长盛盛德灵活配置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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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。

根据《长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、本基金基金份额持有人大会于2018年7月23日表决通过的《关于终止长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及基金管理人长盛基金管理有限公司于2018年7月24日发布的《长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金于2018年7月24日进入财产清算期。

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	长盛盛德混合	
基金主代码	004303	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月3日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,007,615.46份	
基金合同存续期	于2018年7月24日进入清算期	
下属分级基金的基金简称:	长盛盛德混合A	长盛盛德混合C
下属分级基金的交易代码:	004303	004304
报告期末下属分级基金的份额总额	10,000,426.04份	7,189.42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	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。 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,有效识别并防范风险,以获取较好收益。 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*50%+中证综合债指数收益率*50%
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、高于债券型基金和货币市场基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	李修滨
	联系电话	010-82019988	4006800000
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	lixiubin@citicbank.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95558
传真		010-82255988	010-85230024

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

基金级别	长盛盛德混合A	长盛盛德混合C
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)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-4,404,737.10	-537.50
本期利润	-5,254,041.47	-1,181.23
加权平均基金份额本期利润	-0.0496	-0.0604
本期基金份额净值增长率	-6.45%	-6.50%
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	-0.0582	-0.0589
期末基金资产净值	9,418,198.46	6,766.31
期末基金份额净值	0.9418	0.9411

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。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

长盛盛德混合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	-4.33%	0.59%	-3.57%	0.64%	-0.76%	-0.05%
过去三个月	-4.19%	0.56%	-4.07%	0.57%	-0.12%	-0.01%
过去六个月	-6.45%	0.54%	-4.61%	0.58%	-1.84%	-0.04%
过去一年	-4.17%	0.40%	0.17%	0.47%	-4.34%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-1.44%	0.35%	3.75%	0.44%	-5.19%	-0.09%

长盛盛德混合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	-4.35%	0.59%	-3.57%	0.64%	-0.78%	-0.05%
过去三个月	-4.22%	0.56%	-4.07%	0.57%	-0.15%	-0.01%
过去六个月	-6.50%	0.54%	-4.61%	0.58%	-1.89%	-0.04%
过去一年	-4.26%	0.40%	0.17%	0.47%	-4.43%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-1.56%	0.35%	3.75%	0.44%	-5.31%	-0.09%

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

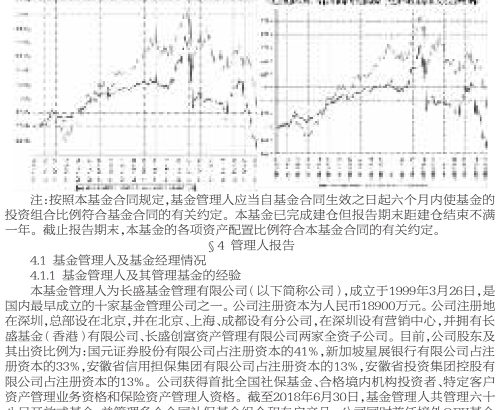
基准指数的构建考虑了三个原则:

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。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%;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,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有关约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截止报告期末,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§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
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,长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛康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,长盛盛兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛淳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,长盛盛禧灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛乾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,长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理。	2017年3月3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管理制度。

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,经济保持了总体平稳、稳中向好态势,但部分数据指标走弱,显示经济存在下行压力。此外,中美贸易摩擦可能给中国出口带来不确定性。金融管理部门放宽了信用投放的监管指标,包括合意信贷额度、流动性(以降准、MLF等方式)、MPA中的广义信贷额度等,我国债券收益率大幅下行。

报告期内,A股市场1月冲高后整体呈现明显调整,成交活跃度下降。转债受股票市场影响和拖累,但调整幅度小于股票。

报告期内,IPO发行基本延续每周一批的常态化发行节奏,但每批IPO家数和募集总金额明显减少。受权益市场调整和风格转换影响,股票底仓波动加大。上市新股平均开板涨幅整体较过去有明显下行,新股网下申购对象数量较年初有所减少。部分新发行转债上市初期出现破发。

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,固定收益配置抓住有利时机、以高信用资质的中短期信用债、银行同业存单为主要投资标的,较好控制了利率风险、信用风险和流动性风险。

