

长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 2 季度报告

2018 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 7 月 20 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛盛瑞混合
基金主代码	004310
交易代码	004310
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 27 日
报告期末基金份额总额	52,045,054.67 份
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	<p>本基金将通过宏观、微观经济指标，市场指标，政策因素等，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>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。在行业配置的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的办法，挑选具备较大投资价值的上市公司。</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>

	本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向，综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券投资组合。在实际的投资运作中，本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。 本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指债券、国债期货及期权的投资。	
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。	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长盛盛瑞混合 A	长盛盛瑞混合 C
下属分级基金的交易代码	004310	004311
报告期末下属分级基金的份额总额	52,004,633.53 份	40,421.14 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2018年4月1日—2018年6月30日）	
	长盛盛瑞混合 A	长盛盛瑞混合 C
1. 本期已实现收益	5,274.84	-113.95
2. 本期利润	-368,990.66	-310.70
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0071	-0.0073
4. 期末基金资产净值	51,229,838.58	39,772.42
5. 期末基金份额净值	0.9851	0.9840

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到 2018 年 6 月 30 日。

3、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

长盛盛瑞混合 A

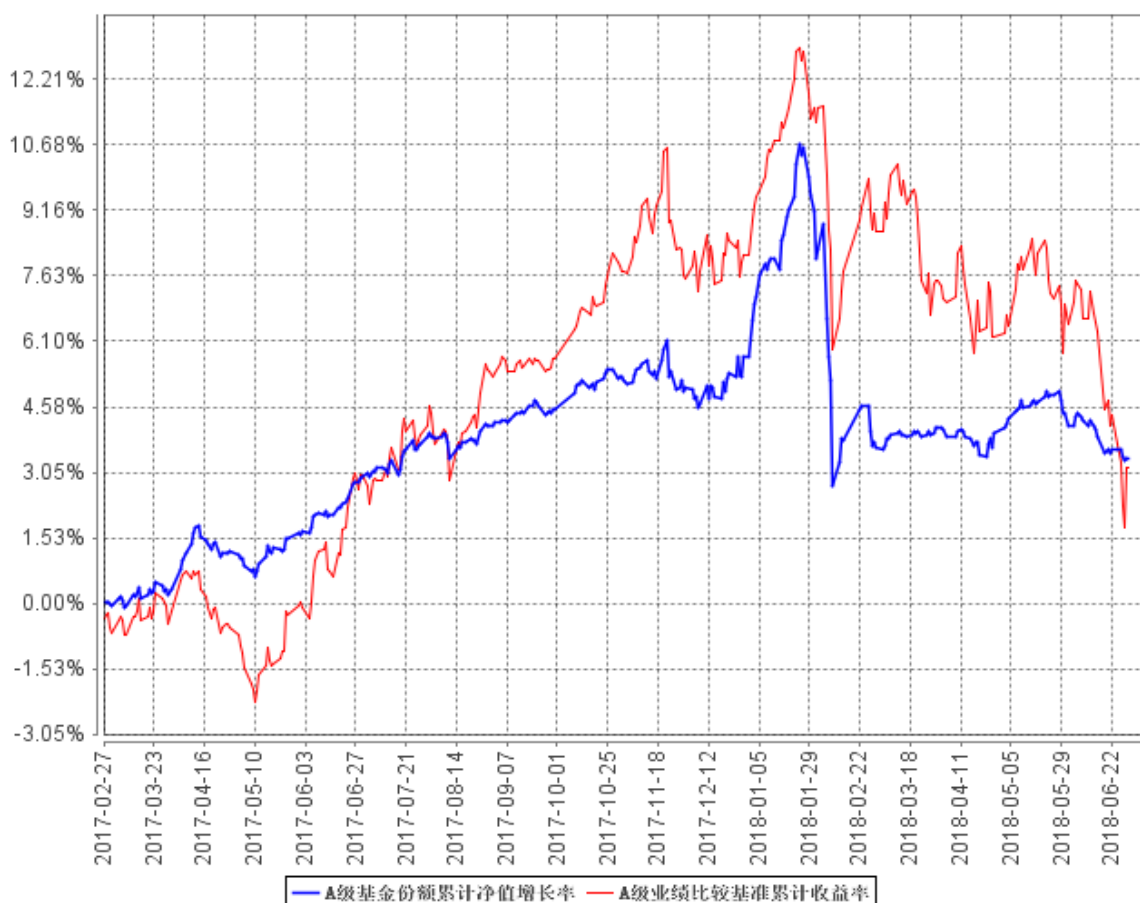
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.72%	0.14%	-4.07%	0.57%	3.35%	-0.43%

