

长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：包商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人包商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长盛盛世混合	
基金主代码	002156	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 12 月 11 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	包商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	565,949,334.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C
下属分级基金的交易代码:	002156	002157
报告期末下属分级基金的份额总额	8,014,592.60 份	557,934,741.57 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满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	<p>(一) 大类资产配置</p> <p>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。本基金将通过深入分析上述指标与因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>1. 行业配置策略</p> <p>本基金通过对国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展的根本性因素进行分析，对处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置。</p> <p>2. 个股配置策略</p> <p>在行业配置的基础上，本基金将通过定量与定性相结合的评估方法，对上市公司的增长前景进行分析，力争所选择的企业具备长期竞争优势。</p> <p>3. 动态调整和组合优化策略</p> <p>本基金管理将根据经济发展状况、产业结构升级、技术发展状况及国家相关政策因素对配置的行业和上市公司进行动态调整。此外，基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对投资组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化。</p>
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	包商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松
	联系电话	010-82019988
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666、010-62350088	95352
传真	010-82255988	0755-33352053
注册地址	深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	包头市青山区钢铁大街 6 号
办公地址	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	深圳市福田区金田路 3038 号现代国际大厦 2805 室
邮政编码	100088	518000
法定代表人	周兵	李镇西

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《证券时报》
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住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层

§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	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	175,412.22	11,227,677.26
本期利润	443,419.10	29,686,149.25
加权平均基金份额本期利润	0.0492	0.0423
本期加权平均净值利润率	4.50%	4.07%
本期基金份额净值增长率	4.67%	4.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	649,513.01	15,045,845.32
期末可供分配基金份额利润	0.0810	0.0270
期末基金资产净值	8,984,805.67	594,378,021.57
期末基金份额净值	1.121	1.065
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	12.10%	6.50%

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

长盛盛世混合 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	1.72%	0.16%	3.01%	0.34%	-1.29%	-0.18%
过去三个月	2.37%	0.14%	3.16%	0.32%	-0.79%	-0.18%
过去六个月	4.67%	0.12%	5.36%	0.29%	-0.69%	-0.17%
过去一年	11.21%	0.30%	8.32%	0.35%	2.89%	-0.05%
自基金合同	12.10%	0.25%	2.90%	0.61%	9.20%	-0.36%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

