

长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 月 31 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

送出日期：2018 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛国企改革混合
基金主代码	001239
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月4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	2,115,033,774.32份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标在于把握中国国企改革所蕴含的投资机会，分享国企改革带给上市公司的投资收益，在严格控制投资风险的基础上，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>(一) 大类资产配置</p> <p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，动态调整基金资产在股票、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。</p> <p>(二) 国企改革主题上市公司的界定</p> <p>本基金投资的国企改革主题公司，主要分为两类： 一是直接或间接受益于已经公告的国企改革方案（含预案，下同）的上市公司。国企改革方案包括但不限于资产重组方案、股权激励方案及纳入国有资本投资运营平台方案等。该类上市公司包括通过改革将使经营状况和盈利能力获得提升的国有企业，参与国有企业改革并使经营状况和盈利能力获得提升的上市公司，以及其他在国企改革进程中获得发展机遇或利润增长点的上市公司。 二是处于国企改革的重点区域、行业，且改革预期较确定的国有企业，或与上述国有企业有较大业务关联的上市公司。</p> <p>(三) 股票投资策略</p> <p>本基金将考察改革对央企和地方国企不同的影响、改革对各个行业的不同影响，筛选出具有投资机会的上市公司股票，构建并动态调整国企改革主题股票精选池。通过对内在价值、相对价值、收购价值等方面的研究，而筛选出估值水平相对合理或低估的上市公司股票，并本着审慎精选的原则，根据市场波动情况构建股票组合并进行动态调整。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		长盛基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	贺倩
	联系电话	010-82019988	010-66060069
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	、 95599
传真		010-82255988	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年 6 月 4 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-23,928,975.93	-324,435,820.16	-1,394,824,036.86
本期利润	-1,452,591.14	-524,146,143.24	-1,184,336,611.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0006	-0.1869	-0.3720
本期基金份额净值增长率	-0.21%	-27.48%	-35.60%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.5501	-0.5405	-0.4308
期末基金资产净值	986,289,842.83	1,199,005,345.03	1,913,905,318.64
期末基金份额净值	0.466	0.467	0.644

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.97%	0.70%	2.31%	0.41%	-0.34%	0.29%
过去六个月	3.56%	0.70%	5.01%	0.35%	-1.45%	0.35%
过去一年	-0.21%	0.63%	10.65%	0.32%	-10.86%	0.31%
自基金合同生效起至今	-53.40%	1.96%	-6.15%	0.82%	-47.25%	1.14%

