

长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金
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

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 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..... | 8 |
| 2.5 其他相关资料..... | 8 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 9 |
| 3.2 基金净值表现..... | 9 |
| §4 管理人报告 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 16 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 6.1 资产负债表..... | 17 |
| 6.2 利润表..... | 18 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 19 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 20 |
| §7 投资组合报告..... | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 36 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 36 |
| 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..... | 37 |
| 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..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 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..... | 41 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 41 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 41 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 41 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 43 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 43 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 44 |
| §10 重大事件揭示..... | 45 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 45 |
| 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..... | 45 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 45 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 45 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 45 |
| 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..... | 45 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 46 |
| 10.8 其他重大事件..... | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51 |
| 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..... | 51 |

| | |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 51 |
| §12 备查文件目录..... | 52 |
| 12.1 备查文件目录..... | 52 |
| 12.2 存放地点..... | 52 |
| 12.3 查阅方式..... | 52 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------------|
| 基金名称 | 长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 长盛分享经济主题 |
| 基金主代码 | 004670 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 7 月 6 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 | 47,007,766.84 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 在中国产业结构转型和产业升级的背景下,把握分享经济相关产业发展中的投资机遇,深度挖掘具备投资价值的上市公司,满足投资人实现资本增值的投资需求。 |
| 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,灵活配置分享经济主题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) 大类资产配置策略</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) 股票投资策略</p> <p>1、分享经济主题的界定</p> <p>分享经济是指将所有者的闲置资源重复性地、有偿或无偿转让给其他社会成员使用,从而重新投入到经济活动与经济流通中并产生经济价值与社会效益的经济模式。分享经济将之前被闲置或浪费的资源利用起来,提升现有资源使用效率,实现个体的福利提升和社会整体的可持续发展,党的十八届五中全会公报明确指出“发展分享经济”。伴随互联网的普及和发展,分享经济已覆盖居民吃穿住行用等各种消费和服务的实体经济层面,形成了一种新的经济形态和商业模式。</p> <p>2、行业配置策略</p> <p>在初步构建分享经济主题股票池之后,本基金通过深入分析判断各细分领域的产业政策变化、景气状况,并结合可投资的规模和相对估值水平,适时调整各子领域的配置比例。</p> |

| | |
|--------|--|
| | <p>3、个股选择</p> <p>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,选择具有长期持续成长能力的公司。对备选分享经济主题相关上市公司,具体从公司基本状况、成长性评估和股票估值三个方面进行筛选。</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>(四) 权证投资策略</p> <p>本基金投资权证的原则是有利于基金资产增值和投资风险控制,具体权证投资的策略是:</p> <p>1、考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率 and 无风险收益率等要素,利用 Black - Scholes 模型、二叉树模型及其它权证定价模型计算权证合理价值。</p> <p>2、根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价(Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价值考量,决策买入、持有或沽出权证。</p> <p>(五) 股指期货投资策略</p> <p>本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货的投资。利用股指期货流动性好,交易成本低等特点,在市场向下带动净值走低时,通过股指期货快速降低投资组合的仓位,从而调整投资组合的风险暴露,避免市场的系统性风险,改善组合的风险收益特性;并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时,通过股指期货快速提高投资组合的仓位,从而提高基金资产收益。</p> <p>(六) 资产支持证券投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 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 | 《证券日报》 |
| 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 | 246,020.16 |
| 本期利润 | -445,514.12 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0162 |
| 本期加权平均净值利润率 | -1.44% |
| 本期基金份额净值增长率 | -1.70% |
| 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 | 4,722,834.36 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1005 |
| 期末基金资产净值 | 51,730,601.20 |
| 期末基金份额净值 | 1.100 |
| 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 | 10.00% |

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。

4、本基金基金合同生效日为2017年7月6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 | -5.34% | 0.67% | -3.57% | 0.64% | -1.77% | 0.03% |
| 过去三个月 | -3.85% | 0.71% | -4.07% | 0.57% | 0.22% | 0.14% |
| 过去六个月 | -1.70% | 0.93% | -4.61% | 0.58% | 2.91% | 0.35% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.00% | 0.83% | 0.26% | 0.48% | 9.74% | 0.35% |

