

长盛同智优势成长混合型证券投资基金  
(LOF)  
2018 年年度报告 摘要

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：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

### 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（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 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长盛同智优势混合（LOF）
场内简称	长盛同智
基金主代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 1 月 5 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	738,338,641.93 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2007 年 2 月 16 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司，所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	本基金为混合型基金，根据对宏观经济、行业状况、公司成长性及资本市场的判断，综合评价各类资产的风险收益水平，对各类资产采取适度灵活的资产配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益—较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。

### 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

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

## § 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	2016 年
本期已实现收益	-89,175,214.37	73,199.33	-255,755,774.94
本期利润	-169,518,346.05	25,077,298.07	-252,290,740.13
加权平均基金份额本期利润	-0.2255	0.0297	-0.2744
本期基金份额净值增长率	-26.46%	3.73%	-23.65%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3687	-0.1415	-0.1724
期末基金资产净值	466,104,325.65	676,404,168.03	736,823,829.95
期末基金份额净值	0.6313	0.8585	0.8276

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

4、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 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	-11.94%	1.54%	-7.60%	1.06%	-4.34%	0.48%
过去六个月	-17.42%	1.41%	-8.46%	0.97%	-8.96%	0.44%
过去一年	-26.46%	1.31%	-15.42%	0.87%	-11.04%	0.44%
过去三年	-41.76%	1.08%	-9.24%	0.76%	-32.52%	0.32%
过去五年	-3.91%	1.42%	30.18%	1.00%	-34.09%	0.42%
自基金转型起至今	41.07%	1.47%	64.11%	1.17%	-23.04%	0.30%

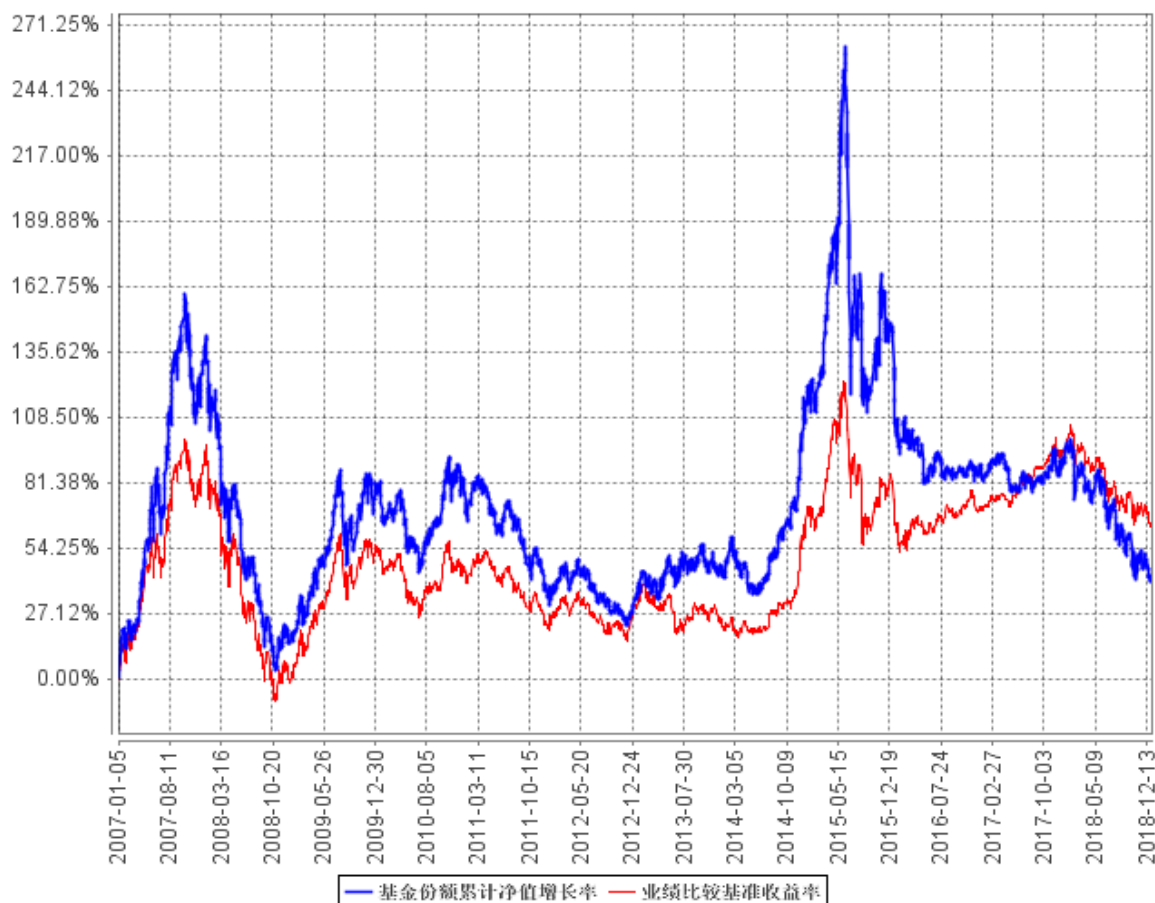
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

