

长盛盛康纯债债券型证券投资基金  
(原长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金)  
2018 年年度报告

2018 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 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。

2018 年 11 月 20 日至 2018 年 12 月 19 日，长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金的基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议通过了《关于长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括调整基金名称、投资目标、投资范围、投资限制、投资策略、基金费用、业绩比较基准、风险收益特征、估值方法等。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。

自 2018 年 12 月 20 日起，长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型为长盛盛康纯债债券型证券投资基金，原《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效，《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》生效。

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 2018 年 12 月 20 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止（注：长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 19 日（基金转型前一日）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 (转型后) .....	6
2.1 基金基本情况 (转型前) .....	6
2.2 基金产品说明 (转型后) .....	6
2.2 基金产品说明 (转型前) .....	8
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	9
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现 (转型后) .....	11
3.2 基金净值表现 (转型前) .....	15
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	20
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>21</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	21
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	22
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	22
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.....	23
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	24
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	25
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	26
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	26
4.9 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.....	27
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>28</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	28
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.....	28
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.....	28
<b>§6 审计报告 (转型后)</b> .....	<b>29</b>
6.1 审计报告基本信息.....	29
6.2 审计报告的基本内容.....	29
<b>§6 审计报告 (转型前)</b> .....	<b>31</b>
6.1 审计报告基本信息.....	31
6.2 审计报告的基本内容.....	31
<b>§7 年度财务报表 (转型后)</b> .....	<b>33</b>
7.1 资产负债表 (转型后) .....	33
7.2 利润表.....	34
7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	35
7.4 报表附注.....	36
<b>§7 年度财务报表 (转型前)</b> .....	<b>56</b>
7.1 资产负债表 (转型前) .....	56

7.2 利润表.....	57
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	58
7.4 报表附注.....	59
<b>§8 投资组合报告（转型后）.....</b>	<b>83</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	83
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	83
8.3 报告期内股票投资组合的重大变动.....	84
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	84
8.5 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.....	84
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	85
8.7 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.....	85
8.8 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.....	85
8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	85
8.10 投资组合报告附注.....	85
<b>§8 投资组合报告（转型前）.....</b>	<b>88</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	88
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	88
8.3 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.....	88
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	88
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	90
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.....	90
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	90
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.....	90
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.....	90
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	91
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	91
8.12 投资组合报告附注.....	91
<b>§9 基金份额持有人信息（转型后）.....</b>	<b>94</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	94
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	94
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.....	94
<b>§9 基金份额持有人信息（转型前）.....</b>	<b>95</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	95
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	95
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.....	95
<b>§ 10 开放式基金份额变动(转型后).....</b>	<b>96</b>
<b>§ 10 开放式基金份额变动(转型前).....</b>	<b>97</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>98</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	98
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.....	98
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	98
11.4 基金投资策略的改变.....	98
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	99
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.....	99
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....	99

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前) .....	100
11.9 其他重大事件 (转型后) .....	101
11.9 其他重大事件 (转型前) .....	102
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>104</b>
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 .....	104
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	104
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>105</b>
13.1 备查文件目录.....	105
13.2 存放地点.....	105
13.3 查阅方式.....	105

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	长盛盛康纯债债券型证券投资基金	
基金简称	长盛盛康纯债	
基金主代码	003922	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 20 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	49,774,121.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长盛盛康纯债 A	长盛盛康纯债 C
下属分级基金的交易代码	003922	003923
报告期末下属分级基金的份额总额	41,635.71 份	49,732,485.30 份

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长盛盛康混合	
基金主代码	003922	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 2 月 13 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	49,774,121.01 份	
基金合同存续期	于 2018 年 12 月 19 日结束	
下属分级基金的基金简称	长盛盛康混合 A	长盛盛康混合 C
下属分级基金的交易代码	003922	003923
报告期末下属分级基金的份额总额	41,635.71 份	49,732,485.30 份

### 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	<p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。</p> <p>（二）债券组合管理策略</p> <p>1、利率策略</p> <p>利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。通过全面研究国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场</p>

	<p>资金供求状况变化趋势及结构,在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。</p> <p>组合久期是反映利率风险最重要的指标,根据对市场利率水平的变化趋势的预期,可以制定出组合的目标久期,预期市场利率水平将上升时,降低组合的久期;预期市场利率将下降时,提高组合的久期。</p> <p>利用收益率曲线斜度变化可以制定相应的债券组合期限结构策略,例如:子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。</p> <p>2、类属配置策略</p> <p>债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况,货币市场及资本市场资金供求关系,以及不同时期市场投资热点,分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利差水平,评定不同债券类属的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。</p> <p>3、信用策略</p> <p>信用品种的选择采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方式,在对宏观经济、利率走势、发行人经营及财务状况进行分析的基础上,结合信用品种的发行条款,建立信用债备选库,并以此为基础拟定信用品种的投资方法。</p> <p>4、相对价值策略</p> <p>本基金认为市场存在着失效的现象,短期因素的影响被过分夸大。债券市场的参与者众多,投资行为、风险偏好、财务与税收处理等各不相同,发掘存在于这些不同因素之间的相对价值,也是本基金发现投资机会的重要方面。本基金密切关注国家法律法规、制度的变动,通过深入分析市场参与者的立场和观点,充分利用因市场分割、市场投资者不同风险偏好或者税收待遇等因素导致的市场失衡机会,形成相对价值投资策略,为本基金的投资带来增加价值。</p> <p>5、债券选择策略</p> <p>根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度,结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素,确定其投资价值,选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。</p> <p>(三) 资产支持证券等品种投资策略</p> <p>包括资产抵押贷款支持证券 (ABS)、住房抵押贷款支持证券 (MBS) 等在内的资产支持证券,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估其内在价值。</p> <p>(四) 中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券,并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险,实现投资收益的最大化。本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况,对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础,结合定性和定量方法,注重对企业未来偿债能力的分析评估,根据评估结果对中小企业私募债券进行分类,以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度,并及时跟踪其信用风险的变化。</p>
业绩比较基准	中债综合指数 (全价) 收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期

	风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。
--	---------------------------------

## 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	通过优化的资产配置，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在严格控制风险的前提下力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>本基金将通过宏观、微观经济指标，市场指标，政策因素等，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>本基金通过对国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展的根本性因素进行分析，对处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置。在行业配置的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的办法，挑选具备较大投资价值的上市公司。</p> <p>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向，综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券投资组合。在实际的投资运作中，本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。</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，适当参与股指债券、国债期货及期权的投资。</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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	陆志俊
	联系电话	010-86497608	95559
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95559
传真		010-86497999	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		100029	200336
法定代表人		周兵	彭纯

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼 中建财富国际中心 3-5 层

## § 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

转型后

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 12 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	长盛盛康纯债 A	长盛盛康纯债 C
本期已实现收益	36.34	41,050.21
本期利润	73.41	84,638.14
加权平均基金份额本期利润	0.0018	0.0017
本期加权平均净值利润率	0.16%	0.16%
本期基金份额净值增长率	0.17%	0.16%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 31 日	
期末可供分配利润	2,482.58	2,162,641.25
期末可供分配基金份额利润	0.0596	0.0435
期末基金资产净值	44,749.05	52,636,859.80
期末基金份额净值	1.0748	1.0584
3.1.3 累计期末指标	2018 年 12 月 31 日	
基金份额累计净值增长率	0.17%	0.16%

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到 2018 年 12 月 31 日。

3、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。

4、长盛盛康纯债债券型证券投资基金由长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型而来，转型日期为 2018 年 12 月 20 日（即基金合同生效日）。

转型前

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日		2017 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	长盛盛康混合 A	长盛盛康混合 C	长盛盛康混合 A	长盛盛康混合 C
本期已实现收益	9.29	-260,306.55	13,182.45	23,609,672.00
本期利润	476.61	-436,618.76	13,798.29	23,731,627.15
加权平均基金份额本期利润	0.0094	-0.0016	0.0881	0.0481
本期加权平均净值利润率	0.88%	-0.15%	8.51%	4.70%
本期基金份额净值增长率	0.94%	0.61%	6.30%	5.03%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 12 月 19 日		2017 年末	
期末可供分配利润	2,446.24	2,121,591.04	4,408.40	21,649,019.79

期末可供分配基金份额利润	0.0588	0.0427	0.0630	0.0503
期末基金资产净值	44,675.64	52,552,221.66	74,391.28	452,395,897.38
期末基金份额净值	1.0730	1.0567	1.0630	1.0503
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2018年12月19日		2017年末	
基金份额累计净值增长率	7.30%	5.67%	6.30%	5.03%

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”均指长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金本报告期最后一日，即12月19日。

## 3.2 基金净值表现（转型后）

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛盛康纯债 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金转型起至今	0.17%	0.02%	0.42%	0.06%	-0.25%	-0.04%

