长盛同德主题增长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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	长盛同德主题混合
基金主代码	519039
交易代码	519039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月25日
报告期末基金份额总额	988,572,008.53份
投资目标	本基金投资目标是在确定促进中国经济持续增长的主题背景下,挖掘中国经济持续增长的动力之所在，选取具有高成长性和具备持续增长潜力的上市公司,分享中国经济高速增长的成果;在严格控制投资风险的前提下,努力保持基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将沿着全球化、城镇化、消费升级、制度变革四大主题进行大类资产配置,根据企业获利能力、增长能力、资产回报率、资产管理能力等定量指标，结合公司治理结构状况等定性指标对行业内上市公司进行综合评价,动态的寻找行业与个股的最佳结合点。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，风险低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金,属于较高风险、较高回报的基金产品。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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	67,297,210.39
2.本期利润	33,678,552.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0332
4.期末基金资产净值	1,510,631,846.45
5.期末基金份额净值	1.5281

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。

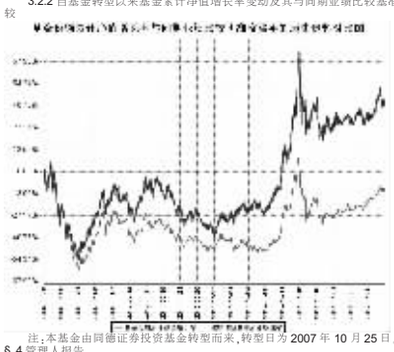
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	2.02%	0.98%	4.09%	0.64%	-2.07%	0.34%

3.2.2 自基金转型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:本基金由同德证券投资基金转型而来,转型日为2007年10月25日。

§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		
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，长盛中证金指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长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，量化投资部负责人。	2017年10月23日	-	10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,同德基金经理助理等职务。
薛林建	本基金基金经理。	2016年1月6日	2017年11月3日	14年	薛林建先生,1976年1月出生。经济学硕士。历任新华人寿保险公司研究员、投资经理,新华资产管理公司高级投资经理,建信基金管理公司资深投资经理,基金经理助理,基金经理。2015年6月加入长盛基金管理有限公司,曾任权益投资部执行总监。

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

四季度股票市场大幅震荡,个股分化严重,蓝筹股大幅上涨,小市值股票大幅下跌。市场整体先震荡走高,在11月中旬达到高点后迅速下挫。概念板块亮点难寻,普遍下跌,仅白马股、一线龙头、芯片国产化、维生素、沪股通50、行业龙头、二线龙头等概念指数实现正收益,雄安新区、乙醇汽油、无人机、充电桩、冷链物流、次新股等概念板块领跌。行业上,食品饮料和家用电器表现兑眼,涨幅大幅领先其他行业,国防军工、计算机、综合等行业表现最差。风格上,大盘价值股跑赢小盘成长股。

组合操作上,我们严格按照基金契约规定的投资流程,选取具有高成长性和具备持续增长潜力的上市公司。主要超配的量化指标是企业获利能力、增长能力、资产周转率和公司治理得分。

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1.5281元;本报告期基金份额净值增长率为2.02%,业绩比较基准收益率为4.09%。

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	1,291,955,873.59	84.90
	其中:股票	1,291,955,873.59	84.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	83,186,427.30	5.47
	其中:债券	83,186,427.30	5.47
	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	143,457,325.66	9.43
8	其他资产	3,133,644.08	0.21
9	合计	1,521,733,270.63	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	41,528,874.24	2.75
B	采矿业	12,472,023.25	0.83
C	制造业	597,672,771.66	39.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,470,379.20	2.02
E	建筑业	96,386,385.78	6.38
F	批发和零售业	35,485,656.33	2.35
G	交通运输、仓储和邮政业	33,087,409.96	2.19
H	住宿和餐饮业	617,126.48	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,450,277.22	2.81
J	金融业	209,586,998.24	13.87
K	房地产业	61,608,703.64	4.08
L	租赁和商务服务业	64,161,554.20	4.25
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	41,628,147.20	2.76
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	24,716,626.19	1.64
S	综合	82,940.00	0.01
	合计	1,291,955,873.59	85.52

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	601888	中国国旅	1,462,180	63,443,990.20	4.20
2	600176	中国巨石	3,609,520	58,799,080.80	3.89
3	000858	五粮液	721,029	57,595,796.52	3.81
4	001979	招商蛇口	2,826,219	55,280,843.64	3.66
5	300156	神雾环保	2,299,830	54,390,979.50	3.60
6	002304	洋河股份	458,663	52,746,245.00	3.49
7	601318	中国平安	706,151	49,416,446.98	3.27
8	000001	平安银行	3,493,400	46,462,220.00	3.08
9	002450	康得新	1,883,634	41,816,674.80	2.77
10	000998	隆平高科	1,442,692	37,106,038.24	2.46

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	79,883,000.00	5.29
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)	3,303,427.30	0.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	83,186,427.30	5.51

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	019563	17国债09	500,000	49,925,000.00	3.30
2	019557	17国债03	300,000	29,958,000.00	1.98
3	123004	铁汉转债	27,438	2,743,800.00	0.18
4	123003	蓝思转债	2,899	289,900.00	0.02
5	132012	17巨化EB	2,830	269,727.30	0.02

