长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金

2019年半年度报告摘要

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2019年8月27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。本半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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月26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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2019年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛中证证券公司分级		
场内简称	券商分级		
基金主代码	502053		
交易代码	502053		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年8月13日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	125,861,419.12份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2015年8月24日		
下属分级基金的基金简称	长盛中证证券公司分级A	长盛中证证券公司分级B	长盛中证证券公司分级
下属分级基金场内简称:	券商A	券商B	券商分级
下属分级基金的交易代码	502054	502055	502053
报告期末下属分级基金份额总额	15,037,617.00份	15,037,617.00份	95,786,185.12份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证全指证券公司指数的有效跟踪。		
投资策略	1、股票投资策略 本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况(如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等)导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。 在正常市场情况下,本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 2、债券组合管理策略 基于流动性管理的需要,本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债,债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。 3、金融衍生工具投资策略 在法律法规许可时,本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以控制并降低投资组合风险、提高投资效率,降低调仓成本与跟踪误差,从而更好地实现本基金的投资目标。 4、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	中证全指证券公司指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%		
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,由于采取了基金份额分级的结构设计,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。		
下属分级基金的风险收益特征	券商A:低风险、收益相对稳定	券商B:高风险、高预期收益	券商分级:较高风险、较高预期收益

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	贺倩
	联系电话	010-86497608	010-66060069
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-86497888	95599
传真		010-86497999	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-2,260,269.20
本期利润	32,496,715.74
加权平均基金份额本期利润	0.2857
本期基金份额净值增长率	35.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1628
期末基金资产净值	111,788,911.04
期末基金份额净值	0.888

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6月30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
过去一个月	9.63%	1.95%	9.60%	1.98%	0.03%	-0.03%
过去三个月	-6.13%	2.18%	-6.65%	2.25%	0.52%	-0.07%
过去六个月	35.64%	2.59%	36.51%	2.64%	-0.87%	-0.05%
过去一年	29.91%	2.25%	29.22%	2.31%	0.69%	-0.06%
过去三年	-9.63%	1.64%	-11.49%	1.68%	1.86%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-5.02%	1.92%	-27.68%	2.11%	22.66%	-0.19%

注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

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,业绩比较基准中中证全指证券公司指数、银行活期存款利率每日按照95%、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

§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2.06亿元。长盛基金总部办公地位于北京,在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构,并拥有全资子公司长盛基金(香港)有限公司和长盛创富资产管理有限公司。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2019年6月30日,基金管理人共管理五十七只开放式基金,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
冯雨生	本基金基金经理,长盛中证100指数证券投资基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理,长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理,长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理,长盛信息安全主题量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同德主题增长混合型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,量化投资部负责人。	2015年8月13日	-	12年	冯雨生先生,硕士,CFA(特许金融分析师)。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程研究员,同盛基金经理助理等职务。

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。

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 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。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。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 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,未发生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,未发现本基金有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

上半年股票市场大幅上涨,大中小市值个股呈普涨态势。概念板块上,鸡产业、工业大麻和白酒等板块涨幅靠前,影视、网络游戏和大基建央企等板块表现较差。行业上,食品饮料、农林牧渔和非银金融等行业涨幅较大,钢铁、建筑装饰和传媒等行业涨幅靠后。风格上,大盘价值股上半年跑赢小盘成长股。

在操作中,我们严格遵守基金合同,在指数权重调整和基金申赎变动时,应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

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0.888元;本报告期基金份额净值增长率为35.64%,业绩比较基准收益率为36.51%。本报告期内日均跟踪误差为0.1003%,年度化跟踪误差为1.5865 %。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,中美贸易摩擦有望阶段性缓和,经济增速下半年仍在探底之中,政府将维持较为宽松的财政政策和货币政策,投资者情绪有望进一步好转。随着外资流入的加速和估值的可能上修,下半年结构性机会将增多。

作为指数基金,我们将继续秉承指数化投资策略,积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,控制基金的跟踪误差。

