

# 长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	62
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>65</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.....	65

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>66</b>
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长盛盛世混合	
基金主代码	002156	
交易代码	002156	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 12 月 11 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	282,904,966.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C
下属分级基金的交易代码:	002156	002157
报告期末下属分级基金的份额总额	249,355,197.44 份	33,549,768.75 份

注：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金于 2015 年 12 月 11 日成立，后经《关于准予长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可【2021】1282 号）变更注册，并经份额持有人大会表决于 2021 年 6 月 21 日通过了《关于长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金选任新任基金托管人有关事项的议案》，修订后的《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2021 年 6 月 21 日生效。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在有效控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	<p>（一）大类资产配置</p> <p>本基金将通过深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>在新股投资方面，本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面，运用基金管理人的研究平台和股票估值体系，深入发掘新股内在价值，结合市场估值水平和股市投资环境，充分考虑中签率、锁定期等因素，有效识别并防范风险，以获取较好收益。</p> <p>在行业配置策略上，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>在个股配置策略上，本基金将通过定量与定性相结合的评估方法，对上市公司的增长前景进行分析，力争所选择的企业具备长期竞争优势。</p>

	同时，本基金将根据经济发展状况、产业结构升级、技术发展状况及国家相关政策因素对配置的行业和上市公司进行动态调整。此外，基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对投资组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	李申
	联系电话	010-86497608	021-60637102
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-86497888	021-60637111
传真		010-86497999	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100029	100033
法定代表人		周兵	田国立

注：1、长盛基金管理有限公司法定代表人已于 2021 年 7 月 21 日变更为高民和。

2、经基金份额持有人大会表决于 2021 年 6 月 21 日通过了《关于长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金选任新任基金托管人有关事项的议案》，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

### 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》
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	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	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼 中建财富国际中心 3-5 层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	34,253,162.96	10,281,374.70
本期利润	12,309,868.31	-298,413.29
加权平均基金份额本期利润	0.0429	-0.0032
本期加权平均净值利润率	3.48%	-0.26%
本期基金份额净值增长率	3.68%	3.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	49,749,143.13	6,388,289.09
期末可供分配基金份额利润	0.1995	0.1904
期末基金资产净值	317,210,771.90	42,328,420.97
期末基金份额净值	1.2721	1.2617
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	50.99%	42.30%

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、修订后的《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效日为2021年6月21日，本报告中的财务指标、图表、净值表现、投资组合报告等内容，不受该合同生效日变更影响，仍保持历史数据的延续性，以2015年12月11日（初始成立日）为起始日进行编制。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛盛世混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.48%	0.51%	-0.91%	0.41%	1.39%	0.10%
过去三个月	6.63%	0.52%	2.42%	0.49%	4.21%	0.03%



过去六个月	3.68%	0.74%	1.47%	0.66%	2.21%	0.08%
过去一年	17.62%	0.61%	14.21%	0.66%	3.41%	-0.05%
过去三年	46.76%	0.76%	32.81%	0.68%	13.95%	0.08%
自基金合同生效起至今	50.99%	0.63%	36.90%	0.62%	14.09%	0.01%

## 长盛盛世混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.45%	0.52%	-0.91%	0.41%	1.36%	0.11%
过去三个月	6.56%	0.52%	2.42%	0.49%	4.14%	0.03%
过去六个月	3.59%	0.74%	1.47%	0.66%	2.12%	0.08%
过去一年	17.46%	0.61%	14.21%	0.66%	3.25%	-0.05%
过去三年	45.78%	0.76%	32.81%	0.68%	12.97%	0.08%
自基金合同生效起至今	42.30%	0.62%	36.90%	0.62%	5.40%	0.00%

注：1、本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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

基准指数的构建考虑了三个原则：

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

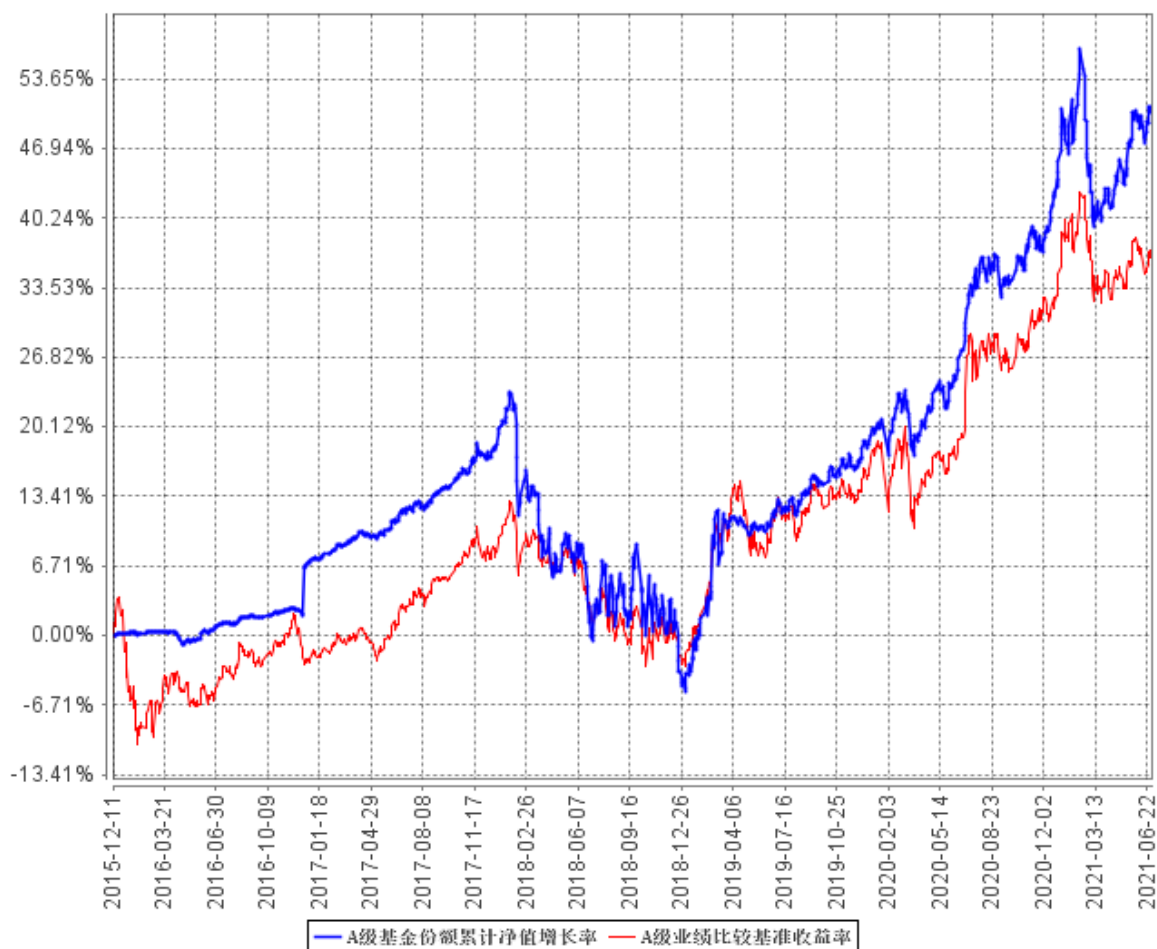
(2) 可比性。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可使业绩比较更具有合理性。