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%

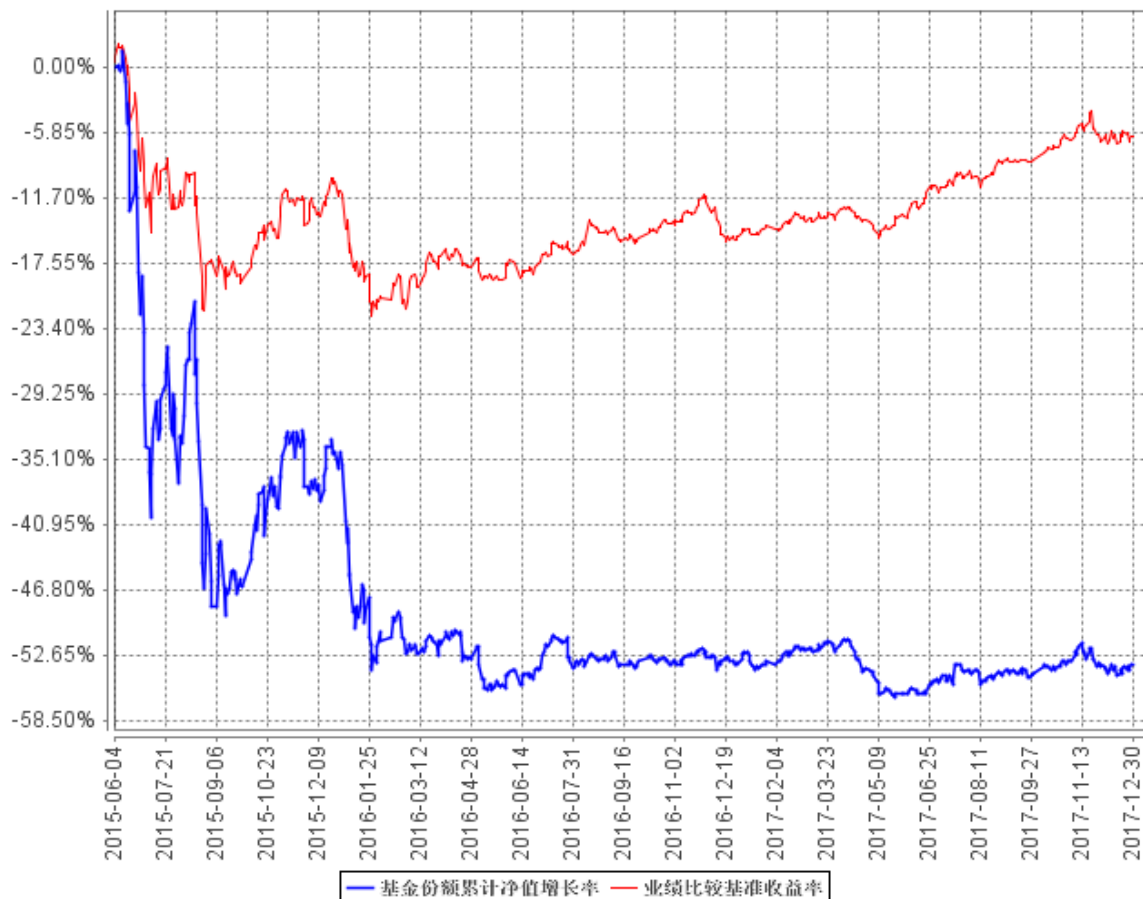
业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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，基准指数每日按照 50%、50%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时

间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

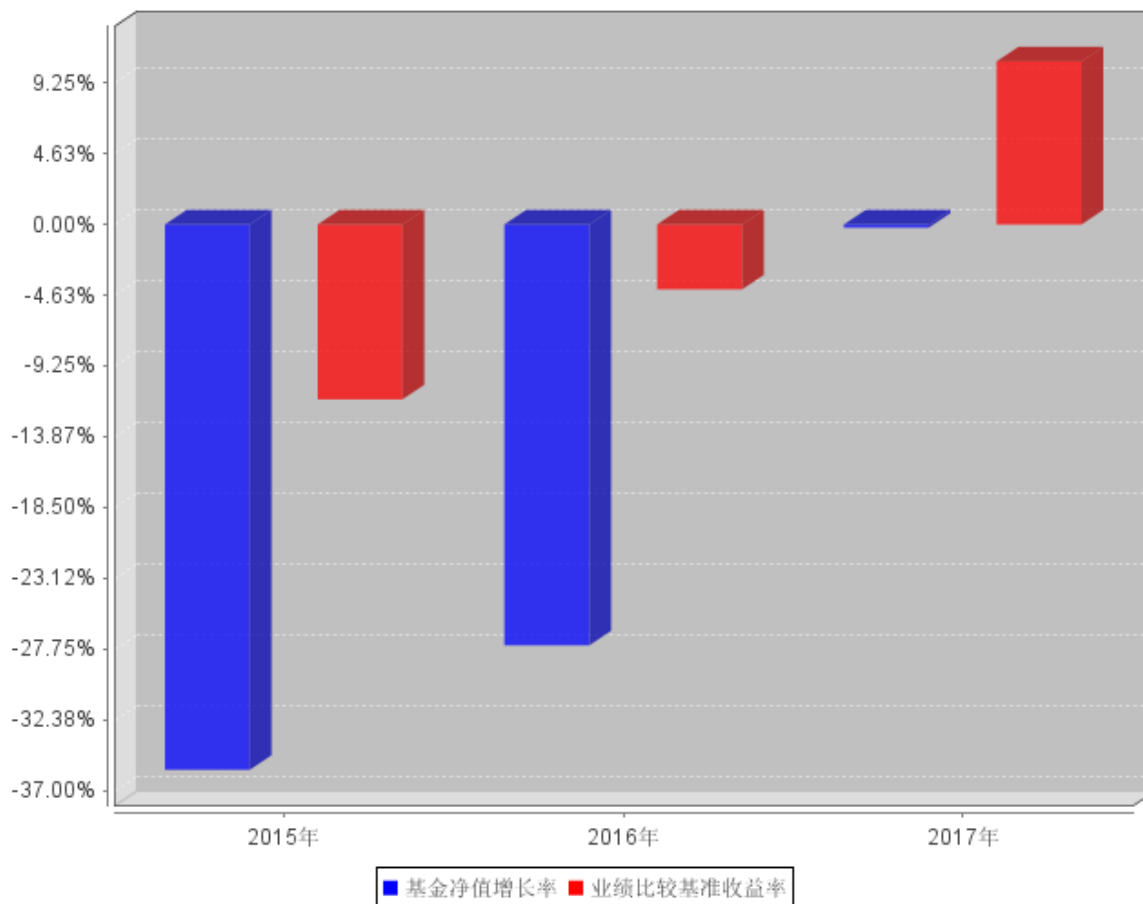
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本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。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。截止报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2015 年 6 月 4 日生效，合同生效当年按照实际存续期计算，不按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。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和特定客户资产管理业务资格。截至 2017 年 12 月 31 日，基金管理人共管理七十四只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔培涛	本基金基金经理，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛动态精选证券投资基金基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，研究部副总监。	2017 年 10 月 9 日	-	10 年	乔培涛先生，1979 年 12 月出生。清华大学硕士。曾任长城证券研究员、行业研究部经理。2011 年 8 月加入长盛基金管理有限公司。
田间	本基金基金经理。	2015 年 6 月 4 日	-	11 年	田间女士，1978 年 11 月出生。中央财经大学经济学硕士。2008 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任行业研究员，基金经理助理、同盛证券投资基金基金经理等职务。

