# 长盛同享保本混合型证券投资基金 2018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:中国银行股份有限公司
送出日期:2018年8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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8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。

根据《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,本基金的第一个保本周期到期日为2018年6月28日。由于第一个保本周期到期时,未能符合保本基金存续条件,将根据本基金《基金合同》的约定,于2018年7月5日起,转型为"长盛同享灵活配置混合型证券投资基金"。详细内容请参见我公司2018年6月6日登载于官网的《关于长盛同享保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后变更为长盛同享灵活配置混合型证券投资基金及相关业务安排的公告》。

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2018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 | 长盛同享保本 | |
| 基金主代码 | 002789 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年6月28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 | 1,317,240,035.71份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 长盛同享保本A | 长盛同享保本C |
| 下属分级基金的交易代码: | 002789 | 002790 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,317,237,947.84份 | 2,087.87份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在控制风险和保持资产流动性的基础上,运用投资组合保险技术,为投资者提供保本周期到期时保本金额安全的保证,并力求获得高于业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | (一)大类资产配置策略<br>(1)CPPI策略<br>根据恒定比例组合保险原理,本基金将根据市场的波动、组合安全垫(即基金净资产超过基金价值底线的数额)的大小动态调整安全资产与风险资产投资的比例,通过对安全资产的投资实现保本周期到期保本金额的安全,通过对风险资产的投资寻求保本期间资产的稳定增值。本基金对安全资产和风险资产的资产配置具体可分为以下四步:<br>第一步:确定安全资产的最低配置比例。<br>第二步:计算投资组合的安全垫(Cushion),即投资组合净值超过安全底线的数额。<br>第三步:确定风险资产的最高配置比例。<br>(2)TIPP策略<br>本基金采用时间不变性投资组合保险策略(TimeInvariantPortfolioProtection)策略,该策略是指基金设置的价值底线随着投资组合收益的变动而调整的投资策略。<br>(二)债券投资策略<br>本基金采用自上而下的策略,以久期管理为核心,从整体资产配置、类属资产配置等方面进行积极主动的债券投资管理,实现基金份额净值的稳步提升。<br>(三)股票投资策略<br>本基金的股票投资策略包括新股申购策略和二级市场投资策略。<br>(1)新股申购<br>本基金将根据市场情况,适度参与新股申购(含增发新股),以增加收益。<br>(2)二级市场股票投资<br>本基金股票投资采用行业配置与个股精选相结合的投资策略,在定性和定量分析的基础上,通过优选具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资,以谋求超额收益。<br>(四)股指期货投资策略<br>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。<br>(五)权证投资策略<br>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。<br>(六)资产支持证券投资策略<br>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 | 两年期银行定期存款收益率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。 |

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 | 010-82019988 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | zhangln@csfunds.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-2666、010-62350088 | 95566 |
| 传真 | | 010-82255988 | 010-66594942 |

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 | 基金管理人的办公地址及基金托管人住所 |

## §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

| 基金级别 | 长盛同享保本A | 长盛同享保本C |
|---|---|---|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2018年1月1日 – 2018年6月30日) | 报告期(2018年1月1日 – 2018年6月30日) |
| 本期已实现收益 | -4,917,868.88 | -0.19 |
| 本期利润 | 46,194,371.68 | 9.44 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0162 | 0.0229 |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.49% | 2.14% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2018年6月30日) | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0643 | 0.0064 |
| 期末基金资产净值 | 1,406,370,415.61 | 2,104.31 |
| 期末基金份额净值 | 1.0677 | 1.0079 |

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

长盛同享保本A

| 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 | 0.25% | 0.04% | 0.17% | 0.01% | 0.08% | 0.03% |
| 过去三个月 | 0.82% | 0.11% | 0.52% | 0.01% | 0.30% | 0.10% |
| 过去六个月 | 1.49% | 0.17% | 1.04% | 0.01% | 0.45% | 0.16% |
| 过去一年 | 4.27% | 0.13% | 2.10% | 0.01% | 2.17% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.77% | 0.11% | 4.22% | 0.01% | 2.55% | 0.10% |

