长盛盛泰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:上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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。

根据《长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、本基金基金份额持有人大会于2018年7月23日表决通过的《关于终止长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及基金管理人长盛基金管理有限公司于2018年7月24日发布的《长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金于2018年07月24日进入财产清算期。

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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛盛泰混合	
基金主代码	003924	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月20日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	52,025,582.67份	
基金合同存续期	2018年7月24日进入清算期	
下属分级基金的基金简称:	长盛盛泰混合A	长盛盛泰混合C
下属分级基金的交易代码:	003924	003925
报告期末下属分级基金的份额总额	52,001,103.15份	24,479.52份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略,把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会,在严格控制风险的前提下,满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	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。 本基金通过对国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展的根本性因素进行分析,对处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置。 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。 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	50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率
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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	胡波
	联系电话	010-82019988	021-61618888
	电子邮箱	zhanglinn@csfunds.com.cn	hubo54@spdb.com.cn
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	95528
传真		010-82256988	021-63602540

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

基金级别	长盛盛泰混合A	长盛盛泰混合C
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)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-3,153,249.76	-348.38
本期利润	-3,751,648.84	-25.59
加权平均基金份额本期利润	-0.0313	-0.0010
本期基金份额净值增长率	-2.25%	-2.34%
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	-0.0117	-0.0129
期末基金资产净值	51,391,080.13	24,163.72
期末基金份额净值	0.9883	0.9871

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。

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

长盛盛泰混合A

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	-1.03%	0.14%	-3.57%	0.64%	2.54%	-0.50%
过去三个月	-0.65%	0.14%	-4.07%	0.57%	3.42%	-0.43%
过去六个月	-2.25%	0.39%	-4.61%	0.58%	2.36%	-0.19%
过去一年	0.20%	0.30%	0.17%	0.47%	0.03%	-0.17%
自基金合同生效起至今	2.39%	0.27%	3.55%	0.44%	-1.16%	-0.17%

长盛盛泰混合C

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	-1.05%	0.14%	-3.57%	0.64%	2.52%	-0.50%
过去三个月	-0.71%	0.14%	-4.07%	0.57%	3.36%	-0.43%
过去六个月	-2.34%	0.39%	-4.61%	0.58%	2.27%	-0.19%
过去一年	0.07%	0.30%	0.17%	0.47%	-0.10%	-0.17%
自基金合同生效起至今	2.20%	0.27%	3.55%	0.44%	-1.35%	-0.17%

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

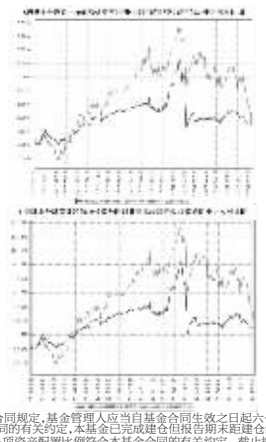
基准指数的构建考虑了三个原则:

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: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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李琪	本基金基金经理、长盛双月红1年期定期开放债券型投资基金基金经理、长盛盛辉混合型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、长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛世一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛全债指数双强型债券投资基金基金经理、长盛同禧债券型证券投资基金基金经理、长盛可转债债券型证券投资基金基金经理。	2017年3月20日	-	10年	李琪先生,1975年2月出生。天津大学管理学博士,历任大公国际资信评估有限公司信用分析师、信用评审委员会委员、泰康资产管理有限责任公司信用研究员。2011年3月加入长盛基金管理有限公司,曾任信用研究员、基金经理助理等职务。
杨衡	本基金基金经理、长盛盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛辉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、长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛悦灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛欣灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理。	2017年3月20日	-	11年	杨衡先生,1975年10月出生,中国科学院数学与系统科学研究院博士,博士后。2007年7月进入长盛基金管理公司,历任固定收益研究员、比较组合组合经理、比较组和30天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。

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

1、报告期内行情回顾

报告期内,经济保持了总体平稳、稳中向好态势,但部分数据指标走弱,显示经济存在下行压力。此外,中美贸易摩擦可能给中国出口带来不确定性。金融管理部门放宽了信用投放的监管指标,包括合意信贷额度、流动性(以降准、MLF等方式)、MPA中的广义信贷额度等,我国债券收益率大幅下行。

报告期内,A股市场1月冲高后整体呈现明显调整,成交活跃度下降,转债受股票市场影响和拖累,但调整幅度小于股票。

报告期内,IPO发行基本延续每周一批的常态化发行节奏,但每批IPO家数和募集总金额明显减少。受权益市场调整和风格转换影响,股票底仓波动加大。上市新股平均开板涨幅整体较过去有明显下行,新股网下申购对象数量较年初有所减少。部分新发行转债上市初期出现破发。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金坚持稳健操作思路,固定收益配置抓住有利时机,以高信用资质的中短期信用债、银行同业存单为主要投资标的,较好控制了利率风险、信用风险和流动性风险。

于2018年6月30日,所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量,负债以预计需要清偿的金额计量,其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

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

4.4.4 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

4.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

4.4.5.1 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。

4.4.5.2 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。

4.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

4.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局[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[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《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《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《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。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,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,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。

(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。

(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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

4.4.7 关联方关系

4.4.7.1 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。

4.4.7.2 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("长盛基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司("上海浦东发展银行")	基金托管人

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。

4.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

4.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

4.4.8.2 关联方报酬

4.4.8.2.1 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	上年度可比期间 2017年3月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	363,922.30	1,014,291.32
其中:支付销售机构的客户维护费	0.29	1.59

