

# 长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长盛盛丰混合	
基金主代码	003641	
交易代码	003641	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 11 月 18 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	177,307,179.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛盛丰混合 A	长盛盛丰混合 C
下属分级基金的交易代码:	003641	003642
报告期末下属分级基金的份额总额	111,320.34 份	177,195,858.88 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略, 前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会, 在严格控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	<p>本基金将通过宏观、微观经济指标, 市场指标, 政策因素等, 动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例, 控制市场风险, 提高配置效率。</p> <p>本基金通过对国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展的根本性因素进行分析, 对处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置。在行业配置的基础上, 通过定性分析和定量分析相结合的办法, 挑选具备较大投资价值的上市公司。</p> <p>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式, 获得与风险相匹配的投资收益, 以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。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, 适当参与股指债券、国债期货及期权的投资。</p>
业绩比较基准	50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金, 具有较高风险、较高预期收益的特征, 其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长盛基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 张利宁	李帅帅

	联系电话	010-86497608	0755-25878287
	电子邮箱	zhangln@csfunds. com. cn	LISHUAISHUAI130@pingan. com. cn
客户服务电话		400-888-2666、 010-86497888	95511-3
传真		010-86497999	0755-82080387

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## § 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	长盛盛丰混合 A	长盛盛丰混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 – 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 – 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	457.15	-255,298.69
本期利润	2,532.11	6,957,561.06
加权平均基金份额本期利润	0.0350	0.0362
本期基金份额净值增长率	4.23%	4.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0015	-0.0070
期末基金资产净值	113,457.70	179,152,295.77
期末基金份额净值	1.0192	1.0110

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛盛丰混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.12%	0.15%	2.96%	0.58%	-1.84%	-0.43%
过去三个月	0.95%	0.17%	-0.11%	0.75%	1.06%	-0.58%
过去六个月	4.23%	0.19%	14.27%	0.77%	-10.04%	-0.58%
过去一年	1.20%	0.31%	8.26%	0.76%	-7.06%	-0.45%
自基金合同生效起至今	9.07%	0.28%	11.37%	0.57%	-2.30%	-0.29%

长盛盛丰混合 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

		准差②	率③	④		
过去一个月	1. 10%	0. 15%	2. 96%	0. 58%	-1. 86%	-0. 43%
过去三个月	0. 90%	0. 17%	-0. 11%	0. 75%	1. 01%	-0. 58%
过去六个月	4. 13%	0. 19%	14. 27%	0. 77%	-10. 14%	-0. 58%
过去一年	0. 99%	0. 31%	8. 26%	0. 76%	-7. 27%	-0. 45%
自基金合同生效起至今	5. 92%	0. 28%	11. 37%	0. 57%	-5. 45%	-0. 29%

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%\*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：

