

长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

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

送出日期：2018 年 8 月 29 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

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.....	6
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	12
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.....	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.....	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
§5 托管人报告	17
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
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
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
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.....	44
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.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长盛盛瑞混合	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	52,045,054.67 份	
基金合同存续期	于 2018 年 7 月 24 日进入清算期	
下属分级基金的基金简称:	长盛盛瑞混合 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

2.2 基金产品说明

投资目标	通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在严格控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	<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> <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。</p> <p>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。</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	平安银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张利宁	方琦
	联系电话	010-82019988	0755-22160168
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95511-3
传真		010-82255988	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区福中三路诺德金融中心主楼 10D	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码		100088	518001
法定代表人		周兵	谢永林

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》
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	基金管理人及基金托管人的办公地址

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	长盛盛瑞混合 A	长盛盛瑞混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-2,779,418.01	-1,137.23
本期利润	-3,681,546.79	-1,863.50
加权平均基金份额本期利润	-0.0308	-0.0378
本期加权平均净值利润率	-3.06%	-3.78%
本期基金份额净值增长率	-2.24%	-2.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配利润	-774,794.95	-648.72
期末可供分配基金份额利润	-0.0149	-0.0160
期末基金资产净值	51,229,838.58	39,772.42
期末基金份额净值	0.9851	0.9840
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	3.36%	3.10%

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

长盛盛瑞混合 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	-1.03%	0.14%	-3.57%	0.64%	2.54%	-0.50%
过去三个月	-0.72%	0.14%	-4.07%	0.57%	3.35%	-0.43%
过去六个月	-2.24%	0.38%	-4.61%	0.58%	2.37%	-0.20%
过去一年	0.40%	0.29%	0.17%	0.47%	0.23%	-0.18%
自基金合同	3.36%	0.26%	3.15%	0.44%	0.21%	-0.18%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

长盛盛瑞混合 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	-1.04%	0.14%	-3.57%	0.64%	2.53%	-0.50%
过去三个月	-0.76%	0.14%	-4.07%	0.57%	3.31%	-0.43%
过去六个月	-2.34%	0.38%	-4.61%	0.58%	2.27%	-0.20%
过去一年	0.21%	0.29%	0.17%	0.47%	0.04%	-0.18%
自基金合同生效起至今	3.10%	0.26%	3.15%	0.44%	-0.05%	-0.18%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

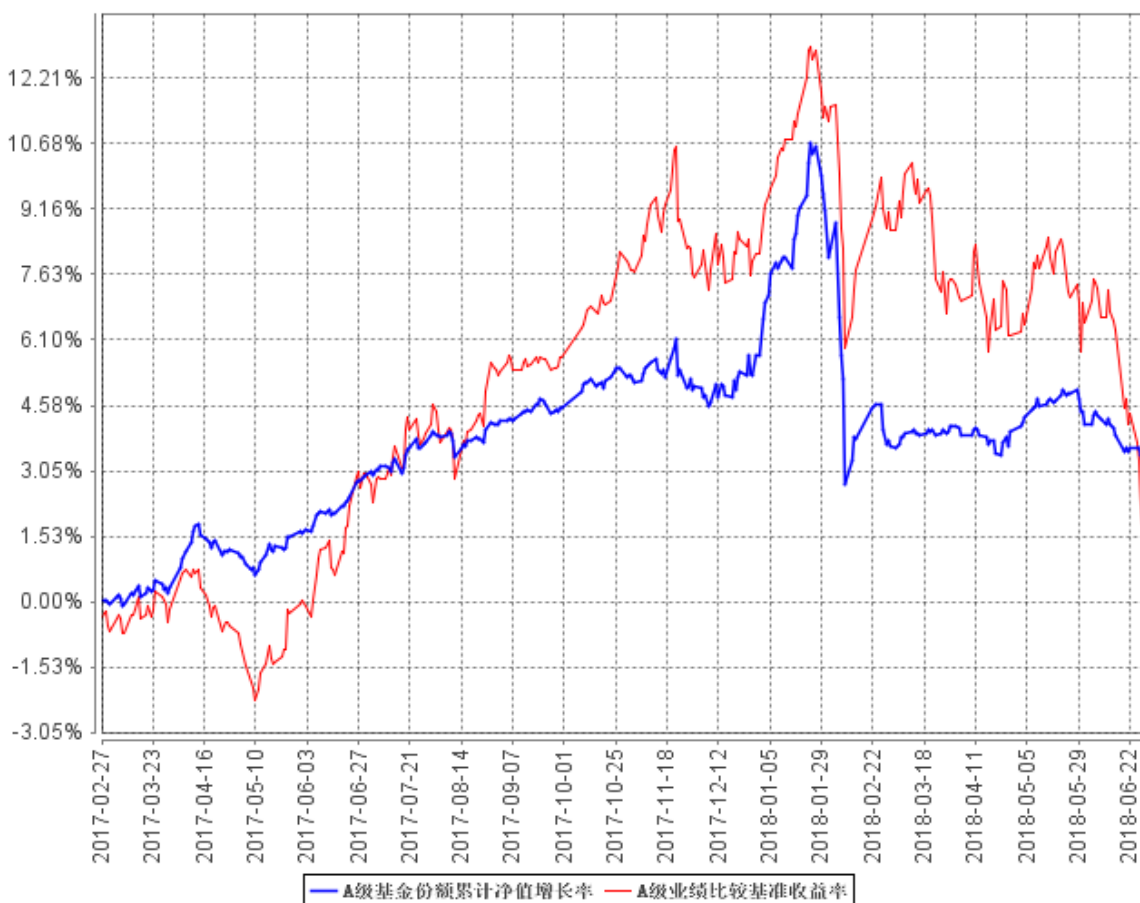
本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

