

# 长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 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.....	41
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
10.2 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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	46
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>48</b>
11.1 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.....	48

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金
基金简称	长盛医疗量化股票
基金主代码	002300
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 2 月 3 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	47,755,207.21 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于医疗行业的优质上市公司，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，通过运用量化投资策略，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金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，灵活配置医疗行业相关的上市公司股票和债券，谋求基金资产的长期稳定增长。</p> <p>（一）大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑：宏观经济指标；微观经济指标；市场指标；政策因素。本基金将通过深入分析上述指标与因素，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，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>（二）医疗行业界定</p> <p>本基金界定的医疗行业包括但不限于化学制药、生物制品、医疗器械、医药商业、中药、医疗服务、医疗检测、医疗信息化、医疗保险、保健品、心理健康及治疗、互联网医疗和医疗设备等领域，以及未来医疗模式、医疗技术和互联网技术创新演变出的其他领域。本基金投资于主营业务隶属上述领域的公司，和非主营业务提供的产品或服务隶属上述领域、且未来这些产品或服务可能成为其主要收入或利润来源的公司；同时投资于直接或间接受益于医疗行业发展的公司。</p> <p>（三）量化投资策略：基于 Black-Litterman 模型</p> <p>本基金在基于历史数据计算的基础上，通过 Black-Litterman 模型导入分析师的未来预期对马可威茨 (Markowitz) 有效边界模型进行优化，产生更稳定的有效边界组合，从而确定医疗行业中子行业权重配置。</p>

	(四) 精选个股 本基金将结合定性与定量分析, 评估医疗行业初选股票池内各只股票的经营状况、股票估值等影响股票走势的因素, 从中选择具有核心竞争优势和长期持续增长模式的公司, 组成本基金医疗行业优选股票库。
业绩比较基准	80%×中证全指医药卫生指数收益率+20%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金, 具有较高风险、较高预期收益的特征, 其风险和预期收益高于混合型基金、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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100088	100818
法定代表人		周兵	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层

### § 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	6,081,416.24
本期利润	5,431,020.12
加权平均基金份额本期利润	0.1167
本期加权平均净值利润率	10.34%
本期基金份额净值增长率	8.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	7,746,524.44
期末可供分配基金份额利润	0.1622
期末基金资产净值	55,501,731.65
期末基金份额净值	1.162
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	16.20%

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

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	-6.52%	1.61%	-6.71%	1.57%	0.19%	0.04%
过去三个月	0.61%	1.45%	-1.36%	1.30%	1.97%	0.15%
过去六个月	8.90%	1.40%	4.32%	1.22%	4.58%	0.18%
过去一年	13.26%	1.13%	6.82%	0.98%	6.44%	0.15%
自基金合同生效起至今	16.20%	0.93%	20.14%	0.94%	-3.94%	-0.01%