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

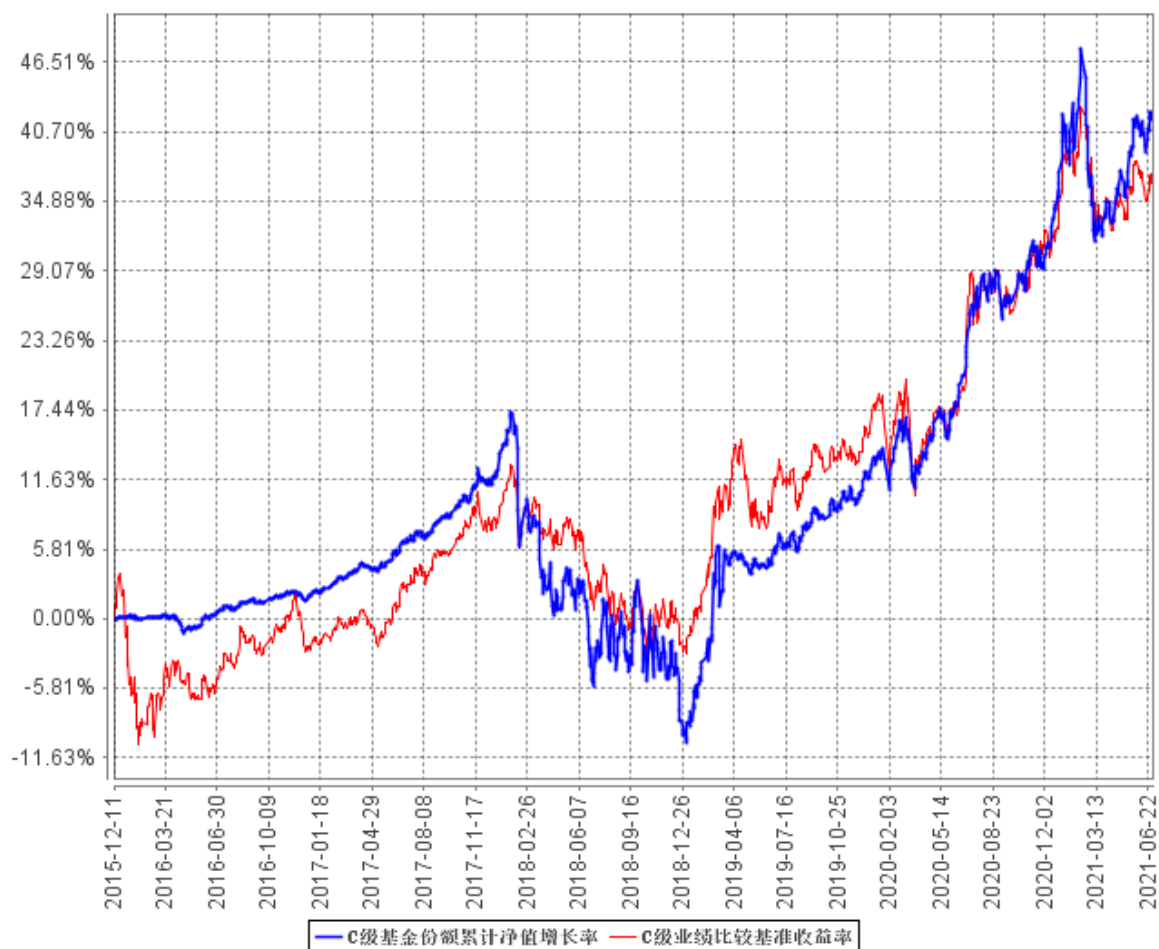
2、为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2015 年 12 月 11 日（初始成立日）为起始日进行编制。

### 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、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。

2、为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2015 年 12 月 11 日（初始成立日）为起始日进行编制。

## § 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 2.06 亿元。长盛基金总部办公地位于北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，并拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。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%。公司拥有公募基金、全国社保基金、私募资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格。截至 2021 年 6 月 30 日，基金管理人共管理六十七只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。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，长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理，长盛信息安全量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016年9月12日	-	16年	李琪先生，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。
付海宁	本基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛多因子策略优选股票型证券投资基金基金经理。	2020年12月22日	-	12年	付海宁先生，硕士。曾任职于美国摩根士丹利、美银美林、标准普尔资产管理等公司。曾任前海开源基金管理有限公司基金经理，2019年12月加入长盛基金管理有限公司。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。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 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

上半年，股市总体呈震荡上涨行情。年初至春节前，股市延续 2020 年四季度上行趋势，呈现加速上涨走势。春节后至 3 月下旬，通胀预期高企叠加大多数白马股和成长股拥挤交易、估值偏贵，抱团股快速杀跌。4 月以来，股市震荡回升，成长股走出修复行情，高景气度个股创出年内新高，锂电和动力电池、新能源汽车、医美、CXO 等板块表现强势。

债市总体维持震荡走势。年初至 2 月中旬，资金超预期紧张，风险资产上涨，通胀预期上行，债市震荡下跌，10 年国债收益率上行至 3.3% 附近。2 月下旬至 5 月底，货币政策未如预期般收紧，专项债发行偏缓，资金面持续宽松，推动债市走强。2 月 18 日至 5 月底，10 年国债和 10 年国开债收益率下行均超 20bp。6 月以来，资金面边际收紧，地方债发行提速，市场乐观预期有所修正，债市呈震荡走势。