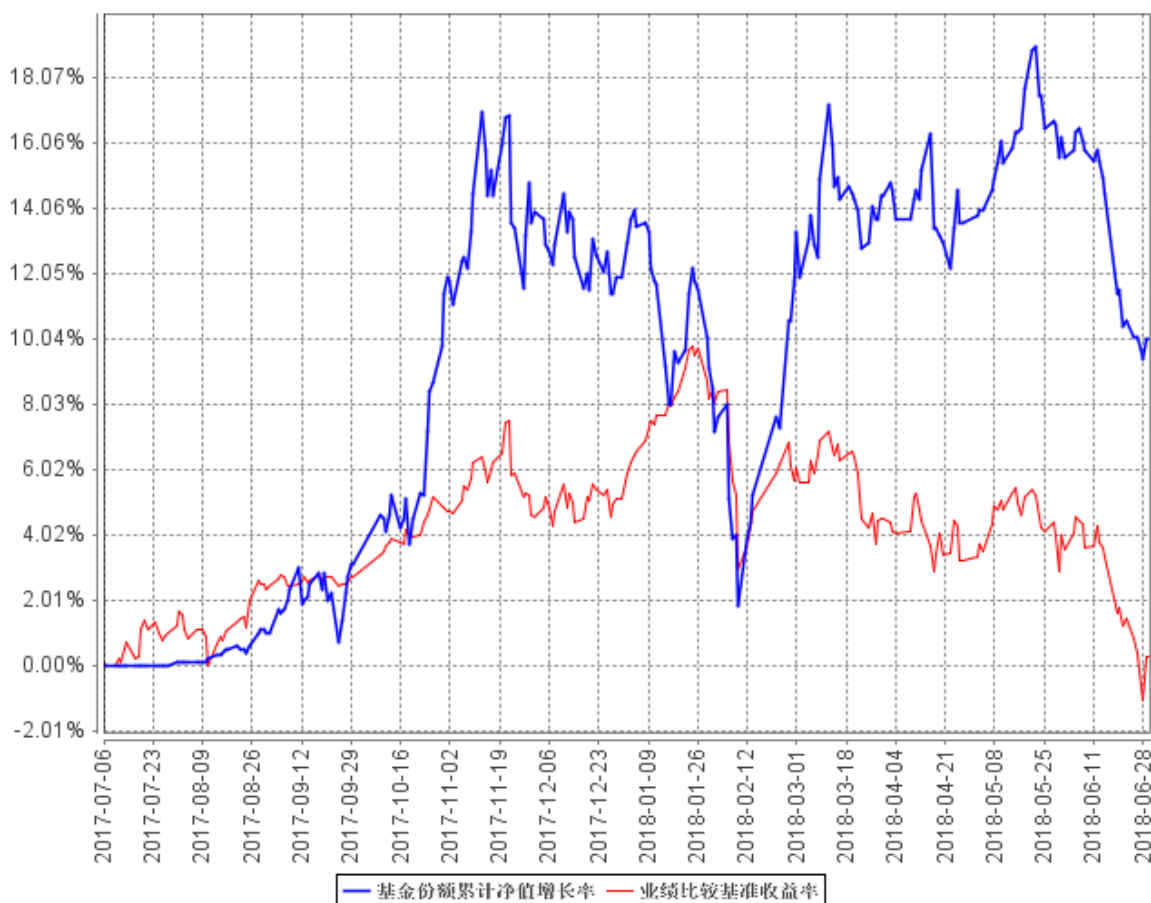
注：本基金业绩比较基准：50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率

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

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：1、本基金基金合同生效日为 2017 年 7 月 6 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------------------------------|------------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 钱文礼 | 本基金基金经理，长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 | 2017 年 10 月 27 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。年初受地产销售和供给侧改革拉动，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，导致对于宏观经济增长产生了较为悲观的预期，指数不断走弱。本基金上半年较大幅度降低了仓位，减小了对于受贸易摩擦情绪影响较大的消费电子等行业的配置，增加了对受贸易摩擦影响教小的半导体等行业的配置，重点加强细分行业绩持续增长个股的配置。

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 1.100 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.70%，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