基准指数的构建考虑了三个原则：

- 1、公允性。选择市场认同度比较高的沪深 300 指数和上证国债指数作为计算的基础指数。
- 2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金持有的股票投资占基金资产的比例范围为 30%—95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数，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 65%、30%、5%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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

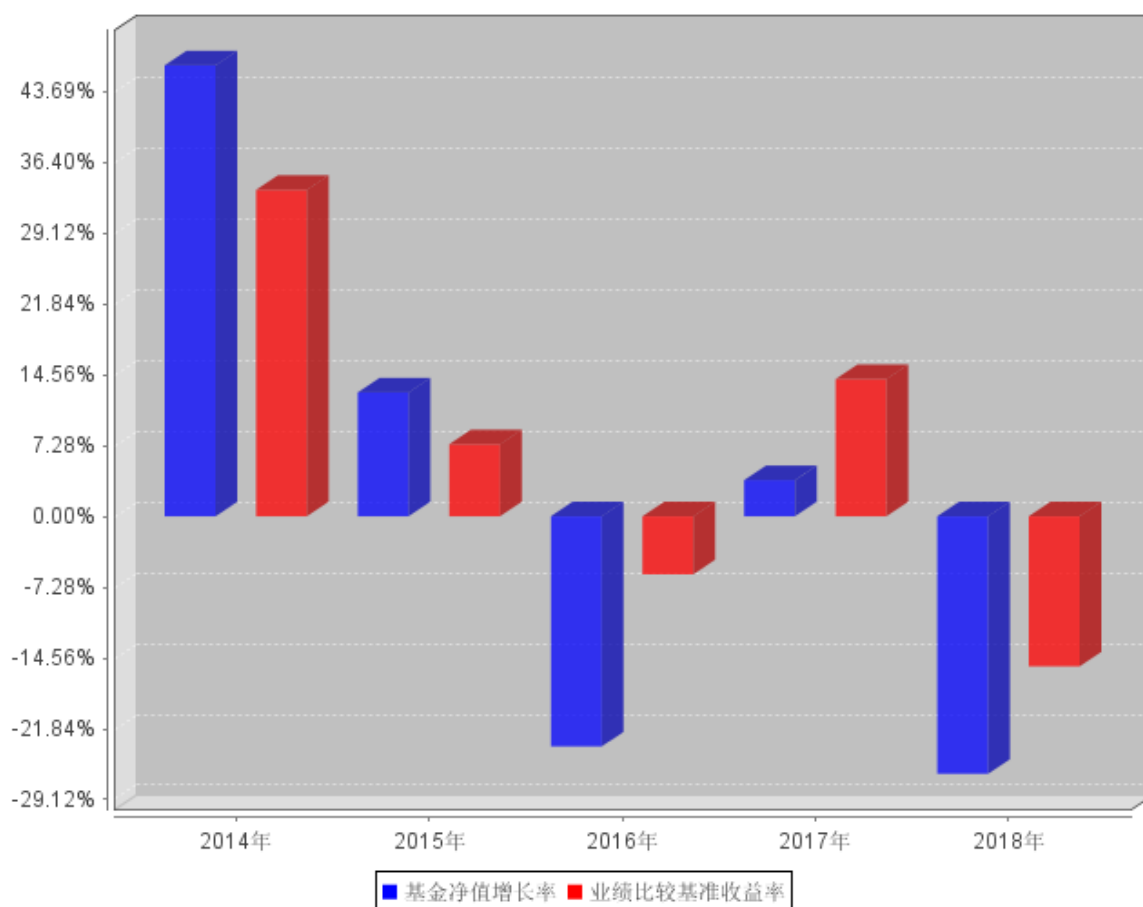


注：1、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 日。

2、按基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	
2016	1.2000	58,902,810.17	47,098,624.63	106,001,434.80	
合计	1.2000	58,902,810.17	47,098,624.63	106,001,434.80	