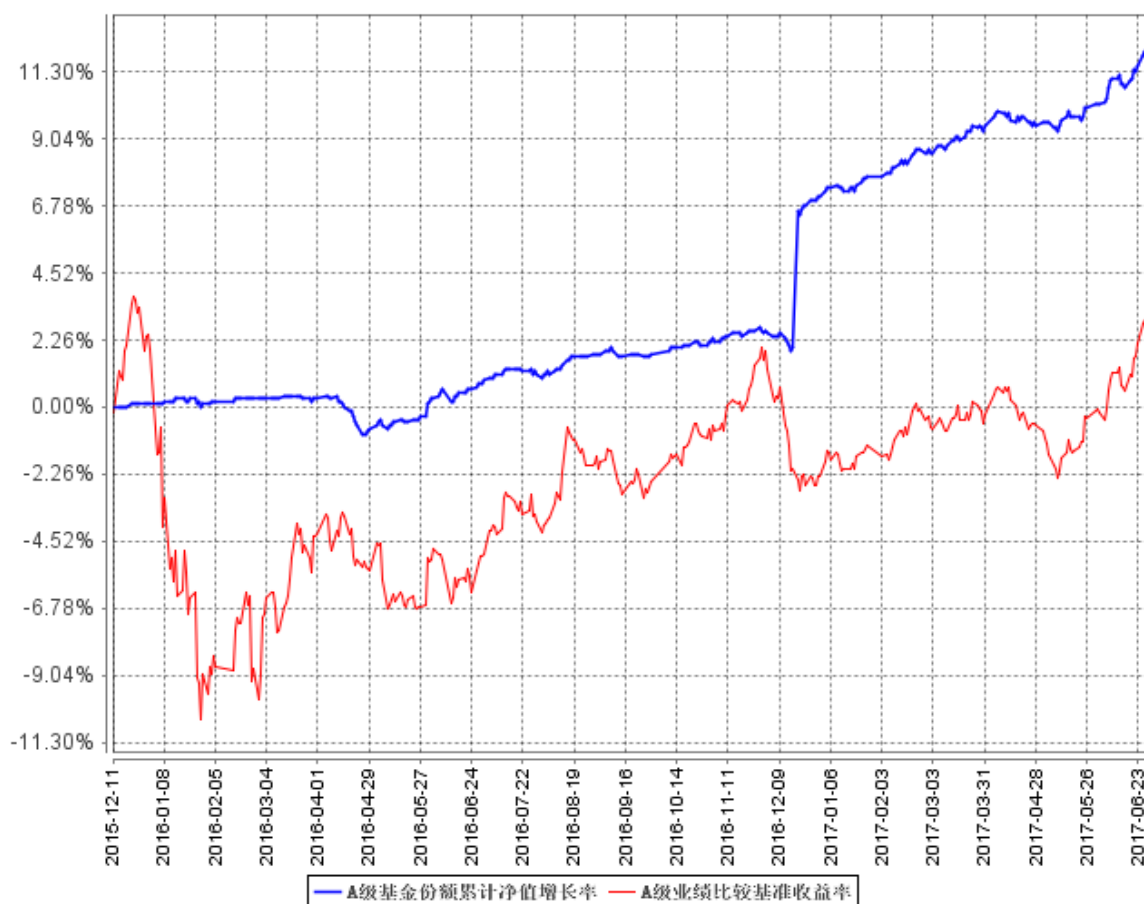
长盛盛世混合 C

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	1.62%	0.13%	3.01%	0.34%	-1.39%	-0.21%
过去三个月	2.31%	0.13%	3.16%	0.32%	-0.85%	-0.19%
过去六个月	4.41%	0.11%	5.36%	0.29%	-0.95%	-0.18%
过去一年	5.86%	0.10%	8.32%	0.35%	-2.46%	-0.25%
自基金合同生效起至今	6.50%	0.09%	2.90%	0.61%	3.60%	-0.52%

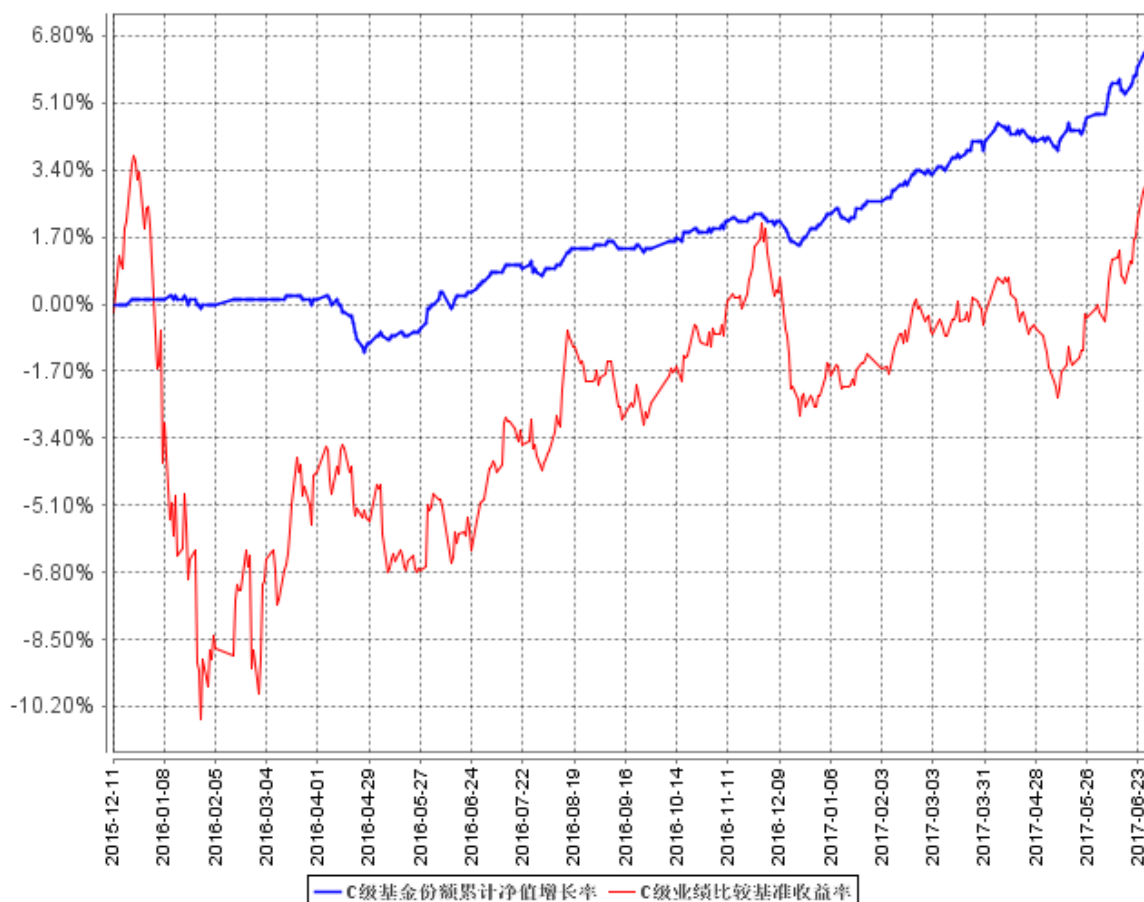
注：由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 50%、50%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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第十二部分“二、投资范围”和“四、投资限制”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、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）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和特定客户资产管理业务资格。截至2017年6月30日，基金管理人共管理七十二只开放式基金，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，长盛双月红1年期定期开放债券型投资基金基金经理，长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛琪一年期定期开放债券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。	2016年9月12日	-	11年	李琪先生，1975年2月出生。天津大学管理学博士。历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，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。
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，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，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，	2016年9月12日	-	9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。

