（上接26版）

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：胡燕亮
联系人：李娟
电话：021-50810687
传真：021-58300279
客户服务电话：021-50810673
公司网址：www.wacaijijin.com
(102) 深圳富济基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04
办公地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
法定代表人：刘鹏宇
联系人：刘勇
电话：0755-83999907-8814
传真：0755-83999926
客户服务电话：0755-83999907
公司网址：www.fujiwealth.cn
(103) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层
法定代表人：马勇
联系人：文雯
电话：010-83363101
传真：010-83363072
客户服务电话：4008-166-1188
公司网址：http://8.jrj.com.cn
(104) 深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801
办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
电话：0755-33227950
传真：0755-33227951
客户服务电话：4006-788-887
公司网址：www.zlfund.cn
(105) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：林卓
联系人：徐江
电话：0411-88891212-119
传真：0411-84396536
客户服务电话：400-0411-001
公司网址：www.haojiyoujijin.com
(106) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：林卓
联系人：徐江
电话：0411-88891212-119
传真：0411-84396536
客户服务电话：400-0411-001
公司网址：www.haojiyoujijin.com
(107) 泰信财富基金销售有限公司
注册地址：北京市石景山区实兴大街30号院3号楼8层8995房间
办公地址：北京市海淀区四环北路69号一层
法定代表人：李静
联系人：张逸伦
电话：13810190956
传真：无
客户服务电话：010-88435555
公司网址：www.taixincf.com
(108) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司
注册地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址：北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦9层
法定代表人：吴雪秀
联系人：董宜
电话：010-88312877
传真：010-88312099
客户服务电话：400-001-1566
公司网址：www.yilucaifu.com
(109) 浙江金观诚基金销售有限公司
注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室
办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富
法定代表人：蒋雪梅
联系人：孙成岩
电话：0571-88337717
传真：0571-88337666
客户服务电话：400-068-0058
公司网址：www.jincheng-fund.com
(110) 浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：杭州市文二西路1号903室
办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路18号同花顺大楼
法定代表人：凌顺平
联系人：吴强
电话：0571-88911818
传真：0571-86800423
客户服务电话：4008-773-772
公司网址：www.5ifund.com
(111) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司
注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人：钱昊旻
联系人：徐英
电话：010-59336539
传真：010-59336500
客户服务电话：4008-909-998
公司网址：www.jrjc.com
(112) 众升财富（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人：李招弟
联系人：李艳
电话：010-59497361
传真：010-64788016
客户服务电话：400-876-9988
公司网址：www.zscffund.com
(113) 珠海盈米基金销售有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201-1203室
法定代表人：肖雯
联系人：邱湘湘
电话：020-89629099
传真：020-89629011
客户服务电话：020-89629066
公司网址：www.yingmi.cn
(114) 奕丰基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人：TEO WEE HOWE
联系人：叶健
电话：0755-89460507
传真：0755-21674453
客户服务电话：400-684-0500
公司网址：www.ifastps.com.cn

（二）注册登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
电话：（010）59378888
传真：（010）66210938
联系人：朱立元
（三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称：北京市信利律师事务所
注册地址：中国北京建国门内大街18号恒基中心一座609-611室
办公地址：中国北京建国门内大街18号恒基中心一座609-611室
法定代表人：江山
电话：（010）65186980
传真：（010）65186981
经办律师：谢思敏、阎建国
（四）审计基金财产的会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
经办会计师：陈玲、张振波
联系人：张振波

五、基金的名称

本基金名称：长盛动态精选证券投资基金

六、基金的类型

基金类型：契约型开放式

七、基金的投资目标

本基金为开放式混合型基金。将通过积极投资于能够充分分享中国经济长期增长的、在各自行业中已经或将要取得领袖地位的50家上市公司股票，在承担适度风险的前提下，追求当期收益和基金资产超过业绩比较基准的长期稳定回报。

八、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市或拟上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资占基金资产净值的比例为20%--95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

