

长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金
2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	52

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长盛战略新兴产业混合	
基金主代码	080008	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 10 月 26 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	107,428,089.15 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C
下属分级基金的交易代码:	080008	001834
报告期末下属分级基金的份额总额	107,428,089.15 份	0.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	重点关注国家战略性新兴产业发展过程中带来的投资机会，分享中国经济发展的长期收益，力争为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	(1) 本基金采用“自上而下”的战略资产配置体系，通过对宏观基本面及证券市场两个层面的因素定性、定量地分析，动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。(2) 本基金将战略性新兴产业相关股票和债券分别纳入战略性新兴产业股票库和债券库，投资于战略性新兴产业的股票及债券比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。(3) 战略性新兴产业的行业配置上，本基金将深入分析判断各子行业的行业景气状况、产业政策变化、行业生命周期，结合行业可投资的规模和相对估值水平，适时调整各子行业的配置比例。
业绩比较基准	50%*中证新兴产业指数+50%*中证综合债券指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	zhangln@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
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100088	100033

法定代表人	周兵	田国立
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	34,883,151.89	-
本期利润	-10,801,725.67	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0902	-
本期加权平均净值利润率	-4.27%	-
本期基金份额净值增长率	-7.38%	-
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	100,382,887.80	-
期末可供分配基金份额利润	0.9344	-
期末基金资产净值	207,810,976.95	-
期末基金份额净值	1.934	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	102.86%	-

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛战略新兴产业混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.86%	1.44%	-4.54%	0.84%	-3.32%	0.60%
过去三个月	-10.75%	1.16%	-5.72%	0.65%	-5.03%	0.51%
过去六个月	-7.38%	1.14%	-5.08%	0.69%	-2.30%	0.45%
过去一年	-1.78%	0.83%	-2.43%	0.59%	0.65%	0.24%
过去三年	7.62%	0.49%	-11.10%	0.92%	18.72%	-0.43%
自基金合同生效起至今	102.86%	0.85%	22.89%	0.91%	79.97%	-0.06%

注：1、长盛战略新兴产业混合 C 份额于 2016 年 6 月 3 日全部赎回。

2、根据《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 2 月 11 日起，由“沪深 300 指数×70%+中证综合债券指数×30%”变更为“50%×中证新兴产业指数+50%×中证综合债券指数”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