基准指数的构建考虑了三个原则：

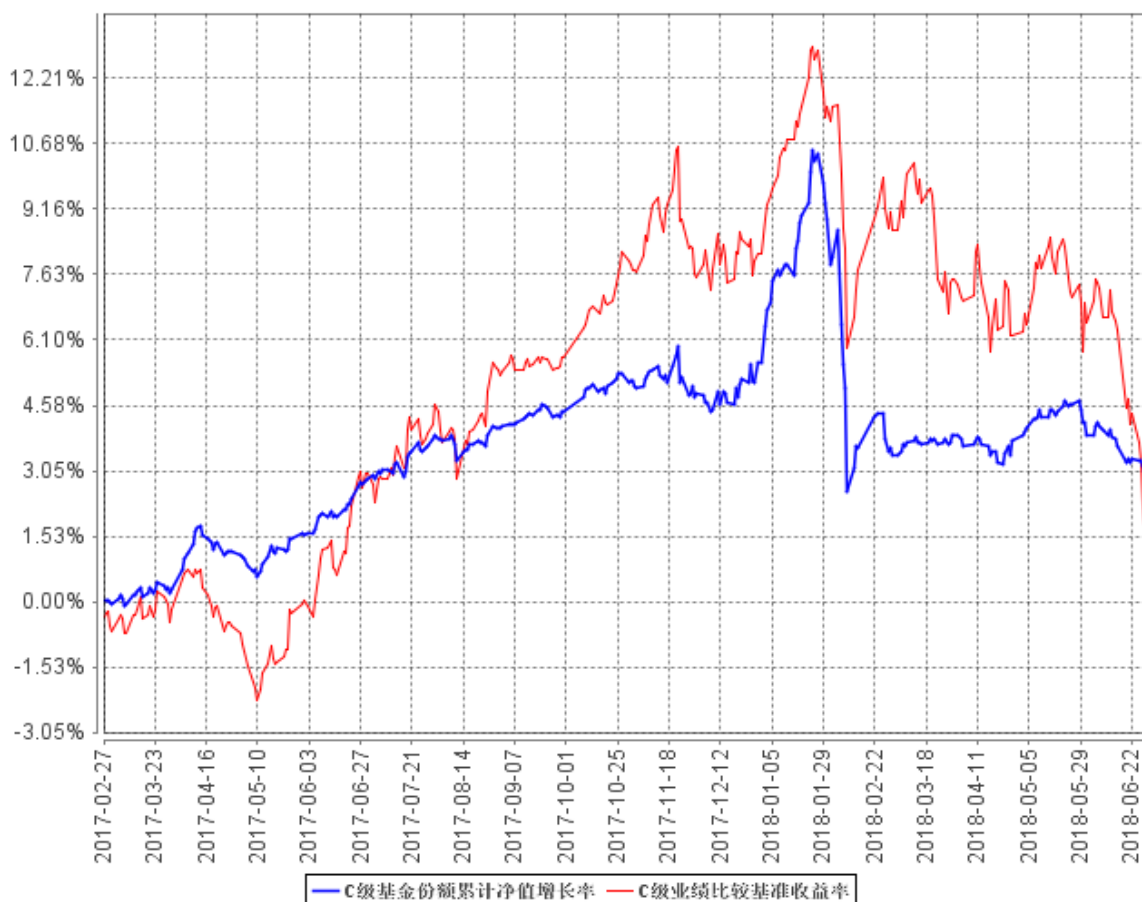
- 1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债指数。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的市场代表性；中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，该指数可以较为全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。
- 2、可比性。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；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

