

长盛盛腾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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金因出现了基金合同终止事由，基金管理人长盛基金管理有限公司于 2018 年 6 月 15 日发布的《关于长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金于 2018 年 6 月 19 日进入财产清算期。并已于 2018 年 7 月 21 日于公司官网刊登《长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金清算报告》。

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 18 日（基金最后运作日）止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	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.....	22
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	46
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	52

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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长盛盛腾混合	
基金主代码	003596	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 1 月 13 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,444,834.24 份	
基金合同存续期	于 2018 年 6 月 19 日进入财产清算期	
下属分级基金的基金简称:	长盛盛腾混合 A	长盛盛腾混合 C
下属分级基金的交易代码:	003596	003597
报告期末下属分级基金的份额总额	240,957.71 份	2,203,876.53 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在有效控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	<p>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。本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向，综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券投资组合。在实际的投资运作中，本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。</p> <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，适当参与股指期货、股指期货、国债期货及期权的投资。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长盛基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁
	联系电话	010-82019988
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666、 010-62350088	95561
传真	010-82255988	021-62535823
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	福州市湖东路 154 号
办公地址	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼
邮政编码	100088	200041
法定代表人	周兵	高建平

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	基金管理人和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

3.1.1 期间数据和指标	2018 年 1 月 1 日-2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日）	
	长盛盛腾混合 A	长盛盛腾混合 C
本期已实现收益	60,310,103.48	4,521,950.36
本期利润	7,210,049.76	343,946.31
加权平均基金份额本期利润	0.1464	0.0600
本期加权平均净值利润率	10.25%	4.17%
本期基金份额净值增长率	3.09%	2.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018 年 6 月 18 日）	
期末可供分配利润	105,109.78	972,332.92
期末可供分配基金份额利润	0.4362	0.4412
期末基金资产净值	346,067.49	3,176,209.45
期末基金份额净值	1.4362	1.4412
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2018 年 6 月 18 日）	
基金份额累计净值增长率	43.62%	44.12%

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”均指本基金最后运作日，即 6 月 18 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

长盛盛腾混合 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	0.41%	0.07%	-0.60%	0.40%	1.01%	-0.33%
过去三个月	0.60%	0.04%	-1.12%	0.50%	1.72%	-0.46%
过去六个月	3.09%	0.49%	-1.67%	0.54%	4.76%	-0.05%
过去一年	18.89%	0.56%	3.25%	0.45%	15.64%	0.11%
自基金合同生效起至今	43.62%	0.54%	8.58%	0.41%	35.04%	0.13%

长盛盛腾混合 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	0.32%	0.07%	-0.60%	0.40%	0.92%	-0.33%
过去三个月	0.26%	0.04%	-1.12%	0.50%	1.38%	-0.46%
过去六个月	2.63%	0.49%	-1.67%	0.54%	4.30%	-0.05%
过去一年	18.63%	0.56%	3.25%	0.45%	15.38%	0.11%
自基金合同生效起至今	44.12%	0.54%	8.58%	0.41%	35.54%	0.13%