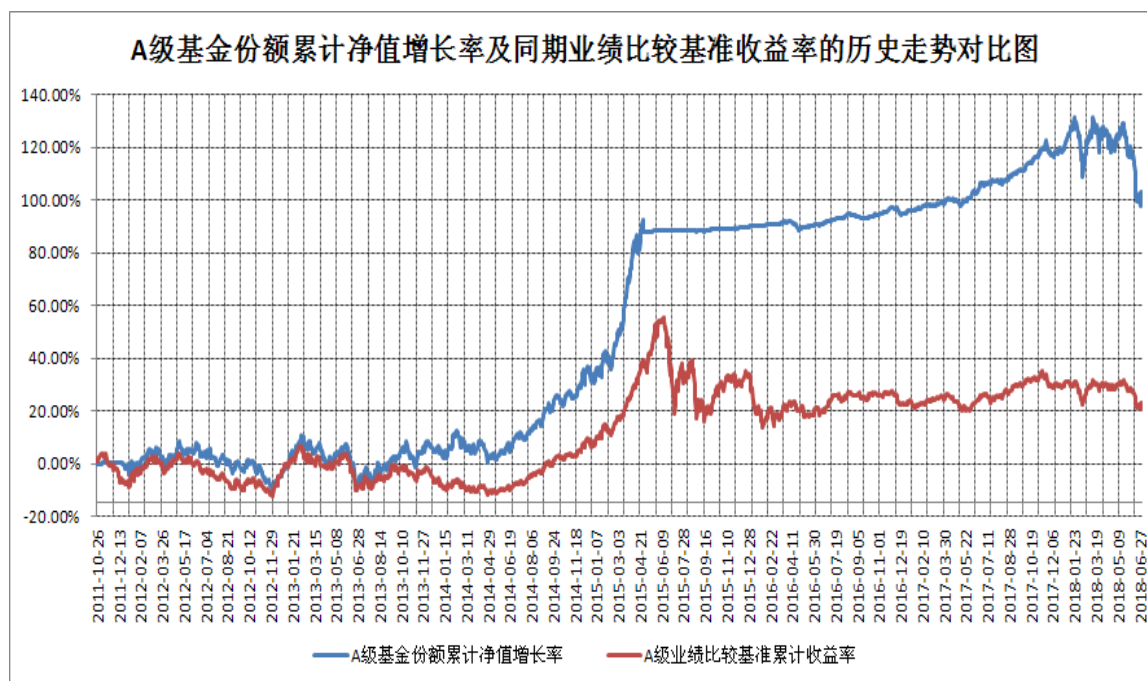
业绩比较基准=50%×中证新兴产业指数+50%×中证综合债券指数

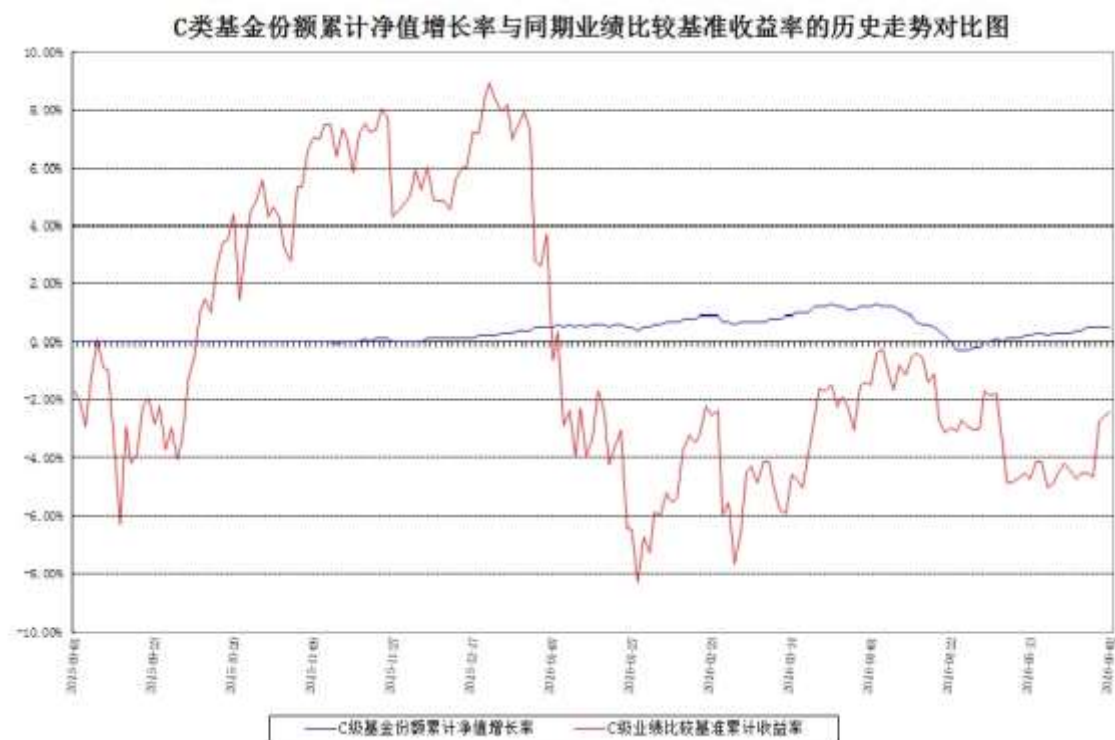
本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定中证新兴产业指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债券指数。

中证新兴产业指数是由中证指数有限公司编制，选择上海证券交易所和深圳证券交易所两市上市的新兴产业的公司中规模大、流动性好的 100 家公司组成，以综合反映沪深两市中新兴产业公司的整体表现。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准，较为合适。

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





注：按照本基金的基金合同规定，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本基金合同的有关规定。截至报告期期末，本基金的投资组合比例符合本基金合同的各项规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、成都设有分公司，在深圳设有营销中心，并拥有长盛基金（香港）有限公司、长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。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、特定客户资产管理业务资格和保险资产管理人资格。截至 2018 年 6 月 30 日，基金管理人共管理六十八只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯雨生	本基金基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛信息安全主题量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金经理，量化投资部负责人。	2016 年 9 月 12 日	-	11 年	冯雨生先生，1983 年 11 月出生。毕业于光华管理学院金融系，北京大学经济学硕士，CFA（特许金融分析师）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程研究员，同盛基金经理助理等职务。
李琪	本基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券型投资基金基金经理，长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基	2016 年 9 月 12 日	-	10 年	李琪先生，1975 年 2 月出生。天津大学管理学博士。历任大公国际资信评估有限公司信用分析师、