	长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 长盛积极配置债券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, 量化投资部负责人。				
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, 长盛盛德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。	2015 年 12月 11日	2017 年 2月 28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，新一轮库存周期对经济基本面形成支撑，生产平稳，外需改善，宏观经济总体平稳；通胀方面，食品价格稳中有落，中上游价格走弱带动 PPI 高位回落，通胀预期回落；受汇率、资产价格以及金融监管去杠杆等因素制约，货币政策更趋于稳健，央行两次上调公开市场操作利率，资金面总体呈现中性偏紧局面。

1 月至 5 月初，债券市场延续了去年四季度以来的调整走势，收益率曲线整体上行，10 年期国债一度上行至 4.38% 的近期高点；5 月中旬以来，经济下行压力逐步显现，叠加汇率压力减弱、金融去杠杆节奏放缓、央行释放稳定流动性预期信号等因素，市场预期修复，现券利率有所下行，债券收益率曲线平坦化下移。

上半年，A 股市场总体呈现震荡走势，上证综指上涨 2.86%，沪深 300 指数上涨 10.78%，创业板指下跌 7.349%。一季度，经济延续改善和企业盈利持续好转，推动 A 股市场走出慢牛行情；4 月初至 5 月上旬，受金融监管去杠杆、央行上调逆回购利率等因素影响，股市呈现下跌走势；5 月中下旬以来，随着金融去杠杆节奏放缓，央行释放稳定流动性信号，叠加新股发行、股东减持等新规的出台，市场走出一波反弹行情。从市场结构来看，行情分化明显，白马股、消费股、绩优蓝筹股显著跑赢市场，而估值较高的成长股则表现较弱。

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，在信用风险可控的前提下重点配置高信用评级的中短期信用债，保持组合流动性和安全性，适度参与利率品种的投资机会，通过不同期限品种逆回购等货币类工具的组合操作，提升资金使用效率和灵活性。权益资产方面，根据市场行情变化，灵活调整权益资产比重，以避免净值大幅波动和回撤。此外，本基金紧密跟踪新股发行，积极准备新股网下申购底仓配置，通过参与新股申购，以提升组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛世混合 A 基金份额净值为 1.121 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.67%；截至本报告期末长盛盛世混合 C 基金份额净值为 1.065 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.41%；同期业绩比较基准收益率为 5.36%。

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，随着供给侧改革价格效应消退、补库存周期结束，叠加房地产投资增速见顶回落和地方政府融资监管趋严等因素影响，经济下行压力渐显。受资产价格、金融去杠杆及汇率等因素制约，货币政策将维持稳健中性，预计资金面将呈现中性偏紧局面。

在海内外经济和政策等多重因素影响下，预计债市波动将加大。投资操作上需重视信用债的票息价值，同时谨慎把握经济基本面再次转弱、流动性边际放松、人民币贬值压力暂缓等带来的利率债交易性机会。

股票市场方面，对中长期经济前景的隐忧使得市场风险偏好难以显著回升，股市存量资金博弈局面难改，但随着经济结构转型及供给侧改革的推进，未来市场将孕育出一些结构性机会。比如，二线蓝筹股、低估值高分红的金融板块以及改革深化、供给侧改革、消费升级等主题机会。

