

[illegible][illegible]

的资产和负债。本基金对股票投资和股指期货投资仅限于中国证监会认可的境内上市公司股票，本基金投资股指期货仅限于套期保值的目的，不得进行投机交易。本基金主要投资于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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规允许基金进行投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-95%，投资于股指期货的投资比例不超过基金资产净值的5%，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%。本基金将根据法律法规的规定及基金合同的约定，动态调整资产配置比例。本基金的投资决策流程、投资组合管理、风险控制流程参见本基金管理人制定的投资管理业务管理制度。

本基金的投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略、衍生品投资策略（主要是指股指期货投资策略）等。其中本基金股票投资策略包括：行业配置策略、个股投资策略、股指期货投资策略等。本基金管理人将根据基金合同、基金管理人管理制度、基金管理人投资管理制度、基金管理人风险控制制度等，动态调整资产配置比例。

本基金投资于股票资产和黄金基金工具必须经过投资决策委员会的决策。

1. 资产配置

本基金遵循“基金合同规定的资产配置比例”和“基金管理人资产配置策略”的原则，根据基金合同的规定，动态调整资产配置比例。

2. 股票投资策略

本基金股票投资策略包括：行业配置策略、个股投资策略、股指期货投资策略等。本基金管理人将根据基金合同、基金管理人管理制度、基金管理人投资管理制度、基金管理人风险控制制度等，动态调整资产配置比例。

3. 固定收益投资策略

本基金固定收益投资策略包括：债券投资策略、货币市场工具投资策略、资产支持证券投资策略等。本基金管理人将根据基金合同、基金管理人管理制度、基金管理人投资管理制度、基金管理人风险控制制度等，动态调整资产配置比例。

4. 衍生品投资策略

本基金衍生品投资策略包括：股指期货投资策略等。本基金管理人将根据基金合同、基金管理人管理制度、基金管理人投资管理制度、基金管理人风险控制制度等，动态调整资产配置比例。

（3）风险控制

本基金风险控制包括：资产配置风险控制、股票投资风险控制、固定收益投资风险控制、衍生品投资风险控制等。本基金管理人将根据基金合同、基金管理人管理制度、基金管理人投资管理制度、基金管理人风险控制制度等，动态调整资产配置比例。

[illegible][illegible]

序号	项	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,402,395.63	454
	其中:股票	6,402,395.63	454
2	基金投资	106,729,106.26	100.76
3	固定收益投资	6,100.00	0.01
	其中:债券	6,100.00	0.01
	资产支持证券	--	--
4	贵金属投资	--	--
5	金融衍生品投资	--	--

6	买入返售金融资产	--	--	--
7	其中：买断式回购的买入返售金融资产	--	--	--
8	银行存款和结算备付金合计	6,020,866.38		5.60
9	其他资产	122,802.23		0.10
9	合计	118,031,940.00		100.00

2. 本基金资产投资于固定收益类资产情况

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	117,721.90	0.10
B	采矿业	56,240.00	0.06
C	制造业	3,496,707.19	2.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,301.00	0.02
E	建筑业	160,461.60	0.13
F	批发和零售业	196,700.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	48,007.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	803,711.64	0.00
J	金融业	16,177.00	0.01
K	房地产业	66,967.40	0.06
L	租赁和商务服务业	169,186.20	0.14
M	科学研究和技术服务业	37,283.20	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	79,629.20	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育		-	-
Q	卫生和社会工作		61,598,020	026
R	文化、体育和娱乐业		81,798,930	007
S	综合		-	-
	合计		5,402,397,43	457

3. 本基金投资于股票资产占基金资产净值比例不低于股票资产市值的 80% 的承诺及执行情况

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002344	海宁皮城	12,000	96,360,000	028
2	002271	东方雨虹	1,300	47,962,000	004

3	002714	联创股份	800	42,380.00	0.04
4	300542	沃森生物	2,300	41,375.00	0.04
5	002075	沙钢股份	2,600	41,312.00	0.04
6	300306	兴唐环境	1,400	37,800.00	0.03
7	002311	海大集团	1,600	37,440.00	0.03
8	300035	麦尔康科	1,200	36,960.00	0.03
9	002060	三花智控	2,000	36,600.00	0.03
10	300088	长信科技	4,600	36,018.00	0.03

4. 投资组合中股票品种和分类的股票投资数量

序号	债券信息	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	--	--
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(27只,估值)	6,100,000	0.01

7	应付债券(可转换债券)		6,100.00	0.00
8	所有者权益		--	--
9	其他		--	--
10	合计		6,100.00	0.01

5. 报告期内期末货币资金和货币资金资产净值比例与期初报告期末货币资金和货币资金资产净值比例

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123803	蓝箭转债	30	3,000.00	0.00
2	123804	铁汉转债	14	1,400.00	0.00
3	128029	大冶转债	13	1,300.00	0.00