在股票配置上,本基金于2月初出清股票仓位(除停牌股票外),之后未再主动增加股票仓位,未参与新股申购。报告期内,随着基金大额赎回后规模缩减,停牌股票仓位占比被动大幅上升,部分停牌股票复牌后连续大幅下跌,短期对基金净值构成较大冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛德混合A基金份额净值为0.9418元,本报告期基金份额净值增长率为-6.45%;截至本报告期末长盛盛德混合C基金份额净值为0.9411元,本报告期基金份额净值增长率为-6.50%;同期业绩比较基准收益率为-4.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中共中央政治局会议指出,当前经济运行稳中有变,面临一些新问题新挑战,外部环境发生明显变化。对于下半年宏观政策动向,保持经济平稳健康发展,坚持实施积极的财政政策和稳健的货币政策,提高政策的前瞻性、灵活性、有效性。财政政策要在扩大内需和结构调整上发挥更大作用。要把好货币供给总闸门,保持流动性合理充裕。把防范化解金融风险和服务实体经济更好结合起来,坚定做好去杠杆工作,把握好力度和节奏。

外围环境来看,美国、英国等多国央行相继收紧货币政策,进入加息周期。在中美贸易摩擦背景下,由于中国经济下行压力的存在,中国货币政策微调,流动性边际宽松,人民币汇率或一定程度上对政策空间形成制约。

展望未来,基本面稳中有变,考虑到仍将面临贸易战等不确定态势,内外部风险短期难消除,汇率、通胀等制约因素仍可能存在,市场压力传导路径依然繁杂。后期操作上,我们认为债市仍有空间,但目前收益率水平较前期有明显配置价值的吸引力在减退。

本基金操作层面,根据基金规模变化,做好组合流动性安排。

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中对基金利润分配原则的约定,本基金本报告期末未实施利润分配。

本基金截至2018年6月30日,期末可供分配利润为-582,650.69元,其中:长盛盛德混合A期末可供分配利润为-582,227.58元(未分配利润已实现部分为-207,053.51元,未分配利润未实现部分为-375,174.07元),长盛盛德混合C期末可供分配利润为-423.11元(未分配利润已实现部分为-153.56元,未分配利润未实现部分为-269.55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

本基金自2018年4月16日至2018年6月30日期间出现连续20个工作日基金资产净值低于5000万元的情形。

§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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《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,对长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金2018年上半年的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,长盛基金管理有限公司在长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金2018年上半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:长盛盛德灵活配置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	1,439,868.04	956,250.99
结算备付金	106,026.81	214,090.91
存出保证金	46,400.96	50,467.23
交易性金融资产	3,963,263.00	198,465,707.17
其中:股票投资	2,963,163.00	124,252,706.87
基金投资	-	-
债券投资	1,000,100.00	74,213,000.30
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	3,700,000.00	1,100,000.00
应收证券清算款	202,370.07	266,625.40
应收利息	29,991.46	813,281.42
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	50.00	-
资产总计	9,487,970.34	201,866,423.12
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	-	-
应付证券清算款	-	198,469.76
应付赎回款	747.24	-
应付管理人报酬	4,743.66	135,337.25
应付托管费	790.61	22,556.21
应付销售服务费	1.29	1.68
应付交易费用	3,091.79	6,853.69
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	53,630.98	127,500.00
负债合计	63,005.57	490,718.59
所有者权益:		
实收基金	10,007,615.46	200,041,117.99
未分配利润	-582,650.69	1,334,586.54
所有者权益合计	9,424,964.77	201,375,704.53
负债和所有者权益总计	9,487,970.34	201,866,423.12

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值为人民币0.9418元,盛德混合A类份额净值为人民币0.9418元,盛德混合C类份额净值为人民币0.9411元;基金份额总额为10,007,615.46份,其中盛德混合A类份额为10,000,426.04份,盛德混合C类份额为7,189.42份。

6.2 利润表

会计主体:长盛盛德灵活配置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3月3日(基金合同生效日)至2017年6月30日
一、收入	-4,493,121.19	18,860,885.85
1.利息收入	1,261,712.00	6,006,553.32
其中:存款利息收入	37,670.50	103,827.42
债券利息收入	1,025,534.15	3,687,848.82
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	198,507.35	2,214,877.08
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-4,905,019.73	9,834,059.00
其中:股票投资收益	-4,783,021.88	8,873,558.65
基金投资收益	-	-
债券投资收益	43,401.69	-94,760.18
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	-165,399.54	1,055,260.53
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-849,948.10	3,020,273.53
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	134.64	-
减:二、费用	762,101.51	1,757,544.97
1. 管理人报酬	321,227.39	1,186,824.98
2. 托管费	53,537.87	197,804.12
3. 销售服务费	9.91	7.14
4. 交易费用	308,273.33	314,665.37
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.21	-
7. 其他费用	79,052.80	58,243.36
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-5,255,222.70	17,103,340.88
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-5,255,222.70	17,103,340.88

