

# 长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

## 金

### 2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长盛创新先锋混合
基金主代码	080002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 6 月 4 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	136,973,998.38 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	选择具有创新能力和行业领先的上市公司，分享企业高速增长成果，在承担适度风险的基础上，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金为混合型证券投资基金，在资产配置上会考虑宏观经济因素、政策因素及市场估值水平。在个股选择上将根据不同行业景气度、“长盛创新选股体系”和“长盛优势选股体系”的股票筛选原则和方法优化个股投资比重。
业绩比较基准	沪深 300 指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金强调精选投资价值较大的创新领先企业，突出资产配置的灵活性和主动性，风险收益略低于股票型基金，高于债券型基金和平衡型基金。

### 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

### 2.4 信息披露方式

登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人的住所

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	2,779,426.80
本期利润	3,592,159.32
加权平均基金份额本期利润	0.0252
本期基金份额净值增长率	2.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0581
期末基金资产净值	129,014,204.19
期末基金份额净值	0.9419

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。

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

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	6.88%	0.86%	3.28%	0.44%	3.60%	0.42%
过去三个月	2.60%	0.85%	4.00%	0.40%	-1.40%	0.45%
过去六个月	2.81%	0.83%	7.07%	0.37%	-4.26%	0.46%
过去一年	-8.90%	0.85%	11.09%	0.44%	-19.99%	0.41%
过去三年	43.20%	1.79%	50.85%	1.14%	-7.65%	0.65%
自基金合同生效起至今	167.08%	1.39%	23.12%	1.13%	143.96%	0.26%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

业绩比较基准 = 沪深 300 指数 × 65% + 上证国债指数 × 35%

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上

证国债指数。

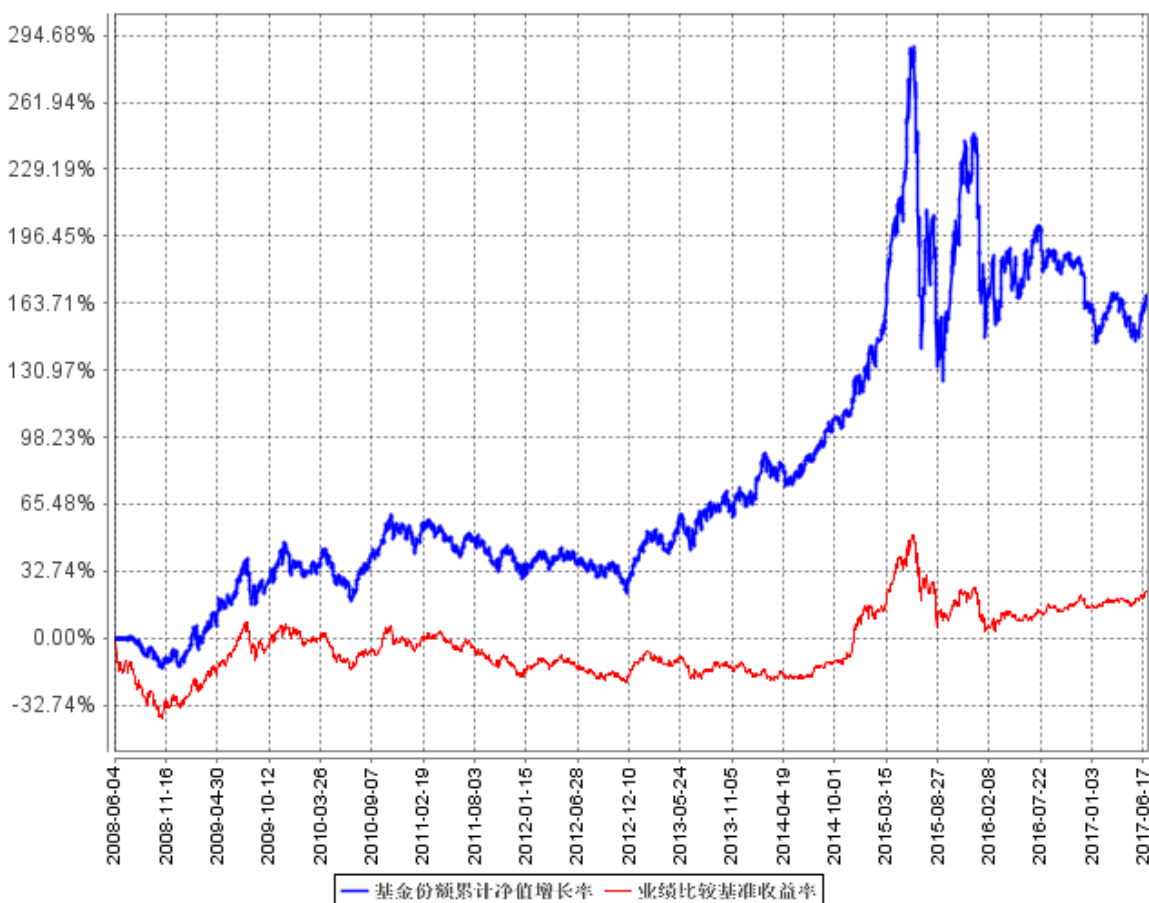
沪深 300 指数是沪深证券交易所联合发布的反映 A 股市场整体走势的成份股指数，由上海和深圳证券交易所市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成，样本覆盖了沪深市场约六成的市值，具有良好的市场代表性。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准，较为合适。