长盛同享保本C

| 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 | 0.29% | 0.03% | 0.17% | 0.01% | 0.12% | 0.02% |
| 过去三个月 | 0.86% | 0.10% | 0.52% | 0.01% | 0.34% | 0.09% |
| 过去六个月 | 2.14% | 0.19% | 1.02% | 0.01% | 1.12% | 0.18% |
| 过去一年 | 3.04% | 0.14% | 1.26% | 0.01% | 1.78% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.20% | 0.11% | 3.18% | 0.01% | 2.02% | 0.10% |

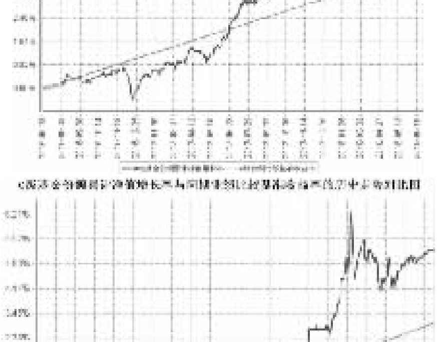
注:1、本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

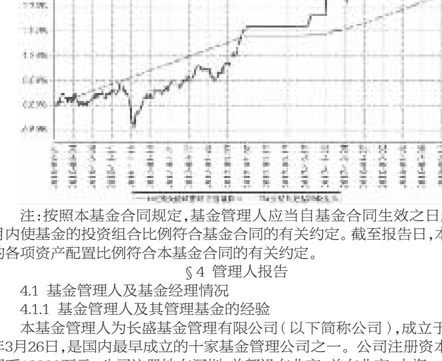
本基金业绩比较基准为两年期银行定期存款税后收益率。

本基金是保本基金,保本周期为2年,以两年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准,能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征,合理衡量比较本基金保本保证的有效性。

2、长盛同享保本C于2016年8月1日开始持有份额,自基金合同生效起至今为:2016年8月1日至2018年6月30日,且分别于2017年7月7日至2017年10月19日、2017年10月27日至2017年11月20日、2017年12月8日至2017年12月19日、2018年1月19日至2018年1月22日期间份额为0份。

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。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。

## §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%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者、特定客户资产管理业务资格和保险资产管理人资格。截至2018年6月30日,基金管理人共管理六十八只开放式基金,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 | | |
| 蔡宾 | 本基金基金经理,长盛基金管理有限公司副总经理,固定收益部总监,社保组合组合经理。 | 2016年6月28日 | – | 15年 | 蔡宾先生,1978年11月出生。毕业于中央财经大学,获硕士学位,CFA(特许金融分析师)。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006年2月加入长盛基金管理有限公司,曾任研究员、社保组合助理,投资经理,长盛积极配置债券基金基金经理,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理,长盛同鑫保本混合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,长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理,公司总经理助理等职务。 |

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

1、报告期内行情回顾

回顾上半年,经济增长有一定韧性,但内外部需求下滑趋势仍存。去杠杆逐步升级,社融规模收缩,基建投资受制于城投债务收缩,地产投资面临政策收紧,出口受到中美贸易摩擦带来的不确定性影响,经济基本面承压。政策微调以提前对冲需求下滑,货币政策从"合理稳定"向"合理充裕"过渡。

受经济基本面和政策面的利好刺激,债市收益率持续下降。尤其二季度内外部压力凸显,货币政策转松预期带动债市情绪明显好转,利率债长短端利率全面下行;信用债方面,受去杠杆影响,企业外部现金流趋弱,民企负面事件冲击信用债市场,中低等级信用债受损明显,信用利差处于较高水平,流动性改善推动高评级需求转暖,信用债分化明显。

上半年,A股市场表现不佳,上证综指下跌13.9%,沪深300指数下跌12.9%,创业板指下跌8.3%。五月下旬以来,内外部压力加剧,A股全面调整,市场情绪明显受损。板块表现方面,创业板跑赢市场,医药、餐饮、食品等消费板块表现好于指数,与经济基本面相关性更高的金融地产、周期板块表现不佳。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金坚持稳健操作思路,按照CPPI保本策略进行大类资产配置,按照久期匹配策略选择低风险的债券资产和银行存单作为安全资产;同时,根据市场形势变化及安全资产的收益积累情况,围绕价值投资主线,精选具备估值优势和持续高分红能力的股票,积极布局权益市场,把握结构性市场机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛同享保本A基金份额净值为1.0677元,本报告期基金份额净值增长率为1.49%,同期业绩比较基准收益率为1.04%;截至本报告期末长盛同享保本C基金份额净值为1.0079元,本报告期基金份额净值增长率为2.14%;同期业绩比较基准收益率为1.02%。