长盛盛康纯债 C

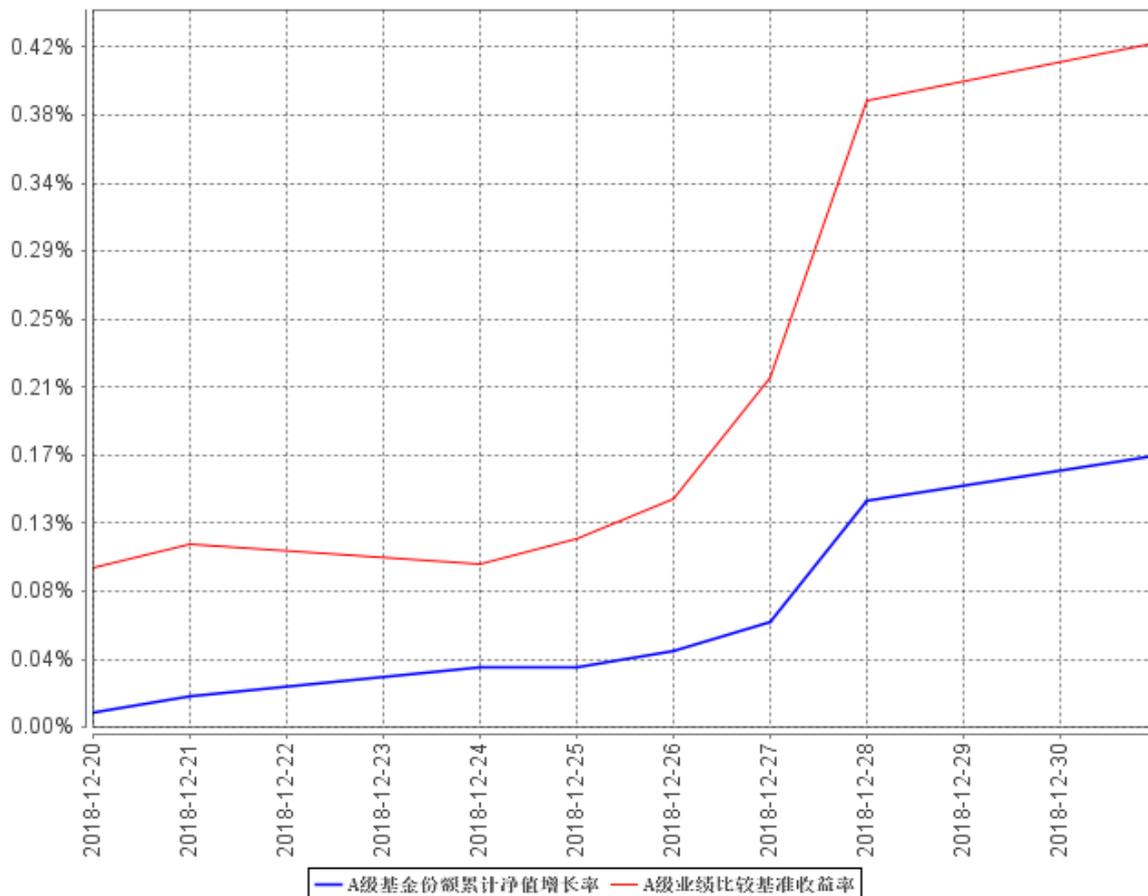
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金转型起至今	0.16%	0.02%	0.42%	0.06%	-0.26%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准：中债综合指数（全价）收益率

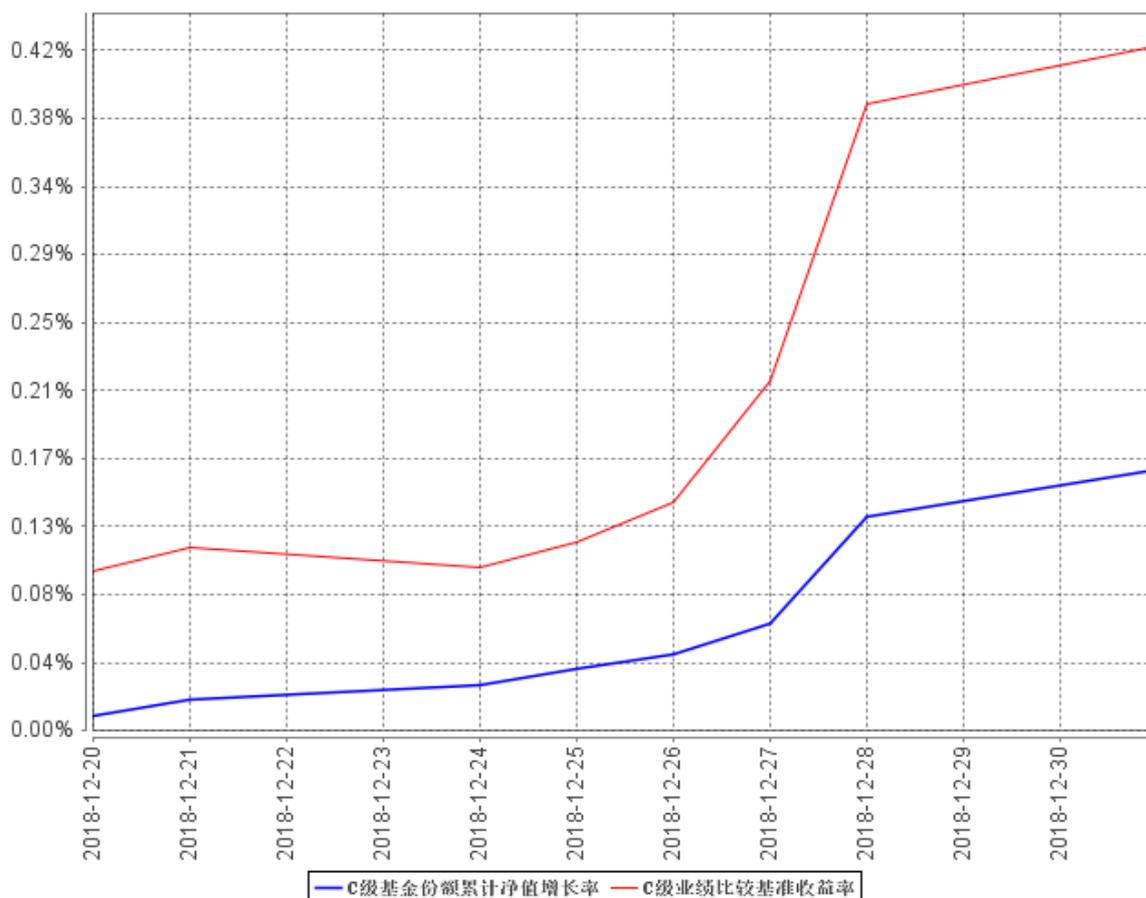
中债综合指数(全价)由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布,该指数样本具有广泛的市场代表性,涵盖了主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等)。本基金为债券型基金,投资范围为固定收益类金融工具,且本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发,可转换债券仅投资可分离交易可转债的纯债部分。鉴于中债综合指数(全价)能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况,所以以其收益率作为本基金的业绩比较基准。

### 3.2.2 自基金转型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

A级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



C级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

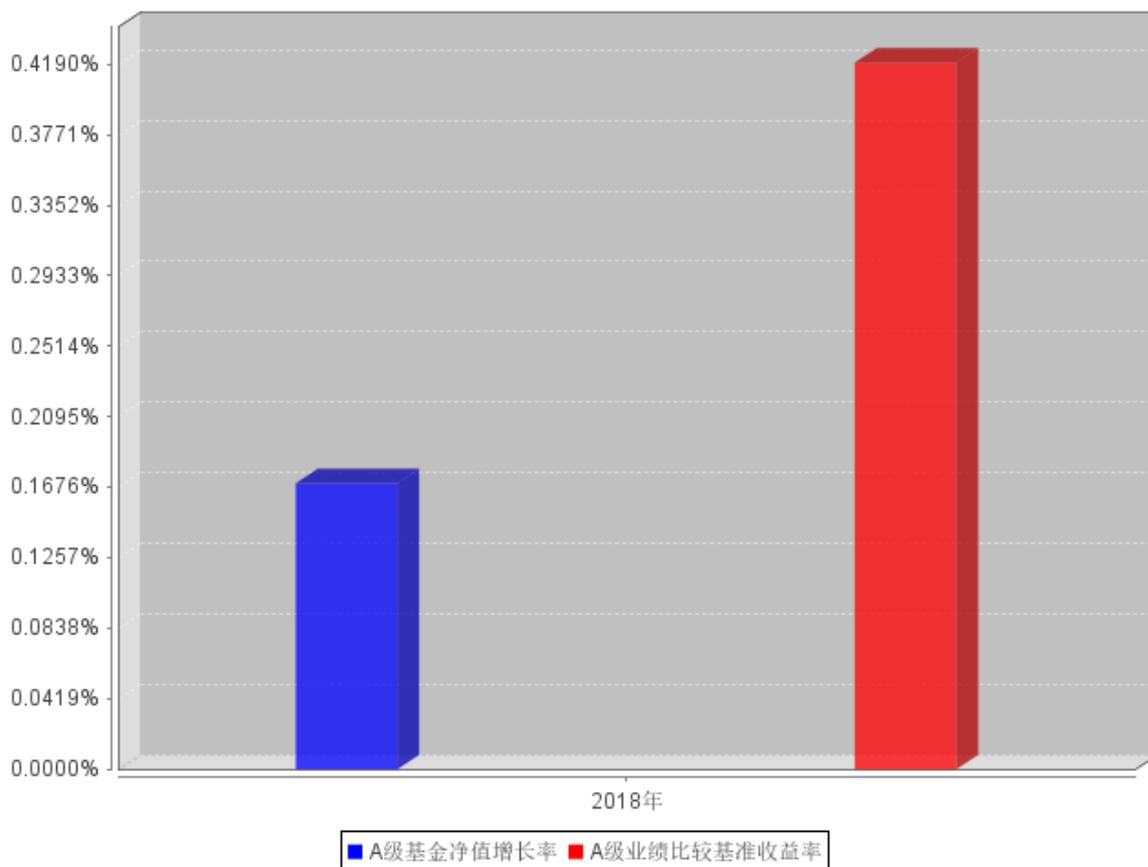


注：1、长盛盛康纯债债券型证券投资基金由长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型而来，转型日期为 2018 年 12 月 20 日（即基金合同生效日）。截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

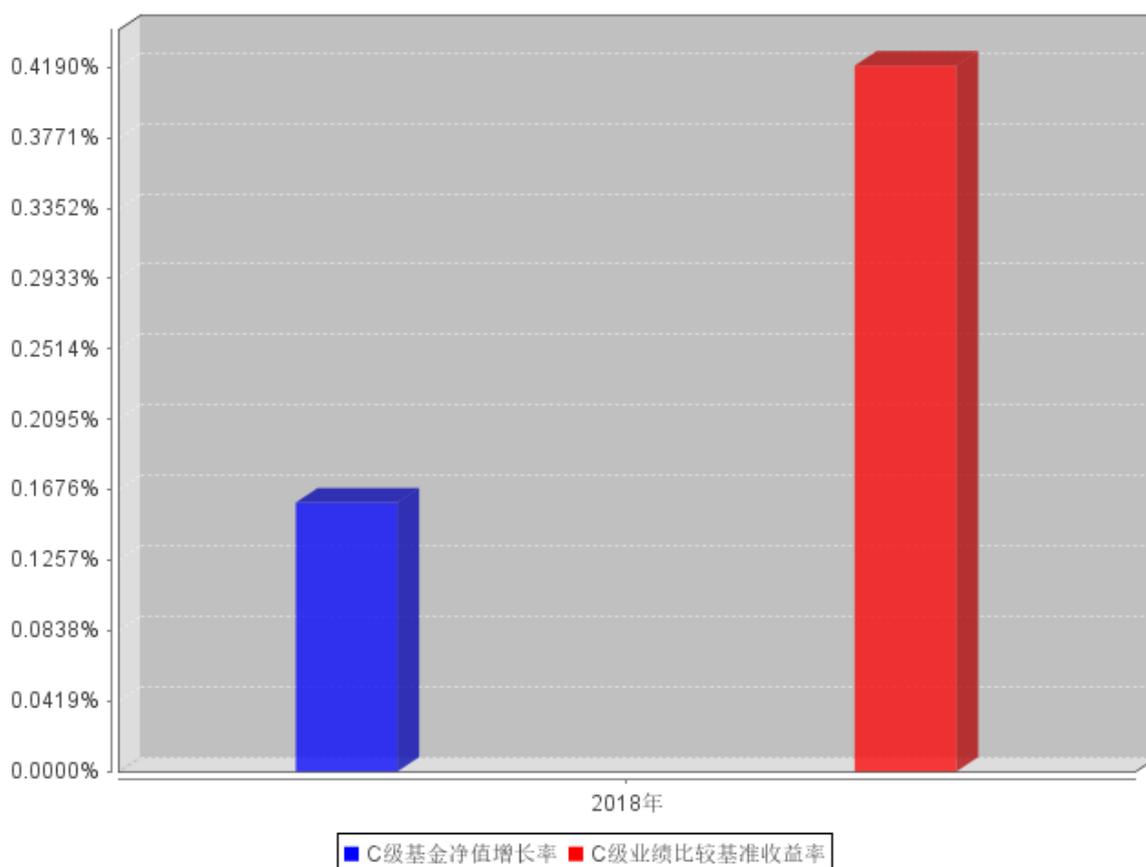
2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；在每个交易日日终，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 3.2.3 自基金转型以来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 A级自基金合同生效以来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