## §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		
王超	本基金基金经理，长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理，长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金经理，长盛同	2017年10月9日	-	11年	王超先生，1981年9月出生。中央财经大学硕士，CFA（特许金融分析师），FRM（金融风险管理师）。2007年7月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。

	盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理，长盛多因子策略优选股票型证券投资基金基金经理。				
代毅	本基金基金经理助理。	2015 年 1 月 8 日	2018 年 5 月 30 日	8 年	代毅先生，1984 年 1 月出生。北京大学金融学硕士。2010 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金经理助理等职务。目前已离任该职务。

注：1、上表基金经理及基金经理助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

全年股票市场呈现震荡下跌走势，个股和行业分化严重。行业上，休闲服务、银行表现相对较好，跌幅较小，电子、有色金属和传媒等行业表现较差。风格上，低市净率、低市盈率、大盘股等风格表现相对较好，跌幅较小，微利股、亏损股和高市盈率股等风格表现较差。

组合操作上，我们严格按照基金合同规定的投资流程，选取业绩能够持续高成长的成长型公司构建股票组合，并根据宏观经济波动、行业景气周期和上市公司成长性等因素的变化，对投资组合进行调整和更新。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.6313 元；本报告期基金份额净值增长率为-26.46%，业绩比较基准收益率为-15.42%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，经济增速大概率将继续向下调整，经济结构将进一步优化，政府预计出台一系列政策来对冲经济下行压力，释放改革动力，流动性将维持宽松。在此背景下，股票市场存在

机构性机会，相对低估、业绩确定性好的优质股会大概率获得资金青睐，与经济转型升级相关的新兴行业类股票有可能获得阶段性超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期末未实施利润分配。

本基金截至 2018 年 12 月 31 日期末可供分配利润为-272,234,316.28 元，其中：未分配利润已实现部分为 118,233,271.21 元，未分配利润未实现部分为-390,467,587.49 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）（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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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）、投资组合报告中的数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师王珊珊、马剑英 2019 年 3 月 27 日对本基金 2018 年 12 月 31 日的资产负债表和 2018 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注出具了安永华明（2019）审字第 60468688\_A05 号标准无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	137,579,518.86	113,604,977.73
结算备付金	442,917.18	182,892.11
存出保证金	173,638.35	520,365.92
交易性金融资产	306,719,201.91	603,326,024.03
其中：股票投资	306,719,201.91	568,592,978.53
基金投资	-	-
债券投资	-	34,733,045.50
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	23,735,589.01	-
应收利息	27,076.38	787,752.52
应收股利	-	-
应收申购款	153,653.30	5,077.18
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	468,831,594.99	718,427,089.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	37,329,562.77
应付赎回款	68,974.09	945,702.73
应付管理人报酬	613,114.48	853,624.21
应付托管费	102,185.75	142,270.70
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	213,996.86	1,021,576.62
应交税费	305,936.83	305,932.19

应付利息	-	-
应付利润	428,798.09	428,798.09
递延所得税负债	-	-
其他负债	994,263.24	995,454.15
负债合计	2,727,269.34	42,022,921.46
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	738,338,641.93	787,863,508.28
未分配利润	-272,234,316.28	-111,459,340.25
所有者权益合计	466,104,325.65	676,404,168.03
负债和所有者权益总计	468,831,594.99	718,427,089.49

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.6313 元，基金份额总额为

738,338,641.93 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-156,001,316.53	52,844,911.80
1. 利息收入	1,023,918.14	1,872,385.96
其中：存款利息收入	645,761.20	1,576,688.99
债券利息收入	378,156.94	295,696.97
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-76,688,978.76	25,953,518.07
其中：股票投资收益	-85,274,369.49	19,000,794.48
基金投资收益	-	-
债券投资收益	94,373.23	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	8,491,017.50	6,952,723.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-80,343,131.68	25,004,098.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6,875.77	14,909.03
<b>减：二、费用</b>	13,517,029.52	27,767,613.73
1. 管理人报酬	8,576,252.44	10,527,086.50
2. 托管费	1,429,375.40	1,754,514.44