###### 2、报告期内本基金投资策略分析

组合操作上，本基金始终坚持稳健投资原则，紧密跟踪产业链动向和市场形势变化，不断优化组合资产配置结构，在稳健投资的基础上尽力寻求组合收益和风险的平衡。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛世混合 A 基金份额净值为 1.2721 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.68%；截至本报告期末长盛盛世混合 C 基金份额净值为 1.2617 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.59%；同期业绩比较基准收益率为 1.47%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自 2020 年疫情爆发以来，中美经济表现错位。展望下半年，这种经济错位现象将继续延续。伴随疫苗接种率提高和疫情改善，美国经济逐步由复苏走向强劲增长，而国内经济在经历自去年二季度以来的修复后面临增长动能趋缓的态势，表现在消费复苏不及预期，出口和地产投资存在不确定性，大宗商品涨价挤压中下游行业利润等方面。为应对中美经济增长不同步和国内经济增长动能放缓压力，国内宏观调控料将加大逆周期调节力度，在美联储逐步开启紧缩政策之前，国内货币政策料将稳健趋松，适时运用降准等政策措施提振经济。

展望后市，国内股市将延续结构性行情，高景气度以及供需格局持续偏紧行业个股仍具有良好的投资机会，货币政策趋松也将推动国内债市向好表现，收益率中枢料将下移。

#### 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债金融估值中心有限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，本基金本报告期末未实施利润分配。

本基金截至 2021 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 56,137,432.22 元，其中：长盛盛世混合 A 期末可供分配利润为 49,749,143.13 元（未分配利润已实现部分为 49,749,143.13 元，未分配利润未实现部分为 18,106,431.33 元），长盛盛世混合 C 期末可供分配利润为 6,388,289.09 元（未分配利润已实现部分为 6,388,289.09 元，未分配利润未实现部分为 2,390,363.13 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

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,047,927.88	14,090,867.44
结算备付金		291,443.28	267,967.79
存出保证金		83,866.76	207,277.67
交易性金融资产	6.4.7.2	400,957,306.13	600,601,737.66
其中：股票投资		134,030,828.50	172,111,583.00
基金投资		-	-
债券投资		266,926,477.63	428,490,154.66
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	64,300,000.00	30,000,000.00
应收证券清算款		3,118,793.08	735,813.28
应收利息	6.4.7.5	4,465,492.61	8,401,026.02
应收股利		-	-
应收申购款		4,193.70	39,999,998.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		476,269,023.44	694,304,688.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 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		113,039,430.43	89,999,665.00
应付证券清算款		2,852,946.38	10,726,375.82
应付赎回款		202,519.08	348,785.21
应付管理人报酬		179,893.33	281,327.67
应付托管费		59,964.46	93,775.89
应付销售服务费		8,318.08	19,221.15
应付交易费用	6.4.7.7	156,750.92	111,375.61
应交税费		20,499.05	33,199.58

应付利息		111,246.20	31,951.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,262.64	189,000.00
负债合计		116,729,830.57	101,834,677.73
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	282,904,966.19	483,758,163.78
未分配利润	6.4.7.10	76,634,226.68	108,711,846.85
所有者权益合计		359,539,192.87	592,470,010.63
负债和所有者权益总计		476,269,023.44	694,304,688.36

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，长盛盛世混合 A 基金份额净值 1.2721 元，基金份额总额 249,355,197.44 份；长盛盛世混合 C 基金份额净值 1.2617 元，基金份额总额 33,549,768.75 份。长盛盛世混合份额总额合计为 282,904,966.19 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		15,928,054.61	26,828,711.75
1.利息收入		8,301,218.58	4,797,690.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	44,260.73	28,434.07
债券利息收入		8,213,467.85	4,745,848.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		43,490.00	23,407.92
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		39,957,401.30	10,222,729.32
其中：股票投资收益	6.4.7.12	42,090,688.26	7,959,446.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,778,425.18	1,155,238.45
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	645,138.22	1,108,044.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-32,523,082.64	11,808,051.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	192,517.37	240.56
<b>减：二、费用</b>		3,916,599.59	2,173,102.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,395,573.51	1,069,097.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	465,191.19	356,365.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	112,708.42	94,535.31
4. 交易费用	6.4.7.19	593,663.46	202,422.65
5. 利息支出		1,219,460.62	330,543.48
其中：卖出回购金融资产支出		1,219,460.62	330,543.48
6. 税金及附加		22,112.24	12,030.23
7. 其他费用	6.4.7.20	107,890.15	108,107.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		12,011,455.02	24,655,608.87
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		12,011,455.02	24,655,608.87

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	483,758,163.78	108,711,846.85	592,470,010.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,011,455.02	12,011,455.02
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）	-200,853,197.59	-44,089,075.19	-244,942,272.78
其中：1.基金申购款	153,166,891.26	37,393,191.94	190,560,083.20
2.基金赎回款	-354,020,088.85	-81,482,267.13	-435,502,355.98
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)	282,904,966.19	76,634,226.68	359,539,192.87
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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)	349,264,894.92	14,685,588.82	363,950,483.74
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	24,655,608.87	24,655,608.87
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)	14,448,099.33	4,352,236.59	18,800,335.92
其中：1.基金申购款	118,894,402.77	10,187,357.39	129,081,760.16
2.基金赎回款	-104,446,303.44	-5,835,120.80	-110,281,424.24
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)	363,712,994.25	43,693,434.28	407,406,428.53

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>周兵</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

长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”),证监许可[2015]1989号《关于准予长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共382,205,154.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第1347号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年12月11日正式生效,基金

合同生效日的基金份额总额为 382,216,462.07 份基金份额(长盛盛世灵活配置混合基金 A 类份额(以下简称“长盛盛世灵活配 A”)13,184,407.64 份,长盛盛世灵活配置混合基金 C 类份额(以下简称“长盛盛世灵活配置 C”)369,032,054.43 份),包含认购资金利息折合 11,308.07 份(长盛盛世灵活配置 A 为 2,196.74 份,长盛盛世灵活配置 C 为 9,111.33 份)。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为包商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《北京市第一中级人民法院民事裁定书》(2020)京 01 破 270 号之一及中国证监会指定,中国建设银行股份有限公司自包商银行股份有限公司被依法宣告破产之日起担任长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金临时基金托管人。

后经召开基金份额持有人大会于 2021 年 6 月 21 日表决通过了《关于长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金选任新任基金托管人有关事项的议案》,长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司。自 2021 年 6 月 21 日起,原《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效,更换基金托管人后的《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