展望下半年受贸易摩擦和国内信用收缩的影响，对外出口和国内固定资产投资有逐步走低的可能性，导致三季度宏观经济增速将逐步减缓。本基金将保持灵活仓位，重点选择行业景气度向上，业绩持续高增长的个股进行重点配置。行业选择上重点选择受宏观经济影响较小的教育，在线阅读，铁路运输等行业，回避受宏观经济影响较大的行业和受政府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 4,722,834.36 元，其中：未分配利润已实现部分为 11,232,027.33 元，未分配利润未实现部分为-6,509,192.97 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

本基金自 2018 年 01 月 08 日至 2018 年 03 月 16 日、2018 年 04 月 03 日至 2018 年 06 月 19 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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”）在长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金（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：长盛分享经济主题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 | 附注号 | 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 | 6.4.7.1 | 24,830,818.87 | 15,079,788.71 |
| 结算备付金 | | 341,647.37 | 331,603.25 |
| 存出保证金 | | 40,732.49 | 52,268.36 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 7,781,168.75 | 24,406,578.19 |
| 其中：股票投资 | | 7,781,168.75 | 22,276,777.69 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 2,129,800.50 |
| 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 | | 19,832,067.41 | 1,170,225.51 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 1,604.04 | 49,442.28 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 378.42 | 11,028,943.30 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 52,828,417.35 | 52,118,849.60 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 798,889.83 | - |
| 应付赎回款 | | 3,228.01 | 225,155.88 |
| 应付管理人报酬 | | 37,088.60 | 46,805.58 |
| 应付托管费 | | 6,181.44 | 7,800.93 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 145,959.45 | 200,681.84 |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 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 | 106,468.82 | 77,915.65 |
| 负债合计 | | 1,097,816.15 | 558,359.88 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 47,007,766.84 | 46,065,436.97 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 4,722,834.36 | 5,495,052.75 |
| 所有者权益合计 | | 51,730,601.20 | 51,560,489.72 |
| 负债和所有者权益总计 | | 52,828,417.35 | 52,118,849.60 |

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.100 元，基金份额总额为 47,007,766.84 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛分享经济主题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 | 附注号 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|
| 一、收入 | | 423,218.79 |
| 1.利息收入 | | 90,323.64 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 55,146.25 |
| 债券利息收入 | | 20,663.28 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 14,514.11 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 536,832.72 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 502,120.99 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -46.49 |
| 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 | 34,758.22 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -691,534.28 |
| 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 | 487,596.71 |
| 减：二、费用 | | 868,732.91 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 229,232.91 |

| | | |
|----------------------------|------------|-------------|
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 38,205.49 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 518,425.11 |
| 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 | 82,869.40 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -445,514.12 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -445,514.12 |

注：本基金合同于 2017 年 7 月 6 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：长盛分享经济主题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） | 46,065,436.97 | 5,495,052.75 | 51,560,489.72 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -445,514.12 | -445,514.12 |
| 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） | 942,329.87 | -326,704.27 | 615,625.60 |
| 其中：1.基金申购款 | 72,505,367.00 | 9,547,371.16 | 82,052,738.16 |
| 2.基金赎回款 | -71,563,037.13 | -9,874,075.43 | -81,437,112.56 |
| 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） | 47,007,766.84 | 4,722,834.36 | 51,730,601.20 |

注：本基金合同于 2017 年 7 月 6 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：

| | | |
|------------|------------|-----------|
| <u>林培富</u> | <u>刁俊东</u> | <u>龚珉</u> |
| 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

长盛分享经济主题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]1111 号文《关于准予长盛分享经济主题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 6 月 5 日至 2017 年 6 月 30 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_A06 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 7 月 6 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 7 月 4 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 257,993,279.90 元，折合 257,993,279.90 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 100,851.04 元，折合 100,851.04 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 258,094,130.94 元，折合 258,094,130.94 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、资产支持证券、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%，其中投资于分享经济主题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：沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

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 | 24,830,818.87 |
| 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： | 24,830,818.87 |

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 | 8,167,807.33 | 7,781,168.75 | -386,638.58 |
| 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 | 8,167,807.33 | 7,781,168.75 | -386,638.58 |

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 | 6,857.37 |
| 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 | 138.33 |
| 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 | -5,408.22 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 16.56 |
| 合计 | 1,604.04 |

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 | 145,959.45 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 145,959.45 |