吴博文	本基金基金经理，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。	2016 年 2 月 17 日	2017 年 10 月 9 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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场

外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年市场继续呈现出较为明显的结构分化行情，以沪深 300 为代表的蓝筹白马股表现较为突出，高估值中小市值股票则普遍较为低迷甚至部分个股连创 2016 年以来新低。本基金在 2017 年四季度做了一些调仓，在国企改革的大框架下，加大了一些价值股的配置，如估值相对便宜的金融地产等。

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 0.466 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.21%，业绩比较基准收益率为 10.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年宏观经济的增速可能会比 2017 年回落，而通胀压力逐渐增大，美国减税加息等也会影响到国内的经济政策决策。社会经济活动的各个层面向龙头集中的趋势越来越显现，各行各业龙头的比较优势越发突出。本基金投资依然首先紧扣国企改革的大趋势。党中央对国企改革做出了新指示：要完善各类国有资产管理体制，加快国有经济布局优化、结构调整、战略性重组，促进国有资产保值增值，推动国有资本做强做优做大。国资委肖亚庆主任在人民日报撰文指出，要深化国有企业改革，培育一批具有全球竞争力的世界一流企业。本基金也是紧扣该精神，力争投资于具备全球竞争力的一流公司，伴随投资标的的成长而成长，争取为持有人获得更大的投资收

益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中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，本基金本报告期末未实施利润分配。

本基金截至 2017 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为-1,163,541,520.16 元，其中，未分配利润已实现部分为-1,163,541,520.16 元，未分配利润未实现部分为 34,797,588.67 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

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师徐艳、马剑英 2018 年 3 月 27 日对本基金 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注出具了安永华明（2018）审字第 60468688_A16 号标准无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	108,523,034.00	337,411,622.43
结算备付金	2,154,112.09	2,824,969.62
存出保证金	1,667,987.84	1,552,537.10
交易性金融资产	872,440,079.17	886,792,166.28
其中：股票投资	821,359,814.67	886,792,166.28
基金投资	-	-
债券投资	51,080,264.50	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	5,237,350.92	-
应收利息	1,184,105.59	155,839.91
应收股利	-	-
应收申购款	9,086.97	90,343.35
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	991,215,756.58	1,228,827,478.69
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 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	-	23,928,844.76
应付赎回款	2,279,348.45	925,005.38
应付管理人报酬	1,252,335.13	1,542,375.72
应付托管费	208,722.51	257,062.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	825,436.65	2,897,274.08
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	360,071.01	271,571.12
负债合计	4,925,913.75	29,822,133.66
所有者权益：		
实收基金	2,115,033,774.32	2,569,250,774.84
未分配利润	-1,128,743,931.49	-1,370,245,429.81
所有者权益合计	986,289,842.83	1,199,005,345.03
负债和所有者权益总计	991,215,756.58	1,228,827,478.69

