

长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金
2018 年年度报告

2018 年 11 月 15 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：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。

基金托管人中国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。

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。

基金管理人已于 2018 年 11 月 13 日发布《关于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终止及基金财产清算的公告》，由于本基金发生触发基金合同终止条款事项，本基金已于 2018 年 11 月 16 日起进入基金财产清算程序。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了带强调事项段的无保留意见的审计报告。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 11 月 15 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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§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.....	14
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49

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.....	49
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.....	49
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
8.12 投资组合报告附注.....	50
§9 基金份额持有人信息.....	52
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
§10 开放式基金份额变动.....	53
§11 重大事件揭示.....	54
11.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
11.4 基金投资策略的改变.....	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
11.8 其他重大事件.....	58
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
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.....	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§13 备查文件目录.....	63
13.1 备查文件目录.....	63
13.2 存放地点.....	63
13.3 查阅方式.....	63

§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	9,099,105.41份
基金合同存续期	于2018年11月16日进入清算期

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</p>

	<p>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和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	010-86497608	010-66594896
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95566
传真		010-86497999	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		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100029	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年 7 月 6 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-3,389,485.32	11,419,832.28
本期利润	-3,501,424.30	11,724,727.98
加权平均基金份额本期利润	-0.1514	0.0962
本期加权平均净值利润率	-13.86%	9.39%
本期基金份额净值增长率	-17.07%	11.90%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-653,033.27	5,495,052.75
期末可供分配基金份额利润	-0.0718	0.1193
期末基金资产净值	8,446,072.14	51,560,489.72
期末基金份额净值	0.928	1.119
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-7.20%	11.90%

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 11 月 15 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.64%	1.10%	-2.02%	1.03%	-4.62%	0.07%
过去六个月	-15.64%	0.99%	-2.25%	0.80%	-13.39%	0.19%
过去一年	-17.07%	0.96%	-6.75%	0.68%	-10.32%	0.28%
自基金合同生效起至今	-7.20%	0.88%	-1.99%	0.58%	-5.21%	0.30%

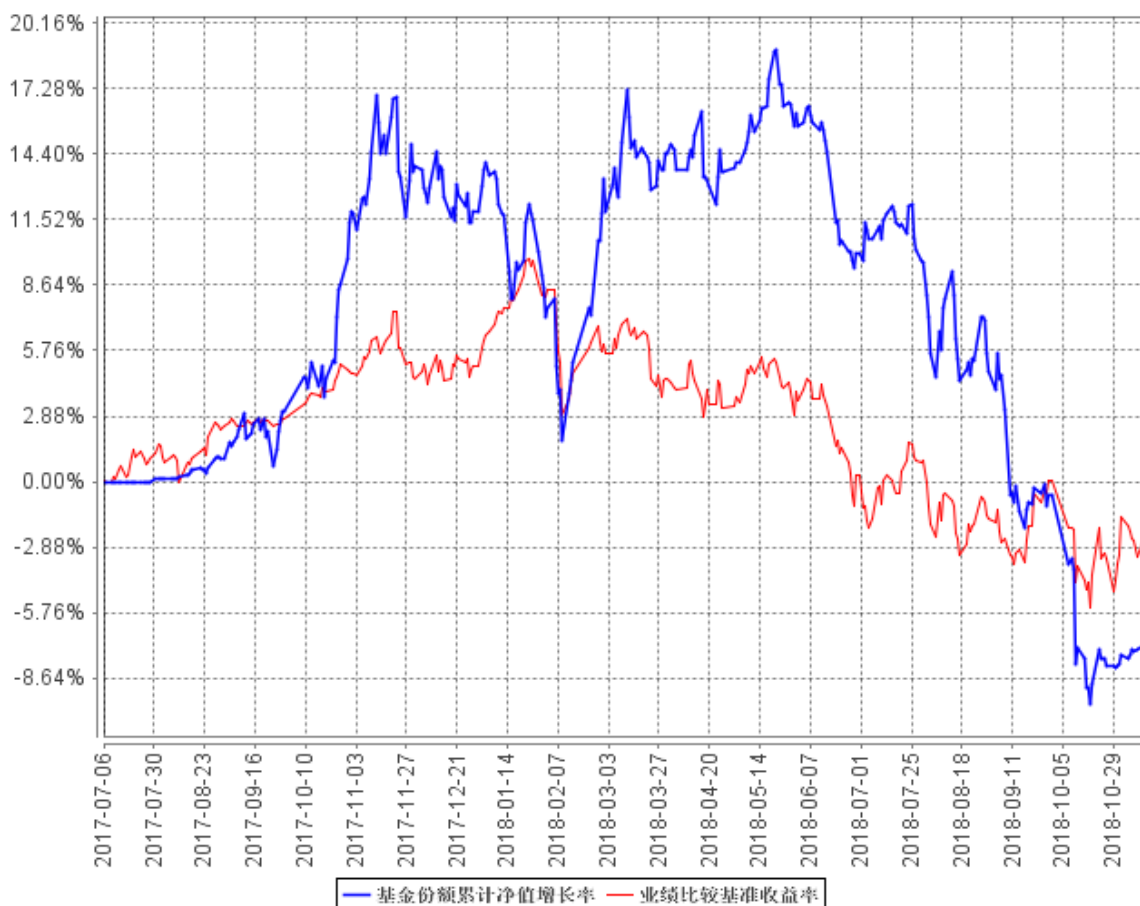
注：本基金业绩比较基准：50%×沪深 300 指数收益率+50%×中证综合债指数收益率