根据《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用的,并不再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;在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用,而是从该类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。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《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资组合中股票等权益类资产投资占基金资产的比例为 0%-95%;权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止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、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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 2021年6月30日
活期存款	3,047,927.88
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:	3,047,927.88

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	104,058,552.22	134,030,828.50	29,972,276.28
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	33,429,382.61	33,718,477.63
	银行间市场	235,877,677.59	233,208,000.00
	合计	269,307,060.20	266,926,477.63
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	373,365,612.42	400,957,306.13	27,591,693.71

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注: 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 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中: 买断式逆回购
交易所市场	64,300,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	64,300,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注: 无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日



应收活期存款利息	2,230.79
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	118.08
应收债券利息	4,463,109.81
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	33.93
合计	4,465,492.61

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	148,977.60
银行间市场应付交易费用	7,773.32
合计	156,750.92

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.49
应付证券出借违约金	-
预提费用	98,260.15
合计	98,262.64

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛世混合 A		
项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	355,031,740.22	355,031,740.22

本期申购	103,532,951.17	103,532,951.17
本期赎回(以“-”号填列)	-209,209,493.95	-209,209,493.95
- 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	249,355,197.44	249,355,197.44

金额单位：人民币元

长盛盛世混合 C		
项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	128,726,423.56	128,726,423.56
本期申购	49,633,940.09	49,633,940.09
本期赎回(以“-”号填列)	-144,810,594.90	-144,810,594.90
- 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	33,549,768.75	33,549,768.75

注：申购含转换入，赎回含转换出。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长盛盛世混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	26,785,047.09	53,861,063.77	80,646,110.86
本期利润	34,253,162.96	-21,943,294.65	12,309,868.31
本期基金份额交易产生的变动数	-11,289,066.92	-13,811,337.79	-25,100,404.71
其中：基金申购款	9,068,585.32	17,843,865.49	26,912,450.81
基金赎回款	-20,357,652.24	-31,655,203.28	-52,012,855.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,749,143.13	18,106,431.33	67,855,574.46

单位：人民币元

长盛盛世混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,796,837.90	19,268,898.09	28,065,735.99
本期利润	10,281,374.70	-10,579,787.99	-298,413.29
本期基金份额交易产生的变动数	-12,689,923.51	-6,298,746.97	-18,988,670.48

其中：基金申购款	4,349,451.39	6,131,289.74	10,480,741.13
基金赎回款	-17,039,374.90	-12,430,036.71	-29,469,411.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,388,289.09	2,390,363.13	8,778,652.22

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	38,375.75
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	4,718.24
其他	1,166.74
合计	44,260.73

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	208,552,321.60
减：卖出股票成本总额	166,461,633.34
买卖股票差价收入	42,090,688.26

#### 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 2021年1月1日至2021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	-2,778,425.18
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	-2,778,425.18

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	198,625,165.33
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	198,332,033.48
减：应收利息总额	3,071,557.03
买卖债券差价收入	-2,778,425.18

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	645,138.22
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	645,138.22

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-32,523,082.64
——股票投资	-34,439,939.09
——债券投资	1,916,856.45
——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	-32,523,082.64

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	192,517.33
基金转换费收入	0.04
合计	192,517.37

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	591,638.46
银行间市场交易费用	2,025.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	593,663.46

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款费用	10.00
债券账户维护费	18,000.00
其他	620.00
合计	107,890.15

#### 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

无。

## 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

2021 年 2 月 7 日由中国证监会指定中国建设银行股份有限公司为本基金临时基金托管人。后经召开基金份额持有人大会于 2021 年 6 月 21 日通过了《关于长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金选任新任基金托管人有关事项的议案》，盛盛世灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
包商银行股份有限公司（“包商银行”）	基金托管人、基金代销机构(2021 年 2 月 7 日前)
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	① 临时基金托管人（2021 年 2 月 7 日—2021 年 6 月 20 日） ② 基金托管人（自 2021 年 6 月 21 日起）

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：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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,395,573.51	1,069,097.66
其中：支付销售机构的客户维护费	55,551.77	2,343.45

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 0.60%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	465,191.19	356,365.95

注：1、支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

2、本期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）应支付的托管费中，2021 年 1 月 1 日至 2021 年 2 月 7 日支付托管人包商银行的托管费为 120,158.46 元，2021 年 2 月 8 日至 2021 年 6 月 30 日支付托管人建设银行的托管费为 345,032.73 元。上年度可比期间（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日）应支付的托管费均为应支付给包商银行的金额。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C	合计
长盛基金公司	-	49,100.42	49,100.42
包商银行	-	9.80	9.80
合计	-	49,110.22	49,110.22
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C	合计
长盛基金公司	-	92,445.06	92,445.06
包商银行	-	265.40	265.40
合计	-	92,710.46	92,710.46

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给长盛基金公司，再由长盛基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.20%/当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无。

**6.4.10.5.2 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：无。

**6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
包商银行	-	22,372.46	10,782,256.15	24,870.57
建设银行	3,047,927.88	16,003.29	-	-

注：本基金的活期银行存款 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 2 月 25 日由基金托管人包商银行保管，按银行同业利率计息；本基金的活期银行存款 2021 年 2 月 26 日至 2021 年 6 月 30 日由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

注：无。



## 6.4.12 期末（2021 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
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	限售期锁定	9.19	49.61	329	3,023.51	16,321.69	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	限售期锁定	24.60	163.00	601	14,784.60	97,963.00	-
300926	博俊	2020年	2021	限售期	10.76	22.16	359	3,862.84	7,955.44	-

	科技	12月29日	2021年7月12日	锁定						
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	限售期锁定	13.39	30.08	217	2,905.63	6,527.36	-
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	限售期锁定	13.11	24.47	322	4,221.42	7,879.34	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	限售期锁定	24.69	31.70	492	12,147.48	15,596.40	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	限售期锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	限售期锁定	12.25	53.66	244	2,989.00	13,093.04	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	限售期锁定	12.76	43.35	307	3,917.32	13,308.45	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	限售期锁定	9.79	23.00	255	2,496.45	5,865.00	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	限售期锁定	4.56	18.87	474	2,161.44	8,944.38	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	限售期锁定	13.00	27.39	324	2,808.00	8,874.36	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	限售期锁定	28.77	99.89	240	6,904.80	23,973.60	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	限售期锁定	16.53	46.05	232	3,834.96	10,683.60	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	限售期锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	限售期锁定	47.33	252.43	403	19,073.99	101,729.29	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月	限售期锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

