属于第二层次以及第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 38,851,831.60 元，无属于第二层次以及第三层次的余额)。

(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(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)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 | 43,583,228.87 | 70.32 |
| | 其中：股票 | 43,583,228.87 | 70.32 |
| 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 | 10,000,000.00 | 16.14 |
| | 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 | 8,233,312.38 | 13.28 |
| 8 | 其他各项资产 | 159,709.98 | 0.26 |
| 9 | 合计 | 61,976,251.23 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 10,010,200.00 | 17.20 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 322,900.00 | 0.55 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 744,000.00 | 1.28 |
| J | 金融业 | 2,659,240.00 | 4.57 |
| K | 房地产业 | 631,500.00 | 1.09 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 14,367,840.00 | 24.69 |

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|---------------|--------------|
| 能源 | - | 0.00 |
| 原材料 | - | 0.00 |
| 工业 | 662,876.63 | 1.14 |
| 非日常生活消费品 | 3,229,120.33 | 5.55 |
| 日常消费品 | - | 0.00 |
| 医疗保健 | 1,666,804.54 | 2.86 |
| 金融 | 12,273,582.94 | 21.10 |
| 信息技术 | 6,444,197.37 | 11.08 |
| 电信业务 | - | 0.00 |
| 公用事业 | 2,970,239.01 | 5.11 |
| 房地产 | 1,968,568.05 | 3.38 |
| 合计 | 29,215,388.87 | 50.21 |

8.3 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

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 | 2601 HK | 中国太保 | 100,000 | 3,138,842.05 | 5.39 |
| 2 | 1288 HK | 农业银行 | 1,000,000 | 3,042,712.40 | 5.23 |
| 3 | 1336 HK | 新华保险 | 66,000 | 2,946,081.20 | 5.06 |
| 4 | 0700 HK | 腾讯控股 | 8,000 | 2,715,035.68 | 4.67 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 38,000 | 2,659,240.00 | 4.57 |
| 6 | 1398 HK | 工商银行 | 450,000 | 2,366,043.26 | 4.07 |
| 7 | 600703 | 三安光电 | 90,000 | 2,285,100.00 | 3.93 |
| 8 | 0884 HK | 旭辉控股集团 | 500,000 | 1,968,568.05 | 3.38 |
| 9 | 0371 HK | 北控水务集团 | 330,000 | 1,668,894.32 | 2.87 |
| 10 | 2018 HK | 瑞声科技 | 13,000 | 1,514,836.10 | 2.60 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.csfunds.com.cn> 网站的年度报告正文。

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 | 1398 HK | 工商银行 | 4,478,853.99 | 8.36 |
| 2 | 1336 HK | 新华保险 | 4,163,157.72 | 7.77 |
| 3 | 2601 HK | 中国太保 | 3,701,056.70 | 6.91 |
| 4 | 1288 HK | 农业银行 | 3,699,740.03 | 6.90 |
| 5 | 0916 HK | 龙源电力 | 2,932,186.80 | 5.47 |
| 6 | 2018 HK | 瑞声科技 | 2,461,448.68 | 4.59 |
| 7 | 0700 HK | 腾讯控股 | 2,259,967.32 | 4.22 |
| 8 | 0522 HK | ASM PACIFIC | 2,192,334.14 | 4.09 |
| 9 | 000915 | 山大华特 | 2,159,264.18 | 4.03 |
| 10 | 2238 HK | 广汽集团 | 2,066,116.23 | 3.86 |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 1,993,745.04 | 3.72 |
| 12 | 0884 HK | 旭辉控股集团 | 1,954,287.50 | 3.65 |
| 13 | 000049 | 德赛电池 | 1,919,828.00 | 3.58 |
| 14 | 600703 | 三安光电 | 1,655,431.00 | 3.09 |
| 15 | 0371 HK | 北控水务集团 | 1,580,149.35 | 2.95 |
| 16 | 000895 | 双汇发展 | 1,558,430.00 | 2.91 |
| 17 | 3888 HK | 金山软件 | 1,547,485.82 | 2.89 |
| 18 | 1293 HK | 广汇宝信 | 1,512,124.20 | 2.82 |
| 19 | 601965 | 中国汽研 | 1,438,447.50 | 2.68 |
| 20 | 000651 | 格力电器 | 1,380,869.00 | 2.58 |
| 21 | 1114 HK | BRILLIANCE CHI | 1,365,516.97 | 2.55 |
| 22 | 0966 HK | 中国太平 | 1,330,634.33 | 2.48 |
| 23 | 0285 HK | 比亚迪电子 | 1,280,626.93 | 2.39 |
| 24 | 2628 HK | 中国人寿 | 1,253,208.96 | 2.34 |
| 25 | 601398 | 工商银行 | 1,239,724.00 | 2.31 |
| 26 | 600585 | 海螺水泥 | 1,222,151.00 | 2.28 |
| 27 | 1171 HK | 兖州煤业股份 | 1,178,302.37 | 2.20 |
| 28 | 0257 HK | 中国光大国际 | 1,152,560.37 | 2.15 |
| 29 | 1093 HK | 石药集团 | 1,099,286.22 | 2.05 |