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 | 2.05 |
| 预提费用 | 106,466.77 |
| 合计 | 106,468.82 |

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 | 46,065,436.97 | 46,065,436.97 |
| 本期申购 | 72,505,367.00 | 72,505,367.00 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -71,563,037.13 | -71,563,037.13 |
| 本期末 | 47,007,766.84 | 47,007,766.84 |

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

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 | 10,100,053.33 | -4,605,000.58 | 5,495,052.75 |
| 本期利润 | 246,020.16 | -691,534.28 | -445,514.12 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 885,953.84 | -1,212,658.11 | -326,704.27 |
| 其中：基金申购款 | 17,668,144.47 | -8,120,773.31 | 9,547,371.16 |
| 基金赎回款 | -16,782,190.63 | 6,908,115.20 | -9,874,075.43 |

| | | | |
|---------|---------------|---------------|--------------|
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 11,232,027.33 | -6,509,192.97 | 4,722,834.36 |

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 | 51,903.35 |
| 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 | 2,323.70 |
| 其他 | 919.20 |
| 合计 | 55,146.25 |

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 | 175,329,445.26 |
| 减：卖出股票成本总额 | 174,827,324.27 |
| 买卖股票差价收入 | 502,120.99 |

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 | -46.49 |
| 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 | -46.49 |

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 | 4,565,916.89 |

| | |
|-------------------------|--------------|
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,466,786.80 |
| 减：应收利息总额 | 99,176.58 |
| 买卖债券差价收入 | -46.49 |

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 | 34,758.22 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 34,758.22 |

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 | -691,534.28 |
| ——股票投资 | -692,814.08 |
| ——债券投资 | 1,279.80 |
| ——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 | -691,534.28 |

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 | 486,728.97 |

| | |
|---------|------------|
| 基金转换费收入 | 867.74 |
| 合计 | 487,596.71 |

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 | 518,425.11 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 518,425.11 |

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 | 39,671.58 |
| 账户维护费 | 13,500.00 |
| 汇划手续费 | 4,902.63 |
| 合计 | 82,869.40 |

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

本基金无需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：1、本基金于本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

2、本基金合同于 2017 年 7 月 6 日生效，无上年度可比期间。

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 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 229,232.91 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 106,408.89 |

注：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：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.2 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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 38,205.49 |

注：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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.3 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末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：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。

6.4.10.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 24,830,818.87 | 51,903.35 |

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：本基金于本报告期末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：本基金本报告期末未进行利润分配。

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有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同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 | 24,830,818.87 | - | - | - | 24,830,818.87 |
| 结算备付金 | 341,647.37 | - | - | - | 341,647.37 |
| 存出保证金 | 40,732.49 | - | - | - | 40,732.49 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 7,781,168.75 | 7,781,168.75 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 19,832,067.41 | 19,832,067.41 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,604.04 | 1,604.04 |
| 应收申购款 | - | - | - | 378.42 | 378.42 |
| 资产总计 | 25,213,198.73 | - | - | 27,615,218.62 | 52,828,417.35 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 798,889.83 | 798,889.83 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 3,228.01 | 3,228.01 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 37,088.60 | 37,088.60 |
| 应付托管费 | - | - | - | 6,181.44 | 6,181.44 |

| | | | | | |
|--------------------------|---------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 应付交易费用 | - | - | - | 145,959.45 | 145,959.45 |
| 其他负债 | - | - | - | 106,468.82 | 106,468.82 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,097,816.15 | 1,097,816.15 |
| 利率敏感度缺口 | 25,213,198.73 | - | - | 26,517,402.47 | 51,730,601.20 |
| 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 | 15,079,788.71 | - | - | - | 15,079,788.71 |
| 结算备付金 | 331,603.25 | - | - | - | 331,603.25 |
| 存出保证金 | 52,268.36 | - | - | - | 52,268.36 |
| 交易性金融资产 | 2,129,800.50 | - | - | 22,276,777.69 | 24,406,578.19 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,170,225.51 | 1,170,225.51 |
| 应收利息 | - | - | - | 49,442.28 | 49,442.28 |
| 应收申购款 | - | - | - | 11,028,943.30 | 11,028,943.30 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 17,593,460.82 | - | - | 34,525,388.78 | 52,118,849.60 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 225,155.88 | 225,155.88 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 46,805.58 | 46,805.58 |
| 应付托管费 | - | - | - | 7,800.93 | 7,800.93 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 200,681.84 | 200,681.84 |
| 其他负债 | - | - | - | 77,915.65 | 77,915.65 |
| 负债总计 | - | - | - | 558,359.88 | 558,359.88 |
| 利率敏感度缺口 | 17,593,460.82 | - | - | 33,967,028.90 | 51,560,489.72 |