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.466 元，基金份额总额为 2,115,033,774.32 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	38,515,823.32	-478,711,364.70
1. 利息收入	5,529,519.84	8,187,934.99
其中：存款利息收入	5,092,120.48	8,187,934.99
债券利息收入	437,399.36	-
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）	10,381,004.14	-287,624,347.20
其中：股票投资收益	-2,334,242.46	-295,305,947.26
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	12,715,246.60	7,681,600.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	22,476,384.79	-199,710,323.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	128,914.55	435,370.59
减：二、费用	39,968,414.46	45,434,778.54
1. 管理人报酬	16,387,335.51	20,143,266.83
2. 托管费	2,731,222.55	3,357,211.11
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	20,437,219.86	21,525,442.84
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	412,636.54	408,857.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-1,452,591.14	-524,146,143.24
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-1,452,591.14	-524,146,143.24

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,569,250,774.84	-1,370,245,429.81	1,199,005,345.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,452,591.14	-1,452,591.14
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）	-454,217,000.52	242,954,089.46	-211,262,911.06
其中：1. 基金申购款	67,506,185.61	-36,328,859.30	31,177,326.31
2. 基金赎回款	-521,723,186.13	279,282,948.76	-242,440,237.37
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）	2,115,033,774.32	-1,128,743,931.49	986,289,842.83
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,973,749,932.59	-1,059,844,613.95	1,913,905,318.64

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-524,146,143.24	-524,146,143.24
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）	-404,499,157.75	213,745,327.38	-190,753,830.37
其中：1. 基金申购款	219,866,195.99	-112,246,055.65	107,620,140.34
2. 基金赎回款	-624,365,353.74	325,991,383.03	-298,373,970.71
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）	2,569,250,774.84	-1,370,245,429.81	1,199,005,345.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

林培富	刁俊东	龚珉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]568号《关于准予长盛国企改革主题灵活配置混合型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6月4日生效，于基金合同生效日，本基金规模为3,250,867,544.91份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行、上市的股票）、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的0%-95%；其中投资于国企改革主题的股票和债券不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，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。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

7.4.6.4 个人所得税

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个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、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
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛基金（香港）有限公司	基金管理人子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,387,335.51	20,143,266.83
其中：支付销售机构的客户维护费	7,819,840.82	9,302,852.69

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付	2,731,222.55	3,357,211.11

的托管费		
------	--	--

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	108,523,034.00	4,970,630.58	337,411,622.43	8,027,377.13

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	(单位: 股)	成本总额	总额	
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.9.2 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
600332	白云山	2017年10月31日	重大事项停牌	32.14	2018年1月8日	30.15	227,301	6,255,259.54	7,305,454.14	-
002745	木林森	2017年12月28日	重大事项停牌	45.50	2018年1月5日	46.50	139,600	5,269,099.05	6,351,800.00	-
601216	君正集团	2017年12月15日	重大事项停牌	4.71	-	-	220,700	1,185,467.00	1,039,497.00	-
600157	永泰能源	2017年11月21日	重大事项停牌	3.36	-	-	308,100	1,158,848.00	1,035,216.00	-
600150	中国船舶	2017年9月27日	重大事项停牌	24.12	2018年3月21日	22.20	42,900	1,051,582.00	1,034,748.00	-
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项停牌	7.76	-	-	90,500	704,517.00	702,280.00	-
601600	中国铝业	2017年9月12日	重大事项停牌	6.65	2018年2月26日	7.28	77,700	582,276.00	516,705.00	-

600685	中船防务	2017年9月27日	重大事项停牌	26.66	2018年3月21日	24.05	7,900	209,592.00	210,614.00	-
000156	华数传媒	2017年12月26日	重大事项停牌	11.40	-	-	14,300	212,047.00	163,020.00	-
600903	贵州燃气	2017年12月28日	重大事项停牌	16.86	2018年1月2日	16.01	3,928	8,680.88	66,226.08	-
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项停牌	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
300659	中孚信息	2017年11月14日	重大事项停牌	40.21	-	-	776	9,971.60	31,202.96	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项停牌	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1 公允价值