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,在存续期内,本基金(包括长盛中证证券公司指数分级份额、长盛中证证券公司指数A份额、长盛中证证券公司指数B份额)不进行收益分配。

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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—长盛基金管理有限公司2019年1月1日至2019年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	7,926,832.80	8,936,222.16
结算备付金	34,640.77	-
存出保证金	9,895.33	13,469.39
交易性金融资产	104,620,492.09	82,963,341.24
其中:股票投资	104,620,492.09	82,963,341.24
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	-	-
应收利息	3,123.28	4,154.56
应收股利	-	-
应收申购款	121,072.64	133,142.09
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	112,716,056.91	92,050,329.44
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	-	-
应付赎回款	645,901.99	547,359.27
应付管理人报酬	88,064.25	79,594.35
应付托管费	19,374.14	17,510.75
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	22,182.84	6,461.78
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	151,622.65	372,011.00
负债合计	927,145.87	1,022,937.15
所有者权益:		
实收基金	117,656,055.43	130,024,365.03
未分配利润	-5,867,144.39	-38,996,972.74
所有者权益合计	111,788,911.04	91,027,392.29
负债和所有者权益总计	112,716,056.91	92,050,329.44

注:报告截止日2019年6月30日,长盛中证证券公司份额净值为人民币0.888元,长盛中证证券公司A份额参考净值为人民币1.029元,长盛中证证券公司B份额参考净值为人民币0.747元;基金份额总额为125,861,419.12份,其中长盛中证证券公司份额为95,786,185.12份,长盛中证证券公司A份额为15,037,617.00份,长盛中证证券公司B份额为15,037,617.00份。

6.2 利润表

会计主体:长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	33,435,962.70	-29,873,049.26
1.利息收入	70,802.44	105,775.53
其中:存款利息收入	70,802.44	105,775.53
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)	-1,567,054.13	-1,735,636.32
其中:股票投资收益	-1,713,808.93	-2,311,478.28
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	146,754.80	575,841.96
3. 公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	34,756,984.94	-28,330,291.24
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	175,229.45	87,102.77
减:二、费用	939,246.96	1,268,639.07
1. 管理人报酬	545,379.78	734,583.53
2. 托管费	119,983.63	161,608.35
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	76,905.67	81,508.40
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	196,977.88	290,938.79
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	32,496,715.74	-31,141,688.33
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	32,496,715.74	-31,141,688.33

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30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)	130,024,365.03	-38,996,972.74	91,027,392.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	32,496,715.74	32,496,715.74
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)	-12,368,309.60	633,112.61	-11,735,196.99
其中:1.基金申购款	90,355,993.14	-4,562,067.99	85,793,925.15
2.基金赎回款	-102,724,302.74	5,195,180.60	-97,529,122.14
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)	117,656,055.43	-5,867,144.39	111,788,911.04

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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)	175,516,336.01	-14,651,257.62	160,865,078.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-31,141,688.33	-31,141,688.33
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)	12,296,919.76	-4,709,316.38	7,587,603.38
其中:1.基金申购款	87,530,933.77	-11,261,218.02	76,269,715.75
2.基金赎回款	-75,234,014.01	6,551,901.64	-68,682,112.37
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)	187,813,255.77	-50,502,262.33	137,310,993.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金(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[2015]1127号文《关于准予长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金注册的批复》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2015年8月13日生效,于基金合同生效日,本基金规模为262,850,224.93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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称"中国农业银行")。

本基金的基金份额包括长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金的基础份额(简称"长盛中证证券公司份额")、长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金的稳健收益类份额(简称"长盛中证证券公司A份额")和长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金的积极收益类份额(简称"长盛中证证券公司B份额")。其中,长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额的基金份额配比始终保持1:1的比例不变。

