长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人：长盛基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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，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	长盛沪港深混合
基金主代码	002732
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年7月5日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	23,598,331.43份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握国内宏观经济政策和市场发展趋势，深入发掘A股和港股两个市场上的高成长上市公司，全面把握中国经济的投资机会。
投资策略	（一）大类资产配置策略 在大类资产配置中，本基金将主要考虑：（1）宏观经济指标；（2）微观经济指标；（3）市场指标；（4）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。 （二）股票投资策略 本基金将适时调整国内A股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例及投资策略，主要依据包括但不限于宏观经济因素、政策因素、两地估值折溢价因素、资金利差、市场情绪以及流动性趋势等。 1.A股投资策略 在A股投资方面，本基金主要突出“自下而上”的个股精选策略，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。 2.港股通标的股票投资策略 在对A1股溢价水平进行重点分析和趋势预测的前提下，本基金管理人将优选香港市场与国内A股在部分行业形成有效互补的行业和上市公司。 最后，本基金将利用两地市场在估值水平、投资者群体结构、交易规则等方面的差异，通过估值套利、事件套利等多重策略获取收益。 （三）债券投资策略 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。 （四）权证投资策略 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。 （五）股指期货投资策略 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。 （六）资产支持证券投资策略 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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中等风险收益特征的基金品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	田青
	联系电话	010-86497608	010-67596096
	电子邮箱	zhanglin@csfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666，010-86497888	010-67596096
传真		010-86497999	010-66275853

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		http://www.csfunds.com.cn	
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	

§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7月5日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	-4,269,967.69	4,516,425.16	-1,076,965.83
本期利润	-6,380,818.28	6,921,100.52	-1,867,391.63
加权平均基金份额本期利润	-0.1879	0.1867	-0.0141
本期基金份额净值增长率	-16.77%	20.64%	-3.60%
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	-0.0319	0.1434	-0.0363
期末基金资产净值	22,844,721.23	58,182,270.20	53,581,608.06
期末基金份额净值	0.968	1.163	0.964

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12月31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	-5.47%	0.73%	-5.15%	0.92%	-0.32%	-0.19%
过去六个月	-12.24%	0.89%	-6.75%	0.81%	-5.49%	0.08%
过去一年	-16.77%	0.97%	-9.96%	0.75%	-6.81%	0.22%
自基金合同生效起至今	-3.20%	0.75%	8.54%	0.56%	-11.74%	0.19%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×40%

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沪深股票组合以及港股通的投资标的之后，选定沪深300指数作为本基金沪深股票组合的业绩基准；恒生综合指数作为本基金港股通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。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数；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%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的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40%、30%、30%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

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。截止报告日，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

注：本基金合同生效日为2016年7月5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年度、2017年度、2016年7月5日（基金合同生效日）至2016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

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		
吴达	本基金基金经理，长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理，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，国际业务部总监，长盛基金（香港）有限公司副总经理。	2016年7月5日	-	16年	吴达先生，1979年8月出生，博士，CFA（特许金融分析师）。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊顿全球收益基金经理助理，星展增韵基金经理，专户投资组合经理；新加坡毕盛高级资产管理公司亚太专户投资组合经理，资产配置委员会成员；华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理；2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，全球经济整体延续复苏格局，但经济体之间分化加大。美国经济一枝独秀，其自身经济复苏动能叠加税改效果释放刺激私人部门持续改善，使得经济在高景气阶段加速。欧洲、日本经济虽处在复苏通道上，但增速回落，外需放缓对其经济增速形成拖累。四季度美国国债收益率曲线倒挂引发了市场对大幅减税刺激后经济回落风险的担忧，美国中期选举后国会分裂、英国退欧事件的一波三折、中美贸易摩擦等国际因素都使市场情绪承压，全球股票市场均大幅下挫。

2018年A股市场经历了金融危机以来的最大幅调整，一方面受累于我国经济短周期回落，另一方面上半年即开始的中美贸易摩擦与金融去杠杆也对市场估值水平造成压制。市场大幅下挫引发了股权质押风险的暴露。四季度的政治局会议释放金融和财税政策向民营企业倾斜的信号，稳定了市场信心使得估值有所恢复。但实体经济继续放缓的趋势未改，经济高频数据与企业盈利情况均延续疲弱的情况，中美贸易谈判重启及个税减免等政策事件的出台也未能有效提振市场情绪。全球股票市场均大幅下挫促使市场风险偏好进一步下降，并等待更积极的财政与货币政策出台。避险情绪下港股市场资金流出比较明显，价值成长板块如医疗、学历教育、商业服务等泛消费板块受到医保带量采购、民办教育、社保缴存等行业政策影响下表现继续疲软，投资者转而拥抱基建、公用事业等纯防御类配置。

报告期内本基金保持了较低的仓位暴露，并在下半年进一步降低了风险暴露以规避系统性风险，同时减少了对香港市场的配置，转为配置国内A股经济后周期、5G与基建等托底经济预期强的部分板块，在一定程度上取得了防御效果。

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0.968元；本报告期基金份额净值增长率为-16.77%，业绩比较基准收益率为-9.96%。

