长盛积极配置债券型证券投资基金 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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	长盛积极配置债券
基金主代码	080003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月8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	389,426,331.93份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳定增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	本基金为积极投资策略的债券型基金,不同与传统债券型基金的投资策略特点,本基金在债券类资产配置上更强调积极主动管理,在债券类资产配置上,本基金通过积极投资配置相对收益率较高的企业债、公司债、可转换债、可分离交易可转债、资产支持证券等创新债券品种,并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极捕捉定收益证券市场中投资机会,以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上,通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有良投资价值的股票,来获取股票市场的积极收益。此外,本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。
业绩比较基准	中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。

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	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	zhanglin@csfundscom.cn	tianqing1.zh@ccbcn.com
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	010-67595096
传真		010-82256883	010-66275853

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	5,378,495.34
本期利润	-7,062,629.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0169
本期基金份额净值增长率	-1.67%
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	0.0684
期末基金资产净值	416,046,331.99
期末基金份额净值	1.0684

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	-0.58%	0.30%	-0.18%	0.13%	-0.40%	0.17%
过去三个月	-1.01%	0.28%	0.92%	0.14%	-1.93%	0.14%
过去六个月	-1.67%	0.28%	2.56%	0.13%	-4.23%	0.15%
过去一年	0.35%	0.21%	3.44%	0.11%	-3.09%	0.10%
过去三年	5.89%	0.19%	8.72%	0.16%	-2.83%	0.03%
自基金合同生效起至今	72.04%	0.35%	57.05%	0.19%	14.99%	0.16%

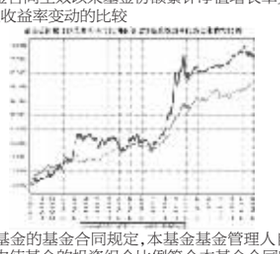
注:本基金业绩比较基准:中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成,为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

沪深300指数是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。沪深300指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。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90%、10%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:按照本基金的基金合同规定,本基金基金管理人自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的约定。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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
段鹏	本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理,长盛盛誉纯债债券型证券投资基金基金经理,长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理,长盛盛通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。	2018 年 6 月22日	-	11年	段鹏先生,1982年12月出生。中央财经大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易,债券投资及流动性管理等工作。2013年12月加入长盛基金管理有限公司。
冯雨生	本基金基金经理,长盛中证100指数证券投资基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)基金经理,长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理,长盛成长价值证券投资基金基金经理,长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理,长盛城镇新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛信息灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理,长盛信息安全主题量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛同德主题精长混合型证券投资基金基金经理,量化投资部负责人。	2016 年 9 月12日	-	11年	冯雨生先生,1983年11月出生。毕业于光华管理学院金融系,北京大学经济学硕士,CFA(特许金融分析师)。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程研究员,同盛基金经理助理等职务。
王赛飞	本基金基金经理,长盛添利宝货币市场基金基金经理。	2018 年 6 月22日	-	6年	王赛飞女士,1987年10月出生。中国人民大学金融学硕士。曾任东公国际资信评估有限公司分析师,信用评审委员会委员,2015年7月加入长盛基金管理有限公司固定收益部,曾任信用研究员、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理等职务。
马文祥	本基金基金经理。	2016 年 1 月20日	2018 年 6 月22日	15年	马文祥先生,1977年7月出生。清华大学经济管理学院经济学硕士。历任中国农业银行主任科员,工银瑞信企业年金基金经理、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013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

报告期内,国内经济稳中趋缓,基本面继续温和回落。表外及低等级债券融资被动收缩,M2和社融同比增速下行, 增加了经济的不确定性。为缓解经济下行压力,宏观政策以宽货币进行对冲,例如年初以来央行3次定向降准、大额投放MLF等,整体银行间市场资金宽松。

报告期内,债券收益率震荡下行,二季度降准落地后,资金面短期反而收紧,市场情绪警惕,带动收益率小幅回调。但随后,在贸易战升温、经济基本面回落担忧、货币政策边际改善确认、股市下跌等因素带动下,利率重回下行。

报告期内,股票市场大幅下跌,个股呈普跌态势,蓝筹股与小市值股票均大幅下跌。概念板块亮点难寻,普遍下跌,仅仿制药、创新药、电子政务、独角兽概念、血液制品等概念指数实现正收益,PM2.5、南北船合并、葡萄酒、特高压、3D玻璃等概念板块领跌。行业上,休闲服务、医药生物和食品饮料等行业表现亮眼, 实现正收益, 涨幅大幅领先其他行业,综合、通信、电气设备等行业表现最差。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

在报告期内,本基金坚持稳健操作思路,在资金面边际放松的情况下,重点配置中短期高等级信用债,适当提升杠杆水平;在利率水平上升空间有限的情况下,适当参与了利率的交易性机会;权益资产方面,将定量的股票筛选和定性的公司研究有机结合, 运用数量模型分析方法,包括股票评级、行业评级、价值成长模型评分等挖掘价值被低估的股票,从而构建本基金的股票投资组合;精选具备估值优势和业绩成长潜力的可转债,择机进行波段操作,提升组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0684元;本报告期基金份额净值增长率为-1.67%,业绩比较基准收益率为2.56%。

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,降杠杆会持续,但力度和节奏会考虑实体经济的可承受度。考虑到中美贸易战加剧以及宽信用政策在短期内尚难见效,短期内经济增长下行压力仍存。宽货币带来的流动性宽松格局仍将持续,有利于债券市场的表现,但波动将加大。

