

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF） 2018 年年度报告 摘要

2018 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 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 2019 年 3 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，普华永道中天会计师事务所（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 2018 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	97,526,920.54 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。
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	010-86497608	010-67595096
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666 010-86497888	010-67595096
传真		010-86497999	010-66275853

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地址

§ 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-1,732,712.98	4,367,883.47	-2,180,083.28
本期利润	-33,002,879.96	23,577,895.28	-32,796,159.37
加权平均基金份额本期利润	-0.3312	0.2012	-0.2086
本期基金份额净值增长率	-23.10%	16.43%	-12.29%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0436	0.3781	0.1742
期末基金资产净值	108,422,396.63	150,482,345.90	162,664,226.07
期末基金份额净值	1.112	1.446	1.242

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到 2018 年 12 月 31 日。

3、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。

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③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-11.39%	1.54%	-11.98%	1.58%	0.59%	-0.04%
过去六个月	-12.85%	1.40%	-14.90%	1.42%	2.05%	-0.02%
过去一年	-23.10%	1.27%	-26.08%	1.27%	2.98%	0.00%
过去三年	-21.47%	1.20%	-25.93%	1.17%	4.46%	0.03%
自基金转型起至今	-38.02%	1.65%	-41.47%	1.55%	3.45%	0.10%

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）

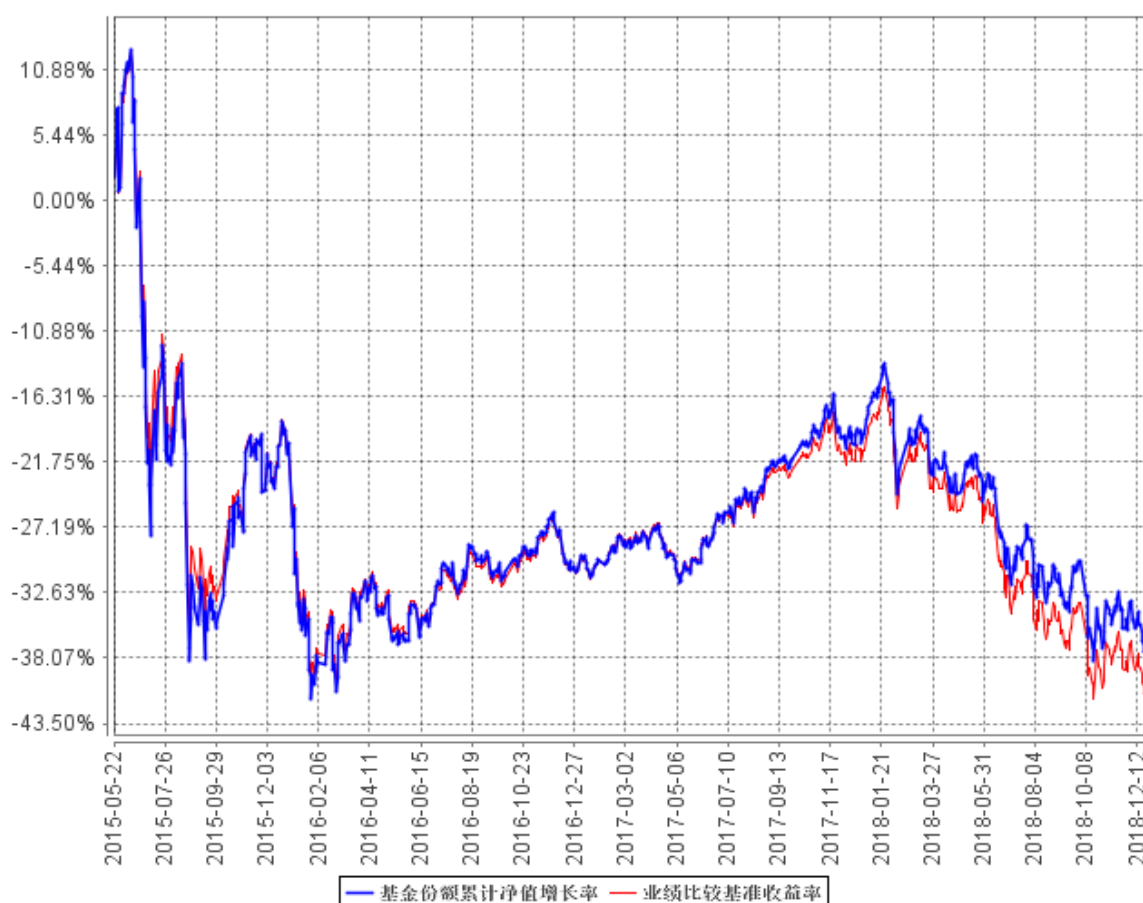
本基金为指数型基金，股票资产跟踪的标的指数为中证 800 指数。中证 800 指数是由上海证券交

