

# 长盛盛泰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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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，投资者在做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 3 月 20 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
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.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
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.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>
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.....	56

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长盛盛泰混合	
基金主代码	003924	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 20 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	600,042,486.35 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛盛泰混合 A	长盛盛泰混合 C
下属分级基金的交易代码:	003924	003925
报告期末下属分级基金的份额总额	600,004,593.64 份	37,892.71 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，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	<p>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。</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>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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

## 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	叶金松	朱萍
	联系电话	010-82019988	021-61618888
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95528
传真		010-82255988	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市中山东一路 12 号
邮政编码		100088	200120
法定代表人		周兵	高国富

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
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场所

## 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	长盛盛泰混合 A	长盛盛泰混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年3月20日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年3月20日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	10,886,440.62	566.89
本期利润	13,139,024.68	711.82
加权平均基金份额本期利润	0.0219	0.0221
本期加权平均净值利润率	2.17%	2.19%
本期基金份额净值增长率	2.19%	2.13%
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	10,886,440.62	664.89
期末可供分配基金份额利润	0.0181	0.0175
期末基金资产净值	613,143,618.32	38,699.71
期末基金份额净值	1.0219	1.0213
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	2.19%	2.13%

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。

4、本基金基金合同生效日为2017年3月20日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

#### 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

长盛盛泰混合 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	1.32%	0.10%	3.01%	0.34%	-1.69%	-0.24%
过去三个月	2.17%	0.14%	3.16%	0.32%	-0.99%	-0.18%
自基金合同生效起至今	2.19%	0.14%	3.37%	0.31%	-1.18%	-0.17%

长盛盛泰混合 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	1.30%	0.10%	3.01%	0.34%	-1.71%	-0.24%
过去三个月	2.11%	0.14%	3.16%	0.32%	-1.05%	-0.18%
自基金合同生效起至今	2.13%	0.14%	3.37%	0.31%	-1.24%	-0.17%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

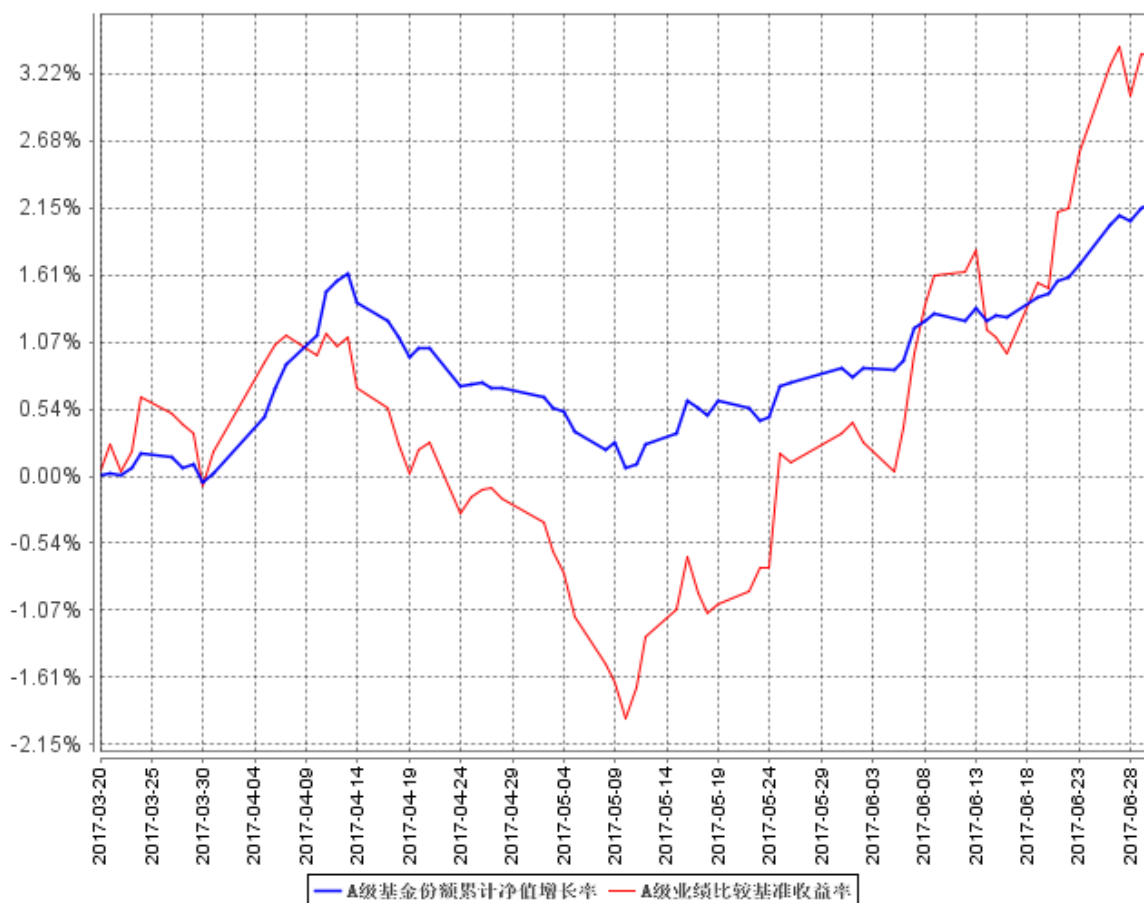
本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