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 802,775,296.54 元，属于第二层次的余额为人民币 69,664,782.63 元，属于第三层次的余额为人

人民币零元(2016年12月31日:第一层次人民币886,097,275.95元,第二层次人民币694,890.33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(2016年:无)。

7.4.10.2 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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于2018年3月27日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	821,359,814.67	82.86
	其中：股票	821,359,814.67	82.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	51,080,264.50	5.15
	其中：债券	51,080,264.50	5.15
	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	110,677,146.09	11.17
8	其他各项资产	8,098,531.32	0.82
9	合计	991,215,756.58	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	669,414.00	0.07
B	采矿业	88,469,567.17	8.97
C	制造业	312,678,068.32	31.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,602,227.55	3.20
E	建筑业	5,484,762.51	0.56
F	批发和零售业	10,437,583.08	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	9,671,254.91	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,484,823.16	1.16
J	金融业	218,656,324.08	22.17
K	房地产业	87,973,595.34	8.92
L	租赁和商务服务业	16,919,312.48	1.72
M	科学研究和技术服务业	238,379.68	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	21,822,324.30	2.21
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	4,542,898.09	0.46
S	综合	709,280.00	0.07
	合计	821,359,814.67	83.28

8.2.2 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。

8.3 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	600584	长电科技	2,184,318	46,591,502.94	4.72
2	600028	中国石化	7,500,000	45,975,000.00	4.66
3	601336	新华保险	580,000	40,716,000.00	4.13
4	601398	工商银行	5,340,000	33,108,000.00	3.36
5	001979	招商蛇口	1,573,524	30,778,129.44	3.12
6	600856	中天能源	2,564,808	29,982,605.52	3.04
7	601939	建设银行	3,429,971	26,342,177.28	2.67
8	000002	万科A	844,100	26,217,746.00	2.66
9	601328	交通银行	3,749,730	23,285,823.30	2.36
10	600036	招商银行	799,941	23,214,287.82	2.35

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> 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601328	交通银行	85,343,707.49	7.12
2	600028	中国石化	82,471,563.19	6.88
3	600036	招商银行	81,550,737.64	6.80
4	600498	烽火通信	76,977,442.54	6.42
5	601988	中国银行	75,597,229.00	6.30
6	002465	海格通信	69,986,528.90	5.84
7	600584	长电科技	67,333,107.56	5.62
8	600085	同仁堂	66,227,271.19	5.52

9	600021	上海电力	63,895,417.80	5.33
10	000018	神州长城	59,977,942.85	5.00
11	600019	宝钢股份	59,109,277.44	4.93
12	601390	中国中铁	54,539,135.30	4.55
13	000400	许继电气	53,408,809.99	4.45
14	600048	保利地产	51,597,950.59	4.30
15	600138	中青旅	51,031,564.89	4.26
16	601601	中国太保	49,824,675.58	4.16
17	600507	方大特钢	49,641,587.27	4.14
18	600267	海正药业	48,486,682.69	4.04
19	601336	新华保险	48,365,644.04	4.03
20	002142	宁波银行	47,803,607.78	3.99
21	002001	新 和 成	45,341,258.24	3.78
22	001979	招商蛇口	45,279,068.13	3.78
23	000983	西山煤电	45,034,175.08	3.76
24	600999	招商证券	44,509,384.80	3.71
25	000060	中金岭南	42,604,200.87	3.55
26	600893	航发动力	40,951,374.84	3.42
27	600026	中远海能	40,926,978.00	3.41
28	601186	中国铁建	40,131,317.76	3.35
29	000063	中兴通讯	39,471,145.95	3.29
30	600428	中远海特	39,398,225.10	3.29
31	300070	碧水源	39,287,103.75	3.28
32	600583	海油工程	38,807,531.56	3.24
33	601318	中国平安	38,600,617.76	3.22
34	600990	四创电子	38,325,170.82	3.20
35	000603	盛达矿业	38,297,820.61	3.19
36	600803	新奥股份	37,684,372.21	3.14
37	600307	酒钢宏兴	37,641,668.00	3.14
38	600597	光明乳业	37,633,826.35	3.14
39	601857	中国石油	37,202,791.00	3.10
40	300015	爱尔眼科	36,039,398.04	3.01
41	002739	万达电影	36,013,552.36	3.00
42	601600	中国铝业	35,685,977.00	2.98
43	002179	中航光电	35,394,498.01	2.95
44	600027	华电国际	34,591,667.17	2.89

