长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(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。

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	长盛同盛成长优选混合
场内简称	长盛同盛
基金主代码	160813
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月5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	226,960,140.21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	2014年12月26日

2.2 基金产品说明

投资目标	聚焦经济转型、产业升级、模式创新、政策热点等板块,通过"自上而下优选行业"和"自下而上精选个股"相结合,重点布局未来增长预期高、成长确定性大的上市公司,为投资者实现资产长期增值。
投资策略	本基金将首先参考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围,通过深入分析上述指标与因素,动态调整基金资产在股票、股指期货、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。 股票投资上,本基金将充分发挥基金管理人研究和投资的团队能力,以深入扎实的研究为基础,聚焦经济转型、产业升级、模式创新、政策热点等板块,将"自上而下优选行业"与"自下而上精选个股"相结合,将定性分析与定量分析相结合,寻找和布局未来增长预期良好、估值合理的上市公司,并审慎选择投资时机和介入时点,为投资者实现资产长期增值。 债券投资上,本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。 股指期货投资上,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。
业绩比较基准	50%×沪深300 指数收益率+50%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金,属于较高风险、较高收益的证券投资基金,通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

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的住所

§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

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	2,448,856.18
本期利润	-17,640,083.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0760
本期基金份额净值增长率	-9.33%
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	-0.0437
期末基金资产净值	171,936,151.24
期末基金份额净值	0.758

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。表中的"期末"均指本报告期最后一日,即6月30日。

4、长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)由同盛证券投资基金转型而来,转型日期为2014年11月5日(即基金合同生效日)。

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	-6.30%	1.53%	-3.57%	0.64%	-2.73%	0.89%
过去三个月	-7.56%	1.23%	-4.07%	0.57%	-3.49%	0.66%
过去六个月	-9.33%	1.21%	-4.61%	0.58%	-4.72%	0.63%
过去一年	-4.89%	1.01%	0.17%	0.47%	-5.06%	0.54%
过去三年	-39.94%	1.82%	-4.44%	0.74%	-35.50%	1.08%
自基金转型起至今	-18.15%	1.89%	31.17%	0.82%	-49.32%	1.07%

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%*沪深300指数收益率+50%*中证综合债指数收益率

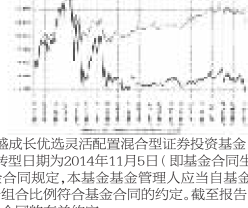
基准指数的构建考虑了三个原则:

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全债指数。目前沪深300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性,用为衡量本基金业绩的基准较为合适。

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%;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、长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)由同盛证券投资基金转型而来,转型日期为2014年11月5日(即基金合同生效日)。

2、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。

§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		
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800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,长盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛平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,长盛上证50指数分级证券投资基金基金经理。	2017年10月23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。
吴博文	本基金基金经理。	2016年2月17日	-	10年	吴博文先生,1983年6月出生。北京大学金融学硕士。历任雷曼兄弟证券股份有限公司分析师助理,野村证券股份有限公司分析师助理,诺安基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理,2015年8月加入长盛基金管理有限公司。

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和利益输送的行为。

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

上半年股票市场呈现震荡下跌走势,个股和行业分化严重。行业上,休闲服务、医药生物和食品饮料等行业表现较好,小幅上涨,综合、通信和电气设备等行业表现较差。风格上,高市净率、高价股、绩优股等风格表现较好,亏损股、微利股和中价股等风格表现较差。

组合操作上,我们严格按照基金合同规定的投资流程,选取受益于经济转型、产业升级、模式创新、政策扶持等中长期发展趋势行业,从中筛选未来增长预期良好、估值合理的股票构建投资组合,并根据宏观经济波动、行业周期和上市公司基本面等因素的变化,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0.758元;本报告期基金份额净值增长率为-9.33%,业绩比较基准收益率为-4.61%。

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,受益内部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。