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,贸易战将继续发酵,实体去杠杆压制内需,经济下行压力增加。食品价格仍将拖累物价上涨,弱需求制约钢铁、煤炭等国内定价商品走强,但油价中枢上移对物价影响值得关注。货币政策有望进一步转松,但是,"宽信用"实现效果值得关注。

经济和政策多重因素支持债市走强,但在复杂的内外环境中,市场波动将加大。投资操作上需重视利率债的投资机会,根据经济基本面、货币政策的节奏变化把握利率债交易性机会,此外,随着宽货币向宽信用传导,发债主体的外部现金流有望恢复,将积极关注信用债投资机会。

股票市场方面,经济的悲观预期将继续压制市场表现,下半年将关注市场的结构性机会,以精选个股作为首要方向。首先,重点关注成长股,尤其是前期跌幅较大且业绩稳定增长的个股,这些个股伴随业绩兑现下半年有望获得超额收益;其次,关注大消费领域,居民消费升级将驱动消费相关的领域出现投资机会;最后,关注经济转型升级带来的投资机会。

本基金已于2018年7月5日转型为灵活配置型基金,下半年将根据资产价格轮动规律把握配置节奏,围绕价值投资主线,根据市场形势变化,选择更加灵活的投资策略。

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。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央国债登记结算有限责任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,本基金本报告期末实施利润分配。

本基金截至2018年6月30日,期末可供分配利润为84,706,960.70元,其中,A类份额期末可供分配利润为84,706,947.31元(A类份额未分配利润已实现部分为84,706,947.31元,未分配利润未实现部分为4,425,520.46元),C类份额期末可供分配利润为13.39元(C类份额未分配利润已实现部分为13.39元,未分配利润未实现部分为3.05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")在长盛同享保本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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:长盛同享保本混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 本期末 2018年6月30日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 资产: | | |
| 银行存款 | 2,750,450,394.78 | 3,709,842.03 |
| 结算备付金 | 1,185,683.20 | 20,500,563.30 |
| 存出保证金 | 345,462.30 | 218,962.64 |
| 交易性金融资产 | – | 5,077,751,089.69 |
| 其中:股票投资 | – | 212,699,907.39 |
| 基金投资 | – | – |
| 债券投资 | – | 4,865,051,182.30 |
| 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 | – | 4,265,413.33 |
| 应收利息 | 204,082.12 | 87,770,688.90 |
| 应收股利 | – | – |
| 应收申购款 | – | 1,088.03 |
| 递延所得税资产 | – | – |
| 其他资产 | – | – |
| 资产总计 | 2,752,185,622.40 | 5,194,217,647.92 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018年6月30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 | – | 1,918,457,909.20 |
| 应付证券清算款 | – | – |
| 应付赎回款 | 1,342,111,243.67 | 6,932,344.84 |
| 应付管理人报酬 | 2,630,691.88 | 3,597,599.18 |
| 应付托管费 | 438,448.62 | 599,599.86 |
| 应付销售服务费 | 0.44 | – |
| 应付交易费用 | 335,066.51 | 637,322.03 |
| 应交税费 | 9,007.21 | – |
| 应付利息 | – | 2,749,320.88 |
| 应付利润 | – | – |
| 递延所得税负债 | – | – |
| 其他负债 | 288,644.15 | 442,516.24 |
| 负债合计 | 1,345,813,102.48 | 1,933,416,612.23 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 1,317,240,035.71 | 3,099,007,013.89 |
| 未分配利润 | 89,132,484.21 | 161,794,021.80 |
| 所有者权益合计 | 1,406,372,519.92 | 3,260,801,035.69 |
| 负债和所有者权益总计 | 2,752,185,622.40 | 5,194,217,647.92 |

注:报告截止日2018年6月30日,长盛同享保本混合型证券投资基金份额总额1,317,240,035.71份。其中A类基金份额净值1.0677元,A类基金份额1,317,237,947.84份;C类基金份额净值1.0079元,C类基金份额2,087.87份。