### C级自基金合同生效以来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



注：长盛盛康纯债债券型证券投资基金由长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型而来，转型日期为 2018 年 12 月 20 日（即基金合同生效日）。基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛盛康混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① ③	② ④
过去三个月	1.04%	0.09%	-3.96%	0.87%	5.00%	-0.78%
过去六个月	0.96%	0.10%	-4.18%	0.77%	5.14%	-0.67%
过去一年	0.94%	0.12%	-8.59%	0.67%	9.53%	-0.55%
自基金合同生效起至今	7.30%	0.10%	-0.12%	0.54%	7.42%	-0.44%

长盛盛康混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	③ ③	④ ④
过去三个月	1.01%	0.09%	-3.96%	0.87%	4.97%	-0.78%
过去六个月	0.88%	0.10%	-4.18%	0.77%	5.06%	-0.67%
过去一年	0.61%	0.12%	-8.59%	0.67%	9.20%	-0.55%
自基金合同 生效起至今	5.67%	0.10%	-0.12%	0.54%	5.79%	-0.44%

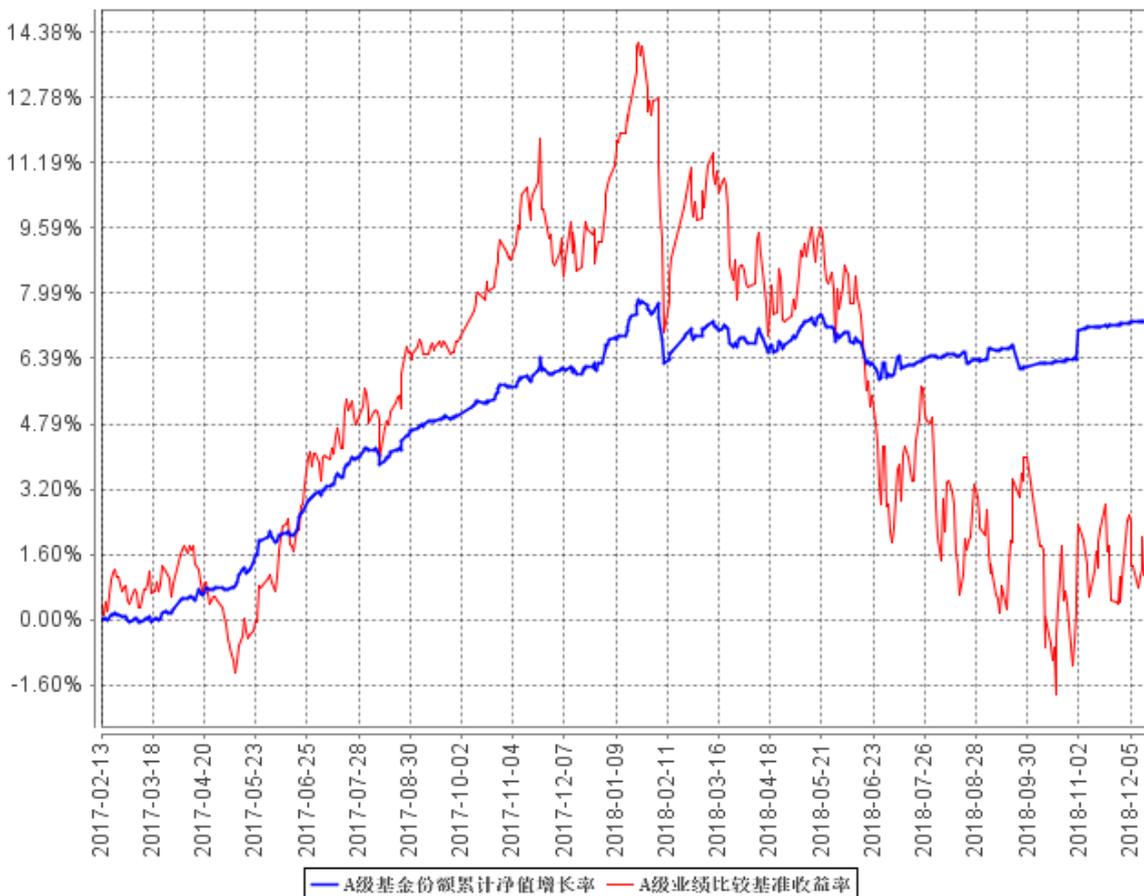
注：本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*50%+中证综合债指数收益率\*50%

基准指数的构建考虑了三个原则：

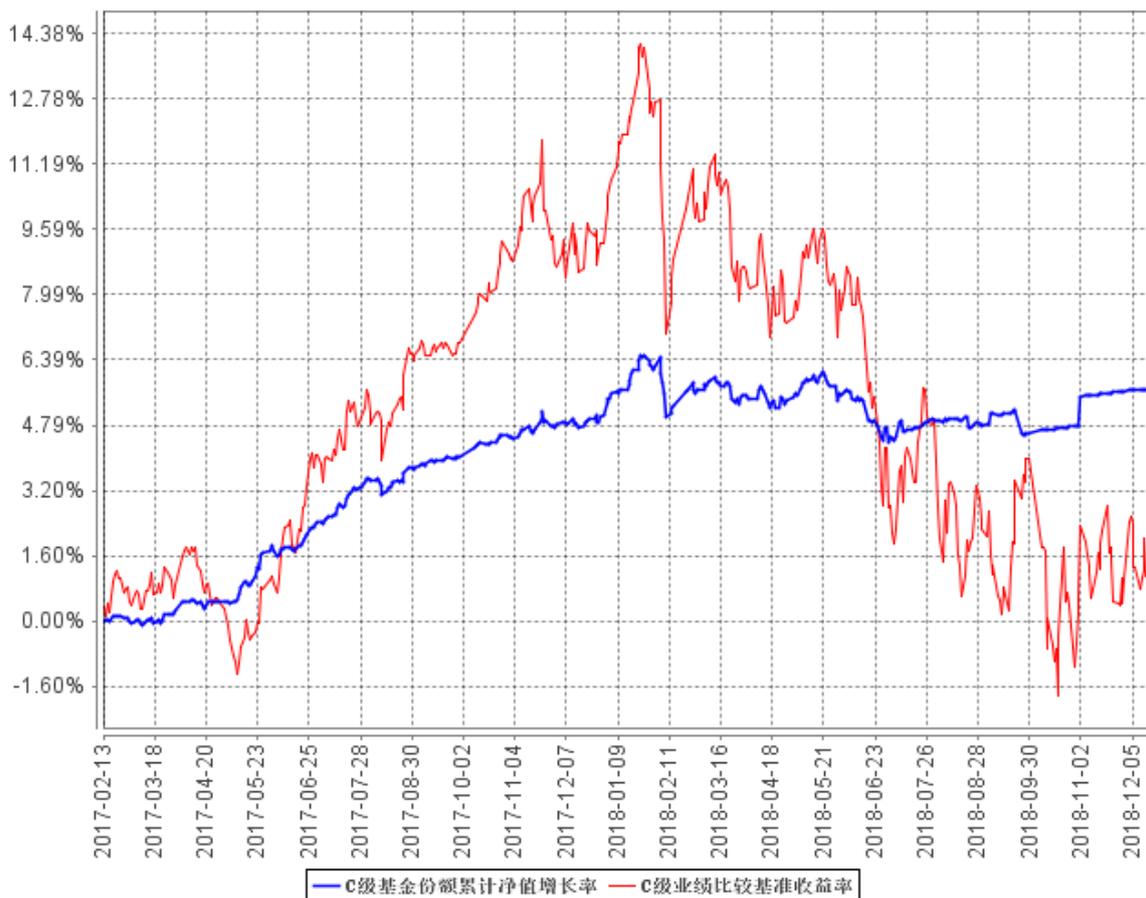
- 1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债指数。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的市场代表性；中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，该指数可以较为全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。
- 2、可比性。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；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

