长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018年8月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛盛杰一年期
基金主代码	004466
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年5月2日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	75,634,167.96份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过优化的资产配置,前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会,在严格控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	三、投资策略 (1)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,包括GDP增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口数据变化等;(2)微观经济指标,包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期等;(3)市场指标,包括股票市场与债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金的供求关系及其变化等;(4)政策因素,包括财政政策、货币政策、产业政策及其它与证券市场密切相关的各种政策。 (II)股票投资策略 在股票投资方面,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,深入发掘股票内在价值,结合市场估值水平和股票市场环境,充分考虑行业景气程度、企业竞争优势等因素,有效识别并防范风险,以获取较好收益。 (III)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。 本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素,构造债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*15%+中证综合债指数收益率*85%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金,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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	郭明
	联系电话	010-82019988	010-66105799
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	95588
传真		010-82256988	010-66105798

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	基金管理人和基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	7,086,878.81
本期利润	6,027,716.49
加权平均基金份额本期利润	0.0229
本期基金份额净值增长率	2.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0424
期末基金资产净值	78,842,224.91
期末基金份额净值	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。

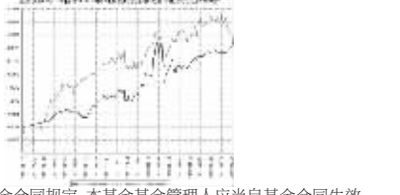
3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。表中的“期末”均指本报告期最后一日,即6月30日。

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

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	0.62%	0.05%	-0.65%	0.19%	1.27%	-0.14%
过去三个月	1.26%	0.06%	0.14%	0.18%	1.12%	-0.12%
过去六个月	2.18%	0.15%	1.41%	0.18%	0.77%	-0.03%
过去一年	3.76%	0.12%	3.04%	0.15%	0.72%	-0.03%
自基金合同生效起至今	4.24%	0.11%	4.53%	0.14%	-0.29%	-0.03%

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。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司(以下简称公司),成立于1999年3月26日,是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币18900万元。公司注册地在深圳,总部设在北京,并在北京、上海、成都设有分公司,在深圳设有营销中心,并拥有长盛基金(香港)有限公司、长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。目前,公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司占注册资本的41%,新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%,安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%, 安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者、特定客户资产管理业务资格和保险资产管理人资格。截至2018年6月30日,基金管理人共管理六十八只开放式基金, 并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外QFII基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张帆	本基金基金经理,长盛纯债债券型证券投资基金基金经理,长盛添利宝货币市场基金基金经理,长盛同德债券型证券投资基金基金经理,FOP业务部总监。	2017年5月2日	-	11年	张帆先生,1983年1月出生。华中科技大学硕士。曾在长江证券股份有限公司从事债券研究、债券投资工作。2012年4月加入长盛基金管理有限公司,曾任非信用研究员、长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理等职务。
杨衡	本基金基金经理,长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理,长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛世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,长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛景灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛享灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2017年5月2日	-	11年	杨衡先生,1975年10月出生。中国科学院数学与系统科学研究院博士,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、长盛纯债30天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。
杨哲	本基金经理,长盛可转债债券型证券投资基金基金经理,长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛同禧债券型证券投资基金基金经理。	2018年6月29日	-	8年	杨哲先生,1984年2月出生,经济学硕士。曾任大公国际资信评估有限公司信用分析师、信用评审委员会委员。2013年9月加入长盛基金管理有限公司,曾任信用研究员等职务。

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

回顾上半年,国内经济总体稳中趋缓,固定资产投资和消费均呈现下行趋势,其中房地产投资平稳,制造业投资小幅回升,投资下滑主要受基建投资放缓拖累,消费乏力主要是受房地产挤出效应;外需方面,则受贸易摩擦影响,进出口增速波动增大。受金融去杠杆、资管新规及规范地方举债等因素影响,5月以来社融增速出现明显下滑。货币政策边际放松,流动性管理从合理稳定转为合理充裕,资金面整体相对宽松。

上半年,债市走出牛市行情,其中十年国开债收益率下行达60BP。一季度,在经济基本面回落、央行定向降准、抵押补充贷款放量、银监会重要监管政策的落地等因素支撑下,债券收益率持续下行;4月份,受资金面短期偏紧,叠加美联储加息预期、油价上涨等因素影响,债券收益率小幅回调。随后,受贸易战升级、融资收缩、货币政策边际放松、股市下跌等因素影响,利率重回下行。