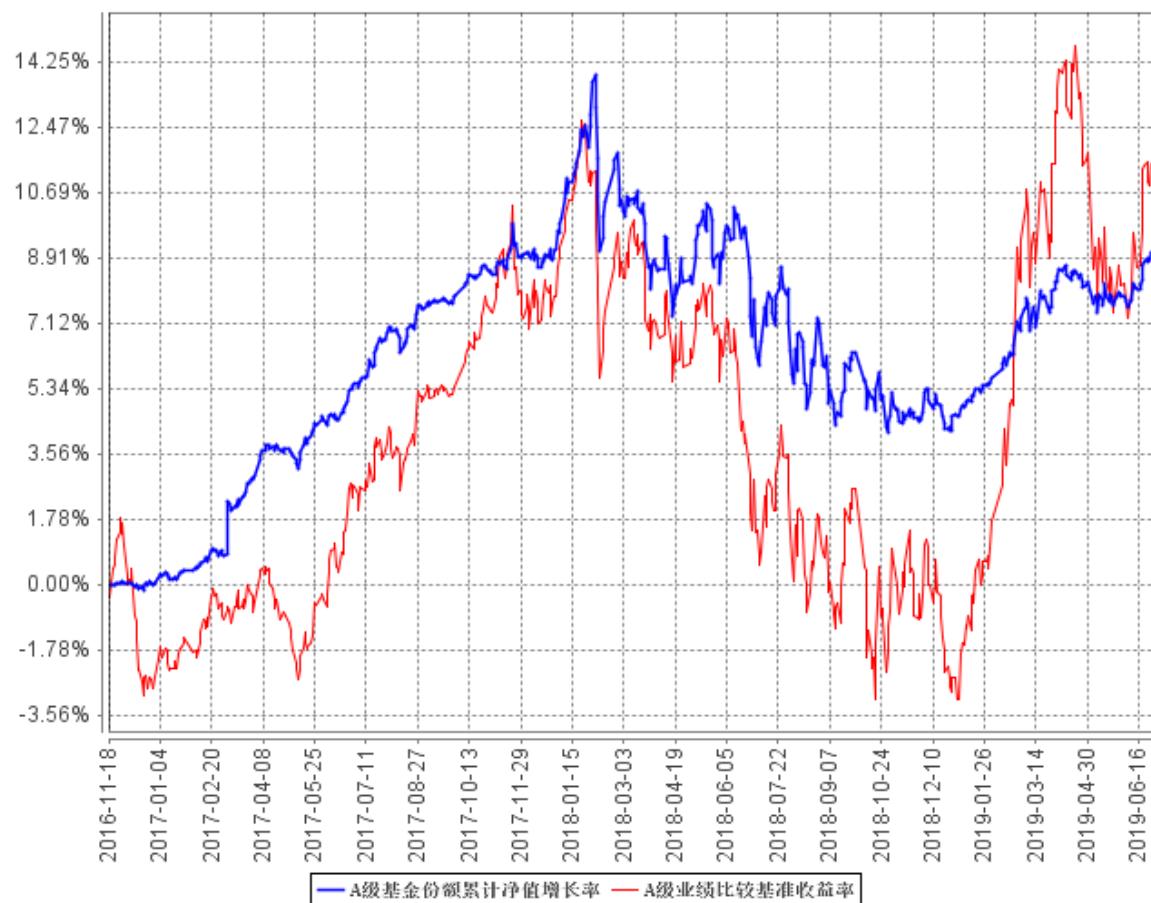
1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债指数。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，具有良好的市场代表性；中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，该指数可以较为全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。