A级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



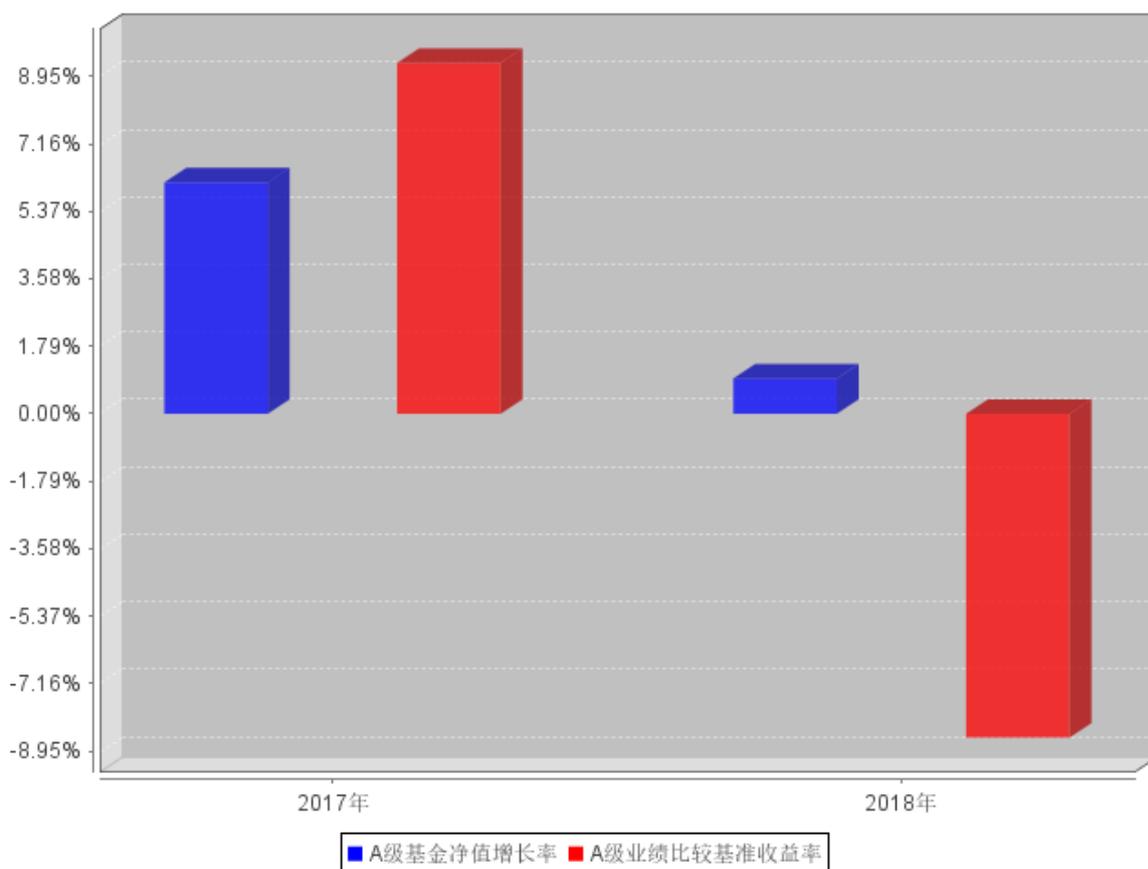
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



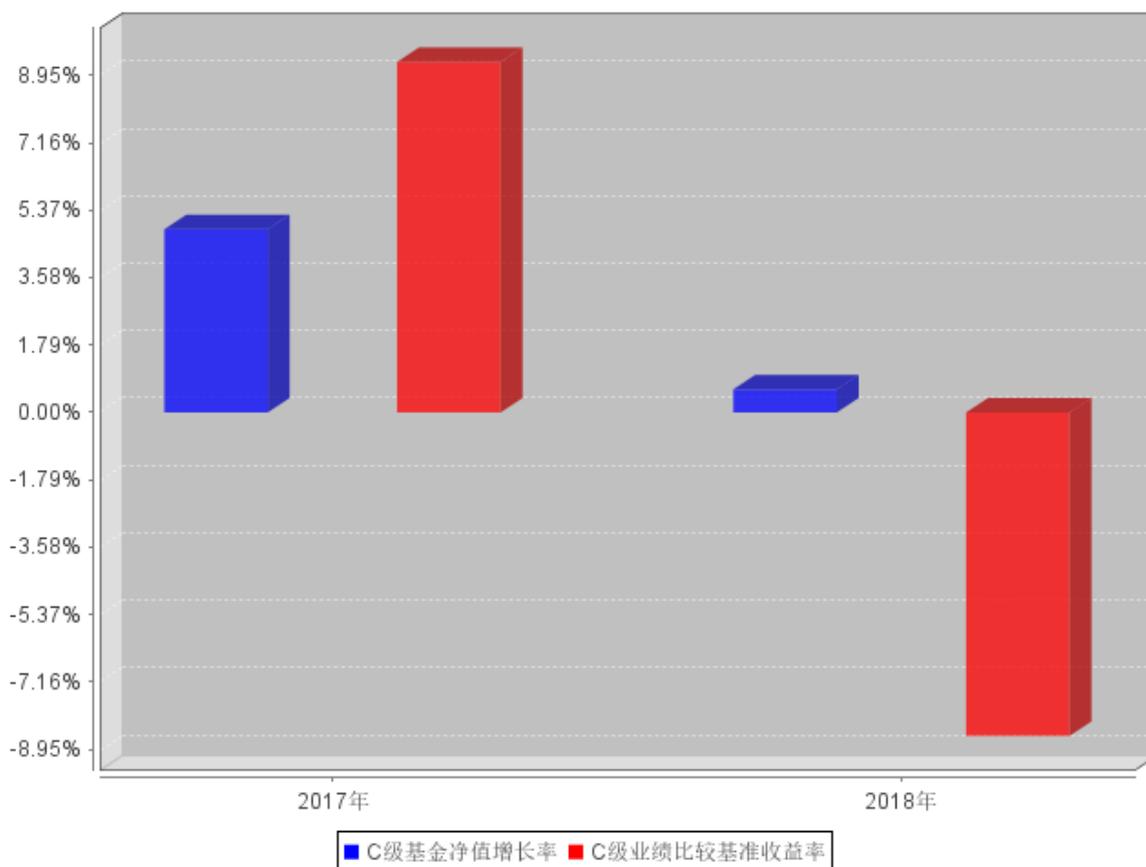
注：按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。截止报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 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

A级自基金合同生效以来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



C级自基金合同生效以来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



注：1、长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金合同于 2017 年 2 月 13 日生效，基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

2、长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金已于 2018 年 12 月 19 日完成转型，2018 年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金于 2017 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日、2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日（基金转型前一日）未进行利润分配。

长盛盛康纯债债券型证券投资基金于 2018 年 12 月 20 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日未进行利润分配。

## § 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%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格。截至 2018 年 12 月 31 日，基金管理人共管理五十八只开放式基金，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（转型后）

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		
杨衡	本基金基金经理，长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理，长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛杰一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。	2018 年 12 月 20 日	-	11 年	杨衡先生，1975 年 10 月出生。中国科学院数学与系统科学研究院博士、博士后。2007 年 7 月进入长盛基金管理有限公司，历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理、长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、报经中国证券投资基金业协会同意，自 2019 年 2 月 14 日起，蔡宾同志担任长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金经理。自 2019 年 2 月 14 日起，杨衡同志不再担任长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金经理。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
杨衡	本基金基金经理，长盛盛辉混 合型证券投资基金基金经理， 长盛盛崇灵活配置混合型证 券投资基金基金经理，长盛盛丰 灵活配置混合型证券投资基金 基金经理，长盛盛杰一年期定 期开放混合型证券投资基金基 金经理。	2017 年 2 月 13 日	2018 年 12 月 19 日	11 年	杨衡先生，1975 年 10 月出生。 中国科学院数学与系统科学 研究院博士、博士后。2007 年 7 月进入长盛基金管理公 司，历任固定收益研究员、 社保组合组合经理助理、社 保组合组合经理、长盛添利 30 天理财债券型证券投资基 金基金经理等职务。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

2018 年以来，中国经济运行内外交困，稳中趋缓。国际方面，一是贸易摩擦持续升级，虽然我国对出口依赖度已经降低，但出口作为前些年经济平稳发展的重要因素，对后续经济走势仍会带来较大影响；二是外围经济持续向好带动货币政策收紧，与我国国内经济下行压力加大步调相异。国内方面，投资和消费增速回落，特别是基建投资增速受制于债务风险管控、资金来源减少出现快速下降；地产投资在低库存的背景下保持较高增速，但地产调控仍然保持高压；制造业投资低位回升，但企业经营出现明显分化，下游、民营企业融资渠道收缩，经营压力持续加大，为后续制造业带来不确定性。居民杠杆较高导致消费被挤出，消费缺乏支撑。

为缓解经济下行压力，宏观调控政策做出适度调整。货币政策方面，中性偏紧的政策取向有所放松。金融去杠杆政策力度和节奏放缓，资管新规细则有所松动。央行适度增加中长期流动性供应，保持流动性合理充裕。2018 年 1 月、4 月、7 月和 10 月四次定向降准，并搭配中期借贷便利、抵押补充贷款等工具投放中长期流动性，资金利率中枢较年初明显下移。引导宽货币向宽信用转化，鼓励银行加大信贷投放力度。

2018 年全年债市整体偏暖。债券市场受经济放缓、通胀温和、货币政策放松、流动性充裕、贸易摩擦加剧、权益资产下跌等多重利好因素推动，债券到期收益率较年初大幅下行。

报告期内，A 股市场在 2018 年 1 月短暂冲高后回落，呈现持续盘跌走势，深市弱于沪市，市场整体成交活跃度明显下降。报告期内，IPO 发行基本延续每周一批的常态化发行节奏，但每批 IPO 家数和募集总金额减少，上市新股平均开板涨幅整体较过去有明显下行，部分次新股出现破发，新股申购收益收敛。

## 2、报告期内本基金投资策略分析

本报告期内，本基金坚持稳健操作思路，有针对性地加强基金投资者结构与组合资产流动性的匹配管理，密切跟踪基金规模变化，积极应对可能存在的大额赎回。

本报告期内，固定收益资产配置抓住市场资金利率的有利时机，坚持以 AAA 高信用评级短期银行存单 CD、中短期利率债等标的配置为主，适当降低组合久期，保持组合流动性，较好控制了利率风险、信用风险和流动性风险。

本报告期内，本基金 2018 年 7 月中旬清空了股票（除停牌股票外），之后未参与新股网下申购。2018 年 12 月，本基金完成由灵活配置混合基金转型为债券型基金的相关工作，并对组合持仓结构进行了调整。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，长盛盛康纯债 A 基金份额净值为 1.0748 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.17%；截至本报告期末长盛盛康纯债 C 基金份额净值为 1.0584 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.16%；同期业绩比较基准收益率为 0.42%。

截至 2018 年 12 月 19 日（基金转型前一日），长盛盛康混合 A 基金份额净值为 1.0730 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.94%；截至本报告期末长盛盛康混合 C 基金份额净值为 1.0567 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.61%；同期业绩比较基准收益率为-8.59%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年，从全球视角看，在贸易战博弈明朗之前，紧缩大环境对于非美经济体的冲击趋势仍难以扭转。从国内视角看，在大规模实质性宽松政策实施前，股票市场虽然可能存在结构性的机会，但发生系统性趋势转变仍在酝酿。预期未来随着宏观政策转向边际叠加，经过传导机制后，持续调整的权益市场有望在“稳杠杆”环境下出现修复。