注 1. 报告期内, 本基金没有进行上市交易操作。						
注 2. 报告期内本基金没有进行基金份额净值超过大中小涨停的前十名资产支持证券投资明细						
和前十名资产支持证券发行人名单。						
注 3. 报告期内本基金没有进行基金份额净值超过大中小涨停的前五名基金投资明细						
和前十名基金管理人名单。						
注 4. 报告期内本基金没有进行基金份额净值超过大中小涨停的前五名权证投资明细						
和前十名基金管理人名单。						
注 5. 报告期内本基金没有进行权证。						
注 6. 报告期内本基金没有进行股指期货。						
注 7. 报告期内本基金没有进行国债期货。						

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	嘉实沪深300ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	106,729,106.26	90.21

10. 报告期内本基金投资的前十名证券的价格波动受政策因素影响说明  
报告期内,本基金未受政策和市场因素较大影响。

11. 报告期内本基金投资的前十名证券的价格波动受市场因素影响说明  
报告期内,本基金未受市场和行业因素较大影响。

12. 报告期内本基金投资的前十名证券的价格波动受其他因素影响说明  
(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的价格波动受其他因素较大影响,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的主体未发生负面、处罚。  
(2) 本基金投资的前十名证券中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。  
(3) 其他因素形成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	31,223.37
2	应收证券清算款	-

3	回收股利	-
4	回收利息	1,380,054
5	回收净款项	(89,219,20)
6	其他应收款	-
7	净摊销费用	-
8	其他	-
9	合计	123,103,21

现金、现金等价物及于报告期末的净投资净增加额

补充说明：本报告期内没有处于转股期的可转换债券。

2、报告期内发生、且对报告期内损益造成重大影响的可转债事项

序号	股票代码	股票名称	流通受限股份的价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况 说明
1	002344	海宁皮城	86,369.00	0.08	重大资产重组
2	000370	广济药业	41,592.00	0.04	重大资产重组

十、报告期内基金投资资产减值准备的计提情况

报告期内本基金未计提资产减值准备。本基金持仓股票均属于优质上市公司，但不保证基金一定能获利，也不保证投资回报。基金的投资业绩并不等同于基金净值的增长，更不代表基金本金的安全。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值的变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

阶段	净增值率①	净增值率标准差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
2015年1月1日至2015年12月31日	10.15%	0.01%	1.50%	0.01%	8.65%	0.00%

生息日(自2012年12月20日)	-0.14%	1.25%	-13.86%	1.29%	4.73%	-0.14%
2013年	20.06%	15.05%	20.96%	16.76%	-1.00%	-0.00%
2014年	20.40%	1.31%	22.24%	1.20%	-1.04%	-0.00%
2015年	66.42%	2.62%	76.08%	2.60%	-20.26%	-0.06%
2016年	-230.77%	1.96%	-20.42%	1.97%	-0.15%	-0.02%
2017年	-12.00%	0.01%	-10.62%	0.02%	-1.47%	-0.01%

2.自基金合同生效之日起至基金清算日止期间长天基金及长天基金控股子公司长天信託有限公司比较

图 1 展示了 2012 年 3 月 22 日至 2017 年 12 月 31 日, 本基金与沪深 300 指数的历史年化收益率对比图。从图中可以看出, 本基金在大部分时间里, 其年化收益率都高于沪深 300 指数的年化收益率, 尤其是在 2015 年, 本基金的年化收益率达到了 15% 以上, 而沪深 300 指数的年化收益率则仅为 10% 左右。这充分说明了本基金在追求绝对收益的同时, 也能够有效规避市场风险, 实现稳健增值。

[illegible][illegible]

申购金额 (含申购费)	申购费率
M < 1000 元	1.2%
1000 元 ≤ M < 200 万元	0.8%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.4%
M ≥ 500 万元	申购费 0%

个人投资者通过直销系统认购本基金A类基金份额并申购基金份额,其申购费率不按申购金额分档,统一按照为0.8%。申购费用于认购时从投资者申购基金A类份额的申购资金中扣除,用于认购时从投资者申购基金A类份额的申购资金中扣除,用于申购时从投资者申购基金A类份额的申购资金中扣除。投资者申购本基金A类基金份额,在申购费用扣除后,在基金份额发售网下公开发售,基金申购费由投资者和基金管理人按照《基金合同》约定的费率,按实际净申购金额分摊,个人投资者通过本公司直销系统通过网上直销系统申购本基金A类基金份额的申购费率为0.8%,按实际净申购金额分摊。

自2023年4月12日起,在本公司直销系统公开发售,基金申购费由投资者和基金管理人按照《基金合同》约定的费率,按实际净申购金额分摊。

自2023年4月12日起,在本公司直销系统公开发售,基金申购费由投资者和基金管理人按照《基金合同》约定的费率,按实际净申购金额分摊。

[illegible][illegible][illegible][illegible][illegible]

---