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《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分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 2017 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 15,695,358.33 元，其中：长盛盛世混合 A 期末可供分配利润为 649,513.01 元（未分配利润已实现部分为 649,513.01 元，未分配利润未实现部分为 320,700.06 元），长盛盛世混合 C 期末可供分配利润为 15,045,845.32 元（未分配利润已实现部分为 15,045,845.32 元，未分配利润未实现部分为 21,397,434.68 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，包商银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长盛盛世灵活配置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。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由长盛基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、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）、投资组合报告等内容真实、准确、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：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	76,714,357.54	5,180,269.52
结算备付金		400,000.00	4,041,192.57
存出保证金		77,700.45	48,792.40
交易性金融资产	6.4.7.2	484,949,755.66	681,941,687.83
其中：股票投资		132,756,448.20	90,719,899.31
基金投资		-	-
债券投资		352,193,307.46	591,221,788.52
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	79,946,134.97	85,000,647.50
应收证券清算款		77,436.26	-
应收利息	6.4.7.5	6,630,659.45	5,970,672.74
应收股利		-	-
应收申购款		499.25	80,711.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		648,796,543.58	782,263,974.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		44,781,251.14	120.00
应付赎回款		7,806.69	7,641.86
应付管理人报酬		305,378.30	381,315.52
应付托管费		101,792.76	127,105.19
应付销售服务费		100,313.39	115,251.76
应付交易费用	6.4.7.7	9,224.65	38,689.51
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	127,949.41	60,000.00
负债合计		45,433,716.34	730,123.84
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	565,949,334.17	765,522,553.32
未分配利润	6.4.7.10	37,413,493.07	16,011,297.04
所有者权益合计		603,362,827.24	781,533,850.36
负债和所有者权益总计		648,796,543.58	782,263,974.20

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额 565,949,334.17 份，其中长盛盛世混合 A 类份额 8,014,592.60 份，份额净值 1.121 元，长盛盛世混合 C 类份额 557,934,741.57 份，份额净值 1.065 元。

6.2 利润表

会计主体：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		34,030,380.42	1,601,362.82
1.利息收入		8,922,953.09	3,951,478.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	101,942.93	333,553.19
债券利息收入		8,218,566.12	2,680,064.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		602,444.04	937,860.49
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,367,506.48	-5,289,390.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,255,968.57	-165,298.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-151,574.95	-5,448,156.17
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,263,112.86	324,065.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	18,726,478.87	2,927,618.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	13,441.98	11,656.23
减：二、费用		3,900,812.07	1,636,071.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,203,954.19	901,225.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	734,651.39	300,408.70
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	724,862.64	289,566.16
4. 交易费用	6.4.7.19	55,965.64	61,279.38
5. 利息支出		34,812.55	3,073.97
其中：卖出回购金融资产支出		34,812.55	3,073.97
6. 其他费用	6.4.7.20	146,565.66	80,517.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,129,568.35	-34,708.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,129,568.35	-34,708.37

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 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）	765,522,553.32	16,011,297.04	781,533,850.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,129,568.35	30,129,568.35
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）	-199,573,219.15	-8,727,372.32	-208,300,591.47
其中：1.基金申购款	2,571,694.16	175,997.71	2,747,691.87
2.基金赎回款	-202,144,913.31	-8,903,370.03	-211,048,283.34
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)	565,949,334.17	37,413,493.07	603,362,827.24
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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)	382,216,462.07	394,446.00	382,610,908.07
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	-34,708.37	-34,708.37
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)	-13,978,880.28	1,706,797.80	-12,272,082.48
其中：1.基金申购款	684,707,463.73	567,477.07	685,274,940.80
2.基金赎回款	-698,686,344.01	1,139,320.73	-697,547,023.28
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)	368,237,581.79	2,066,535.43	370,304,117.22

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

长盛盛世灵活配置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[2015]1989 号《关于准予长盛盛世灵活配置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《长盛盛世灵活配置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基金, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 382,205,154.00 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(2015)第 1347 号验资报告予以验证。经向中

中国证监会备案，《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 12 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 382,216,462.07 份基金份额，其中认购资金利息折合 11,308.07 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，基金托管人为包商银行股份有限公司。

根据《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从该类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，各类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛世灵活配置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)、股指期货、权证、债券、货币市场工具、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)。本基金投资组合中股票等权益类资产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比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，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：50% X 沪深 300 指数收益率 + 50% X 中证综合债指数收益率。

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》、《长盛盛世灵活配置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。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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 重要会计政策和会计估计

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[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》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	76,714,357.54
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
定期存款：存款期限 1 个月以内	-
其他存款	-
合计：	76,714,357.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	114,691,191.54	132,756,448.20	18,065,256.66
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	22,368,170.42	21,484,307.46
	银行间市场	329,751,874.11	330,709,000.00
	合计	352,120,044.53	352,193,307.46
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	466,811,236.07	484,949,755.66	18,138,519.59

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
----	------------------------

	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	50,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	29,946,134.97	-
合计	79,946,134.97	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	2,808.99
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	162.00
应收债券利息	6,626,473.59
应收买入返售证券利息	1,183.46
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	31.41
合计	6,630,659.45

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,177.45
银行间市场应付交易费用	6,047.20
合计	9,224.65

