

长盛全债指数增强型债券投资基金 2017 年年度报告 摘要

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

送出日期：2018 年 3 月 31 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛全债指数增强债券
基金主代码	510080
前端交易代码	510080
后端交易代码	511080
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 10 月 25 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
报告期末基金份额总额	231,157,559.95 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为开放式债券型基金，将运用增强的指数化投资策略，在力求本金安全的基础上，追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用“自上而下”的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值，同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益。
业绩比较基准	标普中国全债指数收益率×92%+标普中国 A 股综合指数收益率×8%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	贺倩
	联系电话	010-82019988	010-66060069
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95599
传真		010-82255988	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	10,621,871.36	7,491,786.04	25,778,368.32
本期利润	9,677,273.77	3,710,338.33	7,644,097.54
加权平均基金份额本期利润	0.0375	0.0196	0.0852
本期基金份额净值增长率	3.25%	-0.06%	4.42%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0597	0.0187	0.4032
期末基金资产净值	265,309,516.62	2,479,427,391.89	112,577,316.63
期末基金份额净值	1.1477	1.1116	1.5243

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。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 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

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
过去三个月	0.14%	0.07%	-0.78%	0.13%	0.92%	-0.06%
过去六个月	1.49%	0.09%	0.10%	0.11%	1.39%	-0.02%
过去一年	3.25%	0.09%	-0.48%	0.13%	3.73%	-0.04%
过去三年	7.75%	0.36%	7.34%	0.19%	0.41%	0.17%
过去五年	44.80%	0.37%	22.88%	0.18%	21.92%	0.19%
自基金合同生效起至今	225.37%	0.35%	79.60%	0.17%	145.77%	0.18%

注：本基金业绩比较基准=标普中国全债指数收益率×92%+标普中国 A 股综合指数收益率×8%。

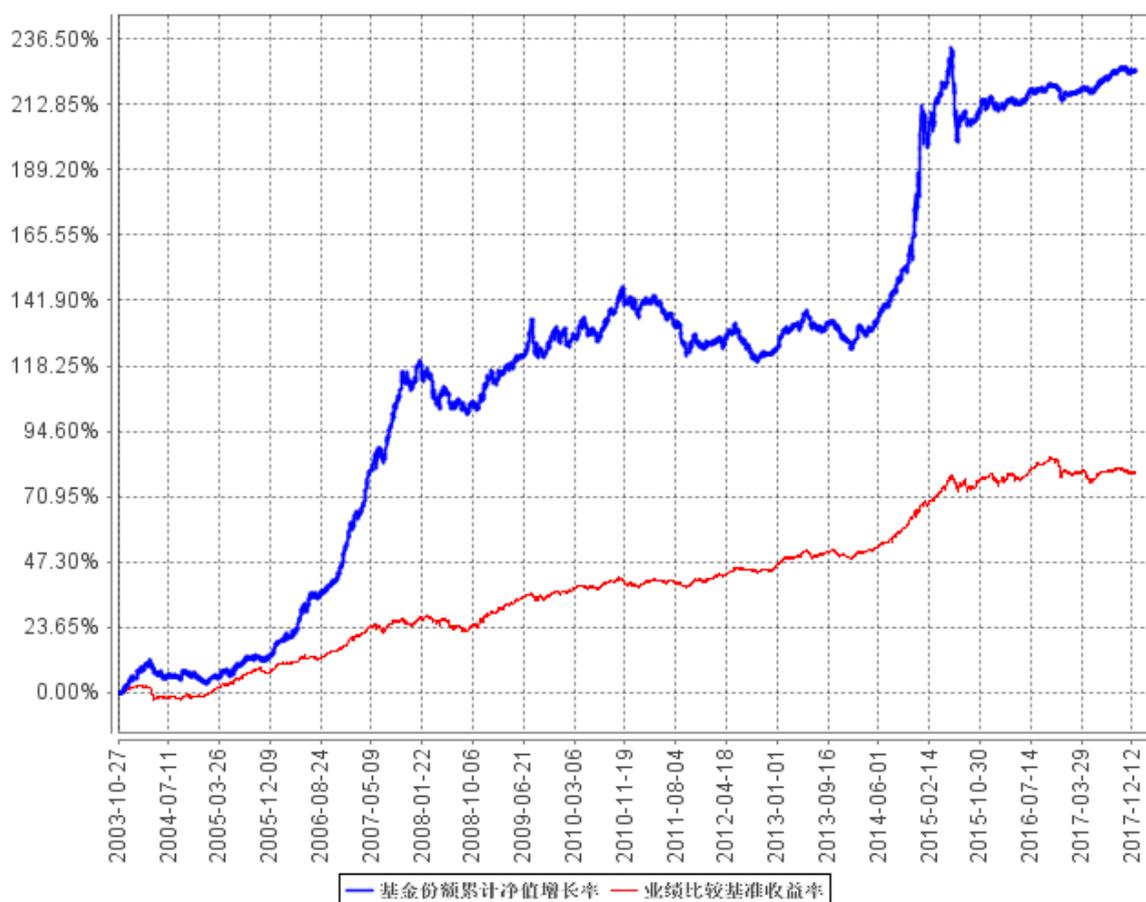
本基金业绩比较基准的构建：本基金为增强性指数化债券型投资基金，对目标指数的投资在资产配置中最低比例为 64%，股票资产配置最高比例为 16%，现金持有最低比例为 3%。由于本基金主

