

长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证 券投资基金 2017 年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 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 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。

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.....	7
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.....	14
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.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
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.....	48

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§12 备查文件目录.....	49
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金
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	23,914,074.61 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>本基金将主要考虑：（1）宏观经济指标，包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口数据变化等；（2）微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期等；（3）市场指标，包括股票市场与债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金的供求关系及其变化等；（4）政策因素，包括财政政策、货币政策、产业政策及其它与证券市场密切相关的各种政策。</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>（三）债券投资策略</p> <p>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</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</p>

	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。
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
注册地址		深圳市福田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	王洪章

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》
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	基金管理人的办公地址及基金托管人的办公地址

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

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	3,048,297.59
本期利润	5,375,398.64
加权平均基金份额本期利润	0.1499
本期加权平均净值利润率	14.57%
本期基金份额净值增长率	14.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	2,079,376.04
期末可供分配基金份额利润	0.0870
期末基金资产净值	26,438,161.54
期末基金份额净值	1.106
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	10.60%

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。

4、本基金合同生效日为2016年7月5日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.03%	0.49%	2.23%	0.33%	-0.20%	0.16%
过去三个月	5.74%	0.56%	3.91%	0.31%	1.83%	0.25%
过去六个月	14.73%	0.57%	8.46%	0.30%	6.27%	0.27%
自基金合同生效起至今	10.60%	0.48%	11.50%	0.38%	-0.90%	0.10%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

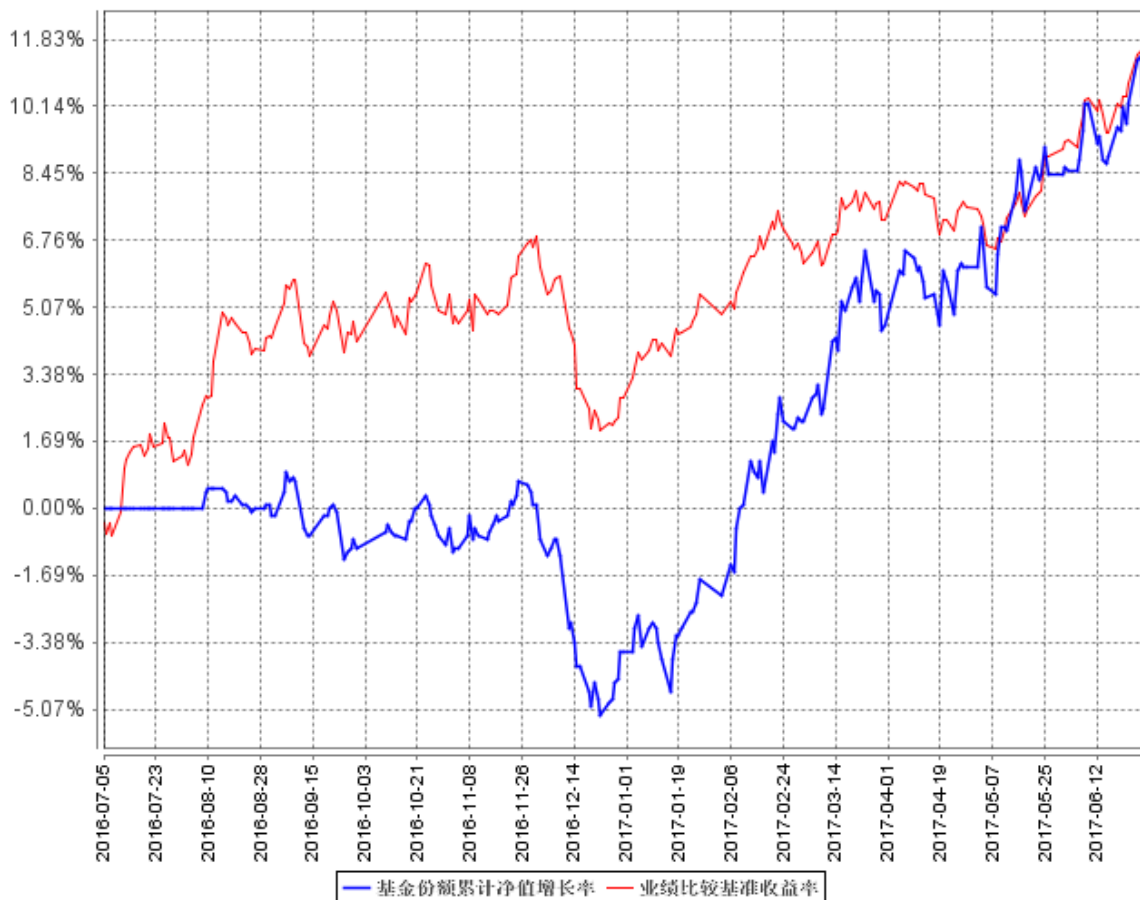
本基金业绩比较基准：中证综合债指数收益率*40%+沪深 300 指数收益率*30%+恒生综合指数收益率*30%