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,本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至2018年6月30日,期末可供分配利润为-9,918,207.23元,其中:未分配利润已实现部分为87,773,046.79元,未分配利润未实现部分为-97,691,254.02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")在长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(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:长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(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	35,645,432.66	36,593,238.76
结算备付金	24,000.95	36,886.50
存出保证金	41,239.50	159,572.87
交易性金融资产	139,093,562.80	170,608,528.53
其中:股票投资	139,093,562.80	158,650,767.53
基金投资	-	-
债券投资	-	11,957,761.00
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	-	219,231.79
应收利息	6,129.35	256,552.94
应收股利	-	-
应收申购款	509.24	15.98
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	174,810,874.50	207,874,027.37
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	-	4,707,617.63
应付赎回款	73,641.32	18,654.91
应付管理人报酬	220,001.42	254,246.21
应付托管费	36,666.91	42,374.35
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	394,740.13	414,037.07
应交税费	1,823,891.66	1,823,891.66
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	325,781.82	363,038.06
负债合计	2,874,723.26	7,623,859.89
所有者权益:		
实收基金	181,854,358.47	192,028,216.40
未分配利润	-9,918,207.23	8,221,951.08
所有者权益合计	171,936,151.24	200,250,167.48
负债和所有者权益总计	174,810,874.50	207,874,027.37

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值为人民币0.758元,基金份额总额为226,960,140.21份。

6.2 利润表

会计主体:长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(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	-15,182,943.96	9,614,637.13
1.利息收入	214,413.71	324,786.84
其中:存款利息收入	88,766.67	324,786.84
债券利息收入	125,647.04	-
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)	4,678,093.90	2,631,976.86
其中:股票投资收益	2,932,565.43	1,598,388.15
基金投资收益	-	-
债券投资收益	104,819.08	-
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	1,640,709.39	1,033,588.71
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-20,088,939.53	6,638,993.81
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	13,487.96	18,879.62
减:二、费用	2,457,139.39	4,617,252.02
1. 管理人报酬	1,423,245.36	1,613,132.53
2. 托管费	237,207.46	268,855.39
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	587,910.61	2,535,639.47
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	208,775.96	199,624.63
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-17,640,083.35	4,997,385.11
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-17,640,083.35	4,997,385.11

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(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)	192,028,216.40	8,221,951.08	200,250,167.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-17,640,083.35	-17,640,083.35
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)	-10,173,857.93	-500,074.96	-10,673,932.89
其中:1.基金申购款	524,905.23	15,718.42	540,623.65
2.基金赎回款	-10,698,763.16	-515,793.38	-11,214,556.54
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)	181,854,358.47	-9,918,207.23	171,936,151.24

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)	227,634,586.87	-6,279,175.22	221,355,411.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,997,385.11	4,997,385.11
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)	-14,526,542.34	31,269.60	-14,495,272.74
其中:1.基金申购款	1,246,183.77	15,648.50	1,261,832.27
2.基金赎回款	-15,772,726.11	15,621.10	-15,757,105.01
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)	213,108,044.53	-1,250,520.51	211,857,524.02

