长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年8月29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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年8月28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2018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	长盛创新驱动
基金主代码	004745
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8月16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	93,442,167.98份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于具有持续创新能力的上市公司的股票,在严格控制风险的前提下,谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金将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,重点投资于创新驱动型上市公司,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:(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。 本基金将通过深入分析上述指标与因素,确定并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,从而实现基金资产的大类资产配置。 (二)股票投资策略 1.创新驱动型公司的界定 创新是中国未来转型发展的首要驱动力,创新驱动型企业是一个国家最有活力的企业。具体来讲,本基金所指的创新包括产品创新、服务创新、技术创新、管理创新、营销创新、流程创新、组织与制度创新、商业模式创新、市场创新等。本基金所投资的创新驱动型公司,指创新已经成为或将要成为公司成长驱动力的公司。通过综合考虑公司创新文化、公司创新战略、公司创新管理能力、公司研发能力、公司研发投入、公司创新项目整体推进等情况,分析创新对公司竞争优势的影响,即创新能否为公司带来先发优势、成本优势低、产品或服务质量的提升、专有知识的形成或差异化优势的建立等,并结合对公司外部环境的分析,判断创新是否已经成为或将要成为公司成长的驱动力。 市场中以技术为核心的行业和以商贸服务为核心的行业都可能通现出创新驱动型上市公司,通过创造新技术、新工艺和新产品,采用新的生产方式和管理模式,开发新领域、提供新服务,在市场竞争中掌握主动权,以技术为核心的行业包括但不限于计算机、通信传媒、电子、机械设备、能源材料、采掘冶金、汽车、家电、国防军工、医药化工、电子设备等行业,以商贸服务为核心的行业包括但不限于商业、纺织服装、食品饮料、休闲娱乐、健康保健、交通运输、建筑建材、金融、农林牧渔、公用事业等行业。 未来如果基金管理人认为有更适当的创新驱动型公司的界定方法, 基金管理人有权对创新驱动型公司的界定方法进行变更,并在招募说明书更新中公告,不许召开持有人大会。 2.个股选择策略 本基金的股票投资策略是以“创新”为主线来进行行业配置,重点投资创新驱动型企业。具体来看,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,选择创新驱动概念的、具有长期持续增长能力的公司。 (三)债券投资策略 本基金在实际的投资管理运作中,将运用利率配置策略、类属配置策略、信用配置策略、相对价值策略及单个债券选择策略等多种策略,以获取债券市场的长期稳定收益。
业绩比较基准	3*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。

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	张利宁	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	zhanglnl@csfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	010-67595096
传真		010-82255988	010-66275853

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	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	2,169,641.50
本期利润	-5,922,200.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0564
本期基金份额净值增长率	-9.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0877
期末基金资产净值	85,247,029.32
期末基金份额净值	0.9123

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2018年6月30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。

4、本基金基金合同生效日为2017年8月16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	-6.28%	0.82%	-3.57%	0.64%	-1.71%	0.18%
过去三个月	-6.30%	0.74%	-4.07%	0.57%	-2.23%	0.17%
过去六个月	-9.98%	0.96%	-4.61%	0.58%	-5.37%	0.38%
自基金合同生效起至今	-8.77%	0.81%	-0.58%	0.49%	-8.19%	0.32%

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:50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率

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,由上海和深圳证券市场中选取 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;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%;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 50%、50%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

注:1、长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效日2017年8月16日,截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定,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有关约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年,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的有关约定。截止报告期末,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、成都设有分公司,在深圳设有营销中心,并拥有长盛基金(香港)有限公司、长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。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、特定客户资产管理业务资格和保险资产管理人资格。截至2018年6月30日,基金管理人共管理六十八只开放式基金,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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
乔培涛	本基金基金经理,长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛动态精选证券投资基金基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,研究部执行总监。	2017年10月9日	-	10年	乔培涛先生,1979年12月出生。清华大学硕士。曾任长城证券研究员,行业研究部经理。2011年8月加入长盛基金管理有限公司。
钱文礼	本基金经理,长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2018年5月21日	-	11年	钱文礼先生,1981年10月出生。西南财经大学金融学硕士。曾任平安证券,金元证券,国海证券研究员。2013年12月加入长盛基金管理有限公司。曾任行业研究员,长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

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

上半年国内经济形势错综复杂,受国际贸易摩擦,国内信用收缩的等事件的影响,主要指数在区间内弱势震荡。年初受地产销售拉动和供给侧改革影响,工业品价格持续上行,中上游行业盈利维持高位。出口受贸易摩擦的影响有提前兑付订单的倾向,导致上半年出口增速维持较高水平。国内消费增速有放缓趋势,整体CPI维持在较低水平。由于其贸易摩擦和信用收缩的强度和持续的时间有很大不确定性, 市场对于贸易摩擦和信用收缩的所产生的影响有较为悲观的预期,导致对于经济产生了较为悲观的预期,指数不断走弱。本基金上半年适当降低了仓位,减小了受宏观经济影响较大的家电,地产配置配套行业,周期等行业的配置,增加了对受宏观经济和贸易摩擦影响教小的交通运输,半导体等行业的配置,重点加强细分行业绩持续增长的个股的配置。