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：1、本基金合同生效日为 2016 年 7 月 5 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、本基金的投资组合比例为：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%。

§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		
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

上半年国内经济短周期复苏的态势在二三线房地产市场与工业企业生产活动的推动下继续保持，境外包括欧洲市场的复苏也支撑了外贸活动的改善。前期工业利润持续修复和企业偿债能力持续改善对制造业的企稳起到一定支撑，金融去杠杆实际效果尚未伤及实体经济，积极因素仍能为经济争取时间。虽然下半年库存周期、地产放缓对经济的下拉作用仍存，但经济放缓整体可控。然而美国新总统正式就职后推进其竞选承诺包括改革医疗法案、推出税改方案等动作受到的阻力较大，投资者开始逐步进入观望和等待兑现期，全球资产波动和不确定性明显上升。继 3 月联储议息会议后，美国 6 月再次宣布加息，全球货币政策将逐步收紧趋于正常化的方向得到了进一步强化。国内货币政策也将保持稳健偏紧、着力去杠杆的主基调，投资资金在此背景下偏好盈利确定性的配置逻辑不变。虽然 6 月份国内央行为防止资金市场出现巨大波动进行了短期货币投放，引发了新兴成长行业的局部反弹，大消费板块、相对低估的港股通板块依然受到主流大资金的青睐。

年初以来，境内机构投资者逐步提高对港股市场的配置，蓝筹股 AH 折溢价一度缩减到 10% 上下。但进入二季度后半段，估值洼地配置力度开始减弱，香港股票市场表现开始出现分化与获利回吐，在 MSCI 宣布将 A 股纳入全球新兴市场指数的刺激下 AH 股折溢价指标再度上升到 20% 以上。沪港深优势精选基金对一季度涨幅较大的行业与个股进行了获利了结，在整体上选择了较为防御性的配置并择机增加了对境内 A 股市场超跌成长股的投资。方向上仍然偏好成长和估值比较匹配的电子、医药、环保等长期成长性行业，取得了较为稳健的回报。

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 1.106 元；本报告期基金份额净值增长率为 14.73%，业绩比较基准收益率为 8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体而言，港股尤其是恒生指数的估值水平已到近年高位，我们认为中期期将是一次很好的评定各个板块乃至整体市场的盈利前景和未来走势的机会，我们目前对于一些板块和个股已有布局。同时中共 19 大在下半年的召开也会给投资者一次机会更好的评定中国经济转型和升级的方向，而美国方面则需要观察特朗普执政风格给其改革具体实施所带来的不确定性，以及美联储缩表进程和经济增长变化之间的关系。

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十六条中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 6 月 30 日，期末可供分配利润为 2,079,376.04 元，其中：未分配利润已实现部分为 2,079,376.04 元，未分配利润未实现部分为 444,710.89 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，自 2017 年 5 月 3 日至 2017 年 6 月 30 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，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 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,952,447.92	6,739,050.65
结算备付金		71,898.74	1,944,524.09
存出保证金		9,508.42	164,502.43
交易性金融资产	6.4.7.2	18,245,858.08	38,851,831.60
其中：股票投资		18,245,858.08	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	8,000,000.00
应收证券清算款		400,392.28	-
应收利息	6.4.7.5	2,189.58	2,309.66
应收股利		63,022.88	-
应收申购款		30,777.88	49,261.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		26,776,095.78	55,751,479.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,849,105.93
应付赎回款		182,459.86	111,817.38
应付管理人报酬		33,113.04	70,074.35
应付托管费		5,518.84	11,679.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	41,800.64	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	6.4.7.8	75,041.86	87,768.93
负债合计		337,934.24	2,169,871.45
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	23,914,074.61	55,599,317.22
未分配利润	6.4.7.10	2,524,086.93	-2,017,709.16
所有者权益合计		26,438,161.54	53,581,608.06
负债和所有者权益总计		26,776,095.78	55,751,479.51