	金经理，长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛全债指数增强型证券投资基金基金经理，长盛同禧债券型证券投资基金基金经理，长盛可转债债券型证券投资基金基金经理。				信用评审委员会委员，泰康资产管理有限责任公司信用研究员。2011年3月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。
--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--------------------------------------------------------------------

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年股票市场大幅下跌，个股呈普跌态势，蓝筹股与小市值股票均大幅下跌。概念板块亮点难寻，普遍下跌，仅仿制药、创新药、电子政务、独角兽概念、血液制品等概念指数实现正收益，PM2.5、南北船合并、葡萄酒、特高压、3D 玻璃等概念板块领跌。行业上，休闲服务、医药生物和食品饮料等行业表现亮眼，实现正收益，涨幅大幅领先其他行业，综合、通信、电气设备等行业表现最差。风格上，大盘价值股跑赢小盘成长股。

组合操作上，我们严格按照相关契约规定的投资流程，深入分析判断各子行业的行业景气状况、产业政策变化、行业生命周期，结合行业可投资的规模和相对估值水平，适时调整各子行业的配置比例，积极寻找国家战略性新兴产业发展带来的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛战略新兴产业混合 A 基金份额净值为 1.934 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.38%，同期业绩比较基准收益率为-5.08%。长盛战略新兴产业混合 C 份额于 2016 年 6 月 3 日全部赎回。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，虽然降杠杆会持续，但力度和节奏会考虑实体经济的可承受度。财政政策可能会放松，货币政策会维持中性，经济增速大概率与以前持平。股票市场经过前期的大幅调整，目前已处于估值相对较低的位置。在此背景下，股票市场下半年会有更好的投资机会。

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。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《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至 2018 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 100,382,887.80，其中，A 类份额期末可供分配利润为 100,382,887.80 元（A 类份额未分配利润已实现部分为 107,138,706.84 元，未分配利润未实现部分为-6,755,819.04 元），C 类份额期末可供分配利润为 0.00 元（长盛战略新兴产业混合 C 份额于 2016 年 6 月 3 日全部赎回）。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	52,155,380.19	11,240,391.99
结算备付金		49,314.89	1,208,709.57
存出保证金		120,794.05	9,521.77
交易性金融资产	6.4.7.2	187,997,068.23	368,854,561.73
其中：股票投资		187,997,068.23	161,679,280.84
基金投资		-	-
债券投资		-	207,175,280.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	13,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	8,575.11	3,569,502.16
应收股利		-	-
应收申购款		13,873.98	60,639.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		240,345,006.45	397,943,326.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	19,599,850.60
应付证券清算款		31,837,302.35	7,989,452.05
应付赎回款		19,965.19	7,336.58
应付管理人报酬		177,130.60	312,501.21
应付托管费		44,282.63	78,125.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	187,778.17	51,533.82
应交税费		-	-

应付利息		-	32,293.88
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	267,570.56	334,931.27
负债合计		32,534,029.50	28,406,024.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	107,428,089.15	177,001,959.17
未分配利润	6.4.7.10	100,382,887.80	192,535,343.03
所有者权益合计		207,810,976.95	369,537,302.20
负债和所有者权益总计		240,345,006.45	397,943,326.91

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金份额总额 107,428,089.15 份，均为 A 类基金份额，A 类基金份额净值为 1.934 元。

6.2 利润表

会计主体：长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-7,677,402.39	28,282,788.68
1.利息收入		960,768.70	4,881,123.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	120,352.61	43,174.60
债券利息收入		832,850.47	4,746,468.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,565.62	91,480.03
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		37,029,197.91	7,622,728.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	36,612,405.15	7,413,308.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-455,178.13	-667,220.29
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	871,970.89	876,640.56
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-45,684,877.56	15,506,002.60
4.汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	17,508.56	272,933.81
减:二、费用		3,124,323.28	3,504,739.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,246,810.93	2,228,001.40
2. 托管费	6.4.10.2.2	311,702.68	557,000.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,332,483.47	332,820.73
5. 利息支出		32,293.88	193,886.27
其中:卖出回购金融资产支出		32,293.88	193,886.27
6. 税金及附加		2,290.09	-
7. 其他费用	6.4.7.20	198,742.23	193,031.09
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-10,801,725.67	24,778,048.87
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-10,801,725.67	24,778,048.87