本基金的股票资产占基金资产的 30%-80%。在正常的市场情况下，基金的平均股票仓位约为 65%，所以，业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

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 65%、35%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约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四条（二）投资范围、（七）投资禁止行为与限制的有关约定。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。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2017 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十二只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理 (助理)期 限		证 券 从 业 年 限	说明
		任职 日期	离任 日期		
赵宏宇	本基金基金经理，长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理，FOF 业务部总监。	2015 年 9 月 24 日	-	9 年	赵宏宇先生，1972 年 6 月出生。四川大学工商管理学院管理学（金融投资研究方向）博士。历任美国晨星公司投资顾问部门数量分析师，招商银行博士后工作站博士后研究员。2007 年 8 月加入长盛基金管理公司，历任金融工程研究员、产品开发经理，首席产品开发师，金融工程与量化投资部副总监、长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理等职务。

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、《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照

诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 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

本基金为创新主题基金，投资目标主要是收益于技术创新驱动业绩增长的相关龙头行业及公司，基本反映其技术创新驱动行业及公司业绩增长的主题投资收益和风险特征。

2017 年上半年市场经过了震荡调整后，大盘蓝筹股票市场逐步恢复上行，尽管创新驱动型



行业及公司基本面仍稳步增长，但整体市场震荡的情况下，创新板块中的信息技术、医药医疗以及其它技术创新板块同时出现较大向下波动，对本基金净值增长带来一定的负面影响。本基金在 4 月份开始积极调整组合的配置结构和投资风格，向中大盘价值风格、大消费行业龙头进行配置转变，相对于市场取得了一定的超额收益回报。

本基金在基金合同允许的主题投资范围内，最大程度投资并跟踪分享技术创新主题相关股票增长的红利。在报告期内操作中，基金管理人严格遵守基金合同，按照主题投资所定义的范围精选个股，并进行灵活配置创新行业，进而实现基金投资的目标。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9419 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.81%，业绩比较基准收益率为 7.07%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人认为宏观经济目前处于底部徘徊阶段，股票市场受益于经济短期回暖与政策利好预期，特别是各项经济改革的具体实施驱动下，预期 2017 年下半年的技术创新驱动的市场行情有望获得恢复。特别是随着各项经济改革及政策的逐步推进，以电子、信息、医药生物以及智能制造为创新驱动的新兴产业主题的股票预期会有一定上涨空间。