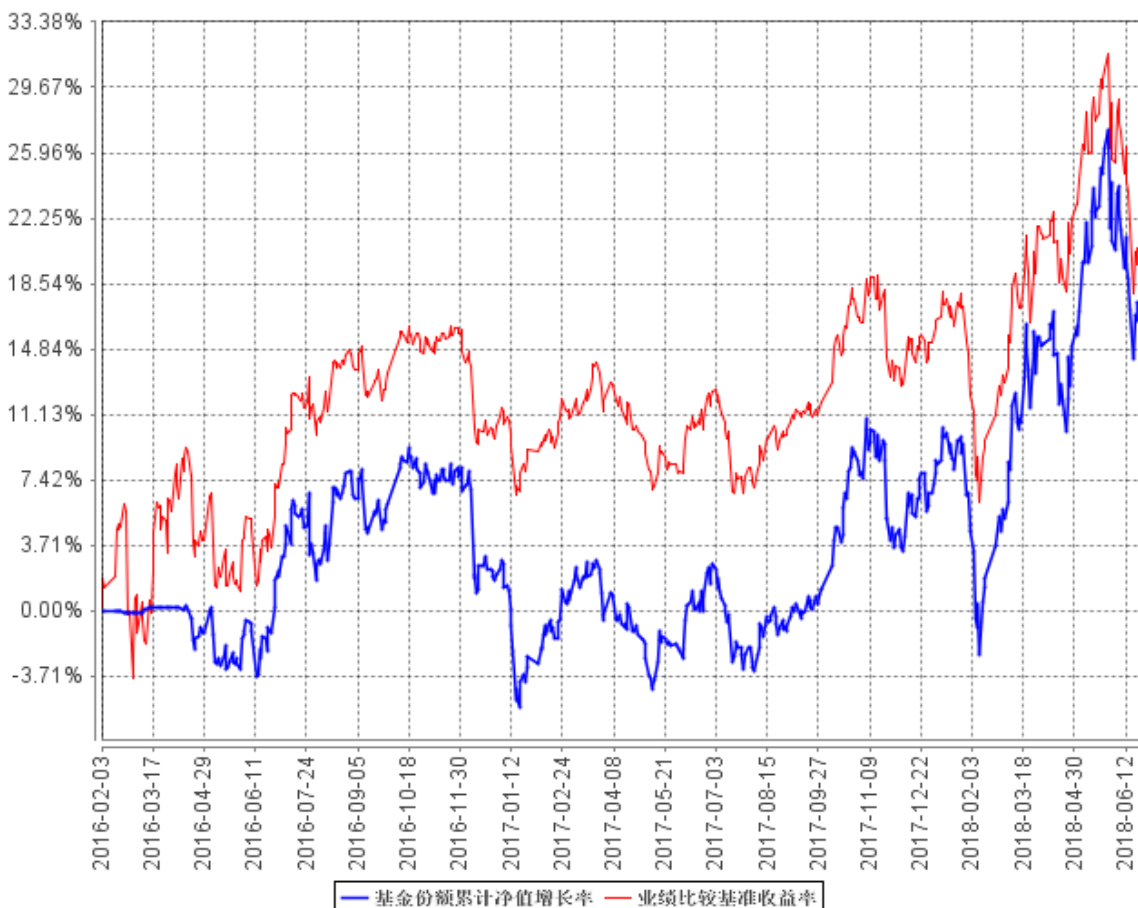
注：由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基



金合同要求，基准指数每日按照 80%、20%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



注：按照本基金合同规定，本基金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约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

## § 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		
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，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）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，长盛量化多策略灵活配置混合型	2017 年 5 月 18 日	-	11 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（金融风险经理）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。

	证券投资基金，长盛中小盘精选混合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。			
--	---	--	--	--

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

上半年股票市场呈现震荡下跌走势，个股和行业分化严重。行业上，休闲服务、医药生物和食品饮料等行业表现较好，小幅上涨，综合、通信和电气设备等行业表现较差。风格上，高市净率、高价股、绩优股等风格表现较好，亏损股、微利股和中价股等风格表现较差。

组合操作上，我们严格按照基金合同规定的投资流程，结合定性与定量分析从医疗相关行业中选取具有核心竞争优势和长期持续增长模式的股票构建投资组合，并根据宏观经济波动、行业周期和上市公司基本面等因素的变化，对投资组合进行调整和更新。

##### 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 1.162 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.90%，业绩比较基准收益率为 4.32%。

#### 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 年下半年的行情，宏观经济大概率平稳回落，经济结构将进一步优化，通胀水平保持稳定，去杠杆和防范金融风险是主要的政策线索，货币政策和财政政策将会保持适度灵活。来自外部的贸易争端会持续形成扰动。在此背景下，股票市场存在结构性机会，受益内部需求和改革增效的行业和板块有望持续获得超额收益，优质板块超跌后的修复行情将会提供阶段性超额收益。

#### 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。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，本报告期内未实施利润分配。