45	000547	航天发展	34,445,134.82	2.87
46	600029	南方航空	33,899,409.00	2.83
47	600795	国电电力	33,320,388.00	2.78
48	601899	紫金矿业	33,227,082.99	2.77
49	600010	包钢股份	33,078,603.00	2.76
50	600606	绿地控股	32,928,244.12	2.75
51	600208	新潮中宝	32,877,169.00	2.74
52	600115	东方航空	32,555,224.57	2.72
53	600993	马应龙	32,459,036.66	2.71
54	601618	中国中冶	32,394,557.00	2.70
55	002048	宁波华翔	32,286,989.00	2.69
56	601333	广深铁路	32,277,892.87	2.69
57	600266	北京城建	31,620,850.00	2.64
58	601398	工商银行	31,498,428.40	2.63
59	600016	民生银行	31,451,655.20	2.62
60	601766	中国中车	30,967,359.12	2.58
61	002221	东华能源	30,638,608.54	2.56
62	000908	景峰医药	30,574,890.35	2.55
63	603188	亚邦股份	30,448,964.39	2.54
64	600340	华夏幸福	30,326,891.92	2.53
65	300498	温氏股份	30,072,061.13	2.51
66	000050	深天马A	29,874,386.95	2.49
67	600582	天地科技	29,753,252.76	2.48
68	600856	中天能源	29,615,812.88	2.47
69	600329	中新药业	29,493,398.58	2.46
70	600323	瀚蓝环境	29,418,369.11	2.45
71	000069	华侨城A	29,341,081.47	2.45
72	000930	中粮生化	28,559,650.33	2.38
73	601668	中国建筑	28,346,956.96	2.36
74	000157	中联重科	27,964,981.33	2.33
75	600585	海螺水泥	27,774,045.72	2.32
76	000902	新洋丰	27,369,222.48	2.28
77	000002	万科A	27,294,385.00	2.28
78	600332	白云山	26,903,756.16	2.24
79	002185	华天科技	26,858,838.76	2.24
80	600270	外运发展	26,728,078.83	2.23

81	000338	潍柴动力	26,658,395.64	2.22
82	600188	兖州煤业	26,572,662.94	2.22
83	000563	陕国投A	26,318,677.98	2.20
84	002228	合兴包装	26,254,467.91	2.19
85	600426	华鲁恒升	26,028,270.83	2.17
86	300284	苏交科	25,971,731.80	2.17
87	601699	潞安环能	25,671,153.84	2.14
88	601939	建设银行	25,621,786.43	2.14
89	601166	兴业银行	25,242,331.99	2.11
90	000601	韶能股份	24,341,445.14	2.03
91	600987	航民股份	24,212,815.86	2.02
92	601669	中国电建	24,167,212.56	2.02
93	600195	中牧股份	24,156,722.84	2.01
94	600061	国投资本	24,143,323.04	2.01
95	300055	万邦达	24,044,010.13	2.01

8.4.2 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	600703	三安光电	94,838,223.55	7.91
2	600031	三一重工	86,955,149.28	7.25
3	000425	徐工机械	75,266,365.24	6.28
4	601390	中国中铁	73,723,087.54	6.15
5	600085	同仁堂	66,149,660.54	5.52
6	600498	烽火通信	66,026,681.69	5.51
7	000930	中粮生化	63,730,147.17	5.32
8	002465	海格通信	63,045,419.19	5.26
9	600019	宝钢股份	61,270,920.73	5.11
10	600021	上海电力	60,580,653.52	5.05
11	601328	交通银行	60,497,175.23	5.05
12	600036	招商银行	60,123,245.32	5.01
13	601988	中国银行	58,471,955.72	4.88
14	000998	隆平高科	55,931,413.96	4.66
15	600507	方大特钢	52,196,589.10	4.35
16	000983	西山煤电	50,656,816.00	4.22
17	002142	宁波银行	49,599,498.60	4.14
18	000018	神州长城	47,543,721.02	3.97