在有关法律法规许可时，基金资产除 5%左右以现金形式持有，其余基金资产可全部用于股票投资。

九、基金的投资策略与程序

（一）投资理念

股票选择重于时机选择；在经济发展的不同阶段，各行业表现的景气度会出现显著差异；只有少数上市公司能充分分享中国经济的未来增长。

（二）投资策略

本基金为主动管理的混合型基金，投资策略上偏重选股能力的发挥，时机的选择放在次要位置。

1、资产配置策略

本基金将采用自上而下的两个层次资产配置策略，首先确定基金资产在不同资产类别之间的配置比例，然后进一步确定各资产类别中不同证券的配置比例。

（1）资产配置比例

本基金股票资产在基金净值中的配置比例将保持在20%—95%的范围中，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

资产配置比例由投资决策委员会根据市场状况确定，基金经理在资产配置比例范围内选择具体基金投资品种。

（2）资产配置模型

资产配置比例的确定程序中在坚持定量分析与定性判断相结合的原则下，强调定量技术辅助决策的作用。

在资产配置过程中，将充分研究宏观经济周期以及股票市场周期变化，做出判断，适当控制股票仓位。当股票市场中股票呈现平均意义上价值被高估的迹象的时候，适当降低股票配置比例，反之适当增加股票仓位。

在分析股票市场投资价值水平方面，本基金将参考FE股票市场估值模型，结合对宏观经济周期数据的判断，作为衡量股票市场价值水平的基础。

FE股票市场估值模型的核心思想是依据整个投资市场其他投资产品的收益率来判断股票市场平均价格水平是否被高估的理论方法。根据中国经济的具体情况，FE股票市场估值模型的基本形式确定为：

$$CEY = a - b \cdot TBY - c \cdot RP - d \cdot LTEG$$

其中，CEY为市场组合中平均市值收益率；
TBY为用7年期国债收益率代表的债券投资收益率；
RP为信用风险补偿，用企业债与国债收益率差额计算获得；
LTEG为上市公司平均收益增长率，估计中用GDP增长率代替。

在资产配置决策中，如果实际CEY小于理论CEY，表示目前股票市场价值被高估了，反之表示股票市场价值被低估了。

如果结合理论模型分析与定性判断得出股票市场价值被高估的结论，在资产配置决策中，将不再扩大股票投资比例。如果股票市场价值高估程度较高的时候，可以选择降低股票持仓比例的策略，实现收益。

2、股票组合的构建与调整

本基金采用自上而下的投资策略，即首先根据国家政策、国内外经济形势以及各产业的生命周期、编制行业景气度指标体系，对各主要行业投资价值进行优先排序，确定各行业的投资比重。然后采用长盛股票综合评级体系，对优选行业内的上市公司进行综合评级，精选出50只最有投资价值的股票。具体选股顺序如下：

（1）股票选择范围：剔除下列股票后的所有A股股票

①暂停上市股票；

②经营状况异常或最近财务报告严重亏损且短期内扭亏无望的股票；

③价格发生异常波动的股票；

④其他经本公司研究员认定应该剔除的股票。

（2）股票数量：50只股票。

（3）选股标准和步骤

依据行业景气度及行业优势地位、财务稳健性、公司管理水平和信息透明度、流通市值及换手率等条件进行选股。具体步骤如下：

①初始行业分类

本基金的行业分类标准主要参照中国证监会的行业分类标准，并借鉴摩根斯坦利和标准普尔公司联合发布的全球行业分类标准（GICS），结合我国上市公司实际情况进行调整。根据我们的基金产品设计，对可供投资的行业划分为三类，即稳定性、成长性和周期性行业。本基金关于行业稳定性、成长性和周期性的判断，有别于一般传统意义上的行业划分，而主要依据行业规模的增长和行业主导产品价格的波动等指标来进行类别归属。基本情况如下表6所示：

表6 行业分类及举例

行业类别	划分标准	投资研究思路	主要行业举例
稳定性行业	主导产品价格比较稳定，产量上下波动不大	以绝对价值法分析为主，相对价值法比较为辅	电力、煤气及水的生产供应业；交通运输、仓储业；食品、饮料。
成长性行业	规模、收入和利润增长明显高于经济增长速度	通过研究员的独立分析判断和对国际证券市场的相对比较	电子、信息技术；传播与文化产业；医药与生物制品；批发和零售贸易；金融、保险业。
周期性行业	价格波动较大、受宏观经济和国家产业政策影响较大	充分紧盯行业景气度指标的变化，进行波段操作	石油化工；金属、非金属；建筑业；房地产业。