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进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末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 | 7,781,168.75 | 15.04 | 22,276,777.69 | 43.21 |
| 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 | 7,781,168.75 | 15.04 | 22,276,777.69 | 43.21 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于本报告期末及上年度末，本基金成立未满一年，尚无充足的经验数据。

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 7,781,168.75 元，无属于第二层次及第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次人民币 22,276,777.69 元，第二层次人民币 2,129,800.50 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。

(3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

| | 交易性金融资产 | | 合计 |
|---|---------|------------|------------|
| | 债券投资 | 权益工具投资 | |
| 2017 年 12 月 31 日 | - | - | - |
| 购买 | - | - | - |
| 出售 | - | - | - |
| 转入第三层级 | - | 325,624.00 | 325,624.00 |
| 转出第三层级 | - | 263,744.00 | 263,744.00 |
| 计入损益的利得或损失 | - | -61,880.00 | -61,880.00 |
| 2018 年 6 月 30 日 | - | - | - |
| 2018 年 6 月 30 日仍持有的资产 计入 2018 年半年度损益的未实现 利得或损失的变动——公允 价值变动损益 | - | - | - |

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益 等项目。

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：于本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元的情况，出现该情况的时间范围为 2018 年 01 月 08 日至 2018 年 03 月 16 日、2018 年 04 月 03 日至 2018 年 06 月 19 日。

§ 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 | 7,781,168.75 | 14.73 |
| | 其中：股票 | 7,781,168.75 | 14.73 |
| 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 | 25,172,466.24 | 47.65 |
| 7 | 其他各项资产 | 19,874,782.36 | 37.62 |
| 8 | 合计 | 52,828,417.35 | 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 | 5,860,239.75 | 11.33 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 174,312.00 | 0.34 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,550,961.00 | 3.00 |
| 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 | 195,656.00 | 0.38 |
| 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 | 7,781,168.75 | 15.04 |

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 | 002475 | 立讯精密 | 77,281 | 1,741,913.74 | 3.37 |
| 2 | 600125 | 铁龙物流 | 185,300 | 1,550,961.00 | 3.00 |
| 3 | 600352 | 浙江龙盛 | 56,839 | 679,226.05 | 1.31 |
| 4 | 600703 | 三安光电 | 32,300 | 620,806.00 | 1.20 |
| 5 | 600271 | 航天信息 | 21,700 | 548,359.00 | 1.06 |
| 6 | 002236 | 大华股份 | 24,000 | 541,200.00 | 1.05 |
| 7 | 600623 | 华谊集团 | 41,300 | 412,174.00 | 0.80 |
| 8 | 002582 | 好想你 | 34,700 | 377,189.00 | 0.73 |
| 9 | 300433 | 蓝思科技 | 12,500 | 262,250.00 | 0.51 |
| 10 | 002600 | 领益智造 | 41,400 | 214,866.00 | 0.42 |
| 11 | 600036 | 招商银行 | 7,400 | 195,656.00 | 0.38 |
| 12 | 600900 | 长江电力 | 10,800 | 174,312.00 | 0.34 |
| 13 | 002281 | 光迅科技 | 8,174 | 173,288.80 | 0.33 |
| 14 | 600426 | 华鲁恒升 | 8,724 | 153,455.16 | 0.30 |
| 15 | 000063 | 中兴通讯 | 10,400 | 135,512.00 | 0.26 |