		日	29 日							
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	限售期锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	限售期锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	限售期锁定	3.40	22.12	576	1,958.40	12,741.12	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	限售期锁定	12.13	27.73	283	3,432.79	7,847.59	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	限售期锁定	4.54	15.34	507	2,301.78	7,777.38	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	限售期锁定	6.87	14.98	1,162	7,982.94	17,406.76	-
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	限售期锁定	7.19	16.20	430	3,091.70	6,966.00	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	限售期锁定	28.28	145.09	360	10,180.80	52,232.40	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	限售期锁定	5.48	17.07	492	2,696.16	8,398.44	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	限售期锁定	8.42	16.77	593	4,993.06	9,944.61	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	限售期锁定	33.22	105.33	588	19,533.36	61,934.04	-

300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	限售期锁定	48.59	106.28	339	16,472.01	36,028.92	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	限售期锁定	15.83	50.96	317	5,018.11	16,154.32	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	限售期锁定	24.90	27.29	295	7,345.50	8,050.55	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	限售期锁定	14.79	37.23	264	3,904.56	9,828.72	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	限售期锁定	6.79	34.76	301	2,043.79	10,462.76	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	限售期锁定	13.06	34.14	254	3,317.24	8,671.56	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	限售期锁定	9.36	26.89	200	1,872.00	5,378.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	限售期锁定	12.10	23.23	410	4,961.00	9,524.30	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	限售期锁定	14.72	28.81	191	2,811.52	5,502.71	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	限售期锁定	20.81	50.60	241	5,015.21	12,194.60	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	限售期锁定	18.71	76.32	201	3,760.71	15,340.32	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	限售期锁定	7.81	28.93	312	2,436.72	9,026.16	-

			日							
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	限售期锁定	12.54	31.22	801	10,044.54	25,007.22	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	限售期锁定	7.83	22.61	218	1,706.94	4,928.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	限售期锁定	14.20	44.02	175	2,485.00	7,703.50	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	限售期锁定	8.05	32.12	170	1,368.50	5,460.40	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	限售期锁定	8.72	35.33	471	4,107.12	16,640.43	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	限售期锁定	7.64	54.81	462	3,529.68	25,322.22	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	限售期锁定	13.75	41.07	275	3,781.25	11,294.25	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	限售期锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	限售期锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	限售期锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	限售期锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
688201	信安世纪	2021年4月13日	2021年10月	限售期锁定	26.78	47.46	2,129	57,014.62	101,042.34	-

		日	月 21 日							
688217	睿昂 基因	2021 年 5 月 7 日	2021 年 11 月 17 日	限售期 锁定	18.42	78.01	1,040	19,156.80	81,130.40	-
688239	航宇 科技	2021 年 6 月 25 日	2022 年 1 月 5 日	限售期 锁定	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688260	昀冢 科技	2021 年 3 月 25 日	2021 年 10 月 8 日	限售期 锁定	9.63	19.43	2,990	28,793.70	58,095.70	-
688316	青云 科技	2021 年 3 月 5 日	2021 年 9 月 16 日	限售期 锁定	63.70	64.98	1,428	90,963.60	92,791.44	-
688323	瑞华 泰	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 28 日	限售期 锁定	5.97	29.08	4,513	26,942.61	131,238.04	-
688425	铁建 重工	2021 年 6 月 11 日	2021 年 12 月 22 日	限售期 锁定	2.87	5.77	43,599	125,129.13	251,566.23	-
688597	煜邦 电力	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	限售期 锁定	5.88	12.07	3,907	22,973.16	47,157.49	-
688613	奥精 医疗	2021 年 5 月 13 日	2021 年 11 月 22 日	限售期 锁定	16.43	82.75	2,617	42,997.31	216,556.75	-
688616	西力 科技	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 22 日	限售期 锁定	7.35	13.77	3,918	28,797.30	53,950.86	-
688626	翔宇 医疗	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	限售期 锁定	28.82	108.33	3,652	105,250.64	395,621.16	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的

股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年6月17日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	1,020	102,000.00	102,000.00	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 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

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 113,039,430.43 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101556023	15 闽高速 MTN001	2021年7月2日	102.15	100,000	10,215,000.00
101800346	18 京能洁能 MTN001	2021年7月2日	103.45	22,000	2,275,900.00
101760073	17 陕煤化 MTN004	2021年7月2日	104.06	100,000	10,406,000.00
101801337	18 中建材 MTN004	2021年7月2日	100.98	100,000	10,098,000.00
102001408	20 河钢集 MTN008	2021年7月2日	97.95	195,000	19,100,250.00
101800206	18 陕交建	2021年7月	104.39	300,000	31,317,000.00

	MTN001	2 日			
101754014	17 恒健 MTN001	2021 年 7 月 2 日	101.35	100,000	10,135,000.00
102000053	20 鲁能源 MTN001	2021 年 7 月 2 日	100.40	200,000	20,080,000.00
101761006	17 首钢 MTN002	2021 年 7 月 2 日	101.87	100,000	10,187,000.00
合计				1,217,000	123,814,150.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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，属证券投资基金中的较高风险品种。本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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和合理保持流动性的基础上，力争为投资者谋求稳健的投资收益。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金托管人中国建设银行，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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	19,148,472.00	24,281,570.00
合计	19,148,472.00	24,281,570.00

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	184,491,221.10	285,936,477.90
AAA 以下	92,128.13	167,370.36
未评级	63,194,656.40	118,104,736.40
合计	247,778,005.63	404,208,584.66

注：未评级债券为国债和政策性金融债。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：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 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 113,039,430.43 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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约为未折现的合约到期现金流量。

#### **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》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、流通受限制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%，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%(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%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合上述要求。

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。于 2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