一方面,资管新规细则、银行理财征求意见稿出台,虽然在发行老产品、产品估值、非标回表等方面都给予了更强灵活性,但更多是利好短久期债券、中高等级信用债、短期非标等资产,需求大量集中转向短久期债券。

另一方面,国务院常务会议上释放出财政边际发力信号,同时强调不搞大水漫灌式强刺激,货币政策基调维持宽松,而信贷方面对小微企业和平台企业有适当放松, 叠加央行窗口指导银行增配低评级信用债,市场对"宽信用"预期升温,机构风险偏好有望进一步抬升,考虑到股票市场经过前期的大幅调整,目前已处于估值相对较低的位置,吸引力有所回升,下半年可能会有更好的投资机会。

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2018年上半年未实施利润分配。

本基金截至2018年6月30日, 期末可供分配收益为26,620,000.06元,其中,未分配收益已实现部分为30,541,965.02 元,未分配收益未实现部分为-3,921,964.96 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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:长盛积极配置债券型证券投资基金

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	6,055,482.53	3,078,000.22
结算备付金	1,925,046.48	1,871,616.54
存出保证金	96,972.13	36,418.80
交易性金融资产	435,107,592.67	482,520,204.47
其中:股票投资	51,932,523.03	72,493,609.91
基金投资	-	-
债券投资	383,175,069.64	410,026,594.56
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	-	10,300,000.00
应收证券清算款	10,128,017.28	19,831.23
应收利息	5,340,041.73	6,333,303.65
应收股利	-	-
应收申购款	4,333.18	4,071.39
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	458,657,486.00	504,163,446.30
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	40,739,818.89	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	31,397.07	2,837.78
应付管理人报酬	257,856.50	320,019.57
应付托管费	68,761.73	85,338.55
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,256.11	76,198.96
应交税费	1,203,124.61	1,201,336.86
应付利息	23,530.02	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	285,409.08	352,547.92
负债合计	42,611,154.01	2,038,279.63
所有者权益:		
实收基金	389,426,331.93	462,152,723.77
未分配利润	26,620,000.06	39,972,442.90
所有者权益合计	416,046,331.99	502,125,166.67
负债和所有者权益总计	458,657,486.00	504,163,446.30

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0684元,基金份额总额389,426,331.93份。

6.2 利润表

会计主体:长盛积极配置债券型证券投资基金

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1月1日至2017年6月30日
一、收入	-4,226,677.17	17,793,178.39
1.利息收入	7,821,364.78	10,242,856.62
其中:存款利息收入	43,475.86	187,810.22
债券利息收入	7,493,142.77	8,185,990.13
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	284,746.15	1,869,056.27
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	353,288.60	-5,011,215.57
其中:股票投资收益	747,091.73	-176,312.81
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,214,807.38	-5,250,126.36
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	821,004.25	415,223.60
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-12,441,125.22	12,218,657.26
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	39,794.67	342,880.08
减:二、费用	2,835,952.71	2,970,775.43
1. 管理人报酬	1,691,440.56	2,129,788.70
2. 托管费	451,050.82	567,943.68
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	405,874.53	19,329.17
5. 利息支出	76,520.27	50,904.36
其中:卖出回购金融资产支出	76,520.27	50,904.36
6. 税金及附加	13,252.51	-
7. 其他费用	197,814.02	202,809.52
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-7,062,629.88	14,822,402.96
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-7,062,629.88	14,822,402.96

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛积极配置债券型证券投资基金

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)	462,152,723.77	39,972,442.90	502,125,166.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,062,629.88	-7,062,629.88
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)	-72,726,391.84	-6,289,812.96	-79,016,204.80
其中:1.基金申购款	1,105,345.56	97,840.73	1,203,186.29
2.基金赎回款	-73,831,737.40	-6,387,653.69	-80,219,391.09
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)	389,426,331.93	26,620,000.06	416,046,331.99
项目	上年度可比期间 2017年1月1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)	820,600,019.34	29,984,446.86	850,584,466.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,822,402.96	14,822,402.96
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)	-354,757,261.30	-14,682,495.53	-369,439,756.83
其中:1.基金申购款	87,773,338.71	3,588,025.45	91,361,364.16
2.基金赎回款	-442,530,600.01	-18,270,520.98	-460,801,120.99
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)	465,842,758.04	30,124,354.29	495,967,112.33

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

长盛积极配置债券型证券投资基金(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[2008]第984号《关于核准长盛积极配置债券型证券投资基金募集的批复》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《长盛积极配置债券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1,361,279,052.21元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司(事务所的性质已变更为特殊普通合伙)普华永道中天验字(2008)第144号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》于2008年10月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,362,144,547.24份基金份额,其中认购资金利息折合865,495.03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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛积极配置债券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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具,其中投资于债券等固定收益类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%;投资于股票、权证等权益类证券的比例不超过基金资产的20%,其中,权证投资的比例不超过基金资产的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%。本基金的业绩比较基准为:中证全债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%。

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》、《长盛积极配置债券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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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声明

本报告期所采用的的会计政策、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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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。

(2)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。

(3)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。

(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

无。

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
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构

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

注:无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,691,440.56	2,129,788.70
其中:支付销售机构的客户维护费	31,537.43	66,843.95

注:支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.75%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:

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	451,050.82	567,943.68

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0.2%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×0.2%/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1月1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
中国建设银行	6,055,482.53	22,230.49	3,059,676.45	73,430.65

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。

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

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款40,739,818.89元, 是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
160302	16进出02	2018 年 7 月 4 日	97.41	420,000	40,912,200.00
合计				420,000	40,912,200.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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131,646,592.67元,属于第二层次的余额为303,461,000.00元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次128,693,344.47元,第二层次353,826,860.00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(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