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

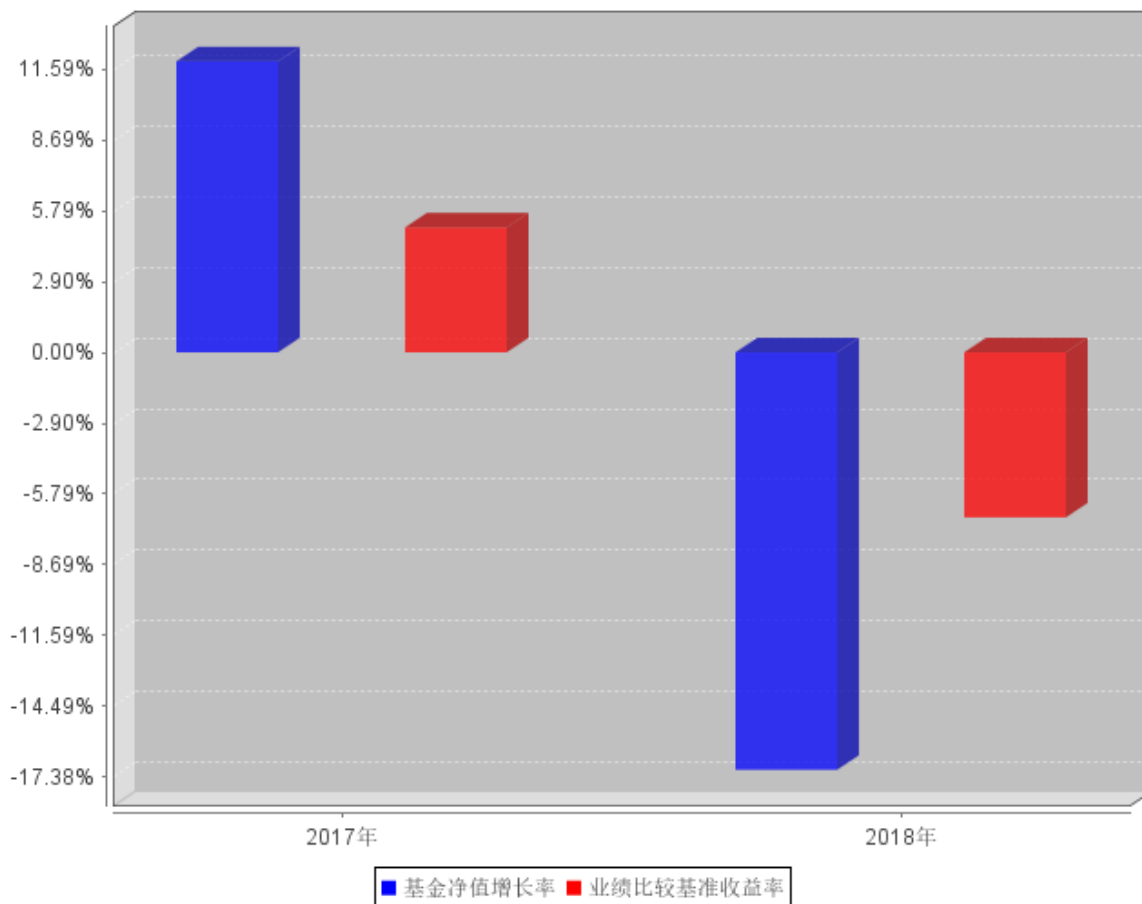
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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。