债券市场方面，维持宏观经济下行、通胀温和、货币政策稳健中性的判断，预计基本面、政策面、资金面整体仍有利于债市。一方面，经济基本面下行压力仍存，货币政策取向或将维持放松，金融去杠杆政策力度和节奏放缓，资管新规细则有所松动，货币宽松格局下，流动性总体维

持充裕。另一方面，短期不利因素对债券市场的冲击和扰动也需要关注，如通胀预期升温、宽信用和扩基建超预期以及美联储持续加息的累积效应。但我们认为债券市场短期的调整振荡或带来波段交易机会。未来一个时期，本基金拟以固定收益资产配置为主。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合规运作，保障资产委托人利益出发，结合监管要求、市场形势及自身业务发展需要，由独立于业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产的运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时督促相关部门改进，并定期制作检查报告报送公司管理层。具体工作情况如下：

1、强调合规宣导与培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种形式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，深化员工合规理念，提高员工合规意识，改善员工合规工作技能，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、持续推动公司完善制度规章建设，扎实公司内控制度基础。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时督促业务部门调整相关业务制度与流程，保证公司制度规章的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司新订或修订了《公司基金从业人员从业资格管理规定》《公司非居民金融账户涉税信息收集及信息报送制度》《长盛基金管理有限公司投资管理制度》《长盛基金管理有限公司关联交易管理制度》《长盛基金管理有限公司员工合规手册》《公司投研体系重大突发事件快速响应流程》《公司场内期权投资管理办法》《公司投资产品风险评级管理制度》《公司及员工廉洁从业管理规定》等多部制度或流程。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》的规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，严肃制度规章执行力，合理保障公司运营及受托资产投资运作合规。报告期内，公司监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核四十余项，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、产品开发、员工行为等。此外，根据业务发展需要、监管机构通报的业内问题，以及公司在日常监督中发现的问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，合理保障公司及受托资产合规、稳健运作。

5、积极参与新产品设计、新业务拓展工作，提供合规意见或建议。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

#### 4.7 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债金融估值中心有限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。

#### 4.8 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 2018 年度未实施利润分配。

本基金截至 2018 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 2,165,123.83 元，其中：长盛盛康纯债 A 期末可供分配利润为 2,482.58 元（长盛盛康纯债 A 的未分配利润已实现部分为 2,482.58 元，未分配利润未实现部分为 630.76 元），长盛盛康纯债 C 期末可供分配利润为 2,162,641.25 元（长盛盛康纯债 C 的未分配利润已实现部分为 2,162,641.25 元，未分配利润未实现部分为 741,733.25 元）。

本基金截至 2018 年 12 月 19 日 (基金转型前一日), 期末可供分配利润为 2,124,037.28 元, 其中: 长盛盛康混合 A 期末可供分配利润为 2,446.24 元 (长盛盛康混合 A 的未分配利润已实现部分为 2,446.24 元, 未分配利润未实现部分为 593.69 元), 长盛盛康混合 C 期末可供分配利润为 2,121,591.04 元 (长盛盛康混合 C 的未分配利润已实现部分为 2,121,591.04 元, 未分配利润未实现部分为 698,145.32 元)。

#### **4.9 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

2018 年度, 基金托管人在长盛盛康纯债债券型证券投资基金及长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议, 尽职尽责地履行了托管人应尽的义务, 不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2018 年度, 长盛基金管理有限公司在长盛盛康纯债债券型证券投资基金及长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上, 托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配, 符合基金合同的规定。

### 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

2018 年度, 由长盛基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关长盛盛康纯债债券型证券投资基金及长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 审计报告（转型后）

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 22278 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛盛康纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了长盛盛康纯债债券基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 12 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛盛康纯债债券基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	长盛盛康纯债债券基金的基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长盛盛康纯债债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长盛盛康纯债债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督长盛盛康纯债债券基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	长盛盛康纯债债券基金的基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或

	<p>错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长盛盛康纯债债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长盛盛康纯债债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长盛盛康纯债债券基金的财务报告过程。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长盛盛康纯债债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛盛康纯债债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞   叶尔甸
会计师事务所的地址	中国·上海市
审计报告日期	2019 年 3 月 27 日

## § 6 审计报告（转型前）

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 22277 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了长盛盛康混合基金 2018 年 12 月 19 日(基金转型前一日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日(基金转型前一日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于长盛盛康混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	长盛盛康混合基金的基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估长盛盛康混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算长盛盛康混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督长盛盛康混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一

重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长盛盛康混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛盛康混合基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	叶尔甸
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2019年3月27日	

## § 7 年度财务报表 (转型后)

## 7.1 资产负债表 (转型后)

会计主体: 长盛盛康纯债债券型证券投资基金

报告截止日: 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	7.4.7.1	1,437,901.43
结算备付金		277,272.73
存出保证金		23,257.81
交易性金融资产	7.4.7.2	47,184,972.00
其中: 股票投资		-
基金投资		-
债券投资		47,184,972.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	3,400,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	947,051.85
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		53,270,455.82
<b>负债和所有者权益</b>		
	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
<b>负债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		398,275.21
应付赎回款		-
应付管理人报酬		21,617.39
应付托管费		4,121.98
应付销售服务费		4,464.19
应付交易费用	7.4.7.7	1,368.20
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	159,000.00
负债合计		588,846.97
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	49,774,121.01
未分配利润	7.4.7.10	2,907,487.84
所有者权益合计		52,681,608.85
负债和所有者权益总计		53,270,455.82

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金份额总额 49,774,121.01 份，其中长盛盛康纯债债券型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.0748 元，A 类基金份额 41,635.71 份；长盛盛康纯债债券型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.0584 元，C 类基金份额 49,732,485.30 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2018 年 12 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛盛康纯债债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 12 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 12 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		99,708.00
1. 利息收入		59,083.00
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,163.80
债券利息收入		40,943.55
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		14,975.65
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,000.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-3,000.00
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号	7.4.7.17	43,625.00

填列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	-
<b>减: 二、费用</b>		14,996.45
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,190.63
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,384.17
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,728.73
4. 交易费用	7.4.7.19	232.52
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	7.4.7.20	6,460.40
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		84,711.55
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		84,711.55

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 长盛盛康纯债债券型证券投资基金

本报告期: 2018 年 12 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 12 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益 (基金净值)	49,774,121.01	2,822,776.29	52,596,897.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	84,711.55	84,711.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款 (以“-”号填列)	-	-	-
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)	49,774,121.01	2,907,487.84	52,681,608.85

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:

<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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛盛康纯债债券型证券投资基金(原名为“长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金”,以下简称“本基金”)由长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型而来。根据长盛基金管理有限公司2018年12月21日发布的《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,原长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金自2018年12月20日起转型为本基金。原《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自2018年12月20日起失效,修订后的《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》自同日起生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。原长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为52,596,897.30元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》和《长盛盛康纯债债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为固定收益类金融工具,具体包括:国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等债券,以及资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、现金等固定收益类金融工具,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)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产。本基金投资组合中债券投资占基金资产的比例不低于80%;在每个交易日日终,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数(全价)收益率。

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2019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》、《长盛盛康纯债债券型证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 2018 年 12 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 12 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 12 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进

行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小

的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	1,437,901.43
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：	1,437,901.43

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,118,690.90	-20,718.90
	银行间市场	40,075,930.00	11,070.00
	合计	47,194,620.90	-9,648.90
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	47,194,620.90	47,184,972.00	-9,648.90

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,400,000.00	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,352.84
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	124.80
应收债券利息	942,838.93
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,724.78
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	10.50
合计	947,051.85

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	618.20
银行间市场应付交易费用	750.00
合计	1,368.20

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	159,000.00
合计	159,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛康纯债 A		
项目	本期 2018 年 12 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	41,635.71	41,635.71
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-

本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	41,635.71	41,635.71

金额单位：人民币元

长盛盛康纯债 C		
项目	本期 2018年12月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	49,732,485.30	49,732,485.30
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	49,732,485.30	49,732,485.30

注：原长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金于基金合同失效前经审计的实收基金为49,774,121.01份，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的实收基金。其中原长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金A类份额41,635.71份转为本基金A类份额41,635.71份，原长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金C类份额49,732,485.30份转为本基金C类份额49,732,485.30份。

#### 7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

长盛盛康纯债 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	2,446.24	593.69	3,039.93
本期利润	36.34	37.07	73.41
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,482.58	630.76	3,113.34

金额单位：人民币元

长盛盛康纯债 C
----------

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	2,121,591.04	698,145.32	2,819,736.36
本期利润	41,050.21	43,587.93	84,638.14
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,162,641.25	741,733.25	2,904,374.50

#### 7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2018年12月20日(基金合同生效日)至2018年 12月31日
活期存款利息收入	3,001.52
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	149.75
其他	12.53
合计	3,163.80

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年12月20日至2018年12月31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	-3,000.00
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	-3,000.00

##### 7.4.7.13.2 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12月20日至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,000,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,936,140.00

减：应收利息总额	66,860.00
买卖债券差价收入	-3,000.00

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

注：无。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

注：无。

**7.4.7.16 股利收益**

注：无。

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年12月20日(基金合同生效日)至2018 年12月31日
1. 交易性金融资产	43,625.00
——股票投资	-
——债券投资	43,625.00
——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	43,625.00

**7.4.7.18 其他收入**

注：无。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018年12月20日(基金合同生效日)至2018 年12月31日
交易所市场交易费用	7.52
银行间市场交易费用	225.00
合计	232.52

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2018年12月20日(基金合同生效日)至2018 年12月31日
审计费用	1,973.86
信息披露费	2,957.26
银行汇划费	354.88
上清所帐户维护费	587.20
中债登账户维护费	587.20
合计	6,460.40

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 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(“长盛基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 12 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,190.63
其中:支付销售机构的客户维护费	7.84

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.30% / 当年天数

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 12 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,384.17

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.08% / 当年天数。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 12 月 20 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛康纯债 A	长盛盛康纯债 C	合计
长盛基金公司	-	1,726.33	1,726.33
交通银行	-	1.06	1.06
合计	-	1,727.39	1,727.39

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给长盛基金公司，再由长盛基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 X 0.10%/ 当年天数。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无。

**7.4.10.4.2 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：无。

**7.4.10.5 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12月20日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	1,437,901.43	3,001.52

