长盛互联网＋主题灵活配置混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

2017年 12 月 31 日
基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018 年 1 月 20 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2018 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛互联网+混合
基金主代码	002085
交易代码	002085
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年 12 月 28 日
报告期末基金份额总额	87,119,619.20 份
投资目标	本基金的投资目标在于把握中国互联网行业发展以及传统产业与互联网融合发展过程中所蕴含的投资机会，在严格控制投资风险的基础上,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势,运用科学严谨、规范化的资产配置方法，灵活配置互联网+主题的上市公司股票和债券,谋求基金资产的长期稳定增长。 （一）大类资产配置策略 在大类资产配置中,本基金将主要考虑:宏观经济指标;微观经济指标;市场指标;政策因素。本基金将通过深入分析上述指标与因素,动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。 （二）股票投资策略 1、互联网+主题的界定 本基金所投资的互联网+主题包括互联网产业链相关行业以及与互联网发生融合发展的传统产业的股票。 2、个股选择 本基金将结合定性与定量分析，充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力,在互联网+主题界定的上市公司中选择具有长期持续成长能力的公司。 本基金筛选股票的程序为: 第一，将将样本空间中过去一年日均成交金额排名在后 20%的股票剔除。 第二，根据本基金对互联网+主题上市公司的界定挑选基金备选股票池。 第三,对备选互联网+主题相关上市公司,其体从公司基本状况、成长性评估和股票估值三个方面进行筛选。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 *50%+中证综合债指数收益率 *50%
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。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017 年 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	4,395,603.97
2.本期利润	19,984,998.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.1977
4.期末基金资产净值	104,495,908.73
5.期末基金份额净值	1.199

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到 2017 年 12 月 31 日。

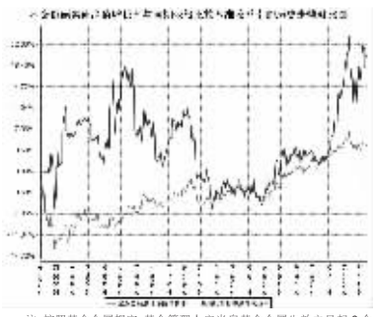
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.09%	1.29%	2.31%	0.41%	14.78%	0.88%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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十二部分二、投资范围及四、投资限制的有关约定。截至报告日,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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵楠	本基金基金经理,长盛电子信息产业混合型证券投资基金基金经理，长盛新兴成长主题混合型证券投资基金基金经理。	2015年 12 月 28 日	-	10年	赵楠先生,1980 年 3 月出生。经济学学士,北京大学光华 MBA 在读。历任安信证券研究中心研究员,光大永明资产管理股份有限公司权益投资部高级股票投资经理、资深股票投资经理、权益部新业务负责人、投行总部执行董事等职务。2015 年 2 月加入长盛基金管理有限公司。

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 公平交易专项说明

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。

公司对报告期内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,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易。

本报告期内,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 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年四季度股票市场延续了行业轮动与个股分化的走势。总体来讲,金融、消费等行业表现较强,周期、成长等行业表现较弱,中证 1000、深次新股、创业板等指数出现了非常明显的调整。

投资运作分析与回顾:一季度本产品净值表现不佳,出现小幅的下跌,跑输基准指数,吸取了之前净值快速回撤的教训,二季度在股票仓位、行业、个股选择方面,更加审慎,注重净值的波动和回撤。三季度市场整体偏好周期及部分热点成长股,账户表现一般,在操作方面,趁部分行业、个股调整时机,加大配置力度。四季度,账户表现较好,贡献了全年净值大部分的涨幅,账户主动操作较少,基本以持股为主。从全年来看,概况来说:一季度的操作是全年的转折点,行业配置和个股选择相比较 2016 年来有了非常大的变化,二季度稳中求进,三季度坚持所坚持的,四季度对耐心持股给予了回报。

展望 2018 年股票市场,仍维持之前偏乐观的判断。这样的判断是建立在企业盈利持续改善的基础之上,预计投资风格和分化仍将延续。在账户操作层面,坚持以公司盈利为前提,选择价格合理,较强盈利能力的公司,耐心持有。

4.5 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 1.199 元;本报告期基金份额净值增长率为 17.09%,业绩比较基准收益率为 2.31%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	97,848,718.30	92.78
	其中:股票	97,848,718.30	92.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,442,370.00	5.16
	其中:债券	5,442,370.00	5.16
	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	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,963,687.89	1.86
8	其他资产	207,493.24	0.20
9	合计	105,462,269.43	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	60,264,139.30	57.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,979,890.00	1.89
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	35,604,689.00	34.07
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	97,848,718.30	93.64

5.2.2 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。

5.3 报告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

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	000858	五粮液	128,000	10,224,640.00	9.78
2	000651	格力电器	232,200	10,147,140.00	9.71
3	600036	招商银行	345,700	10,032,214.00	9.60
4	601318	中国平安	141,600	9,909,168.00	9.48
5	600519	贵州茅台	11,110	7,749,113.90	7.42
6	000333	美的集团	115,900	6,424,337.00	6.15
7	000418	小天鹅 A	75,300	5,109,105.00	4.89
8	600741	华域汽车	150,000	4,453,500.00	4.26
9	600104	上汽集团	135,000	4,325,400.00	4.14
10	601166	兴业银行	236,500	4,018,135.00	3.85

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,442,370.00	5.21
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	5,442,370.00	5.21

5.5 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债券投资明细

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	019557	17国债03	54,500	5,442,370.00	5.21

注:本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,765.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	135,811.85
5	应收申购款	45,915.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	207,493.24

5.11.4 报告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处于转股期的可转换债券(可交换债券)。