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.106 元，基金份额总额

23,914,074.61 份。

2、本基金合同于 2016 年 7 月 5 日生效，上年度财务报表的实际编制期间为 2016 年 7 月 5 日至 2016 年 12 月 31 日止期间。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		5,971,108.33
1.利息收入		61,044.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	36,526.66
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		24,517.89
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,117,740.32
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,985,392.00
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
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	132,348.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,327,101.05

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	465,222.41
减：二、费用		595,709.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	279,581.28
2. 托管费	6.4.10.2.2	46,596.93
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	190,938.90
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	78,592.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,375,398.64
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,375,398.64

注：本基金合同于 2016 年 7 月 5 日生效，无上年度可比期间。

6.3 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 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）	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）	-	5,375,398.64	5,375,398.64
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）	-31,685,242.61	-833,602.55	-32,518,845.16
其中：1.基金申购款	39,160,932.81	2,613,743.15	41,774,675.96
2.基金赎回款	-70,846,175.42	-3,447,345.70	-74,293,521.12
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）	23,914,074.61	2,524,086.93	26,438,161.54

注：本基金合同于 2016 年 7 月 5 日生效，无上年度可比期间。

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

长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]第 2643 号《关于准予长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛沪港深优势精选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基金，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 322,303,314.69 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 896 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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》于 2016 年 7 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 322,529,979.43 份基金份额，其中认购资金利息折合 226,664.74 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%。

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。

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 重要会计政策和会计估计

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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

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[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]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) 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。

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。

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 2017年6月30日
活期存款	7,952,447.92
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,952,447.92

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	16,709,182.83	18,245,858.08	1,536,675.25
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	16,709,182.83	18,245,858.08	1,536,675.25

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	1,430.38
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	48.49
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	706.69
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4.02
合计	2,189.58

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	41,800.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	41,800.64

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	658.10
预提费用	74,383.76
合计	75,041.86

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,599,317.22	55,599,317.22
本期申购	39,160,932.81	39,160,932.81
本期赎回(以“-”号填列)	-70,846,175.42	-70,846,175.42
- 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	23,914,074.61	23,914,074.61

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,108,315.39	-909,393.77	-2,017,709.16
本期利润	3,048,297.59	2,327,101.05	5,375,398.64
本期基金份额交易产生的变动数	139,393.84	-972,996.39	-833,602.55
其中：基金申购款	1,783,081.94	830,661.21	2,613,743.15
基金赎回款	-1,643,688.10	-1,803,657.60	-3,447,345.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,079,376.04	444,710.89	2,524,086.93

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	31,136.43
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	4,222.97
其他	1,167.26
合计	36,526.66

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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	69,985,176.56
减：卖出股票成本总额	66,999,784.56
买卖股票差价收入	2,985,392.00

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期未取得衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	132,348.32
基金投资产生的股利收益	-
合计	132,348.32

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	2,327,101.05
——股票投资	2,327,101.05
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	2,327,101.05

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	465,222.41
合计	465,222.41

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	190,938.90
银行间市场交易费用	-
合计	190,938.90

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	44,630.98
证券组合费	578.31
账户维护费	360.00
银行费用	3,270.51
合计	78,592.58

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

本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

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”）	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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

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 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	279,581.28

其中：支付销售机构的客户维护费	149,592.15
-----------------	------------

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。

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	46,596.93

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。

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

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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自有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人于本报告期内未运用自有资金投资本基金份额。

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

注：本基金本报告期及上年度末末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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	
	2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	7,952,447.92	31,136.43
合计	7,952,447.92	31,136.43

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

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配事项。

6.4.12 期末（2017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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金是以一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金重点投资于A股和港股两个市场上的高成长上市公司股票，该类型股票的波动会受到宏观经济环境、行业周期和公司自身经营状况等因素的影响。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、管理风险以及本基金的特定风险。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。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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%。本基金所持大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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

