

长株潭金融定增一号私募证券投资基金 2017 年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	长株潭金融定增一号私募证券投资基金
基金编号	S65539
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2015-10-09
基金管理人	湖南长株潭金融服务有限公司
基金托管人（如有）	中国国际金融股份有限公司
投资顾问（如有）	无
报告期末基金份额总额（份）	39,732,542.05
基金到期日期	2018-09-30

1.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	专一策略：长株潭金融定增一号是专一的上市公司定增基金，优选折扣大、定增方案对公司业绩起明显促进作用、公司估值具有明显优势等特征的上市公司进行投资，更多的是以自下而上的方式选股配置资产，偏好价值明显被低估但具有持续成长优势的股票。同时对跌破发行价的优质上市公司进行战略性配置，以实现基金的价值最大化并保持基金的流动性。
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	本基金是股票型基金，一般情况下其预期风险和预期收益高于混合型、债券型基金，属于高风险收益特征的证券投资品种。

1.3 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		湖南长株潭金融服务有限公司	中国国际金融股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高菁娴	
	联系电话	85223178	
	电子邮箱	778652808@qq.com	
传真		073185418288	
注册地址		长沙市岳麓区文轩路 27 号麓谷企业广场 C3 栋 13 楼	

办公地址	长沙市岳麓区文轩路 27 号麓谷企业广场 C3 栋 13 楼	
邮政编码	411205	
法定代表人	刘锡平	

1.4 信息披露方式

--

1.5 其他相关资料（如有）

项目	名称	办公地址
会计师事务所	无	无
注册登记机构	无	无
外包机构	无	无

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：元

期间数据和指标	年	年	年
本期已实现收益	-119,847.51		
本期利润	-119,847.51		
期末数据和指标	年末	年末	年末
期末可供分配利润	-168,965.25		
期末可供分配基金份额利润	-0.004		
期末基金资产净值	39,563,576.8		
期末基金份额净值	0.996		
累计期末指标	年末	年末	年末
基金份额累计净值增长率（%）	9.4419		

无分级 二级 三级

2.2 基金净值表现

阶段	净值增长率（%）	净值增长率标准差（%）	业绩比较基准收益率（%）	业绩比较基准收益率标准差（%）
当年	-0.3			
自基金合同生效起至今	9.44			

2.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：元

年度	每份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
17.4.5	97,350	281,697.1	0	379,047.10	
17.3.22	105,000	275,370.39	0	380,370.39	

3、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	
报告期期间基金总申购份额	
减：报告期期间基金总赎回份额	
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	39,732,542.05

4、管理人说明的其他情况

--

5、托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

--

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

--

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

--

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	本期末 2017-12-31	上年度末 2016-12-31
资产：		
银行存款		
结算备付金		
存出保证金		

交易性金融资产		
其中：股票投资		
基金投资		
债券投资		
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		
应收利息		
应收股利		
应收申购款		
递延所得税资产		
其他资产		
资产总计		
负债和所有者权益	本期末 2017-12-31	上年度末 2016-12-31
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		
应付管理人报酬		
应付托管费		
应付销售服务费		
应付交易费用		
应交税费		
应付利息		
应付利润		
递延所得税负债		
其他负债		
负债合计		
所有者权益：		
实收基金		
未分配利润		
所有者权益合计		
负债和所有者权益总计		

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2017-01-01 至 2017-12-31	2016-01-01 至 2016-12-31

一、收入		
1. 利息收入		
其中：存款利息收入		
债券利息收入		
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产收入		
其他利息收入		
2. 投资收益（损失以“-”填列）		
其中：股票投资收益		
基金投资收益		
债券投资收益		
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		
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”填列）		
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）		
5. 其他收入（损失以“-”填列）		
减：二、费用		
1. 管理人报酬		
其中：固定管理费		
业绩报酬		
2. 托管费		
3. 销售服务费		
4. 外包服务费		
5. 交易费用		
6. 利息支出		
其中：卖出回购金融资产支出		
7. 其他费用		
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）		
减：所得税费用		
四、净利润 （净亏损以“-”号填列）		

6.3 所有者权益变动表

项目	本期		
	2017-01-01 至 2017-12-31		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合

项目	上年度可比期间 2016-01-01 至 2016-12-31		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
			计
一、期初所有者权益（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）			
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）			
其中：1. 基金申购款			
2. 基金赎回款			
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）			
项目	上年度可比期间 2016-01-01 至 2016-12-31		
一、期初所有者权益（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）			
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）			
其中：1. 基金申购款			
2. 基金赎回款			
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）			

7、 期末投资组合情况

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额 (人民币)	占基金总资产的 比例 (%)
1	权益投资		
	其中：普通股		
	存托凭证		
2	基金投资		
3	固定收益投资		
	其中：债券		
	资产支持证券		

4	金融衍生品投资		
	其中：远期		
	期货		
	期权		
	权证		
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	货币市场工具		
7	银行存款和结算备付金合计	683,293.61	
8	其它组合资产	39,000,130.70	
	合计	39,683,424.31	

华宝信托-投资6号集合资金信托计划 39,000,000.00 元；应收利息 130.7 元。

7.2 报告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：元

序号	行业类别	公允价值	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		
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		
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		

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
合计		

8、信息披露报告

此处请上传管理人向投资者披露的信息披露报告 pdf 文件，需加盖管理人公章。

请点击工具栏上“附件列表”按钮上传附件。

信息披露报告是否经托管机构复核：是