19	601186	中国铁建	46,338,255.25	3.86
20	300070	碧水源	46,080,489.13	3.84
21	600873	梅花生物	45,697,049.08	3.81
22	000060	中金岭南	44,649,702.34	3.72
23	002001	新和成	44,162,427.46	3.68
24	600583	海油工程	44,060,152.01	3.67
25	000902	新洋丰	44,049,285.23	3.67
26	601766	中国中车	43,681,069.15	3.64
27	600428	中远海特	43,451,882.92	3.62
28	600999	招商证券	42,898,850.76	3.58
29	000063	中兴通讯	41,438,157.41	3.46
30	600267	海正药业	41,407,774.09	3.45
31	600026	中远海能	40,622,156.36	3.39
32	600340	华夏幸福	40,545,184.06	3.38
33	002353	杰瑞股份	39,914,706.48	3.33
34	601318	中国平安	39,496,336.07	3.29
35	002179	中航光电	39,388,151.67	3.29
36	601600	中国铝业	38,142,134.40	3.18
37	600138	中青旅	37,901,078.17	3.16
38	601857	中国石油	37,489,709.63	3.13
39	300015	爱尔眼科	37,445,134.82	3.12
40	000603	盛达矿业	37,316,563.70	3.11
41	600990	四创电子	37,095,907.10	3.09
42	600028	中国石化	36,510,978.20	3.05
43	600597	光明乳业	36,496,864.35	3.04
44	600307	酒钢宏兴	36,290,305.00	3.03
45	600737	中粮糖业	35,904,293.38	2.99
46	600048	保利地产	35,411,760.28	2.95
47	600803	新奥股份	35,225,503.38	2.94
48	600795	国电电力	34,982,218.00	2.92
49	600027	华电国际	34,391,423.86	2.87
50	601333	广深铁路	34,151,011.08	2.85
51	002739	万达电影	33,852,139.90	2.82
52	600029	南方航空	33,088,217.71	2.76
53	600993	马应龙	32,934,550.52	2.75
54	600010	宝钢股份	32,820,332.40	2.74
55	601601	中国太保	32,639,926.49	2.72
56	600115	东方航空	32,547,379.61	2.71

57	601618	中国中冶	32,229,172.00	2.69
58	600606	绿地控股	31,974,866.94	2.67
59	600893	航发动力	31,886,050.34	2.66
60	601899	紫金矿业	31,731,539.00	2.65
61	002048	宁波华翔	31,253,777.29	2.61
62	600016	民生银行	31,122,712.74	2.60
63	000050	深天马A	30,534,472.40	2.55
64	600208	新湖中宝	30,468,066.40	2.54
65	002470	金正大	30,306,918.80	2.53
66	603188	亚邦股份	29,665,421.00	2.47
67	601668	中国建筑	29,650,677.52	2.47
68	600266	北京城建	29,563,975.89	2.47
69	002221	东华能源	29,458,919.98	2.46
70	600323	瀚蓝环境	29,381,549.51	2.45
71	600188	兖州煤业	29,065,796.69	2.42
72	600584	长电科技	28,943,961.02	2.41
73	601800	中国交建	28,748,490.48	2.40
74	600426	华鲁恒升	28,566,538.02	2.38
75	000338	潍柴动力	28,257,034.00	2.36
76	300373	扬杰科技	28,218,638.80	2.35
77	600585	海螺水泥	28,099,741.60	2.34
78	000547	航天发展	28,031,591.93	2.34
79	600329	中新药业	27,969,409.18	2.33
80	000157	中联重科	27,756,920.00	2.31
81	000908	景峰医药	27,732,284.98	2.31
82	601088	中国神华	27,314,903.90	2.28
83	600887	伊利股份	26,891,168.83	2.24
84	000563	陕国投A	26,801,032.80	2.24
85	300498	温氏股份	26,732,031.66	2.23
86	000848	承德露露	26,225,248.57	2.19
87	000568	泸州老窖	26,145,941.38	2.18
88	002185	华天科技	25,889,215.00	2.16
89	002156	通富微电	25,852,184.95	2.16
90	000400	许继电气	25,793,548.81	2.15
91	002228	合兴包装	25,541,948.77	2.13
92	601166	兴业银行	24,981,515.31	2.08
93	002304	洋河股份	24,972,970.00	2.08
94	600270	外运发展	24,837,827.90	2.07