3.2.3 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比较

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：本基金合同生效日为 2017 年 7 月 6 日，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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 15 日、2017 年 7 月 6 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止会计期间均未进行利润分配。

§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

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，长盛电子信息产业混合型证券投资基金基金经理，长盛电子信息主题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遵规守信情况的说明

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

2018 年市场除在年初在金融地产的带动下出现上涨后大部分时间呈现单边下跌的走势, 期间虽有小幅反弹但是整体反弹幅度不大. 全年受资管新规和摩擦的影响上证综指和沪深 300 跌幅都在 20%以上, 以信息技术行业为代表的新兴产业跌幅尤为明显, 申万 TMT 几个主要行业都出现较大下跌, 以电子的跌幅最大超过 40%, 传媒, 计算机等跌幅都在 20%以上.

本基金在 2018 年上半年重点投资电子和软件行业并在高点兑现收益, 在大盘大幅下跌的情况下较好控制回撤, 但是在 3 季度和四季度初受大盘快速下跌的影响, 导致净值出现较大回撤。分享经济在 4 季度进入清算程序, 在清算过程当中时刻将基金持有人的利益放在第一位, 配合清算组完成了全部持仓的卖出清算, 未发生任何流动性风险。

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 0.928 元; 本报告期基金份额净值增长率为-17.07%, 业绩比较基准收益率为-6.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计未来一段时间各种宏观经济指标缓慢下行将持续, 关注重点在于新增信贷和社融增速能否回升, 从而使得信用收缩得到缓解或者重启信用扩张。伴随央行不断通过各种金融工具为金融机构和实体经济注入流动性, 预计 2019 年将有可能迎来流动性拐点, 整体市场流动性好转, 风险偏好有望出现逆转, 指数有望重新走出上涨的行情。M1 和 M2 增速将逐步趋稳回升, 贸易摩擦有望得以缓和。在经过 2018 年大幅估值下调之后众多行业和公司的估值已经达到或者接近历史低位, 未来一段时间估值回调的压力有望逐步缓解。本基金 2019 年将进入清盘尾声, 基金管理人将尽职尽责, 防范清盘中的风险, 保证清盘顺利完成。

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，本报告期内未实施利润分配。

本基金截止 2018 年 11 月 15 日，期末可供分配利润为-653,033.27 元，其中：未分配利润已实现部分为 315,582.54 元，未分配利润未实现部分为-968,615.81 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

本基金自 2018 年 1 月 8 日至 2018 年 3 月 16 日、2018 年 4 月 3 日至 2018 年 6 月 19 日止期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形；2018 年 7 月 3 日至 2018 年 11 月 15 日止期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，本基金已于 2018 年 11 月 16 日起进入基金财产清算程序。

§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 审计报告

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	带强调事项段的无保留意见
审计报告编号	安永华明（2019）专字第 60468688_A10 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	长盛分享经济主题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	<p>我们审计了长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2018 年 11 月 15 日的资产负债表，2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 15 日（最后运作日）止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照财务报表 7.4.2 所述编制基础编制。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。</p>
强调事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注财务报表 7.4.2 对编制基础的说明。基金管理 层根据《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》的规定为基金份额持有人编制财务报表，因此，财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供基金管理人向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。本段内容不影响已发表的审计意见。</p>
其他信息	<p>长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的	管理层负责按照财务报表 7.4.2 所述编制基础编制财务报表（包