②行业优选

在行业归类的基础上，按照不同类别行业的不同特性，按照国家政策、国内宏观经济形势和各产业发展情况，进行行业的筛选。具体步骤是：

A、编制行业景气度数据。根据国家统计局和国家信息中心等权威机构统计的数据编制各行业的景气度数据，然后根据过去四个季度行业景气度的历史数据，由行业研究员对未来四个季度行业景气度做出预测。然后按照行业景气度的绝对值和变化情况选出绝对值最高和上升速度最快的部分行业。

B、将选出的行业与国际同行业进行比较，比较的内容主要包括所选行业与发达国家相同行业的周期性差异、与国外同行业上市公司的平均市盈率和市净率水平比较、有代表性公司的市盈率、市净率水平比较。

C、确定各行业的投资比例。在不超过该行业流通市值所占沪深市场总流通市值比例4倍的范围内，基金经理可以根据研究报告决定在单个行业上的投资比重，超过3倍的投资建议必须提交公司投资决策委员会讨论。本基金在单个行业上的投资比例不超过该行业流通市值占全市场流通市值的5倍。

③股票精选标准

在确定行业投资比例后，本基金将根据以下几个方面最终确定所选股票：

A、公司在行业中的地位

主要用以下几个标准来衡量，一是公司的核心竞争力，主要包括技术水平、营销能力等；二是产品的市场占有率；三是主要产品的销售收入增长率；四是净利润增长率。先对各指标分别排名，然后将各指标的排名结果相加，所得和的排名作为股票的综合排名。

B、财务稳健性

公司财务稳健性主要从盈利能力（包括成长性）和偿债能力两方面考虑。

由于本基金主要投资于那些能够充分分享中国经济增长的、行业景气度不断提升、有良好业绩记录和较高业绩增长控期的上市公司的股票，所以我们对上市公司财务状况的关注主要集中在公司盈利能力的历史纪录以及变化趋势方面，这方面的指标主要包括净资产收益率、总资产收益率、销售收入增长率、主营业务收入增长率、净利润增长率五个指标，在给上市公司财务状况评分过程中这5个指标的权重最高；与此同时，本基金对上市公司的财务风险也比较关注，如果公司销售收入的快速增长是建立在大量举债的基础上，那么公司的业绩增长就缺乏可持续性，因此，本基金对上市公司偿债能力的分析指标（如资产负债率、流动比率）也给予了一定的权重。对于其他方面的财务指标，如每股经营活动现金流、净资产周转率等则作为参考指标，在具体的财务状况评分中基本不计入权重。

公司研究员按照上述的方法，对候选公司的财务状况进行综合打分，作为反映公司财务稳健性的指标。为了保证上述评分方法的有效性，本基金将每半年对评分体系进行检讨，必要时适当调整指标所占的权重。

C、公司的管理水平和信息透明度

本基金选择的上市公司的管理能力参考指标主要包括企业家能力、企业发展战略、组织/控制/激励体系三类指标。在上市公司信息透明度方面，主要参考信息披露、投资者沟通、内部人控制等指标。通过对上述两类指标分别排名，然后将各指标的排名结果相加，所得和的排名作为股票的综合排名。

D、流动性

主要考虑流通市值和换手率指标。首先剔除过去一年日平均换手率低于1%的个股，然后根据过去一年的日均流通市值和换手率数据，先对各指标分别排名，然后将各指标的排名结果相加，所得和的排名作为股票的综合排名。

按照以上步骤，我们按照一定的权重加权排名作为股票的综合排名，最终精选出50只股票，组成本基金持仓股票组合。

（4）股票调整

依据本基金选股指标体系进行动态调整，调整范围如下：本基金定期公告的重点关注股票；拟上市股票；公司基本面发生重大改变的股票；其他经过投资决策委员会依据研究报告认定的股票。以上这些股票一起构成本基金股票的候选股票组合。

股票的调整根据安全边际的大小进行。即：研究员每周对持仓股票及候选股票的安全边际进行排名比较，对于落入后10%的持仓股票将于下周适当时机卖出，对于进入后20%—10%之间的候选股票将于下周适当时机买入，但持仓股票数量始终维持在50只不变。其中：