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。

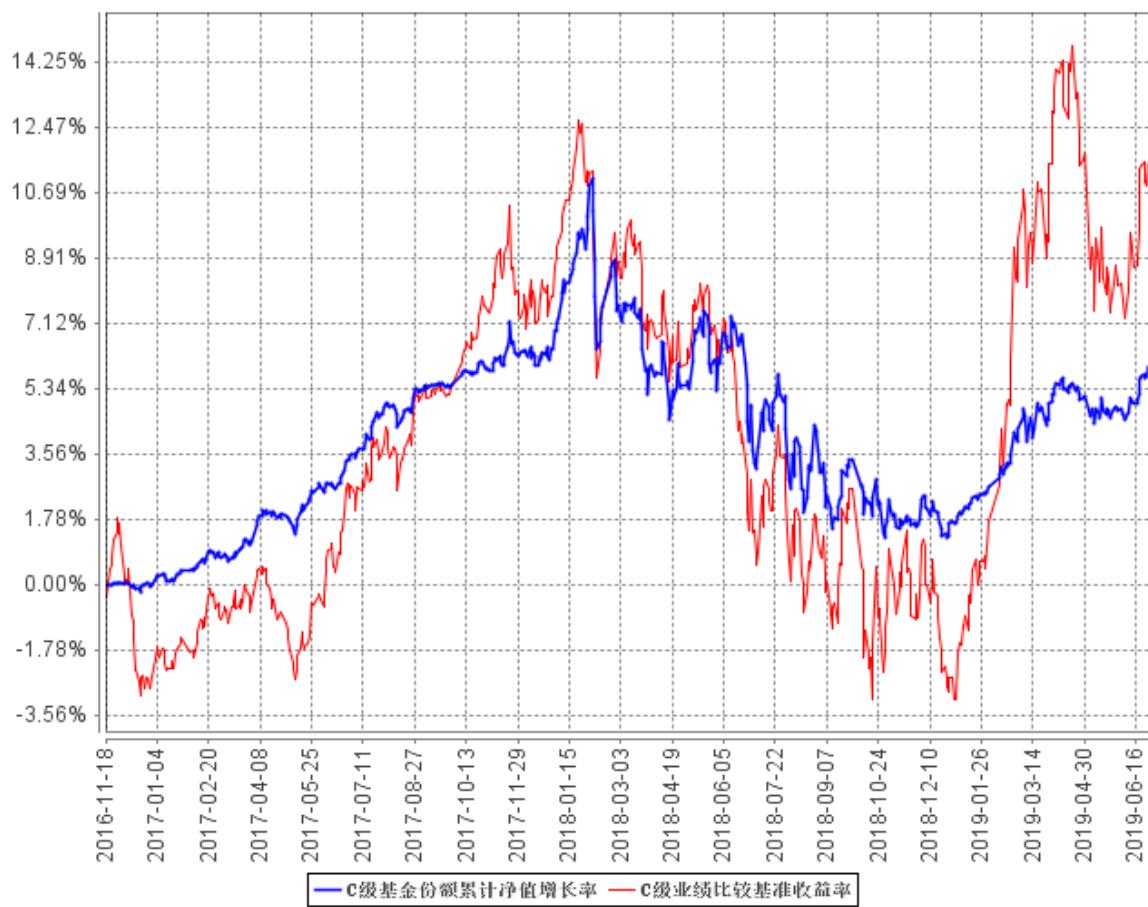
3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 50%、50%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A 级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## C 级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截止报告期末，本基金的各项资产配置比例符合本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 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、特定客户资产管理、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 2019 年 6 月 30 日，基金管理人共管理五十七只开放式基金，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，长盛盛辉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，长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理。	2016年11月18日	-	12 年	杨衡先生，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。

- 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、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

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。

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，从宏观背景上看，在内外交困的局面下，宏观经济面临下行压力，结构性矛盾更加突出。货币政策面临包括资产价格、汇率等较多约束，货币政策取向更偏向结构性货币政策，货币政策基调合理充裕，仍提“总闸门”。

报告期内，股票市场继 2018 年下跌后，2019 年一季度大幅反弹，2019 年二季度明显回撤后

有所回升。G20 会议中美元首会面，达成不继续增加关税，缓解了 5 月以来压制股票市场情绪和投资者风险偏好的因素。

报告期内，债券市场表现来看，2019 年一季度债券收益率呈震荡胶着走势，4 月份信用扩张和风险偏好提升产生扰动，债券收益率快速上升，之后随着监管层表态及采取呵护资金面措施，债券收益率又明显下降。流动性相对宽裕、回购利率维持相对低位的同时，存在资金淤积和分化现象。

报告期内，IPO 发行基本延续每周一批的常态化发行节奏，多只新股网下申购要求的股票底仓门槛下调到 1000 万元。另一方面，转债一级市场一季度发行加速后，二季度有所减速。此外，值得关注的是，上半年，科创板各项工作加速推进。2019 年 6 月 13 日，在上海举办了科创板开板仪式，6 月 19 日后多只科创板新股迅速进入密集招股发行中。

## 2、报告期内本基金投资策略分析

本报告期内，本基金坚持稳健操作思路，有针对性地加强基金投资者结构与组合资产流动性的匹配管理，密切跟踪基金规模变化，积极应对可能存在的大额申赎。

本报告期内，固定收益资产配置坚持以 AAA 高信用评级短期银行 CD、短期利率债等标的为主，通过优化组合久期，保持组合流动性，较好控制了利率风险、信用风险和流动性风险。