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、成都设有分公司，在深圳设有营销中心，并拥有长盛基金（香港）有限公司、长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者、特定客户资产管理业务资格和保险资产管理人资格。截至 2018 年 6 月 30 日，基金管理人共管理六十八只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
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	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。

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。				
---	--	--	--	--

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

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

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

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

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金坚持稳健操作思路，固定收益配置抓住有利时机、以高信用资质的中短期信用债、银行同业存单为主要投资标的，较好控制了利率风险、信用风险和流动性风险。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛瑞混合 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 -2.24%；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 -2.34%；同期业绩比较基准收益率为 -4.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中共中央政治局会议指出，当前经济运行稳中有变，面临一些新问题新挑战，外部环境发生明显变化。对于下半年宏观政策动向，保持经济平稳健康发展，坚持实施积极的财政政策和稳健的货币政策，提高政策的前瞻性、灵活性、有效性。财政政策要在扩大内需和结构调整上发挥更

大作用。要把好货币供给总闸门，保持流动性合理充裕。把防范化解金融风险和服务实体经济更好结合起来，坚定做好去杠杆工作，把握好力度和节奏。

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

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

本基金操作层面，根据基金规模变化，做好组合流动性安排。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至 2018 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-775,443.67 元，其中：长盛盛瑞混合 A 期末可供分配利润为-774,794.95 元（未分配利润已实现部分为-171,007.52 元，未分配利润未实现部分为-603,787.43 元），长盛盛瑞混合 C 期末可供分配利润为-648.72 元（未分配利润已实现部分为-180.24 元，未分配利润未实现部分为-468.48 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，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛盛瑞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：长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,025,220.04	952,495.28
结算备付金		295,315.96	97,496.42
存出保证金		58,368.72	59,405.77
交易性金融资产	6.4.7.2	46,013,932.88	198,731,023.12
其中：股票投资		4,057,672.88	125,179,822.82
基金投资		-	-
债券投资		41,956,260.00	73,551,200.30
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	3,100,000.00	1,200,000.00
应收证券清算款		222,524.60	266,625.40
应收利息	6.4.7.5	640,507.97	785,542.35
应收股利		-	-
应收申购款		800.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		51,356,670.17	202,092,588.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	198,299.18
应付赎回款		-	99.57
应付管理人报酬		25,421.08	135,506.25
应付托管费		4,236.80	22,584.39
应付销售服务费		6.49	5.19
应付交易费用	6.4.7.7	3,763.82	7,543.29
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	53,630.98	135,000.00
负债合计		87,059.17	499,037.87
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	52,045,054.67	200,047,935.55
未分配利润	6.4.7.10	-775,443.67	1,545,614.92
所有者权益合计		51,269,611.00	201,593,550.47
负债和所有者权益总计		51,356,670.17	202,092,588.34

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，长盛盛瑞混合 A 份额净值人民币 0.9851 元，长盛盛瑞混合 C 份额净值人民币 0.9840 元；基金份额总额 52,045,054.67，其中，长盛盛瑞混合 A 份额总额 52,004,633.53 份，长盛盛瑞混合 C 份额总额 40,421.14 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 27 日(基金合 同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-2,850,685.84	19,512,515.78
1.利息收入		1,629,781.66	5,955,468.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,947.36	104,846.60
债券利息收入		1,406,611.07	3,616,385.41
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		197,223.23	2,234,236.65
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-3,577,627.34	11,013,293.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,501,925.05	9,690,191.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	70,508.64	308,218.78
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	-146,210.93	1,014,883.43

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-902,855.05	2,543,751.97
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	14.89	1.50
减：二、费用		832,724.45	1,800,700.42
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	361,945.22	1,226,957.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	60,324.22	204,492.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	49.28	14.25
4. 交易费用	6.4.7.18	314,281.54	314,160.13
5. 利息支出		23,893.00	-
其中：卖出回购金融资产支出		23,893.00	-
6. 税金及附加		0.21	-
7. 其他费用	6.4.7.19	72,230.98	55,075.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,683,410.29	17,711,815.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,683,410.29	17,711,815.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	200,047,935.55	1,545,614.92	201,593,550.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,683,410.29	-3,683,410.29
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）	-148,002,880.88	1,362,351.70	-146,640,529.18
其中：1.基金申购款	35,120.04	759.64	35,879.68
2.基金赎回款	-148,038,000.92	1,361,592.06	-146,676,408.86
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）	-	-	-

