长盛量化多策略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	长盛量化多策略
基金主代码	003658
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年2月22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	70,201,115.12份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对多种策略超额收益进行历史有效性验证和持续监控,深度挖掘具备阶段性成长机会的上市公司,满足投资人长期稳健的投资收益需求。
投资策略	(一)大类资产配置策略 本基金将通过宏观、微观经济指标,市场指标,政策因素等,动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。 (二)股票投资策略 1.量化策略相关子策略 基金管理人主要根据上市公司基本面数据、二级市场交易价格特征、分析师预期信息和行为特征,上市公司行为等数据和信息构建多个量化选股策略,并对组合中的相关策略,定期采用等权重配置进行再平衡,并在此基础上进行优化和调整。 (1)基于基本面的多因子选股策略 基金管理人对上市公司基本面数据进行因子化,并进行了历史回测,选择长期表现稳定的因子作为选股标准,主要选择盈利水平因子、成长性因子、盈利质量因子和估值因子等长期表现较好的因子。 (2)基于二级市场交易特征的多因子选股策略 基金管理人对二级市场交易特征数据进行因子化,并进行了历史回测,选择长期表现稳定的因子作为选股标准,主要选择股价冲击成本因子、价格弹性因子、价格动量因子、非线性市值等长期表现较好的因子。 (3)分析师羊群行为事件驱动策略 分析师对股票的推荐行为存在用明显的羊群行为特征,会对股价形成持续的推动作用,基金管理人利用这一效应构建了与之相对应的事件驱动策略。 (4)上市公司盈利持续高增长事件驱动策略 上市公司业绩持续增长是上市公司二级市场价格上涨的最主要原因,基金管理人也基于上述效应构建了相应的事件驱动策略,对发布业绩预期等相关公告的上市公司进行重点跟踪分析和评估。 (三)债券投资策略 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。 (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和板策略,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*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	zhanglin@csfunds.com.cn	fcsk@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	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2月22日(基金合同生效日)-2017年12月31日
本期已实现收益	-5,400,180.18	22,000,012.69
本期利润	-17,121,200.36	27,083,539.48
加权平均基金份额本期利润	-0.2099	0.0689
本期基金份额净值增长率	-22.87%	8.90%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1598	0.0893
期末基金资产净值	58,985,312.25	154,547,758.28
期末基金份额净值	0.840	1.089

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	-10.64%	1.51%	-5.04%	0.82%	-5.60%	0.69%
过去六个月	-17.16%	1.34%	-5.26%	0.74%	-11.90%	0.60%
过去一年	-22.87%	1.29%	-9.62%	0.67%	-13.25%	0.62%
自基金合同生效起至今	-16.00%	1.05%	-2.36%	0.54%	-13.64%	0.51%

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*50%+中证综合债指数收益率*50%

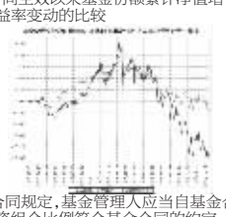
基准指数的构建考虑了三个原则:

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

2、可比性。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%;根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数,可使业绩比较更具有合理性。

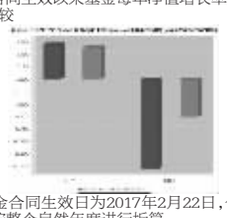
3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求, 基准指数每日按照50%、50%的比例采取再平衡, 再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按照基金合同规定,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:本基金基金合同生效日为2017年2月22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2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日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		
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500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、长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理、长盛同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。	2017年2月22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。

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

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

3、报经中国证券投资基金业协会同意,自2019年3月18日起,冯雨生同志担任长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。自2019年3月18日起,王超同志不再担任长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对投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

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,利用多种量化策略深度挖掘具备阶段性成长机会的股票构建投资组合,并根据市场环境变化和量化策略有效性,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0.840元; 本报告期基金份额净值增长率为-22.87%,业绩比较基准收益率为-9.62%。

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, 当存在有异议时,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-11,215,802.87元,其中:未分配利润已实现部分为3,946,461.03元,未分配利润未实现部分为-15,162,263.90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”)在长盛量化多策略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

