长盛盛辉混合型证券投资基金 2019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:2019年8月27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2019年8月26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2019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	长盛盛辉混合	
基金主代码	003169	
交易代码	003169	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年08月16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	127,607,901.32份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛盛辉混合A	长盛盛辉混合C
下属分级基金的交易代码:	003169	003170
报告期末下属分级基金的份额总额	108,073,561.62份	19,534,339.70份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略,前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会,在有效控制风险的前提下力争满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	(一)大类资产配置 在大类资产配置中,本基金将主要考虑:(1)宏观经济指标;(2)微观经济指标;(3)市场指标;(4)政策因素。 (二)股票投资策略 在新股投资方面,本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面,运用基金管理人的研究平台和股票估值体系,深入发掘新股内在价值,结合市场估值水平和股市投资环境,充分考虑中签率、锁定期等因素,有效识别并的范风险,以获取较好收益。 (三)债券投资策略 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。
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,高于债券型基金的特征。

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	010-86497808	010-66594896
	电子邮箱	zhanglin@csfunds.com.cn	fcsd@bank.of.china.com
客户服务电话		400-888-2666,010-86497818	95566
传真		010-86497899	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

基金级别	长盛盛辉混合A	长盛盛辉混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-1,879,143.81	-15,462.27
本期利润	9,271,029.90	103,394.37
加权平均基金份额本期利润	0.1021	0.1944
本期基金份额净值增长率	11.14%	11.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0184	0.0234
期末基金资产净值	111,570,080.45	20,363,266.96
期末基金份额净值	1.0324	1.0424

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

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

3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。表中的“期末”均指本报告期最后一日,即6月30日。

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

长盛盛辉混合A

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	1.69%	1.02%	2.96%	0.58%	-1.27%	0.44%
过去三个月	-2.92%	1.20%	-0.11%	0.75%	-2.81%	0.45%
过去六个月	11.14%	1.08%	14.27%	0.77%	-3.13%	0.31%
过去一年	-0.24%	1.02%	8.26%	0.76%	-8.50%	0.26%
自基金合同生效起至今	3.24%	0.66%	12.32%	0.56%	-9.08%	0.10%

长盛盛辉混合C

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	1.68%	1.02%	2.96%	0.58%	-1.28%	0.44%
过去三个月	-2.98%	1.20%	-0.11%	0.75%	-2.87%	0.45%
过去六个月	11.06%	1.08%	14.27%	0.77%	-3.22%	0.31%
过去一年	-0.38%	1.02%	8.26%	0.76%	-8.64%	0.26%
自基金合同生效起至今	4.24%	0.66%	12.32%	0.56%	-8.08%	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:50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率

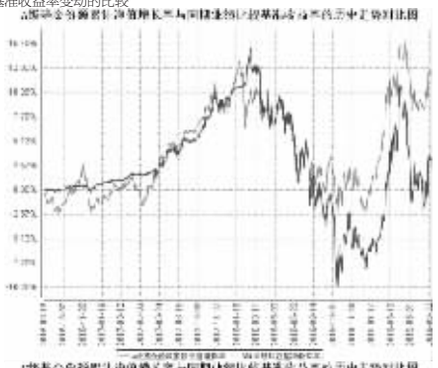
基准指数的构建考虑了三个原则:

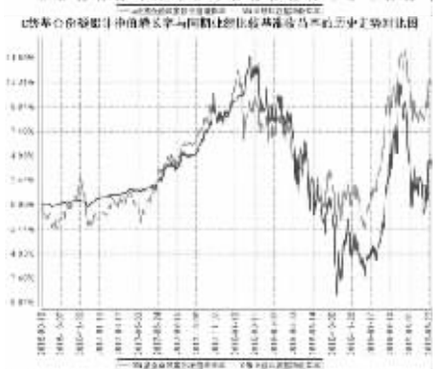
1、公允性。本基金为混合型基金,在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后, 选定沪深300指数作为本基金股票组合的业绩基准;债券组合的业绩基准则采用中证综合债指数。沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数, 由上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数, 具有良好的市场代表性。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数, 该指数可以较为全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。

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%-65%; 债券等固定收益类资产投资占基金资产的比例不低于30%;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





注: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2.06亿元。长盛基金总部办公地位于北京,在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构,并拥有全资子公司长盛基金(香港)有限公司和长盛创富资产管理有限公司。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2019年6月30日,基金管理人共管理五十七只开放式基金,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		
李琪	本基金基金经理,长盛成熟新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛金债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛可转债债券型证券投资基金基金经理,长盛信息安全量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016年8月16日	-	11年	李琪先生,博士,历任大分国际资信评估有限公司信用分析师,信用评审委员会委员,泰康资产管理有限责任公司信用研究员。2011年3月加入长盛基金管理有限公司,曾任信用研究员、基金经理助理等职务。
杨衡	本基金基金经理,长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理。	2016年8月16日	-	12年	杨衡先生,博士,博士后。2007年7月进入长盛基金管理公司,历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理、长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