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

长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)由同盛证券投资基金(以下简称"基金同盛")转型而成。根据基金同盛的基金份额持有人大会审议通过的《关于同盛证券投资基金转型有关事项的议案》,并经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于准予同盛证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2014]998号)及深圳证券交易所《终止上市通知书》(深证上[2014]406号)的同意,基金同盛于2014年11月4日进行终止上市权益登记,2014年11月5日终止上市。自基金同盛终止上市之日起,基金同盛转型为长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(以下简称"本基金"),由《同盛证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金为契约型上市开放式,存续期限不定。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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》、《关于同盛证券投资基金转换所得长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金份额折算的公告》等相关规定,基金管理人确定2014年12月3日作为基金份额折算基准日。经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算基准日基金份额净值为人民币1.247992463元,折算基准日本基金份额净值采用四舍五入的方法保留到小数点后第9位。本基金管理人按照1:1.247992463的折算比例对基金同盛进行了基金份额折算,折算后的基金份额净值为人民币1.000元,折算后本基金的基金份额数采用截尾的方式保留到整数,所产生的误差归入基金资产。折算前基金同盛份额总额为30亿份,折算后基金份额总额为3,743,977,389.00份。本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于2014年12月4日对折算后的份额进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自2014年11月17日至2014年11月28日期间开放集中申购,集中申购款扣除申购费用后的净申购金额为人民币609,423,974.44元,折合609,423,974.44份基金份额;申购资金在集中申购期间产生的利息为人民币88,606.90元,折合88,606.90份基金份额;集中申购期间收到的实收基金共计人民币609,512,581.34元,折合609,512,581.34份基金份额。业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具(2014)验字第60468688_A12号验资报告予以验证。

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)、股指期货、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:本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%;其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具;权证投资占基金资产净值的0%-3%;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以后,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%。本基金的业绩比较基准为:50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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(以下合称"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。

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6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日期间的经营成果和净值变动情况。

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需说明的会计差错更正。

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;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

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增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。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;

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。

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。

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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

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、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《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

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:本基金于本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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	1,423,245.36	1,613,132.53
其中:支付销售机构的客户维护费	44,545.94	59,843.13

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%的

年费率计提。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

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	237,207.46	268,855.39

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%的年费率计提。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

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:本基金于本报告期及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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:本基金管理人于本报告期及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金份额。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国元证券	3,743,978.00	1.6496%	3,743,978.00	1.5622%

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	35,645,432.66	85,094.50	46,066,137.09	316,009.02

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计算。

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:本基金于本报告期间及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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

6.4.12.1 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	新股未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股未上市	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	2018年8月20日	7.25	210,900	1,792,808.00	1,358,196.00	-
600221	海航控股	2018年1月10日	重大事项停牌	2.61	2018年7月20日	2.91	274,600	878,978.00	716,706.00	-
000426	兴业矿业	2018年6月19日	重大事项停牌	7.21	2018年8月27日	6.47	49,300	477,587.00	355,453.00	-
600750	江中药业	2018年6月19日	重大事项停牌	17.57	2018年8月1日	16.12	17,500	329,241.00	307,475.00	-
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事项停牌	8.37	-	-	35,976	365,458.00	301,119.12	-
002408	齐翔腾达	2018年6月19日	重大事项停牌	12.28	-	-	23,800	322,723.00	292,264.00	-
600811	东方集团	2018年5月30日	重大事项停牌	3.76	-	-	62,600	286,708.00	235,376.00	-
603690	至纯科技	2018年3月12日	重大事项停牌	18.29	2018年7月10日	20.12	3,106	5,373.38	56,808.74	-
603825	华扬联众	2018年4月16日	重大事项停牌	25.08	2018年8月17日	22.57	2,209	23,149.26	55,401.72	-
000415	渤海金控	2018年1月17日	重大事项停牌	5.19	2018年7月17日	5.26	5,400	36,868.00	28,026.00	-
601118	海南橡胶	2018年5月24日	重大事项停牌	5.87	-	-	4,500	28,442.00	26,415.00	-
002602	世纪华通	2018年6月12日	重大事项停牌	32.50	-	-	800	27,442.00	26,000.00	-
000008	神州高铁	2018年6月6日	重大事项停牌	4.41	2018年8月7日	4.46	4,800	38,857.00	21,168.00	-
603880	南卫股份	2018年4月9日	重大事项停牌	18.85	2018年8月15日	20.74	1,043	9,399.44	19,660.55	-
000587	金洲慈航	2018年6月15日	重大事项停牌	4.96	2018年7月2日	4.46	1,100	7,425.00	5,456.00	-
603501	韦尔股份	2018年5月15日	重大事项停牌	37.70	-	-	57	400.14	2,148.90	-