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛盛德灵活配置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)	200,041,117.99	1,334,586.54	201,375,704.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-5,255,222.70	-5,255,222.70
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)	-190,033,502.53	3,337,985.47	-186,695,517.06
其中:1.基金申购款	26,522.39	344.14	26,866.53
2.基金赎回款	-190,060,024.92	3,337,641.33	-186,722,383.59
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)	10,007,615.46	-582,650.69	9,424,964.77

项目	上年度可比期间 2017年3月3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)	600,046,750.02	-	600,046,750.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,103,340.88	17,103,340.88
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)	173.99	8.72	182.71
其中:1.基金申购款	973.99	26.01	1,000.00
2.基金赎回款	-800.00	-17.29	-817.29
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)	600,046,924.01	17,103,349.60	617,150,273.61

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

长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系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]2933号《关于准予长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的注册,由长盛基金管理有限公司于2017年2月24日至2017年2月28日止的期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资并出具(2017)验字60468688_A03号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年3月3日正式生效。本基金为契约型开放式。截至2017年3月2日止,A类已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币599,997,000.00元,折合599,997,000.00份A类基金份额;有效认购资金在募集期间产生的利息人民币27,000.00元,折合27,000.00份A类基金份额;以上收到的实收基金共计人民币600,024,000.00元,折合600,024,000.00份A类基金份额。盛德混合C类已收到首次募集的有效净认购金额为人民币22,750.00元,折合22,750.00份C类基金份额;募集资金在募集期间产生的利息为人民币0.02元,折合0.02份C类基金份额;以上收到的实收基金共计人民币22,750.02元,折合22,750.02份C类基金份额。盛德混合A类及C类收到的实收基金合计人民币600,046,750.02元,分别折合成A类和C类基金份额,合计折合600,046,750.02份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

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、中小企业私募债及其他经中国证监会允许基金投资的债券)、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(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%;权证投资占基金资产净值的0%-3%;每个交易日日终,在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%。本基金业绩比较基准:沪深300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

根据《长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、本基金基金份额持有人大会于2018年7月23日表决通过的《关于终止长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》以及基金管理人长盛基金管理有限公司于2018年7月24日发布的《长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金于2018年7月24日进入财产清算期,详情参见正文附注6.4.8.2资产负债表日后事项。本基金财务报表以非持续经营基础编制。

于2018年6月30日,所有资产以可回收金额和账面价值孰低计量,负债以预计需要清偿的金额计量,其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

6.4.6.1印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

6.4.6.2增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定,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;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,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(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,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;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、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股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

6.4.6.3企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资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,股权的股息、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。

6.4.6.4个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,暂减按25%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;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司("中信银行")	基金托管人

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

注:本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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3月3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	321,227.39	1,186,824.98
其中:支付销售机构的客户维护费	2.01	-

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.60%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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3月3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托管费	53,537.87	197,804.12

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%/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

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	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 长盛盛德混合A	长盛盛德混合C	合计
长盛基金管理有限公司	-	0.02	0.02
合计	-	0.02	0.02

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年3月3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 长盛盛德混合A	长盛盛德混合C	合计
长盛基金管理有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

注:基金销售服务费每日计提,按月支付。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别,适用不同的销售服务费率。其中,本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.10%/当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

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:本基金于本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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:本基金管理人于本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金份额。

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:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未持有本基金份额。

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 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年3月3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
中信银行	1,439,868.04	31,232.79	3,312,333.95	82,034.70

注:本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管,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:本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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:本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000566	海南海药	2017年11月22日	重大事项停牌	13.00	2018年7月9日	11.60	88,700	1,160,183.63	1,153,100.00	-
600221	海航控股	2018年1月10日	重大事项停牌	2.61	2018年7月20日	2.91	396,000	1,281,409.09	1,033,560.00	-
000793	华闻传媒	2018年2月1日	重大事项停牌	6.89	2018年7月16日	7.56	112,700	1,164,445.15	776,503.00	-