责任	<p>括确定该编制基础对于在具体情况下编制财务报表是可接受的），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。</p> <p>治理层负责监督长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金特殊目的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>（1）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。</p> <p>（2）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>（3）评价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>我们与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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊 马剑英
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2019 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 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 11 月 15 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 11 月 15 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	14,127,762.04	15,079,788.71
结算备付金		65,866.63	331,603.25
存出保证金		27,651.41	52,268.36
交易性金融资产	7.4.7.2	1,086,062.60	24,406,578.19
其中：股票投资		1,086,062.60	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,170,225.51
应收利息	7.4.7.5	11,902.26	49,442.28
应收股利		-	-
应收申购款		1,438.86	11,028,943.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		15,320,683.80	52,118,849.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 11 月 15 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		6,720,359.99	225,155.88
应付管理人报酬		9,738.42	46,805.58
应付托管费		1,623.06	7,800.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	19,163.18	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	7.4.7.8	123,727.01	77,915.65
负债合计		6,874,611.66	558,359.88
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	9,099,105.41	46,065,436.97
未分配利润	7.4.7.10	-653,033.27	5,495,052.75
所有者权益合计		8,446,072.14	51,560,489.72
负债和所有者权益总计		15,320,683.80	52,118,849.60

注：(1)报告截止日 2018 年 11 月 15 日，基金份额净值 0.928 元，基金份额总额

9,099,105.41 份。

(2)本财务报表的实际编制期间系 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 15 日止，本基金于 2018 年 11 月 16 日进入清算期。

7.2 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 11 月 15 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 15 日	上年度可比期间 2017 年 7 月 6 日(基 金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-2,240,995.51	13,354,146.59
1. 利息收入		125,077.54	1,004,192.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	84,491.93	178,660.59
债券利息收入		20,663.28	35,463.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		19,922.33	790,068.73
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,009,942.29	11,255,139.33
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,072,918.77	11,042,704.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-46.49	-864.90
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	63,022.97	213,300.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-111,938.98	304,895.70
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	755,808.22	789,918.82
减：二、费用		1,260,428.79	1,629,418.61
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	331,322.96	908,595.96
2. 托管费	7.4.10.2.2	55,220.52	151,432.67
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	739,531.55	481,813.90
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	134,353.76	87,576.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,501,424.30	11,724,727.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,501,424.30	11,724,727.98

注：本财务报表的实际编制期间系 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 15 日止，上年度可比期间系 2017 年 7 月 6 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止。

7.3 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 11 月 15 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 15 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）	-	-3,501,424.30	-3,501,424.30
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）	-36,966,331.56	-2,646,661.72	-39,612,993.28
其中：1. 基金申购款	75,259,605.07	9,547,502.16	84,807,107.23
2. 基金赎回款	-112,225,936.63	-12,194,163.88	-124,420,100.51
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）	9,099,105.41	-653,033.27	8,446,072.14
项目	上年度可比期间 2017年7月6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、期初所有者权益（基金净值）	258,094,130.94	-	258,094,130.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,724,727.98	11,724,727.98
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）	-212,028,693.97	-6,229,675.23	-218,258,369.20
其中：1. 基金申购款	24,109,031.98	2,859,685.37	26,968,717.35
2. 基金赎回款	-236,137,725.95	-9,089,360.60	-245,227,086.55
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）	46,065,436.97	5,495,052.75	51,560,489.72

注：本财务报表的实际编制期间系 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 15 日止，上年度可比期间系 2017 年 7 月 6 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止。

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向社会公开募集，基金合同于 2017 年 7 月 6 日生效，于基金合同生效日，本基金规模为 258,094,130.94 份基

金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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%。

根据《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》、《关于避险策略基金的指导意见》、《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》的有关规定，本基金已出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，已触发基金合同终止事由，以 2018 年 11 月 15 日为基金最后运作日，依法进行基金财产清算。清算结果已经报中国证监会备案并获得中国证监会机构部函【2019】133 号《关于长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金清算备案的回函》。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照《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》约定的资产估值和会计核算方法及财务报表 7.4.4 所述的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表按照 7.4.2 所述的编制基础编制，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 11 月 15 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 15 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照《长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金合同》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际

编制期间系 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 15 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；

保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移

一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别

列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公

司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 投资者的现金红利保留到小数点后第 2 位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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，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免征增值税；

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免征增值税；

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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 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[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。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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。

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 11 月 15 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	14,127,762.04	15,079,788.71
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计：	14,127,762.04	15,079,788.71

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 11 月 15 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	893,105.88	1,086,062.60	192,956.72
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	893,105.88	1,086,062.60	192,956.72
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	21,970,602.19	22,276,777.69	306,175.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,131,080.30	2,129,800.50
	银行间市场	-	-
	合计	2,131,080.30	2,129,800.50
			-1,279.80