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7.75
预提费用	127,941.66

合计	127,949.41
----	------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛世混合 A		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,384,696.51	9,384,696.51
本期申购	1,915,983.43	1,915,983.43
本期赎回(以“-”号填列)	-3,286,087.34	-3,286,087.34
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	8,014,592.60	8,014,592.60

金额单位：人民币元

长盛盛世混合 C		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	756,137,856.81	756,137,856.81
本期申购	655,710.73	655,710.73
本期赎回(以“-”号填列)	-198,858,825.97	-198,858,825.97
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	557,934,741.57	557,934,741.57

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长盛盛世混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	577,143.66	91,848.14	668,991.80
本期利润	175,412.22	268,006.88	443,419.10
本期基金份额交易产生的变动数	-103,042.87	-39,154.96	-142,197.83
其中：基金申购款	124,813.03	26,798.76	151,611.79
基金赎回款	-227,855.90	-65,953.72	-293,809.62

本期已分配利润	-	-	-
本期末	649,513.01	320,700.06	970,213.07

单位：人民币元

长盛盛世混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,072,817.90	7,269,487.34	15,342,305.24
本期利润	11,227,677.26	18,458,471.99	29,686,149.25
本期基金份额交易产生的变动数	-4,254,649.84	-4,330,524.65	-8,585,174.49
其中：基金申购款	11,262.88	13,123.04	24,385.92
基金赎回款	-4,265,912.72	-4,343,647.69	-8,609,560.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,045,845.32	21,397,434.68	36,443,280.00

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	85,356.22
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	15,971.68
其他	615.03
合计	101,942.93

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	13,110,405.97
减：卖出股票成本总额	7,854,437.40
买卖股票差价收入	5,255,968.57

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债	-151,574.95

券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-151,574.95

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	651,238,150.41
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	640,532,906.19
减：应收利息总额	10,856,819.17
买卖债券差价收入	-151,574.95

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期末持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,263,112.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,263,112.86

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	18,726,478.87
——股票投资	16,198,677.59
——债券投资	2,527,801.28
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
合计	18,726,478.87

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	12,821.01
转换费收入	620.97
合计	13,441.98

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	49,940.64
银行间市场交易费用	6,025.00
合计	55,965.64

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	38,679.70
信息披露费	89,261.96
银行划款费用	24.00
债券账户维护费	18,300.00
其他	300.00
合计	146,565.66

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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(“长盛基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
包商银行股份有限公司(“包商银行”)	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金未开通关联方交易单元。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,203,954.19	901,225.92
其中：支付销售机构的客户维护费	6,513.76	18,111.77

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 0.6% 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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.6%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	734,651.39	300,408.70

注：支付基金托管人包商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C	合计
长盛基金公司	-	721,495.12	721,495.12
包商银行	-	3,002.51	3,002.51
合计	-	724,497.63	724,497.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C	合计
长盛基金公司	-	267,632.93	267,632.93
包商银行	-	14,958.99	14,958.99
合计	-	282,591.92	282,591.92

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给长盛基金公司，再由长盛基金公司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 C 类基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人于本报告期及上年度可比期间内均未运用自有资金投资本基金份额。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
包商银行	76,714,357.54	85,356.22	2,519,187.49	110,950.45

注：本基金的银行存款由基金托管人包商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
--------	------	-----------------	----------------	--------	------	------	-----	----------	----------	---

注：基金可使用以基金名义开设股票账户，选择网下或者网上一种方式进行新股申购。从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 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
000700	模塑科技	2017 年 6 月 28 日	重大事项停牌	8.09	2017 年 8 月 16 日	8.00	247,400	2,344,774.00	2,001,466.00	-
601313	江南嘉捷	2017 年 6 月 12 日	重大事项停牌	8.79	-	-	184,300	2,221,635.55	1,619,997.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会风险控制管理委员会、督察长、公司风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以

及风险控制措施；第二道监控防线由公司监察稽核部和风险管理部构成，监察稽核部负责对公司业务的法律合规风险和运作风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险控制委员会构成，公司管理层通过风险控制委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，在公司督察长的指导下，监察稽核部和风险管理部对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门总监、风险控制委员会、公司总经理、风险控制管理委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会及其下设风险控制管理委员会构成，风险控制管理委员会通过督察长、监察稽核部和风险管理部的工作，掌握整体风险状况并进行决策。风险控制管理委员会负责审查公司风险控制体系及其有效性、公司内控制度的实施情况。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	180,450,000.00	168,891,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	130,259,000.00	372,338,000.00
合计	310,709,000.00	541,229,000.00

注：未评级债券为短期融资券、政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	18,041,330.00	18,461,662.90
AAA 以下	3,442,977.46	11,501,125.62
未评级	20,000,000.00	20,030,000.00
合计	41,484,307.46	49,992,788.52