基金合同生效后,本基金将根据基金合同约定,办理场内的长盛中证证券公司份额与长盛中证证券公司A份额、长盛中证证券公司B份额之间的场内份额配对转换业务,即:基金份额持有人可将其场内的长盛中证证券公司份额,按1:1的基金份额配比,申请分拆为长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额;或基金份额持有人可将其持有的长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额,按1:1的基金份额配比,申请合并为长盛中证证券公司份额的场内份额。场外的长盛中证证券公司份额不进行份额配对转换。场外的长盛中证证券公司份额通过跨系统转托管至场内后,可按照场内的长盛中证证券公司份额配对转换规则进行操作。基金合同生效后,长盛中证证券公司份额设置单独的基金代码,可以进行场内与场外的申购和赎回。在符合法律法规和上海证券交易所规定的上市条件的情况下,长盛中证证券公司份额、长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额交易代码不同,可在上海证券交易所上市交易,但是长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额不接受申购或赎回。

在本基金存续期内,每个会计年度(基金合同生效不足六个月的除外)11月份的最后一个交易日,本基金将根据基金合同的规定进行基金的定期份额折算。在折算基准日,本基金将按照以下规则进行基金的折算:长盛中证证券公司份额和长盛中证证券公司A份额的基金份额参考净值计算规则进行计算;对于长盛中证证券公司A份额参考净值超出人民币1.000元部分,将折算为场内长盛中证证券公司份额。每两份长盛中证证券公司份额将按一份长盛中证证券公司A份额获得新增长盛中证证券公司份额的分配,场内长盛中证证券公司份额持有人折算后获得新增场内长盛中证证券公司份额,场外长盛中证证券公司份额持有人折算后获得新增场外长盛中证证券公司份额。折算后长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额的比例仍为1:1,长盛中证证券公司A份额参考净值调整为人民币1.000元。

除以上的定期份额折算外,本基金还将在以下两种情况进行不定期份额折算,即:当长盛中证证券公司份额的基金份额净值大于或等于人民币1.500元时;当长盛中证证券公司B份额的基金份额参考净值达到或跌破人民币0.250元时。折算后本基金将确保长盛中证证券公司A份额和长盛中证证券公司B份额的比例为1:1。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、权证、股指期货、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为85%以上,其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的80%,现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%-10%,其中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,现金或者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、应收申购款等;权证投资不高于基金资产净值的3%。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:中证全指证券公司指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2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征增值税试点的通知》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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内,未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	545,379.78	734,583.53
其中:支付销售机构的客户维护费	182,596.64	180,073.94

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1.00%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.00%/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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	119,983.63	161,608.35

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0.22%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.22%/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

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	7,926,832.80	70,516.52	12,597,887.27	105,106.04

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1 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104,620,492.09元,无属于第二层次和第三层次的余额(2018年12月31日:第一层次的余额为人民币68,933,290.24元,属于第二层次的余额为人民币14,030,051.00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、或属于非公开发行等情况,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第三层次公允价值本期未发生变动(2018上半年:无)。

6.4.10.2 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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于2019年8月26日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 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	104,620,492.09	92.82
	其中:股票	104,620,492.09	92.82
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	7,961,473.57	7.06
8	其他各项资产	134,091.25	0.12
9	合计	112,716,056.91	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	104,620,492.09	93.59
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	104,620,492.09	93.59

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 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。

7.3 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

7.3.1 期末指数投资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	600030	中信证券	738,300	17,578,923.00	15.73
2	600837	海通证券	752,888	10,683,480.72	9.56
3	601211	国泰君安	419,827	7,703,825.45	6.89
4	601688	华泰证券	304,123	6,788,025.36	6.07
5	600999	招商证券	266,298	4,551,032.82	4.07
6	000166	申万宏源	838,663	4,201,701.63	3.76
7	000776	广发证券	275,345	3,783,240.30	3.38
8	600958	东方证券	333,333	3,559,996.44	3.18
9	002736	国信证券	229,153	3,015,653.48	2.70
10	601377	兴业证券	436,199	2,939,981.26	2.63