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,059,125.93	15,038,630.01
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	1.32	-
7. 其他费用	452,274.43	447,382.78
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-169,518,346.05</b>	<b>25,077,298.07</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-169,518,346.05</b>	<b>25,077,298.07</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 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、期初所有者权益（基金净值）	787,863,508.28	-111,459,340.25	676,404,168.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-169,518,346.05	-169,518,346.05
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）	-49,524,866.35	8,743,370.02	-40,781,496.33
其中：1. 基金申购款	7,244,883.49	-1,828,827.09	5,416,056.40
2. 基金赎回款	-56,769,749.84	10,572,197.11	-46,197,552.73
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）	738,338,641.93	-272,234,316.28	466,104,325.65
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	890,349,173.49	-153,525,343.54	736,823,829.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,077,298.07	25,077,298.07
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）	-102,485,665.21	16,988,705.22	-85,496,959.99
其中：1. 基金申购款	7,110,480.57	-1,214,577.94	5,895,902.63
2. 基金赎回款	-109,596,145.78	18,203,283.16	-91,392,862.62
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）	787,863,508.28	-111,459,340.25	676,404,168.03

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

长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）（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”）证监基金字[2006]260号文《关于核准同智证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》的核准，由封闭式基金同智证券投资基金转型而成，自2007年1月5日起，《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。本基金于2007年1月22日（“转换基准日”）的基金净值为人民币955,116,003.53元，于2007年1月23日（“转换日”）折合基金份额955,116,000.00份。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券，权证以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资占基金资产的比例范围为30%-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为0%-3%；债券投资占基金资产的比例范围为0%-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在5%以



上，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将不低于 80%的股票资产投资于具有较大成长潜力的上市公司的股票。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,576,252.44	10,527,086.50
其中：支付销售机构的客户维护费	2,855,721.50	3,519,600.82

注：基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。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

#### 7.4.8.2.2 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31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,429,375.40	1,754,514.44

注：基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。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

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

注：无。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1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	137,579,518.86	627,673.78	113,604,977.73	1,499,221.85

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。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600270	外运发展	2018年12月13日	重大事项停牌	20.99	-	-	196,900	3,570,805.00	4,132,931.00	-
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项停牌	2.59	2019年1月2日	4.38	78,000	403,631.00	202,020.00	-

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。外运发展已于 2018 年 12 月 21 日获得上交所出具的《关于中外运空运发展股份有限公司股票终止上市的决定》，并于 2018 年 12 月 28 日终止上市。外运发展终止上市后，换股股权登记日收市后登记在册的除中国外运以外的全体股东可按照公告方案进行换股。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

**7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****7.4.10.1 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 302,334,105.11 元，属于第二层次的余额为人民币 4,183,076.80 元，属于第三层次的余额为人民币 202,020.00 元（2017 年 12 月 31 日：第一层次人民币 554,216,013.45 元，第二层次人民币 49,110,010.58 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

公开发售等情况，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转入第三层次公允价值的金额为人民币 202,020.00 元（2017 年：无）。

#### 7.4.10.2 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。

#### 7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.10.4 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	306,719,201.91	65.42
	其中：股票	306,719,201.91	65.42
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	138,022,436.04	29.44
8	其他各项资产	24,089,957.04	5.14
9	合计	468,831,594.99	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	5,306,064.00	1.14
C	制造业	204,870,741.64	43.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,238,592.00	1.98
E	建筑业	9,669,952.00	2.07
F	批发和零售业	5,634,323.92	1.21
G	交通运输、仓储和邮政业	13,240,240.10	2.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,814,928.32	8.11
J	金融业	50,145.80	0.01
K	房地产业	3,736,908.00	0.80
L	租赁和商务服务业	11,089,801.65	2.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,481,626.08	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-



P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,585,878.40	0.98
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	306,719,201.91	65.80

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600176	中国巨石	1,877,098	18,151,537.66	3.89
2	600585	海螺水泥	399,922	11,709,716.16	2.51
3	600332	白云山	300,000	10,728,000.00	2.30
4	603501	韦尔股份	360,000	10,580,400.00	2.27
5	600845	宝信软件	479,905	10,006,019.25	2.15
6	601186	中国铁建	889,600	9,669,952.00	2.07
7	002353	杰瑞股份	600,000	9,000,000.00	1.93
8	000063	中兴通讯	450,020	8,815,891.80	1.89
9	002383	合众思壮	600,000	7,098,000.00	1.52
10	600900	长江电力	400,000	6,352,000.00	1.36

