长盛生态环境主题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,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	长盛生态环境混合
基金主代码	000598
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月10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	135,621,414.75份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于从事或受益于生态环境主题的上市公司,通过精选个股和风险控制,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	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,灵活配置国内生态环境主题行业的上市公司股票和债券,谋求基金资产的长期稳定增长。本基金对生态环境主题上市公司股票的界定是:公司主营业务中从事与生态环境主题相关的业务,或者直接或间接受益于生态环境投资主题所带来的较高回报,相关股票具体包括:节能技术和装备;节能产品、节能建材和节能服务;环保技术和设备;环保服务及环保受益相关行业;清洁生产技术和清洁产品;资源回收及循环利用产业;与有效利用土地等自然资源,形成生态与经济良性循环主题相关的行业以及城市园林等相关行业上市公司。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,选择生态环境主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
业绩比较基准	50%*中证环保产业指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
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	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	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	-30,305,445.63	37,570,558.20	-39,473,422.92
本期利润	-45,215,171.08	51,021,491.89	-71,303,962.95
加权平均基金份额本期利润	-0.3134	0.2535	-0.2530
本期基金份额净值增长率	-18.97%	19.27%	-14.15%
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	0.3545	0.6707	0.4008
期末基金资产净值	183,696,322.07	275,483,862.37	339,144,570.92
期末基金份额净值	1.354	1.671	1.401

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	-10.39%	1.33%	-3.67%	0.91%	-6.72%	0.42%
过去六个月	-15.22%	1.00%	-8.62%	0.75%	-6.60%	0.25%
过去一年	-18.97%	0.89%	-18.26%	0.70%	-0.71%	0.19%
过去三年	-17.03%	0.96%	-24.02%	0.74%	6.99%	0.22%
自基金合同生效起至今	35.40%	1.46%	0.89%	0.95%	34.51%	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:50%*中证环保产业指数收益率+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。本基金为主题混合型基金,在综合比较目前市场上各主要行业指数的编制特点后,本基金选择以中证环保产业指数作为股票投资的业绩比较基准。中证环保产业指数是由中证指数有限公司编制,根据联合国环境与经济综合核算体系对于环保产业的界定方法,将符合资源管理、清洁技术和产品、污染管理的公司纳入环保产业主题,采用等权重加权方式,反映上海和深圳市场环保产业公司表现的指数。本基金主要投资于生态环境主题相关上市公司股票,因此中证环保产业指数适合作为本基金的业绩比较基准。

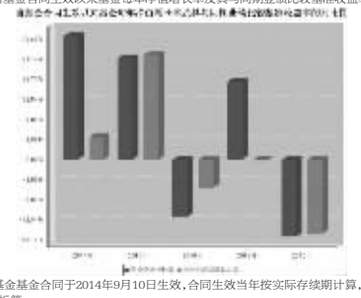
2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响,本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%,其中投资于生态环境主题的股票和债券不低于非现金基金资产的80%;根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数,可使业绩比较更具有合理性。

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:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六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 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:本基金基金合同于2014年9月10日生效,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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔培涛	本基金基金经理,长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛动态精选证券投资基金基金经理,长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,研究部执行总监。	2018年5月21日	-	10年	乔培涛先生,1979年12月出生。清华大学硕士。曾任长城证券研究员、行业研究部经理。2011年8月加入长盛基金管理有限公司。
代毅	本基金基金经理,长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理	2018年9月14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。
张谊然	本基金基金经理助理。	2017年3月9日	-	12年	张谊然女士,1985年5月出生。英国约克大学硕士。曾就职于中国国际金融有限公司等。2012年9月加入长盛基金管理有限公司。
刘旭明	本基金基金经理。	2014年9月11日	2018年5月21日	15年	刘旭明先生,1977年5月出生。清华大学管理学硕士。曾任中信证券研究部首席分析师、国信证券经济研究所首席分析师。2013年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究部总监。目前已离任该职务。

注:1、上表基金经理和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年市场呈现前高后低的走势,各项经济数据表现出韧性,但货币政策呈现持续的紧信用和去杠杆,叠加贸易战的外部冲击,使得A股跌幅较大,上证指数也创了历史第二大跌幅。

行业分化明显,上半年来看医药、食品饮料、餐饮旅游等行业较强,计算机、电子、周期有轮涨的机会,下半年食品饮料、通讯等行业有轮涨的机会,个股方面“头部”效应明显。生态环境直接相关的环保产业则全年处于向下调整期,受地方财政收缩和经济去杠杆影响较大。

