长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF） 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：中国建设银行股份有限公司
送出日期：2018年8月29日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国建设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。

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	长盛同庆中证800指数（LOF）
场内简称	长盛同庆
基金主代码	160806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月22日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	99,441,005.56份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015年8月6日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将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控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内，以实现对中证800指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于0.35%，且年化跟踪误差小于4%的投资目标。当预期成份股发生调整、成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证800指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金将在基金合同生效3个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。
业绩比较基准	95%×中证800指数收益率＋5%×一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	zhanglnl@csfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666，010-62350088	010-67595096
传真		010-82250988	010-66275853

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	基金管理人和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(2018年1月1日－2018年6月30日)
本期已实现收益	175,198.78
本期利润	-16,880,022.21
加权平均基金份额本期利润	-0.1668
本期基金份额净值增长率	-11.76%
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	0.2077
期末基金资产净值	126,868,766.74
期末基金份额净值	1.276

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。

4、本基金由长盛同庆中证800指数分级证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为2015年5月22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标准差③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-6.93%	1.35%	-7.69%	1.32%	0.76%	0.03%
过去三个月	-9.31%	1.12%	-10.63%	1.10%	1.32%	0.02%
过去六个月	-11.76%	1.13%	-13.13%	1.11%	1.37%	0.02%
过去一年	-3.70%	0.92%	-6.76%	0.91%	3.06%	0.01%
过去三年	-22.34%	1.59%	-26.01%	1.47%	3.67%	0.12%
自基金转型起至今	-28.87%	1.69%	-31.23%	1.57%	2.36%	0.12%

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＝95%×中证800指数收益率＋5%×一年期银行定期存款利率（税后）。

基准指数：中证800指数。

本基金的业绩比较基准中证800指数由中证指数有限公司构建和发布。具体的编制规则和再平衡过程请参见中证800指数指数编制细则。

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，业绩比较基准中证800指数，一年期银行定期存款每日按照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 自基金转型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：1、本基金由长盛同庆中证800指数分级证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为2015年5月22日。

2、按照本基金合同规定，本基金将在基金合同生效3个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。截止本报告期末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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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，长盛盛鑫灵活配置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，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，长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金（LOF）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。	2015年5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。

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 管理人对报告期内办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

在报告期内，我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略，尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响，将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.276元，本报告期份额净值增长率为-11.76%，同期业绩比较基准收益率为-13.13%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.05%，控制在0.35%之内；年化跟踪误差为1.05%，控制在4%之内。

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2018年下半年的行情，宏观经济大概率平稳回落，经济结构将进一步优化，通胀水平保持稳定，去杠杆和防范金融风险是主要的政策线索，货币政策和财政政策将会保持适度灵活。来自外部的贸易争端会持续形成扰动。在此背景下，股票市场存在结构性机会，受益内需需求和改革增效的行业和板块有望持续获得超额收益，优质板块超跌后的修复行情将会提供阶段性超额收益。

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。

4.6 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）、投资总监（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资产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，本基金本报告期未实施利润分配。

截至2018年6月30日，期末可供分配利润为20,655,428.67元，其中，未分配利润已实现部分为87,953,398.96元，未分配利润未实现部分为-67,297,970.31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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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：长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）

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	13,864,151.16	9,737,947.25
结算备付金	－	－
存出保证金	2,251.71	4,482.17
交易性金融资产	114,539,724.71	142,405,963.34
其中：股票投资	114,531,258.55	142,223,995.80
基金投资	－	－
债券投资	8,466.16	181,957.54
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	2,104.27	2,060.66
应收股利	－	－
应收申购款	705.00	640.08
递延所得税资产	－	－
其他资产	－	－
资产总计	128,408,936.85	152,151,083.50

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	－	－
应付证券清算款	－	－
应付赎回款	2,545.60	66,317.11
应付管理人报酬	109,528.58	128,111.79
应付托管费	24,096.31	28,184.60
应付销售服务费	－	－
应付交易费用	8,140.74	8,337.38
应交税费	－	－
应付利息	－	－
应付利润	－	－
递延所得税负债	－	－
其他负债	1,396,858.88	1,437,796.72
负债合计	1,540,170.11	1,668,737.60
所有者权益：		
实收基金	106,213,338.07	111,143,123.68
未分配利润	20,655,428.67	39,339,222.22
所有者权益合计	126,868,766.74	150,482,345.90
负债和所有者权益总计	128,408,936.85	152,151,083.50

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.276元，基金份额总额99,441,005.56份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）