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

注：无。

**7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：无。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是债券型基金，具有中等风险水平的特征，其风险和预期收益低于股票型基金和混合型基金、高于货币市场基金。本基金的投资范围为固定收益类金融工具，具体包括：国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等债券，以及资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、现金等固定收益类金融工具，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)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以

控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	490,637.00
合计	490,637.00

注：未评级部分为政策性金融债。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无余额。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	9,622,000.00
合计	9,622,000.00

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	37,072,335.00
合计	37,072,335.00

注：未评级部分为政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无余额。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无余额。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 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在基金运作过程中严格按照《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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的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%。

本基金所持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。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有流动性受限的资产的估值占基金资产净值的比例符合上述要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金

额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2018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	1,437,901.43	-	-	-	1,437,901.43
结算备付金	277,272.73	-	-	-	277,272.73
存出保证金	23,257.81	-	-	-	23,257.81
交易性金融资产	16,719,972.00	30,465,000.00	-	-	47,184,972.00
买入返售金融资产	3,400,000.00	-	-	-	3,400,000.00
应收利息	-	-	-	947,051.85	947,051.85
资产总计	21,858,403.97	30,465,000.00	-	947,051.85	53,270,455.82
负债					
应付证券清算款	-	-	-	398,275.21	398,275.21

应付管理人报酬	-	-	-	21,617.39	21,617.39
应付托管费	-	-	-	4,121.98	4,121.98
应付销售服务费	-	-	-	4,464.19	4,464.19
应付交易费用	-	-	-	1,368.20	1,368.20
其他负债	-	-	-	159,000.00	159,000.00
负债总计	-	-	-	588,846.97	588,846.97
利率敏感度缺口	21,858,403.97	30,465,000.00	-	358,204.88	52,681,608.85

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
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12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	132,255.18
	2. 市场利率上升 25 个基点	-132,255.18

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 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二层次的余额为 47,184,972.00 元, 无属于第一或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 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。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 年度财务报表 (转型前)

## 7.1 资产负债表 (转型前)

会计主体: 长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日: 2018 年 12 月 19 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 19 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	11,216,208.82	1,998,151.88
结算备付金		277,272.73	197,725.43
存出保证金		23,257.81	23,902.32
交易性金融资产	7.4.7.2	26,145,148.00	440,394,995.52
其中: 股票投资		-	61,684,833.92
基金投资		-	-
债券投资		26,145,148.00	378,710,161.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	14,500,000.00	5,900,000.00
应收证券清算款		1,500,651.10	3,145.26
应收利息	7.4.7.5	610,296.55	4,400,973.96
应收股利		-	-
应收申购款		-	200.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		54,272,835.01	452,919,094.37
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 19 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,500,000.00	-
应付赎回款		-	104.99
应付管理人报酬		16,426.76	230,223.45
应付托管费		2,737.81	38,370.56
应付销售服务费		2,735.46	38,364.28
应付交易费用	7.4.7.7	1,143.20	6,742.43
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	152,894.48	135,000.00
负债合计		1,675,937.71	448,805.71
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	49,774,121.01	430,816,860.47
未分配利润	7.4.7.10	2,822,776.29	21,653,428.19
所有者权益合计		52,596,897.30	452,470,288.66
负债和所有者权益总计		54,272,835.01	452,919,094.37

注: 1. 报告截止日 2018 年 12 月 19 日(基金转型前一日), 基金份额总额 49,774,121.01 份, 其中长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.0730 元, 长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额 41,635.71 份; 长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.0567 元, 长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金 C 类基金份额 49,732,485.30 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日(基金转型前一日)止期间。

## 7.2 利润表

会计主体: 长盛盛康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 12 月 19 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 13 日(基 金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		2,175,480.92	27,805,014.11
1. 利息收入		10,646,709.85	15,860,737.09
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	43,815.25	163,420.42
债券利息收入		10,251,275.83	14,303,725.91
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		351,618.77	1,393,590.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-8,295,521.40	11,819,948.08
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	-9,248,343.27	9,946,061.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	138,899.83	470,685.80
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	813,922.04	1,403,200.66
3. 公允价值变动收益(损失以	7.4.7.17	-175,844.89	122,570.99

“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	137.36	1,757.95
<b>减: 二、费用</b>		2,611,623.07	4,059,588.67
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,699,583.75	2,674,100.48
2. 托管费	7.4.10.2.2	283,263.92	445,683.43
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	283,211.17	445,538.58
4. 交易费用	7.4.7.19	144,546.49	308,223.25
5. 利息支出		-	14,269.57
其中: 卖出回购金融资产支出		-	14,269.57
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	201,017.74	171,773.36
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		-436,142.15	23,745,425.44
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		-436,142.15	23,745,425.44

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 长盛盛康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 12 月 19 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 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)	430,816,860.47	21,653,428.19	452,470,288.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-436,142.15	-436,142.15
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)	-381,042,739.46	-18,394,509.75	-399,437,249.21
其中: 1. 基金申购款	46,616.07	2,885.77	49,501.84
2. 基金赎回款	-381,089,355.53	-18,397,395.52	-399,486,751.05
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)	49,774,121.01	2,822,776.29	52,596,897.30

项目	上年度可比期间 2017 年 2 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益 (基金净值)	600,018,721.52	-	600,018,721.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	23,745,425.44	23,745,425.44
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)	-169,201,861.05	-2,091,997.25	-171,293,858.30
其中: 1. 基金申购款	431,344,827.75	19,347,516.65	450,692,344.40
2. 基金赎回款	-600,546,688.80	-21,439,513.90	-621,986,202.70
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)	430,816,860.47	21,653,428.19	452,470,288.66

注: 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

长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金(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”)证监许可[2016]2365号《关于准予长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共600,018,693.14元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第129号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年2月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为600,018,721.52份基金份额,其中认购资金利息折合28.38份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。不从本类

别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛康灵活配置混合型证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(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、权证、股指期货、国债期货、债券回购、货币市场工具、同业存单、资产支持证券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相关规定)。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：50% X 沪深 300 指数收益率+50% X 中证综合债指数收益率。

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 2019 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》、《长盛盛康灵活配置混合型证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。

经中国证监会批准，基金管理人长盛基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为长盛盛康纯债债券型证券投资基金，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日(基金转型前一日)止期间的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 2018 年 12 月 19 日(基金转型前一日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日(基金转型前一日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日(基金转型前一日)。比较财务报表的实际编制期间为 2017 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分

别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；

若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

于 2017 年 9 月 4 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 9 月 4 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣

后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 19 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	11,216,208.82	1,998,151.88
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：	11,216,208.82	1,998,151.88

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月19日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,628,641.90	6,601,148.00
	银行间市场	19,569,780.00	19,544,000.00
	合计	26,198,421.90	26,145,148.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	26,198,421.90	26,145,148.00	-53,273.90
项目	上年度末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	61,194,977.34	61,684,833.92	489,856.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,203,017.19	6,205,161.60
	银行间市场	372,874,430.00	372,505,000.00
	合计	379,077,447.19	378,710,161.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	440,272,424.53	440,394,995.52	122,570.99

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无余额。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月19日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	14,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	14,500,000.00	-
项目	上年度末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,900,000.00	-

银行间市场	-	-
合计	5,900,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月19日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	2,508.98	455.33
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	2,766.20	89.00
应收债券利息	599,789.08	4,397,178.14
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	5,126.28	3,240.69
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	106.01	10.80
合计	610,296.55	4,400,973.96

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月19日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	618.20	2,598.39
银行间市场应付交易费用	525.00	4,144.04
合计	1,143.20	6,742.43

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月19日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	152,894.48	135,000.00
合计	152,894.48	135,000.00

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛康混合 A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	69,982.88	69,982.88
本期申购	21,207.36	21,207.36
本期赎回(以“-”号填列)	-49,554.53	-49,554.53
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	41,635.71	41,635.71

金额单位：人民币元

长盛盛康混合 C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	430,746,877.59	430,746,877.59
本期申购	25,408.71	25,408.71
本期赎回(以“-”号填列)	-381,039,801.00	-381,039,801.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	49,732,485.30	49,732,485.30

注：申购含转换入；赎回含转换出。

## 7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

长盛盛康混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,411.72	-3.32	4,408.40
本期利润	9.29	467.32	476.61
本期基金份额交易产生的变动数	-1,974.77	129.69	-1,845.08
其中：基金申购款	1,578.75	-104.27	1,474.48
基金赎回款	-3,553.52	233.96	-3,319.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,446.24	593.69	3,039.93

金额单位：人民币元

长盛盛康混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,655,721.64	-6,701.85	21,649,019.79
本期利润	-260,306.55	-176,312.21	-436,618.76
本期基金份额交易产生的变动数	-19,273,824.05	881,159.38	-18,392,664.67
其中：基金申购款	1,386.87	24.42	1,411.29
基金赎回款	-19,275,210.92	881,134.96	-18,394,075.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,121,591.04	698,145.32	2,819,736.36

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至 2018年12月19日	2017年2月13日（基金合同生效日）至2017年12月31日
活期存款利息收入	32,190.28	77,881.81
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	11,411.40	58,135.37
其他	213.57	27,403.24
合计	43,815.25	163,420.42

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至 2018年12月19日	2017年2月13日（基金合同生效日）至2017年12月31日
卖出股票成交总额	68,339,669.47	98,180,589.19
减：卖出股票成本总额	77,588,012.74	88,234,527.57
买卖股票差价收入	-9,248,343.27	9,946,061.62

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至 2018年12月19日	2017年2月13日（基金合同生效日）至2017年12月31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	138,899.83	470,685.80

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	138,899.83	470,685.80

#### 7.4.7.13.2 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12月19日	上年度可比期间 2017年2月13日（基金合同生效日）至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,437,224,386.57	1,774,347,225.81
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,413,734,557.19	1,743,231,389.71
减：应收利息总额	23,350,929.55	30,645,150.30
买卖债券差价收入	138,899.83	470,685.80

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

注：

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年12月19日	上年度可比期间 2017年2月13日（基金合同生效日）至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	813,922.04	1,403,200.66
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	813,922.04	1,403,200.66

#### 7.4.7.17 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12月19日	上年度可比期间 2017年2月13日（基金合同生效日）至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-175,844.89	122,570.99
——股票投资	-489,856.58	489,856.58
——债券投资	314,011.69	-367,285.59
——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	-175,844.89	122,570.99