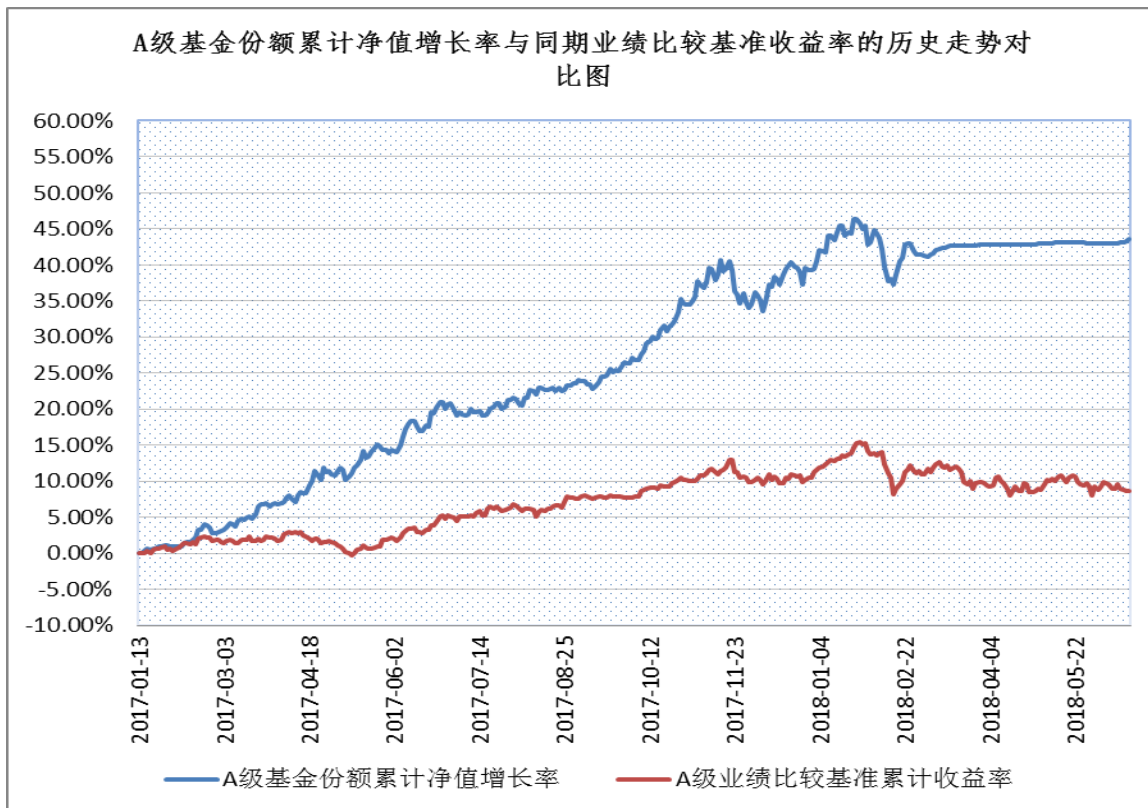
注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

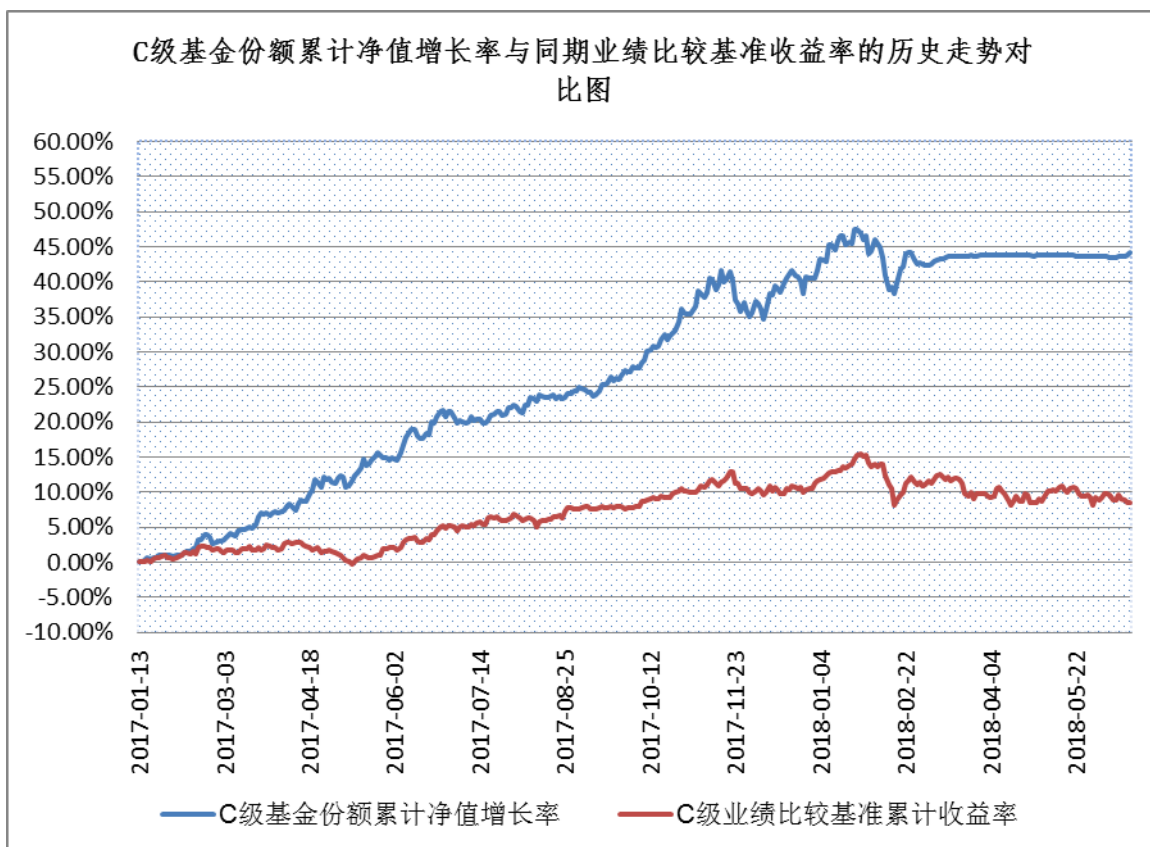
本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