要投资于债券，股票投资是作为增强型投资提高收益的一种手段，预计股票投资比例的平均值为 8%，因此将基金业绩比较设定为：标普中国全债指数收益率×92%+标普中国 A 股综合指数收益率×8%。

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 92%、8%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。

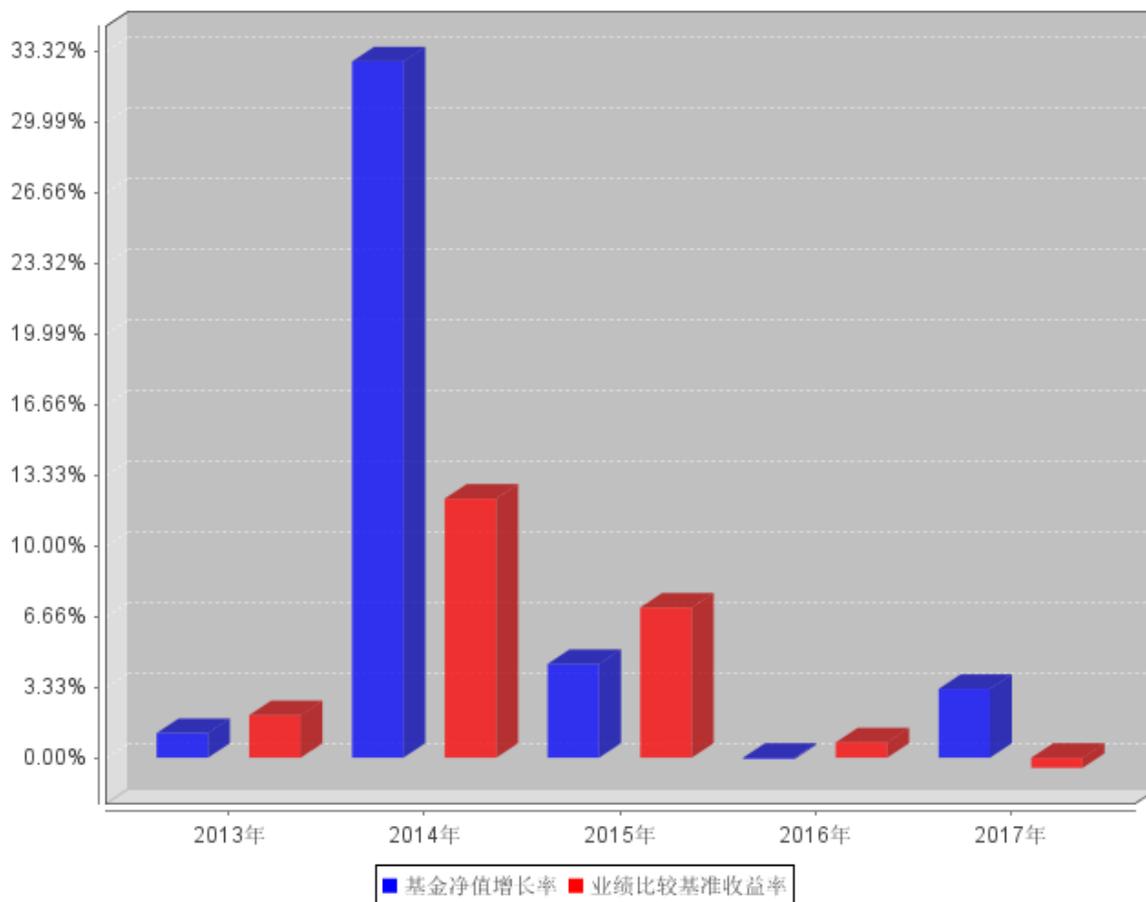
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10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
2017	-	-	-	-	
2016	4.110	914,828,728.47	17,465,117.88	932,293,846.35	
2015	0.440	1,933,838.20	3,036,778.39	4,970,616.59	
合计	4.550	916,762,566.67	20,501,896.27	937,264,462.94	