注：未评级债券为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	76,714,357.54	-	-	-	76,714,357.54
结算备付金	400,000.00	-	-	-	400,000.00
存出保证金	77,700.45	-	-	-	77,700.45
交易性金融资产	334,151,977.46	18,041,330.00	-	132,756,448.20	484,949,755.66
买入返售金融资产	79,946,134.97	-	-	-	79,946,134.97
应收证券清算款	-	-	-	77,436.26	77,436.26
应收利息	-	-	-	6,630,659.45	6,630,659.45
应收申购款	-	-	-	499.25	499.25
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	491,290,170.42	18,041,330.00	-	139,465,043.16	648,796,543.58
负债					
应付证券清算款	-	-	-	44,781,251.14	44,781,251.14
应付赎回款	-	-	-	7,806.69	7,806.69
应付管理人报酬	-	-	-	305,378.30	305,378.30
应付托管费	-	-	-	101,792.76	101,792.76
应付销售服务费	-	-	-	100,313.39	100,313.39
应付交易费用	-	-	-	9,224.65	9,224.65
其他负债	-	-	-	127,949.41	127,949.41
负债总计	-	-	-	45,433,716.34	45,433,716.34
利率敏感度缺口	491,290,170.42	18,041,330.00	-	94,031,326.82	603,362,827.24
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,180,269.52	-	-	-	5,180,269.52
结算备付金	4,041,192.57	-	-	-	4,041,192.57
存出保证金	48,792.40	-	-	-	48,792.40
交易性金融资产	564,388,742.90	26,635,540.62	197,505.00	90,719,899.31	681,941,687.83
买入返售金融资产	85,000,647.50	-	-	-	85,000,647.50
应收利息	-	-	-	5,970,672.74	5,970,672.74
应收申购款	99.85	-	-	80,611.79	80,711.64
资产总计	658,659,744.74	26,635,540.62	197,505.00	96,771,183.84	782,263,974.20
负债					

应付证券清算款	-	-	-	120.00	120.00
应付赎回款	-	-	-	7,641.86	7,641.86
应付管理人报酬	-	-	-	381,315.52	381,315.52
应付托管费	-	-	-	127,105.19	127,105.19
应付销售服务费	-	-	-	115,251.76	115,251.76
应付交易费用	-	-	-	38,689.51	38,689.51
其他负债	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	-	-	-	730,123.84	730,123.84
利率敏感度缺口	658,659,744.74	26,635,540.62	197,505.00	96,041,060.00	781,533,850.36

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	下降25个基点	207,993.03	764,449.77
	上升25个基点	-207,993.03	-764,449.77

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。于2017年6月30日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例(%)
交易性金融资产-股票投资	132,756,448.20	22.00	90,719,899.31	11.61
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	132,756,448.20	22.00	90,719,899.31	11.61
----	----------------	-------	---------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	9,805,073.73	-
2. 业绩比较基准下降 5%	-9,805,073.73	-	

注：于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 11.61%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 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 2017 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 129,011,302.10 元，属于第二层次的余额为 355,938,453.56 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 87,453,459.70 元，第二层次 594,488,228.13 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 2017 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（2016 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	132,756,448.20	20.46
	其中：股票	132,756,448.20	20.46
2	固定收益投资	352,193,307.46	54.28
	其中：债券	352,193,307.46	54.28
	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	79,946,134.97	12.32
	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	77,114,357.54	11.89
7	其他各项资产	6,786,295.41	1.05
8	合计	648,796,543.58	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	1,186,000.00	0.20
C	制造业	70,478,787.48	11.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,208,600.00	1.03
E	建筑业	7,884,810.24	1.31
F	批发和零售业	4,413,360.00	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	3,575,333.00	0.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,776,445.50	0.63
J	金融业	27,438,171.98	4.55
K	房地产业	5,146,840.00	0.85
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	751,800.00	0.12
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,896,300.00	0.31
	合计	132,756,448.20	22.00