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 | 002475 | 立讯精密 | 6,639,896.41 | 12.88 |
| 2 | 600703 | 三安光电 | 4,845,059.00 | 9.40 |
| 3 | 300433 | 蓝思科技 | 4,323,732.60 | 8.39 |
| 4 | 002600 | 领益智造 | 3,686,082.00 | 7.15 |
| 5 | 002456 | 欧菲科技 | 3,447,195.60 | 6.69 |
| 6 | 300423 | 鲁亿通 | 2,978,273.16 | 5.78 |
| 7 | 601398 | 工商银行 | 2,938,881.00 | 5.70 |

| | | | | |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 8 | 002508 | 老板电器 | 2,815,144.00 | 5.46 |
| 9 | 002582 | 好想你 | 2,783,707.58 | 5.40 |
| 10 | 002384 | 东山精密 | 2,413,105.00 | 4.68 |
| 11 | 002281 | 光迅科技 | 2,395,353.00 | 4.65 |
| 12 | 600426 | 华鲁恒升 | 2,206,433.68 | 4.28 |
| 13 | 600125 | 铁龙物流 | 2,192,378.00 | 4.25 |
| 14 | 603799 | 华友钴业 | 2,126,700.00 | 4.12 |
| 15 | 600570 | 恒生电子 | 2,100,666.00 | 4.07 |
| 16 | 600498 | 烽火通信 | 2,064,504.00 | 4.00 |
| 17 | 002236 | 大华股份 | 1,941,302.00 | 3.77 |
| 18 | 300323 | 华灿光电 | 1,925,964.00 | 3.74 |
| 19 | 600584 | 长电科技 | 1,920,862.00 | 3.73 |
| 20 | 600446 | 金证股份 | 1,854,402.00 | 3.60 |
| 21 | 300498 | 温氏股份 | 1,840,006.00 | 3.57 |
| 22 | 600352 | 浙江龙盛 | 1,813,081.00 | 3.52 |
| 23 | 600271 | 航天信息 | 1,794,868.40 | 3.48 |
| 24 | 600900 | 长江电力 | 1,717,458.00 | 3.33 |
| 25 | 600036 | 招商银行 | 1,626,274.14 | 3.15 |
| 26 | 600571 | 信雅达 | 1,561,626.00 | 3.03 |
| 27 | 601939 | 建设银行 | 1,456,877.90 | 2.83 |
| 28 | 002402 | 和而泰 | 1,414,065.00 | 2.74 |
| 29 | 600623 | 华谊集团 | 1,409,129.00 | 2.73 |
| 30 | 000100 | TCL 集团 | 1,302,855.00 | 2.53 |
| 31 | 603601 | 再升科技 | 1,263,086.00 | 2.45 |
| 32 | 300465 | 高伟达 | 1,262,141.00 | 2.45 |
| 33 | 600000 | 浦发银行 | 1,230,984.00 | 2.39 |
| 34 | 002466 | 天齐锂业 | 1,220,384.00 | 2.37 |
| 35 | 002142 | 宁波银行 | 1,196,233.80 | 2.32 |
| 36 | 600487 | 亨通光电 | 1,195,066.00 | 2.32 |
| 37 | 600028 | 中国石化 | 1,185,799.00 | 2.30 |
| 38 | 603595 | 东尼电子 | 1,177,796.00 | 2.28 |
| 39 | 000049 | 德赛电池 | 1,172,444.00 | 2.27 |
| 40 | 002049 | 紫光国微 | 1,162,229.30 | 2.25 |
| 41 | 000886 | 海南高速 | 1,077,922.00 | 2.09 |
| 42 | 601818 | 光大银行 | 1,044,105.00 | 2.03 |
| 43 | 002648 | 卫星石化 | 1,035,886.00 | 2.01 |