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

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

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

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

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内, 未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

上半年,我国经济运行稳中趋缓。一季度,在地方债发行前置和信贷加速投放的推动下,经济增长动能有所改善,经济表现总体平稳且好于预期。二季度,国际经济疲态显现,国内经济动能回落。制造业投资增速下滑,基建投资增速维持低位,房地产投资显现回落迹象,整体固定资产投资增速减缓。汽车、家电等消费放缓,带动全社会消费品零售增速回落。此外,受中美贸易摩擦的滞后影响,出口下行压力加大。猪肉、水果等价格走高,带动通胀水平上升。

上半年债券市场总体呈现震荡走势。年初至4月中旬,受经济悲观预期修正、通胀预期抬头、贸易谈判向好发展、市场风险偏好走强等多重因素影响,债市震荡调整,特别是4月中上旬债市调整加剧。4月下旬以来,受益于中美贸易摩擦担忧升级、国内外经济基本面回落、风险资产调整、资金面明显宽松、美联储降息预期升温等多重利好因素推动,债市呈现上涨走势。

股市方面,年初至4月中旬,受中美贸易谈判预期向好和经济增长动能改善等利好因素推动,市场风险偏好明显回升,A股呈现快速上涨走势,整体估值水平有所抬升。4月中下旬以来,受中美贸易摩擦担忧重现和经济增长势头放缓等因素影响,A股整体呈现震荡调整走势。行业上,食品饮料、农林牧渔和非银金融等行业涨幅较大,钢铁、建筑装饰和传媒等行业涨幅靠后。概念板块上,鸡产业、工业大麻和白酒板块涨幅靠前,影视、网络游戏和大基建典企板块表现较差。风格上,大盘价值股跑赢小盘成长股。

2、报告期内本基金投资策略分析

组合操作上, 根据市场形势变化, 通过优化资产配置和灵活运用多种投资策略,积极把握股票和债券的投资机会。债券投资上,坚持稳健操作风格,在严控信用风险的基础上重点布局中高等级信用债, 积极挖掘可转债的投资机会和利率债的波段操作机会。股票投资上,根据市场变化调整权益资产仓位,精选盈利增长稳定和估值合理的个股。同时,紧密跟踪新股和可转债发行,积极参与网下申购,提升组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛辉混合A基金份额净值为1.0324元, 本报告期基金份额净值增长率为11.14%; 截至本报告期末长盛盛辉混合C基金份额净值为1.0424元,本报告期基金份额净值增长率为11.05%;同期业绩比较基准收益率为14.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,国际国内经济运行仍面临较多不确定性和不稳定性。针对国际国内经济金融形势的变化,国内宏观政策调控将更加注重前瞻性、协调性和有效性。为应对内部经济动能放缓和外部不确定性上升风险,逆周期调节料将加大力度,实施节奏也有望加快。财政政策将加力提效,减税降费、维稳基建投资和扩大内需刺激消费等政策措施有望助力经济企稳,并改善企业盈利预期。货币政策料将继续保持稳健偏宽松基调,流动性保持合理充裕,疏通货币政策传导机制,尽力实现宽货币向宽信用的转化。同时,注重防范和化解金融风险。

债市方面,未来一段时间内外部经济基本面、货币政策和流动性环境对债市仍构成支撑,中高等级信用债仍具有一定的配置价值。同时,密切关注和防范刚性兑付逐步打破和经济下行压力加大背景下的信用风险的暴露。

股市方面,在经济增长动能放缓、企业业绩仍在寻底阶段和中美贸易摩擦仍有可能反复的情况下,市场风险偏好难以大幅回升,但经过前期调整,市场风险有一定程度的释放。随着减税降费、扩内需、稳增长政策效果的逐步显现和利率水平的下行,市场或将出现阶段性机会和结构性机会。

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, 本基金报告期内未实施利润分配。

本基金截至2019年6月30日,期末可供分配利润为2,548,773.26 元,其中:长盛盛辉混合A期末可供分配利润为1,993,740.48元(未分配利润已实现部分为1,993,740.48元,未分配利润未实现部分为1,502,778.35元),长盛盛辉混合C期末可供分配利润为555,032.78元(未分配利润已实现部分为555,032.78元,未分配利润未实现部分为273,894.47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”)在长盛盛辉混合型证券投资基金(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:长盛盛辉混合型证券投资基金