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股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	684,242.22
2	应收证券清算款	479,265.09
3	应收股利	-
4	应收利息	1,912,327.99
5	应收申购款	27,808.78
6	其他应收款	30,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,133,644.08

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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300156	神雾环保	54,390,979.50	3.60	重大事项停牌

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

报告期初基金份额总额	1,054,677,569.70
报告期期间基金总申购份额	1,751,965.27
减:报告期期间基金总赎回份额	67,857,526.44
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期末基金份额总额	988,572,008.53

§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:本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§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.中国证券监督管理委员会关于核准同德证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复;

2.《长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金合同》;

3.《长盛同德主题增长混合型证券投资基金托管协议》;

4.《长盛同德主题增长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和/或基金托管人的办公地址。

9.3 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

2018年1月20日

长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)

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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	长盛同庆中证800指数(LOF)
场内简称	长盛同庆
基金主代码	160806
交易代码	160806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月22日
报告期末基金份额总额	104,056,548.64份
投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将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控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内,以实现对中证800指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性,通过抽样方式构建基金股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%，且年化跟踪误差小于4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×中证800指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为抽样复制指数的股票型基金,具有高风险、高预期收益的特征,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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

§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	2,211,923.68
2.本期利润	4,269,336.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0402
4.期末基金资产净值	150,482,345.90
5.期末基金份额净值	1.446

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。

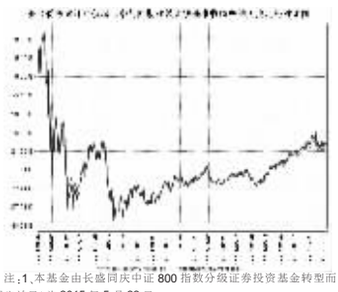
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	2.77%	0.73%	2.04%	0.72%	0.73%	0.01%

3.2.2 自基金转型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:1.本基金由长盛同庆中证800指数分级证券投资基金转型而来,基金转型日(即基金合同生效日)为2015年5月22日。

2.按照本基金合同规定,本基金将在基金合同生效3个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。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(三)投资范围、(九)投资限制的有关约定。截止本报告期末本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§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，长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛盛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，长盛同盛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5月22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1.446元,本报告期份额净值增长率为2.77%,同期业绩比较基准收益率为2.04%,报告期内,本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.03%,控制在0.35%之内;年化跟踪误差为0.68%,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	142,223,995.80	93.48
	其中:股票	142,223,995.80	93.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	181,957.54	0.12
	其中:债券	181,957.54	0.12
	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	9,737,947.25	6.40
8	其他资产	7,182.91	0.00
9	合计	152,151,083.50	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	819,066.01	0.54
B	采矿业	4,836,571.03	3.21
C	制造业	60,728,729.11	40.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,485,608.91	2.32
E	建筑业	4,843,215.52	3.22
F	批发和零售业	4,284,361.94	2.85
G	交通运输、仓储和邮政业	3,986,898.77	2.65
H	住宿和餐饮业	65,807.02	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,715,684.41	3.80
J	金融业	35,810,302.14	23.80
K	房地产业	8,754,795.52	5.82
L	租赁和商务服务业	1,291,006.53	0.86
M	科学研究和技术服务业	100,763.20	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	1,159,950.96	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	79,835.60	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,179,048.77	0.78
S	综合	315,095.47	0.21
	合计	137,456,740.91	91.34

5.2.2 报告期末积极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	采掘业	62,758.73	0.04
C	制造业	3,112,279.13	2.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	171,563.10	0.11
E	建筑业	89,362.95	0.06
F	批发和零售业	92,646.96	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	22,682.01	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	530,366.71	0.35
J	金融业	-	-
K	房地产业	116,221.18	0.08
L	租赁和商务服务业	44,299.36	0.03
M	科学研究和技术服务业	60,965.56	0.04
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	359,650.95	0.24
S	综合	102,718.60	0.07
	合计	4,767,254.89	3.17

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

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	99,887	6,990,092.26	4.65
2	600519	贵州茅台	5,103	3,559,291.47	2.37
3	000002	万科A	104,654	3,250,553.24	2.16
4	600036	招商银行	95,116	2,760,266.32	1.83
5	000651	格力电器	57,323	2,505,015.10	1.66
6	000333	美的集团	41,468	2,298,571.24	1.53
7	601166	兴业银行	123,571	2,099,471.29	1.40
8	601398	工商银行	305,912	1,896,654.40	1.26
9	600887	伊利股份	56,134	1,806,953.46	1.20
10	600016	民生银行	212,596	1,783,680.44	1.19

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	300296	利亚德	20,600	401,494.00	0.27
2	600487	亨通光电	8,600	347,612.00	0.23
3	000793	华闻传媒	19,495	195,144.95	0.13
4	600809	山西汾酒	3,053	173,990.47	0.12
5	002129	中环股份	14,776	169,776.24	0.11

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)	181,957.54	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	181,957.54	0.12

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	113013	国君转债	530	55,591.70	0.04
2	128024	宁行转债	462	46,200.00	0.03
3	123006	东财转债	267	26,700.00	0.02
4	128016	雨虹转债	108	12,320.64	0.01
5	113017	吉视转债	100	10,000.00	0.01

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	4,482.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,060.66
5	应收申购款	640.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,182.91

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6