易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数。其成份股由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成,综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。

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 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

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

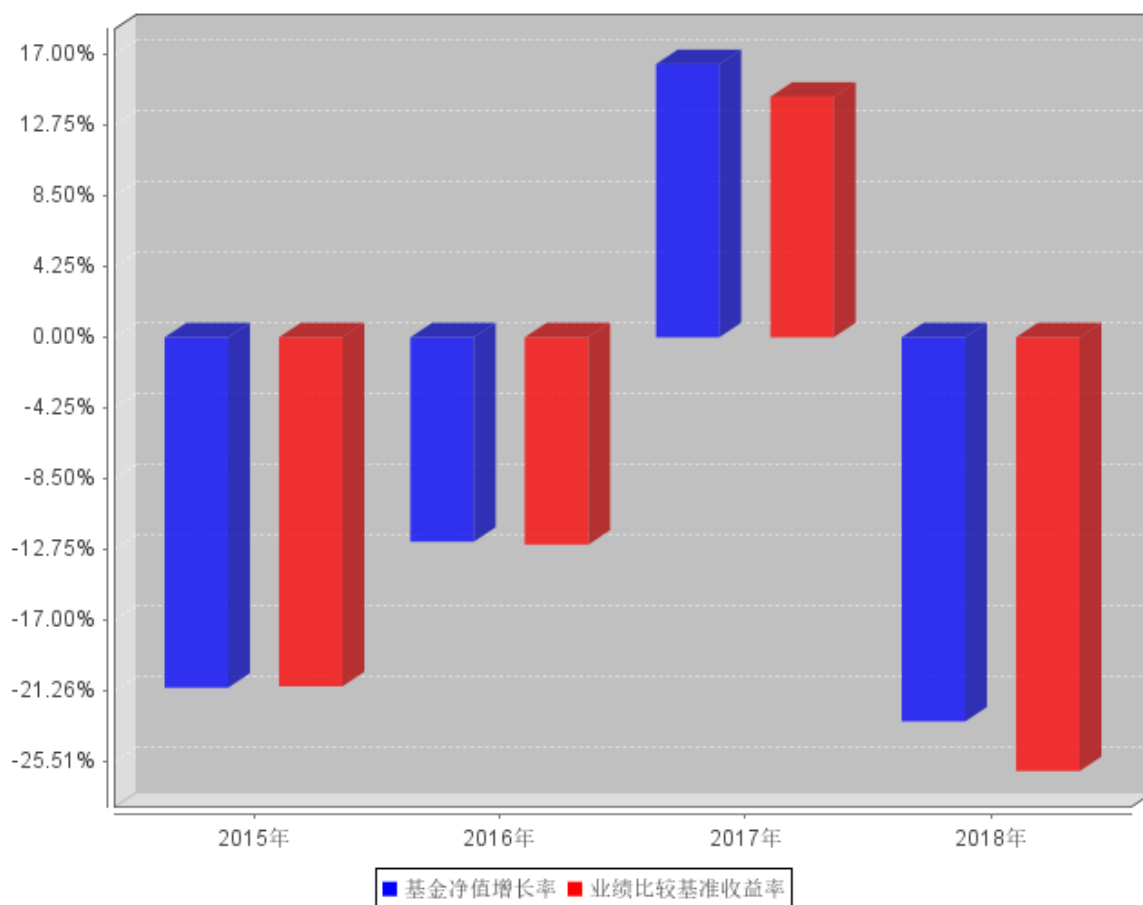


注: 1、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来,基金转型日(即基金合同生效日)为 2015 年 5 月 22 日。

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。

3.2.3 自基金转型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：本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，转型日（即基金合同生效日）为 2015 年 5 月 22 日。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格。截至 2018 年 12 月 31 日，基金管理人共管理五十八只开放式基金，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，长盛多因子策略优选股票型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

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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.112 元；本报告期基金份额净值增长率为-23.10%，业绩比较基准收益率为-26.08%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为 0.06%，控制在 0.35% 之内；年化跟踪误差为 1.12%，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