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、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 2017 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	7,952,447.92	-	-	-	7,952,447.92
结算备付金	71,898.74	-	-	-	71,898.74
存出保证金	9,508.42	-	-	-	9,508.42
交易性金融资产	-	-	-	18,245,858.08	18,245,858.08
应收证券清算款	-	-	-	400,392.28	400,392.28
应收利息	-	-	-	2,189.58	2,189.58
应收股利	-	-	-	63,022.88	63,022.88
应收申购款	-	-	-	30,777.88	30,777.88
资产总计	8,033,855.08	-	-	18,742,240.70	26,776,095.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	182,459.86	182,459.86

应付管理人报酬	-	-	-	33,113.04	33,113.04
应付托管费	-	-	-	5,518.84	5,518.84
应付交易费用	-	-	-	41,800.64	41,800.64
其他负债	-	-	-	75,041.86	75,041.86
负债总计	-	-	-	337,934.24	337,934.24
利率敏感度缺口	8,033,855.08	-	-	18,404,306.46	26,438,161.54
上年度末 2016 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	6,739,050.65	-	-	-	6,739,050.65
结算备付金	1,944,524.09	-	-	-	1,944,524.09
存出保证金	164,502.43	-	-	-	164,502.43
交易性金融资产	-	-	-	38,851,831.60	38,851,831.60
买入返售金融资产	8,000,000.00	-	-	-	8,000,000.00
应收利息	-	-	-	2,309.66	2,309.66
应收申购款	-	-	-	49,261.08	49,261.08
资产总计	16,848,077.17	-	-	38,903,402.34	55,751,479.51
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,849,105.93	1,849,105.93
应付赎回款	-	-	-	111,817.38	111,817.38
应付管理人报酬	-	-	-	70,074.35	70,074.35
应付托管费	-	-	-	11,679.04	11,679.04
应付交易费用	-	-	-	39,425.82	39,425.82
其他负债	-	-	-	87,768.93	87,768.93
负债总计	-	-	-	2,169,871.45	2,169,871.45
利率敏感度缺口	16,848,077.17	-	-	36,733,530.89	53,581,608.06

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（2016 年 12 月 31 日：同。）

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	本期末 2016 年 12 月 31 日

	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产						
股票投资	9,169,108.08		-9,169,108.08	18,516,477.62		-18,516,477.62
资产合计	9,169,108.08		-9,169,108.08	18,516,477.62		-18,516,477.62
以外币计价的负债						
负债合计						
资产负债表外汇 风险敞口净额	9,169,108.08		-9,169,108.08	18,516,477.62		-18,516,477.62

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变 量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	港币相对人 民币升值 5%	458,455.40	925,824.00
	港币相对人 民币贬值 5%	-458,455.40	-925,824.00

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。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 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%。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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	18,245,858.08	69.01	38,851,831.60	72.51
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	18,245,858.08	69.01	38,851,831.60	72.51

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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	2,013,049.54	1,479,074.23
2. 业绩比较基准下降 5%	-2,013,049.54	-1,479,074.23	

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 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 18,245,858.08 元，无属于第二层次以及第三层次的余额。（2016 年度第一层次的余额为 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 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。

(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	18,245,858.08	68.14
	其中：股票	18,245,858.08	68.14
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	8,024,346.66	29.97
7	其他各项资产	505,891.04	1.89
8	合计	26,776,095.78	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为 9,169,108.08 元，占期末资产净值比例为 34.68%。

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	271,100.00	1.03
C	制造业	5,812,580.00	21.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	411,370.00	1.56
F	批发和零售业	149,100.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	714,380.00	2.70
J	金融业	892,980.00	3.38
K	房地产业	213,600.00	0.81

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	251,500.00	0.95
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	360,140.00	1.36
S	综合	-	-
	合计	9,076,750.00	34.33

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
金融	2,197,966.38	8.31
原材料	-	-
公用事业	841,535.23	3.18
日常消费品	-	-
电信业务	289,798.49	1.10
房地产	250,308.13	0.95
信息技术	1,830,660.26	6.92
工业	1,364,005.72	5.16
医疗保健	1,239,129.39	4.69
非日常生活消费品	705,010.98	2.67
能源	450,693.50	1.70
合计	9,169,108.08	34.68