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	177,001,959.17	192,535,343.03	369,537,302.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-10,801,725.67	-10,801,725.67
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)	-69,573,870.02	-81,350,729.56	-150,924,599.58
其中:1.基金申购款	4,068,044.96	4,550,235.20	8,618,280.16
2.基金赎回款	-73,641,914.98	-85,900,964.76	-159,542,879.74
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)	107,428,089.15	100,382,887.80	207,810,976.95
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	269,788,385.30	232,112,583.84	501,900,969.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	24,778,048.87	24,778,048.87
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)	-55,055,999.74	-48,830,093.59	-103,886,093.33
其中：1.基金申购款	3,463,859.52	3,115,675.56	6,579,535.08
2.基金赎回款	-58,519,859.26	-51,945,769.15	-110,465,628.41
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)	214,732,385.56	208,060,539.12	422,792,924.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

林培富

刁俊东

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金(以下简称“原基金”)基金份额持有人大会的决议由长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2011]第 1219 号《关于核准长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同祥泛资源主题

股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 941,564,638.02 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 411 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 10 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 941,658,939.32 份基金份额，其中认购资金利息折合 94,301.30 份基金份额。

原基金份额持有人大会自 2013 年 12 月 23 日起至 2014 年 1 月 22 日止以通讯方式召开，会议审议通过了《关于修改长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，经中国证监会备案后决议生效。根据原基金份额持有人大会决议，《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2014 年 2 月 11 日生效，基金投资目标、范围和策略调整，同时“长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金”更名为“长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金”。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司 2015 年 8 月 28 日发布的《关于长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类份额，调低管理费率、调整赎回费率并修改基金合同的公告》，本基金自 2015 年 9 月 1 日起，根据赎回费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛战略新兴产业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)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中对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%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；投资于战略新兴产业的股票及债券不低于本基金非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：50%×中证新兴产业指数+50%×中证综合债券指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(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》、《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	52,155,380.19
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	52,155,380.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	208,255,306.24	187,997,068.23	-20,258,238.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	208,255,306.24	187,997,068.23	-20,258,238.01

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	8,506.17
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	19.98
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	48.96
合计	8,575.11

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	187,778.17
银行间市场应付交易费用	-
合计	187,778.17

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付赎回费	4.52
预提费用	262,643.91
其他	4,922.13
合计	267,570.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛战略新兴产业混合 A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	177,001,959.17	177,001,959.17
本期申购	4,068,044.96	4,068,044.96
本期赎回(以“-”号填列)	-73,641,914.98	-73,641,914.98
- 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	107,428,089.15	107,428,089.15

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长盛战略新兴产业混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	143,265,564.49	49,269,778.54	192,535,343.03
本期利润	34,883,151.89	-45,684,877.56	-10,801,725.67
本期基金份额交易产生的变动数	-71,010,009.54	-10,340,720.02	-81,350,729.56
其中：基金申购款	3,875,976.19	674,259.01	4,550,235.20
基金赎回款	-74,885,985.73	-11,014,979.03	-85,900,964.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	107,138,706.84	-6,755,819.04	100,382,887.80

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	112,759.05
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	6,863.04
其他	730.52
合计	120,352.61

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	426,513,784.27
减：卖出股票成本总额	389,901,379.12
买卖股票差价收入	36,612,405.15

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-455,178.13
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	-455,178.13

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	232,659,439.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	228,329,739.20
减：应收利息总额	4,784,878.05
买卖债券差价收入	-455,178.13

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	871,970.89
基金投资产生的股利收益	-
合计	871,970.89

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-45,684,877.56
——股票投资	-46,396,415.87
——债券投资	711,538.31
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-45,684,877.56

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	14,680.90
基金转换费收入	2,827.66
合计	17,508.56

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,331,283.47
银行间市场交易费用	1,200.00
合计	1,332,483.47

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	133,891.13
银行划款费用	7,298.32
帐户维护费	27,000.00
其他费用	800.00
合计	198,742.23