全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、银行表现相对较好，跌幅较小，电子、有色金属和传媒等行业表现较差。风格上，低市净率、低市盈率、大盘股等风格表现相对较好，跌幅较小，微利股、亏损股和高市盈率股等风格表现较差。

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）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

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

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至截至 2018 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 4,252,861.92 元，其中，未分配利润已实现部分为 84,335,391.56 元，未分配利润未实现部分为-80,082,529.64 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关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 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师薛竞、叶尔甸于 2019 年 3 月 27 日对本基金 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字（2019）第 22259 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：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	11,659,812.87	9,737,947.25
结算备付金	-	-
存出保证金	3,241.89	4,482.17
交易性金融资产	98,320,603.44	142,405,953.34
其中：股票投资	98,302,594.54	142,223,995.80
基金投资	-	-
债券投资	18,008.90	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	2,306.85	2,060.66
应收股利	-	-
应收申购款	634.85	640.08
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	109,986,599.90	152,151,083.50
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 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	6,168.14	66,317.11
应付管理人报酬	94,979.88	128,111.79
应付托管费	20,895.56	28,184.60
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,601.84	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	1,437,557.85	1,437,786.72
负债合计	1,564,203.27	1,668,737.60
所有者权益:		
实收基金	104,169,534.71	111,143,123.68
未分配利润	4,252,861.92	39,339,222.22
所有者权益合计	108,422,396.63	150,482,345.90
负债和所有者权益总计	109,986,599.90	152,151,083.50

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.112 元，基金份额总额 97,526,920.54 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-30,967,421.08	25,957,981.03
1.利息收入	85,082.85	93,207.28
其中：存款利息收入	84,978.21	93,129.58
债券利息收入	104.64	77.70
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）	208,109.16	6,617,018.23
其中：股票投资收益	-2,224,616.30	4,177,515.37
基金投资收益	-	-
债券投资收益	28,151.40	5,125.99
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	2,404,574.06	2,434,376.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-31,270,166.98	19,210,011.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	9,553.89	37,743.71
减：二、费用	2,035,458.88	2,380,085.75
1.管理人报酬	1,304,878.76	1,566,252.49
2.托管费	287,073.35	344,575.53
3.销售服务费	-	-

4. 交易费用	51,011.28	75,497.24
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	392,495.49	393,760.49
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	-33,002,879.96	23,577,895.28
减: 所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-33,002,879.96	23,577,895.28

7.3 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	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)	-	-33,002,879.96	-33,002,879.96
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)	-6,973,588.97	-2,083,480.34	-9,057,069.31
其中: 1. 基金申购款	1,237,102.58	158,077.23	1,395,179.81
2. 基金赎回款	-8,210,691.55	-2,241,557.57	-10,452,249.12
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)	104,169,534.71	4,252,861.92	108,422,396.63
项目	上年度可比期间 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)	139,854,839.29	22,809,386.78	162,664,226.07
二、本期经营活动产生	-	23,577,895.28	23,577,895.28

的基金净值变动数 (本期利润)			
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)	-28,711,715.61	-7,048,059.84	-35,759,775.45
其中: 1. 基金申购款	290,987.34	72,073.07	363,060.41
2. 基金赎回款	-29,002,702.95	-7,120,132.91	-36,122,835.86
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)	111,143,123.68	39,339,222.22	150,482,345.90

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:

<u>林培富</u>	<u>刁俊东</u>	<u>龚珉</u>
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 800A”)以及长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(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 份额和同庆 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 0.593624387,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 1.270917071,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数为 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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: 中证 800 指数收益率 $\times$ 95%+一年期银行定期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2019 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货,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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

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(“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
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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：无。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,304,878.76	1,566,252.49
其中：支付销售机构的客户维护费	87,129.75	111,267.35

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	287,073.35	344,575.53

注：支付基金托管人中国建设银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 当年天数。

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：无。

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：无。

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：无。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
中国建设银行	11,659,812.87	84,850.95	9,737,947.25	92,980.25

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。

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：无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2018 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
601860	紫金银行	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 3 日	新股未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

7.4.9.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110049	海尔转债	2018 年 12 月 18 日	2019 年 1 月 18 日	配债未上市	100.00	100.00	170	17,000.00	17,000.00	-

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	复牌开盘价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	重大事项停牌	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	69,934	1,324,618.21	1,119,643.34	-