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年12月19日	上年度可比期间 2017年2月13日（基金合同生效日）至2017年12月31日
基金赎回费收入	134.61	1,750.89
基金转换费收入	2.75	0.25
其他	-	6.81
合计	137.36	1,757.95

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年12月19日	上年度可比期间 2017年2月13日（基金合同生效日）至2017年12月31日
交易所市场交易费用	136,746.49	298,648.25
银行间市场交易费用	7,800.00	9,575.00
合计	144,546.49	308,223.25

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至 2018年12月19日	上年度可比期间 2017年2月13日（基金合同生效日）至2017年12月31日
审计费用	58,026.14	60,000.00
信息披露费	87,042.74	75,000.00
银行汇划费	10,923.26	16,273.36
上清所帐户维护费	22,812.80	9,600.00
其他	300.00	400.00
中债登帐户维护费	21,912.80	10,500.00
合计	201,017.74	171,773.36

### 7.4.7.21 分部报告

无。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

无。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据基金管理人长盛基金管理有限公司 2018 年 12 月 21 日发布的《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2018 年 12 月 20 日起转型为“长盛盛康纯债债券型证券投资基金”。原《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2018 年 12 月 20 日起失效，修订后的《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》自同日起生效。

### 7.4.9 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(“长盛基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日	2017 年 2 月 13 日(基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,699,583.75	2,674,100.48
其中:支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	263.03	561.56

注:支付基金管理人长盛基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.60% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 13 日(基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	283,263.92	445,683.43

注:支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 19 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛康混合 A	长盛盛康混合 C	合计
长盛基金	-	283,133.42	283,133.42
交通银行	-	35.62	35.62
合计	-	283,169.04	283,169.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 2 月 13 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛康混合 A	长盛盛康混合 C	合计
长盛基金	-	442,999.44	442,999.44
交通银行	-	46.14	46.14
合计	-	443,045.58	443,045.58

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给长盛基金公司，再由长盛基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 7.4.10.4.2 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：无。

#### 7.4.10.5 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 12 月 19 日		上年度可比期间 2017 年 2 月 13 日（基金合同生效日）至 2017 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
	交通银行	11,216,208.82	32,190.28	1,998,151.88

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 7.4.12 期末（2018 年 12 月 19 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

注：无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，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。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、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、权证、股指期货、国债期货、债券回购、货币市场工具、同业存单、资产支持证券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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 7.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.7 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月19日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	26,165,161.60
合计	-	26,165,161.60

注：未评级部分为政策性金融债。

#### 7.4.13.2.8 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无余额。

#### 7.4.13.2.9 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月19日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	19,544,000.00	352,545,000.00
合计	19,544,000.00	352,545,000.00

#### 7.4.13.2.10 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 12 月 19 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	6,601,148.00	-
合计	6,601,148.00	-

注：未评级部分为政策性金融债。

#### 7.4.13.2.11 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无余额。

#### 7.4.13.2.12 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无余额。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2018 年 12 月 19 日(基金转型前一日)，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 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在基金运作过程中严格按照《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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的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%。本基金与由本

基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持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。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 19 日(基金转型前一日)，本基金持有流动性受限的资产的估值占基金资产净值的比例符合上述要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 12 月 19 日(基金转型前一日)，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### **7.4.13.4 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。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大, 此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产, 因此存在相应的利率风险。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位: 人民币元

本期末 2018 年 12 月 19 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,216,208.82	-	-	-	11,216,208.82
结算备付金	277,272.73	-	-	-	277,272.73
存出保证金	23,257.81	-	-	-	23,257.81
交易性金融资产	26,145,148.00	-	-	-	26,145,148.00
买入返售金融资产	14,500,000.00	-	-	-	14,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,500,651.10	1,500,651.10
应收利息	-	-	-	610,296.55	610,296.55
资产总计	52,161,887.36	-	-	2,110,947.65	54,272,835.01
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,500,000.00	1,500,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	16,426.76	16,426.76
应付托管费	-	-	-	2,737.81	2,737.81
应付销售服务费	-	-	-	2,735.46	2,735.46
应付交易费用	-	-	-	1,143.20	1,143.20
其他负债	-	-	-	152,894.48	152,894.48
负债总计	-	-	-	1,675,937.71	1,675,937.71
利率敏感度缺口	52,161,887.36	-	-	435,009.94	52,596,897.30
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	1,998,151.88	-	-	-	1,998,151.88
结算备付金	197,725.43	-	-	-	197,725.43
存出保证金	23,902.32	-	-	-	23,902.32
交易性金融资产	378,710,161.60	-	-	61,684,833.92	440,394,995.52
买入返售金融资产	5,900,000.00	-	-	-	5,900,000.00
应收证券清算款	-	-	-	3,145.26	3,145.26
应收利息	-	-	-	4,400,973.96	4,400,973.96
应收申购款	-	-	-	200.00	200.00
资产总计	386,829,941.23	-	-	66,089,153.14	452,919,094.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	104.99	104.99
应付管理人报酬	-	-	-	230,223.45	230,223.45
应付托管费	-	-	-	38,370.56	38,370.56

应付销售服务费	-	-	38,364.28	38,364.28
应付交易费用	-	-	6,742.43	6,742.43
其他负债	-	-	135,000.00	135,000.00
负债总计	-	-	448,805.71	448,805.71
利率敏感度缺口	386,829,941.23	-	65,640,347.43	452,470,288.66

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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12月19日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降25个基点	11,111.69	186,629.88
	市场利率上升25个基点	-11,111.69	-186,629.88

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的0-95%，权证投资占基金资产净值的0%-3%，每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的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。

**7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月19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	-	-	61,684,833.92	13.63
合计	-	-	61,684,833.92	13.63

**7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

于 2018 年 12 月 19 日 (基金转型前一日)，本基金未持有交易性权益类投资 (2017 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 13.63%)，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2017 年 12 月 31 日：同)。

**7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

## (1) 公允价值

## (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 19 日 (基金转型前一日)，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二层次的余额为 26,145,148.00 元，无属于第一或第三层次的余额。(2017 年 12 月 31 日：第一层次 60,469,585.47 元，第二层次 379,925,410.05 元，无属于第三层次的余额)。

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃 (包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输

入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 19 日 (基金转型前一日)，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告 (转型后)

### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	47,184,972.00	88.58
	其中：债券	47,184,972.00	88.58
	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	3,400,000.00	6.38
	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	1,715,174.16	3.22
8	其他各项资产	970,309.66	1.82
9	合计	53,270,455.82	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

注：本基金本报告期末未持有境内投资股票。

## 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。

## 8.2.3 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

### 8.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

### 8.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

## 8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	37,562,972.00	71.30
	其中：政策性金融债	37,562,972.00	71.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,622,000.00	18.26
9	其他	-	-
10	合计	47,184,972.00	89.57

## 8.5 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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	170209	17 国开 09	300,000	30,465,000.00	57.83
2	111809122	18 浦发银行 CD122	100,000	9,622,000.00	18.26
3	018005	国开 1701	36,000	3,615,840.00	6.86
4	018002	国开 1302	29,900	2,991,495.00	5.68
5	108603	国开 1804	4,900	490,637.00	0.93

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

注：基金本报告期末未持有资产支持性证券。

## 8.7 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：基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.8 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投资。

## 8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.9.2 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。

### 8.9.3 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。

## 8.10 投资组合报告附注

### 8.10.1

18 浦发银行 CD122：根据银保监会 2018 年 5 月 4 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表-银监罚决字〔2018〕4 号-上海浦东发展银行股份有限公司》的公告，浦发银行因内控管理严重违反审慎经营规则；通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款；通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节；理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求；提供不实说明材料、不配合调查取证；以贷转存，虚增存贷款；票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严；国内信用证业务贸易背景审查不严；贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款；违规通过同业投资转存款方式，虚增存款；票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理；对代理收付资金的信托计划提供保本承诺；以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产；投资多款同业理财产品未尽职审查，涉及金额较大；修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符；为非保本理财产品出具保本承诺函；向关系人发放信用贷款；向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符；收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本共 19 项违规被罚罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。根据 1 月 20 日浦发银行《关于成都分行处罚事项的公告》2018 年 1 月 18 日，银监会四川监管局对公司成都分行作出行政处罚决定，对成都分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，执行罚款 46,175 万元人民币。此外，对成都分行原行

长、2名副行长、1名部门负责人和1名支行行长分别给予禁止终身从事银行业工作、取消其高级管理人员任职资格、警告及罚款。对以上事件，本基金做出如下说明：浦发银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，上述处罚对经营管理不构成实质性影响，同时公司高度重视相关事项，已进一步采取控制措施改进或正在落实整改。针对成都分行上述违规经营事项，浦发银行高度重视，在监管机构和地方政府的指导和帮助下，及时调整了成都分行经营班子，并对资产状况进行了全面评估，分类施策、强化管理，按照审慎原则计提风险拨备，稳妥有序化解风险。目前，成都分行已按监管要求完成了整改，总体风险可控，客户权益未受影响，经营管理迈入正轨。在此基础上，公司在全行范围内认真开展举一反三教育整改工作，深刻反思，统一思想，吸取教训；端正全行经营理念，更加关注安全性、流动性和效益性的平衡发展，强化统一法人管理；将防范和化解金融风险放在更加突出的位置，强化合规内控体制机制建设，着重提升内控执行力和有效性，确保全行依法合规、稳健发展。并且上述处罚金额已全额计入2017年度公司损益，对公司的业务开展及持续经营无重大不利影响。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，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。

### 8.10.2

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,257.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	947,051.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	970,309.66

### 8.10.4 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）。

### **8.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末未持有股票。

### **8.10.6 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 投资组合报告 (转型前)

### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	26,145,148.00	48.17
	其中：债券	26,145,148.00	48.17
	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	14,500,000.00	26.72
	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	11,493,481.55	21.18
8	其他资产	2,134,205.46	3.93
9	合计	54,272,835.01	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

注：本基金本报告期末未持有境内投资股票。

#### 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所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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	601398	工商银行	4,090,021.00	0.90
2	601288	农业银行	2,751,835.00	0.61
3	600519	贵州茅台	2,700,551.00	0.60
4	601111	中国国航	1,927,800.00	0.43
5	601939	建设银行	1,474,000.00	0.33