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,246,810.93	2,228,001.40
其中：支付销售机构的客户维护费	98,231.28	84,358.28

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.0% ÷ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	311,702.68	557,000.32

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×0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	52,155,380.19	112,759.05	10,495,947.18	35,190.79

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项停牌	6.44	2018年8月20日	7.25	441,200	3,856,566.89	2,841,328.00	-
601727	上海电气	2018年6月6日	重大事项停牌	5.48	2018年8月7日	5.71	500,000	3,253,365.93	2,740,000.00	-
300072	三聚环保	2018年6月19日	重大事项停牌	23.28	2018年7月10日	24.00	66,100	2,344,522.00	1,538,808.00	-
000008	神州高铁	2018年6月6日	重大事项停牌	4.41	2018年8月7日	4.46	190,900	1,397,638.00	841,869.00	-
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项停牌	38.03	-	-	11,667	663,558.90	443,696.01	-
600221	海航控股	2018年1月10日	重大事项停牌	2.61	2018年7月20日	2.91	165,500	562,473.00	431,955.00	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2018 年 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 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期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

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 6.4.12。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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算

备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	52,155,380.19	-	-	-	52,155,380.19
结算备付金	49,314.89	-	-	-	49,314.89
存出保证金	120,794.05	-	-	-	120,794.05
交易性金融资产	-	-	-	187,997,068.23	187,997,068.23
应收利息	-	-	-	8,575.11	8,575.11
应收申购款	14.91	-	-	13,859.07	13,873.98
资产总计	52,325,504.04	-	-	188,019,502.41	240,345,006.45
负债					
应付证券清算款	-	-	-	31,837,302.35	31,837,302.35
应付赎回款	-	-	-	19,965.19	19,965.19
应付管理人报酬	-	-	-	177,130.60	177,130.60
应付托管费	-	-	-	44,282.63	44,282.63
应付交易费用	-	-	-	187,778.17	187,778.17
其他负债	-	-	-	267,570.56	267,570.56
负债总计	-	-	-	32,534,029.50	32,534,029.50
利率敏感度缺口	52,325,504.04	-	-	155,485,472.91	207,810,976.95
上年度末 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	11,240,391.99	-	-	-	11,240,391.99
结算备付金	1,208,709.57	-	-	-	1,208,709.57
存出保证金	9,521.77	-	-	-	9,521.77
交易性金融资产	196,650,059.99	9,805,294.90	719,926.00	161,679,280.84	368,854,561.73
买入返售金融资产	13,000,000.00	-	-	-	13,000,000.00
应收利息	-	-	-	3,569,502.16	3,569,502.16
应收申购款	14.91	-	-	60,624.78	60,639.69
资产总计	222,108,698.23	9,805,294.90	719,926.00	165,309,407.78	397,943,326.91
负债					
卖出回购金融资产款	19,599,850.60	-	-	-	19,599,850.60
应付证券清算款	-	-	-	7,989,452.05	7,989,452.05
应付赎回款	-	-	-	7,336.58	7,336.58
应付管理人报酬	-	-	-	312,501.21	312,501.21
应付托管费	-	-	-	78,125.30	78,125.30
应付交易费用	-	-	-	51,533.82	51,533.82

应付利息	-	-	-	32,293.88	32,293.88
其他负债	-	-	-	334,931.27	334,931.27
负债总计	19,599,850.60	-	-	8,806,174.11	28,406,024.71
利率敏感度缺口	202,508,847.63	9,805,294.90	719,926.00	156,503,233.67	369,537,302.20

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（2018年6月30 日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降25个基点	-	291,880.55
	市场利率上升25个基点	-	-291,880.55

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中对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%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；投资于战略新兴产业的股票及债券不低于本基金非现金基金资产

的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	187,997,068.23	90.47	161,679,280.84	43.75
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	187,997,068.23	90.47	161,679,280.84	43.75

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	16,376,148.16	8,129,820.65
	业绩比较基准下降 5%	-16,376,148.16	-8,129,820.65

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 179,071,382.07 元，属于第二层次的余额为 8,925,686.16 元，无属于第三层次的余额。(2017 年 12 月 31 日：第一层次 157,278,926.58 元，第二层次 211,575,635.15 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