报告截止日: 2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	10,803,968.81	1,939,783.81
结算备付金	430,806.10	-
存出保证金	11,340.83	798.31
交易性金融资产	123,712,006.61	81,997,727.56
其中:股票投资	77,219,838.37	48,266,627.56
基金投资	-	-
债券投资	46,492,168.24	33,741,100.00
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	10,500,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	700,399.23	370,994.37
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	146,158,511.58	84,309,304.04
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	3,700,000.00	-
应付证券清算款	10,249,567.10	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	47,347.98	43,376.87
应付托管费	15,782.69	14,458.96
应付销售服务费	322.36	48.50
应付交易费用	132,483.01	1,027.98
应交税费	138.99	-
应付利息	882.57	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	78,629.48	169,000.00
负债合计	14,225,164.18	227,912.23
所有者权益:		
实收基金	127,607,901.32	90,522,249.70
未分配利润	4,325,446.08	-6,430,857.87
所有者权益合计	131,933,347.40	84,091,391.83
负债和所有者权益总计	146,158,511.58	84,309,304.04

注:报告截止日2019年6月30日,长盛盛辉混合型证券投资基金份额总额127,607,901.32份。其中长盛盛辉混合型证券投资基金A类基金份额净值1.0324元,基金份额总额108,073,561.62份; 长盛盛辉混合型证券投资基金C类基金份额净值1.0424元,基金份额总额19,534,339.70份。

6.2 利润表

会计主体:长盛盛辉混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	10,186,525.65	-2,438,437.86
1.利息收入	620,822.86	1,239,286.15
其中:存款利息收入	11,524.39	79,658.30
债券利息收入	584,073.70	1,022,776.14
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	25,224.86	137,851.71
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-1,690,403.63	12,520,714.75
其中:股票投资收益	-2,032,244.08	12,146,714.84
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-687,100.94	-320,272.39
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	1,028,941.39	694,272.30
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	11,288,030.25	-16,229,604.35
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	76.08	31,156.59
减:二、费用	821,101.48	854,868.91
1. 管理人报酬	273,769.22	391,936.38
2. 托管费	91,253.08	130,645.48
3. 销售服务费	568.89	907.01
4. 交易费用	260,713.62	223,407.91
5. 利息支出	101,538.25	-
其中:卖出回购金融资产支出	101,538.25	-
6. 税金及附加	42.93	275.53
7. 其他费用	93,226.49	107,696.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	9,374,424.17	-3,293,306.77
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	9,374,424.17	-3,293,306.77

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛盛辉混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	90,522,249.70	-6,430,857.87	84,091,391.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,374,424.17	9,374,424.17
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)	37,085,651.62	1,381,879.78	38,467,531.40
其中:1.基金申购款	37,183,559.00	1,384,019.21	38,567,578.21
2.基金赎回款	-97,907.38	-2,139.43	-100,046.81
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)	127,607,901.32	4,325,446.08	131,933,347.40

项目	上年度可比期间 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)	200,222,353.62	18,808,849.14	219,031,202.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,293,306.77	-3,293,306.77
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)	-109,491,415.71	-12,347,802.77	-121,839,218.48
其中:1.基金申购款	96,919,700.57	10,851,883.70	107,771,584.27
2.基金赎回款	-206,411,116.28	-23,199,686.47	-229,610,802.75
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)	90,730,937.91	3,167,739.60	93,898,677.51

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

长盛盛辉混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2016]第1693号《关于准予长盛盛辉混合型证券投资基金注册的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛辉混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币600,232,393.75元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1091号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛盛辉混合型证券投资基金基金合同》于2016年8月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为600,232,422.22份基金份额,其中认购资金利息折合28.47份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《长盛盛辉混合型证券投资基金基金合同》和《长盛盛辉混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额; 从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额, 称为C类基金份额。A类基金份额与C类基金份额分别设置基金代码,并且由于基金费用的不同,分别计算和公告基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛辉混合型证券投资基金基金合同》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)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具、同业存单、银行存款、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。本基金股票资产投资占基金资产的比例为0%-65%; 债券等固定收益类资产投资占基金资产的比例不低于30%;权证投资占基金资产净值的0%-3%;在每个交易日日终,扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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沪深300指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

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8月26日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛盛辉混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至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须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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计算销售额。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。

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(“长盛基金”)	基金管理人、注册登记机构、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

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

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国元证券	21,708,032.66	10.91%	-	-

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国元证券	912,100.00	1.51%	-	-

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国元证券	114,400,000.00	27.42%	-	-

6.4.8.1.4 权证交易

无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券