6	601318	中国平安	1,254,094.00	0.28
7	600036	招商银行	782,536.00	0.17
8	603156	养元饮品	166,828.87	0.04
9	600901	江苏租赁	155,843.75	0.03
10	601828	美凯龙	134,064.15	0.03
11	601066	中信建投	101,299.80	0.02
12	601838	成都银行	89,465.01	0.02
13	601869	长飞光纤	89,344.95	0.02
14	603587	地素时尚	67,203.84	0.01
15	603693	江苏新能	48,456.00	0.01
16	603680	今创集团	47,171.67	0.01
17	601990	南京证券	38,771.70	0.01
18	603876	鼎胜新材	38,223.42	0.01
19	603733	仙鹤股份	33,132.42	0.01
20	603486	科沃斯	32,812.78	0.01

#### 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	601398	工商银行	5,122,629.00	1.13
2	601288	农业银行	3,625,108.00	0.80
3	601939	建设银行	2,668,302.00	0.59
4	600519	贵州茅台	2,561,728.20	0.57
5	601111	中国国航	1,763,399.00	0.39
6	600104	上汽集团	1,514,967.00	0.33
7	600352	浙江龙盛	1,472,277.41	0.33
8	600048	保利地产	1,441,445.00	0.32
9	601877	正泰电器	1,430,403.00	0.32
10	600004	白云机场	1,379,402.00	0.30
11	600028	中国石化	1,378,302.00	0.30
12	600011	华能国际	1,302,189.00	0.29
13	601009	南京银行	1,299,541.80	0.29
14	601988	中国银行	1,242,071.00	0.27
15	601006	大秦铁路	1,209,739.00	0.27
16	601998	中信银行	1,200,624.00	0.27
17	600177	雅戈尔	1,191,809.62	0.26
18	600027	华电国际	1,189,170.00	0.26

19	601857	中国石油	1,163,674.02	0.26
20	601818	光大银行	1,149,303.00	0.25

### 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	16,393,035.40
卖出股票收入（成交）总额	68,339,669.47

### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,601,148.00	12.55
	其中：政策性金融债	6,601,148.00	12.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	19,544,000.00	37.16
9	其他	-	-
10	合计	26,145,148.00	49.71

### 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111815478	18 民生银行 CD478	100,000	9,933,000.00	18.89
2	111809122	18 浦发银行 CD122	100,000	9,611,000.00	18.27
3	018005	国开 1701	36,000	3,607,560.00	6.86
4	018002	国开 1302	29,900	2,993,588.00	5.69

注：本基金本报告期末仅持有上述四只债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

注：基金本报告期末未持有资产支持性证券。

### 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资产支持证券。

### 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投资。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金本报告期内未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

#### (1) 18 民生银行 CD478

根据银保监会 2018 年 12 月 7 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表-银保监银罚决字〔2018〕5 号-中国民生银行股份有限公司》的公告，民生银行因贷款业务严重违反审慎经营规则，被罚款 200 万元。根据银保监会 2018 年 12 月 7 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表-银保监银罚决字〔2018〕8 号-中国民生银行股份有限公司》的公告，民生银行因：内控管理严重违反审慎经营规则；同业投资违规接受担保；同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；本行理财产品之间风险隔离不到位；个人理财资金违规投资；票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；为非保本理财产品提供保本承诺等原因，被罚款 3160 万元。

对以上事件，本基金判断，民生银行是全国性股份制商业银行之一，上述处罚对公司影响小。后续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。

#### (2) 18 浦发银行 CD122

根据银保监会 2018 年 5 月 4 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表-银监罚决字〔2018〕4 号-上海浦东发展银行股份有限公司》的公告，浦发银行因内控管理严重违反审慎经营规则；通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款；通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节；理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求；提供不实说明

材料、不配合调查取证；以贷转存，虚增存贷款；票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严；国内信用证业务贸易背景审查不严；贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款；违规通过同业投资转存款方式，虚增存款；票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理；对代理收付资金的信托计划提供保本承诺；以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产；投资多款同业理财产品未尽职审查，涉及金额较大；修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符；为非保本理财产品出具保本承诺函；向关系人发放信用贷款；向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符；收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本共 19 项违规被罚罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。根据 1 月 20 日浦发银行《关于成都分行处罚事项的公告》2018 年 1 月 18 日，银监会四川监管局对公司成都分行作出行政处罚决定，对成都分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，执行罚款 46,175 万元人民币。此外，对成都分行原行长、2 名副行长、1 名部门负责人和 1 名支行行长分别给予禁止终身从事银行业工作、取消其高级管理人员任职资格、警告及罚款。对以上事件，本基金做出如下说明：浦发银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，上述处罚对经营管理不构成实质性影响，同时公司高度重视相关事项，已进一步采取控制措施改进或正在落实整改。针对成都分行上述违规经营事项，浦发银行高度重视，在监管机构和地方政府的指导和帮助下，及时调整了成都分行经营班子，并对资产状况进行了全面评估，分类施策、强化管理，按照审慎原则计提风险拨备，稳妥有序化解风险。目前，成都分行已按监管要求完成了整改，总体风险可控，客户权益未受影响，经营管理迈入正轨。在此基础上，公司在全行范围内认真开展举一反三教育整改工作，深刻反思，统一思想，吸取教训；端正全行经营理念，更加关注安全性、流动性和效益性的平衡发展，强化统一法人管理；将防范和化解金融风险放在更加突出的位置，强化合规内控体制机制建设，着重提升内控执行力和有效性，确保全行依法合规、稳健发展。并且上述处罚金额已全额计入 2017 年度公司损益，对公司的业务开展及持续经营无重大不利影响。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，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。

### 8.12.2

本基金本报告期末未持有股票。

**8.12.3 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	23,257.81
2	应收证券清算款	1,500,651.10
3	应收股利	-
4	应收利息	610,296.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,134,205.46

**8.12.4 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）。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末未持有股票。

**8.12.6 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。
-----------------------------

## § 9 基金份额持有人信息 (转型后)

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
长盛盛康纯债 A	9	4,626.19	0.00	0.00%	41,635.71	100.00%
长盛盛康纯债 C	191	260,379.50	49,663,221.36	99.86%	69,263.94	0.14%
合计	200	248,870.61	49,663,221.36	99.78%	110,899.65	0.22%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长盛盛康纯债 A	99.38	0.2387%
	长盛盛康纯债 C	200.00	0.0004%
	合计	299.38	0.0006%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 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	份额级别	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	长盛盛康纯债 A	0
	长盛盛康纯债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛盛康纯债 A	0
	长盛盛康纯债 C	0
	合计	0

## § 9 基金份额持有人信息 (转型前)

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
长盛盛康混合 A	9	4,626.19	0.00	0.00%	41,635.71	100.00%
长盛盛康混合 C	191	260,379.50	49,663,221.36	99.86%	69,263.94	0.14%
合计	200	248,870.61	49,663,221.36	99.78%	110,899.65	0.22%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长盛盛康混合 A	99.38	0.2387%
	长盛盛康混合 C	200.00	0.0004%
	合计	299.38	0.0006%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	长盛盛康混合 A	0
	长盛盛康混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛盛康混合 A	0
	长盛盛康混合 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	长盛盛康纯债 A	长盛盛康纯债 C
基金合同生效日基金份额总额	41,635.71	49,732,485.30
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	41,635.71	49,732,485.30

## § 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	长盛盛康混合 A	长盛盛康混合 C
基金合同生效日基金份额总额	1,594.60	600,017,126.92
本报告期期初基金份额总额	69,982.88	430,746,877.59
本报告期期间基金总申购份额	21,207.36	25,408.71
减:本报告期期间基金总赎回份额	49,554.53	381,039,801.00
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	41,635.71	49,732,485.30

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会表决投票时间为 2018 年 11 月 20 日至 2018 年 12 月 19 日，会议审议了《关于长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”）。依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告》等规定，本次基金份额持有人大会于 2018 年 12 月 20 日表决通过本次会议议案，同意本基金转型为长盛盛康纯债债券型证券投资基金，允许基金管理人按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对基金合同进行修订，本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

### 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

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。

#### 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

本报告期本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

### 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

报告期内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，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元，已连续为本基金提供审计服务 2 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（转型后）

### 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	
川财证券	2	-	-	-	-	-

### 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
川财证券	490,049.00	100.00%	56,400,000.00	100.00%	-	-

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，并能为本公司基金提供全面的信息服。

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深圳交易单元为共用交易单元。

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：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

### 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	
川财证券		283,320,506.47	100.00%	60,929.22	100.00%	-

### 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
川财证券	17,167,481.90	100.00%	1,641,500,000.00	100.00%	-	-

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深圳交易单元为共用交易单元。

## 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：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

## 11.9 其他重大事件（转型后）

除上述事项外，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	长盛盛康纯债债券型证券投资 基金基金合同	《中国证券报》及本 公司网站	2018 年 12 月 21 日
2	长盛盛康纯债债券型证券投资	同上	2018 年 12 月 21 日

	基金基金合同摘要		
3	长盛盛康纯债债券型证券投资 基金托管协议	同上	2018 年 12 月 21 日
4	长盛盛康纯债债券型证券投资 基金招募说明书	同上	2018 年 12 月 21 日
5	长盛基金管理有限公司关于办 公地址变更的公告	同上	2018 年 12 月 3 日

### 11.9 其他重大事件（转型前）

除上述事项外，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	长盛盛康灵活配置混合型证券投资 基金份额持有人大会表决 结果暨决议生效的公告	《中国证券报》及本 公司网站	2018 年 12 月 21 日
2	长盛基金管理有限公司关于办 公地址变更的公告	同上	2018 年 12 月 3 日
3	长盛盛康灵活配置混合型证券 投资基金关于以通讯方式召开 基金份额持有人大会的第二次 提示性公告	同上	2018 年 11 月 22 日
4	长盛盛康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 9 月 27 日
5	长盛盛康灵活配置混合型证券 投资基金招募说明书（更新）	同上	2018 年 9 月 27 日
6	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 6 月 30 日
7	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
8	长盛盛康灵活配置混合型证券 投资基金 2018 年第 1 季度报告	同上	2018 年 4 月 20 日
9	长盛盛康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	长盛盛康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
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	关于修改长盛盛康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	长盛盛康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 3 月 23 日
14	长盛盛康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
15	长盛盛康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
16	长盛盛康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
17	长盛盛康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

## § 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	20180101~20181231	430,663,221.36	-	381,000,000.00	49,663,221.36	99.78%

#### 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、《长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 6、《长盛盛康纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 7、《长盛盛康纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 8、法律意见书；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 10、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址及/或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、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2019年3月29日