本基金截止 2018 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 7,746,524.44 元，其中：未分配利润已实现部分为 8,798,448.01 元，未分配利润未实现部分为 -1,051,923.57 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,814,793.45	3,778,059.63
结算备付金		43,971.22	33,862.01
存出保证金		24,192.18	13,288.52
交易性金融资产	6.4.7.2	44,663,797.08	74,256,918.78
其中：股票投资		44,663,797.08	70,082,940.78
基金投资		-	-
债券投资		-	4,173,978.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,466.25	99,659.72
应收股利		-	-
应收申购款		5,659,624.33	21,023.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		57,207,844.51	78,202,812.09
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,435,017.30	-
应付赎回款		94,665.39	2,193,484.49
应付管理人报酬		63,936.05	98,694.32
应付托管费		10,656.01	16,449.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	32,372.56	26,817.60

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	69,465.55	142,809.63
负债合计		1,706,112.86	2,478,255.10
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	47,755,207.21	70,997,444.38
未分配利润	6.4.7.10	7,746,524.44	4,727,112.61
所有者权益合计		55,501,731.65	75,724,556.99
负债和所有者权益总计		57,207,844.51	78,202,812.09

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.162 元，基金份额总额为 47,755,207.21 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金

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	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		6,094,003.80	797,371.66
1.利息收入		44,686.44	17,174.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,577.63	17,174.11
债券利息收入		24,108.81	-
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）		6,361,538.77	2,136,521.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,166,828.93	1,879,834.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,160.00	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	189,549.84	256,687.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-650,396.12	-1,379,853.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	338,174.71	23,529.64
<b>减：二、费用</b>		662,983.68	761,720.70



1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	390,286.73	469,658.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	65,047.86	78,276.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	135,594.01	142,367.10
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	6.4.7.20	72,055.08	71,418.57
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,431,020.12	35,650.96
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,431,020.12	35,650.96

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金

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）	70,997,444.38	4,727,112.61	75,724,556.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,431,020.12	5,431,020.12
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）	-23,242,237.17	-2,411,608.29	-25,653,845.46
其中：1.基金申购款	52,554,054.31	8,269,628.27	60,823,682.58
2.基金赎回款	-75,796,291.48	-10,681,236.56	-86,477,528.04
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）	47,755,207.21	7,746,524.44	55,501,731.65
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		



持证券、货币市场工具、权证、股指期货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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于医疗行业上市公司的股票和债券不低于非现金基金资产的 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需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金业绩比较基准：80%\*中证全指医药卫生指数收益率+20%\*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于 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 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 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	6,814,793.45
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	6,814,793.45

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	41,240,428.98	44,663,797.08	3,423,368.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	41,240,428.98	44,663,797.08	3,423,368.10

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	1,438.57
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	17.82
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.05
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	9.81
合计	1,466.25

**6.4.7.6 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	32,372.56
银行间市场应付交易费用	-
合计	32,372.56

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	39.38
预提费用	69,426.17
合计	69,465.55

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	70,997,444.38	70,997,444.38
本期申购	52,554,054.31	52,554,054.31
本期赎回(以“-”号填列)	-75,796,291.48	-75,796,291.48
本期末	47,755,207.21	47,755,207.21

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,310,552.32	2,416,560.29	4,727,112.61
本期利润	6,081,416.24	-650,396.12	5,431,020.12
本期基金份额交易产生的变动数	406,479.45	-2,818,087.74	-2,411,608.29
其中：基金申购款	6,970,071.27	1,299,557.00	8,269,628.27
基金赎回款	-6,563,591.82	-4,117,644.74	-10,681,236.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,798,448.01	-1,051,923.57	7,746,524.44

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	19,629.57
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	341.90
其他	606.16
合计	20,577.63

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	60,968,517.82
减：卖出股票成本总额	54,801,688.89
买卖股票差价收入	6,166,828.93



**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,160.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,160.00

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,302,456.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,174,190.00
减：应收利息总额	123,106.68
买卖债券差价收入	5,160.00

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

注：本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

注：本基金本报告期未取得衍生工具收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	189,549.84
基金投资产生的股利收益	-
合计	189,549.84

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	-650,396.12
——股票投资	-650,608.12
——债券投资	212.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-650,396.12