上半年,A股市场整体跌幅较大,上证综指跌幅13.9%,创业板指数跌幅8.3%。一月份,市场在以银行、地产、周期为主的大盘股拉动下走出一波上涨行情, 二月以来A股市场呈震荡下跌走势, 尤其是5月中旬以来,受中美贸易摩擦升级、股权质押平仓、人民币贬值等因素影响,A股市场加速下跌。行业上,食品饮料和休闲服务行业表现较好,通信、综合、电气设备等行业跌幅较大。风格上,受贸易战、股权质押平仓风险等因素影响,小盘成长股跌幅大于大盘价值股。

可转债方面,受股市大跌影响,可转债整体下跌,但跌幅明显小于A股;转股溢价率被动抬升,偏债型转债数量明显增加。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金坚持稳健操作思路,在资金面边际松及违约风险增大的情况下,适度拉长久期,并增配利率债,严控信用风险;权益资产方面,股票资产和可转债资产比重保持在较低水平,大幅降低了权益类资产大幅下跌带来的不利影响。

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1.0424元;本报告期基金份额净值增长率为2.18%,业绩比较基准收益率为1.41%。

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,国内去杠杆和中美贸易摩擦背景下,投资和外需两大支撑经济韧性的因素均受到削弱,经济面临下行压力;而积极财政政策将加大力度,通过基建投资、减税降费等措施以托底经济。货币政策方面,将保持流动性合理充裕,预计资金利率将继续维持较低水平。

债券市场方面, 经济基本面和货币政策仍对债券牛市构成支撑,操作上需重视流动性充裕局面下中短端信用债的配置机会,同时,积极把握中美贸易摩擦反复等因素带来的长端利率的交易性机会。

股票市场方面, 对经济前景的隐忧使得市场风险偏好难以显著回升,但经过前期大幅调整, 目前A股估值已处于历史低位,下半年随着积极财政加大力度和利率水平的下行,市场将出现阶段性机会和结构性机会。转债方面,预计下半年转债发行继续提速,关注估值修复后的配置机会。

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。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议,由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定,本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至2018年6月30日, 期末可供分配收益为3,208,056.95元,其中:未分配收益已实现部分为3,537,826.36元,未分配收益未实现部分为-329,769.41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,本基金托管人在对长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何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

本报告期内,长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金的管理人——长盛基金管理有限公司在长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	270,641.36	5,604,456.62
结算备付金	1,362,766.78	4,916,647.41
存出保证金	71,377.94	35,523.46
交易性金融资产	83,321,630.00	526,605,381.10
其中:股票投资	-	19,916,770.10
基金投资	-	-
债券投资	83,321,630.00	506,688,611.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	694,480.10	-
应收利息	949,828.17	8,351,969.67
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	86,670,724.35	545,513,978.26
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	7,500,000.00	171,799,699.35
应付证券清算款	-	3,493,572.59
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	38,684.58	187,544.63
应付托管费	9,671.14	46,886.16
应付销售服务费	38,684.58	187,544.63
应付交易费用	18,074.22	33,457.61
应交税费	129.91	-
应付利息	-1,888.90	55,170.49
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	225,143.91	112,500.00
负债合计	7,828,499.44	175,916,375.46
所有者权益:		
实收基金	75,634,167.96	362,274,064.11
未分配利润	3,208,056.95	7,323,538.69
所有者权益合计	78,842,224.91	369,597,602.80
负债和所有者权益总计	86,670,724.35	545,513,978.26

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0424元,基金份额总额75,634,167.96份。

6.2 利润表

会计主体:长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年5月2日(基金合同生效日)至2017年6月30日
一、收入	9,880,744.12	2,625,114.02
1.利息收入	6,452,094.68	2,799,148.17
其中:存款利息收入	81,844.55	364,992.59
债券利息收入	6,301,631.86	1,600,644.90
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	68,618.27	833,510.68
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	4,487,811.76	-319,073.33
其中:股票投资收益	2,464,188.52	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,023,623.24	-319,073.33
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	-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-1,059,162.22	145,039.18
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
减:二、费用	3,853,027.63	965,430.62
1. 管理人报酬	825,538.32	351,969.49
2. 托管费	206,384.59	87,992.39
3. 销售服务费	825,538.32	351,969.49
4. 交易费用	280,206.56	3,890.36
5. 利息支出	1,503,260.91	139,275.34
其中:卖出回购金融资产支出	1,503,260.91	139,275.34
6. 税金及附加	13,569.11	-
7. 其他费用	198,589.82	30,333.55
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	6,027,716.49	1,659,683.40
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	6,027,716.49	1,659,683.40