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、央行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





注：按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 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，长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛淳灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛禧灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长	2017 年 1 月 13 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。

	盛盛德灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 长盛盛乾灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理。			
--	--	--	--	--

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、交易所利率债、逆回购等为主要投资标的，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，本基金于一季度择机高位出清股票仓位，之后未再主动买入股票，未参与新股申购。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛腾混合 A 基金份额净值为 1.4362 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.09%；截至本报告期末长盛盛腾混合 C 基金份额净值为 1.4412 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.63%；同期业绩比较基准收益率为-1.67%。

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，配合完成基金清算工作。

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，本报告期内未实施利润分配。

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

本基金自 2018 年 2 月 13 日至 2018 年 6 月 18 日期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

根据《长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，本基金已于 2018 年 6 月 19 日进入清算期。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 18 日（基金 最后运作日）	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,441,415.36	1,045,509.03
结算备付金		64,686.73	348,469.51
存出保证金		63,592.08	42,876.23
交易性金融资产	6.4.7.2	-	312,656,572.74
其中：股票投资		-	155,401,652.54
基金投资		-	-
债券投资		-	157,254,920.20
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	-	2,900,000.00
应收证券清算款		-	330,241.66
应收利息	6.4.7.5	13,472.85	2,088,681.04
应收股利		-	-
应收申购款		350.00	63,429.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,583,517.02	319,475,779.32
负债和所有者权益			
		本期末	上年度末
		2018 年 6 月 18 日（基金	2017 年 12 月 31 日
		最后运作日）	
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		-	-
应付赎回款		10,382.99	143,404.54
应付管理人报酬		1,199.52	170,087.35
应付托管费		299.88	42,521.83

应付销售服务费		357.69	1,799.58
应付交易费用	6.4.7.7	-	14,748.42
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	49,000.00	142,500.66
负债合计		61,240.08	515,062.38
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,444,834.24	228,888,031.61
未分配利润	6.4.7.10	1,077,442.70	90,072,685.33
所有者权益合计		3,522,276.94	318,960,716.94
负债和所有者权益总计		3,583,517.02	319,475,779.32

注：1. 报告截止日 2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日），长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金份额总额 2,444,834.24 份，其中 A 类基金份额净值 1.4362 元，A 类基金份额 240,957.71 份；C 类基金份额净值 1.4412 元，C 类基金份额 2,203,876.53 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日）止期间。