股票安全边际=股票内在价值—股票市场价格

本基金对股票内在价值的计算主要依据DCF模型和市盈率定价模型。

3、债券组合的构建与调整

本基金为主动管理的混合型基金，债券投资收益是基金投资收益的来源之一，债券组合的构建与调整依据下列标准进行：

（1）类似信用等级和期限的债券中选择到期收益率较高的债券；

（2）类似信用等级、久期及到期收益率水平的债券中选择凸性较大的债券；

（3）流动性较高的债券；

（4）可获得较好当期收益的债券；

（5）其他价值被低估、有增值潜力的债券。

（三）基金投资决策与程序

1、研究过程

研究部门通过对宏观经济形势及证券市场走势的研究与分析，向投资决策委员会提交资产配置研究报告。

2、决策机制与决策过程

（1）决策依据

国家有关法律、法规和基金合同的有关规定是本基金进行投资的前提；宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势是本基金投资决策的基础；投资对象收益和风险的科学合理配比是本基金维护投资者利益的重要保障。

（2）决策机制与程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会根据研究部门提交的报告对基金的资产配置下达指导性意见，基金经理按照上述要求提交具体的投资方案，经投资决策委员会批准后，在授权范围内组织投资方案的实施，并对投资方案的实施绩效负责。

3、投资组合的构建

通过自上而下地进行行业优选和个股选择，适度集中投资，相对长期持有，构建本基金的投资组合。

（1）股票投资组合的构建。

通过自上而下地进行行业优选和个股选择，适度集中投资，相对长期持有，构建本基金的股票投资组合。

（2）债券投资组合的构建。

本基金的债券投资作为股票投资的有益补充，可以提高投资组合收益并适当分散风险。

4、交易过程

基金经理通过投资管理系统向交易部下达基金划款指令书。交易部负责交易执行和一线监控。

5、投资组合调整过程

基金经理密切关注宏观经济及市场形势，结合基金申购赎回情况和组合调整情况等，对投资组合进行动态监控和调整。

6、业绩与风险评估过程：基金经理小组和公司专职投资评估员按照投资决策委员会指导性方针和投资实施方案对投资业绩进行评估。

（四）投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定，运作管理本基金。

本基金投资组合应遵循下列规定：

1、本基金投资于股票、债券的比例，不低于本基金资产总值的80%；

2、本基金持有一家上市公司的股票，不超过本基金资产净值的10%；

3、本基金投资于股票的比例不低于本基金资产净值的20%；

4、本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的10%，并按有关规定履行信息披露义务；

5、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

6、本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

7、本基金与本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证不得超过该权证的10%；

8、本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金全部管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；

9、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

10、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

11、中国证监会规定的其它比例限制。

在本基金成立六个月内，应达到上述比例限制。除上述第9、10项外，因基金规模或市场剧烈变动导致投资组合不符合上述规定时，本基金管理人将在合理期限内进行调整，以符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定。

（五）禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

1、投资于其他基金；

2、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；

3、动用银行信贷资金从事证券买卖；

4、将基金资产用于非法担保、资金拆借或者贷款；

5、从事证券信用交易；

6、以基金资产进行房地产投资；

7、从事可能使基金资产承担无限责任的投资；

8、将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；

9、违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等行为来操纵和扰乱市场价格；

10、进行内幕交易、利益输送等损害基金份额持有人利益的行为；

11、通过股票投资取得对上市公司的控制权；

12、因基金投资股票而参加上市公司股东大会的、与上市公司董事会或其他持有 5%以上投票权的股东恶意串通，致使股东大会表决结果侵犯社会公众股东的合法权益；

13、证券法规规定禁止从事的其他行为。

十、基金的业绩比较标准

本基金业绩衡量基准=标普中国A股综合指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%

十一、基金的风险收益特征

本基金属于证券投资基金中的适度风险品种，在承担适度风险的前提下，获取长期稳定的收益。

十二、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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责任。