注:本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

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135,197,858.62元,属于第二层次的余额为人民币3,895,704.18元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次人民币155,175,267.57元,第二层次人民币15,433,260.96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(2017年:无)。

6.4.10.2承诺事项

注: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

注: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	139,093,562.80	79.57
	其中:股票	139,093,562.80	79.57
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	35,669,433.61	20.40
7	其他各项资产	47,878.09	0.03
8	合计	174,810,874.50	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

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	61,983.00	0.04
B	采矿业	4,087,869.20	2.38
C	制造业	67,007,502.84	38.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,653,997.92	1.54
E	建筑业	2,611,503.25	1.52
F	批发和零售业	6,087,649.00	3.54
G	交通运输、仓储和邮政业	877,609.20	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,718,281.18	14.38
J	金融业	24,409,373.60	14.20
K	房地产业	1,994,287.20	1.16
L	租赁和商务服务业	120,100.32	0.07
M	科学研究和技术服务业	79,391.50	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	165,093.23	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	92,208.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	4,102,563.36	2.39
S	综合	24,150.00	0.01
	合计	139,093,562.80	80.90

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

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	300271	华宇软件	565,798	10,003,308.64	5.82
2	002382	蓝帆医疗	400,000	7,720,000.00	4.49
3	600036	招商银行	220,400	5,827,376.00	3.39
4	600352	浙江龙盛	400,000	4,780,000.00	2.78
5	002419	天虹股份	315,000	4,599,000.00	2.67
6	600282	南钢股份	1,000,000	4,420,000.00	2.57
7	000568	泸州老窖	71,900	4,375,834.00	2.55
8	300433	蓝思科技	200,000	4,196,000.00	2.44
9	002142	宁波银行	244,330	3,980,135.70	2.31
10	300618	寒锐钴业	30,000	3,850,200.00	2.24

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。

7.4 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	300433	蓝思科技	14,235,010.87	7.11
2	600340	华夏幸福	13,749,516.00	6.87
3	300271	华宇软件	10,439,296.26	5.21
4	600383	金地集团	8,785,360.22	4.39
5	600567	山鹰纸业	8,382,392.14	4.19
6	601939	建设银行	7,336,019.30	3.66
7	600282	南钢股份	6,957,102.29	3.47
8	600362	江西铜业	6,486,680.00	3.24
9	600048	保利地产	6,316,536.00	3.15
10	001979	招商蛇口	5,871,791.00	2.93
11	002382	蓝帆医疗	5,798,668.96	2.90
12	601899	紫金矿业	5,796,380.65	2.89
13	600740	山西焦化	4,796,217.98	2.40
14	300558	贝达药业	4,778,356.52	2.39
15	002920	德赛西威	4,290,017.60	2.14
16	600176	中国巨石	4,269,054.01	2.13
17	000671	阳 光 城	4,150,505.00	2.07
18	002440	闰土股份	4,035,832.00	2.02
19	002419	天虹股份	3,882,114.00	1.94
20	300618	寒锐钴业	3,862,672.00	1.93

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	600340	华夏幸福	14,211,313.71	7.10
2	300433	蓝思科技	9,275,598.35	4.63
3	600584	长电科技	9,125,005.04	4.56
4	603989	艾华集团	9,088,419.50	4.54
5	300373	扬杰科技	8,314,451.12	4.15
6	600383	金地集团	8,304,757.00	4.15
7	600856	中天能源	7,015,729.00	3.50
8	600036	招商银行	6,433,096.01	3.21
9	601006	大秦铁路	5,880,603.00	2.94
10	601899	紫金矿业	5,702,083.35	2.85
11	600740	山西焦化	5,679,798.14	2.84
12	600362	江西铜业	5,548,875.00	2.77
13	001979	招商蛇口	5,415,691.90	2.70
14	300558	贝达药业	5,411,562.08	2.70
15	002156	通富微电	5,305,306.68	2.65
16	600048	保利地产	5,291,669.00	2.64
17	002410	广 联 达	4,536,954.00	2.27
18	000671	阳 光 城	4,434,109.50	2.21
19	601699	潞安环能	4,328,256.00	2.16
20	601666	平煤股份	4,311,993.00	2.15
21	002440	闰土股份	4,297,183.50	2.15
22	002142	宁波银行	4,238,015.12	2.12