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	294,715.69
基金转换费收入	43,459.02
合计	338,174.71

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	135,594.01
银行间市场交易费用	-
合计	135,594.01

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	44,630.98
银行划款费用	2,628.91
合计	72,055.08

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

本基金并无需作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 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1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	390,286.73	469,658.55
其中：支付销售机构的客户维护费	113,605.07	163,451.68

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.5%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 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1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	65,047.86	78,276.48

注：支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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内均未运用固有资金投资本基金份额。

##### 6.4.10.4.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期及上年度末未持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1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
中国银行	6,814,793.45	19,629.57	4,388,193.67	16,378.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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。

##### 6.4.12.2 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	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
------	------	------	------	------	------	--------	-------	--------	--------	----

				单价						
002252	上海莱士	2018年2月23日	重大事项停牌	21.46	-	-	25,795	517,831.29	553,560.70	-
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	32,800	440,252.00	426,400.00	-
002437	誉衡药业	2018年6月11日	重大事项停牌	5.74	2018年8月13日	5.57	22,200	177,877.81	127,428.00	-
300238	冠昊生物	2018年2月2日	重大事项停牌	18.02	2018年7月18日	16.98	5,982	242,130.39	107,795.64	-

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。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本报告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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,814,793.45	-	-	-	6,814,793.45
结算备付金	43,971.22	-	-	-	43,971.22
存出保证金	24,192.18	-	-	-	24,192.18
交易性金融资产	-	-	-	44,663,797.08	44,663,797.08
应收利息	-	-	-	1,466.25	1,466.25
应收申购款	-	-	-	5,659,624.33	5,659,624.33
资产总计	6,882,956.85	-	-	50,324,887.66	57,207,844.51
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,435,017.30	1,435,017.30
应付赎回款	-	-	-	94,665.39	94,665.39
应付管理人报酬	-	-	-	63,936.05	63,936.05
应付托管费	-	-	-	10,656.01	10,656.01
应付交易费用	-	-	-	32,372.56	32,372.56
其他负债	-	-	-	69,465.55	69,465.55
负债总计	-	-	-	1,706,112.86	1,706,112.86
利率敏感度缺口	6,882,956.85	-	-	48,618,774.80	55,501,731.65
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,778,059.63	-	-	-	3,778,059.63
结算备付金	33,862.01	-	-	-	33,862.01
存出保证金	13,288.52	-	-	-	13,288.52

交易性金融资产	4,173,978.00	-	-	70,082,940.78	74,256,918.78
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	99,659.72	99,659.72
应收申购款	-	-	-	21,023.43	21,023.43
资产总计	7,999,188.16	-	-	70,203,623.93	78,202,812.09
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,193,484.49	2,193,484.49
应付管理人报酬	-	-	-	98,694.32	98,694.32
应付托管费	-	-	-	16,449.06	16,449.06
应付交易费用	-	-	-	26,817.60	26,817.60
其他负债	-	-	-	142,809.63	142,809.63
负债总计	-	-	-	2,478,255.10	2,478,255.10
利率敏感度缺口	7,999,188.16	-	-	67,725,368.83	75,724,556.99

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例	公允价值	占基金资 产净值比



		(%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	44,663,797.08	80.47	70,082,940.78	92.55
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	44,663,797.08	80.47	70,082,940.78	92.55

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合在过去一个年度的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	+5%	3,111,853.88	4,467,748.86
	-5%	-3,111,853.88	-4,467,748.86

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 43,448,612.74 元，属于第二层次的余额为人民币 1,215,184.34 元，无属于第三层次的余额。（2017 年 12 月 31 日：第一层次人民币 68,208,999.78 元，第二层次人民币 6,047,919.00 元，无属于第三层次的余额。）

##### (2) 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可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（2017 年：无）。

##### 6.4.14.2 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

注：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	44,663,797.08	78.07
	其中：股票	44,663,797.08	78.07
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	6,858,764.67	11.99
7	其他各项资产	5,685,282.76	9.94
8	合计	57,207,844.51	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	36,427,218.02	65.63
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	7,522,195.10	13.55
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	714,383.96	1.29