基准指数的构建考虑了三个原则：

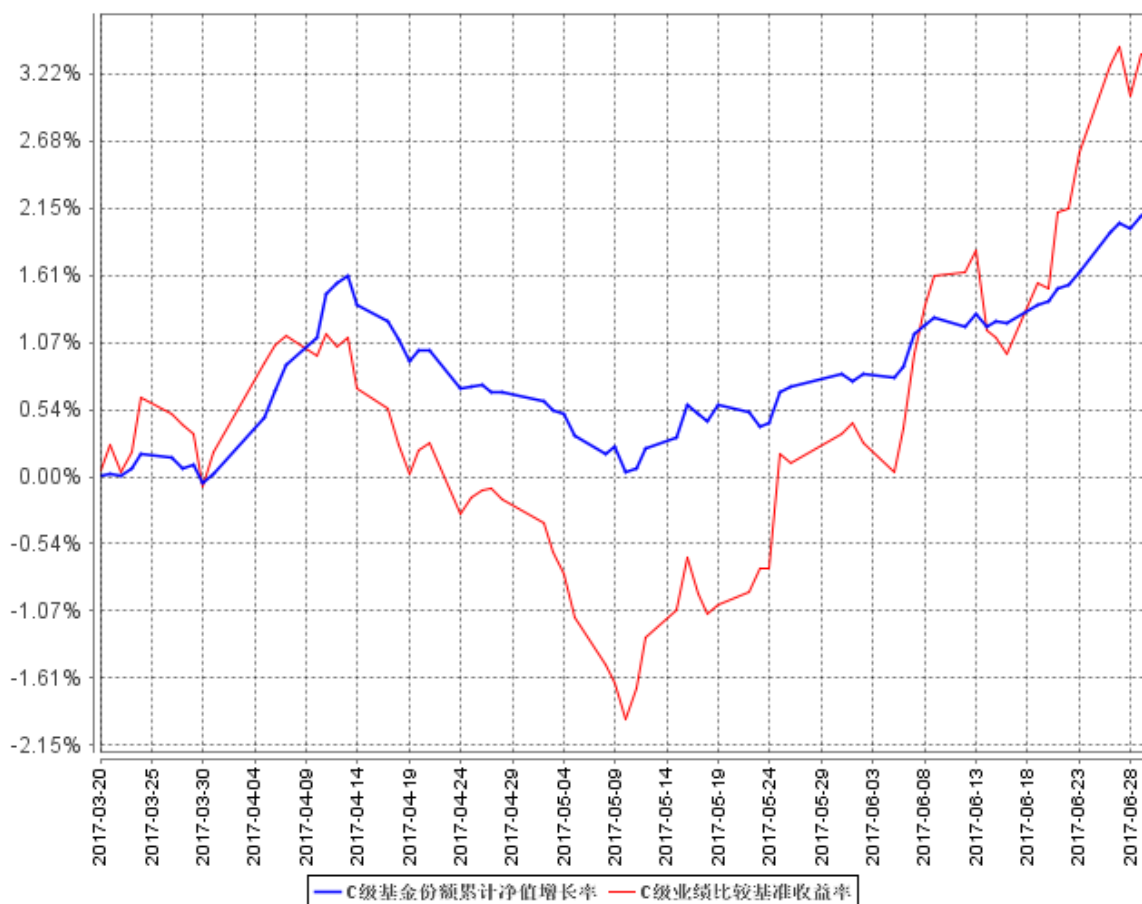
- 1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债指数。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的市场代表性；中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，该指数可以较为全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。
- 2、可比性。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；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