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	362,274,064.11	7,323,538.69	369,597,602.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,027,716.49	6,027,716.49
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)	-286,639,896.15	-10,143,198.23	-296,783,094.38
其中:1.基金申购款	31,516,896.56	1,155,904.28	32,672,800.84
2.基金赎回款	-318,156,792.71	-11,299,102.51	-329,455,895.22
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)	75,634,167.96	3,208,056.95	78,842,224.91
项目	上年度可比期间 2017年5月2日(基金合同生效日)至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	362,274,064.11	-	362,274,064.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,659,683.40	1,659,683.40
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	362,274,064.11	1,659,683.40	363,933,747.51

注:报告期末基金管理人的管理费按前一日基金资产净值0.15%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:日管理费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年5月2日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	206,384.59	87,992.39

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%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×0.15%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
长盛基金	11,900.59
中国工商银行	812,922.85
合计	824,823.44
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2017年5月2日(基金合同生效日)至2017年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
长盛基金	129.61
中国工商银行	347,706.06
合计	347,835.67

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给长盛基金,再由长盛基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.60%/ 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年5月2日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	270,641.36	54,323.22	782,073.30	27,976.05

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额7,500,000.00元, 于2018年7月2日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 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6月30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6,109,878.40元,属于第二层次的余额为77,211,751.60元,无属于第三层次的余额。(于2017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22,486,498.50 元,属于第二层次的余额为504,118,882.60 元,无属于第三层次的余额。)

(ii)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

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	83,321,630.00	96.14
	其中:债券	83,321,630.00	96.14
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,633,408.14	1.88
7	其他各项资产	1,715,686.21	1.98
8	合计	86,670,724.35	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601088	中国神华	3,655,546.50	0.99
2	600704	物产中大	2,920,758.95	0.79
3	601939	建设银行	2,771,011.00	0.75
4	600036	招商银行	2,671,909.00	0.72
5	600383	金地集团	2,267,197.15	0.61
6	600104	上汽集团	2,259,986.12	0.61
7	000876	新 希 望	2,240,369.00	0.61
8	601288	农业银行	2,002,756.00	0.54
9	000001	平安银行	1,960,076.00	0.53
10	600900	长江电力	1,953,714.00	0.53
11	601328	交通银行	1,854,382.00	0.50
12	600816	安信信托	1,836,943.91	0.50
13	600177	雅戈尔	1,811,797.94	0.49
14	600023	浙能电力	1,806,340.00	0.49
15	000625	长安汽车	1,668,120.00	0.45
16	601166	兴业银行	1,563,299.00	0.42
17	600011	华能国际	1,561,871.00	0.42
18	600376	首开股份	1,553,666.50	0.42
19	000895	双汇发展	1,538,199.00	0.42
20	601998	中信银行	1,522,732.00	0.41

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600176	中国巨石	12,119,575.00	3.28
2	600754	锦江股份	6,610,815.20	1.79
3	601088	中国神华	3,601,337.00	0.97
4	601939	建设银行	2,786,878.00	0.75
5	600704	物产中大	2,739,366.50	0.74
6	600036	招商银行	2,646,281.02	0.72
7	600104	上汽集团	2,503,172.57	0.68
8	000876	新 希 望	2,364,890.58	0.64
9	300021	大禹节水	2,170,411.00	0.59
10	000001	平安银行	2,044,066.00	0.55
11	600900	长江电力	2,035,028.00	0.55
12	601288	农业银行	1,958,781.00	0.53
13	600023	浙能电力	1,892,504.00	0.51
14	600816	安信信托	1,800,585.00	0.49
15	600011	华能国际	1,772,526.00	0.48
16	601328	交通银行	1,767,480.00	0.48
17	600177	雅戈尔	1,765,953.47	0.48
18	600383	金地集团	1,726,584.96	0.47
19	000625	长安汽车	1,722,206.00	0.47
20	002146	荣盛发展	1,524,869.00	0.41

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	75,632,250.33
卖出股票收入(成交)总额	94,837,649.94

注:本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3表中的“买入金额”(或“买入股票成本”)、“卖出金额”(或“卖出股票收入”)均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	8,093,751.60	10.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,940,000.00	37.97
	其中:政策性金融债	29,940,000.00	37.97
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)	6,109,878.40	7.75
8	同业存单	39,178,000.00	49.69
9	其他	-	-
10	合计	83,321,630.00	105.68

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	180203	18国开03	100,000	10,151,000.00	12.88