6.2 利润表

会计主体：长盛盛腾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 18 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 18 日（基 金最后运作日）	上年度可比期间 2017 年 1 月 13 日（基金 合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		8,249,175.81	61,662,246.80
1.利息收入		939,039.57	3,246,866.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	57,370.45	134,905.59
债券利息收入		647,982.90	2,094,231.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		233,686.22	1,017,729.32
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		64,567,276.68	16,995,475.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	64,679,060.40	15,764,107.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	14,972.13	-64,925.91
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	-126,755.85	1,296,294.00

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-57,278,057.77	41,317,542.45
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	20,917.33	102,362.85
减：二、费用		695,179.74	1,678,944.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	211,096.71	871,609.03
2. 托管费	6.4.10.2.2	52,774.22	217,902.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	7,570.70	4,436.57
4. 交易费用	6.4.7.19	352,755.23	511,585.26
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加			
7. 其他费用	6.4.7.20	70,982.88	73,411.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,553,996.07	59,983,301.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,553,996.07	59,983,301.83

注：本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日）止期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛盛腾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 18 日（基金最后运作日）

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日）		
	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）	228,888,031.61	90,072,685.33	318,960,716.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,553,996.07	7,553,996.07
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	-226,443,197.37	-96,549,238.70	-322,992,436.07

填列)			
其中：1.基金申购款	6,131,190.50	2,657,238.52	8,788,429.02
2.基金赎回款	-232,574,387.87	-99,206,477.22	-331,780,865.09
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）	2,444,834.24	1,077,442.70	3,522,276.94
项目	上年度可比期间 2017年1月13日(基金合同生效日)至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	300,028,320.91	-	300,028,320.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	59,983,301.83	59,983,301.83
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）	-15,366,679.82	-685,781.93	-16,052,461.75
其中：1.基金申购款	24,997,554.77	3,749,154.16	28,746,708.93
2.基金赎回款	-40,364,234.59	-4,434,936.09	-44,799,170.68
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）	284,661,641.09	59,297,519.90	343,959,160.99

注：本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日）止期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

林培富	刁俊东	龚珉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛盛腾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[2016]2258号《关于准予长盛盛腾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《长盛盛腾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,首次设立募集不包括认购资金利息共 300,028,294.04 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 016 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 300,028,320.91 份基金份额,其中认购资金利息折合 26.87 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长盛盛腾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。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。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《长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具、同业存单、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%;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% X 沪深 300 指数收益率+50% X 中证综合债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛盛腾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《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金因出现了基金合同终止事由,基金管理人长盛基金管理有限公司于 2018 年 6 月 15 日发布的《关于长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金于 2018 年 6 月 19 日进入财产清算期,并于 2018 年 7 月 21 日于公司官网刊登《长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金清算报告》。

本基金财务报表以非持续经营基础编制。

2018 年 6 月 18 日(基金最后运作日),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

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 18 日(基金最后运作日)止期间的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 2018 年 6 月 18 日(基金最后运作日)的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 18 日(基金最后运作日)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18日（基金最后运作日）
活期存款	3,441,415.36
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：	3,441,415.36

6.4.7.2 交易性金融资产

注：无余额。

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

注：无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月18日（基金最后运作日）
应收活期存款利息	10,406.05
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	2,791.57
应收债券利息	-
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	-

其他	275.23
合计	13,472.85

6.4.7.6 其他资产

注：无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

注：无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
	2018年6月18日（基金最后运作日）
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	49,000.00
合计	49,000.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛腾混合 A		
项目	本期	
	2018年1月1日至2018年6月18日（基金最后运作日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	220,308,648.76	220,308,648.76
本期申购	557,706.96	557,706.96
本期赎回(以“-”号填列)	-220,625,398.01	-220,625,398.01
- 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	240,957.71	240,957.71