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：1、本基金基金合同生效日为 2017 年 3 月 20 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。
- 2、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。截至本报告期末本基金仍处于建仓期。
- 3、本基金的投资组合比例为：本基金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 0%-3%；在扣除股指期货和国债合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

## §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，长盛盛世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。	2017 年 3 月 20 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。
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	2017 年 3 月 20 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有限公司，历任固定收益研究

<p>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,长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理。</p>			<p>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。</p>
---	--	--	---

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合规守信情况的说明

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，以高信用资质的中短期信用债和银行同业存单为主要投资标的，报告期内加大了同业存单的配置力度。在股票底仓配置上，通过量化手段精选个股，充分分散、优化持仓结构，控制权益下行风险；同时，紧密跟踪新股和转债发行，积极参与网下申购，提升组合收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛泰混合 A 基金份额净值为 1.0219 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.19%；截至本报告期末长盛盛泰混合 C 基金份额净值为 1.0213 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.13%；同期业绩比较基准收益率为 3.37%。

## 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，长盛盛泰混合 A 期末可供分配利润为 10,886,440.62 元（长盛盛泰混合 A 的未分配利润已实现部分为 10,886,440.62 元，未分配利润未实现部分为 2,252,584.06 元），长盛盛泰混合 C 期末可供分配利润为 664.89 元（长盛盛泰混合 C 的未分配利润已实现部分为 664.89 元，未分配利润未实现部分为 142.11 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现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、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、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：长盛盛泰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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	4,356,286.73
结算备付金		526,768.84
存出保证金		87,171.94
交易性金融资产	6.4.7.2	593,265,785.32
其中：股票投资		128,253,449.32
基金投资		-
债券投资		465,012,336.00
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	9,000,000.00
应收证券清算款		220,240.80
应收利息	6.4.7.5	6,239,041.80
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		613,695,295.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
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		-
应付赎回款		204.15
应付管理人报酬		299,939.16
应付托管费		49,989.88
应付销售服务费		5.53
应付交易费用	6.4.7.7	117,080.93

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	45,757.75
负债合计		512,977.40
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	600,042,486.35
未分配利润	6.4.7.10	13,139,831.68
所有者权益合计		613,182,318.03
负债和所有者权益总计		613,695,295.43

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，长盛盛泰混合 A 基金份额净值 1.0219 元，基金份额总额 600,004,593.64 份；长盛盛泰混合 C 基金份额净值 1.0213 元，基金份额总额 37,892.71 份。长盛盛泰混合份额总额合计为 600,042,486.35 份。

2、本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 3 月 20 日(基金合同生 效日)至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		14,682,471.47
1.利息收入		5,579,455.46
其中：存款利息收入	6.4.7.11	814,258.31
债券利息收入		3,177,223.00
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,587,974.15
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,850,287.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,859,877.59
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-22,845.91
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	1,013,255.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,252,728.99