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	24,101,682.49	24,406,578.19	304,895.70

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

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

注：无。

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11月15日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	11,421.66	2,317.85
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	406.34	149.20
应收债券利息	-	46,951.71
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	74.26	23.50
合计	11,902.26	49,442.28

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年11月15日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	19,163.18	200,681.84
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	19,163.18	200,681.84

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年11月15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	15,727.01	415.65
预提费用	108,000.00	77,500.00
合计	123,727.01	77,915.65

7.4.7.9 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11月15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	75,259,605.07	75,259,605.07
本期赎回（以“-”号填列）	-112,225,936.63	-112,225,936.63
本期末	9,099,105.41	9,099,105.41

7.4.7.10 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	-3,389,485.32	-111,938.98	-3,501,424.30
本期基金份额交易产生的变动数	-6,394,985.47	3,748,323.75	-2,646,661.72
其中：基金申购款	18,079,191.83	-8,531,689.67	9,547,502.16
基金赎回款	-24,474,177.30	12,280,013.42	-12,194,163.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	315,582.54	-968,615.81	-653,033.27

7.4.7.11 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 11月15日	上年度可比期间 2017年7月6日(基金合同生效日) 至2017年12月31日
活期存款利息收入	79,632.92	163,308.98
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	3,736.18	15,105.88
其他	1,122.83	245.73
合计	84,491.93	178,660.59

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 2018年1月1日至 2018年11月15日	上年度可比期间 2017年7月6日(基金合 同生效日)至2017年12月 31日
卖出股票成交总额	249,301,457.81	154,821,010.23
减：卖出股票成本总额	252,374,376.58	143,778,306.00
买卖股票差价收入	-3,072,918.77	11,042,704.23

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1月1日至 2018年11月15日	上年度可比期间 2017年7月6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	-46.49	-864.90
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	-864.90

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11月15日	上年度可比期间 2017年7月6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	4,565,916.89	4,437,627.74
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,466,786.80	4,363,069.70
减：应收利息总额	99,176.58	75,422.94
买卖债券差价收入	-46.49	-864.90

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

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 11月15日	上年度可比期间 2017年7月6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	63,022.97	213,300.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	63,022.97	213,300.00

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11月15日	上年度可比期间 2017年7月6日(基金合同 生效日)至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-111,938.98	304,895.70
——股票投资	-113,218.78	306,175.50
——债券投资	1,279.80	-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	-111,938.98	304,895.70

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 11月15日	上年度可比期间 2017年7月6日(基金合同生效日) 至2017年12月31日
基金赎回费收入	752,921.83	788,722.33
基金转换费收入	2,886.39	1,196.49
合计	755,808.22	789,918.82

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	上年度可比期间 2017年7月6日(基金合同生效
----	-----------------------	-----------------------------

	11 月 15 日	日)至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	739,531.55	481,813.90
银行间市场交易费用	-	-
合计	739,531.55	481,813.90

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 11 月 15 日	上年度可比期间 2017 年 7 月 6 日(基金合同生 效日)至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	43,000.00	40,000.00
信息披露费	65,000.00	37,500.00
账户维护费	19,500.00	3,000.00
银行费用	6,853.76	7,076.08
合计	134,353.76	87,576.08

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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

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

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1月1日至2018年 11月15日	上年度可比期间 2017年7月6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	331,322.96	908,595.96
其中：支付销售机构的客户维护费	152,502.04	607,980.18

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

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 11月15日	上年度可比期间 2017年7月6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	55,220.52	151,432.67

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

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11月 15日		上年度可比期间 2017年7月6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
	中国银行	14,127,762.04	79,632.92	15,079,788.71

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。

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11月15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。

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，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；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。

7.4.13.3 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。

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 7.4.12 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 7.4.12.3 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。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 11 月 15 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,127,762.04	-	-	-	14,127,762.04
结算备付金	65,866.63	-	-	-	65,866.63
存出保证金	27,651.41	-	-	-	27,651.41
交易性金融资产	-	-	-	1,086,062.60	1,086,062.60
应收利息	-	-	-	11,902.26	11,902.26
应收申购款	-	-	-	1,438.86	1,438.86
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,221,280.08	-	-	1,099,403.72	15,320,683.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,720,359.99	6,720,359.99
应付管理人报酬	-	-	-	9,738.42	9,738.42
应付托管费	-	-	-	1,623.06	1,623.06
应付交易费用	-	-	-	19,163.18	19,163.18