金额单位：人民币元

长盛盛腾混合 C		
项目	本期	
	2018年1月1日至2018年6月18日（基金最后运作日）	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,579,382.85	8,579,382.85
本期申购	5,573,483.54	5,573,483.54
本期赎回(以“-”号填列)	-11,948,989.86	-11,948,989.86
- 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	2,203,876.53	2,203,876.53

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

长盛盛腾混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,758,972.37	45,845,002.61	86,603,974.98
本期利润	60,310,103.48	-53,100,053.72	7,210,049.76
本期基金份额交易产生的变动数	-100,855,377.26	7,146,462.30	-93,708,914.96
其中：基金申购款	367,242.29	-132,332.70	234,909.59
基金赎回款	-101,222,619.55	7,278,795.00	-93,943,824.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	213,698.59	-108,588.81	105,109.78

单位：人民币元

长盛盛腾混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,676,434.14	1,792,276.21	3,468,710.35
本期利润	4,521,950.36	-4,178,004.05	343,946.31
本期基金份额交易产生的变动数	-4,223,121.05	1,382,797.31	-2,840,323.74
其中：基金申购款	3,665,785.14	-1,243,456.21	2,422,328.93
基金赎回款	-7,888,906.19	2,626,253.52	-5,262,652.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,975,263.45	-1,002,930.53	972,332.92

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18日(基金最后运作日)
活期存款利息收入	51,351.66
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	5,575.30

其他	443.49
合计	57,370.45

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18日（基金最后 运作日）
卖出股票成交总额	183,713,405.30
减：卖出股票成本总额	119,034,344.90
买卖股票差价收入	64,679,060.40

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18日（基金最后 运作日）
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	14,972.13
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	14,972.13

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18日（基金最后 运作日）
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	185,930,054.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	182,626,675.90
减：应收利息总额	3,288,406.47
买卖债券差价收入	14,972.13

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 2018年1月1日至2018年6月18日（基金最后 运作日）
股票投资产生的股利收益	-126,755.85
基金投资产生的股利收益	-
合计	-126,755.85

6.4.7.17 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18日（基金最后 运作日）
1. 交易性金融资产	-57,278,057.77
——股票投资	-57,483,537.07
——债券投资	205,479.30
——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	-57,278,057.77

6.4.7.18 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 18 日（基金最后运作日）
基金赎回费收入	20,583.95
基金转换费收入	333.38
合计	20,917.33

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日）
交易所市场交易费用	351,030.23
银行间市场交易费用	1,725.00
合计	352,755.23

6.4.7.20 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 18 日（基金最后运作日）
审计费用	-
信息披露费	40,000.00
银行汇划费	3,382.88
其他	600.00
账户维护费	27,000.00
合计	70,982.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

1、自 2018 年 6 月 19 日本基金进入清算程序起至清算款划出前一日止期间，本基金银行存款、

结算备付金及存出保证金产生的利息收入将由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司先行垫付，基金管理人垫付资金孳生的利息归本基金的基金管理人所有，待实际结息资金到账后再归还本基金的基金管理人，与之前预估数所产生的误差也由本基金的基金管理人承担。

2、本基金最后运作日确认的应付赎回款 10,382.99 元已于 2018 年 6 月 19 日从本基金托管账户划付给基金份额持有人。2018 年 6 月 19 日确认的应付赎回款 102,929.56 元，已于 2018 年 6 月 21 日从本基金托管账户划付给基金份额持有人。

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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日）	上年度可比期间 2017 年 1 月 13 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	211,096.71	871,609.03
其中：支付销售机构的客户维护费	1,092.12	0.00

注：支付基金管理人长盛基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日）	2017 年 1 月 13 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	52,774.22	217,902.19

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日）		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛腾混合 A	长盛盛腾混合 C	合计
长盛基金	-	1,688.18	1,688.18
合计	-	1,688.18	1,688.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 13 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销售服务费		
	长盛盛腾混合 A	长盛盛腾混合 C	合计
长盛基金	-	83.87	83.87
合计	-	83.87	83.87