§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，在香港、北京分别设有子公司。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和特定客户资产管理业务资格。截至 2017 年 12 月 31 日，基金管理人共管理七十四只开放式基金，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		
马文祥	本基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券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，长盛盛鑫灵活配置混合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，固定收益部副总监。	2014 年 9 月 10 日	-	13 年	马文祥先生，1977 年 7 月出生。清华大学经济管理学院经济学硕士。历任中国农业银行主任科员，工银瑞信企业年金基金经理、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2013 年 8 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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

4.3.3 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，本基金未发生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

面对国内国际错综复杂的经济形势，17 年国内经济显示出超预期的韧性，GDP 实际同比增速达到 6.9%，录得近年来经济增速的首次反弹。其中既有海外经济复苏对进出口的拉动，又有国内供给侧改革及环保限产改善企业利润、房地产去库存拉动上下游产业链，显示我国经济整体正激发出较为强劲的内生动力。

在此过程中，债券市场全年持续调整，债券收益率整体上行幅度较大。在经济基本面较强、资金面中性偏紧和监管调控政策不断强化等因素综合影响下，债市收益率分别在 4-5 月、9-10 月出现大幅上行，四季度也基本维持在高位震荡态势。在“去杠杆”政策下，央行持续抬升政策利率，并控制流动性投放量，债券收益率曲线形态持续扁平化，期限错配放大杠杆的行为不再能够获得稳定正收益。

A 股市场整体回暖，结构性行情显著。2017 年全年上证综指上涨 6.56%，沪深 300 指数上涨 21.78%，创业板指下跌 10.67%。养老金入市、境外投资者入场等新形势下，A 股投资逻辑出现一定变化。市场总体呈现二八分化格局，白马股、消费股、绩优蓝筹股显著跑赢市场，保险、家电、食品饮料等板块有不错的表现。而一部分市值较小、基本面较差的股票在大幅下跌的同时，成交量也出现大幅萎缩。

以光大转债发行为标志，转债发行重启并逐步扩容，尤其是自 10 月份开始转债发行改为信用申购，转债市场加速扩容，市场规模从年初的不足 400 亿元迅速扩大到 1500 亿以上。在供给节奏的变化和权益市场波动的共同影响下，转债市场流动性和市场波动提升明显。市场热点也逐步转向行业龙头及优质标的，与 A 股市场呈现类似的结构分化。