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。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。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛瑞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、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债及其他经中国证监会允许基金投资的债券)、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具、同业存单、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：50%×沪深 300 指数收益率+50%×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》、《长盛盛瑞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。

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

于 2018 年 6 月 30 日，所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的

金额计量，其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整的反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金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。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	1,025,220.04
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	1,025,220.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,896,943.05	4,057,672.88	-839,270.17

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,602,010.00	2,600,260.00
	银行间市场	39,328,010.00	39,356,000.00
	合计	41,930,020.00	41,956,260.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	46,826,963.05	46,013,932.88	-813,030.17

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

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 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	3,100,000.00	-
合计	3,100,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	184.46
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	119.52
应收债券利息	640,702.65
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-522.33
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	23.67
合计	640,507.97

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,763.82
银行间市场应付交易费用	1,000.00
合计	3,763.82

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
预提费用	53,630.98
合计	53,630.98

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛瑞混合 A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	200,013,552.10	200,013,552.10
本期申购	2,417.32	2,417.32
本期赎回(以“-”号填列)	-148,011,335.89	-148,011,335.89
- 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	52,004,633.53	52,004,633.53

金额单位：人民币元

长盛盛瑞混合 C		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,383.45	34,383.45
本期申购	32,702.72	32,702.72
本期赎回(以“-”号填列)	-26,665.03	-26,665.03

- 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	40,421.14	40,421.14

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长盛盛瑞混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,985,992.51	-440,637.42	1,545,355.09
本期利润	-2,779,418.01	-902,128.78	-3,681,546.79
本期基金份额交易产生的变动数	622,417.98	738,978.77	1,361,396.75
其中：基金申购款	-10.79	-8.45	-19.24
基金赎回款	622,428.77	738,987.22	1,361,415.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-171,007.52	-603,787.43	-774,794.95

单位：人民币元

长盛盛瑞混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	335.31	-75.48	259.83
本期利润	-1,137.23	-726.27	-1,863.50
本期基金份额交易产生的变动数	621.68	333.27	954.95
其中：基金申购款	445.34	333.54	778.88
基金赎回款	176.34	-0.27	176.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-180.24	-468.48	-648.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	20,364.34
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	5,239.34
其他	343.68
合计	25,947.36

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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	154,524,047.75
减：卖出股票成本总额	158,025,972.80
买卖股票差价收入	-3,501,925.05

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 2018年1月1日至2018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	70,508.64
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	70,508.64

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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	218,442,258.09
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	215,514,650.00
减：应收利息总额	2,857,099.45
买卖债券差价收入	70,508.64

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	-146,210.93
基金投资产生的股利收益	-

合计	-146,210.93
----	-------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-902,855.05
——股票投资	-1,044,254.75
——债券投资	141,399.70
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-902,855.05

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	14.89
合计	14.89

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	311,431.54
银行间市场交易费用	2,850.00
合计	314,281.54

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	19,835.79
上清所帐户维护费	13,500.00

银行间账户维护费	13,500.00
其他	600.00
合计	72,230.98

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

截至本财务报表批准报出日止，本基金最后运作日所持交易性金融资产均已变现，变现产生的证券清算款已于 2018 年 7 月 25 日划入本基金托管账户。

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”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 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

无。

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
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 2 月 27 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	361,945.22	1,226,957.42
其中:支付销售机构的客户维护费	19.71	3.22

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 27 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	60,324.22	204,492.94

注: 支付基金托管人平安银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

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固有资金投资本基金的情况

无。

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

无。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 2 月 27 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	期末余额	当期利息收入
平安银行	1,025,220.04	20,364.34	3,255,348.46	79,740.21

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，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

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2018 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

无。

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
000566	海南海药	2017 年 11 月 22 日	重大事 项停牌	13.00	2018 年 7 月 9 日	11.60	91,300	1,194,147.18	1,186,900.00	-
600221	海航控股	2018 年 1 月 10 日	重大事 项停牌	2.61	2018 年 7 月 20 日	2.91	396,000	1,281,254.55	1,033,560.00	-
000793	华闻传媒	2018 年 2 月 1 日	重大事 项停牌	6.89	2018 年 7 月 16 日	7.56	115,892	1,196,154.15	798,495.88	-