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给长盛基金，再由长盛基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 X 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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**

注：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

注：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18日(基金最后运作日)		上年度可比期间 2017年1月13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
兴业银行	3,441,415.36	51,351.66	2,860,342.20	104,706.76

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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

注：无。

6.4.12 期末（2018年6月18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**

注：无。

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**

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、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兴业银行，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18日(基金最后运作日)	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	10,778,920.20
合计	-	10,778,920.20

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月18日(基金最后运作日)	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	136,476,000.00
合计	-	136,476,000.00

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18日(基金最后运作日)	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	10,000,000.00
合计	-	10,000,000.00

注：未评级部分为政策性金融债。

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 2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日），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时间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18日(基金最后运作日)					
资产					
银行存款	3,441,415.36	-	-	-	3,441,415.36
结算备付金	64,686.73	-	-	-	64,686.73
存出保证金	63,592.08	-	-	-	63,592.08
应收利息	-	-	-	13,472.85	13,472.85
应收申购款	-	-	-	350.00	350.00
资产总计	3,569,694.17	-	-	13,822.85	3,583,517.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,382.99	10,382.99
应付管理人报酬	-	-	-	1,199.52	1,199.52
应付托管费	-	-	-	299.88	299.88
应付销售服务费	-	-	-	357.69	357.69
其他负债	-	-	-	49,000.00	49,000.00
负债总计	-	-	-	61,240.08	61,240.08
利率敏感度缺口	3,569,694.17	-	-	-47,417.23	3,522,276.94
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	1,045,509.03	-	-	-	1,045,509.03
结算备付金	348,469.51	-	-	-	348,469.51
存出保证金	42,876.23	-	-	-	42,876.23
交易性金融资产	157,254,920.20	-	-	155,401,652.54	312,656,572.74
买入返售金融资产	2,900,000.00	-	-	-	2,900,000.00
应收证券清算款	-	-	-	330,241.66	330,241.66
应收利息	-	-	-	2,088,681.04	2,088,681.04
应收申购款	-	-	-	63,429.11	63,429.11
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	161,591,774.97	-	-	157,884,004.35	319,475,779.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	143,404.54	143,404.54
应付管理人报酬	-	-	-	170,087.35	170,087.35
应付托管费	-	-	-	42,521.83	42,521.83
应付销售服务费	-	-	-	1,799.58	1,799.58
应付交易费用	-	-	-	14,748.42	14,748.42
其他负债	-	-	-	142,500.66	142,500.66
负债总计	-	-	-	515,062.38	515,062.38
利率敏感度缺口	161,591,774.97	-	-	-157,368,941.97	318,960,716.94

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18日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	-	104,544.72
市场利率上升 25 个基点	-	-104,544.72	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金股票资产投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日）		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	-	-	155,401,652.54	48.72
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	155,401,652.54	48.72

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2018 年 6 月 18 日（基金最后运作日）本基金期末交易性权益类投资无余额，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，本基金运营不满一年，无足够历史数据分析其他价格风险敏感性。

6.4.14 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 18 日（基金最后运作日），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无属于第一层、第二层次或第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 155,287,256.89 元，属于第二层次的余额为 157,369,315.85 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 18 日（基金最后运作日），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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-	-
	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	3,506,102.09	97.84
7	其他各项资产	77,414.93	2.16
8	合计	3,583,517.02	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

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	7,510,000.00	2.35
2	601398	工商银行	5,913,000.00	1.85
3	601328	交通银行	3,385,000.00	1.06
4	601288	农业银行	2,525,835.00	0.79