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0.60%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 0.60% / 当年天数。

4.4.8.2.2 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	上年度可比期间 2017年3月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	60,653.72	169,048.53

注:支付基金托管人上海浦东发展银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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 0.10% / 当年天数。

4.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	长盛盛泰混合A	长盛盛泰混合C	合计
长盛基金	-	0.30	0.30
合计	-	0.30	0.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年3月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛泰混合A	长盛盛泰混合C	合计
长盛基金	-	-	-
合计	-	-	-

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给长盛基金,再由长盛基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=前一日C类基金资产净值 X 0.20%/ 当年天数。

4.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

4.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

4.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金份额。

4.4.8.4.2 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。

4.4.8.5 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		上年度可比期间 2017年3月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行	4,025,531.63	64,009.14	4,356,286.73	188,680.25

注:本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行保管,按银行同业利率计息。

4.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

4.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

4.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

4.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

4.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000566	海南海药	2017年11月22日	重大事项停牌	13.00	2018年7月9日	11.60	91,600	1,197,949.78	1,190,800.00	-
600221	海航控股	2018年1月10日	重大事项停牌	2.61	2018年7月20日	2.91	396,000	1,281,427.48	1,033,560.00	-
000793	华闻传媒	2018年2月1日	重大事项停牌	6.89	2018年7月16日	7.56	116,400	1,201,238.17	801,996.00	-

注:本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

4.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

4.4.9.3.1 银行间市场债券正回购本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

4.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

4.4.10 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2018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1,042,406.00元,属于第二层次的余额为44,992,856.00元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次117,804,669.66元,第二层次82,024,439.06元,无第三层次)。

(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2018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(2017年12月31日:同)。

(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	4,068,762.00	7.89
	其中:股票	4,068,762.00	7.89
2	固定收益投资	41,966,500.00	81.38
	其中:债券	41,966,500.00	81.38
	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	4,273,258.90	8.29
7	其他各项资产	1,261,261.58	2.45
8	合计	51,569,782.48	100.00

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	-	-
C	制造业	2,233,206.00	4.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,033,560.00	2.01
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	-	-
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	801,996.00	1.56
S	综合	-	-
	合计	4,068,762.00	7.91

7.2.2 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。

7.3 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

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	000566	海南海药	91,600	1,190,800.00	2.32
2	002219	恒康医疗	98,900	1,042,406.00	2.03
3	600221	海航控股	396,000	1,033,560.00	2.01
4	000793	华闻传媒	116,400	801,996.00	1.56

注:本基金本报告期末仅持有上述四只股票。

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	601939	建设银行	7,349,000.00	3.63
2	600036	招商银行	5,924,232.00	2.93
3	600016	民生银行	4,729,122.00	2.34
4	601988	中国银行	4,594,743.00	2.27
5	601818	光大银行	3,836,549.00	1.90
6	601398	工商银行	3,670,697.00	1.81
7	601288	农业银行	3,476,869.00	1.72
8	002926	华西证券	202,330.48	0.10
9	603156	养元饮品	166,828.87	0.08
10	600901	江苏租赁	155,843.75	0.08
11	300741	华宝股份	101,325.00	0.05
12	601838	成都银行	89,465.01	0.04
13	002925	盈趣科技	68,670.00	0.03
14	601828	美凯龙	63,671.52	0.03
15	002929	润建通信	51,540.40	0.03
16	603630	今创集团	47,171.67	0.02
17	300740	御家汇	39,615.18	0.02
18	002928	华夏航空	33,849.60	0.02
19	300739	明阳电路	28,142.60	0.01
20	300733	西菱动力	21,839.70	0.01

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	601939	建设银行	8,515,629.00	4.21
2	600016	民生银行	6,083,569.00	3.01
3	601398	工商银行	6,010,123.00	2.97
4	600036	招商银行	5,847,316.00	2.89
5	601988	中国银行	5,764,516.00	2.85
6	601288	农业银行	5,755,845.00	2.85
7	601818	光大银行	4,972,927.00	2.46
8	000732	泰禾集团	2,312,334.72	1.14
9	600048	保利地产	2,060,598.00	1.02
10	000671	阳光城	1,824,129.00	0.90
11	002450	康得新	1,769,604.00	0.87
12	000001	平安银行	1,747,241.00	0.86
13	002142	宁波银行	1,615,781.90	0.80
14	601877	正泰电器	1,613,947.00	0.80
15	600004	白云机场	1,612,795.00	0.80
16	002202	金风科技	1,549,508.00	0.77
17	600352	浙江龙盛	1,536,481.00	0.76
18	601009	南京银行	1,506,927.44	0.75
19	600104	上汽集团	1,489,516.81	0.74
20	601998	中信银行	1,467,039.00	0.73

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	34,733,184.61
卖出股票收入(成交)总额	150,120,921.95

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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,995,500.00	5.83
	其中:政策性金融债	2,995,500.00	5.83
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	38,971,000.00	75.80
9	其他	-	-
10	合计	41,966,500.00	81.62

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111809117	18浦发银行CD117	100,000	9,910,000.00	19.27
2	111815160	18民生银行CD160	100,000	9,910,000.00	19.27
3	111710368	17兴业银行CD368	100,000	9,582,000.00	18.64
4	111781410	17南京银行CD141	100,000	9,569,000.00	18.61
5	108602	国开1704	30,000	2,995,500.00	5.83

7.7 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。

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。

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拟战略明细

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