注：本基金截至 2018 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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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。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、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。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。

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平安银行，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 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,600,260.00	14,863,500.00
合计	2,600,260.00	14,863,500.00

注：未评级债券为国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	39,356,000.00	58,580,000.00
合计	39,356,000.00	58,580,000.00

6.4.13.2.4 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 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	107,700.30
未评级	-	-
合计	-	107,700.30

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。

于 2018 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。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持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，部分基金资产流

通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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、债券投资和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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2018 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	1,025,220.04	-	-	-	1,025,220.04
结算备付金	295,315.96	-	-	-	295,315.96
存出保证金	58,368.72	-	-	-	58,368.72
交易性金融资产	41,956,260.00	-	-	4,057,672.88	46,013,932.88
买入返售金融资产	3,100,000.00	-	-	-	3,100,000.00
应收证券清算款	-	-	-	222,524.60	222,524.60
应收利息	-	-	-	640,507.97	640,507.97
应收申购款	-	-	-	800.00	800.00
资产总计	46,435,164.72	-	-	4,921,505.45	51,356,670.17
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	25,421.08	25,421.08
应付托管费	-	-	-	4,236.80	4,236.80
应付销售服务费	-	-	-	6.49	6.49
应付交易费用	-	-	-	3,763.82	3,763.82
其他负债	-	-	-	53,630.98	53,630.98
负债总计	-	-	-	87,059.17	87,059.17
利率敏感度缺口	46,435,164.72	-	-	4,834,446.28	51,269,611.00
上年度末 2017 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	952,495.28	-	-	-	952,495.28
结算备付金	97,496.42	-	-	-	97,496.42
存出保证金	59,405.77	-	-	-	59,405.77
交易性金融资产	73,443,500.00	107,700.30	-	125,179,822.82	198,731,023.12
买入返售金融资产	1,200,000.00	-	-	-	1,200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	266,625.40	266,625.40
应收利息	-	-	-	785,542.35	785,542.35
资产总计	75,752,897.47	107,700.30	-	126,231,990.57	202,092,588.34
负债					
应付证券清算款	-	-	-	198,299.18	198,299.18
应付赎回款	-	-	-	99.57	99.57
应付管理人报酬	-	-	-	135,506.25	135,506.25
应付托管费	-	-	-	22,584.39	22,584.39
应付销售服务费	-	-	-	5.19	5.19
应付交易费用	-	-	-	7,543.29	7,543.29
其他负债	-	-	-	135,000.00	135,000.00
负债总计	-	-	-	499,037.87	499,037.87
利率敏感度缺口	75,752,897.47	107,700.30	-	125,732,952.70	201,593,550.47

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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月 31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	6,996.08	37,746.05
	2. 市场利率上升 25 个基点	-6,996.08	-37,746.05

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。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0-95%，权证投资占基金资产净值的 0%-3%。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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	4,057,672.88	7.91	125,179,822.82	62.10
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,057,672.88	7.91	125,179,822.82	62.10

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2018 年 6 月 30 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 7.91%，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。于 2017 年 12 月 31 日，本基金的运营期小于一年，无足够的经验数据对其他价格风险的敏感性进行分析。

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 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额 1,038,717.00 元，属于第二层次的余额为 44,975,215.88 元，无属于第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第一层次的余额 117,965,999.97 元，属于第二层次的余额为 80,765,023.15 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输

入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	4,057,672.88	7.90
	其中：股票	4,057,672.88	7.90
2	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	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	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	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,320,536.00	2.57
7	其他各项资产	922,201.29	1.80
8	合计	51,356,670.17	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	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

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601939	建设银行	8,333,222.00	4.13
2	600036	招商银行	5,922,859.00	2.94
3	601288	农业银行	5,010,892.00	2.49
4	600016	民生银行	4,729,248.00	2.35
5	601988	中国银行	4,594,743.00	2.28
6	601398	工商银行	4,368,764.00	2.17
7	601818	光大银行	3,836,377.00	1.90
8	002926	华西证券	202,330.48	0.10
9	603156	养元饮品	166,828.87	0.08
10	600901	江苏租赁	155,843.75	0.08
11	300741	华宝股份	101,325.00	0.05
12	601838	成都银行	89,465.01	0.04
13	002925	盈趣科技	68,670.00	0.03
14	601828	美凯龙	63,671.52	0.03
15	002929	润建通信	51,540.40	0.03
16	603680	今创集团	47,171.67	0.02