本报告期内，本基金维持相对较低的股票仓位，股票底仓优选指数成份股，以蓝筹价值股为主。行业和个股选择上相对偏防御，底仓组合整体的低波动、低回撤和派息分红等指标是重要考量，报告期内投资操作的换手率相对较低。

新股投资上坚持紧密跟踪，优选投资标的，注重实操细节和各类风险控防，上市后积极变现锁定收益。此外，本报告期内，本基金积极参与转债的网下申购，获得一定的收益增强。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛丰混合 A 基金份额净值为 1.0192 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.23%；截至本报告期末长盛盛丰混合 C 基金份额净值为 1.0110 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.13%；同期业绩比较基准收益率为 14.27%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从实体经济数据看，经济和企业盈利存在下行压力。中美博弈对基本面、企业盈利的影响有待进一步观察。风险偏好阶段性修复后，市场中期走势仍需要基本面支撑，中报业绩影响市场回升高度。考虑到未来市场仍存一定的解禁压力，需要关注 IPO 发行规模变化、科创板开通及定增对市场的影响。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本基金管理人已分别与中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，本基金本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2019 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-1,237,840.12 元，其中：长盛盛丰混合 A 期末可供分配利润为 168.30 元（未分配利润已实现部分为 168.30 元，未分配利润未实现部分为 1,969.06 元），长盛盛丰混合 C 期末可供分配利润为-1,238,008.42 元（未分配利润已实现部分为-1,238,008.42 元，未分配利润未实现部分为 3,194,445.31 元）。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安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损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	2,271,055.95	1,177,568.88
结算备付金	32,360.60	439,545.45
存出保证金	16,600.08	20,053.28
交易性金融资产	175,246,507.05	158,395,466.99
其中：股票投资	24,467,107.05	22,945,466.99
基金投资	—	—
债券投资	150,779,400.00	135,450,000.00
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	9,000,000.00
应收证券清算款	—	5,174.38
应收利息	1,940,928.19	3,366,440.28
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	179,507,451.87	172,404,249.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	—	—
应付赎回款	401.34	—
应付管理人报酬	87,744.03	87,797.46
应付托管费	14,624.02	14,632.94
应付销售服务费	29,229.77	29,257.99
应付交易费用	4,586.88	1,740.21
应交税费	0.36	—

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	105,112.00	172,500.00
负债合计	241,698.40	305,928.60
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	177,307,179.22	177,256,293.37
未分配利润	1,958,574.25	-5,157,972.71
所有者权益合计	179,265,753.47	172,098,320.66
负债和所有者权益总计	179,507,451.87	172,404,249.26

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，长盛盛丰混合型证券投资基金份额总额 177,307,179.22 份。

其中长盛盛丰混合型证券投资基金 A 类基金份额净值 1.0192 元，基金份额总额 111,320.34 份；

长盛盛丰混合型证券投资基金 C 类基金份额净值 1.0110 元，基金份额总额 177,195,858.88 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	8,042,440.01	-1,802,718.73
1.利息收入	2,898,344.62	3,208,307.12
其中：存款利息收入	13,930.26	13,624.30
债券利息收入	2,818,973.23	3,114,903.06
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	65,441.13	79,779.76
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-2,070,845.46	1,491,188.43
其中：股票投资收益	-2,072,543.69	483,218.74
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-256,522.94	-29,909.71
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	258,221.17	1,037,879.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7,214,934.71	-6,502,363.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.14	149.53
<b>减：二、费用</b>	1,082,346.84	1,259,722.40

1. 管理人报酬	570,619.44	622,210.20
2. 托管费	95,103.30	103,701.65
3. 销售服务费	190,134.50	207,346.85
4. 交易费用	83,194.50	221,504.30
5. 利息支出	36,082.11	—
其中：卖出回购金融资产支出	36,082.11	—
6. 税金及附加	1.37	—
7. 其他费用	107,211.62	104,959.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	6,960,093.17	-3,062,441.13
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	6,960,093.17	-3,062,441.13