#### 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未来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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2021年6月30日					
资产					
银行存款	3,047,927.88	-	-	-	3,047,927.88
结算备付金	291,443.28	-	-	-	291,443.28
存出保证金	83,866.76	-	-	-	83,866.76
交易性金融资产	69,878,472.00	191,380,023.70	5,667,981.93	134,030,828.50	400,957,306.13
买入返售金融资产	64,300,000.00	-	-	-	64,300,000.00
应收证券清算款	-	-	-	3,118,793.08	3,118,793.08
应收利息	-	-	-	4,465,492.61	4,465,492.61
应收申购款	-	-	-	4,193.70	4,193.70
资产总计	137,601,709.92	191,380,023.70	5,667,981.93	141,619,307.89	476,269,023.44
负债					
卖出回购金融资产款	113,039,430.43	-	-	-	113,039,430.43
应付证券清算款	-	-	-	2,852,946.38	2,852,946.38
应付赎回款	-	-	-	202,519.08	202,519.08
应付管理人报酬	-	-	-	179,893.33	179,893.33
应付托管费	-	-	-	59,964.46	59,964.46
应付销售服务费	-	-	-	8,318.08	8,318.08
应付交易费用	-	-	-	156,750.92	156,750.92
应付利息	-	-	-	111,246.20	111,246.20
应交税费	-	-	-	20,499.05	20,499.05
其他负债	-	-	-	98,262.64	98,262.64
负债总计	113,039,430.43	-	-	3,690,400.14	116,729,830.57
利率敏感度缺口	24,562,279.49	191,380,023.70	5,667,981.93	137,928,907.75	359,539,192.87
上年度末					
2020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	14,090,867.44	-	-	-	14,090,867.44
结算备付金	267,967.79	-	-	-	267,967.79
存出保证金	207,277.67	-	-	-	207,277.67
交易性金融资产	91,292,377.36	283,809,879.60	53,387,897.70	172,111,583.00	600,601,737.66
买入返售金融资产	30,000,000.00	-	-	-	30,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	735,813.28	735,813.28
应收利息	-	-	-	8,401,026.02	8,401,026.02
应收申购款	-	-	-	39,999,998.50	39,999,998.50
资产总计	135,858,490.26	283,809,879.60	53,387,897.70	221,248,420.80	694,304,688.36
负债					
卖出回购金融资产	89,999,665.00	-	-	-	89,999,665.00

产款					
应付证券清算款	-	-	-	10,726,375.82	10,726,375.82
应付赎回款	-	-	-	348,785.21	348,785.21
应付管理人报酬	-	-	-	281,327.67	281,327.67
应付托管费	-	-	-	93,775.89	93,775.89
应付销售服务费	-	-	-	19,221.15	19,221.15
应付交易费用	-	-	-	111,375.61	111,375.61
应付利息	-	-	-	31,951.80	31,951.80
应交税费	-	-	-	33,199.58	33,199.58
其他负债	-	-	-	189,000.00	189,000.00
负债总计	89,999,665.00	-	-	11,835,012.73	101,834,677.73
利率敏感度缺口	45,858,825.26	283,809,879.60	53,387,897.70	209,413,408.07	592,470,010.63

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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,288,881.26	2,721,988.31
2. 市场利率上升 25 个基点	-1,288,881.26	-2,721,988.31	

#### 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等权益类资产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%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。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。

#### 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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	134,030,828.50	37.28	172,111,583.00	29.05
合计	134,030,828.50	37.28	172,111,583.00	29.05

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	14,264,377.71	18,497,070.74
2. 业绩比较基准下降 5%	-14,264,377.71	-18,497,070.74	

#### 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 2021 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 132,916,040.02 元，第二层次的余额为 268,041,266.11 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 168,836,739.37 元，属于第二层次的余额为 431,764,998.29 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 2021 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(2020 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	134,030,828.50	28.14
	其中：股票	134,030,828.50	28.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	266,926,477.63	56.05
	其中：债券	266,926,477.63	56.05
	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	64,300,000.00	13.50
	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	3,339,371.16	0.70
8	其他各项资产	7,672,346.15	1.61
9	合计	476,269,023.44	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	14,743.38	0.00
B	采矿业	6,798,700.00	1.89
C	制造业	77,047,581.29	21.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,576,620.39	1.27
E	建筑业	27,168.76	0.01
F	批发和零售业	104,931.08	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	244,495.54	0.07
J	金融业	19,535,462.82	5.43
K	房地产业	602,442.56	0.17
L	租赁和商务服务业	900,300.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	13,800,728.00	3.84
N	水利、环境和公共设施管理业	43,647.68	0.01



O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,334,007.00	2.87
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	134,030,828.50	37.28

### 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：报告期末未持有港股通投资股票投资组合。

### 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	000858	五粮液	59,200	17,635,088.00	4.90
2	600519	贵州茅台	6,306	12,969,550.20	3.61
3	600036	招商银行	165,000	8,941,350.00	2.49
4	600763	通策医疗	13,400	5,507,400.00	1.53
5	603259	药明康德	34,200	5,355,378.00	1.49
6	300760	迈瑞医疗	10,100	4,848,505.00	1.35
7	000568	泸州老窖	20,500	4,836,770.00	1.35
8	002142	宁波银行	116,933	4,556,879.01	1.27
9	300012	华测检测	115,000	3,666,200.00	1.02
10	600900	长江电力	165,000	3,405,600.00	0.95
11	601012	隆基股份	38,200	3,393,688.00	0.94
12	601166	兴业银行	160,000	3,288,000.00	0.91
13	600276	恒瑞医药	46,166	3,137,903.02	0.87
14	300347	泰格医药	15,000	2,899,500.00	0.81
15	000333	美的集团	37,500	2,676,375.00	0.74
16	603127	昭衍新药	14,200	2,609,250.00	0.73
17	601699	潞安环能	200,000	2,362,000.00	0.66
18	002594	比亚迪	8,907	2,235,657.00	0.62
19	002415	海康威视	34,600	2,231,700.00	0.62
20	600690	海尔智家	85,800	2,223,078.00	0.62
21	300759	康龙化成	10,000	2,169,900.00	0.60
22	300750	宁德时代	4,000	2,139,200.00	0.59
23	603501	韦尔股份	6,500	2,093,000.00	0.58
24	600809	山西汾酒	4,475	2,004,800.00	0.56
25	300015	爱尔眼科	27,150	1,927,107.00	0.54
26	300122	智飞生物	10,000	1,867,300.00	0.52