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，控制组合久期，在信用风险可控的前提下重点配置中短期信用债，保持组合流动性。权益资产方面，根据市场风格变化，灵活调整权益资产比重，以避免净值大幅波动；精选具备估值优势和业绩成长潜力的股票和可转债，择机进行波段操作，提升组合收益。

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 1.1477 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.25%，业绩比较基准收益率为-0.48%。

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 2018 年，我国经济增长的结构和质量相比过去有望得到显著改善，经济运行的韧性和活力进一步增强，消费对 GDP 增长贡献率逐步提升，环保限产下大中企业盈利持续改善，旧城棚户区改造及基建投资托底下预计经济增速不会出现断崖式下跌。受汇率、资产价格以及政策防风险等因素制约，货币政策更趋于稳健中性。全球主要海外经济体经济温和复苏，通胀有所分化。

债券市场方面，在海内外经济和政策等多重因素影响下，预计债券收益率将维持高位震荡，“严监管、去杠杆”的监管大环境叠加稳健中性货币政策仍将制约市场收益率趋势下行，通胀预期抬头、海外市场减税加息也会对债市形成一定利空；从长期来看，较高的绝对收益水平将逐步提升固收类资产的配置价值。经济运行态势有利于低风险行业和企业，但是低评级高风险企业的信用风险可能持续上升。

股市方面，养老金入市、境外投资者入场等新形势带来权益市场投资逻辑的变化，预计业绩为王的结构性机会仍将持续，重点关注基本面持续改善、低估值高分红的大金融板块，环保限产带来盈利改善的周期性行业、满足人民美好生活需求的消费升级行业以及 5G 通信、半导体、创新药等科技主题机会。积极抓住权益市场机会，提升组合收益。

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并出具报告。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，本基金本报告期末实施利润分配。

本基金截至 2017 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 13,803,325.07 元，未分配利润已实现部分为 13,803,325.07 元，未分配利润未实现部分为 20,348,631.60 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长盛基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师薛竞、顾卓毅 2018 年 3 月 27 日对本基金 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2018)第 22123 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛全债指数增强型债券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	6,128,195.45	61,040,310.46
结算备付金	2,886,136.54	995,186.26
存出保证金	348,640.33	325,367.83
交易性金融资产	232,641,763.30	184,377,690.13
其中：股票投资	9,927,091.00	13,414,357.63
基金投资	-	-
债券投资	222,714,672.30	170,963,332.50
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	23,500,000.00	2,209,695,894.54
应收证券清算款	746,224.66	20,630,038.31
应收利息	3,861,699.93	7,694,987.67
应收股利	-	-
应收申购款	12,707.32	14,884.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	270,125,367.53	2,484,774,359.21
负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 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	45,383.73	21,789.09
应付管理人报酬	169,092.58	655,396.67
应付托管费	45,091.38	174,772.46
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	27,899.49	56,593.70
应交税费	4,354,204.85	4,354,204.85

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	174,178.88	84,210.55
负债合计	4,815,850.91	5,346,967.32
所有者权益：		
实收基金	231,157,559.95	2,230,441,746.87
未分配利润	34,151,956.67	248,985,645.02
所有者权益合计	265,309,516.62	2,479,427,391.89
负债和所有者权益总计	270,125,367.53	2,484,774,359.21

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1477 元，基金份额总额

231,157,559.95 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛全债指数增强型债券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	13,075,099.05	6,824,469.86
1. 利息收入	13,209,034.30	11,357,157.53
其中：存款利息收入	310,368.10	758,899.47
债券利息收入	11,485,754.07	7,864,254.41
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,412,912.13	2,734,003.65
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-922,841.74	-1,018,083.04
其中：股票投资收益	2,342,998.64	-1,114,811.51
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,457,792.12	40,182.81
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	191,951.74	56,545.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-944,597.59	-3,781,447.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,733,504.08	266,843.08
减：二、费用	3,397,825.28	3,114,131.53
1. 管理人报酬	2,229,434.48	1,923,477.80
2. 托管费	594,515.85	512,927.53