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	44,663,797.08	80.47

### 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所有股票投资明细

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	600276	恒瑞医药	58,502	4,432,111.52	7.99
2	002262	恩华药业	163,934	3,280,319.34	5.91
3	002422	科伦药业	90,000	2,889,000.00	5.21
4	000963	华东医药	54,000	2,605,500.00	4.69
5	002019	亿帆医药	124,863	2,203,831.95	3.97
6	000538	云南白药	19,800	2,117,808.00	3.82
7	000650	仁和药业	300,000	1,908,000.00	3.44
8	002007	华兰生物	55,000	1,768,800.00	3.19
9	600998	九州通	100,000	1,696,000.00	3.06
10	600196	复星医药	40,231	1,665,161.09	3.00
11	600085	同仁堂	45,300	1,598,184.00	2.88
12	600329	中新药业	79,912	1,518,328.00	2.74
13	600436	片仔癀	12,650	1,415,914.50	2.55
14	601607	上海医药	55,471	1,325,756.90	2.39
15	002020	京新药业	100,000	1,178,000.00	2.12
16	002589	瑞康医药	76,690	1,046,051.60	1.88
17	600062	华润双鹤	40,000	982,000.00	1.77
18	600056	中国医药	51,500	940,905.00	1.70
19	603367	辰欣药业	40,000	934,800.00	1.68
20	600518	康美药业	39,300	899,184.00	1.62
21	002773	康弘药业	17,100	889,371.00	1.60
22	300463	迈克生物	30,000	747,900.00	1.35
23	000028	国药一致	14,800	738,520.00	1.33
24	000513	丽珠集团	16,273	715,198.35	1.29
25	300015	爱尔眼科	22,124	714,383.96	1.29
26	002252	上海莱士	25,795	553,560.70	1.00
27	600521	华海药业	19,632	523,978.08	0.94
28	600201	生物股份	28,574	488,329.66	0.88
29	002001	新和成	24,480	464,140.80	0.84

30	000566	海南海药	32,800	426,400.00	0.77
31	002219	恒康医疗	30,700	323,578.00	0.58
32	002294	信立泰	7,900	293,643.00	0.53
33	002223	鱼跃医疗	12,600	245,574.00	0.44
34	600161	天坛生物	10,751	208,031.85	0.37
35	600216	浙江医药	14,800	188,996.00	0.34
36	300294	博雅生物	4,600	142,554.00	0.26
37	002550	千红制药	22,900	128,011.00	0.23
38	002437	誉衡药业	22,200	127,428.00	0.23
39	002332	仙琚制药	13,450	117,687.50	0.21
40	002462	嘉事堂	5,689	110,366.60	0.20
41	300238	冠昊生物	5,982	107,795.64	0.19
42	600771	广誉远	49	2,693.04	0.00

## 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	002007	华兰生物	3,752,104.00	4.95
2	600998	九州通	3,726,394.17	4.92
3	002422	科伦药业	3,013,818.00	3.98
4	000639	西王食品	2,358,212.00	3.11
5	002262	恩华药业	2,230,941.56	2.95
6	600276	恒瑞医药	1,784,897.60	2.36
7	002019	亿帆医药	1,759,302.74	2.32
8	000650	仁和药业	1,745,293.00	2.30
9	600329	中新药业	1,497,634.76	1.98
10	000963	华东医药	1,434,890.00	1.89
11	002382	蓝帆医疗	1,311,713.00	1.73
12	002020	京新药业	1,116,652.00	1.47
13	603367	辰欣药业	1,079,561.00	1.43
14	600062	华润双鹤	958,551.48	1.27
15	300142	沃森生物	890,820.00	1.18
16	300463	迈克生物	809,900.00	1.07
17	300558	贝达药业	562,468.00	0.74