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 | 600703 | 三安光电 | 7,169,598.27 | 13.91 |
| 2 | 002600 | 领益智造 | 4,914,894.72 | 9.53 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 4,614,414.41 | 8.95 |
| 4 | 300433 | 蓝思科技 | 3,939,583.20 | 7.64 |
| 5 | 600584 | 长电科技 | 3,809,446.82 | 7.39 |
| 6 | 002456 | 欧菲科技 | 3,444,729.00 | 6.68 |
| 7 | 300423 | 鲁亿通 | 2,938,357.07 | 5.70 |
| 8 | 002508 | 老板电器 | 2,923,095.30 | 5.67 |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 2,897,240.86 | 5.62 |
| 10 | 000049 | 德赛电池 | 2,787,727.24 | 5.41 |
| 11 | 603799 | 华友钴业 | 2,583,049.74 | 5.01 |
| 12 | 600031 | 三一重工 | 2,414,660.60 | 4.68 |
| 13 | 600176 | 中国巨石 | 2,373,098.90 | 4.60 |
| 14 | 600570 | 恒生电子 | 2,368,404.00 | 4.59 |
| 15 | 002582 | 好想你 | 2,365,397.40 | 4.59 |
| 16 | 002281 | 光迅科技 | 2,178,784.06 | 4.23 |
| 17 | 600498 | 烽火通信 | 2,100,680.00 | 4.07 |
| 18 | 600426 | 华鲁恒升 | 2,087,532.61 | 4.05 |
| 19 | 002384 | 东山精密 | 2,040,682.00 | 3.96 |
| 20 | 600446 | 金证股份 | 2,018,478.40 | 3.91 |
| 21 | 600050 | 中国联通 | 1,933,048.40 | 3.75 |
| 22 | 300498 | 温氏股份 | 1,893,321.00 | 3.67 |
| 23 | 300323 | 华灿光电 | 1,829,157.00 | 3.55 |
| 24 | 000039 | 中集集团 | 1,682,379.00 | 3.26 |
| 25 | 002402 | 和而泰 | 1,586,745.65 | 3.08 |
| 26 | 600571 | 信雅达 | 1,563,104.00 | 3.03 |
| 27 | 603005 | 晶方科技 | 1,554,629.00 | 3.02 |
| 28 | 600900 | 长江电力 | 1,509,908.00 | 2.93 |
| 29 | 601231 | 环旭电子 | 1,506,322.00 | 2.92 |
| 30 | 601939 | 建设银行 | 1,487,142.82 | 2.88 |
| 31 | 002236 | 大华股份 | 1,477,438.00 | 2.87 |
| 32 | 600036 | 招商银行 | 1,373,054.10 | 2.66 |
| 33 | 600066 | 宇通客车 | 1,357,100.95 | 2.63 |

| | | | | |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 34 | 002049 | 紫光国微 | 1,279,501.05 | 2.48 |
| 35 | 603601 | 再升科技 | 1,258,206.00 | 2.44 |
| 36 | 000886 | 海南高速 | 1,238,465.00 | 2.40 |
| 37 | 300465 | 高伟达 | 1,227,423.00 | 2.38 |
| 38 | 000100 | TCL 集团 | 1,220,221.00 | 2.37 |
| 39 | 002466 | 天齐锂业 | 1,207,362.58 | 2.34 |
| 40 | 002142 | 宁波银行 | 1,187,200.00 | 2.30 |
| 41 | 600028 | 中国石化 | 1,183,236.00 | 2.29 |
| 42 | 603595 | 东尼电子 | 1,180,694.20 | 2.29 |
| 43 | 600000 | 浦发银行 | 1,173,420.00 | 2.28 |
| 44 | 600487 | 亨通光电 | 1,163,073.18 | 2.26 |
| 45 | 600271 | 航天信息 | 1,161,798.00 | 2.25 |
| 46 | 002320 | 海峡股份 | 1,138,453.00 | 2.21 |
| 47 | 300348 | 长亮科技 | 1,116,919.00 | 2.17 |
| 48 | 002035 | 华帝股份 | 1,115,806.00 | 2.16 |
| 49 | 002648 | 卫星石化 | 1,115,802.00 | 2.16 |
| 50 | 600352 | 浙江龙盛 | 1,110,497.45 | 2.15 |
| 51 | 603929 | 亚翔集成 | 1,101,240.00 | 2.14 |
| 52 | 600016 | 民生银行 | 1,089,608.74 | 2.11 |
| 53 | 000735 | 罗牛山 | 1,041,089.00 | 2.02 |

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 | 161,024,529.41 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 175,329,445.26 |

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

根据 2017-07-31 处罚决定，浙江龙盛关于控股孙公司收到民事判决书的公告。江苏省南京市中级人民法院依照《中华人民共和国水污染防治法》第二十九条第一款、《中华人民共和国环境保护法》第六十四条、《中华人民共和国侵权责任法》第六十五条、《最高人民法院关于审理环境民事公益诉讼案件适用法律若干问题的解释》第二十二条的规定，判决如下：