17	300740	御家汇	39,615.18	0.02
18	002928	华夏航空	33,849.60	0.02
19	300739	明阳电路	28,142.60	0.01
20	300733	西菱动力	21,839.70	0.01

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	9,438,743.46	4.68
2	600016	民生银行	6,082,133.00	3.02
3	601398	工商银行	6,015,239.00	2.98
4	600036	招商银行	5,848,202.00	2.90
5	601288	农业银行	5,766,909.00	2.86
6	601988	中国银行	5,739,550.00	2.85
7	601818	光大银行	4,973,075.00	2.47
8	000732	泰禾集团	2,304,501.36	1.14
9	600048	保利地产	2,062,172.24	1.02
10	000671	阳光城	1,819,028.00	0.90
11	002450	康得新	1,771,798.00	0.88
12	000513	丽珠集团	1,615,846.00	0.80
13	601877	正泰电器	1,614,026.00	0.80
14	600004	白云机场	1,612,507.00	0.80
15	002142	宁波银行	1,606,052.50	0.80
16	002202	金风科技	1,540,095.00	0.76
17	600352	浙江龙盛	1,536,326.00	0.76
18	601009	南京银行	1,530,423.88	0.76
19	600104	上汽集团	1,490,067.24	0.74
20	601998	中信银行	1,467,359.00	0.73

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	37,948,077.61
卖出股票收入（成交）总额	154,524,047.75

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	2,600,260.00	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

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	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

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

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 and 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，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。

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	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

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（可交换债券）。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000566	海南海药	1,186,900.00	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

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
长盛盛瑞混合 A	36	1,444,573.15	52,000,000.00	99.99%	4,633.53	0.01%
长盛盛瑞混合 C	171	236.38	0.00	0.00%	40,421.14	100.00%
合计	207	251,425.38	52,000,000.00	99.91%	45,054.67	0.09%

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	长盛盛瑞混合 A	0.00	0.0000%
	长盛盛瑞混合 C	1,096.07	2.7116%
	合计	1,096.07	0.0021%

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛瑞混合 A	长盛盛瑞混合 C
基金合同生效日（2017 年 2 月 27 日）基金份额总额	599,997,099.95	21,301.57
本报告期期初基金份额总额	200,013,552.10	34,383.45
本报告期基金总申购份额	2,417.32	32,702.72
减：本报告期基金总赎回份额	148,011,335.89	26,665.03
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	52,004,633.53	40,421.14

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2018 年 6 月 20 日发布《关于以通讯开会方式召开长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，本次基金份额持有人大会的审议事项为《关于终止长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，投票期为：2018 年 6 月 20 日至 2018 年 7 月 22 日。截至本报告期末尚未计票产生基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

原督察长叶金松先生因退休离任，由张利宁女士担任本公司督察长。

上述变更事项已经公司第七届董事会第七次会议审议通过，并按规定向相关监管机构备案。2018 年 4 月 27 日，中国证券监督管理委员会北京监管局作出《关于对长盛基金管理有限公司拟任合规负责人任职资格的意见》（京证监发〔2018〕136 号），对张利宁女士担任本公司督察长无异议。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为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	
东北证券	2	191,320,152.75	100.00%	139,916.06	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
东北证券	6,183,230.75	100.00%	575,700,000.00	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、本基金租用证券公司深圳交易单元为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(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	关于以通讯开会方式召开长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《中国证券报》及本公司网站	2018年6月22日
2	关于以通讯开会方式召开长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	同上	2018年6月21日
3	关于以通讯开会方式召开长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	同上	2018年6月20日
4	长盛基金管理有限公司高级管理人员督察长变更的公告	同上	2018年5月3日
5	长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	同上	2018年4月20日
6	长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2018年4月13日
7	长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2018年4月13日
8	长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金 2017 年度报告摘要	同上	2018年3月31日
9	长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金 2017 年度报告	同上	2018年3月31日
10	关于修改长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同等法律文件的公告	同上	2018年3月23日
11	长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金托管协议	同上	2018年3月23日
12	长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更	同上	2018年3月23日

	新)		
13	长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金合同	同上	2018 年 3 月 22 日
14	长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	同上	2018 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	20180101~20180630	99,999,000.00	0.00	73,999,000.00	26,000,000.00	49.96%
	2	20180101~20180630	99,999,000.00	0.00	73,999,000.00	26,000,000.00	49.96%
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。

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8月29日