其他负债	-	-	-	123,727.01	123,727.01
负债总计	-	-	-	6,874,611.66	6,874,611.66
利率敏感度缺口	14,221,280.08	-	-	-5,775,207.94	8,446,072.14
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期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。

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。

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11月15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	1,086,062.60	12.86	22,276,777.69	43.21
合计	1,086,062.60	12.86	22,276,777.69	43.21

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末未持有非固定收益类投资或持有的非固定收益类投资占比并不重大，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。于上年度末，本基金成立未满一年，尚无充足的经验数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 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 1,086,062.60 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。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（2017 年：无）。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

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 1 月 8 日至 2018 年 3 月 16 日、2018 年 4 月 3 日至 2018 年 6 月 19 日；本基金存在连续六十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 7 月 3 日至 2018 年 11 月 15 日。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,086,062.60	7.09
	其中：股票	1,086,062.60	7.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	14,193,628.67	92.64
8	其他各项资产	40,992.53	0.27
9	合计	15,320,683.80	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,086,062.60	12.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育		-
Q	卫生和社会工作		-
R	文化、体育和娱乐业		-
S	综合		-
	合计	1,086,062.60	12.86

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

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	000063	中兴通讯	47,813	965,822.60	11.44
2	601231	环旭电子	12,000	120,240.00	1.42

注：本基金本报告期末仅持有上述二只股票。

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	002475	立讯精密	8,675,909.41	16.83
2	600703	三安光电	6,465,472.54	12.54
3	300433	蓝思科技	5,243,531.60	10.17
4	002600	领益智造	4,489,321.00	8.71
5	002456	欧菲科技	4,466,197.60	8.66
6	300423	鲁亿通	3,532,367.16	6.85
7	002384	东山精密	3,134,104.00	6.08
8	002582	好想你	3,035,914.58	5.89
9	600125	铁龙物流	3,004,296.01	5.83
10	601398	工商银行	2,938,881.00	5.70
11	002508	老板电器	2,815,144.00	5.46
12	600570	恒生电子	2,642,706.00	5.13
13	600271	航天信息	2,595,658.40	5.03
14	603799	华友钴业	2,449,002.00	4.75
15	002281	光迅科技	2,395,353.00	4.65
16	603929	亚翔集成	2,234,971.00	4.33
17	600900	长江电力	2,229,956.00	4.32

18	600498	烽火通信	2,228,816.00	4.32
19	600426	华鲁恒升	2,206,433.68	4.28
20	600036	招商银行	2,019,589.14	3.92
21	300323	华灿光电	1,982,868.00	3.85
22	002236	大华股份	1,941,302.00	3.77
23	601939	建设银行	1,928,210.90	3.74
24	600584	长电科技	1,920,862.00	3.73
25	300498	温氏股份	1,900,787.00	3.69
26	300496	中科创达	1,893,314.00	3.67
27	600446	金证股份	1,854,402.00	3.60
28	600352	浙江龙盛	1,813,081.00	3.52
29	600487	亨通光电	1,683,789.00	3.27
30	002049	紫光国微	1,654,768.30	3.21
31	002035	华帝股份	1,569,307.50	3.04
32	600571	信雅达	1,561,626.00	3.03
33	002402	和而泰	1,516,651.00	2.94
34	000063	中兴通讯	1,493,026.00	2.90
35	601899	紫金矿业	1,423,950.00	2.76
36	600623	华谊集团	1,409,129.00	2.73
37	300348	长亮科技	1,360,508.00	2.64
38	002916	深南电路	1,355,005.00	2.63
39	600188	兖州煤业	1,348,454.00	2.62
40	002405	四维图新	1,316,557.00	2.55
41	000100	TCL 集团	1,302,855.00	2.53
42	300017	网宿科技	1,301,128.00	2.52
43	603601	再升科技	1,263,086.00	2.45
44	300465	高伟达	1,262,141.00	2.45
45	600031	三一重工	1,254,221.00	2.43
46	000049	德赛电池	1,245,682.00	2.42
47	600000	浦发银行	1,230,984.00	2.39
48	300059	东方财富	1,222,420.00	2.37
49	002466	天齐锂业	1,220,384.00	2.37
50	002142	宁波银行	1,196,233.80	2.32
51	600028	中国石化	1,185,799.00	2.30
52	601088	中国神华	1,182,083.00	2.29
53	603595	东尼电子	1,177,796.00	2.28