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	298,308.96	230,964.08
5. 利息支出	75,143.47	255,026.93
其中：卖出回购金融资产支出	75,143.47	255,026.93
6. 其他费用	200,422.52	191,735.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	9,677,273.77	3,710,338.33
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	9,677,273.77	3,710,338.33

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛全债指数增强型债券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	2,230,441,746.87	248,985,645.02	2,479,427,391.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,677,273.77	9,677,273.77
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）	-1,999,284,186.92	-224,510,962.12	-2,223,795,149.04
其中：1. 基金申购款	87,050,905.91	10,357,916.32	97,408,822.23
2. 基金赎回款	-2,086,335,092.83	-234,868,878.44	-2,321,203,971.27
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）	231,157,559.95	34,151,956.67	265,309,516.62
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	73,856,759.68	38,720,556.95	112,577,316.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,710,338.33	3,710,338.33
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）	2,156,584,987.19	1,138,848,596.09	3,295,433,583.28
其中：1. 基金申购款	2,477,048,339.21	1,186,542,297.31	3,663,590,636.52
2. 基金赎回款	-320,463,352.02	-47,693,701.22	-368,157,053.24
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）	-	-932,293,846.35	-932,293,846.35
五、期末所有者权益（基金净值）	2,230,441,746.87	248,985,645.02	2,479,427,391.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛全债指数增强型债券投资基金(原名为长盛中信全债指数增强型债券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]90号《关于同意长盛中信全债指数增强型债券投资基金设立的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金契约》(后更名为《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》)发起,并于2003年10月25日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币924,036,786.93元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第141号验资报告予以验证。募集期内产生的认购资金利息折合1,051,897.05份基金份额,分别计入各投资者基金账户。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》和本基金的基金管理人于2016年4月15日发布的《关于长盛中信全债指数增强型债券投资基金更名及变更业

绩比较基准的公告》，长盛中信全债指数增强型债券投资基金于 2016 年 4 月 15 日公告后更名为长盛全债指数增强型债券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛全债指数增强型债券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的各种债券、股票及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。作为债券型基金，本基金主要投资于各类债券品种，品种主要包括：国债、金融债、企业债与可转换债券。本基金对目标指数的投资在资产配置中的比例最低为 64%，股票投资在资产配置中的比例不超过 16%。自基金合同生效日至 2016 年 4 月 14 日本基金的业绩比较基准为：中信标普全债指数收益率×92%+中信标普 A 股综合指数收益率×8%。根据本基金的基金管理人于 2016 年 4 月 15 日发布的《关于长盛中信全债指数增强型债券投资基金更名及变更业绩比较基准的公告》，自 2016 年 4 月 15 日起本基金的业绩比较变更为标普中国全债指数收益率×92%+标普中国 A 股综合指数收益率×8%。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2018 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛全债指数增强型债券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

7.4.7 关联方关系

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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构

国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
国元证券	135,210,477.73	71.87%	39,158,113.17	25.97%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
国元证券	467,980,878.71	92.55%	40,380,380.60	40.87%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
国元证券	6,869,900,000.00	99.86%	12,315,100,000.00	93.40%

7.4.8.1.4 权证交易

注：无。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国元证券	125,919.20	71.87%	21,991.22	87.10%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国元证券	36,467.99	25.97%	12,791.18	23.46%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,229,434.48
其中：支付销售机构的客户维护费	190,983.45	226,211.71

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0.75%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×0.75% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日

当期发生的基金应支付的托管费	594,515.85	512,927.53
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人 中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.8.4.2 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：无。