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于

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

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600760	中航沈飞	28,722,454.68	4.25
2	600795	国电电力	24,364,145.11	3.60
3	601668	中国建筑	21,193,416.40	3.13
4	002027	分众传媒	20,991,767.60	3.10
5	300271	华宇软件	20,591,656.28	3.04
6	600585	海螺水泥	20,392,780.53	3.01
7	300122	智飞生物	19,188,122.00	2.84
8	600176	中国巨石	18,238,734.18	2.70

9	002382	蓝帆医疗	17,396,432.52	2.57
10	000338	潍柴动力	16,071,481.31	2.38
11	002202	金风科技	15,308,153.49	2.26
12	002920	德赛西威	14,279,973.28	2.11
13	600338	西藏珠峰	13,872,055.72	2.05
14	600362	江西铜业	13,387,509.00	1.98
15	600845	宝信软件	12,081,715.23	1.79
16	002353	杰瑞股份	11,879,214.44	1.76
17	600068	葛洲坝	11,876,362.00	1.76
18	603993	洛阳钼业	11,774,007.67	1.74
19	603259	药明康德	11,641,044.60	1.72
20	300747	锐科激光	11,493,925.89	1.70

#### 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	600760	中航沈飞	26,731,622.52	3.95
2	002382	蓝帆医疗	24,737,061.67	3.66
3	300271	华宇软件	23,836,949.04	3.52
4	600795	国电电力	23,806,550.12	3.52
5	300122	智飞生物	21,837,641.57	3.23
6	601668	中国建筑	18,395,275.00	2.72
7	000338	潍柴动力	17,767,871.90	2.63
8	002027	分众传媒	16,081,138.12	2.38
9	601336	新华保险	14,942,365.00	2.21
10	601088	中国神华	14,193,361.77	2.10
11	603259	药明康德	13,883,502.28	2.05
12	600068	葛洲坝	13,835,018.00	2.05
13	600338	西藏珠峰	13,499,579.47	2.00
14	002202	金风科技	13,498,623.00	2.00
15	300618	寒锐钴业	12,376,852.40	1.83
16	600690	青岛海尔	12,159,418.02	1.80
17	002920	德赛西威	11,880,365.77	1.76
18	600340	华夏幸福	11,687,969.58	1.73
19	603993	洛阳钼业	11,466,697.00	1.70
20	300747	锐科激光	11,401,115.33	1.69

### 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	943,648,606.36
卖出股票收入（成交）总额	1,039,860,752.21

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前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的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

本基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 8.12.3 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	173,638.35
2	应收证券清算款	23,735,589.01
3	应收股利	-
4	应收利息	27,076.38
5	应收申购款	153,653.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,089,957.04

### 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中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
38,704	19,076.55	6,907,661.97	0.94%	731,430,979.96	99.06%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	黄晓峰	709,737.00	1.43%
2	高兆明	577,298.00	1.17%
3	黄带顺	513,292.00	1.04%
4	王明瑞	486,832.00	0.98%
5	刘占武	418,871.00	0.85%
6	陈克明	387,000.00	0.78%
7	刘惠忠	358,136.00	0.72%
8	张晓宇	270,141.00	0.55%
9	荆南飞	248,712.00	0.50%
10	李萍	244,469.00	0.49%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 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	534,130.12	0.0723%

### 9.4 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（2007年1月5日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	787,863,508.28
本报告期期间基金总申购份额	7,244,883.49
减：本报告期期间基金总赎回份额	56,769,749.84
本报告期期末基金份额总额	738,338,641.93

## § 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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 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，本报告期内应支付该会计师事务所的报酬为 70,000.00 元。已连续为本基金服务 18 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	
东兴证券	1	918,647,782.64	46.41%	855,537.39	46.41%	-
东北证券	1	508,765,644.26	25.70%	473,813.55	25.70%	-
国泰君安	1	299,875,801.23	15.15%	279,275.94	15.15%	-
长江证券	1	147,689,860.57	7.46%	137,543.39	7.46%	-
招商证券	1	104,628,366.36	5.29%	97,441.20	5.29%	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
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
东兴证券	243,024.09	18.08%	-	-	-	-
东北证券	735,065.90	54.69%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	365,950.98	27.23%	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
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。

2、本公司租用券商交易单元的程序

（1）研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

（2）研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

（3）研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

（4）试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用

手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

（5）本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

（6）交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

### 3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

（1）本基金报告期内新增租用交易单元情况：

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

## §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

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

长盛基金管理有限公司

2019 年 3 月 29 日