6.2 利润表

会计主体:长盛同享保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 85,838,735.79 | 148,804,934.54 |
| 1.利息收入 | 77,351,088.39 | 97,783,736.43 |
| 其中:存款利息收入 | 4,066,269.08 | 1,604,937.19 |
| 债券利息收入 | 73,037,213.33 | 96,094,592.92 |
| 资产支持证券利息收入 | – | – |
| 买入返售金融资产收入 | 247,605.98 | 84,206.32 |
| 其他利息收入 | – | – |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | -43,996,317.07 | 22,645,719.49 |
| 其中:股票投资收益 | -11,833,083.01 | 29,157,800.17 |
| 基金投资收益 | – | – |
| 债券投资收益 | -32,114,431.56 | -10,550,143.21 |
| 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 | -48,802.50 | 4,038,062.53 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | 51,112,250.19 | 26,909,828.19 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | – | – |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 1,371,714.28 | 1,465,650.43 |
| 减:二、费用 | 39,644,354.67 | 46,220,880.96 |
| 1. 管理人报酬 | 17,955,428.39 | 26,865,316.93 |
| 2. 托管费 | 2,992,571.37 | 4,477,552.77 |
| 3. 销售服务费 | 0.44 | 10.66 |
| 4. 交易费用 | 1,225,148.62 | 713,395.36 |
| 5. 利息支出 | 17,126,046.01 | 13,929,250.70 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 17,126,046.01 | 13,929,250.70 |
| 6. 税金及附加 | 104,972.16 | – |
| 7. 其他费用 | 240,187.68 | 235,354.54 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 46,194,381.12 | 102,584,053.58 |
| 减:所得税费用 | – | – |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 46,194,381.12 | 102,584,053.58 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛同享保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 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) | 3,099,007,013.89 | 161,794,021.80 | 3,260,801,035.69 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | – | 46,194,381.12 | 46,194,381.12 |
| 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) | -1,781,766,978.18 | -118,855,918.71 | -1,900,622,896.89 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,239,639.00 | 79,842.02 | 1,319,481.02 |
| 2.基金赎回款 | -1,783,006,617.18 | -118,935,760.73 | -1,901,942,377.91 |
| 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) | 1,317,240,035.71 | 89,132,484.21 | 1,406,372,519.92 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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) | 4,590,498,519.96 | 5,025,701.13 | 4,595,524,221.09 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | – | 102,584,053.58 | 102,584,053.58 |
| 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) | -314,822,280.26 | -4,090,839.18 | -318,913,119.44 |
| 其中:1.基金申购款 | 552,794.60 | 4,516.90 | 557,311.50 |
| 2.基金赎回款 | -315,375,074.86 | -4,095,356.08 | -319,470,430.94 |
| 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) | 4,275,676,239.70 | 103,518,915.53 | 4,379,195,155.23 |

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

长盛同享保本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[2016]第885号《关于准予长盛同享保本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《长盛同享保本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4,732,530,528.91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854号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》于2016年6月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,734,480,303.02份基金份额,其中认购资金利息折合1,949,774.11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。本基金第一个保本周期由安徽省信用担保集团有限公司作为担保人,就第一个保本周期内为基金管理人对本基金份额持有人承担的保本清偿义务提供不可撤销的连带责任保证。

根据《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》和《长盛同享保本混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用的,不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》和《长盛同享保本混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的第一个保本周期为2年,自基金合同生效之日起至2个公历年后的对应日止。其后保本周期起始日以基金管理人公告为准。保本周期届满时,若本基金符合保本基金存续条件,本基金转入下一保本周期;基金管理人将在保本周期到期前公告到期处理规则,确定下一个保本周期的起止时间;若本基金不符合保本基金存续条件,则在一定期限内将本基金变更为非保本的"长盛同享灵活配置混合型证券投资基金"。具体日期以基金管理人公告为准。本基金第一个保本周期的保本金额指基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的投资金额(即认购保本金额,包括该类基金份额的净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和);其后各保本周期的保本金额为过渡期申购并持有到期的基金份额在当期份额折算日(当期保本周期开始日的前一工作日)的资产净值及其申购费用之和,以及上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额在当期份额折算日的资产净值。基金第一个保本周期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积(即"可赎回金额")加上该部分基金份额在该保本周期内的累计分红款之和低于其保本金额,基金管理人应补足该差额(即保本赔付差额),并在保本周期到期日后20个工作日(含)内,将差额支付给基金份额持有人。本基金A类基金份额、C类基金份额分别计算可赎回金额、保本金额、保本赔付差额。其后各保本周期到期日,对于过渡期申购并持有至到期、或从上一保本周期转入下一保本周期并持有至下一保本周期到期的基金份额,适用下一保本周期的保本条款。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同享保本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公开发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货、货币市场工具及法律、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。本基金将基金资产划分为安全资产和风险资产,其中安全资产主要投资于国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、大额存单、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款等品种。风险资产主要投资于股票、权证、股指期货等品种。本基金风险资产占基金资产的比例不高于40%;安全资产占基金资产的比例不低于60%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:两年期银行定期存款收益率(税后)。