95	300055	万邦达	24,723,319.11	2.06
96	600835	上海机电	24,678,633.21	2.06
97	600108	亚盛集团	24,150,350.65	2.01
98	601669	中国电建	24,145,360.16	2.01
99	000860	顺鑫农业	24,115,671.37	2.01
100	600600	青岛啤酒	24,086,306.26	2.01

8.4.3 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	6,882,673,293.60
卖出股票收入（成交）总额	6,968,292,746.44

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	51,080,264.50	5.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	51,080,264.50	5.18

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019563	17 国债 09	511,570	51,080,264.50	5.18

注：本基金本报告期末未持有上述一只债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	1,667,987.84
2	应收证券清算款	5,237,350.92
3	应收股利	-
4	应收利息	1,184,105.59
5	应收申购款	9,086.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,098,531.32

8.12.4 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）。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末投资前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.6 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，分项之和与和项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
45,234	46,757.61	3,064,523.62	0.14%	2,111,969,250.70	99.86%

9.2 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	11,046.46	0.0005%

9.3 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	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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月4日）基金份额总额	3,250,867,544.91
本报告期期初基金份额总额	2,569,250,774.84
本报告期基金总申购份额	67,506,185.61
减:本报告期基金总赎回份额	521,723,186.13
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	2,115,033,774.32

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

由于任期届满，高新不再担任公司董事长，周放生不再担任公司独立董事。根据公司 2016 年度股东会议决议，选举林培富为公司董事，选举张良庆为公司独立董事；根据公司第七届董事会第一次会议决议，选举周兵担任公司董事长；根据公司第七届董事会第二次会议决议，聘任林培富担任公司总经理，周兵不再担任公司总经理，同时林培富不再担任公司副总经理。以上公司高级管理人员变更，已于 2017 年 3 月 30 日向中国证监会北京监管局报备。

根据公司 2017 年第一次临时股东会议决议，同意张良庆先生不再担任公司第七届董事会独立董事职务，选举朱慈蕴女士担任公司第七届董事会独立董事。以上独立董事人员变更，已于 2018 年 1 月 9 日向中国证监会北京监管局报备。

11.2.2 基金经理变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2017 年 10 月 9 日起，乔培涛同志兼任长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自 2017 年 10 月 9 日起，乔林建同志不再担任长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 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，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 90,000.00 元，已连续提供审计

服务 3 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中泰证券	2	2,694,715,332.43	19.47%	2,509,591.15	20.50%	-
东北证券	2	2,407,401,757.57	17.39%	2,048,043.90	16.73%	-
光大证券	1	2,168,574,402.90	15.67%	2,019,600.33	16.50%	-
天风证券	2	1,818,664,850.60	13.14%	1,329,991.66	10.87%	-
兴业证券	1	1,429,220,603.03	10.32%	1,331,034.62	10.87%	-
申银万国	1	1,280,294,713.96	9.25%	1,192,341.27	9.74%	-
中信证券	1	991,348,650.21	7.16%	923,244.80	7.54%	-
国泰君安	2	584,575,765.97	4.22%	544,410.58	4.45%	-
首创证券	1	305,251,425.74	2.21%	223,231.71	1.82%	-
东方证券	2	163,214,580.36	1.18%	119,359.37	0.98%	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	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	-	-	-	-	-
中信建投证 券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财 富证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	51,125,223.40	100.00%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财	-	-	-	-	-	-

富证券						
中银国际	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	东北证券	深圳	1
2	首创证券	深圳	1
3	天风证券	上海	1
4	中泰证券	深圳	1
5	西藏东方财富证券	上海	1
6	西藏东方财富证券	深圳	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况:

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	国金证券	上海	1
2	华创证券	深圳	1
3	中投证券	上海	1

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 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 3 月 31 日