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	177,256,293.37	-5,157,972.71	172,098,320.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	6,960,093.17	6,960,093.17
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)	50,885.85	156,453.79	207,339.64
其中：1.基金申购款	65,053,700.92	39,552.61	65,093,253.53
2.基金赎回款	-65,002,815.07	116,901.18	-64,885,913.89
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)	177,307,179.22	1,958,574.25	179,265,753.47
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	198,215,959.78	12,783,425.85	210,999,385.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,062,441.13	-3,062,441.13
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)	55,257.53	9,163.25	64,420.78
其中：1.基金申购款	115,342.33	12,501.12	127,843.45
2.基金赎回款	-60,084.80	-3,337.87	-63,422.67
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)	-	-9,518,497.58	-9,518,497.58
五、期末所有者权益 (基金净值)	198,271,217.31	211,650.39	198,482,867.70

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

长盛盛丰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]2249号《关于准予长盛盛丰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《长盛盛丰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 700,108,458.00 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(2016)第 1523 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 18 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 700,108,461.62 份基金份额,其中认购资金利息折合 3.62 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,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。各类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债及其他经中国证监会允许基金投资的债券)、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具、同业存单、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为 0%–95%；权证投资占基金资产净值的 0%–3%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、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。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2019 年 8 月 26 日批准报出。

#### 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》、《长盛盛丰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于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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[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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 关联方关系

##### 6.4.7.1 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

无。

##### 6.4.7.2 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
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	570,619.44	622,210.20
其中：支付销售机构的客户维护费	107.27	83.59

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.6% 的年费率计

提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.6%/当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付 的托管费	95,103.30	103,701.65

注：支付基金托管人平安银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 6.4.8.2.3 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 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛丰混合 A	长盛盛丰混合 C	合计
长盛基金公司	-	190,041.37	190,041.37
合计	-	190,041.37	190,041.37
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛丰混合 A	长盛盛丰混合 C	合计
长盛基金公司	-	207,241.92	207,241.92
合计	-	207,241.92	207,241.92

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。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	期末余额	当期利息收入
平安银行	2,271,055.95	9,772.03	1,082,009.48	10,473.84

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

金额单位：人民币元

6.4.9.1.2 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

113028	环境 转债	2019 年 6 月 20 日	2019 年 7 月 8 日	新债未 上市	100.00	100.00	520	52,000.00	52,000.00	-
--------	----------	--------------------	-------------------	-----------	--------	--------	-----	-----------	-----------	---

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.10 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 2019 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 24,410,130.51 元，属于第二层次的余额为 150,836,376.54 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 22,945,466.99 元，第二层次 135,450,000.00 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 2019 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(2018 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	24,467,107.05	13.63
	其中：股票	24,467,107.05	13.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	150,779,400.00	84.00
	其中：债券	150,779,400.00	84.00
	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	-	-
	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	2,303,416.55	1.28
8	其他各项资产	1,957,528.27	1.09
9	合计	179,507,451.87	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,075,800.00	0.60
B	采矿业	1,421,110.10	0.79
C	制造业	11,575,103.05	6.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,003,200.00	0.56
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,403,500.00	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	3,009,050.00	1.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.02
J	金融业	3,665,183.54	2.04
K	房地产业	1,251,450.00	0.70
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	24,467,107.05	13.65

### 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前十名股票投资明细

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	000538	云南白药	16,000	1,334,720.00	0.74
2	000002	万 科A	45,000	1,251,450.00	0.70
3	002262	恩华药业	100,000	1,079,000.00	0.60
4	300498	温氏股份	30,000	1,075,800.00	0.60
5	000858	五 粮 液	7,000	825,650.00	0.46
6	000568	泸州老窖	10,000	808,300.00	0.45
7	000423	东阿阿胶	20,000	796,400.00	0.44
8	600519	贵州茅台	800	787,200.00	0.44
9	600036	招商银行	20,000	719,600.00	0.40
10	601933	永辉超市	70,000	714,700.00	0.40