（一）、被告德司达（南京）染料有限公司赔偿环境修复费用人民币 2,428.29 万元。

（二）、被告德司达（南京）染料有限公司应在本判决生效之日起六十日内，支付第一项所列款项的 50%，剩余款项于 2018 年 12 月 31 日前支付。

（三）、被告德司达（南京）染料有限公司在本判决生效后十日内给付原告江苏省环保联合会律师费 17 万元。

案件受理费 164,065 元，由被告德司达（南京）染料有限公司负担。本基金做出如下说明：

浙江龙盛是国内龙头染料企业，产业链完整，具有较强行业竞争力，公司基本面良好。基于相关研究，本基金判断，旗下浙江龙盛受到处罚，对浙江龙盛的影响较小，因为此次处罚是由于公司子公司环保管理疏忽而造成的一次性处罚，对公司经营持续性没有影响，处罚亦没有限制子

公司的经营，子公司及公司母体一直保持稳定经营。此次处罚，公司从中深刻吸取教训，引以为戒，继续进一步加强企业内部管理。我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，本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记录，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 | 40,732.49 |
| 2 | 应收证券清算款 | 19,832,067.41 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,604.04 |
| 5 | 应收申购款 | 378.42 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 19,874,782.36 |

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未存在流通受限情况。

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 |
| 552 | 85,159.00 | 16,157,091.56 | 34.37% | 30,850,675.28 | 65.63% |

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 | 218,869.03 | 0.4656% |

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 | 10~50 |
| 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（2017年7月6日）基金份额总额 | 258,094,130.94 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 46,065,436.97 |
| 本报告期基金总申购份额 | 72,505,367.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 71,563,037.13 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 47,007,766.84 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未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，无涉及基金管理人、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 | |
| 招商证券 | 1 | 179,074,626.39 | 53.24% | 166,773.34 | 53.24% | - |
| 长江证券 | 1 | 132,234,884.06 | 39.31% | 123,149.88 | 39.31% | - |
| 东兴证券 | 1 | 15,160,985.51 | 4.51% | 14,119.47 | 4.51% | - |
| 东北证券 | 1 | 9,883,478.71 | 2.94% | 9,204.47 | 2.94% | - |
| 华融证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 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 |
|------|--------------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 4,624,446.80 | 100.00% | 25,000,000.00 | 55.56% | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | 20,000,000.00 | 44.44% | - | - |
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |

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) 资历雄厚，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 | 方正证券 | 上海 | 1 |

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：

| 序号 | 证券公司名称 | 交易单元所属市场 | 数量 |
|----|--------|----------|----|
| 1 | 东莞证券 | 深圳 | 1 |

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 | 《证券日报》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 | 同上 | 2018年6月15日 |

| | | | |
|----|--|----|------------|
| | 有限公司定投业务并参加定投申购优惠活动的公告 | | |
| 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 |
| 8 | 长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金 2017 年度报告 | 同上 | 2018年3月31日 |
| 9 | 长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金 2017 年度报告摘要 | 同上 | 2018年3月31日 |
| 10 | 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 |
| 11 | 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 |
| 12 | 关于修改长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同等法律文件的公告 | 同上 | 2018年3月23日 |
| 13 | 长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新） | 同上 | 2018年3月23日 |
| 14 | 长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同 | 同上 | 2018年3月23日 |
| 15 | 长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议 | 同上 | 2018年3月23日 |
| 16 | 长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要 | 同上 | 2018年2月13日 |
| 17 | 长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更 | 同上 | 2018年2月13日 |

| | | | |
|----|--------------------------------------|----|-----------------|
| | 新) | | |
| 18 | 长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告 | 同上 | 2018 年 1 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

| 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 | 20180620~20180630 | 0.00 | 16,157,091.56 | 0.00 | 16,157,091.56 | 34.37% |
| 个人 | 1 | 20180101~20180107 | 9,873,429.08 | 0.00 | 9,873,429.08 | 0.00 | 0.00% |
| | 2 | 20180403~20180409 | 0.00 | 8,794,195.25 | 8,794,195.25 | 0.00 | 0.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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。</p> | | | | | | | |

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、《长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛分享经济主题灵活配置混合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