注:本基金截至2018年6月30日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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层次的余额,属于第二层次的余额为人民币3,963,263.00 元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次人民币118,331,560.68元,第二层次人民币80,134,146.49元,无属于第三层次的余额)。

(2) 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可转换债券等,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次,并根据估值调整中采用的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,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动(2017年:无)。

6.4.10.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.10.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.10.4财务报表的批准

本财务报表已于2018年8月27日经本基金的基金管理人批准。

§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	2,963,163.00	31.23
	其中:股票	2,963,163.00	31.23
2	固定收益投资	1,000,100.00	10.54
	其中:债券	1,000,100.00	10.54
	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	3,700,000.00	39.00
	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	1,545,894.85	16.29
7	其他各项资产	278,812.49	2.94
8	合计	9,487,970.34	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

金额单位:人民币元

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	-	-
C	制造业	1,153,100.00	12.23
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	1,033,560.00	10.97
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	-	-
K	房地产业	-	-
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	776,503.00	8.24
S	综合	-	-
	合计	2,963,163.00	31.44

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

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	000566	海南海药	88,700	1,153,100.00	12.23
2	600221	海航控股	396,000	1,033,560.00	10.97
3	000793	华闻传媒	112,700	776,503.00	8.24

注:本基金本报告期末仅持有上述三只股票。

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	601939	建设银行	8,333,223.30	4.14
2	600036	招商银行	5,923,730.00	2.94
3	600016	民生银行	4,729,240.00	2.35
4	601818	光大银行	4,683,944.00	2.33
5	601988	中国银行	4,594,719.00	2.28
6	601398	工商银行	4,368,798.00	2.17
7	601288	农业银行	2,909,685.00	1.44
8	603156	养元饮品	166,828.87	0.08
9	600901	江苏租赁	155,843.75	0.08
10	300741	华宝股份	101,325.00	0.05
11	601838	成都银行	89,465.01	0.04
12	002925	盈趣科技	68,670.00	0.03
13	601828	美凯龙	63,671.52	0.03
14	002929	润建通信	51,540.40	0.03
15	603680	今创集团	47,171.67	0.02
16	300740	御家汇	39,615.18	0.02
17	002928	华夏航空	33,849.60	0.02
18	300739	明阳电路	28,142.60	0.01
19	300733	西菱动力	21,839.70	0.01
20	603516	淳中科技	16,458.32	0.01

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	601939	建设银行	9,438,416.70	4.69
2	600016	民生银行	6,083,104.00	3.02
3	601398	工商银行	6,013,891.00	2.99
4	600036	招商银行	5,848,416.00	2.90
5	601288	农业银行	5,766,910.00	2.86
6	601818	光大银行	5,585,620.00	2.77
7	601988	中国银行	5,510,313.00	2.74
8	000732	泰禾集团	2,234,184.00	1.11
9	600048	保利地产	2,061,171.00	1.02
10	002450	康得新	1,769,722.00	0.88
11	000671	阳光城	1,766,298.00	0.88
12	601877	正泰电器	1,614,704.00	0.80
13	000513	丽珠集团	1,573,097.00	0.78
14	002142	宁波银行	1,561,311.00	0.78
15	600352	浙江龙盛	1,536,564.48	0.76
16	002252	上海莱士	1,515,213.00	0.75
17	601009	南京银行	1,506,939.20	0.75
18	002202	金风科技	1,499,810.00	0.74
19	600522	中天科技	1,425,295.00	0.71
20	600028	中国石化	1,422,687.00	0.71

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	36,454,614.69
卖出股票收入(成交)总额	151,939,988.88

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	1,000,100.00	10.61
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,000,100.00	10.61

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	019571	17国债17	10,000	1,000,100.00	10.61

注:本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

1、海南海药:1)2018年5月16日,当事人:海南海药、刘悉承、王伟、周庆国、任荣波、林健、张晖收到中国证券监督管理委员会海南监管局《中国证券监督管理委员会海南监管局行政处罚决定书》([2018]2号),对其未按规定披露对外担保和关联交易事项的违法行为,处罚如下:

一、对海南海药给予警告,并处以30万元罚款。二、对刘悉承、王伟给予警告,并分别处以10万元罚款。三、对周庆国给予警告,并处以5万元罚款。四、对任荣波、林健、张晖给予警告,并分别处以3万元罚款。