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.csfunds.com.cn> 网站的半年度报告正文。

### 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	300498	温氏股份	2,838,300.00	1.65
2	000776	广发证券	2,610,208.47	1.52
3	600886	国投电力	1,257,855.99	0.73
4	000538	云南白药	1,253,660.00	0.73
5	000002	万 科A	1,214,158.00	0.71
6	002262	恩华药业	1,014,000.00	0.59
7	000568	泸州老窖	1,000,520.00	0.58

8	600030	中信证券	948,500.00	0.55
9	600887	伊利股份	917,000.00	0.53
10	601211	国泰君安	889,300.00	0.52
11	002024	苏宁易购	871,300.00	0.51
12	000423	东阿阿胶	858,320.00	0.50
13	600900	长江电力	854,700.00	0.50
14	600795	国电电力	782,000.00	0.45
15	601333	广深铁路	728,000.00	0.42
16	000425	徐工机械	639,000.00	0.37
17	000089	深圳机场	619,500.00	0.36
18	600066	宇通客车	590,400.00	0.34
19	001872	招商港口	586,600.00	0.34
20	600085	同仁堂	586,000.00	0.34

#### 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	8,783,967.01	5.10
2	601939	建设银行	4,749,996.00	2.76
3	000776	广发证券	2,646,119.00	1.54
4	601398	工商银行	2,307,285.00	1.34
5	600036	招商银行	2,253,869.00	1.31
6	300498	温氏股份	1,930,347.00	1.12
7	603885	吉祥航空	1,342,144.00	0.78
8	600029	南方航空	894,274.00	0.52
9	600886	国投电力	846,500.00	0.49
10	000568	泸州老窖	750,052.00	0.44
11	600795	国电电力	735,000.00	0.43
12	601111	中国国航	728,624.00	0.42
13	600887	伊利股份	562,200.00	0.33
14	600900	长江电力	423,750.00	0.25
15	601211	国泰君安	402,200.00	0.23
16	600585	海螺水泥	375,078.00	0.22
17	600989	宝丰能源	372,646.80	0.22
18	600030	中信证券	370,805.00	0.22
19	002024	苏宁易购	249,400.00	0.14
20	600928	西安银行	225,354.51	0.13

### 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	28,483,877.03
卖出股票收入（成交）总额	31,982,147.99

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,997,600.00	1.67
2	央行票据	—	—
3	金融债券	9,996,000.00	5.58
	其中：政策性金融债	9,996,000.00	5.58
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	52,000.00	0.03
8	同业存单	137,733,800.00	76.83
9	其他	—	—
10	合计	150,779,400.00	84.11

### 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	111906099	19 交通银行 CD099	300,000	29,112,000.00	16.24
2	111812203	18 北京银行 CD203	300,000	29,046,000.00	16.20
3	111918044	19 华夏银行 CD044	220,000	21,348,800.00	11.91
4	111908049	19 中信银行 CD049	200,000	19,408,000.00	10.83
4	111910143	19 兴业银行 CD143	200,000	19,408,000.00	10.83
5	190201	19 国开 01	100,000	9,996,000.00	5.58

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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

#### 1、19 中信银行 CD049

根据交易商协会 2019 年 4 月 15 日的自律处分信息，公司作为江苏宏图科技股份有限公司相关债务融资工具的主承销商，在后续管理工作中存在以下违反银行间市场自律管理规则的行为：宏图高科于 2018 年 11 月 26 日披露了《江苏宏图科技股份有限公司关于“15 宏图 MTN001”与投资人达成一致的公告》，其中“已与‘15 宏图 MTN001’全部投资人就延期兑付方案达成一致”的表述与实际情况不符，中信银行作为“15 宏图 MTN001”的主承销商，在知悉上述不真实内容的情况下，未督导发行人就真实内容予以纠正，对发行人的督导职责履行不到位；中信银行于 2018 年 12 月 6 日召集召开了“18 宏图高科 SCP002”持有人会议，相关召集公告披露不及时，持有人会议议案披露不完整；2018 年 9 月和 11 月，宏图高科主体评级下调事项触发了“18 宏图高科 SCP002”投资者保护的事先约束条款，中信银行作为召集人未及时召开持有人会议。依据相关规定，经 2019 年第 4 次自律处分会议审议，给予中信银行通报批评处分，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。对以上事件，本基金判断，中信银行作为大型全国性股份制银行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