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	204,609,323.44
卖出股票收入(成交)总额	206,999,028.07

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

根据2017-07-31处罚决定,浙江龙盛关于控股孙公司收到民事判决书的公告。江苏省南京市中级人民法院依照《中华人民共和国水污染防治法》第二十九条第一款、《中华人民共和国环境保护法》第六十四条、《中华人民共和国侵权责任法》第六十五条、《最高人民法院关于审理环境民事公益诉讼案件适用法律若干问题的解释》第二十二条的规定,判决如下:

(一)、被告德司达(南京)染料有限公司赔偿环境修复费用人民币2,428.29万元。

(二)、被告德司达(南京)染料有限公司应在本判决生效之日起六十日内,支付第一项所列款项的50%,剩余款项于2018年12月31日前支付。

(三)、被告德司达(南京)染料有限公司在本判决生效后十日内给付原告江苏省环保联合会律师费17万元。

案件受理费164,065元,由被告德司达(南京)染料有限公司负担。本基金做出如下说明:

浙江龙盛是国内龙头染料企业,产业链完整,具有较强行业竞争力,公司基本面良好。基于相关研究,本基金判断,旗下浙江龙盛受到处罚,对浙江龙盛的影响较小,因为此次处罚是由于公司子公司环保管理疏忽而造成的一次性处罚,对公司经营持续性没有影响,处罚亦没有限制子公司的经营,子公司及公司母体一直保持稳定经营。此次处罚,公司从中深刻吸取教训,引以为戒,继续进一步加强企业内部管理。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,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	41,239.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,129.35
5	应收申购款	509.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,878.09

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

注:报告期末前十名股票中不存在流通受限情况

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

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
19,680	11,532.53	16,356,424.00	7.21%	210,603,716.21	92.79%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	国元证券股份有限公司	3,743,978.00	1.74%
2	天津珍熙美容发展有限公司	3,656,580.00	1.70%
3	杨京京	3,238,471.00	1.51%
4	黄爱萍	2,417,766.00	1.12%
5	北京朝照物业管理有限公司	2,258,866.00	1.05%
6	北京首创能达投资开发有限公司	2,021,683.00	0.94%
7	陈润和	1,871,989.00	0.87%
8	浙江省工艺品进出口有限公司	1,682,169.00	0.78%
9	梁亚峰	1,294,336.00	0.60%
10	郑果毅	1,208,144.00	0.56%

注: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。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.0000%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年11月5日)基金份额总额	3,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	239,658,726.46
本报告期基金总申购份额	655,164.71
减:本报告期基金总赎回份额	13,353,750.96
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	226,960,140.21

§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,本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,无涉及基金管理人、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	
天风证券	1	162,769,307.04	39.72%	119,034.02	34.55%	-
中泰证券	1	129,205,065.53	31.53%	120,329.00	34.93%	-
招商证券	1	43,935,196.75	10.72%	40,917.08	11.88%	-
东方证券	1	34,367,440.94	8.39%	32,006.00	9.29%	-
光大证券	2	22,822,832.72	5.57%	16,691.23	4.84%	-
中信证券	2	16,691,039.47	4.07%	15,544.62	4.51%	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	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
天风证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	845,005.37	99.45%	-	-	-	-
招商证券	4,640.42	0.55%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

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、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:

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	新时代证券	上海	1
2	光大证券	上海	1
3	光大证券	深圳	1

(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