8.4.2 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 | 002475 | 立讯精密 | 3,141,733.16 | 5.86 |

| | | | | |
|----|---------|--------|--------------|------|
| 2 | 0966 HK | 中国太平 | 3,034,001.30 | 5.66 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 2,572,254.50 | 4.80 |
| 4 | 0371 HK | 北控水务集团 | 2,328,247.36 | 4.35 |
| 5 | 1398 HK | 工商银行 | 2,136,707.96 | 3.99 |
| 6 | 1530 HK | 中国中药 | 1,972,651.32 | 3.68 |
| 7 | 601965 | 中国汽研 | 1,968,538.50 | 3.67 |
| 8 | 2238 HK | 广汽集团 | 1,892,805.34 | 3.53 |
| 9 | 3968 HK | 招商银行 | 1,867,305.28 | 3.48 |
| 10 | 000049 | 德赛电池 | 1,712,919.00 | 3.20 |
| 11 | 0570 HK | 三生制药 | 1,611,922.43 | 3.01 |
| 12 | 0998 HK | 中信银行 | 1,602,253.63 | 2.99 |
| 13 | 2018 HK | 瑞声科技 | 1,596,697.30 | 2.98 |
| 14 | 0916 HK | 龙源电力 | 1,561,416.78 | 2.91 |
| 15 | 6818 HK | 中国光大银行 | 1,554,625.56 | 2.90 |
| 16 | 600068 | 葛洲坝 | 1,544,100.00 | 2.88 |
| 17 | 600195 | 中牧股份 | 1,522,321.38 | 2.84 |
| 18 | 1336 HK | 新华保险 | 1,475,348.59 | 2.75 |
| 19 | 2628 HK | 中国人寿 | 1,339,712.92 | 2.50 |
| 20 | 2601 HK | 中国太保 | 1,317,420.57 | 2.46 |
| 21 | 0285 HK | 比亚迪电子 | 1,291,895.29 | 2.41 |
| 22 | 1171 HK | 兖州煤业股份 | 1,280,875.55 | 2.39 |
| 23 | 0257 HK | 中国光大国际 | 1,261,186.01 | 2.35 |
| 24 | 601398 | 工商银行 | 1,224,000.00 | 2.28 |
| 25 | 0165 HK | 中国光大控股 | 1,217,781.39 | 2.27 |
| 26 | 000651 | 格力电器 | 1,211,813.00 | 2.26 |
| 27 | 002185 | 华天科技 | 1,191,040.00 | 2.22 |
| 28 | 600585 | 海螺水泥 | 1,176,524.77 | 2.20 |
| 29 | 601988 | 中国银行 | 1,171,005.00 | 2.19 |
| 30 | 6881 HK | 中国银河 | 1,156,939.73 | 2.16 |
| 31 | 600703 | 三安光电 | 1,130,389.55 | 2.11 |
| 32 | 300083 | 劲胜智能 | 1,089,336.00 | 2.03 |
| 33 | 600373 | 中文传媒 | 1,083,966.67 | 2.02 |

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 | 119,208,779.59 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 121,342,521.08 |

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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。

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

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

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。

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 | 141,016.37 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | -637.18 |
| 5 | 应收申购款 | 19,330.79 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 159,709.98 |

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 |
| 2,151 | 23,252.07 | 9,331,645.21 | 18.66% | 40,683,561.17 | 81.34% |

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 | 798,755.71 | 1.5970% |

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 | 50~100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 50~100 |

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016年7月5日）基金份额总额 | 322,529,979.43 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 55,599,317.22 |
| 本报告期基金总申购份额 | 135,353,829.79 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 140,937,940.63 |
| 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 | 50,015,206.38 |

§ 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 年第一次临时股东大会决议，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 基金经理的变动情况

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 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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 50,000.00 元，已连续提供审计服务 2 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 | |
| 银河证券 | 2 | 240,551,300.67 | 100.00% | 184,237.35 | 100.00% | - |

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 |
| 银河证券 | - | - | 118,600,000.00 | 100.00% | - | - |

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：

(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。

§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

| 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 | 20170524~20170710、 20170714~20170926、 20171018~20171025 | 0.00 | 9,232,686.98 | 0.00 | 9,232,686.98 | 18.46% |
| | 2 | 20170427~20170502 | 0.00 | 23,410,075.33 | 23,410,075.33 | 0.00 | 0.00% |

产品特有风险

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。

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。

长盛基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日