#### 2、19 兴业银行 CD143

根据银保监会 2018 年 5 月 4 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表—

银保监银罚决字〔2018〕1号-兴业银行股份有限公司》的公告，兴业银行因同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保、债券卖出回购业务违规出表、个人理财资金违规投资、向四证不全的房地产项目提供融资等12项违规被罚5870万元，这12项案由中，多涉及违反宏观调控政策、影子银行和交叉金融产品风险以及违法违规展业。与兴业银行一同被罚的还有该银行旗下的兴业金融租赁有限责任公司。兴业金融租赁因未制定明确的服务收费标准并公示以及办理融资租赁业务时搭售理财产品被罚110万元。除此之外，兴业银行苏州分行还存在买入返售业务项下基础资产不合规的情况，该银行两名直接责任人受到银保监会处罚。其中，原兴业银行苏州分行行长黄立峰受到警告处分，并被罚款5万元；胡刚被警告并罚款10万元。根据4月16日《上海银监局行政处罚信息公开表（沪银监罚决字〔2018〕12号）》，2015年9月，兴业银行股份有限公司上海分行在某理财业务中，对底层资产为非标准化债权资产的投资投前尽职调查严重不审慎。责令改正，罚款人民币50万元。根据4月2日中国人民银行福州中心支行公布了福银罚字〔2018〕10号行政处罚公示表，兴业银行股份有限公司因违反国库管理规定，被警告并处罚款5万元人民币。对以上事件，本基金做出如下说明：兴业银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，公司高度重视内部控制建设，并围绕内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督等方面不断加强和完善内部控制机制。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

### 3、19 民生银行 CD032

2018年11月9日，银保监银罚决字〔2018〕5号行政处罚信息公开表显示，公司贷款业务严重违反审慎经营规则，被处以罚款200万元；银保监银罚决字〔2018〕8号行政处罚信息公开表显示，公司内控管理严重违反审慎经营规则，同业投资违规接受担保，同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资，本行理财产品之间风险隔离不到位，个人理财资金违规投资，票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用，为非保本理财产品提供保本承诺，被处以罚款3,160万元。2019年4月2日，大银保监罚决字〔2019〕76号行政处罚信息公开表显示，公司以贷收贷，掩盖资产真实质量，以贷转存，虚增存贷款规模，被处以罚款100万元；大银保监罚决字〔2019〕78号行政处罚信息公开表显示，公司贷后管理不到位，银行承兑汇票保证金来源审查不严格，贷款回流作银行承兑汇票保证金，被处以罚款50万元；大银保监罚决字〔2019〕80号行政处罚信息公开表显示，公司贷后管理不到位，以贷收贷，掩盖资产真实质量，贴现资金回流作银行承兑汇票保证金，滚动循环签发银行承兑汇票，被处以罚款100万元。对以上事件，本基金判断，民生银行作为大型全国性股份制银行，经营稳健，上述处罚对公司影