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
<b>减：二、费用</b>		1,542,734.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,014,291.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	169,048.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	18.36
4. 交易费用	6.4.7.17	308,600.13
5. 利息支出		2,388.88
其中：卖出回购金融资产支出		2,388.88
6. 其他费用	6.4.7.18	48,387.75
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		13,139,736.50
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		13,139,736.50

注：本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 20 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）	600,036,506.03	-	600,036,506.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,139,736.50	13,139,736.50
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）	5,980.32	95.18	6,075.50
其中：1.基金申购款	7,280.83	119.17	7,400.00
2.基金赎回款	-1,300.51	-23.99	-1,324.50
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）	600,042,486.35	13,139,831.68	613,182,318.03

注：本基金合同于 2017 年 3 月 20 日生效，无上年度可比期间。

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：

<u>林培富</u>	<u>刁俊东</u>	<u>龚珉</u>
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

长盛盛泰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(“中国证监会”)证监许可[2016]第 2425 号《关于准予长盛盛泰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《长盛盛泰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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 600,031,992.78 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(2017)第 282 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 600,036,506.03 份基金份额,其中认购资金利息折合 4,513.25 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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据经批准的《长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长盛盛泰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。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码,并且由于基金费用的不同,分别计算和公告基金份额净值。投资人可自由选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛泰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)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具、同业存单、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但必须符合中国证监会相关规定)。本基金投资组合比例为:对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，现金或者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%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

#### 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》、《长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金》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

本基金 2017 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止期间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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的

参数。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。



其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需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	4,356,286.73
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	4,356,286.73

### 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	126,613,138.88	128,253,449.32	1,640,310.44
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	34,053,791.70	34,100,336.00
	银行间市场	430,346,125.75	430,912,000.00
	合计	464,399,917.45	465,012,336.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	591,013,056.33	593,265,785.32	2,252,728.99

### 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	9,000,000.00	-
合计	9,000,000.00	-

**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	1,514.13
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	213.30
应收债券利息	6,233,203.62
应收买入返售证券利息	4,075.47
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	35.28
合计	6,239,041.80

**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	114,095.30
银行间市场应付交易费用	2,985.63
合计	117,080.93

## 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	-
预提费用	45,757.75
合计	45,757.75

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛泰混合 A		
项目	本期 2017年3月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	600,004,593.64	600,004,593.64
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 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	600,004,593.64	600,004,593.64

金额单位：人民币元

长盛盛泰混合 C		
项目	本期 2017年3月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	31,912.39	31,912.39
本期申购	7,280.83	7,280.83
本期赎回(以“-”号填列)	-1,300.51	-1,300.51
- 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	37,892.71	37,892.71

注：1. 本基金自 2017 年 3 月 6 日至 2017 年 3 月 15 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金

600,031,992.78 元。根据《长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 4,513.25 元在本基金成立后，折算为 4,513.25 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2017 年 3 月 20 日(基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 18 日止期间暂不向投资人开放基金交易。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长盛盛泰混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	10,886,440.62	2,252,584.06	13,139,024.68
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,886,440.62	2,252,584.06	13,139,024.68

单位：人民币元

长盛盛泰混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	566.89	144.93	711.82
本期基金份额交易产生的变动数	98.00	-2.82	95.18
其中：基金申购款	119.36	-0.19	119.17
基金赎回款	-21.36	-2.63	-23.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	664.89	142.11	807.00

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	188,680.25
定期存款利息收入	613,611.11
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	11,662.60

其他	304.35
合计	814,258.31

#### 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3月20日(基金合同生效日)至 2017年6月30日
卖出股票成交总额	78,637,075.14
减：卖出股票成本总额	72,777,197.55
买卖股票差价收入	5,859,877.59

#### 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3月20日(基金合同生效日)至2017年 6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-22,845.91
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	-22,845.91

##### 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3月20日(基金合同生效日)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	30,088,085.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	29,409,670.00
减：应收利息总额	701,260.91
买卖债券差价收入	-22,845.91

**6.4.7.14 衍生工具收益**

注：本基金本报告期未取得衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月20日(基金合同生效日)至2017年 6月30日
股票投资产生的股利收益	1,013,255.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,013,255.34