本基金作为专注于投资技术创新型公司为主的投资基金，基金管理人将继续秉承创新驱动的投资策略，积极应对市场及行业板块的结构性业绩基本面变化、结合行业增长的趋势判断等因素对目标投资带来的影响。在积极控制基金的结构性和个股的配置风险的前提下，以实现投资者获取技术创新投资最大收益为目标，充分发挥基金投资的灵活配置功能，为各类基金投资者创造更多的财富保值增值机会。

#### 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并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十九条中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期末实施利润分配。

本基金截至 2017 年 6 月 30 日，期末可供分配收益为-7,959,794.19 元，其中：未分配收益已实现部分为 109,962,354.59 元，未分配收益未实现部分为-117,922,148.78 元。

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

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛创新先锋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

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	8,081,298.57	9,307,644.30
结算备付金	28,221.18	132,973.15
存出保证金	17,472.01	151,455.00
交易性金融资产	122,117,336.66	125,308,453.71
其中：股票投资	100,572,036.66	100,750,053.71
基金投资	-	-
债券投资	21,545,300.00	24,558,400.00
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	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	228,646.90	261,017.17
应收股利	-	-
应收申购款	8,583.73	30,462.07
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	130,481,559.05	135,192,005.40
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 6 月 30 日</b>	<b>2016 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	995,770.98	248,507.25
应付管理人报酬	156,092.73	177,187.50
应付托管费	26,015.45	29,531.26
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	116,942.39	27,374.73
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	172,533.31	248,404.08
负债合计	1,467,354.86	731,004.82
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	136,973,998.38	146,754,020.30
未分配利润	-7,959,794.19	-12,293,019.72
所有者权益合计	129,014,204.19	134,461,000.58
负债和所有者权益总计	130,481,559.05	135,192,005.40

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值：0.9419 元，基金份额总额

136,973,998.38 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛创新先锋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 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	5,169,614.76	-4,461,635.76
1.利息收入	423,534.43	798,615.73
其中：存款利息收入	29,531.95	262,490.59
债券利息收入	394,002.48	518,694.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	17,430.64
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	3,920,456.39	8,374,926.76
其中：股票投资收益	3,425,791.11	7,586,676.81
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-63,509.75	-94,209.88
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	558,175.03	882,459.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	812,732.52	-13,674,376.22
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	12,891.42	39,197.97
<b>减：二、费用</b>	1,577,455.44	3,393,413.14
1. 管理人报酬	963,615.86	2,433,302.08

2. 托管费	160,602.62	405,550.38
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	287,990.37	388,527.69
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	165,246.59	166,032.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>3,592,159.32</b>	<b>-7,855,048.90</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>3,592,159.32</b>	<b>-7,855,048.90</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛创新先锋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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	146,754,020.30	-12,293,019.72	134,461,000.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,592,159.32	3,592,159.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-9,780,021.92	741,066.21	-9,038,955.71
其中：1.基金申购款	11,143,430.30	-1,029,629.07	10,113,801.23
2.基金赎回款	-20,923,452.22	1,770,695.28	-19,152,756.94
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）	136,973,998.38	-7,959,794.19	129,014,204.19
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益 (基金净值)	105,990,952.80	78,275,146.05	184,266,098.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,855,048.90	-7,855,048.90
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)	387,118,318.20	162,279,274.14	549,397,592.34
其中：1.基金申购款	417,239,092.66	166,705,656.23	583,944,748.89
2.基金赎回款	-30,120,774.46	-4,426,382.09	-34,547,156.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-215,971,855.12	-215,971,855.12
五、期末所有者权益 (基金净值)	493,109,271.00	16,727,516.17	509,836,787.17

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

长盛创新先锋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[2008]第 378 号《关于核准长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛创新先锋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 848,057,772.27 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司(事务所性质已变更为特殊普通合伙)普华永道中天验字(2008)第 077 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2008 年 6 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 848,262,882.92 份基金份额,其中认购资金利息折合 205,110.65 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《长盛创新先锋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公开发行、上市的股票、债券及中国证监会