**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	300142	沃森生物	3,863,265.00	5.10
2	600276	恒瑞医药	3,598,182.00	4.75
3	300347	泰格医药	2,969,301.55	3.92
4	600196	复星医药	2,730,762.00	3.61
5	002007	华兰生物	2,446,420.00	3.23
6	300122	智飞生物	2,376,992.00	3.14
7	600566	济川药业	2,143,904.00	2.83
8	300558	贝达药业	2,138,128.00	2.82
9	000963	华东医药	2,121,248.00	2.80
10	002382	蓝帆医疗	2,103,649.00	2.78
11	000639	西王食品	2,045,503.00	2.70
12	600436	片仔癀	2,035,969.00	2.69
13	000423	东阿阿胶	1,950,820.00	2.58
14	000999	华润三九	1,878,502.98	2.48
15	002737	葵花药业	1,849,845.00	2.44
16	600518	康美药业	1,841,197.00	2.43
17	600998	九州通	1,691,670.00	2.23
18	000915	山大华特	1,437,087.20	1.90
19	600285	羚锐制药	1,322,738.00	1.75
20	600976	健民集团	1,296,119.39	1.71

**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	30,033,153.31
卖出股票收入（成交）总额	60,968,517.82

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**

注：本基金本报告期末未持有债券。

**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**

注：本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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损益明细**

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明****7.11.1 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。

**7.11.2 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。

**7.11.3 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。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1**

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。

**7.12.2** 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。

**7.12.3 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	24,192.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,466.25
5	应收申购款	5,659,624.33

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,685,282.76

#### 7.12.4 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可转换债券（可交换债券）。

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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。



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
3,024	15,792.07	0.00	0.00%	47,755,207.21	100.00%

### 8.2 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	4,154.68	0.0087%

### 8.3 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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年2月3日）基金份额总额	332,476,665.65
本报告期期初基金份额总额	70,997,444.38
本报告期基金总申购份额	52,554,054.31
减：本报告期基金总赎回份额	75,796,291.48
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	47,755,207.21

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

#### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

原督察长叶金松先生因退休离任，由张利宁女士担任本公司督察长。

上述变更事项已经公司第七届董事会第七次会议审议通过，并按规定向相关监管机构备案。2018 年 4 月 27 日，中国证券监督管理委员会北京监管局作出《关于对长盛基金管理有限公司拟任合规负责人任职资格的意见》（京证监发〔2018〕136 号），对张利宁女士担任本公司督察长无异议。

#### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 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。

### 10.5 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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
方正证券	2	56,322,877.83	61.89%	41,189.05	61.89%	-
长江证券	2	28,309,305.54	31.11%	20,701.78	31.11%	-
东兴证券	2	6,369,487.76	7.00%	4,658.03	7.00%	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-

### 10.7.2 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
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,299,350.00	100.00%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

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、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	国盛证券	上海	1
2	国盛证券	深圳	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

## 10.8 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《上海证券报》及本公司网站	2018年6月30日
2	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金开通南京苏宁基金销售有限公司定投业务并参加定投申购优惠活动的公告	同上	2018年6月15日
3	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加恒宇天泽为销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2018年6月13日
4	长盛基金管理有限公司关于上海基煜基金销售有限公司参加费率优惠活动的公告	同上	2018年6月12日
5	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加银河证券申购（含定投）费率优惠活动的公告	同上	2018年5月21日
6	长盛基金管理有限公司高级管理人员督察长变更的公告	同上	2018年5月3日
7	长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金2018年第1季度报告	同上	2018年4月20日
8	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东海证券申购费率优惠活动的公告	同上	2018年4月2日
9	长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金2017年度报告	同上	2018年3月31日
10	长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金2017年度报告摘要	同上	2018年3月31日

11	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	同上	2018 年 3 月 30 日
12	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加展恒基金费率优惠活动的公告	同上	2018 年 3 月 26 日
13	长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2018 年 3 月 20 日
14	长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金招募说明书（摘要）	同上	2018 年 3 月 20 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 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。



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛医疗行业量化配置股票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。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金管理人互联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8月29日