本基金的托管人——中国农业银行根据基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据取自《长盛动态精选证券投资基金2018年第3季度报告》，报告截止日：2018年9月30日。本报告中财务资料未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	178,979,919.67	61.46
	其中：股票	178,979,919.67	61.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	59,787,000.00	20.53
	其中：债券	59,787,000.00	20.53
	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	46,029,261.43	15.81
8	其他资产	6,404,385.91	2.20
9	合计	291,200,567.01	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	7,748,200.00	2.68
C	制造业	90,205,659.18	31.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,020,100.00	3.12
E	建筑业	10,375,660.80	3.58
F	批发和零售业	5,495,200.00	1.90
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	11,888,819.69	4.11
J	金融业	22,899,890.00	7.91
K	房地产业	10,336,500.00	3.57
L	租赁和商务服务业	2,584,760.00	0.89
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	5,532,630.00	1.91
R	文化、体育和娱乐业	2,892,500.00	1.00
S	综合	-	-
	合计	178,979,919.67	61.82

（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。

3、报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601668	中国建筑	1,889,920	10,375,660.80	3.58
2	600585	海螺水泥	255,200	9,388,808.00	3.24
3	600036	招商银行	285,000	8,746,650.00	3.02
4	601088	中国神华	380,000	7,748,200.00	2.68
5	600309	万华化学	160,000	6,795,200.00	2.35
6	600011	华能国际	830,000	6,399,300.00	2.21
7	600519	贵州茅台	7,600	5,548,000.00	1.92
8	601318	中国平安	80,000	5,480,000.00	1.89
9	600048	保利地产	450,000	5,476,500.00	1.89
10	601398	工商银行	900,000	5,193,000.00	1.79

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	19,752,000.00	6.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,035,000.00	13.83
	其中：政策性金融债	40,035,000.00	13.83
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	59,787,000.00	20.65

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	150223	15国开23	300,000	30,018,000.00	10.37
2	189933	18贴现国债33	200,000	19,752,000.00	6.82
3	180209	18国开09	100,000	10,017,000.00	3.46

注：本基金本报告期末仅持有上述三只债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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、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、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（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。

（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。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（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。

（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。

（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。

11、投资组合报告附注

（1）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。

（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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	459,391.05
2	应收证券清算款	4,918,245.63
3	应收股利	-
4	应收利息	1,022,092.78
5	应收申购款	4,656.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,404,385.91

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有可转换债券（可交换债券）。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

（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。

十三、基金的业绩

基金合同生效以来的业绩如下：

项目	基金份额净值增长率	同期业绩比较基准收益率	超额收益率
2004年5月21日（基金合同生效日）至2004年12月31日	-3.71%	-15.96%	12.25%
2005年度	3.39%	-9.00%	12.39%
2006年度	130.03%	103.69%	26.34%
2007年度	120.24%	156.31%	-36.07%
2008年度	-57.57%	-61.03%	3.46%
2009年度	81.13%	99.36%	-18.23%
2010年度	6.02%	-3.13%	9.15%
2011年度	-20.11%	-26.88%	6.77%
2012年度	-4.31%	5.32%	-9.63%
2013年度	19.52%	2.76%	16.76%
2014年度	23.35%	45.51%	-22.16%
2015年度	37.63%	27.51%	10.12%
2016年度	-17.94%	-11.25%	-6.69%
2017年度	10.46%	5.57%	4.89%
2018年1月1日至2018年9月30日	-15.54%	-18.69%	3.15%
2004年5月21日（基金合同生效日）至2018年9月30日	387.95%	236.09%	151.86%

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

十四、基金费用与税收

（一）基金运营过程中，从基金资产中支付的费用

1、费用种类

（1）基金管理人的管理费；
（2）基金托管人的托管费；
（3）证券交易费用；
（4）基金信息披露费用；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）与基金相关的会计师费和律师费；
（7）按照国家有关规定可以列入的其它费用。

2、费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计算。计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计算。计算方法如下：

H＝E×0.20%÷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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（3）上述（一）项中（3）至（7）项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的其它规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。基金成立前所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金资产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费

（1）投资者可选择在申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费用。申购费用由申购人承担，不列入基金资产。

（2）投资者选择交纳前端申购费用时，申购费率按照单笔申购金额递减，最高为不超过净申购金额的1.5%，具体费率如下：

申购金额	申购费率	养老金特定客户申购费率
100万以内	1.5%	0.45%
满100万不满500万	1.2%	0.36%
满500万不满1000万	0.6%	0.18%
满1000万以上	0.2%	0.06%

养老金特定申购费率适用于通过本公司直销柜台申购本基金A类基金份额的养老金客户，包括基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，具体包括：全国社会保障基金；可以投资基金的地方社会保障基金；企业年金单一计划以及集合计划；企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划；企业年金养老金产品。如未来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，本公司在法律法规允许的前提下可将其纳入养老金客户范围。