响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

#### 4、19 浦发银行 CD082

根据银保监会 2018 年 5 月 4 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表—银监罚决字〔2018〕4 号—上海浦东发展银行股份有限公司》的公告，浦发银行因内控管理严重违反审慎经营规则；通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款；通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节；理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求；提供不实说明材料、不配合调查取证；以贷转存，虚增存贷款；票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严；国内信用证业务贸易背景审查不严；贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款；违规通过同业投资转存款方式，虚增存款；票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理；对代理收付资金的信托计划提供保本承诺；以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产；投资多款同业理财产品未尽职审查，涉及金额较大；修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符；为非保本理财产品出具保本承诺函；向关系人发放信用贷款；向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符；收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本共 19 项违规被罚罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。根据 1 月 20 日浦发银行《关于成都分行处罚事项的公告》2018 年 1 月 18 日，银监会四川监管局对公司成都分行作出行政处罚决定，对成都分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，执行罚款 46,175 万元人民币。此外，对成都分行原行长、2 名副行长、1 名部门负责人和 1 名支行行长分别给予禁止终身从事银行业工作、取消其高级管理人员任职资格、警告及罚款。对以上事件，本基金做出如下说明：浦发银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，上述处罚对经营管理不构成实质性影响，同时公司高度重视相关事项，已进一步采取控制措施改进或正在落实整改。针对成都分行上述违规经营事项，浦发银行高度重视，在监管机构和地方政府的指导和帮助下，及时调整了成都分行经营班子，并对资产状况进行了全面评估，分类施策、强化管理，按照审慎原则计提风险拨备，稳妥有序化解风险。目前，成都分行已按监管要求完成了整改，总体风险可控，客户权益未受影响，经营管理迈入正轨。在此基础上，公司在全行范围内认真开展举一反三教育整改工作，深刻反思，统一思想，吸取教训；端正全行经营理念，更加关注安全性、流动性和效益性的平衡发展，强化统一法人管理；将防范和化解金融风险放在更加突出的位置，强化学规内控体制机制建设，着重提升内控执行力和有效性，确保全行依法合规、稳健发展。并且上述处罚金额已全额计入 2017 年度公司损益，对公司的业务开展及持续经营无重大不利影响。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的

经营状况。

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票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	16,600.08
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,940,928.19
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,957,528.27

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券（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：本基金本报告期末前十名股票中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 盛丰 混合 A	25	4,452.81	0.00	0.00%	111,320.34	100.00%
长盛 盛丰 混合 C	173	1,024,253.52	177,117,928.74	99.96%	77,930.14	0.04%
合计	198	895,490.80	177,117,928.74	99.89%	189,250.48	0.11%

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	长盛盛丰 混合 A	98.55	0.0885%
	长盛盛丰 混合 C	1,315.78	0.0007%
	合计	1,414.33	0.0008%

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	长盛盛丰混合 A	0
	长盛盛丰混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	长盛盛丰混合 A	0
	长盛盛丰混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛丰混合 A	长盛盛丰混合 C
基金合同生效日（2016 年 11 月 18 日）基金 份额总额	9,994.45	700,098,467.17
本报告期期初基金份额总额	47,119.40	177,209,173.97
本报告期期间基金总申购份额	64,791.33	64,988,909.59
减：本报告期期间基金总赎回份额	590.39	65,002,224.68
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	111,320.34	177,195,858.88

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未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

根据公司 2019 年第一次临时股东会议决议，同意钱力不再担任公司第七届董事会董事，选举严琛担任公司第七届董事会董事。以上董事人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

因个人原因，杨思乐向公司申请辞去副总经理职务，根据公司第七届董事会第十二次会议决议，杨思乐不再担任公司副总经理职务。以上公司高级管理人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

根据公司第七届董事会第十三次会议决议，聘任张壬午担任首席信息官。以上公司高级管理人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

#### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 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 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
东北证券	2	59,507,067.00	100.00%	43,517.55	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券	32,674,611.37	100.00%	360,400,000.00	100.00%	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

- (1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。
- (2) 资力雄厚，信誉良好。
- (3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。
- (5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况： 无。

## § 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	20190101~20190630	78,108,027.75	0.00	0.00	78,108,027.75	44.05%
	2	20190101~20190630	99,009,900.99	0.00	0.00	99,009,900.99	55.84%
	3	20190325~20190506	0.00	64,961,023.39	64,961,023.39	0.00	0.00%

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。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

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

长盛基金管理有限公司

2019 年 8 月 27 日