2)2018年5月15日,海南海药股份有限公司全资子公司海南海药投资有限公司及相关董事、高级管理人员张晖、林健、王伟、李昕昕、刘悉承收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(黑调查字[2018]15号、16号、17号、18号、19号、20号)。因海药投资涉嫌超比例持有"人民同泰"股票未及时公告、在限制期买卖"人民同泰"股票、短线交易"人民同泰"股票,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证券监督管理委员会决定对海药投资及相关董事、高级管理人员立案调查。

目前该公司生产经营正常,本次行政处罚不会对该公司的生产、经营造成重大影响。本基金认为:该处罚对于该公司整体经营业绩不构成重大影响。

2、华闻传媒:事件一:谢敏于2004年8月至调查日,在五矿证券有限公司(以下简称五矿证券)任职,为证券从业人员。2004年8月20日至2017年3月21日期间,谢敏借用其妻、子和兄"谢某英"、"谢某1"、"谢某2"等五个证券账户,通过营业部热键委托、网上交易委托等方式交易"北大荒"、"华闻传媒"、"珠海中富"等多只股票。经查,上述账户一是存在同一日期同一时段委托网上交易下单的电脑IP和MAC地址完全相同的情况,且存在同一时段同向交易同只股票的情况。二是我局在五矿证券谢敏办公室检查发现的其个人苹果笔记本电脑MAC地址与上述相关账户网上交易下单电脑MAC地址一致;"谢某2"账户委托交易记录中使用该笔记本电脑的信息与谢敏出行信息高度一致。三是"谢某2"账户部分交易委托IP地址为谢敏所在办公场所访问互联网使用的固定IP。四是"谢某英"、"谢某1"、"谢某2"账户资金主要来源于当事人和谢某英,部分资金来源于当事人兄、弟,账户资金系谢敏可以控制的资金。综合委托下单交易流水、交易下单地址、出差记录证明、账户资金来源和去向等在案证据,足以认定谢敏借他人名义买卖股票。上述事实,有任职情况说明、相关证券账户资料、证券交易记录、银行账户流水、下单电脑截屏和询问笔录等证据证明,足以认定。谢敏上述行为违反了《证券法》第四十三条"证券交易所、证券公司和证券登记结算机构的从业人员、证券监督管理机构的工作人员以及法律、行政法规禁止参与股票交易的其他人员,在任期或者法定限期内,不得直接或者以化名、借他人名义持有、买卖股票,也不得收受他人赠送的股票"的规定,构成了《证券法》第一百九十九条所述违法行为。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,依据《证券法》第一百九十九条的规定,我局决定:责令谢敏依法处理非法持有的股票,没收谢敏违法所得135,862.22元,并处以30万元罚款,罚没款共计435,862.22元。

华闻传媒作为上市公司主体在该事件中不存在违法违规行为,并未受到处罚。

事件二:2017年12月7日,国广资产通过永盈1号增持公司股份2,170,600股,占公司已发行股份的0.11%,交易金额21,887,094.07元;在实施增持公司股份操作时,由于工作人员操作失误,将两笔"买入"指令误操作成"卖出",合计错误卖出公司股份10,000股,且未及时发现上述错误卖出股份的情况,并在当日交易时间内继续操作买入交易,直至当天操作完成后查看交易记录时,发现两笔误操作:两笔均卖出公司股份5,000 股,卖出均价10.0155 元/股,合计卖出公司股份10,000股(占公司已发行股份的0.0005%),合计成交金额100,155 元。根据《证券法》第四十七条规定"上市公司董事、监事、高级管理人员、持有上市公司股份百分之五以上的股东,将其持有的该公司的股票在买入后六个月内卖出,或者在卖出后六个月内又买入,由此所得收益归该公司所有,公司董事会应当收回其所得收益。"国广资产于2017年12月7日卖出公司股票的行为构成了短线交易,所得收益应由公司收回。

经公司自查,国广资产的上述交易行为未发生在公司披露定期报告的敏感期内,不存在因获悉内幕信息而交易公司股票的情况,亦不存在利用短线交易谋求利益的目的。公司及国广资产针对本次误操作的补救措施如下:

(一)上述操作失误导致国广资产违规卖出公司股票的短线交易所得收益1,155.00元[10,000股*(卖出均价10.0155元/股-买入最低价9.90元/股)= 1,155.00元],将尽快收归公司所有。