（3）投资者选择交纳后端申购费用时，申购费率按持有期递减，具体费率如下：

持有期	申购费率
一年以内	1.8%
满一年不满二年	1.0%
满二年不满三年	0.5%
满三年以后	0

2、赎回费

本基金赎回费率按持有期递减，最高不超过赎回金额的1.5%。赎回费率表如下：

持有期（Y）	赎回费率
Y＜7日	1.5%
7日≤Y＜一年	0.5%
一年≤Y＜两年	0.3%
两年≤Y＜三年	0.1%
Y≥三年	0

本基金的赎回费用由赎回人承担，其中，对持续持有期少于7日的投资者取的赎回费全额计入基金财产；对于持续持有期长于7日（含）的投资者收取赎回费的25%归入基金财产，余额为注册登记费和其他手续费。

3、基金管理人可以调整申购费率、赎回费率或收费方式，最新的申购费率、赎回费率和收费方式在更新的招募说明书中列示。如调整费率或收费方式，基金管理人最迟将于新的费率或收费方式开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

4、基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并及时告知基金托管人与相关机构。

（三）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务依照国家税收法律、法规的规定予以确定和履行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理方法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

（一）在“重要提示”中，更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
（二）更新了“三、基金管理人”中的相关内容。
（三）更新了“四、基金托管人”中的相关内容。
（四）更新了“五、相关服务机构”中的相关内容。
（五）更新了“九、基金的投资管理”中的相关内容。
（六）更新了“十、基金的业绩”中的相关内容。
（七）更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”中的相关内容。
（八）更新了“二十二、其他应披露事项”中的相关内容。

十六、签署日期

本招募说明书（更新）于2018年12月26日签署。

长盛基金管理有限公司
2018年12月28日

证券代码：000157　证券简称：中联重科　公告编号：2018－71号

中联重科股份有限公司 关于股东减持股份的进展公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

中联重科股份有限公司（以下简称“公司”、“本公司”）于 2018 年 10 月 27 日披露了《关于股东减持股份的预披露公告》（公告编号：2018－051），持有公司股份168,635,680股（占披露时本公司总股本比例2.16%）的股东佳卓集团有限公司（GOOD EXCEL GROUP LIMITED）（以下简称“佳卓集团”），计划在上述公告之日起 15个交易日后的6个月内，以大宗交易方式减持本公司股份不超过168,635,680股（占其持有公司股份总数的100%，占本公司总股本比例2.16%）；其中，在减持的任意连续九十个自然日内，减持股份的总数不超过2018年10月27日公告时公司股份总数的2%，即155,840,471股。

公司近日收到佳卓集团《关于减持所持中联重科股份有限公司股份的告知函》，佳卓集团于2018年12 月27日通过深圳证券交易所交易系统以大宗交易方式减持本公司股份138,819,479股，占本公司总股本比例1.78%。具体情况如下：

一、股东减持情况

1、股东减持股份情况

股东名称	减持方式	减持期间	减持均价（元/股）	减持股数（万股）	减持比例（%）
佳卓集团有限公司(GOOD EXCEL GROUP LIMITED)	大宗交易	2018年12 月27日	3.6	13,881.9479	82.32%

2、股东本次减持前后持股情况

股东名称	股份性质	本次减持前持有股份		本次减持后持有股份	
		股数（万股）	占总股本比例（%）	股数（万股）	占总股本比例（%）
佳卓集团有限公司(GOOD EXCEL GROUP LIMITED)	合计持有股份	16,863.5680	2.16%	2981.6201	0.38%
	其中：无限售条件股份	16,863.5680	2.16%	2981.6201	0.38%
	有限售条件股份	0	0	0	0

二、其他相关说明

1、本次减持符合《证券法》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》、《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等相关规定。公司将继续关注上述减持计划后续的实施情况，督促佳卓集团严格按照相关法律法规的规定合规减持，并及时履行相关信息披露义务。

2、佳卓集团本次减持股份事项已按照相关规定进行了预披露，本次减持情况与此前已披露的减持计划一致。

3、佳卓集团不存在应当履行而未履行的承诺事项，本次减持价格根据市场