54	002007	华兰生物	1,165,522.00	2.26
55	600362	江西铜业	1,110,945.00	2.15
56	300351	永贵电器	1,106,586.00	2.15
57	600536	中国软件	1,102,596.00	2.14
58	002229	鸿博股份	1,102,265.00	2.14
59	300136	信维通信	1,101,981.00	2.14
60	300731	科创新源	1,086,751.00	2.11
61	000401	冀东水泥	1,082,018.00	2.10
62	000886	海南高速	1,077,922.00	2.09
63	300352	北信源	1,061,033.00	2.06
64	601601	中国太保	1,059,654.00	2.06
65	601818	光大银行	1,044,105.00	2.03
66	002648	卫星石化	1,035,886.00	2.01

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	600703	三安光电	9,254,238.05	17.95
2	002475	立讯精密	8,225,644.88	15.95
3	002600	领益智造	5,805,206.35	11.26
4	300433	蓝思科技	5,036,598.58	9.77
5	002456	欧菲科技	4,361,867.00	8.46
6	600584	长电科技	3,809,446.82	7.39
7	300423	鲁亿通	3,532,446.07	6.85
8	600031	三一重工	3,417,755.60	6.63
9	002582	好想你	2,987,535.40	5.79
10	002508	老板电器	2,923,095.30	5.67
11	600570	恒生电子	2,905,104.00	5.63
12	601398	工商银行	2,897,240.86	5.62
13	000049	德赛电池	2,881,936.24	5.59
14	603799	华友钴业	2,859,290.74	5.55
15	600125	铁龙物流	2,806,001.41	5.44
16	002384	东山精密	2,628,211.50	5.10
17	600271	航天信息	2,536,655.22	4.92
18	600176	中国巨石	2,373,098.90	4.60
19	002281	光迅科技	2,351,398.20	4.56
20	600498	烽火通信	2,257,445.00	4.38

21	600426	华鲁恒升	2,239,330.21	4.34
22	603929	亚翔集成	2,238,746.39	4.34
23	600900	长江电力	2,202,269.00	4.27
24	600446	金证股份	2,018,478.40	3.91
25	002236	大华股份	2,005,401.00	3.89
26	300498	温氏股份	1,948,476.00	3.78
27	600036	招商银行	1,948,096.10	3.78
28	601939	建设银行	1,943,117.82	3.77
29	600050	中国联通	1,933,048.40	3.75
30	300496	中科创达	1,916,130.65	3.72
31	300323	华灿光电	1,885,374.00	3.66
32	600352	浙江龙盛	1,774,024.53	3.44
33	002049	紫光国微	1,717,173.05	3.33
34	002035	华帝股份	1,715,577.00	3.33
35	002402	和而泰	1,687,701.65	3.27
36	000039	中集集团	1,682,379.00	3.26
37	600487	亨通光电	1,619,690.18	3.14
38	601231	环旭电子	1,618,731.00	3.14
39	300348	长亮科技	1,606,159.00	3.12
40	600571	信雅达	1,563,104.00	3.03
41	603005	晶方科技	1,554,629.00	3.02
42	601899	紫金矿业	1,408,173.77	2.73
43	600623	华谊集团	1,380,847.71	2.68
44	600066	宇通客车	1,357,100.95	2.63
45	002916	深南电路	1,352,831.00	2.62
46	600188	兖州煤业	1,343,534.00	2.61
47	002405	四维图新	1,337,067.43	2.59
48	300017	网宿科技	1,316,499.00	2.55
49	603601	再升科技	1,258,206.00	2.44
50	000886	海南高速	1,238,465.00	2.40
51	300465	高伟达	1,227,423.00	2.38
52	300059	东方财富	1,226,947.77	2.38
53	000100	TCL 集团	1,220,221.00	2.37
54	002466	天齐锂业	1,207,362.58	2.34
55	002142	宁波银行	1,187,200.00	2.30
56	600028	中国石化	1,183,236.00	2.29
57	603595	东尼电子	1,180,694.20	2.29
58	600000	浦发银行	1,173,420.00	2.28