000540	中天金融	2017 年 8 月 21 日	重大事项停牌	2.59	2019 年 1 月 2 日	4.38	41,740	179,382.41	108,106.60	-
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事项停牌	6.21	-	-	16,168	296,006.55	100,403.28	-
600270	外运发展	2018 年 12 月 13 日	吸收合并	20.99	-	-	3,769	75,844.85	79,111.31	-
002183	怡亚通	2018 年 12 月 25 日	重大事项停牌	5.01	2019 年 1 月 2 日	4.96	11,600	167,620.00	58,116.00	-
000693	*ST 华泽	2018 年 5 月 2 日	重大事项停牌	2.68	-	-	3,507	75,126.69	9,398.76	-

注：1、根据中外运空运发展股份有限公司（以下简称“外运发展”）于 2018 年 11 月 3 日公布的《中国外运股份有限公司换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司暨关联交易报告书》和中国外运股份有限公司（以下简称“中国外运”）于 2019 年 1 月 15 日公布的《中国外运发行 A 股股份换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司上市公告书暨 2018 年第三季度财务报表》，中国外运向外运发展除中国外运以外的股东发行 A 股股票，以换股比例 1:3.8225 取得外运发展股东持有的外运发展全部股票，吸收合并外运发展；外运发展自 2018 年 12 月 13 日起连续停牌。换股合并后新增的中国外运股票于 2019 年 1 月 18 日上市流通，当日开盘单价为 5.30 元。外运发展自 2018 年 12 月 28 日起终止上市并摘牌。

2、本基金截至 2018 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

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 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 12 月 31 日，本基金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中属于第一层次的余额为 96,778,678.35 元，属于第二层次的余额为 1,333,415.21 元，属于第三层次的余额为 208,509.88 元 (2017 年 12 月 31 日：第一层次 137,439,903.23 元，第二层次 4,882,376.11 元，第三层次 83,674.00 元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产		
	债券投资	权益工具投资	合计
2018 年 1 月 1 日		83,674.00	83,674.00
购买	-	-	-
出售	-	-97,571.50	-97,571.50
转入第三层次	-	208,509.88	208,509.88
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	13,897.50	13,897.50
计入损益的利得或损失	-	13,897.50	13,897.50
2018 年 12 月 31 日	-	208,509.88	208,509.88
2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2018 年年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动		-230,581.27	-230,581.27

损益

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

	2018 年 12 月 31 日公允价值	估值 技术	名称	不可观察输入值	
				范围/加权平 均值	与公允价值 之间的关系
交易性金融资	208,509.88	市场法	市净率	1.2-2.6	正向
产—股票投资			流动性折扣	26%-30%	反向

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 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。

§ 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	98,302,594.54	89.38
	其中：股票	98,302,594.54	89.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,008.90	0.02
	其中：债券	18,008.90	0.02
	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	11,659,812.87	10.60
8	其他各项资产	6,183.59	0.01
9	合计	109,986,599.90	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	317,689.97	0.29
B	采矿业	3,364,823.94	3.10
C	制造业	41,083,113.84	37.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,909,978.26	2.68
E	建筑业	3,317,734.53	3.06
F	批发和零售业	2,516,982.69	2.32
G	交通运输、仓储和邮政业	2,900,024.57	2.67
H	住宿和餐饮业	41,279.40	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,003,863.60	3.69
J	金融业	28,398,707.10	26.19
K	房地产业	6,171,113.04	5.69
L	租赁和商务服务业	1,307,842.58	1.21
M	科学研究和技术服务业	57,619.52	0.05

N	水利、环境和公共设施管理业	306,124.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	483,992.60	0.45
R	文化、体育和娱乐业	571,543.47	0.53
S	综合	229,275.39	0.21
	合计	97,981,708.50	90.37

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	9,398.76	0.01
C	制造业	153,234.88	0.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	50,145.80	0.05
K	房地产业	108,106.60	0.10
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	320,886.04	0.30

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净
----	------	------	--------	------	--------

					值比例 (%)
1	601318	中国平安	97,087	5,446,580.70	5.02
2	600519	贵州茅台	5,003	2,951,820.03	2.72
3	000002	万 科 A	99,554	2,371,376.28	2.19
4	600036	招商银行	90,416	2,278,483.20	2.10
5	000651	格力电器	54,623	1,949,494.87	1.80
6	601166	兴业银行	117,471	1,755,016.74	1.62
7	601398	工商银行	290,612	1,537,337.48	1.42
8	000333	美的集团	39,568	1,458,476.48	1.35
9	601328	交通银行	240,570	1,392,900.30	1.28
10	600016	民生银行	242,395	1,388,923.35	1.28