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网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601108	财通证券	2,358,783.00	2.59
2	002926	华西证券	1,264,884.00	1.39
3	600837	海通证券	1,193,739.00	1.31
4	600061	国投资本	1,076,798.48	1.18
5	000166	申万宏源	1,037,488.00	1.14
6	601211	国泰君安	938,637.00	1.03
7	601066	中信建投	850,025.00	0.93
8	601688	华泰证券	810,782.00	0.89
9	601878	浙商证券	765,077.00	0.84
10	600030	中信证券	552,346.00	0.61
11	600999	招商证券	547,086.00	0.60
12	000776	广发证券	540,320.00	0.59
13	600958	东方证券	487,297.00	0.54
14	601162	天风证券	486,987.00	0.53
15	002939	长城证券	453,922.00	0.50
16	600621	华鑫股份	450,004.00	0.49
17	601377	兴业证券	360,632.00	0.40
18	002945	华林证券	356,816.36	0.39
19	601901	方正证券	344,628.00	0.38
20	002736	国信证券	332,265.00	0.37

7.4.2 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	600030	中信证券	3,701,211.00	4.07
2	600837	海通证券	3,599,789.00	3.95
3	601211	国泰君安	2,414,323.00	2.65
4	601688	华泰证券	2,354,672.00	2.59
5	000776	广发证券	1,452,390.00	1.60
6	600958	东方证券	1,403,007.00	1.54
7	600999	招商证券	1,385,203.00	1.52
8	002736	国信证券	1,013,219.00	1.11
9	601377	兴业证券	1,010,218.00	1.11
10	601901	方正证券	1,003,984.00	1.10
11	000783	长江证券	940,573.00	1.03
12	000166	申万宏源	827,902.00	0.91
13	601788	光大证券	792,193.00	0.87
14	601555	东吴证券	778,127.00	0.85
15	601099	太平洋	736,450.00	0.81
16	601198	东兴证券	593,160.00	0.65
17	000750	国海证券	547,336.00	0.60
18	002673	西部证券	539,170.00	0.59
19	601881	中国银河	507,482.00	0.56
20	002797	第一创业	491,640.00	0.54

7.4.3 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	18,566,714.84
卖出股票收入(成交)总额	29,952,740.00

注:本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金跟踪的标的指数为中证全指证券公司指数,配置了中证全指证券公司指数成分股广发证券。

2019年3月25日,广发证券收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》(广东证监局行政监管措施决定书[2019]20号),指出公司存在对境外子公司管控不到位,未有效督促境外子公司强化合规风险管理及审慎开展业务等问题,违反了《证券公司监督管理条例》第二十七条、《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》第二十七条的规定;广东证监局依照《证券公司监督管理条例》第七十条的规定,决定对公司采取责令改正的行政监管措施。广发证券是中国最优秀的证券公司之一,综合实力强,基本面良好。基于相关研究,本基金判断,本次处罚对广发证券的影响较小,因为境外业务在公司收入中的占比较低。今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.12.3 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	9,895.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,123.28
5	应收申购款	121,072.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	134,091.25

7.12.4 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处于转股期的可转换债券(可交换债券)。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	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
长盛中证证券公司分级A	96	156,641.84	4,197,881.00	27.92%	10,839,736.00	72.08%
长盛中证证券公司分级B	1,004	14,977.71	332,567.00	2.21%	14,705,050.00	97.79%
长盛中证证券公司分级	7,341	13,048.11	482,759.00	0.50%	95,303,426.12	99.50%
合计	8,441	14,910.72	5,013,207.00	3.98%	120,848,212.12	96.02%

注:1、对于分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对于合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

2、以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.2 期末上市基金前十名持有人

长盛中证证券公司分级A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	梁小红	4,927,324.00	32.77%
2	恒安标准人寿保险有限公司 - 传统分红险	2,093,457.00	13.92%
3	王少男	1,408,850.00	9.37%
4	北京磐沣投资管理合伙企业(有限合伙) - 磐沣价值私募证券投资基金	904,324.00	6.01%
5	招商财富 - 招商银行 - 招商财富 - 铂润4号债券套利专项资产管理计划	700,000.00	4.65%
6	余晓敏	452,300.00	3.01%
7	北京磐沣投资管理合伙企业(有限合伙) - 磐沣现金管理私募证券投资基金	400,000.00	2.66%
8	黄英	312,776.00	2.08%
9	施鸿宇	279,574.00	1.86%
10	李新花	269,450.00	1.79%