长盛盛瑞混合 C

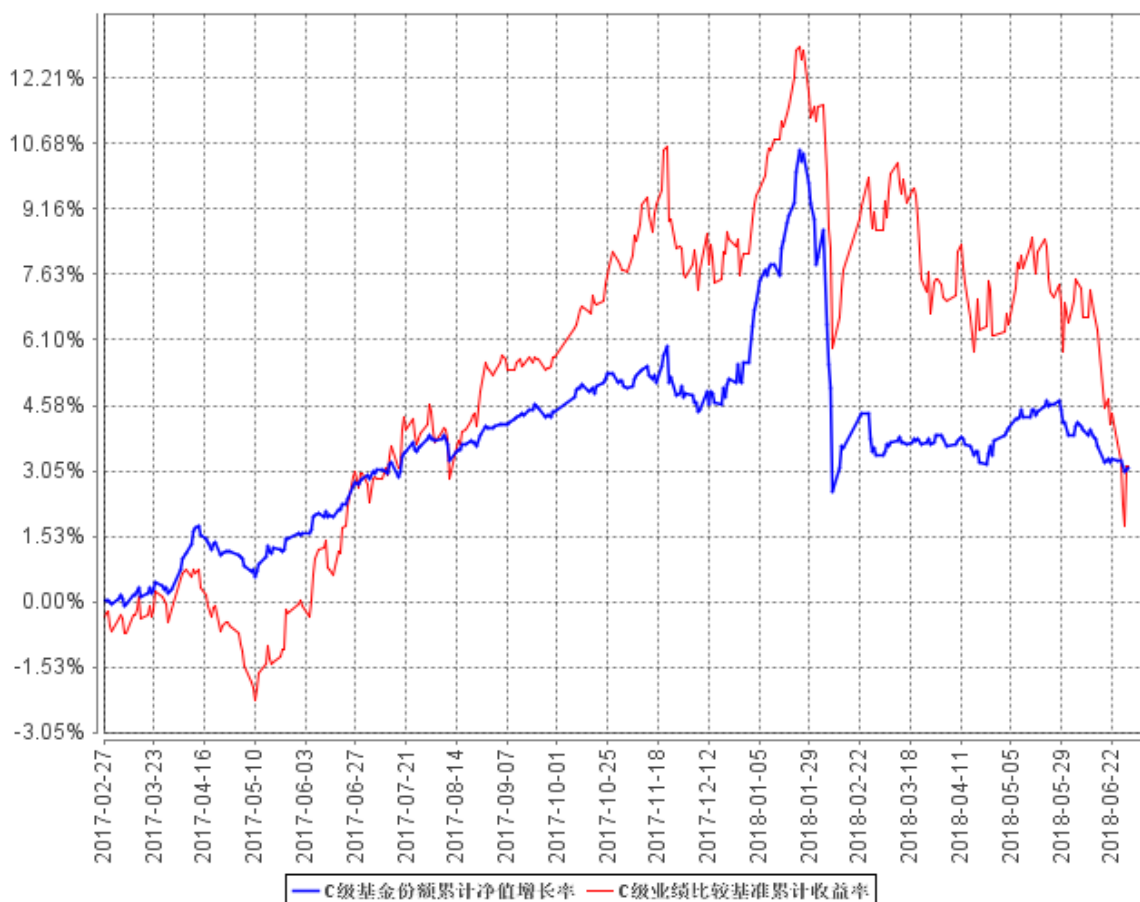
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.76%	0.14%	-4.07%	0.57%	3.31%	-0.43%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	2017年2月27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

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。				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 公平交易专项说明