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，全球经济增速大概率将放缓，政策不确定下全球经济增长下行压力加大，IMF在新发布的世界经济展望中也将2019年全球经济增长预期下调。全球经济增速的放缓对于出口而言意味着需求放缓，中美贸易互征关税对出口的负面影响将显现。我国经济增长速度预期将进一步下行，主要基于房地产市场销售下滑向投资传导、全球需求放缓叠加中美加征关税将对外需产生较大压力、在房地产与出口同存下行压力下，制造业投资改善的趋势可能被打断、基建投资增速或有改善但难以改变整体经济下行的趋势。

国内宏观政策仍将统筹协调稳增长和防风险的平衡，保持宏观经济、民生就业、资本市场以及市场预期的稳定是政策的核心内容，稳健的货币政策与积极的财政政策的组合仍将延续。货币政策方面，2018年以来已经实施四次降准，但存款准备金率与国际比仍偏高，未来降准仍有若干次的空间。由于短期经济增速仍处于回落区间，市场估值再度扩张需要等待政策与市场资金面回暖，但市场大部分板块通过估值收缩消化风险的同时开始向国际市场估值体系靠拢，其中优质公司标的在目前的水平值得逐步配置以获取长期盈利增长带来的回报。

2019年策略上重点是做好投资的防守反击，关注中国经济降速换挡后资产盈利能力能够保持或通过进口替代提升的行业，例如国家支持的信息产业与高端装备产业链、基建与政府投入稳定经济增长的相关板块。

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，确保基金的估值的公平、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，本基金本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2018年12月31日，期末可供分配利润为-753,610.20元，其中：未分配利润已实现部分为696,361.80元，未分配利润未实现部分为-1,449,972.00元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自2018年1月12日至2018年3月21日、自2018年3月28日至2018年6月11日期间出现连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形；自2018年7月2日至2018年12月31日期间出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师薛竞、叶尔甸于2019年3月27日对本基金2018年12月31日的资产负债表、2018年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普华永道中天审字(2019)第22268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：长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产：		
银行存款	16,010,178.11	6,322,222.92
结算备付金	18,085.45	1,911,089.46
存出保证金	6,368.32	141,016.37
交易性金融资产	6,885,965.52	43,583,228.87
其中：股票投资	6,885,965.52	43,583,228.87
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	10,000,000.00
应收证券清算款	108,301.99	-
应收利息	3,230.28	-637.18
应收股利	-	-
应收申购款	14,886.97	19,330.79
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	23,047,016.64	61,976,251.23
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	125.56	3,490,667.19
应付赎回款	14,387.01	9,203.36
应付管理人报酬	29,674.65	74,614.19
应付托管费	4,945.74	12,435.70
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	13,108.23	67,047.65
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	140,054.22	140,012.94
负债合计	202,295.41	3,793,981.03
所有者权益：		
实收基金	23,598,331.43	50,015,206.38
未分配利润	-753,610.20	8,167,063.82
所有者权益合计	22,844,721.23	58,182,270.20
负债和所有者权益总计	23,047,016.64	61,976,251.23

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值0.968元，基金份额总额23,598,331.43份。

7.2 利润表

会计主体：长盛沪港深优势精选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
一、收入	-5,316,250.93	8,187,085.65
1.利息收入	137,216.19	138,078.10
其中：存款利息收入	92,098.84	101,550.06
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	45,117.35	36,528.04
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-3,617,636.37	4,663,940.91
其中：股票投资收益	-4,128,504.65	4,460,463.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	510,868.28	203,477.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,110,850.59	2,404,675.36
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	275,019.84	980,391.28
减：二、费用	1,064,567.35	1,265,985.13
1. 管理人报酬	555,817.46	618,423.60
2. 托管费	92,636.18	103,070.64
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	268,980.62	396,471.27
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	147,133.09	148,019.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-6,380,818.28	6,921,100.52
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-6,380,818.28	6,921,100.52

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛沪港深优势精选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）	50,015,206.38	8,167,063.82	58,182,270.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,380,818.28	-6,380,818.28
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）	-26,416,874.95	-2,539,855.74	-28,956,730.69
其中：1.基金申购款	35,039,361.00	5,602,251.88	40,641,612.88
2.基金赎回款	-61,456,235.95	-8,142,107.62	-69,598,343.57
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）	23,598,331.43	-753,610.20	22,844,721.23
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）	55,599,317.22	-2,017,709.16	53,581,608.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,921,100.52	6,921,100.52
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）	-5,584,110.84	3,263,672.46	-2,320,438.38
其中：1.基金申购款	135,353,829.79	17,597,296.55	152,951,125.34
2.基金赎回款	-140,937,940.63	-14,333,623.09	-155,271,563.72
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）	50,015,206.38	8,167,063.82	58,182,270.20

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

长盛沪港深优势精选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[2015]第2643号《关于准予长盛沪港深优势精选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《长盛沪港深优势精选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募集人民币322,303,314.69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(2016)第896号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年7月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为322,529,979.43份基金份额，其中认购资金利息折合226,664.74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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛沪港深优势精选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)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金将基金资产的0-95%投资于股票资产(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-95%)，权证投资比例不超过基金资产净值的3%，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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×40%。

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》、《长盛沪港深优势精选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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2018年12月31日，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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年度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年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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)对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(5)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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6)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 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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、基金销售机