5	601857	中国石油	712,800.00	0.22
6	002926	华西证券	282,324.24	0.09
7	603156	养元饮品	166,828.87	0.05
8	600901	江苏租赁	155,843.75	0.05
9	601828	美凯龙	102,218.16	0.03
10	601838	成都银行	89,465.01	0.03
11	002925	盈趣科技	68,670.00	0.02
12	603680	今创集团	47,171.67	0.01
13	300740	御家汇	39,615.18	0.01
14	300739	明阳电路	28,142.60	0.01
15	300733	西菱动力	21,839.70	0.01
16	603056	德邦股份	20,066.64	0.01
17	603712	七一二	18,300.10	0.01
18	603516	淳中科技	16,458.32	0.01
19	603356	华菱精工	12,650.19	0.00

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	600519	贵州茅台	32,481,496.00	10.18
2	000651	格力电器	27,099,688.50	8.50
3	600809	山西汾酒	21,318,119.40	6.68
4	000568	泸州老窖	20,164,724.68	6.32
5	300136	信维通信	17,276,871.75	5.42
6	600276	恒瑞医药	15,956,273.10	5.00
7	000661	长春高新	13,666,470.84	4.28
8	600887	伊利股份	8,486,242.00	2.66
9	601939	建设银行	6,645,803.00	2.08
10	000858	五粮液	5,975,748.09	1.87
11	601398	工商银行	5,309,594.00	1.66
12	601328	交通银行	3,245,000.00	1.02
13	601288	农业银行	2,430,000.00	0.76
14	601857	中国石油	642,400.00	0.20
15	002926	华西证券	504,341.87	0.16
16	600901	江苏租赁	271,542.15	0.09

17	002925	盈趣科技	252,374.64	0.08
18	601828	美凯龙	229,616.16	0.07
19	601838	成都银行	209,007.67	0.07
20	603156	养元饮品	198,478.87	0.06

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	21,116,229.43
卖出股票收入（成交）总额	183,713,405.30

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2

本基金报告期末未持有股票。

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	63,592.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,472.85
5	应收申购款	350.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	77,414.93

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

注：本基金报告期末未持有股票。

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
长盛盛腾混合 A	33	7,301.75	-	-	240,957.71	100.00%
长盛盛腾混合 C	246	8,958.85	-	-	2,203,876.53	100.00%
合计	279	8,762.85	-	-	2,444,834.24	100.00%

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	长盛盛腾混合 A	8,916.76	3.7005%
	长盛盛腾混合 C	6,373.54	0.2892%
	合计	15,290.30	0.6254%

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	长盛盛腾混合 A	0
	长盛盛腾混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛盛腾混合 A	0
	长盛盛腾混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛腾混合 A	长盛盛腾混合 C
基金合同生效日（2017 年 1 月 13 日）基金份额总额	299,999,994.99	28,325.92
本报告期期初基金份额总额	220,308,648.76	8,579,382.85
本报告期基金总申购份额	557,706.96	5,573,483.54
减：本报告期基金总赎回份额	220,625,398.01	11,948,989.86
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	240,957.71	2,203,876.53

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

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

本报告期内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	
中信建投	1	118,036,267.30	57.93%	86,320.61	57.93%	-
东北证券	1	85,723,773.00	42.07%	62,689.86	42.07%	-

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
中信建投	4,931,746.00	30.42%	644,100,000.00	99.84%	-	-
东北证券	11,278,618.43	69.58%	1,000,000.00	0.16%	-	-

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) 资质雄厚，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、本基金租用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：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	关于长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告	《中国证券报》及本公司网站	2018年6月15日
2	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
3	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金开通深圳前海微众银行股份有限公司定投业务并参加定投申购优惠活动的公告	同上	2018年6月15日
4	长盛盛腾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
5	长盛盛腾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
6	长盛盛腾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
7	关于修改长盛盛腾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
8	长盛盛腾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
9	长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2018年3月23日
10	长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金合同	同上	2018年3月23日
11	长盛盛腾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	长盛盛腾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2月24日
13	长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2018年2月24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

	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	20180101~20180307	219,439,128.00	-	219,439,128.00	-	-
个人	1	20180524~20180618	652,011.40	-	-	652,011.40	27.44%
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、《长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2018年8月29日