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，未发现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 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，数据显示，经济二季度表现弱于预期，经济下行压力得到进一步确认。此外，美对华加征关税加剧中美贸易摩擦，央行再度宣布定向降准，棚改项目审批规范化，在海外债市收益率普遍回落的背景下，我国债券收益率大幅下行。随着利好因素逐步清晰，信用风险开始发酵，投资者大面积转向利率债，债券市场交易活跃度上升，行情的波动也较一季度明显加大，市场明显被交易户所主导。

报告期内，A 股市场出现明显调整，成交活跃度下降。其中上证综指下跌 10.14%，沪深 300 指数下跌 9.94%，创业板指下跌 15.46%。受股票市场影响，中证转债指数下跌 5.82%。

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缩减，新股网下申购对象数量较年初有所减少。部分独角兽概念新股上市初期表现较好。

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），之后未再主动买入股票，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封死跌停，大幅下跌后才能卖出，短期对基金净值冲击较大。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛瑞混合 A 基金份额净值为 0.9851 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.72%；截至本报告期末长盛盛瑞混合 C 基金份额净值为 0.9840 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.76%；同期业绩比较基准收益率为 -4.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4,057,672.88	7.90
	其中：股票	4,057,672.88	7.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	41,956,260.00	81.70
	其中：债券	41,956,260.00	81.70
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	3,100,000.00	6.04
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,320,536.00	2.57
8	其他资产	922,201.29	1.80
9	合计	51,356,670.17	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,225,617.00	4.34
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	2.02
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	798,495.88	1.56
S	综合	-	-
	合计	4,057,672.88	7.91

5.2.2 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。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000566	海南海药	91,300	1,186,900.00	2.32
2	002219	恒康医疗	98,550	1,038,717.00	2.03
3	600221	海航控股	396,000	1,033,560.00	2.02
4	000793	华闻传媒	115,892	798,495.88	1.56

注：本基金本报告期末仅持有上述四只股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,600,260.00	5.07
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	39,356,000.00	76.76
9	其他	-	-
10	合计	41,956,260.00	81.83

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111816174	18 上海银行 CD174	100,000	9,962,000.00	19.43
2	111809117	18 浦发银行 CD117	100,000	9,910,000.00	19.33

3	111820110	18 广发银行 CD110	100,000	9,902,000.00	19.31
4	111710368	17 兴业银行 CD368	100,000	9,582,000.00	18.69
5	019571	17 国债 17	26,000	2,600,260.00	5.07

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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、恒康医疗

恒康医疗股份有限公司于 2017 年 8 月 11 日接到控股股东通知，其已收到中国证监会下发的《行政处罚决定书》（[2017]80 号），中国证监会决定对其作出如下处罚：“没收违法所得 3,041,068 元，并处以 3,041,068 元罚款。”

起因：2016 年 2 月 1 日，恒康医疗集团股份有限公司（以下简称“公司”）控股股东阙文彬先生收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（沪证专调查字 2016124 号）。因涉嫌违反证券法律法规，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对其进行立案稽查。详见公司于 2016 年 2 月 3 日发布的《关于收到中国证监会调查通知书的公告》（公告编号：2016-025 号）。

基于相关研究，本基金认为，该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。

3、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，本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记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	58,368.72
2	应收证券清算款	222,524.60
3	应收股利	-
4	应收利息	640,507.97
5	应收申购款	800.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	922,201.29

5.11.4 报告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）。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000566	海南海药	1,186,900.00	2.32	重大事项停牌
2	600221	海航控股	1,033,560.00	2.02	重大事项停牌
3	000793	华闻传媒	798,495.88	1.56	重大事项停牌

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛瑞混合 A	长盛盛瑞混合 C
报告期期初基金份额总额	70,012,665.93	60,943.49
报告期期间基金总申购份额	2,214.95	3,648.19
减：报告期期间基金总赎回份额	18,010,247.35	24,170.54
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	52,004,633.53	40,421.14

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

资 者 类 别	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	20180401~20180630	29,999,000.00	0.00	3,999,000.00	26,000,000.00	49.96%
	2	20180401~20180630	39,999,000.00	0.00	13,999,000.00	26,000,000.00	49.96%
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。							

8.2 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛瑞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。

9.2 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。

9.3 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/或管理人互联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

2018 年 7 月 20 日