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	-15,789,399.69	11,370,589.26
1.利息收入	41,178.95	48,536.28
其中：存款利息收入	41,094.79	48,520.76
债券利息收入	84.16	15.52
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）	1,218,901.73	2,149,907.25
其中：股票投资收益	3,278.55	1,051,786.80
基金投资收益	－	－
债券投资收益	27,859.91	4,690.48
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	1,187,763.27	1,093,429.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-17,055,220.99	9,147,854.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	－	－
5.其他收入（损失以“-”号填列）	5,740.62	24,291.71
减：二、费用	1,090,622.52	1,218,639.84
1. 管理人报酬	709,396.92	793,089.63
2. 托管费	156,067.35	174,479.65
3. 销售服务费	－	－
4. 交易费用	30,089.75	55,949.80
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	195,068.50	195,120.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-16,880,022.21	10,151,949.42
减：所得税费用	－	－
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-16,880,022.21	10,151,949.42

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）

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）	111,143,123.68	39,339,222.22	150,482,345.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	－	-16,880,022.21	-16,880,022.21
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）	-4,929,785.61	-1,803,771.34	-6,733,556.95
其中：1.基金申购款	165,967.62	61,700.26	227,667.88
2.基金赎回款	-5,095,753.23	-1,865,471.60	-6,961,224.83
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）	106,213,338.07	20,655,428.67	126,868,766.74

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）	139,854,839.29	22,809,386.78	162,664,226.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	－	10,151,949.42	10,151,949.42
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）	-18,241,945.86	-3,664,756.04	-21,906,701.90
其中：1.基金申购款	164,335.19	31,851.59	196,186.78
2.基金赎回款	-18,406,281.05	-3,696,607.63	-22,102,888.68
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）	121,612,893.43	29,296,580.16	150,909,473.59

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：

_____林焰_____ _____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

长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”）是由原长盛同庆中证800指数分级证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。根据原《长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金合同》，原基金分级运作期为三年，分级运作期届满后转为上市开放式基金(LOF)。根据深圳证券交易所深证上[2015]205号《终止上市同意书》，原基金于2015年5月20日进行基金份额权益登记，于2015年5月21日终止上市。自2015年5月22日起，原基金分级运作期届满自动转为上市开放式基金(LOF)，并更名为长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)。经向中国证监会备案，《长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)》于2015年5月22日正式生效，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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据原《长盛同庆中证800指数分级证券投资基金基金合同》和原《长盛同庆中证800指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金在分级运作期内的基金份额包括长盛同庆中证 800 分级份额以下简称“同庆分级份额 ”)、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“同庆 800B”)，原基金在分级运作期届满后，根据同庆800A和同庆800B基金份额转换比例对基金份额持有人基金份额转换基准日登记在册的基金份额实施转换，按照本基金基金合同参考净值计算规则分别对同庆800A分额和同庆800B份额计算分级运作期期末基金份额参考净值，并按照各自的份额参考净值转换为本基金基金份额。于2015年5月21日（基金份额转换日）日终，同庆800A转换前份额数为157,659,406.00份，转换比例为0.5936824387，转换后对应本基金份额数为93,590,468.00份；同庆800B转换前份额数为236,489,110.00份，转换比例为1.2709917071，转换后对应本基金份额数为300,558,047.00份；同庆分级份额转换前份额数为148,119,975.78份，转换后对应本基金份额总额为148,119,975.78份。截至2015年5月21日转换完成当日，本基金基金份额总额为542,268,490.78份。本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司根据原基金基金合同约定，对同庆800A、同庆800B的份额持有人的基金份额进行了计算，并向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

经深圳证券交易所深证上[2015]378号审核同意，本基金292,227,017.00份基金份额于2015年8月6日在深圳证券交易所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深圳证券交易所场内后即可上市流通。?

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)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)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券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)。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%－95%，其中投资于中证800指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为0-3%，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%。本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×95%＋一年期银行定期存款利率(税后) ×5%。

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》、《长盛同庆中证800指数型证券投资基金(LOF)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2018年6月30日止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声明

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

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需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《关于全面推开营改增试点财政政策的通知》、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纳税额。

(2)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。

(3)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。

(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

无。

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（“长盛基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

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 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	709,396.92	793,089.63
其中：支付销售机构的客户维护费	47,760.82	55,482.71

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.00%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：日基金管理费＝前一日基金资产净值×1.00%/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	156,067.35	174,479.65

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.22%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：日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

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 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
中国建设银行	13,864,151.16	41,070.16	11,915,786.49	48,408.92

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

金额单位：人民币元

6.4.9.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	－
603706	东方环宇	2018年6月20日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	－
603105	芯能科技	2018年6月20日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	－

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.9.2 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
601390	中国中铁	2018年5月7日	重大事项停牌	6.44	－	－	65,499	727,110.52	421,813.56	－
002450	康得新	2018年6月4日	重大事项停牌	15.40	－	－	23,502	228,125.10	361,930.80	－
002252	上海莱士	2018年2月23日	重大事项停牌	21.46	－	－	9,891	89,972.77	212,260.86	－
300072	三聚环保	2018年6月19日	重大事项停牌	23.28	2018年7月10日	24.00	8,376	149,232.42	194,993.28	－