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。

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

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	000540	中天金融	41,740	108,106.60	0.10
2	600485	信威集团	16,168	100,403.28	0.09
3	603185	上机数控	1,076	52,831.60	0.05
4	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.05
5	000693	*ST 华泽	3,507	9,398.76	0.01

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	601398	工商银行	2,953,500.00	1.96
2	002027	分众传媒	543,360.00	0.36
3	601229	上海银行	488,197.00	0.32
4	603288	海天味业	433,616.00	0.29
5	600919	江苏银行	357,466.00	0.24
6	002415	海康威视	295,754.00	0.20
7	002460	赣锋锂业	241,113.00	0.16
8	002044	美年健康	220,438.00	0.15

9	600011	华能国际	211,501.00	0.14
10	300015	爱尔眼科	202,821.00	0.13
11	300408	三环集团	187,167.00	0.12
12	000413	东旭光电	186,018.00	0.12
13	300142	沃森生物	179,104.00	0.12
14	300003	乐普医疗	177,910.00	0.12
15	603156	养元饮品	166,828.87	0.11
16	600867	通化东宝	157,434.00	0.10
17	601877	正泰电器	157,082.10	0.10
18	600901	江苏租赁	155,843.75	0.10
19	000001	平安银行	148,824.00	0.10
20	002422	科伦药业	147,246.00	0.10

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	601398	工商银行	3,213,508.00	2.14
2	603259	药明康德	568,920.00	0.38
3	601318	中国平安	357,505.00	0.24
4	601066	中信建投	212,897.00	0.14
5	600901	江苏租赁	185,210.40	0.12
6	000002	万 科 A	183,008.00	0.12
7	603156	养元饮品	181,886.90	0.12
8	002001	新 和 成	179,806.50	0.12
9	002739	万达电影	171,589.50	0.11
10	002405	四维图新	165,478.48	0.11
11	601099	太平洋	156,816.44	0.10
12	000488	晨鸣纸业	152,857.18	0.10
13	300168	万达信息	147,313.00	0.10
14	002271	东方雨虹	146,994.20	0.10
15	600036	招商银行	144,033.00	0.10
16	000651	格力电器	136,557.00	0.09
17	600025	华能水电	134,001.50	0.09
18	000977	浪潮信息	130,817.10	0.09
19	603019	中科曙光	130,105.00	0.09
20	002673	西部证券	128,291.92	0.09

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	10,455,947.70
卖出股票收入（成交）总额	20,887,414.32

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	-	-
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）	18,008.90	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,008.90	0.02

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	110049	海尔转债	170	17,000.00	0.02
2	113523	伟明转债	10	1,008.90	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述 2 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

(1) 兴业银行

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股兴业银行。

根据银保监会 2018 年 5 月 4 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表-银保监银罚决字〔2018〕1 号-兴业银行股份有限公司》的公告，兴业银行因同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保、债券卖出回购业务违规出表、个人理财资金违规投资、向四证不全的房地产项目提供融资等 12 项违规被罚 5870 万元，这 12 项案由中，多涉及违反宏观调控政策、影子银行和交叉金融产品风险以及违法违规展业。与兴业银行一同被罚的还有该银行旗下的兴业金融租赁有限责任公司。兴业金融租赁因未制定明确的服务收费标准并公示以及办理融资租赁业务时搭售理财产品被罚 110 万元。除此之外，兴业银行苏州分行还存在买入返售业务项下基础资产不合规的情况，该银行两名直接责任人受到银保监会处罚。其中，原兴业银行苏州分行行长黄立峰受到警告处分，并被罚款 5 万元；胡刚被警告并罚款 10 万元。根据 4 月 16 日《上海银监局行政处罚信息公开表（沪银监罚决字〔2018〕12 号）》，2015 年 9 月，兴业银行股份有限公司上海分行在某理财业务中，对底层资产为非标准化债权资产的投资投前尽职调查严重不审慎。责令改正，罚款人民币 50 万元。根据 4 月 2 日中国人民银行福州中心支行公布了福银罚字〔2018〕10 号行政处罚公示表，兴业银行股份有限公司因违反国库管理规定，被警告并处罚款 5 万元人民币。对