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沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601988	中国银行	1,362,800	5,042,360.00	0.84
2	601398	工商银行	931,900	4,892,475.00	0.81
3	600690	青岛海尔	297,700	4,480,385.00	0.74
4	000963	华东医药	88,800	4,413,360.00	0.73
5	600741	华域汽车	181,900	4,409,256.00	0.73
6	600886	国投电力	500,000	3,950,000.00	0.65
7	600036	招商银行	162,433	3,883,773.03	0.64
8	002035	华帝股份	159,147	3,851,357.40	0.64
9	002372	伟星新材	202,644	3,785,389.92	0.63
10	000651	格力电器	90,000	3,705,300.00	0.61
11	000001	平安银行	391,240	3,673,743.60	0.61
12	601939	建设银行	596,000	3,665,400.00	0.61
13	300258	精锻科技	212,129	3,502,249.79	0.58
14	002543	万和电气	140,340	3,448,153.80	0.57
15	601231	环旭电子	218,800	3,437,348.00	0.57
16	002508	老板电器	78,000	3,391,440.00	0.56
17	002241	歌尔股份	167,084	3,221,379.52	0.53
18	002376	新北洋	222,324	3,050,285.28	0.51
19	600015	华夏银行	314,160	2,896,555.20	0.48
20	002056	横店东磁	386,000	2,895,000.00	0.48
21	002410	广联达	152,083	2,859,160.40	0.47
22	000926	福星股份	217,200	2,649,840.00	0.44
23	601006	大秦铁路	314,700	2,640,333.00	0.44
24	000333	美的集团	60,000	2,582,400.00	0.43
25	000002	万科A	100,000	2,497,000.00	0.41
26	002367	康力电梯	205,748	2,403,136.64	0.40
27	601186	中国铁建	191,800	2,307,354.00	0.38

28	601800	中国交建	144,800	2,300,872.00	0.38
29	601390	中国中铁	261,800	2,269,806.00	0.38
30	600674	川投能源	230,000	2,258,600.00	0.37
31	600000	浦发银行	174,851	2,211,865.15	0.37
32	601766	中国中车	217,100	2,197,052.00	0.36
33	000700	模塑科技	247,400	2,001,466.00	0.33
34	002309	中利集团	154,558	1,933,520.58	0.32
35	600805	悦达投资	258,000	1,896,300.00	0.31
36	601313	江南嘉捷	184,300	1,619,997.00	0.27
37	002078	太阳纸业	199,000	1,462,650.00	0.24
38	002454	松芝股份	113,975	1,436,085.00	0.24
39	600081	东风科技	110,228	1,372,338.60	0.23
40	601633	长城汽车	100,000	1,329,000.00	0.22
41	600487	亨通光电	43,600	1,222,980.00	0.20
42	600028	中国石化	200,000	1,186,000.00	0.20
43	600109	国金证券	100,000	1,172,000.00	0.19
44	002396	星网锐捷	57,900	1,120,365.00	0.19
45	603660	苏州科达	26,007	1,064,986.65	0.18
46	000729	燕京啤酒	149,921	1,007,469.12	0.17
47	600978	宜华生活	100,000	1,005,000.00	0.17
48	300303	聚飞光电	227,880	986,720.40	0.16
49	601668	中国建筑	100,000	968,000.00	0.16
50	000089	深圳机场	100,000	935,000.00	0.15
51	300150	世纪瑞尔	120,006	909,645.48	0.15
52	300265	通光线缆	70,000	889,000.00	0.15
53	002581	未名医药	40,000	818,000.00	0.14
54	603377	东方时尚	20,000	751,800.00	0.12
55	600499	科达洁能	58,200	462,108.00	0.08
56	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
57	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
58	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.01
59	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
60	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
61	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
62	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
63	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
64	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
65	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
66	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00

67	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
68	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
69	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
70	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
71	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
72	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
73	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
74	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
75	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	600886	国投电力	3,744,985.00	0.48
2	002508	老板电器	2,276,385.64	0.29
3	000651	格力电器	2,252,300.00	0.29
4	000002	万科A	2,172,140.00	0.28
5	600674	川投能源	2,095,701.00	0.27
6	002078	太阳纸业	1,406,940.00	0.18
7	002376	新北洋	1,380,029.00	0.18
8	601633	长城汽车	1,266,647.00	0.16
9	600028	中国石化	1,190,000.00	0.15
10	600978	宜华生活	1,186,982.00	0.15
11	600109	国金证券	1,182,063.00	0.15
12	300265	通光线缆	1,098,606.01	0.14
13	000729	燕京啤酒	1,072,600.15	0.14
14	002410	广联达	1,019,888.00	0.13
15	002581	未名医药	966,141.00	0.12
16	601668	中国建筑	886,030.59	0.11
17	000700	模塑科技	840,004.00	0.11
18	000089	深圳机场	827,521.99	0.11
19	603377	东方时尚	827,077.00	0.11
20	000926	福星股份	752,886.00	0.10

