长盛环球景气行业大盘精选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,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	长盛环球行业混合(QDII)
基金主代码	080006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月26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	40,682,813.98份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于全球证券市场,把握全球经济趋势,精选景气投资行业,并在此基础上投资于其中的优势公司,实现充分分享全球经济增长收益的目标;同时在投资国家或地区配置上,有效实现全球分散化投资,力争充分分散风险,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法,运用Black-Litterman资产配置模型实现行业层面的风险最优配置,在行业内部,运用全球最化选股模型精选个股,投资管理人将两者进行有机结合,构建最优化的投资组合。
业绩比较基准	摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index)
风险收益特征	本基金为混合型基金,风险和收益低于股票型基金,高于货币基金和债券基金。同时,本基金为全球混合型证券投资基金,除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外,本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。此外,由于投资国家与地区市场的分散,风险低于投资单一市场的混合型基金。

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	zhanglin@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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	BANK OF CHINA (HONG KONG LIMITED)
	中文	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港花园道1号中银大厦

2.5 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	-2,285,068.87	7,423,073.33	3,548,663.17
本期利润	-9,963,291.71	12,206,786.22	5,346,781.37
加权平均基金份额本期利润	-0.2392	0.2806	0.0900
本期基金份额净值增长率	-17.71%	27.47%	-1.28%
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	0.1338	0.3778	0.0807
期末基金资产净值	46,124,570.51	59,828,466.92	29,288,491.53
期末基金份额净值	1.134	1.378	1.081

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	-11.48%	1.37%	-13.27%	1.22%	1.79%	0.15%
过去六个月	-16.98%	1.27%	-8.91%	0.92%	-8.07%	0.35%
过去一年	-17.71%	1.25%	-9.53%	0.86%	-8.18%	0.39%
过去三年	3.56%	1.02%	14.12%	0.72%	-10.56%	0.30%
过去五年	9.14%	1.10%	13.92%	0.74%	-4.78%	0.36%
自基金合同生效起至今	18.85%	0.95%	78.64%	0.87%	-59.79%	0.08%

注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

业绩比较基准=摩根斯坦利世界大盘股可投资指数(MSCI World Large Cap IMI Index)x 100%(以下简称MSCI世界指数)。

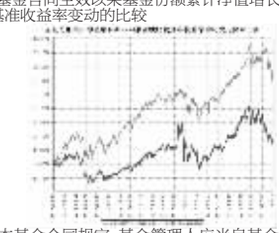
本基金为混合型基金,主要投资范围为全球主要发达地区股票市场大盘类股票,在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后选取上述指数。

摩根斯坦利世界大盘股可投资指数是按照自由流通市值调整方法编制的跟踪全球成熟市场的全球性投资指数,是MSCI标准化指数之一,适合作为全球市场投资业绩比较基准的指数。全球超过80%的基金经理人,是以MSCIBARRA编制的指数作为投资绩效评估的标准。在全球范围内,MSCI世界指数已经成为全球市场投资工具的基准标尺之一,并且由MSCIBARRA每日在市场发布。截至2010年12月,摩根斯坦利世界大盘股可投资指数涵盖23个国家和地区的超过730只股票,代表了全球国家大约75%的总市值,与本基金主要投资方向比较吻合。

MSCI世界指数样本覆盖了与证监会已经签立合作谅解备忘录的主要国家,并为许多国际著名股票投资基金选用为投资比较基准,具有良好的市场代表性。比较起来,该指数具有较好的权威性、市场代表性,用为衡量本基金业绩的基准比较合适。

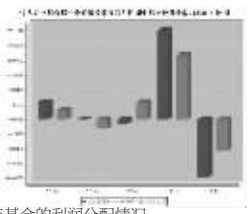
本基金的股票资产占基金资产的60%-95%。在正常的市场情况下,基金的平均股票仓位约为85%,所以,业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合本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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:本基金过去三年未进行利润分配。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吴迟	本基金基金经理、长盛沪港深优势精选灵活配置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。	2010年5月26日	-	16年	吴迟先生,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、星展摩顿基金经理、专户投资组合经理;新加坡毕盛高荣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,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,美国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年香港与美国股票市场均前高后低,整体表现受国际市场情绪与中美贸易摩擦的影响,虽然整体表现略强于国内A股但成长板块也大幅下挫。国内市场大幅下跌后引发股权质押风险的暴露后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。但由于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。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。

报告期内本基金降低了仓位暴露水平,从年初的偏成长型配置转为偏防守型,同时对部分美股中概股适当配置以分散市场震荡下行的风险,但在比例上依然偏重港股蓝筹,部分成长板块对组合净值造成了一定拖累。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.134元;本报告期基金份额净值增长率为-17.71%,业绩比较基准收益率为-9.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当下时点展望2019年,从全球视角看,在贸易战博弈明朗之前,紧缩大环境对于非美经济体的冲击趋势仍难以扭转。从国内视角看,2019年上半年,在大规模实质性宽松政策实施前,市场发生系统性趋势转变仍在酝酿,结构性的机会仍然存在。政策回暖很难在短期改变基本面下行的趋势,但可以助力估值的修复,因此市场存在超跌反弹的中期机会。2019年下半年,宏观政策边际转向,经过传导机制后,有望在“稳杠杆”环境下,使持续调整的权益市场出现修复。同时,一旦发达市场波动率开始抬升,叠加美国内部政治问题的发酵,中美博弈的僵局或迎来阶段性破局,从而使紧缩政策的外溢效应出现缓解,打开国内的政策空间,并对市场的风险偏好带来边际上的提振。