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年3月20日(基金合同生效日)至 2017年6月30日
1. 交易性金融资产	2,252,728.99
——股票投资	1,640,310.44
——债券投资	612,418.55
——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	2,252,728.99

**6.4.7.17 其他收入**

注：本基金于2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日止期间未取得其他收入。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日
交易所市场交易费用	306,225.13
银行间市场交易费用	2,375.00



合计	308,600.13
----	------------

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月20日(基金合同生效日)至2017年6月30日
审计费用	21,533.18
信息披露费	24,224.57
银行汇划费	2,230.00
其他	400.00
合计	48,387.75

#### 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

本基金并无需作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的管理人于2017年8月3日发布分红公告，向截至2017年8月4日止本基金登记注册的份额持有人进行利润分配，长盛盛泰混合A类按每10份基金份额分配红利人民币0.2100元，实际分配收益金额人民币12,600,052.38元；长盛盛泰混合C类按每10份基金份额分配红利人民币0.2100元，实际分配收益金额人民币1,376.98元；以上实际分配收益金额共计人民币12,601,429.36元。

除以上情况外，无其他需要说明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

本基金于2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日止期间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”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构

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：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

### 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
	2017年3月20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	1,014,291.32
其中：支付销售机构的客户维护费	1.59

注：支付基金管理人长盛基金的管理人报酬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。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.60% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月20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	169,048.53

注：支付基金托管人浦发银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 X 0.1% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本期未产生与关联方的销售服务费。

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 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，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 C 类基金份额资产净值 X 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：本基金于 2017 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日止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内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：除基金管理人之外的其他关联方本期末未投资本基金。

**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3月20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
浦发银行	4,356,286.73	188,680.25

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，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：本基金于2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日止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**

本基金于2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日止期间无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

注：本基金于2017年3月20日（基金合同生效日）至2017年6月30日止期间未进行利润分配。

**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
002010	传化智联	2017年6月30日	重大事项停牌	15.26	2017年7月4日	16.77	108,604	1,897,308.44	1,657,297.04	-
002399	海普瑞	2017年4月28日	重大事项停牌	20.23	-	-	73,608	1,629,237.44	1,489,089.84	-
000100	TCL集团	2017年4月21日	重大事项停牌	3.48	2017年7月26日	3.72	390,000	1,413,700.00	1,357,200.00	-
601872	招商轮船	2017年5月2日	重大事项停牌	5.19	-	-	201,700	1,065,812.00	1,046,823.00	-
600100	同方股份	2017年4月21日	重大事项停牌	14.38	-	-	49,500	694,905.00	711,810.00	-

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

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 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

本基金是一只混合型证券投资基金，具有较高风险。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行浦发银行，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
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	464,710,658.40
合计	464,710,658.40

注：未评级部分为国债、同业存单、短期融资券、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 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
AAA	-
AAA 以下	294,703.50
未评级	6,974.10
合计	301,677.60

注：未评级部分为国债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内

变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦在证券交易所上市，因此除附注 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，其余均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产等。

##### 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	4,356,286.73	-	-	-	4,356,286.73
结算备付金	526,768.84	-	-	-	526,768.84

存出保证金	87,171.94	-	-	-	87,171.94
交易性金融资产	465,012,336.00	-	-	128,253,449.32	593,265,785.32
买入返售金融资产	9,000,000.00	-	-	-	9,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	220,240.80	220,240.80
应收利息	-	-	-	6,239,041.80	6,239,041.80
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	478,982,563.51	-	-	134,712,731.92	613,695,295.43
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	204.15	204.15
应付管理人报酬	-	-	-	299,939.16	299,939.16
应付托管费	-	-	-	49,989.88	49,989.88
应付销售服务费	-	-	-	5.53	5.53
应付交易费用	-	-	-	117,080.93	117,080.93
其他负债	-	-	-	45,757.75	45,757.75
负债总计	-	-	-	512,977.40	512,977.40
利率敏感度缺口	478,982,563.51	-	-	134,199,754.52	613,182,318.03