27	000983	山西焦煤	220,000	1,828,200.00	0.51
28	000001	平安银行	76,021	1,719,595.02	0.48
29	000661	长春高新	4,000	1,548,000.00	0.43
30	600188	兖州煤业	100,000	1,536,000.00	0.43
31	600887	伊利股份	39,607	1,458,725.81	0.41
32	002156	通富微电	50,000	1,202,000.00	0.33
33	600025	华能水电	200,000	1,158,000.00	0.32
34	600438	通威股份	25,000	1,081,750.00	0.30
35	601898	中煤能源	150,000	1,072,500.00	0.30
36	002709	天赐材料	10,000	1,065,800.00	0.30
37	300059	东方财富	31,401	1,029,638.79	0.29
38	601888	中国中免	3,000	900,300.00	0.25
39	002508	老板电器	16,000	744,000.00	0.21
40	300124	汇川技术	9,600	712,896.00	0.20
41	300896	爱美客	892	703,680.96	0.20
42	600048	保利地产	50,000	602,000.00	0.17
43	603456	九洲药业	12,000	582,960.00	0.16
44	002050	三花智控	20,000	479,600.00	0.13
45	688626	翔宇医疗	3,652	395,621.16	0.11
46	688161	威高骨科	2,492	264,276.60	0.07
47	688425	铁建重工	43,599	251,566.23	0.07
48	688613	奥精医疗	2,617	216,556.75	0.06
49	300862	蓝盾光电	5,843	211,867.18	0.06
50	300973	立高食品	993	150,347.40	0.04
51	688323	瑞华泰	4,513	131,238.04	0.04
52	300978	东箭科技	5,930	107,558.34	0.03
53	300957	贝泰妮	403	101,729.29	0.03
54	688201	信安世纪	2,129	101,042.34	0.03
55	688678	福立旺	4,198	99,492.60	0.03
56	300919	中伟股份	601	97,963.00	0.03
57	688316	青云科技	1,428	92,791.44	0.03
58	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
59	688217	睿昂基因	1,040	81,130.40	0.02
60	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
61	300979	华利集团	588	61,934.04	0.02
62	688260	昀冢科技	2,990	58,095.70	0.02
63	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
64	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
65	688616	西力科技	3,918	53,950.86	0.02

66	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
67	688597	煜邦电力	3,907	47,157.49	0.01
68	605123	派克新材	599	45,643.80	0.01
69	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
70	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
71	300981	中红医疗	339	36,028.92	0.01
72	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
73	301015	百洋医药	462	25,322.22	0.01
74	301009	可靠股份	801	25,007.22	0.01
75	300953	震裕科技	240	23,973.60	0.01
76	605268	王力安防	1,642	22,659.60	0.01
77	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
78	300968	格林精密	1,162	17,406.76	0.00
79	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
80	301013	利和兴	471	16,640.43	0.00
81	300614	百川畅银	329	16,321.69	0.00
82	300982	苏文电能	317	16,154.32	0.00
83	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
84	300932	三友联众	492	15,596.40	0.00
85	301002	崧盛股份	201	15,340.32	0.00
86	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
87	300940	南极光	307	13,308.45	0.00
88	300937	药易购	244	13,093.04	0.00
89	300962	中金辐照	576	12,741.12	0.00
90	300985	致远新能	445	12,384.05	0.00
91	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
92	300996	普联软件	241	12,194.60	0.00
93	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
94	301016	雷尔伟	275	11,294.25	0.00
95	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
96	300955	嘉亨家化	232	10,683.60	0.00
97	300948	冠中生态	379	10,464.41	0.00
98	300987	川网传媒	301	10,462.76	0.00
99	605005	合兴股份	634	10,321.52	0.00
100	300986	志特新材	264	9,828.72	0.00
101	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
102	300993	玉马遮阳	410	9,524.30	0.00
103	301004	嘉益股份	312	9,026.16	0.00
104	300945	曼卡龙	474	8,944.38	0.00

105	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
106	300991	创益通	254	8,671.56	0.00
107	300975	商络电子	492	8,398.44	0.00
108	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
109	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
110	300926	博俊科技	359	7,955.44	0.00
111	300930	屹通新材	322	7,879.34	0.00
112	300963	中洲特材	283	7,847.59	0.00
113	300967	晓鸣股份	507	7,777.38	0.00
114	301011	华立科技	175	7,703.50	0.00
115	300972	万辰生物	430	6,966.00	0.00
116	300927	江天化学	217	6,527.36	0.00
117	300943	春晖智控	255	5,865.00	0.00
118	300995	奇德新材	191	5,502.71	0.00
119	301012	扬电科技	170	5,460.40	0.00
120	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
121	300992	泰福泵业	200	5,378.00	0.00
122	301010	晶雪节能	218	4,928.98	0.00
123	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
124	300917	特发服务	16	442.56	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	600036	招商银行	8,778,869.22	1.48
2	601166	兴业银行	7,516,449.00	1.27
3	002594	比亚迪	5,977,001.60	1.01
4	601888	中国中免	5,566,043.00	0.94
5	002142	宁波银行	5,094,150.66	0.86
6	603259	药明康德	5,027,053.00	0.85
7	000002	万科 A	4,990,035.00	0.84
8	601088	中国神华	4,882,699.00	0.82
9	600763	通策医疗	4,574,003.00	0.77
10	300896	爱美客	3,691,807.00	0.62
11	300347	泰格医药	3,615,235.00	0.61
12	300012	华测检测	3,455,915.74	0.58

13	601318	中国平安	3,407,400.00	0.58
14	600900	长江电力	3,391,900.00	0.57
15	300677	英科医疗	3,330,000.00	0.56
16	603659	璞泰来	2,795,397.00	0.47
17	600809	山西汾酒	2,773,399.75	0.47
18	600690	海尔智家	2,654,558.82	0.45
19	601699	潞安环能	2,606,497.00	0.44
20	000069	华侨城 A	2,529,834.00	0.43

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600809	山西汾酒	12,796,678.00	2.16
2	000568	泸州老窖	11,144,022.00	1.88
3	000858	五粮液	7,386,405.00	1.25
4	002594	比亚迪	5,636,909.00	0.95
5	601888	中国中免	5,555,162.00	0.94
6	300750	宁德时代	5,507,967.92	0.93
7	601088	中国神华	5,159,176.00	0.87
8	002271	东方雨虹	4,837,700.50	0.82
9	601012	隆基股份	4,808,310.00	0.81
10	300274	阳光电源	4,741,710.22	0.80
11	000002	万科 A	4,434,116.45	0.75
12	300896	爱美客	4,385,446.00	0.74
13	300037	新宙邦	4,219,148.08	0.71
14	600519	贵州茅台	3,273,041.00	0.55
15	601318	中国平安	3,150,634.00	0.53
16	002475	立讯精密	3,038,162.20	0.51
17	601166	兴业银行	2,822,300.00	0.48
18	688202	美迪西	2,552,792.35	0.43
19	000596	古井贡酒	2,500,743.00	0.42
20	000069	华侨城 A	2,459,881.00	0.42