以上事件，本基金做出如下说明：兴业银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，公司高度重视内部控制建设，并围绕内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督等方面不断加强和完善内部控制机制。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

（2）民生银行

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股民生银行。

根据银保监会 2018 年 12 月 7 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表-银保监银罚决字〔2018〕5 号-中国民生银行股份有限公司》的公告，民生银行因贷款业务严重违反审慎经营规则，被罚款 200 万元。根据银保监会 2018 年 12 月 7 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表-银保监银罚决字〔2018〕8 号-中国民生银行股份有限公司》的公告，民生银行因：内控管理严重违反审慎经营规则；同业投资违规接受担保；同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；本行理财产品之间风险隔离不到位；个人理财资金违规投资；票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；为非保本理财产品提供保本承诺等原因，被罚款 3160 万元。

对以上事件，本基金判断，民生银行是全国性股份制商业银行之一，上述处罚对公司影响小。后续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。

（3）招商银行

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股招商银行。

根据银监罚决字〔2018〕1 号，招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）因电话销售欺骗投保人，被深圳保监局罚款 30 万元；根据银监罚决字〔2018〕1 号，招商银行因违反内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款以及同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等行为，被中国银监会罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。对以上事件，本基金判断招商银行作为全国性的股份制银行，具有一定的系统重要性，具有较强的市场口碑和较强的市场竞争力，整体来看，上述处罚对公司影响极小。后续将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。

（4）伟明转债

根据温鹿公（绣）行罚决字[2018]15476 号，浙江伟明环保股份有限公司（以下简称“伟明环保”）因不履行国际联网备案职责案被行政处罚，针对上述事件，本基金做出如下说明：伟明环保是一家固体废弃物处理为主业的上市公司，是固废处理领域的领军企业，同时具有垃圾处理

及发电行业全产业链优势,拥有行业领先的研发能力和技术水平,基本面较好,上述处罚对公司影响小。后续将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。

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	3,241.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,306.85
5	应收申购款	634.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,183.59

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000540	中天金融	108,106.60	0.10	重大事项停牌
2	600485	信威集团	100,403.28	0.09	重大事项停牌
3	601860	紫金银行	50,145.80	0.05	新股未上市
4	000693	*ST 华泽	9,398.76	0.01	重大事项停牌

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,分项之和与合计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
7,222	13,504.14	16,613,430.41	17.03%	80,913,490.13	82.97%

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.2 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	工银瑞信基金公司－农行－中国农业银行离退休人员福利负债	4,805,376.00	5.89%
2	中国工商银行股份有限公司企业年金计划－中国建设银行股份有限公司	4,603,371.00	5.64%
3	中国工商银行股份有限公司企业年金计划－中国建设银行股份有限公司	3,728,891.00	4.57%
4	余栋腾	2,392,881.00	2.93%
5	王飞舟	1,677,417.00	2.05%
6	恒生电子股份有限公司	1,164,532.00	1.43%
7	靳宁卿	990,000.00	1.21%
8	中国银行股份有限公司企业年金计划－中国农业银行	949,200.00	1.16%
9	纪伟才	938,029.00	1.15%
10	于成福	932,390.00	1.14%

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。

9.3 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	0.80	0.0000%

9.4 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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 22 日）基金份额总额	542,268,490.78
本报告期期初基金份额总额	104,056,548.64
本报告期期间基金总申购份额	1,158,146.71
减:本报告期期间基金总赎回份额	7,687,774.81
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	97,526,920.54

§ 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

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。

11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

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。本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元，已连续提供审计服务 10 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	
银河证券	1	15,211,582.61	51.47%	14,166.41	51.52%	-
光大证券	1	7,278,262.41	24.63%	6,778.40	24.65%	-
长江证券	1	4,807,715.80	16.27%	4,457.84	16.21%	-
兴业证券	1	2,246,387.50	7.60%	2,092.00	7.61%	-
联合证券	1	9,321.00	0.03%	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中金证券	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
银河证券	52,286.00	13.21%	-	-	-	-
光大证券	135,667.10	34.28%	-	-	-	-
长江证券	86,385.90	21.82%	-	-	-	-
兴业证券	52,275.30	13.21%	-	-	-	-
联合证券	69,200.00	17.48%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

中金证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

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:无。

(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	中信证券	上海	1
2	国信证券	深圳	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：本基金本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

2019 年 3 月 29 日