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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）
	市场利率下降25个基点	253,824.00
	市场利率上升25个基点	-253,824.00

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。



本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金股票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 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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	128,253,449.32	20.92
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	128,253,449.32	20.92

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金运营不满一年，无足够历史数据分析其他价格风险敏感性。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

#### 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为 122,162,249.84 元，属于第二层次的余额为 471,103,535.48 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。

(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	128,253,449.32	20.90
	其中：股票	128,253,449.32	20.90
2	固定收益投资	465,012,336.00	75.77
	其中：债券	465,012,336.00	75.77
	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	9,000,000.00	1.47
	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	4,883,055.57	0.80
7	其他各项资产	6,546,454.54	1.07
8	合计	613,695,295.43	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	1,797,500.00	0.29
B	采矿业	5,140,718.00	0.84
C	制造业	49,039,436.38	8.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,883,548.95	2.10
E	建筑业	1,344,310.00	0.22
F	批发和零售业	3,479,944.00	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	11,044,368.70	1.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,653,834.09	0.43
J	金融业	26,382,363.28	4.30
K	房地产业	12,495,545.92	2.04
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	1,991,880.00	0.32
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	128,253,449.32	20.92

### 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	601288	农业银行	965,300	3,397,856.00	0.55
2	601988	中国银行	644,300	2,383,910.00	0.39
3	000338	潍柴动力	155,300	2,049,960.00	0.33
4	000938	紫光股份	33,250	2,032,240.00	0.33
5	000069	华侨城 A	198,000	1,991,880.00	0.32
6	002450	康得新	85,600	1,927,712.00	0.31
7	000540	中天金融	274,200	1,905,690.00	0.31
8	000860	顺鑫农业	94,100	1,882,941.00	0.31
9	000900	现代投资	202,400	1,862,080.00	0.30
10	000089	深圳机场	198,202	1,853,188.70	0.30
11	000729	燕京啤酒	275,300	1,850,016.00	0.30
12	000623	吉林敖东	80,730	1,847,909.70	0.30
13	002152	广电运通	222,283	1,847,171.73	0.30
14	002603	以岭药业	105,708	1,845,661.68	0.30
15	002042	华孚色纺	172,500	1,844,025.00	0.30
16	002142	宁波银行	95,460	1,842,378.00	0.30
17	000883	湖北能源	364,900	1,831,798.00	0.30
18	000989	九芝堂	96,401	1,827,762.96	0.30
19	000543	皖能电力	313,500	1,827,705.00	0.30
20	000422	湖北宜化	306,800	1,825,460.00	0.30
21	000671	阳光城	312,700	1,819,914.00	0.30
22	002267	陕天然气	206,900	1,818,651.00	0.30
23	000732	泰禾集团	107,964	1,800,839.52	0.29