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	2,945,000.00	0.38
2	002651	利君股份	2,837,901.00	0.36
3	600858	银座股份	489,826.00	0.06
4	600081	东风科技	423,603.96	0.05
5	603986	兆易创新	258,092.00	0.03
6	601375	中原证券	238,653.30	0.03
7	300625	三雄极光	227,826.20	0.03
8	601878	浙商证券	190,263.78	0.02
9	601952	苏垦农发	177,850.50	0.02
10	002867	周大生	144,144.40	0.02
11	603877	太平鸟	125,677.60	0.02
12	300623	捷捷微电	116,186.75	0.01
13	603630	拉芳家化	113,334.95	0.01
14	603626	科森科技	108,445.88	0.01
15	603298	杭叉集团	106,972.58	0.01
16	002851	麦格米特	104,890.12	0.01
17	002841	和胜股份	104,462.40	0.01
18	002859	洁美科技	101,517.58	0.01
19	603980	吉华集团	96,158.12	0.01
20	603113	金能科技	95,486.90	0.01

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	33,692,308.70
卖出股票收入（成交）总额	13,110,405.97

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,986,000.00	6.63
	其中：政策性金融债	39,986,000.00	6.63
4	企业债券	21,484,307.46	3.56

5	企业短期融资券	290,723,000.00	48.18
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	352,193,307.46	58.37

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	041654053	16 沪城建 CP001	400,000	40,088,000.00	6.64
2	041653047	16 广新控股 CP002	300,000	30,132,000.00	4.99
3	011698846	16 首农 SCP003	300,000	30,081,000.00	4.99
4	011698826	16 中金黄金 SCP003	300,000	30,072,000.00	4.98
5	041660055	16 闽漳龙 SCP001	300,000	30,042,000.00	4.98

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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投资。

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

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	77,700.45
2	应收证券清算款	77,436.26
3	应收股利	-
4	应收利息	6,630,659.45
5	应收申购款	499.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,786,295.41

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可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长盛盛世混合 A	268	29,905.20	0.00	0.00%	8,014,592.60	100.00%
长盛盛世混合 C	236	2,364,130.26	554,848,762.56	99.45%	3,085,979.01	0.55%
合计	504	1,122,915.35	554,848,762.56	98.04%	11,100,571.61	1.96%

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	长盛盛世混合 A	0.00	0.0000%
	长盛盛世混合 C	98.61	0.0000%
	合计	98.61	0.0000%

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	长盛盛世混合 A	0
	长盛盛世混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛盛世混合 A	0
	长盛盛世混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C
基金合同生效日（2015 年 12 月 11 日）基金份额总额	13,184,407.64	369,032,054.43
本报告期期初基金份额总额	9,384,696.51	756,137,856.81
本报告期基金总申购份额	1,915,983.43	655,710.73
减：本报告期基金总赎回份额	3,286,087.34	198,858,825.97
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	8,014,592.60	557,934,741.57

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

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

由于任期届满，高新不再担任公司董事长，周放生不再担任公司独立董事。根据公司 2016 年度股东会议决议，选举林培富为公司董事，选举张良庆为公司独立董事；根据公司第七届董事会第一次会议决议，选举周兵担任公司董事长；根据公司第七届董事会第二次会议决议，聘任林培富担任公司总经理，周兵不再担任公司总经理，同时林培富不再担任公司副总经理。以上公司高级管理人员变更，已于 2017 年 3 月 30 日向中国证监会北京监管局报备。

10.2.2 基金经理变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2017 年 2 月 28 日起，杨衡同志不再担任长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动情况。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、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

报告期内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普华永道中天会计师事务所（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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	2	44,749,784.02	100.00%	32,725.78	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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东兴证券	17,367,688.91	100.00%	1,770,200,000.00	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，并能为本公司基金提供全面的信息服。

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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.8 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司旗下部分基金增加基煜销售并开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》及本公司网站	2017年6月29日
2	长盛基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》和《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	同上	2017年4月27日
3	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	同上	2017年4月22日
4	长盛基金管理有限公司高级管理人员董事长变更的公告	同上	2017年3月28日
5	长盛基金管理有限公司高级管理人员副总经理变更的公告	同上	2017年3月28日
6	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	同上	2017年3月28日
7	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金 2016 年度报告	同上	2017年3月27日
8	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金 2016 年度报告摘要	同上	2017年3月27日
9	长盛基金管理有限公司关于增加肯特瑞财富为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2017年3月24日
10	长盛基金管理有限公司关于增加蛋卷基金为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2017年3月21日
11	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宜信普泽费率优惠活动的公告	同上	2017年3月16日
12	长盛基金管理有限公司关于调整长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理的公告	同上	2017年3月2日

13	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	同上	2017 年 1 月 21 日
14	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2017 年 1 月 20 日
15	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2017 年 1 月 20 日

§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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	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	持有份额	份额占比
机构	1	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	280,555,920.56	0.00	100,000,000.00	180,555,920.56	31.90%

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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2017年8月24日