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普华永道中天审字(2019)第22284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:长盛量化多策略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	15,803,988.97	9,087,596.29
结算备付金	5,053,273.92	370,817.88
存出保证金	39,178.45	233,186.38
交易性金融资产	39,474,241.49	147,837,843.26
其中:股票投资	39,411,260.39	138,599,727.26
基金投资	-	-
债券投资	62,981.10	9,238,116.00
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	8,761.54	219,231.85
应收利息	12,177.85	214,677.27
应收股利	-	-
应收申购款	1,686.73	197,575.97
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	60,393,308.95	158,160,928.90
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	540,985.52	-
应付赎回款	421,101.37	2,930,648.98
应付管理人报酬	77,903.30	206,414.99
应付托管费	12,983.86	34,402.49
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	19,722.33	295,667.52
应交税费	0.35	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	335,299.97	146,036.64
负债合计	1,407,996.70	3,613,170.62
所有者权益:		
实收基金	70,201,115.12	141,878,574.63
未分配利润	-11,215,802.87	12,669,183.65
所有者权益合计	58,985,312.25	154,547,758.28
负债和所有者权益总计	60,393,308.95	158,160,928.90

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值0.840元,基金份额总额70,201,115.12份。

7.2 利润表

会计主体:长盛量化多策略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2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入	-14,638,094.22	36,883,654.17
1.利息收入	130,324.51	1,534,714.86
其中:存款利息收入	108,776.55	998,203.13
债券利息收入	21,547.96	76,534.70
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	459,977.03
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-3,155,823.00	27,832,159.19
其中:股票投资收益	-4,626,083.52	24,741,955.94
基金投资收益	-	-
债券投资收益	106,616.10	43,382.12
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	1,363,644.42	3,046,821.13
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-11,721,020.18	5,083,526.79
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	108,424.45	2,433,253.33
减:二、费用	2,483,106.14	9,800,114.69
1. 管理人报酬	1,244,151.45	5,041,644.29
2. 托管费	207,358.64	840,274.09
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	672,480.47	3,751,961.50
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.05	-
7. 其他费用	359,115.53	166,234.81
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-17,121,200.36	27,083,539.48
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-17,121,200.36	27,083,539.48

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛量化多策略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)	141,878,574.63	12,669,183.65	154,547,758.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,121,200.36	-17,121,200.36
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)	-71,677,459.51	-6,763,786.16	-78,441,245.67
其中:1.基金申购款	9,062,674.50	952,704.25	10,015,378.75
2.基金赎回款	-80,740,134.01	-7,716,490.41	-88,456,624.42
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)	70,201,115.12	-11,215,802.87	58,985,312.25
项目	上年度可比期间 2017年2月22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)	747,266,452.70	-	747,266,452.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,083,539.48	27,083,539.48
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)	-605,387,878.07	-14,414,355.83	-619,802,233.90
其中:1.基金申购款	10,252,742.47	381,244.02	10,633,986.49
2.基金赎回款	-615,640,620.54	-14,795,599.85	-630,436,220.39
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)	141,878,574.63	12,669,183.65	154,547,758.28

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

长盛量化多策略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2738号《关于准予长盛量化多策略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《长盛量化多策略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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集747,013,215.48元, 业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第149号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年2月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为747,266,452.70份基金份额,其中认购资金利息折合253,237.22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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、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。本基金类别资产配置比例为:股票投资占基金资产的比例为0%-95%;权证投资占基金资产净值的比例不高于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、存出保证金及应收申购款等,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%。

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》、《长盛量化多策略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。

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货, 可以选择按照实际买入价计算销售额, 或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

7.4.7 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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: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2月22日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,244,151.45	5,041,644.29
其中:支付销售机构的客户维护费	623,902.03	2,766,377.84

注:支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值的1.5%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 X1.5% / 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2月22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	207,358.64	840,274.09

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0.25%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×0.25% / 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2月22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	15,803,988.97	94,302.56	9,087,596.29	966,141.28

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

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
600270	外运发展	2018年12月13日	吸收合并	20.99	-	-	28,200	474,438.00	591,918.00	注1

注:1、根据中外运空运发展股份有限公司(以下简称 “外运发展”)于2018年11月3日公布的《中国外运股份有限公司换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司暨关联交易报告书》和中国外运股份有限公司(以下简称“中国外运”)于2019年1月15日公布的《中国外运发行A股股份换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司上市公告书暨2018年第三季度财务报表》, 中国外运向外运发展除中国外