(二)国广资产承诺:在法定期限内不减持所持华闻传媒股份。

(三)公司董事会及控股股东国广资产已深刻认识到了本次违规事件给公司和市场带来不良影响,就本次短线交易行为向广大投资者致以诚挚的歉意,并同时承诺将自觉遵守《证券法》的规定。

(四)公司董事会再次向所有持有公司股份5%以上股东、董事、监事及高级管理人员提醒告知了《证券法》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《上市公司董事、监事和高级管理人员所持本公司股份及其变动管理规则》等文件的相关规定,要求公司持股5%以上股东、董事、监事和高级管理人员严格规范增持、减持公司股票的行为,谨慎操作,切实管理好自己名下的股票账户,避免此类情况的再次出现。

事件三:依据《中华人民共和国证券法》(以下简称《证券法》)的有关规定,我会对万玉珍、万明内幕交易行为进行了立案调查、审理,并依法向当事人告知了作出行政处罚的事实、理由、依据及当事人依法享有的权利,本案现已调查、审理终结。根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,依据《证券法》第二百零二条的规定,我会决定:一、没收万玉珍违法所得66,632.00元,并处以199,896.00元罚款。二、没收万明违法所得13,588,506.26元,并处以40,765,518.78元罚款。

基于相关研究,本基金认为,事件一中公司不存在违法违规行为,未受到处罚,事件二中公司通过自查作出了补救措施,事件三中处罚系对违法违规人员的个人处罚,对于公司整体经营业绩不构成重大影响。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。

除上述事项外,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,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2

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。

7.12.3 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	46,400.96
2	应收证券清算款	202,370.07
3	应收股利	-
4	应收利息	29,991.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	50.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	278,812.49

7.12.4 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的可转换债券(可交换债券)。

7.12.5 期末前十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	000566	海南海药	1,153,100.00	12.23	重大事项停牌
2	600221	海航控股	1,033,560.00	10.97	重大事项停牌
3	000793	华闻传媒	776,503.00	8.24	重大事项停牌

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	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 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
长盛盛德混合A	7	1,428,632.29	10,000,000.00	100.00%	426.04	0.00%
长盛盛德混合C	70	102.71	0.00	0.00%	7,189.42	100.00%
合计	77	129,969.03	10,000,000.00	99.92%	7,615.46	0.08%

注:对于分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对于合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长盛盛德混合A	203.36	0.0020%
	长盛盛德混合C	898.69	12.5002%
	合计	1,102.05	0.0110%

注:对于分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对于合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.3 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	份额级别	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	长盛盛德混合A	0
	长盛盛德混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛盛德混合A	0
	长盛盛德混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长盛盛德混合A	长盛盛德混合C
基金合同生效日(2017年3月3日)基金份额总额	600,024,000.00	22,750.02
本报告期期初基金份额总额	200,021,281.04	19,836.95
本报告期基金总申购份额	24,294.34	2,228.05
减:本报告期基金总赎回份额	190,045,149.34	14,875.58
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,000,426.04	7,189.42

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金于2018年6月13日发布《关于以通讯开会方式召开长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》,本次基金份额持有人大会的审议事项为《关于终止长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,投票期为:2018年6月15日至2018年7月22日。截至本报告期末尚未计票产生基金份额持有人大会决议。

10.2 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

10.2.1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。

10.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期,无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 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安永华明会计师事务所(特殊普通合伙),本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 成交金额	股票交易 占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	应支付该券商的佣金 占当期佣金总量的比例	备注
东吴证券	2	187,483,328.18	100.00%	137,110.52	100.00%	-

10.7.2 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 成交金额	债券交易 占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	债券回购交易 占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	权证交易 占当期权证成交总额的比例
东吴证券	4,633,240.10	100.00%	706,800,000.00	100.00%	-	-

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、本基金租用证券公司深圳交易单元为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:无。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180101~20180415,20180417~20180630	100,012,500.00	0.00	94,012,500.00	6,000,000.00	59.95%
	2	20180101~20180630	100,008,000.00	0.00	96,008,000.00	4,000,000.00	39.97%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况,当该基金份额持有人大量赎回本基金时,可能导致的风险包括:巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于5000万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对,保护中小投资者利益。							

11.2 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

2018年8月29日