批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金类别资产配置比例为：股票投资占基金资产的 30%-80%，债券投资占基金资产的 15%-65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不少于 5%。其中，权证投资占基金资产净值的 0%-3%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×65%+上证国债指数×35%。

#### **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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、以及其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 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**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金



融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

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

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

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	963,615.86	2,433,302.08
其中：支付销售机构的客户维护费	189,531.49	220,779.49

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.5% 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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	160,602.62	405,550.38

注：支付基金托管人中国银行的基金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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：本基金管理人于本报告期及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金份额。

#### 6.4.8.4.2 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：除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

### 6.4.8.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国银行	8,081,298.57	28,086.15	88,900,630.13

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

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

#### 6.4.9.2 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
002049	紫光国芯	2017 年 2 月 20 日	重大事项	31.51	2017 年 7 月 17 日	27.74	57,765	2,230,449.28	1,820,175.15	-

			停牌								
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	重大 事项 停牌	6.85	2017 年 8 月 21 日	8.22	200,000	1,562,000.00	1,370,000.00	-	
300271	华宇 软件	2017 年 6 月 22 日	重大 事项 停牌	16.59	2017 年 7 月 4 日	16.80	48,932	887,649.80	811,781.88	-	

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日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。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末本基金未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.10 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 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 96,495,970.32 元，第二层次的余额为 25,621,366.34 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 98,893,955.66 元，第二层次 26,414,498.05 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 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	100,572,036.66	77.08
	其中：股票	100,572,036.66	77.08
2	固定收益投资	21,545,300.00	16.51
	其中：债券	21,545,300.00	16.51
	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	8,109,519.75	6.22
7	其他各项资产	254,702.64	0.20
8	合计	130,481,559.05	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	637,500.00	0.49
C	制造业	57,147,651.89	44.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,982,364.96	3.86
F	批发和零售业	6,044,411.60	4.69
G	交通运输、仓储和邮政业	4,061,300.00	3.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,434,905.49	19.71
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	1,509,000.00	1.17
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	754,902.72	0.59
S	综合	-	-
	合计	100,572,036.66	77.95

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	000063	中兴通讯	350,000	8,309,000.00	6.44
2	300017	网宿科技	300,114	3,622,375.98	2.81
3	300383	光环新网	245,600	3,330,336.00	2.58
4	000938	紫光股份	47,768	2,919,580.16	2.26
5	002456	欧菲光	150,000	2,725,500.00	2.11
6	300302	同有科技	150,591	2,712,143.91	2.10
7	300493	润欣科技	200,450	2,587,809.50	2.01
8	603888	新华网	75,000	2,429,250.00	1.88
9	600741	华域汽车	100,000	2,424,000.00	1.88
10	603108	润达医疗	150,120	2,391,411.60	1.85

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>网站的半年度报告正文。

### 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	000063	中兴通讯	5,975,905.69	4.44
2	601669	中国电建	2,837,646.17	2.11
3	600741	华域汽车	2,752,789.00	2.05
4	000963	华东医药	2,441,916.00	1.82
5	002770	科迪乳业	2,340,321.30	1.74
6	300452	山河药辅	2,285,942.52	1.70
7	601800	中国交建	2,142,860.00	1.59
8	000338	潍柴动力	2,091,009.00	1.56

9	002792	通宇通讯	2,037,162.00	1.52
10	002788	鹭燕医药	1,979,117.00	1.47
11	000625	长安汽车	1,921,487.00	1.43
12	300302	同有科技	1,872,085.76	1.39
13	300017	网宿科技	1,864,081.00	1.39
14	000400	许继电气	1,810,793.59	1.35
15	601668	中国建筑	1,802,000.00	1.34
16	300016	北陆药业	1,796,733.00	1.34
17	002051	中工国际	1,733,087.40	1.29
18	300548	博创科技	1,716,355.33	1.28
19	002662	京威股份	1,690,882.21	1.26
20	000541	佛山照明	1,628,376.20	1.21