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产		合计
	债券投资	权益工具投资	
2017 年 12 月 31 日	-	-	-
购买	-	-	-
出售	-	-	-
转入第三层级	-	1,878,600.00	1,878,600.00
转出第三层级	-	-1,521,600.00	-1,521,600.00
计入损益的利得或损失	-	-357,000.00	-357,000.00
2018 年 6 月 30 日	-	-	-
2018 年 6 月 30 日仍持有的资产 计入 2018 年半年度损益的未实现 利得或损失的变动——公允 价值变动损益		-	-

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益 等项目。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	187,997,068.23	78.22
	其中：股票	187,997,068.23	78.22
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	52,204,695.08	21.72
7	其他各项资产	143,243.14	0.06
8	合计	240,345,006.45	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,912,321.00	1.88
C	制造业	138,027,752.63	66.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,353,307.85	2.58
E	建筑业	7,773,901.00	3.74
F	批发和零售业	5,497,360.00	2.65
G	交通运输、仓储和邮政业	431,955.00	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,706,713.00	7.56
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,007,758.14	1.93

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,669,891.60	2.25
R	文化、体育和娱乐业	2,616,108.01	1.26
S	综合	-	-
	合计	187,997,068.23	90.47

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600031	三一重工	433,300	3,886,701.00	1.87
2	002241	歌尔股份	347,800	3,544,082.00	1.71
3	600893	航发动力	141,500	3,158,280.00	1.52
4	002008	大族激光	57,900	3,079,701.00	1.48
5	300024	机器人	173,800	3,024,120.00	1.46
6	000938	紫光股份	48,200	3,017,320.00	1.45
7	600660	福耀玻璃	116,100	2,984,931.00	1.44
8	002024	苏宁易购	209,500	2,949,760.00	1.42
9	600535	天士力	113,746	2,936,921.72	1.41
10	601186	中国铁建	332,400	2,865,288.00	1.38
11	601390	中国中铁	441,200	2,841,328.00	1.37
12	000049	德赛电池	99,438	2,806,140.36	1.35
13	601727	上海电气	500,000	2,740,000.00	1.32
14	600104	上汽集团	77,715	2,719,247.85	1.31
15	600522	中天科技	303,400	2,672,954.00	1.29
16	300124	汇川技术	81,100	2,661,702.00	1.28
17	600637	东方明珠	173,900	2,618,934.00	1.26
18	000625	长安汽车	290,000	2,610,000.00	1.26
19	601633	长城汽车	259,500	2,548,290.00	1.23
20	000963	华东医药	52,800	2,547,600.00	1.23
21	600487	亨通光电	113,500	2,502,675.00	1.20
22	000423	东阿阿胶	46,305	2,491,672.05	1.20
23	002044	美年健康	110,191	2,490,316.60	1.20
24	002841	视源股份	46,300	2,472,883.00	1.19
25	000333	美的集团	47,316	2,470,841.52	1.19
26	600085	同仁堂	69,500	2,451,960.00	1.18

27	600089	特变电工	347,776	2,410,087.68	1.16
28	600271	航天信息	92,800	2,345,056.00	1.13
29	002065	东华软件	270,900	2,329,740.00	1.12
30	600498	烽火通信	92,700	2,303,595.00	1.11
31	002236	大华股份	101,000	2,277,550.00	1.10
32	600111	北方稀土	199,200	2,266,896.00	1.09
33	600516	方大炭素	92,800	2,262,464.00	1.09
34	600019	宝钢股份	290,100	2,259,879.00	1.09
35	002925	盈趣科技	40,600	2,248,428.00	1.08
36	002555	三七互娱	180,900	2,197,935.00	1.06
37	002466	天齐锂业	44,145	2,189,150.55	1.05
38	300015	爱尔眼科	67,500	2,179,575.00	1.05
39	300251	光线传媒	213,400	2,172,412.00	1.05
40	002601	龙蟠佰利	166,300	2,150,259.00	1.03
41	600066	宇通客车	111,737	2,144,233.03	1.03
42	600528	中铁工业	209,600	2,142,112.00	1.03
43	300136	信维通信	69,400	2,132,662.00	1.03
44	002456	欧菲科技	132,000	2,129,160.00	1.02
45	600674	川投能源	243,700	2,125,064.00	1.02
46	600196	复星医药	51,200	2,119,168.00	1.02
47	600570	恒生电子	40,000	2,118,000.00	1.02
48	300433	蓝思科技	100,000	2,098,000.00	1.01
49	601877	正泰电器	92,800	2,071,296.00	1.00
50	600050	中国联通	420,200	2,067,384.00	0.99
51	601800	中国交建	181,500	2,067,285.00	0.99
52	300408	三环集团	87,600	2,058,600.00	0.99
53	603799	华友钴业	21,120	2,058,566.40	0.99
54	000100	TCL 集团	699,300	2,027,970.00	0.98
55	601808	中海油服	212,100	2,023,434.00	0.97
56	002460	赣锋锂业	52,100	2,010,018.00	0.97
57	600118	中国卫星	104,354	1,993,161.40	0.96
58	000826	启迪桑德	113,700	1,987,476.00	0.96
59	600176	中国巨石	192,900	1,973,367.00	0.95
60	600025	华能水电	646,600	1,965,664.00	0.95
61	300070	碧水源	139,200	1,939,056.00	0.93
62	002415	海康威视	51,900	1,927,047.00	0.93
63	000786	北新建材	103,800	1,923,414.00	0.93
64	600703	三安光电	100,000	1,922,000.00	0.92
65	603993	洛阳钼业	300,300	1,888,887.00	0.91