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	600703	三安光电	55,000	1,083,500.00	4.10
2	601318	中国平安	18,000	892,980.00	3.38
3	600195	中牧股份	45,000	872,550.00	3.30
4	371 HK	北控水务集团	160,000	841,535.23	3.18
5	000049	德赛电池	16,000	828,960.00	3.14
6	966 HK	中国太平	45,033	773,102.12	2.92
7	1530 HK	三生制药	80,000	719,332.10	2.72
8	3968 HK	招商银行	30,000	613,185.48	2.32
9	002241	歌尔股份	30,000	578,400.00	2.19
10	1336 HK	新华保险	16,000	551,302.78	2.09
11	548 HK	深圳高速公	88,000	543,040.19	2.05

		路股份			
12	000997	新大陆	22,000	499,180.00	1.89
13	700 HK	腾讯控股	2,000	484,646.53	1.83
14	257 HK	光大国际	50,000	422,677.04	1.60
15	3969 HK	中国通号	80,000	417,990.27	1.58
16	002185	华天科技	55,000	398,200.00	1.51
17	002450	康得新	16,000	360,320.00	1.36
18	934 HK	中石化冠德	88,000	329,184.70	1.25
19	600566	济川药业	8,000	304,240.00	1.15
20	2382 HK	舜宇光学科技	5,000	303,772.00	1.15
21	00144 HK	招商局港口	16,000	300,647.49	1.14
22	728 HK	中国电信	90,000	289,798.49	1.10
23	2196 HK	复兴医药	10,000	262,545.80	0.99
24	1293 HK	宝信汽车	80,000	260,376.00	0.98
24	6886 HK	HTSC	20,000	260,376.00	0.98
25	600089	特变电工	25,000	258,250.00	0.98
26	1093 HK	石药集团	26,000	257,251.49	0.97
27	000069	华侨城 A	25,000	251,500.00	0.95
28	3380 HK	龙光地产	56,000	250,308.13	0.95
29	1114 HK	BRILLIANCE CHI	20,000	246,836.45	0.93
30	600068	葛洲坝	20,000	224,800.00	0.85
31	600160	巨化股份	18,000	216,540.00	0.82
32	148 HK	建滔化工	8,000	215,938.50	0.82
33	300113	顺网科技	8,000	215,200.00	0.81
34	001979	招商蛇口	10,000	213,600.00	0.81
35	3888 HK	金山软件	12,000	211,946.06	0.80
36	300144	宋城演艺	10,000	208,700.00	0.79
37	2238 HK	广汽集团	16,635	197,798.53	0.75
38	981 HK	中芯国际	25,000	196,366.90	0.74
39	002078	太阳纸业	26,000	191,100.00	0.72
40	000063	中兴通讯	8,000	189,920.00	0.72
41	002051	中工国际	9,000	186,570.00	0.71
42	600114	东睦股份	10,000	175,000.00	0.66
43	601168	西部矿业	20,000	153,800.00	0.58
44	002343	慈文传媒	4,000	151,440.00	0.57
45	000963	华东医药	3,000	149,100.00	0.56
46	603328	依顿电子	10,000	141,500.00	0.54

47	600884	杉杉股份	8,000	131,760.00	0.50
48	1171 HK	兖州煤业股份	20,000	121,508.80	0.46
49	601699	潞安环能	15,000	117,300.00	0.44
50	2727 HK	上海电气	30,000	97,641.00	0.37
51	000651	格力电器	2,000	82,340.00	0.31