#### 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	300294	博雅生物	5,702,614.04	4.24
2	601601	中国太保	3,858,891.68	2.87
3	001979	招商蛇口	3,507,755.50	2.61
4	000733	振华科技	3,303,076.19	2.46
5	002466	天齐锂业	3,203,093.20	2.38
6	600721	百花村	3,068,129.80	2.28
7	600266	北京城建	3,054,303.97	2.27
8	002055	得润电子	3,042,640.00	2.26
9	300182	捷成股份	2,823,541.65	2.10
10	002739	万达电影	2,363,819.45	1.76
11	600498	烽火通信	2,243,595.36	1.67
12	300452	山河药辅	2,046,185.44	1.52
13	300251	光线传媒	2,018,108.45	1.50
14	603998	方盛制药	1,965,226.16	1.46
15	002179	中航光电	1,853,205.60	1.38
16	601668	中国建筑	1,820,000.00	1.35
17	600845	宝信软件	1,695,785.58	1.26
18	300016	北陆药业	1,582,486.00	1.18
19	300166	东方国信	1,542,663.30	1.15
20	300014	亿纬锂能	1,501,345.00	1.12



**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	91,984,390.42
卖出股票收入（成交）总额	96,839,159.55

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

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	21,545,300.00	16.70
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,545,300.00	16.70

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	010303	03 国债(3)	75,000	7,392,000.00	5.73
2	010107	21 国债(7)	70,000	7,179,200.00	5.56
3	010213	02 国债(13)	70,000	6,974,100.00	5.41

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 只债券。

**7.7 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。

**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

网宿科技股份有限公司于 2017 年 6 月 23 日收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对网宿科技股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（沪证监决【2017】52 号），该函具体内容如下：

“经查，我局发现你公司存在未及时披露购买理财产品事项。2016 年 1 月 1 日至 2 月 3 日，公司以自有资金购买理财产品累计达 2.5 亿元，占最近一期（2014 年）经审计净资产的 15.28%，公司未在购买理财产品金额累计达到公司最近一期经审计净资产 10%时及时披露该等事项，仅在 2016 年 4 月 27 日披露的一季报中对自有资金购买理财产品额度、收益情况进行了披露。

本基金做出如下说明：

网宿科技是 CDN 行业龙头公司，公司基本面良好，行业规模成长较快。公司在接到证监会的警示函后，与 7 月 5 日披露了《关于自有资金购买理财产品的进展公告》，保荐机构 7 月 13 日也做出了核查意见。基于对公司的相关研究，本基金判断，此次购买理财产品，是为了提高资金利用效率，披露不及时的问题已经得到整改，对公司经营没有不良影响。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，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	17,472.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	228,646.90
5	应收申购款	8,583.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	254,702.64

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
13,290	10,306.55	838,516.56	0.61%	136,135,481.82	99.39%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	204,371.72	0.1492%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年6月4日）基金份额总额	848,262,882.92
本报告期期初基金份额总额	146,754,020.30
本报告期基金总申购份额	11,143,430.30
减：本报告期基金总赎回份额	20,923,452.22
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	136,973,998.38

## §10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

由于任期届满，高新不再担任公司董事长，周放生不再担任公司独立董事。根据公司 2016 年度股东会议决议，选举林培富为公司董事，选举张良庆为公司独立董事；根据公司第七届董事会第一次会议决议，选举周兵担任公司董事长；根据公司第七届董事会第二次会议决议，聘任林培富担任公司总经理，周兵不再担任公司总经理，同时林培富不再担任公司副总经理。以上公司高级管理人员变更，已于 2017 年 3 月 30 日向中国证监会北京监管局报备。

#### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动情况。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期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	
安信证券	1	125,539,535.05	66.99%	116,914.92	66.99%	-
银河证券	1	61,862,585.38	33.01%	57,613.32	33.01%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	2,511,361.80	100.00%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

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的情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	国信证券	上海	1
2	国信证券	深圳	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元的情况：无。

长盛基金管理有限公司

2017年8月24日