7.4.8.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国农业银行	6,128,195.45	180,790.88	61,040,310.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 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 2017 年 12 月 31 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 40,206,210.00 元，属于第二层次的余额为 192,435,553.30 元，无属于第三层次的余额。(2016 年 12 月 31 日：第一层次 14,352,488.23 元，第二层次 170,025,201.90 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 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》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、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起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的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	9,927,091.00	3.67
	其中：股票	9,927,091.00	3.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	222,714,672.30	82.45
	其中：债券	222,714,672.30	82.45
	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	23,500,000.00	8.70
	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	9,014,331.99	3.34
8	其他各项资产	4,969,272.24	1.84
9	合计	270,125,367.53	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	192,482.00	0.07
C	制造业	5,692,872.00	2.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,192,905.00	0.45
E	建筑业	313,786.00	0.12
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	192,284.00	0.07
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	890,630.00	0.34
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	1,452,132.00	0.55
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	9,927,091.00	3.74

8.2.2 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。

8.3 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	600703	三安光电	80,000	2,031,200.00	0.77
2	600111	北方稀土	108,000	1,575,720.00	0.59
3	300070	碧水源	83,600	1,452,132.00	0.55
4	601985	中国核电	162,300	1,192,905.00	0.45
5	002415	海康威视	30,000	1,170,000.00	0.44
6	601336	新华保险	10,000	702,000.00	0.26
7	600104	上汽集团	9,800	313,992.00	0.12
8	601390	中国中铁	37,400	313,786.00	0.12
9	600060	海信电器	20,000	300,400.00	0.11
10	600028	中国石化	31,400	192,482.00	0.07

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

<http://www.csfunds.com.cn> 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600703	三安光电	7,679,381.00	0.31
2	601800	中国交建	5,708,822.00	0.23
3	601336	新华保险	5,652,220.00	0.23
4	601689	拓普集团	4,290,049.00	0.17
5	300070	碧水源	4,024,149.27	0.16

6	600276	恒瑞医药	3,765,729.47	0.15
7	600118	中国卫星	3,102,365.85	0.13
8	002439	启明星辰	3,085,876.00	0.12
9	300207	欣旺达	2,881,788.00	0.12
10	600518	康美药业	2,770,136.00	0.11
11	000021	深科技	2,716,484.00	0.11
12	601668	中国建筑	2,697,083.00	0.11
13	601766	中国中车	2,369,415.50	0.10
14	600111	北方稀土	2,263,824.00	0.09
15	002527	新时达	2,030,528.00	0.08
16	600893	航发动力	1,999,768.64	0.08
17	600150	中国船舶	1,930,623.10	0.08
18	600031	三一重工	1,759,953.00	0.07
19	601991	大唐发电	1,721,116.00	0.07
20	601872	招商轮船	1,505,677.00	0.06

8.4.2 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	600703	三安光电	7,101,454.40	0.29
2	601689	拓普集团	5,670,262.00	0.23
3	601800	中国交建	5,430,402.00	0.22
4	601336	新华保险	5,258,767.00	0.21
5	600276	恒瑞医药	4,887,340.00	0.20
6	601766	中国中车	3,720,877.00	0.15
7	300207	欣旺达	3,554,824.00	0.14
8	600118	中国卫星	3,393,859.00	0.14
9	002527	新时达	2,888,811.24	0.12
10	002439	启明星辰	2,867,472.00	0.12
11	601668	中国建筑	2,863,658.98	0.12
12	600518	康美药业	2,734,503.00	0.11
13	300070	碧水源	2,514,062.00	0.10
14	000021	深科技	2,485,356.00	0.10
15	300036	超图软件	2,382,912.28	0.10
16	600893	航发动力	2,283,800.00	0.09
17	601186	中国铁建	2,116,274.94	0.09

18	002273	水晶光电	2,072,187.00	0.08
19	601872	招商轮船	1,916,198.00	0.08
20	600150	中国船舶	1,905,682.24	0.08

8.4.3 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	90,700,914.88
卖出股票收入（成交）总额	97,436,656.59