长盛中证证券公司分级B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	李绍发	746,201.00	4.96%
2	林秀清	476,700.00	3.17%
3	王凯	455,916.00	3.03%
4	刘玉彬	440,196.00	2.93%
5	张景涛	363,099.00	2.41%
6	李建平	353,882.00	2.35%
7	王红举	342,355.00	2.28%
8	伏牛资产管理(北京)有限公司 - 伏牛基金一号私募基金	332,367.00	2.21%
9	陈彦巍	325,850.00	2.17%
10	沈锋	308,665.00	2.05%

长盛中证证券公司分级

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	国联人寿保险股份有限公司 - 分红产品贰号	481,303.00	6.33%
2	王凯	464,146.00	6.11%
3	刘玉彬	362,293.00	4.77%
4	郭明占	259,526.00	3.42%
5	韩劲	247,524.00	3.26%
6	朱俊云	240,188.00	3.16%
7	张征	173,108.00	2.28%
8	陈万荣	156,116.00	2.05%
9	苏鹏	117,237.00	1.54%
10	张锋	109,363.00	1.44%

注:1、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。

2、对于长盛中证证券公司指数分级、长盛中证证券公司A、长盛中证证券公司B前十名持有人持有份额比例的分母采用各自级别的份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长盛中证证券公司分级A	0.00	0.0000%
	长盛中证证券公司分级B	0.00	0.0000%
	长盛中证证券公司分级	1,582.41	0.0017%
	合计	1,582.41	0.0017%

注:对于分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对于合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.4 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	份额级别	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	长盛中证证券公司分级A	0
	长盛中证证券公司分级B	0
	长盛中证证券公司分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛中证证券公司分级A	0
	长盛中证证券公司分级B	0
	长盛中证证券公司分级	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长盛中证证券公司分级A	长盛中证证券公司分级B	长盛中证证券公司分级
基金合同生效日(2015年8月13日)基金份额总额	31,708,386.00	31,708,386.00	199,433,452.93
本报告期期初基金份额总额	10,379,817.00	10,379,817.00	67,736,053.30
本报告期期间基金总申购份额	-	-	78,284,330.04
减:本报告期期间基金总赎回份额	-	-	88,748,802.50
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	4,657,800.00	4,657,800.00	38,514,604.28
本报告期期末基金份额总额	15,037,617.00	15,037,617.00	95,786,185.12

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

10.2.1本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司2019年第一次临时股东会议决议,同意钱力不再担任公司第七届董事会董事,选举严琛担任公司第七届董事会董事。以上董事人员变更,已向中国证监会北京监管局报备。

因个人原因,杨思乐向公司申请辞去副总经理职务,根据公司第七届董事会第十二次会议决议,杨思乐不再担任公司副总经理职务。以上公司高级管理人员变更,已向中国证监会北京监管局报备。

根据公司第七届董事会第十三次会议决议,聘任张壬午担任首席信息官。以上公司高级管理人员变更,已向中国证监会北京监管局报备。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

2019年1月,中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019年4月,中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略没有改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
兴业证券	1	18,305,276.48	37.73%	17,048.02	39.97%	-
中泰证券	2	15,420,536.36	31.78%	11,823.52	27.72%	-
申银万国	1	14,793,642.00	30.49%	13,776.70	32.30%	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-

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要,并能为本公司基金提供全面的信息服务。

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、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、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:无。

(2)本基金报告期内停止租用交易单元情况:

序号	席位号	券商名称	市场
1、	37783	西藏东方财富证券	上海
2、	002532	西藏东方财富证券	深圳
3、	393616	东海证券	深圳

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 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8月27日