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	1398 HK	工商银行	1,495,143.41	2.79
2	2628 HK	中国人寿	1,253,208.96	2.34
3	1336 HK	新华保险	1,237,500.66	2.31
4	1171 HK	兖州煤业股份	1,178,302.37	2.20
5	257 HK	光大国际	1,152,560.37	2.15
6	002250	联化科技	1,000,980.00	1.87
7	002078	太阳纸业	935,291.00	1.75
8	2018 HK	瑞声科技	867,629.62	1.62
9	934 HK	中石化冠德	804,562.29	1.50
10	601318	中国平安	733,716.00	1.37
11	300408	三环集团	720,683.00	1.35
12	300083	劲胜精密	682,396.00	1.27
13	000333	美的集团	677,449.00	1.26
14	601965	中国汽研	664,200.00	1.24
15	425 HK	敏实集团	658,437.53	1.23
16	300144	宋城演艺	636,988.00	1.19
17	603328	依顿电子	590,523.00	1.10
18	600089	特变电工	589,322.96	1.10
19	300070	碧水源	585,182.97	1.09
20	600703	三安光电	577,159.00	1.08

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	002475	立讯精密	2,639,262.53	4.93

2	002415	海康威视	2,572,254.50	4.80
3	371 HK	北控水务集团	2,079,461.45	3.88
4	2018 HK	瑞声科技	1,596,697.30	2.98
5	6818 HK	中国光大银行	1,554,625.56	2.90
6	1398 HK	工商银行	1,494,228.92	2.79
7	2628 HK	中国人寿	1,339,712.92	2.50
8	570 HK	中国中药	1,276,846.60	2.38
9	601965	中国汽研	1,245,785.00	2.33
10	165 HK	中国光大控股	1,217,781.39	2.27
11	601988	中国银行	1,171,005.00	2.19
12	6881 HK	中国银河	1,156,939.73	2.16
13	1171 HK	兖州煤业股份	1,153,303.38	2.15
14	1530 HK	三生制药	1,103,768.02	2.06
15	002019	亿帆鑫富	1,071,226.00	2.00
16	000651	格力电器	1,054,533.00	1.97
17	998 HK	中信银行	1,042,437.11	1.95
18	2899 HK	紫金矿业	1,009,976.98	1.88
19	002236	大华股份	995,423.22	1.86
20	3968 HK	招商银行	942,924.47	1.76

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	44,066,709.99
卖出股票收入（成交）总额	69,985,176.56

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。

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。

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投资。

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

本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	9,508.42
2	应收证券清算款	400,392.28
3	应收股利	63,022.88
4	应收利息	2,189.58

5	应收申购款	30,777.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	505,891.04

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：本基金本报告期末投资前十名股票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
591	40,463.75	9,331,645.21	39.02%	14,582,429.40	60.98%

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	443,080.02	1.8528%

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
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 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	39,160,932.81
减：本报告期基金总赎回份额	70,846,175.42
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	23,914,074.61

§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

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

本报告期内本基金托管人的高级管理人员无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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

报告期内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	
银河证券	2	114,018,273.59	100.00%	87,083.04	100.00%	-

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
银河证券	-	-	90,600,000.00	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。

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旗下部分基金增加基煜销售并开通基金转换业务的公告	《中国证券报》及本公司网站	2017年6月29日
2	长盛基金管理有限公司关于增加宁波银行为旗下部分基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务的公告	同上	2017年5月26日
3	长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	同上	2017年5月23日
4	长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	同上	2017年5月3日
5	长盛基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》和《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	同上	2017年4月27日
6	长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	同上	2017年4月22日
7	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	同上	2017年4月22日

8	长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金节假日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	同上	2017年4月11日
9	长盛基金管理有限公司高级管理人员董事长变更的公告	同上	2017年3月28日
10	长盛基金管理有限公司高级管理人员副总经理变更的公告	同上	2017年3月28日
11	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	同上	2017年3月28日
12	长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金 2016 年度报告摘要	同上	2017年3月27日
13	长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金 2016 年度报告	同上	2017年3月27日
14	长盛基金管理有限公司关于增加肯特瑞财富为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2017年3月24日
15	长盛基金管理有限公司关于增加蛋卷基金为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2017年3月21日
16	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宜信普泽费率优惠活动的公告	同上	2017年3月17日
17	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	同上	2017年2月23日
18	长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2017年2月16日
19	长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2017年2月16日
20	长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	同上	2017年1月21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	2017/5/24 至 2017/6/30	-	9,232,686.98	-	9,232,686.98	38.61%
	2	2017/4/27 至 2017/5/2	-	23,410,075.33	23,410,075.33	-	-

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。

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、《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》；
- 3、《长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

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址。

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

2017年8月24日