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 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。

8.5 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	17,789,303.80	6.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	41,879,304.20	15.79
	其中：政策性金融债	41,879,304.20	15.79
4	企业债券	22,334,945.30	8.42
5	企业短期融资券	100,308,000.00	37.81
6	中期票据	10,124,000.00	3.82
7	可转债（可交换债）	30,279,119.00	11.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	222,714,672.30	83.95

8.6 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	011764063	17 京能源 SCP002	200,000	20,080,000.00	7.57
2	011758018	17 中核建 SCP001	200,000	20,070,000.00	7.56
3	011752057	17 东航股 SCP008	200,000	20,046,000.00	7.56
4	011756037	17 华电 SCP010	200,000	20,042,000.00	7.55

5	160213	16 国开 13	200,000	17,338,000.00	6.54
---	--------	----------	---------	---------------	------

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

本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。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	348,640.33
2	应收证券清算款	746,224.66
3	应收股利	-
4	应收利息	3,861,699.93
5	应收申购款	12,707.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	4,969,272.24
---	----	--------------

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110034	九州转债	6,667,910.00	2.51
2	120001	16 以岭 EB	2,611,000.00	0.98
3	110030	格力转债	1,684,160.00	0.63
4	127004	模塑转债	1,632,676.50	0.62
5	110033	国贸转债	577,650.00	0.22
6	128015	久其转债	454,914.90	0.17
7	113012	骆驼转债	75,302.80	0.03

8.11.5 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中不存在流通受限情况。

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,280	36,808.53	162,340,349.52	70.23%	68,817,210.43	29.77%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	0.00	0.0000%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年10月25日）基金份额总额	925,088,683.98
本报告期期初基金份额总额	2,230,441,746.87
本报告期基金总申购份额	87,050,905.91
减:本报告期基金总赎回份额	2,086,335,092.83
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	231,157,559.95

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

由于任期届满，高新不再担任公司董事长，周放生不再担任公司独立董事。根据公司 2016 年度股东会议决议，选举林培富为公司董事，选举张良庆为公司独立董事；根据公司第七届董事会第一次会议决议，选举周兵担任公司董事长；根据公司第七届董事会第二次会议决议，聘任林培富担任公司总经理，周兵不再担任公司总经理，同时林培富不再担任公司副总经理。以上公司高级管理人员变更，已于 2017 年 3 月 30 日向中国证监会北京监管局报备。

根据公司 2017 年第一次临时股东会议决议，同意张良庆先生不再担任公司第七届董事会独立董事职务，选举朱慈蕴女士担任公司第七届董事会独立董事。以上独立董事人员变更，已于 2018 年 1 月 9 日向中国证监会北京监管局报备。

11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付该会计师事务所审计费用 60,000.00 元，已连续为本基金提供审计服务 15 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国元证券	1	1,135,210,477.73	71.87%	125,919.20	71.87%	-
中山证券	1	52,927,093.74	28.13%	49,290.92	28.13%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国元证券	467,980,878.71	92.55%	6,869,900,000.00	99.86%	-	-
中山证券	37,661,899.24	7.45%	9,300,000.00	0.14%	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

- (2) 资力雄厚，信誉良好。
- (3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。
- (5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需 要，并能为本公司基金提供全面的信息服 务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；
- (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；
- (3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；
- (4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；
- (5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；
- (6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017 年 1 月 4 日至 2017 年 3 月 13 日	81,014,717.80	-	81,014,717.80	-	-
	2	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 1 月 3 日	1,309,748,177.15	-	1,309,748,177.15	-	-
	3	2017 年 1 月 4 日至 2017 年 1 月 4 日	67,512,152.31	-	67,512,152.31	-	-
	4	2017 年 1 月 4 日至 2017 年 12 月 31 日	67,602,802.74	80,536,017.90	-	148,138,820.64	64.09%

产品特有风险

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

长盛基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日