国内改策层面,在面对稳中有变的经济形势下,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之,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。

短期看,港股等离岸中概股市场能否企稳主要关注中美双方贸易摩擦的进展、国内重点会议释放的政策信号等。在宏观去杠杆主基调不变的大环境下,预计制造业投资复苏的进程会比较缓慢,年末进出口贸易也可能会受到关税变化的影响而偏弱,弱市行情大概率将延续。本基金对经济短周期增长与国际形势保持谨慎,配置上保持防御性分散组合,同时在中期视角机会的把握上重点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,例如信息产业与高端装备、消费升级相关产业链等。

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5,441,756.53元,其中:未分配利润已实现部分为15,042,886.08元,未分配利润未实现部分为-9,601,129.55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10月8日至2018年11月30日期间出现连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在长盛环球景气行业大盘精选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

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普华永道中天审字(2019)第22270号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:长盛环球景气行业大盘精选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	14,719,625.41	14,448,296.90
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	31,061,670.51	45,816,496.41
其中:股票投资	31,061,670.51	45,816,496.41
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	-	-
应收证券清算款	578,108.81	-
应收利息	461.25	792.84
应收股利	7,354.82	-
应收申购款	8,944.21	26,434.98
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	46,376,165.01	60,292,001.13
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	-	28,812.80
应付赎回款	15,157.01	178,511.86
应付管理人报酬	72,326.86	90,824.00
应付托管费	12,054.47	15,137.32
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	152,056.16	150,248.23
负债合计	251,594.50	463,534.21
所有者权益:		
实收基金	40,682,813.98	43,423,881.54
未分配利润	5,441,756.53	16,404,585.38
所有者权益合计	46,124,570.51	59,828,466.92
负债和所有者权益总计	46,376,165.01	60,292,001.13

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.134元,基金份额总额40,682,813.98份。

7.2 利润表

会计主体:长盛环球景气行业大盘精选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	-8,308,375.27	13,929,304.11
1.利息收入	19,325.68	51,555.01
其中:存款利息收入	19,325.68	51,555.01
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	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-1,199,713.93	9,505,400.04
其中:股票投资收益	-2,045,520.05	8,983,463.52
基金投资收益	-	-60,013.00
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	845,806.12	581,949.52
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-7,678,222.84	4,783,712.89
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	543,853.15	-448,565.05
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6,382.67	37,201.22
减:二、费用	1,654,916.44	1,722,517.89
1. 管理人报酬	989,013.92	976,619.81
2. 托管费	164,835.69	162,769.89
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	338,516.77	423,343.60
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	162,550.06	159,784.59
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-9,963,291.71	12,206,786.22
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-9,963,291.71	12,206,786.22

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛环球景气行业大盘精选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)	43,423,881.54	16,404,585.38	59,828,466.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-9,963,291.71	-9,963,291.71
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)	-2,741,067.56	-999,537.14	-3,740,604.70
其中:1.基金申购款	2,769,980.52	978,715.19	3,738,695.71
2.基金赎回款	-5,501,048.08	-1,978,252.33	-7,479,300.41
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)	40,682,813.98	5,441,756.53	46,124,570.51
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)	27,100,758.91	2,187,732.62	29,288,491.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	12,206,786.22	12,206,786.22
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)	16,323,122.63	2,010,066.54	18,333,189.17
其中:1.基金申购款	48,651,618.90	8,308,504.01	56,960,122.91
2.基金赎回款	-32,328,496.27	-6,298,437.47	-38,626,933.74
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)	43,423,881.54	16,404,585.38	59,828,466.92

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

长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金(原名为长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金,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”)证监基金字[2009]第1501号《关于核准长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金募集的批复》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《长盛环球景气行业大盘精选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,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339,898,507.52元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第122号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金合同》于2010年5月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为340,041,384.63份基金份额,其中认购资金利息折合142,877.11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,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金于2015年7月16日公告后更名为长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《长盛环球景气行业大盘精选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在全球证券市场公开发行上市的股票、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中对股票及其他权益类证券投资占本基金基金资产的目标比例为60%-95%,其中投资于业绩比较基准内23个全球发达地区市场大盘类上市公司股票的部分不低于本基金股票资产总额的80%;投资现金、货币市场工具及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产净值的5%-40%。本基金的业绩比较基准为:摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index)。

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》、《长盛环球景气行业大盘精选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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外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。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

7.4.7 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、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人
国元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
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
国元证券经纪(香港)有限公司(GUOYUAN SECURITIES BROKERAGE (HONG KONG) LIMITED)	基金管理人股东控制的公司
(中银国际证券有限公司 (BOCI SECURITIES LIMITED)	基金托管人控制的公司

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。

7.4.8 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	989,013.92	976,619.81
其中:支付销售机构的客户维护费	101,262.11	128,309.61

注:支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.80%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.80%/当年天数。

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	164,835.69	162,769.89

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

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	2,084,534.79	19,325.68	3,570,964.11	50,147.63
中银香港	12,635,090.62	-	10,877,322.79	-
合计	14,719,625.41	19,325.68	14,448,286.90	50,147.63

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管。其中,中国银行保管部分的资金按适用利率或约定利率计息,中银香港保管部分的资金不计息。

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

注:无。

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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
00940 HK	CHINA ANIMAL HEALTHCARE