24	002440	闰土股份	118,000	1,800,680.00	0.29
25	000735	罗牛山	287,600	1,797,500.00	0.29
26	000876	新希望	218,600	1,796,892.00	0.29
27	000001	平安银行	191,300	1,796,307.00	0.29
28	000157	中联重科	397,900	1,786,571.00	0.29
29	000685	中山公用	162,770	1,782,331.50	0.29
30	002250	联化科技	124,600	1,781,780.00	0.29
31	000625	长安汽车	123,400	1,779,428.00	0.29
32	002385	大北农	282,600	1,777,554.00	0.29
33	000926	福星股份	144,700	1,765,340.00	0.29
34	000539	粤电力A	331,155	1,765,056.15	0.29
35	000726	鲁泰A	145,900	1,730,374.00	0.28
36	002010	传化智联	108,604	1,657,297.04	0.27
37	600741	华域汽车	64,400	1,561,056.00	0.25
38	002399	海普瑞	73,608	1,489,089.84	0.24
39	601318	中国平安	28,000	1,389,080.00	0.23
40	601898	中煤能源	234,400	1,378,272.00	0.22
41	600267	海正药业	116,200	1,357,216.00	0.22
42	000100	TCL 集团	390,000	1,357,200.00	0.22
43	600739	辽宁成大	74,600	1,345,038.00	0.22
44	600820	隧道股份	133,100	1,344,310.00	0.22
45	600548	深高速	148,200	1,339,728.00	0.22
46	600637	东方明珠	61,441	1,331,426.47	0.22
47	600642	申能股份	210,821	1,328,172.30	0.22
48	600674	川投能源	135,100	1,326,682.00	0.22
49	600036	招商银行	55,330	1,322,940.30	0.22
50	601169	北京银行	143,700	1,317,729.00	0.21
51	600016	民生银行	160,200	1,316,844.00	0.21
52	600736	苏州高新	186,000	1,315,020.00	0.21
53	600037	歌华有线	90,300	1,314,768.00	0.21
54	601998	中信银行	208,600	1,312,094.00	0.21
55	600811	东方集团	200,200	1,305,304.00	0.21
56	600177	雅戈尔	128,920	1,304,670.40	0.21
57	600690	青岛海尔	86,645	1,304,007.25	0.21
58	600015	华夏银行	141,240	1,302,232.80	0.21
59	600048	保利地产	130,600	1,302,082.00	0.21
60	600010	包钢股份	593,760	1,300,334.40	0.21
61	601398	工商银行	247,200	1,297,800.00	0.21
62	601166	兴业银行	76,900	1,296,534.00	0.21

63	600999	招商证券	75,269	1,296,132.18	0.21
64	601818	光大银行	319,600	1,294,380.00	0.21
65	601555	东吴证券	115,100	1,292,573.00	0.21
66	600352	浙江龙盛	135,300	1,289,409.00	0.21
67	600157	永泰能源	360,000	1,285,200.00	0.21
68	601766	中国中车	126,700	1,282,204.00	0.21
69	600064	南京高科	84,900	1,281,990.00	0.21
70	600033	福建高速	335,600	1,278,636.00	0.21
71	600035	楚天高速	231,900	1,277,769.00	0.21
72	601328	交通银行	207,300	1,276,968.00	0.21
73	601006	大秦铁路	149,600	1,255,144.00	0.20
74	601857	中国石油	162,900	1,252,701.00	0.20
75	601939	建设银行	202,700	1,246,605.00	0.20
76	600028	中国石化	206,500	1,224,545.00	0.20
77	600027	华电国际	249,100	1,203,153.00	0.20
78	600079	人福医药	61,300	1,202,706.00	0.20
79	600029	南方航空	130,000	1,131,000.00	0.18
80	601872	招商轮船	201,700	1,046,823.00	0.17
81	600089	特变电工	95,900	990,647.00	0.16
82	600704	物产中大	113,800	829,602.00	0.14
83	600100	同方股份	49,500	711,810.00	0.12
84	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
85	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
86	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
87	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
88	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
89	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
90	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
91	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
92	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
93	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
94	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
95	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
96	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
97	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
98	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
99	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 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000157	中联重科	3,649,282.00	0.60
2	601288	农业银行	3,290,047.00	0.54
3	000538	云南白药	2,803,554.00	0.46
4	000027	深圳能源	2,615,016.00	0.43
5	601988	中国银行	2,350,149.00	0.38
6	600016	民生银行	2,338,852.00	0.38
7	601169	北京银行	2,337,055.00	0.38
8	600118	中国卫星	2,329,438.50	0.38
9	000001	平安银行	2,149,199.00	0.35
10	000543	皖能电力	2,082,878.00	0.34
11	000860	顺鑫农业	2,036,270.59	0.33
12	000989	九芝堂	2,035,901.75	0.33
13	000729	燕京啤酒	2,007,475.00	0.33
14	002267	陕天然气	1,938,560.00	0.32
15	000625	长安汽车	1,902,135.00	0.31
16	002010	传化智联	1,897,308.44	0.31
17	002603	以岭药业	1,895,130.40	0.31
18	000732	泰禾集团	1,887,527.80	0.31
19	002142	宁波银行	1,880,156.60	0.31
20	000926	福星股份	1,863,009.00	0.30