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0.9123元; 本报告期基金份额净值增长率为-9.98%,业绩比较基准收益率为-4.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,受外需减弱和国内信用收缩的影响,预计三季度宏观经济增速有减缓的可能性,投资和出口有进一步放缓的趋势,消费的增速整体下降。本基金将重点配置受宏观经济影响较小,符合创新驱动主题的教育,在线阅读,医药等必选消费等行业的配置,减少周期性行业和部分可选消费的配置,坚决回避受宏观经济影响较大的行业和受补贴影响较大的行业。

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。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

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定, 本基金本报告期间未实施利润分配。

本基金截止2018年6月30日, 期末可供分配利润为-8,195,138.66元,其中:未分配利润已实现部分为3,540,086.51元,未分配利润未实现部分为-11,735,225.17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,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的真实、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:长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日: 2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	26,633,994.24	29,791,106.54
结算备付金	534,579.62	368,013.61
存出保证金	42,015.51	38,261.44
交易性金融资产	26,564,175.72	181,581,219.74
其中:股票投资	26,564,175.72	161,609,219.74
基金投资	-	-
债券投资	-	19,972,000.00
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	32,295,450.13	-
应收利息	-1,140.75	503,062.63
应收股利	-	-
应收申购款	837.58	1,448.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	86,029,902.05	212,283,112.52
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
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	355,635.05	64,723.37
应付管理人报酬	109,778.00	275,962.32
应付托管费	18,296.34	45,992.04
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	125,179.11	189,291.83
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	173,984.23	70,161.97
负债合计	782,872.73	646,121.53
所有者权益:		
实收基金	93,442,167.98	208,833,968.25
未分配利润	-8,195,138.66	2,803,022.74
所有者权益合计	85,247,029.32	211,636,990.99
负债和所有者权益总计	86,029,902.05	212,283,112.52

注:1、报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.9123元,基金份额总额93,442,167.98份。

2、本基金合同于2017年8月16日生效,上年度财务报表的实际编制期间为2017年8月16日至2017年12月31日止期间。

6.2 利润表

会计主体:长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	-4,384,434.82
1.利息收入	207,943.62
其中:存款利息收入	120,750.55
债券利息收入	41,890.41
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	45,302.66
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	3,198,428.61
其中:股票投资收益	2,800,341.86
基金投资收益	-
债券投资收益	31,782.80
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	366,303.95
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-8,091,842.24
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	301,035.19
减:二、费用	1,537,766.92
1. 管理人报酬	782,172.73
2. 托管费	130,362.14
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	430,742.21
5. 利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	-
7. 其他费用	194,488.84
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-5,922,200.74
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-5,922,200.74

注:本基金合同于2017年8月16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:长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	208,833,968.25	2,803,022.74	211,636,990.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,922,200.74	-5,922,200.74
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)	-115,391,800.27	-5,075,960.66	-120,467,760.93
其中:1.基金申购款	2,140,112.28	14,020.55	2,154,132.83
2.基金赎回款	-117,531,912.55	-5,089,981.21	-122,621,893.76
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)	93,442,167.98	-8,195,138.66	85,247,029.32

注:本基金合同于2017年8月16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

长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2016]2931号文《关于准予长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册,由长盛基金管理有限公司于2017年5月31日至2017年8月11日止的期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资并出具(2017)验字60468688_A05号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年8月16日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。截至2017年8月15日止,本基金已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币445,514,398.66元, 折合445,514,398.66份基金份额; 有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币155,685.84元, 折合155,685.84份基金份额; 以上收到的实收基金共计人民币445,670,084.50元,折合445,670,084.50份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均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。

本基金的投资范围为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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、权证、股指期货、国债期货、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资比例为股票投资占基金资产的比例为0%-95%,其中投资于创新驱动型上市公司的证券不低于本基金非现金资产的80%; 权证投资占基金资产净值的比例不高于3%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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的投资比例不低于基金资产净值的5%,股指期货、国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为:50%*沪深300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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)》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

6.4.6.1印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

6.4.6.2增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,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(以下简称“资管产品运营业务”),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

6.4.6.3企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资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,股权的股息、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。

6.4.6.4个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》 的规定,自2013年1月1日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,暂减按25%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;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

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,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、基金代销机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联交易单元进行的交易

注:本基金本报告期内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 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	782,172.73
其中:支付销售机构的客户维护费	618,532.01

注:1、本基金合同于2017年8月16日生效,无上年度可比期间。

2、基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	130,362.14

注:1、本基金合同于2017年8月16日生效,无上年度可比期间。

2、基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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:本基金本报告期内未发生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:本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	26,633,994.24	119,438.45

注:1、本基金合同于2017年8月16日生效,无上年度可比期间。

2、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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金