6.4.2 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》、《长盛同享保本混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年6月30日期间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6月30日的财务状况以及2018年1月1日至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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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。

(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。

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("长盛基金") | 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 |

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 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 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 17,955,428.39 | 26,865,316.93 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 6,539,525.38 | 10,458,337.74 |

注:支付基金管理人长盛基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.2%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×1.2%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,992,571.37 | 4,477,552.77 |

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0.2%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×0.2%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

注:无。

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

单位:人民币元

| 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国银行 | 165,165,192.33 | – | – | – | – | – |
| 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国银行 | – | – | – | – | – | – |

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 2018年1月1日至2018年6月30日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 |
| 中国银行 | 2,750,450,394.78 | 316,633.33 | 32,358,430.04 | 99,887.21 |

注:本基金的部分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。

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(2018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

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由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决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日,本基金未持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。(2017年12月31日:第一层次的余额为212,585,511.74元,属于第二层次的余额为4,865,165,577.95元,无属于第三层次的余额。)。

(ii)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债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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 | – | – |
| | 其中:股票 | – | – |
| 2 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中:债券 | – | – |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 3 | 贵金属投资 | – | – |
| 4 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 5 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,751,636,077.98 | 99.98 |
| 7 | 其他各项资产 | 549,544.42 | 0.02 |
| 8 | 合计 | 2,752,185,622.40 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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股票。

7.2.2 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

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 | 601009 | 南京银行 | 84,778,144.85 | 2.60 |
| 2 | 600031 | 三一重工 | 56,609,104.00 | 1.74 |
| 3 | 002142 | 宁波银行 | 21,430,820.23 | 0.66 |
| 4 | 001979 | 招商蛇口 | 18,832,105.90 | 0.58 |
| 5 | 002007 | 华兰生物 | 16,652,424.00 | 0.51 |
| 6 | 600062 | 华润双鹤 | 14,921,735.87 | 0.46 |
| 7 | 600066 | 宇通客车 | 13,789,140.00 | 0.42 |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 12,344,177.00 | 0.38 |
| 9 | 601336 | 新华保险 | 6,833,315.00 | 0.21 |
| 10 | 002456 | 欧菲科技 | 6,795,081.88 | 0.21 |
| 11 | 600585 | 海螺水泥 | 6,735,361.00 | 0.21 |
| 12 | 000001 | 平安银行 | 2,009,890.00 | 0.06 |
| 13 | 002926 | 华西证券 | 282,324.24 | 0.01 |
| 14 | 603156 | 养元饮品 | 166,828.87 | 0.01 |
| 15 | 600901 | 江苏租赁 | 155,843.75 | 0.00 |
| 16 | 601828 | 美凯龙 | 134,064.15 | 0.00 |
| 17 | 603259 | 药明康德 | 102,405.60 | 0.00 |
| 18 | 300741 | 华宝股份 | 101,325.00 | 0.00 |
| 19 | 601838 | 成都银行 | 89,465.01 | 0.00 |
| 20 | 603001 | 奥康国际 | 85,500.00 | 0.00 |