66	603160	汇顶科技	28,900	1,875,321.00	0.90
67	600219	南山铝业	687,500	1,863,125.00	0.90
68	000538	云南白药	17,300	1,850,408.00	0.89
69	002594	比亚迪	38,600	1,840,448.00	0.89
70	300003	乐普医疗	50,000	1,834,000.00	0.88
71	600406	国电南瑞	115,900	1,831,220.00	0.88
72	000768	中航飞机	115,900	1,812,676.00	0.87
73	601766	中国中车	232,100	1,787,170.00	0.86
74	300122	智飞生物	38,100	1,742,694.00	0.84
75	600332	白云山	43,133	1,641,210.65	0.79
76	300072	三聚环保	66,100	1,538,808.00	0.74
77	002202	金风科技	115,970	1,465,860.80	0.71
78	000725	京东方 A	410,400	1,452,816.00	0.70
79	601012	隆基股份	81,340	1,357,564.60	0.65
80	300059	东方财富	100,000	1,318,000.00	0.63
81	600276	恒瑞医药	17,203	1,303,299.28	0.63
82	600436	片仔癀	11,500	1,287,195.00	0.62
83	600588	用友网络	50,000	1,225,500.00	0.59
84	601985	中国核电	210,800	1,191,020.00	0.57
85	000008	神州高铁	190,900	841,869.00	0.41
86	002739	万达电影	11,667	443,696.01	0.21
87	600221	海航控股	165,500	431,955.00	0.21
88	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.06
89	000063	中兴通讯	9,000	117,270.00	0.06
90	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.04
91	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.02
92	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.02
93	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
94	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	9,989,326.90	2.70
2	000333	美的集团	8,510,753.20	2.30
3	600585	海螺水泥	8,206,418.46	2.22

4	600019	宝钢股份	7,463,006.15	2.02
5	000049	德赛电池	7,366,179.19	1.99
6	002241	歌尔股份	6,777,255.82	1.83
7	601012	隆基股份	6,567,619.00	1.78
8	600104	上汽集团	6,534,301.33	1.77
9	000002	万科A	6,084,686.93	1.65
10	000963	华东医药	5,873,105.00	1.59
11	002065	东华软件	5,727,704.00	1.55
12	600570	恒生电子	5,690,072.00	1.54
13	601088	中国神华	5,680,474.00	1.54
14	002008	大族激光	5,652,806.00	1.53
15	600028	中国石化	5,204,777.00	1.41
16	000938	紫光股份	5,092,332.00	1.38
17	000423	东阿阿胶	4,904,472.60	1.33
18	600703	三安光电	4,824,754.61	1.31
19	300059	东方财富	4,753,423.00	1.29
20	601390	中国中铁	4,641,329.00	1.26

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	23,637,694.00	6.40
2	000002	万科A	19,191,524.00	5.19
3	000333	美的集团	17,065,770.75	4.62
4	000063	中兴通讯	13,109,119.00	3.55
5	000001	平安银行	12,359,396.00	3.34
6	600585	海螺水泥	9,617,498.42	2.60
7	600900	长江电力	9,567,838.00	2.59
8	000858	五粮液	8,521,315.00	2.31
9	002142	宁波银行	8,083,875.04	2.19
10	600276	恒瑞医药	7,647,338.61	2.07
11	001979	招商蛇口	6,695,435.00	1.81
12	600690	青岛海尔	6,653,688.69	1.80
13	600019	宝钢股份	5,611,191.54	1.52
14	601088	中国神华	5,132,649.96	1.39
15	601888	中国国旅	4,744,648.96	1.28