报告期内,本基金上半年保持低仓位,超额收益明显;下半年仓位保持中性偏低,择机参与强势板块的反弹,但是低仓位和行业选择影响了反弹收益率。

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1.354元;本报告期基金份额净值增长率为-18.97%,业绩比较基准收益率为-18.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年GDP增速会进一步回落,符合经济发展客观规律,但是企业盈利有可能见底回升,原因在于贸易战趋向于缓和、货币处于持续宽松的状态、信用紧缩的局面开始缓解。这样的经济环境下,基本面良好的优质个股可能会率先反弹逐步走出来。新经济新成长的行业和及传统行业的龙头个股会存在明显的超额收益。

我们可以持续观察的指标是各项深化改革政策的落地、信用利差的变化、企业盈利预期的变化。同时,我们要防范的下行风险是新旧动能转换的时间过长和OECD国家经济超预期下滑。

相对2018年,本基金将自下而上为主,寻找业绩稳定向上的优质个股,争取为投资者创造良好收益。

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,2018年度未实施利润分配。

本基金截至2018年12月31日,期末可供分配利润为48,074,907.32元,其中:未分配利润已实现部分为103,885,161.72元,未分配利润未实现部分为-55,810,254.40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”)在对长盛生态环境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

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、2018年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注出具了安永华明(2019)审字第60468688_A08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:长盛生态环境主题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	93,509,906.34	18,594,792.64
结算备付金	1,472,517.99	278,824.48
存出保证金	117,535.09	91,820.46
交易性金融资产	82,590,583.70	195,364,025.44
其中:股票投资	82,520,823.44	191,896,234.94
基金投资	-	-
债券投资	69,760.26	3,467,790.50
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	-	60,400,000.00
应收证券清算款	10,369,506.78	2,879,626.65
应收利息	17,151.91	57,374.75
应收股利	-	-
应收申购款	19,041.42	804,345.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	188,096,243.23	278,470,809.63
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	2,881,930.85	695,747.17
应付赎回款	15,161.00	1,333,394.12
应付管理人报酬	242,184.84	338,973.38
应付托管费	40,364.13	56,495.59
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	885,766.13	231,969.75
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	334,513.86	330,367.25
负债合计	4,399,921.16	2,986,947.26
所有者权益:		
实收基金	135,621,414.75	164,890,130.28
未分配利润	48,074,907.32	110,593,732.09
所有者权益合计	183,696,322.07	275,483,862.37
负债和所有者权益总计	188,096,243.23	278,470,809.63

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值为人民币1.354元,基金份额总额为135,621,414.75份。

7.2 利润表

会计主体:长盛生态环境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	-38,470,582.14	58,455,897.38
1.利息收入	833,181.35	874,050.01
其中:存款利息收入	739,947.79	571,891.01
债券利息收入	38,871.58	30,010.53
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	54,361.98	272,148.47
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-24,509,250.18	44,024,455.90
其中:股票投资收益	-26,234,360.77	41,566,176.81
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,760.10	-
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	1,722,350.49	2,458,279.09
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-14,909,725.45	13,450,933.69
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	115,212.14	106,457.78
减:二、费用	6,744,588.94	7,434,405.49
1. 管理人报酬	3,342,682.92	4,506,441.65
2. 托管费	557,113.77	751,073.65
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,481,165.38	1,824,677.24
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.08	-
7. 其他费用	363,626.79	352,212.95
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-45,215,171.08	51,021,491.89
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-45,215,171.08	51,021,491.89

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛生态环境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)	164,890,130.28	110,593,732.09	275,483,862.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-45,215,171.08	-45,215,171.08
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)	-29,268,715.53	-17,303,653.69	-46,572,369.22
其中:1.基金申购款	14,863,742.34	8,766,715.23	23,630,457.57
2.基金赎回款	-44,132,457.87	-26,070,368.92	-70,202,826.79
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)	135,621,414.75	48,074,907.32	183,696,322.07
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)	242,110,757.43	97,033,813.49	339,144,570.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	51,021,491.89	51,021,491.89
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)	-77,220,627.15	-37,461,573.29	-114,682,200.44
其中:1.基金申购款	29,910,740.35	16,156,608.39	46,067,348.74
2.基金赎回款	-107,131,367.50	-53,618,181.68	-160,749,549.18
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)	164,890,130.28	110,593,732.09	275,483,862.37

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

长盛生态环境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[2014]303号文《关于核准长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》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2014年9月10日正式生效,于基金合同生效日,本基金规模为2,910,089,921.32份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期间不定。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。本基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的0%-95%;其中投资于生态环境主题的股票和债券不低于非现金基金资产的80%;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,保持现金或到期日在一年期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、应收申购款等。本基金业绩比较标准为:50%*中证环保产业指数收益率+50%*中证综合债指数收益率。

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),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	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: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	3,342,682.92	4,506,441.65
其中:支付销售机构的客户维护费	1,410,121.61	1,719,365.11

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%费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/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	557,113.77	751,073.65

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%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/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	93,509,906.34	727,029.03	18,594,792.64	558,730.80

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

注:无。

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