#### 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	162,820,817.93
卖出股票收入（成交）总额	208,552,321.60

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	25,775,758.40	7.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	56,567,370.00	15.73
	其中：政策性金融债	56,567,370.00	15.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	182,940,000.00	50.88
7	可转债（可交换债）	1,643,349.23	0.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	266,926,477.63	74.24

### 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	101800206	18 陕交建 MTN001	300,000	31,317,000.00	8.71
2	101800346	18 京能洁能 MTN001	300,000	31,035,000.00	8.63
3	200315	20 进出 15	300,000	30,210,000.00	8.40
4	102001408	20 河钢集 MTN008	300,000	29,385,000.00	8.17
5	102000053	20 鲁能源 MTN001	200,000	20,080,000.00	5.58

### 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。

### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	83,866.76
2	应收证券清算款	3,118,793.08
3	应收股利	-
4	应收利息	4,465,492.61
5	应收申购款	4,193.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,672,346.15

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	------	---------

				比例 (%)
1	113013	国君转债	763,723.70	0.21

#### 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不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长盛盛世混合 A	84	2,968,514.26	249,095,918.65	99.90%	259,278.79	0.10%
长盛盛世混合 C	704	47,655.92	24,354,838.71	72.59%	9,194,930.04	27.41%
合计	788	359,016.45	273,450,757.36	96.66%	9,454,208.83	3.34%

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛盛世混合 A	0.00	0.0000%
	长盛盛世混合 C	1,058.21	0.0032%
	合计	1,058.21	0.0004%

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

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长盛盛世混合 A	0
	长盛盛世混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛盛世混合 A	0
	长盛盛世混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C
基金合同生效日（2015 年 12 月 11 日）基金份额总额	13,184,407.64	369,032,054.43
本报告期期初基金份额总额	355,031,740.22	128,726,423.56
本报告期基金总申购份额	103,532,951.17	49,633,940.09
减：本报告期基金总赎回份额	209,209,493.95	144,810,594.90
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	249,355,197.44	33,549,768.75

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2021 年 6 月 21 日审议通过了《关于长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金选任新任基金托管人有关事项的议案》，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

### 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

我公司第七届董事会任期已满，根据《公司法》和《公司章程》的有关规定，2021 年 6 月 6 日，我公司召开了 2021 年第一次临时股东会会议。会议选举俞仕新、高民和、毕功兵、杜愚为新任董事，蔡咏、陈翔、李伟强、朱慈蕴不再担任董事。公司已按规定向相关监管机构报备。

根据公司第八届董事会第二次会议决议，聘任周兵同志担任公司总经理，林培富同志不再担任公司总经理。公司已按规定向相关监管机构报备。

原董事会秘书孙杰同志退休，根据公司第八届董事会第二次会议决议，聘任刁俊东同志担任财务负责人兼董事会秘书。

#### 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

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
华泰证券	1	151,786,505.68	41.78%	141,358.67	43.17%	-
中金证券	1	105,413,726.55	29.01%	98,172.05	29.98%	-
东兴证券	3	102,750,773.08	28.28%	84,783.21	25.89%	-
海通证券	1	3,369,555.80	0.93%	3,138.12	0.96%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

### 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
华泰证券	3,381,080.00	9.41%	-	-	-	-
中金证券	19,407,592.10	53.99%	339,300,000.00	63.58%	-	-
东兴证券	13,095,620.55	36.43%	194,400,000.00	36.42%	-	-
海通证券	59,580.90	0.17%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金本期新增证券公司交易单元均为共用交易单元。

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共用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	华西证券	深圳	1
2	海通证券	上海	1
3	长江证券	上海	1
4	国元证券	上海	1
5	兴业证券	深圳	1

6	光大证券	深圳	1
7	银河证券	上海	1
8	东兴证券	上海	1
9	东方证券	深圳	1
10	申万宏源	上海	1
11	中金证券	上海	1
12	招商证券	深圳	1
13	东北证券	深圳	1
14	华泰证券	深圳	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况:

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	东兴证券	深圳	1

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月22日
2	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金托管协议	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月22日
3	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月22日
4	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金(长盛盛世混合A份额)基金产品资料概要(更新)	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月22日
5	长盛基金管理有限公司关于长盛盛世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	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月22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	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月18日
7	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月10日
8	长盛基金管理有限公司关于以通讯方式召开长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年5月20日

	基金份额持有人大会的第二次提示性公告		
9	长盛基金管理有限公司关于以通讯方式召开长盛盛世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	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 5 月 19 日
10	长盛基金管理有限公司关于以通讯方式召开长盛盛世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	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 5 月 18 日
11	关于长盛基金管理有限公司直销中心开展旗下部分基金赎回费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 24 日
12	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 1 季度报告提示性公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 22 日
13	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 22 日
14	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 6 日
15	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 31 日
16	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 31 日
17	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 18 日
18	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 2 月 19 日
19	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金托管协议	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 2 月 19 日
20	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金（长盛盛世混合 A 份额）基金产品资料概要（更新）	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 2 月 19 日

21	关于长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同等法律文件的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 2 月 19 日
22	关于长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金由中国建设银行股份有限公司担任临时基金托管人的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 2 月 7 日
23	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 1 月 22 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	20210101~20210223	101,556,117.29	0.00	101,556,117.29	0.00	0.00%
	2	20210224~20210425、 20210428~20210630	0.00	143,010,700.15	83,424,192.21	59,586,507.94	21.06%
	3	20210125~20210228、 20210310~20210630	90,907,438.01	0.00	0.00	90,907,438.01	32.13%

#### 产品特有风险

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会《关于准予长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可〔2015〕1989 号文）准予注册。基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为包商银行股份有限公司，基金合同生效日为 2015 年 12 月 11 日。

2021 年 2 月 7 日由中国证监会指定中国建设银行股份有限公司为本基金临时基金托管人。

2021 年 5 月 19 日至 2021 年 6 月 20 日长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金选任新任基金托管人有关事项的议案》，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 2021 年 6 月 21 日起，原《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效，更换基金托管人后的《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/或基金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、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日