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 | 601009 | 南京银行 | 155,648,057.45 | 4.77 |
| 2 | 600031 | 三一重工 | 50,542,584.00 | 1.55 |
| 3 | 601169 | 北京银行 | 47,966,627.06 | 1.47 |
| 4 | 001979 | 招商蛇口 | 44,613,646.81 | 1.37 |
| 5 | 000001 | 平安银行 | 21,747,878.00 | 0.67 |
| 6 | 601336 | 新华保险 | 20,386,759.93 | 0.63 |
| 7 | 002142 | 宁波银行 | 18,905,575.58 | 0.58 |
| 8 | 002007 | 华兰生物 | 17,264,661.44 | 0.53 |
| 9 | 002376 | 新北洋 | 16,805,997.01 | 0.52 |
| 10 | 600062 | 华润双鹤 | 15,398,404.60 | 0.47 |
| 11 | 600066 | 宇通客车 | 13,346,576.98 | 0.41 |
| 12 | 601318 | 中国平安 | 10,897,795.74 | 0.33 |
| 13 | 002262 | 恩华药业 | 10,063,083.86 | 0.31 |
| 14 | 002456 | 欧菲科技 | 7,777,617.82 | 0.24 |
| 15 | 600585 | 海螺水泥 | 7,186,693.00 | 0.22 |
| 16 | 300070 | 碧水源 | 2,818,328.20 | 0.09 |
| 17 | 603259 | 药明康德 | 559,912.10 | 0.02 |
| 18 | 002926 | 华西证券 | 507,454.44 | 0.02 |
| 19 | 601828 | 美凯龙 | 301,152.90 | 0.01 |
| 20 | 600901 | 江苏租赁 | 271,542.15 | 0.01 |

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 | 263,681,023.65 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 466,906,997.07 |

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的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

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,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,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 | 345,462.30 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 204,082.12 |
| 5 | 应收申购款 | – |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 549,544.42 |

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债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

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 |
| 长盛同享保本A | 8,705 | 151,319.70 | 151,191,280.59 | 11.48% | 1,166,046,667.25 | 88.52% |
| 长盛同享保本C | 2 | 1,043.94 | 0.00 | 0.00% | 2,087.87 | 100.00% |
| 合计 | 8,707 | 151,285.18 | 151,191,280.59 | 11.48% | 1,166,048,755.12 | 88.52% |

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。

8.2 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 | 长盛同享保本A | 297,097.20 | 0.0226% |
| | 长盛同享保本C | 99.80 | 4.7800% |
| | 合计 | 297,197.00 | 0.0226% |

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。

8.3 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 | 长盛同享保本A | 0 |
| | 长盛同享保本C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 长盛同享保本A | 0 |
| | 长盛同享保本C | 0 |
| | 合计 | 0 |

## §9 开放式基金份额变动

单位:份

| 项目 | 长盛同享保本A | 长盛同享保本C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2016年6月28日)基金份额总额 | 4,734,480,303.02 | – |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,099,006,713.89 | 300.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,237,351.13 | 2,287.87 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 1,783,006,117.18 | 500.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | – | – |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,317,237,947.84 | 2,087.87 |

## §10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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

原督察长叶金松先生因退休离任,由张利宁女士担任本公司督察长。

上述变更事项已经公司第七届董事会第七次会议审议通过,并按规定向相关监管机构备案。2018年4月27日,中国证券监督管理委员会北京监管局作出《关于对长盛基金管理有限公司拟任合规负责人任职资格的意见》(京证监发〔2018〕136号),对张利宁女士担任本公司督察长无异议。

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

报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内本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普华永道中天会计师事务所(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 | |
| 银河证券 | 1 | 520,806,201.45 | 71.47% | 485,023.13 | 71.47% | – |
| 安信证券 | 1 | 113,389,913.44 | 15.56% | 105,600.32 | 15.56% | – |
| 光大证券 | 1 | 94,530,387.91 | 12.97% | 88,035.73 | 12.97% | – |
| 国信证券 | 2 | – | – | – | – | – |
| 平安证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 国金证券 | 1 | – | – | – | – | – |
| 第一创业 | 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 |
| 银河证券 | 865,916,838.98 | 66.68% | 7,590,000,000.00 | 100.00% | – | – |
| 安信证券 | 44,929,651.92 | 3.46% | – | – | – | – |
| 光大证券 | 19,898,849.32 | 1.53% | – | – | – | – |
| 国信证券 | – | – | – | – | – | – |
| 平安证券 | – | – | – | – | – | – |
| 国金证券 | 367,874,324.82 | 28.33% | – | – | – | – |
| 第一创业 | – | – | – | – | – | – |

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:无。

## §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

2018年8月29日