16	600038	中直股份	4,569,739.14	1.24
17	600583	海油工程	4,551,380.00	1.23
18	600028	中国石化	4,485,389.00	1.21
19	000049	德赛电池	4,393,530.62	1.19
20	000581	威孚高科	4,373,626.00	1.18

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	462,615,582.38
卖出股票收入（成交）总额	426,513,784.27

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	120,794.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,575.11
5	应收申购款	13,873.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	143,243.14

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金报告期末未持有可转换债券（可交换债券）。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.1 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长盛战略新兴产业混合 A	2,031	52,894.18	93,042,934.78	86.61%	14,385,154.37	13.39%
长盛战略新兴产业混合 C	0	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	2,031	52,894.18	93,042,934.78	86.61%	14,385,154.37	13.39%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛战略新兴产业混合 A	101,845.40	0.0948%
	长盛战略新兴产业混合 C	0.00	0.0000%
	合计	101,845.40	0.0948%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长盛战略新兴产业混合 A	0
	长盛战略新兴产业混合 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛战略新兴产业混合 A	0
	长盛战略新兴产业混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C
基金合同生效日（2011 年 10 月 26 日）基金份额总额	941,658,939.32	-
本报告期期初基金份额总额	177,001,959.17	-
本报告期基金总申购份额	4,068,044.96	-
减：本报告期基金总赎回份额	73,641,914.98	-
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	107,428,089.15	-

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

原督察长叶金松先生因退休离任，由张利宁女士担任本公司督察长。

上述变更事项已经公司第七届董事会第七次会议审议通过，并按规定向相关监管机构备案。2018 年 4 月 27 日，中国证券监督管理委员会北京监管局作出《关于对长盛基金管理有限公司拟任合规负责人任职资格的意见》（京证监发〔2018〕136 号），对张利宁女士担任本公司督察长无异议。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	1	460,026,159.15	51.88%	428,423.58	51.88%	-
民生证券	1	426,704,846.24	48.12%	397,387.38	48.12%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	16,009,207.40	57.79%	-	-	-	-
民生证券	11,694,576.31	42.21%	9,000,000.00	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情况稳定。

(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

10.8 其他重大事件

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

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司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》《上海证券报》《证券时报》及本公司网站	2018年6月30日
2	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金开通南京苏宁基金销售有限公司定投业务并参加定投申购优惠活动的公告	同上	2018年6月15日
3	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加恒宇天泽为销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2018年6月13日
4	长盛基金管理有限公司关于上海基煜基金销售有限公司参加费率优惠活动的公告	同上	2018年6月12日
5	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加银河证券申购（含定投）费率优惠活动的公告	同上	2018年5月21日
6	关长盛基金旗下在徽商银行代销、托管基金暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	同上	2018年5月17日
7	长盛基金管理有限公司高级管理人员督察长变更的公告	同上	2018年5月3日
8	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	同上	2018年4月20日
9	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东海证券申购费率优惠活动的公告	同上	2018年4月2日
10	长盛战略新兴产业灵活配置	同上	2018年3月31日

	混合型证券投资基金 2017 年度报告		
11	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金 2017 年度报告 摘要	同上	2018 年 3 月 31 日
12	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购优惠活动的公告	同上	2018 年 3 月 31 日
13	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	2018 年 3 月 30 日
14	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加展恒基金费率优惠活动的公告	同上	2018 年 3 月 26 日
15	关于修改长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同等法律文件的公告	同上	2018 年 3 月 23 日
16	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2018 年 3 月 23 日
17	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议	同上	2018 年 3 月 23 日
18	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同	同上	2018 年 3 月 23 日
19	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2018 年 3 月 23 日
20	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	同上	2018 年 1 月 20 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101~20180630	163,042,934.78	0.00	70,000,000.00	93,042,934.78	86.61%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、中国证监会《关于长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》；
- 3、《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 6、法律意见书；
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 8、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地点。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或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8月29日