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	000538	云南白药	3,058,740.00	0.50
2	002146	荣盛发展	2,711,360.00	0.44
3	000709	河钢股份	2,581,800.00	0.42
4	000600	建投能源	2,564,836.00	0.42
5	000786	北新建材	2,439,454.61	0.40

6	000027	深圳能源	2,433,819.00	0.40
7	002475	立讯精密	2,016,079.50	0.33
8	600009	上海机场	1,927,830.00	0.31
9	600118	中国卫星	1,918,559.00	0.31
10	002223	鱼跃医疗	1,903,974.25	0.31
11	600340	华夏幸福	1,858,864.00	0.30
12	600008	首创股份	1,856,921.00	0.30
13	002024	苏宁云商	1,810,806.00	0.30
14	002083	孚日股份	1,732,690.79	0.28
15	000425	徐工机械	1,713,600.00	0.28
16	600717	天津港	1,713,022.00	0.28
17	002594	比亚迪	1,646,359.05	0.27
18	000157	中联重科	1,595,589.00	0.26
19	603328	依顿电子	1,586,205.20	0.26
20	002202	金风科技	1,459,922.03	0.24

#### 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	199,390,336.43
卖出股票收入（成交）总额	78,637,075.14

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	13,747,842.50	2.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,057,790.00	3.27
	其中：政策性金融债	20,057,790.00	3.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,090,000.00	8.17
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	294,703.50	0.05
8	同业存单	380,822,000.00	62.11
9	其他	-	-
10	合计	465,012,336.00	75.84



**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	111721027	17 渤海银行 CD027	1,000,000	97,830,000.00	15.95
2	111712005	17 北京银行 CD005	1,000,000	97,080,000.00	15.83
3	111710251	17 兴业银行 CD251	600,000	59,328,000.00	9.68
4	11758034	17 广州金融 SCP001	500,000	50,090,000.00	8.17
5	111714129	17 江苏银行 CD129	500,000	48,910,000.00	7.98

**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

本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	87,171.94
2	应收证券清算款	220,240.80
3	应收股利	-
4	应收利息	6,239,041.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,546,454.54

### 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。

### 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未存在流通受限的情况。

### 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
长盛盛泰混合 A	6	100,000,765.61	600,001,500.00	100.00%	3,093.64	0.00%
长盛盛泰混合 C	212	178.74	0.00	0.00%	37,892.71	100.00%
合计	218	2,752,488.47	600,001,500.00	99.99%	40,986.35	0.01%

### 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	长盛盛泰混合 A	-	-
	长盛盛泰混合 C	100.04	0.2640%
	合计	100.04	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	长盛盛泰混合 A	0
	长盛盛泰混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛盛泰混合 A	0
	长盛盛泰混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛泰混合 A	长盛盛泰混合 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 20 日）基金 份额总额	600,004,593.64	31,912.39
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	-	7,280.83
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎 回份额	-	1,300.51
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	600,004,593.64	37,892.71

## §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

本报告期本基金经理未曾变动。

#### 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

本报告期内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	
国信证券	2	277,135,420.05	100.00%	202,679.00	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
国信证券	34,141,113.79	100.00%	1,630,034,000.00	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必要，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：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	国信证券	深圳	1
2	国信证券	上海	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：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	长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购_赎回_转换及定期定额投资业务的公告	《证券时报》及本公司网站	2017年6月14日
2	长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	同上	2017年6月14日
3	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
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	长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公	同上	2017年3月21日

---

	告		
--	---	--	--



## §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 3 月 20 日至 2017 年 6 月 30 日	-	299,999,000.00	-	299,999,000.00	50.00%
	2	2017 年 3 月 20 日至 2017 年 6 月 30 日	-	199,999,000.00	-	199,999,000.00	33.33%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

### 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、《长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛泰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