59	000401	冀东水泥	1,166,747.00	2.26
60	601088	中国神华	1,141,786.00	2.21
61	002320	海峡股份	1,138,453.00	2.21
62	002648	卫星石化	1,115,802.00	2.16
63	002007	华兰生物	1,089,958.73	2.11
64	600016	民生银行	1,089,608.74	2.11
65	300351	永贵电器	1,089,185.00	2.11
66	600362	江西铜业	1,087,252.00	2.11
67	300731	科创新源	1,071,877.00	2.08
68	002229	鸿博股份	1,069,574.00	2.07
69	300628	亿联网络	1,061,936.00	2.06
70	000735	罗牛山	1,041,089.00	2.02

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	231,296,880.27
卖出股票收入（成交）总额	249,301,457.81

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的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

本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

根据中兴通讯公告，美国商务部工业与安全局（BIS）于美国时间 6 月 8 日通过《关于中兴通讯的替代命令》，批准《替代的和解协议》立即生效。根据协议，中兴通讯将支付合计 14 亿美元民事罚款，包括在 6 月 8 日后 60 日内一次性支付 10 亿美元，以及在 6 月 8 日后 90 日内支付至由中兴通讯选择、经 BIS 批准的美国银行托管账户并在为期十年的监察期内暂缓执行的额外 4 亿美元罚款。监察期内，若中兴通讯遵守协议约定的监察条件和 2018 年 6 月 8 日命令，监察期届满后 4 亿美元罚款将被豁免支付。在中兴通讯支付罚款后，BIS 于 7 月 13 日终止了其于 4 月 15 日激活的拒绝令，将中兴通讯及中兴康讯从《禁止出口人员清单》移除。

中兴通讯是全球四大通信设备商之一，具备全球竞争力，未来将受益于 5G 大规模建设。基于相关研究，本基金判断，公司从禁止出口名单移除后，公司经营已逐步恢复正常。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其业务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

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 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	27,651.41
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	11,902.26
5	应收申购款	1,438.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,992.53

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：本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

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

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
415	21,925.56	-	-	9,099,105.41	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	98.81	0.0015%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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
本报告期期间基金总申购份额	75,259,605.07
减：本报告期期间基金总赎回份额	112,225,936.63
本报告期期末基金份额总额	9,099,105.41

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

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 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为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，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 43,000.00 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

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	179,074,626.39	37.26%	166,773.34	37.26%	-
长江证券	1	132,234,884.06	27.51%	123,149.88	27.51%	-
东兴证券	1	101,859,231.29	21.19%	94,862.22	21.19%	-
东北证券	1	67,429,596.34	14.03%	62,797.25	14.03%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
长城证券	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	-	-	-	-	-

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
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%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

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：

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

11.8 其他重大事件

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	长盛基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	《证券日报》及本公司网站	2018年12月3日
2	关于长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金 基金合同终止及基金财产清算的公告	同上	2018年11月13日
3	长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金 2018年第3季度报告	同上	2018年10月24日
4	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9月29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东海证券申	同上	2018年9月10日

	购（含定投）费率优惠活动的公告		
6	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 摘要	同上	2018 年 8 月 29 日
7	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	同上	2018 年 8 月 29 日
8	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东北证券申购（含定投）费率优惠活动的公告	同上	2018 年 8 月 13 日
9	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加第一创业证券申购（含定投）费率优惠活动的公告	同上	2018 年 8 月 13 日
10	长盛基金管理有限公司关于开通国元证券销售代理旗下部分开放式基金基金定投业务的公告	同上	2018 年 8 月 9 日
11	长盛基金管理有限公司关于增加唐鼎耀华为旗下基金代销机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2018 年 8 月 7 日
12	长盛分享经济主题灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	同上	2018 年 7 月 20 日
13	长盛基金管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司销售旗下部分基金并参加费率优惠活	同上	2018 年 7 月 6 日

	动的公告		
14	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
15	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金开通南京苏宁基金销售有限公司定投业务并参加定投申购优惠活动的公告	同上	2018年6月15日
16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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

23	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
24	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
25	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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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2月13日
31	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

§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	20180620~20180702	0.00	16,157,091.56	16,157,091.56	0.00	0.00%
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>							

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。

13.2 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。

13.3 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、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2019年3月29日