5.11.5 报告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不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	118,982,614.61
报告期期间基金总申购份额	16,115,475.07
减:报告期期间基金总赎回份额	47,978,470.48
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	87,119,619.20

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

注:本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016]36 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]46 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]70 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 [2016]140 号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56 号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税[2017]90 号)及《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规、部门规章和规范性文件的规定,自 2018 年 1 月 1 日(含)起,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适用简易计税方法,按照规定的税费率缴纳增值税及附加税费。

自 2018 年 1 月 1 日(含)起,本公司将对旗下存续及新增产品发生的增值税应税行为按照相关法律法规及税收政策计算和缴纳增值税及相应附加税费;前述税费金额是产品管理、运作和处分过程中发生的,将由产品资产承担,从产品资产中提取缴纳,可能会使相关产品净值或实际收益降低,敬请投资者知悉。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛互联网＋主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛互联网＋主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛互联网＋主题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。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金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 1 月 20 日

长盛中证金融地产指数分级证券投资基金

2017年第四季度报告

2017年 12 月 31 日
基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2018 年 1 月 20 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2018 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛中证金融地产分级
场内简称	金融地产
基金主代码	160814
交易代码	160814
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年 6 月 16 日
报告期末基金份额总额	293,130,151.53 份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%,实现对中证金融地产指数的有效跟踪。
投资策略	1、股票投资策略 本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况(如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等)导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。 2、债券组合管理策略 基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债,债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。 3、金融衍生工具投资策略 在法律法规许可时,本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以控制并降低投资组合风险,提高投资效率,降低调仓成本与跟踪误差,从而更好地实现本基金的投资目标。 4、资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得较稳定收益。
业绩比较基准	中证申万一带一路主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,由于采取了基金份额分级的结构设计,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。
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
下属分级基金的基金简称	长盛一带一A / 长盛一带一B / 长盛中证申万一带一路指数分级
下属分级基金场内简称	一带一A / 一带一B / 一带一路
下属分级基金的交易代码	150214 / 150215 / 150213
报告期末下属分级基金的份额总额	84,706,872.00 份 / 84,706,872.00 份 / 1,262,482,239.54 份
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定 / 高风险、高预期收益 / 较高风险、较高预期收益

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017 年 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	2,732,181.79
2.本期利润	7,935,897.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0264
4.期末基金资产净值	242,820,572.82
5.期末基金份额净值	0.828

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到 2017 年 12 月 31 日。

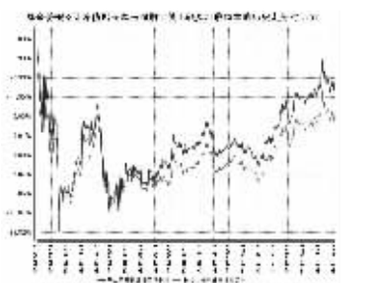
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.96%	0.87%	2.58%	0.85%	0.38%	0.02%

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:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当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十五部分(二)投资范围、(七)投资限制的有关约定。截至报告日,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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王超	本基金基金经理,长盛创瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理,长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理,长盛鑫鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金,长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理,长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金经理,长盛同辉深证 100 等权重指数证券投资基金(LOF)基金经理,长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理、长盛同德成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理、长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理。	2015 年 6 月 16 日	-	10年	王超先生,1981 年 9 月出生。中央财经大学硕士,CFA(特许金融分析师)、FRM(金融风险管理师)。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。

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 公平交易专项说明

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。

公司对报告期内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,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易。

本报告期内,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 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内,我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略,尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响,将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为 0.828 元;本报告期基金份额净值增长率为 2.96%,同期业绩比较基准收益率为 2.58%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为 0.05%，控制在 0.35%之内;年化跟踪误差为 0.99%,控制在 4%之内。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	229,446,935.58	94.00
	其中:股票	229,446,935.58	94.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	247,500.00	0.10
	其中:债券	247,500.00	0.10
	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	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,334,286.88	5.87
8	其他资产	64,760.27	0.03
9	合计	244,093,482.73	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	335,243.00	0.14
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	192,655,396.87	79.34
K	房地产业	35,172,093.08	14.48
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	228,713,282.95	94.19

5.2.2 报告期末按投资行业分类的境内股票投资组合

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	采掘业	10,399.22	0.00
C	制造业	388,731.91	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	261,318.60	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,714.78	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	22,682.01	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,744.96	0.00
M	科学研究和技术服务业	29,013.56	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,739.65	0.00
R	文化、体育和娱乐业	12,307.94	0.01
S	综合	-	-
	合计	733,652.63	0.30

5.2.3 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。

5.3 报告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

5.3.1 报告期末指数投资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

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	601318	中国平安	534,605	37,411,657.90	15.41
2	600036	招商银行	506,902	14,710,296.04	6.06
3	601166	兴业银行	596,700	10,137,933.00	4.18
4	600016	民生银行	1,161,240	9,742,803.60	4.01
5	601328	交通银行	1,352,240	8,397,410.40	3.46
6	601939	建设银行	1,000,235	7,681,804.80	3.16
7	601288	农业银行	1,982,900	7,594,507.00	3.13
8	000002	万 科 A	228,461	7,095,998.66	2.92
9	600030	中信证券	387,685	7,017,098.50	2.89
10	600000	浦发银行	552,546	6,956,554.14	2.86

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600025	华能水电	43,985	233,120.50	0.10
2	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
3	603711	香飘飘	1,318	35,019.26	0.01
4	603917	合力科技	1,022	29,014.58	0.01
5	603963	大理药业	999	28,531.44	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	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(可交换债)	247,500.00	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	247,500.00	0.10

5.5 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债券投资明细

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	128024	宁行转债	2,475	247,500.00	0.10

注:本基金本报告期末仅持有 1 只债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 |