长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金

2017 半年度 报告摘要

2017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：包商银行股份有限公司
送出日期：2017年8月24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。

基金托管人包商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月23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2017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	长盛盛世混合	
基金主代码	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	包商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	565,949,334.17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	8,014,592.60份	557,934,741.57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	（一）大类资产配置 在大类资产配置中，本基金将主要考虑：（1）宏观经济指标；（2）微观经济指标；（3）市场指标；（4）政策因素。本基金将通过深入分析上述指标与因素，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。 （二）股票投资策略 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。 1. 行业配置策略 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。 2.个股配置策略 在行业配置的基础上，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。 3. 动态调整和组合优化策略 本基金管理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	包商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	董熙
	联系电话	010-82019988	0755-33352056
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	dongyanbsh@163.com
客户服务电话		400-888-2666，010-62330088	95352
传真		010-82255988	0755-33352053

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	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

§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(2017年1月1日－2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日－2017年6月30日)
本期已实现收益	175,412.22	11,227,677.26
本期利润	443,419.10	29,686,149.25
加权平均基金份额本期利润	0.0492	0.0423
本期基金份额净值增长率	4.67%	4.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0810	0.0270
期末基金资产净值	8,984,805.67	594,378,021.57
期末基金份额净值	1.121	1.065

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	1.72%	0.16%	3.01%	0.34%	-1.29%	-0.18%
过去三个月	2.37%	0.14%	3.16%	0.32%	-0.79%	-0.18%
过去六个月	4.67%	0.12%	5.36%	0.29%	-0.69%	-0.17%
过去一年	11.21%	0.30%	8.32%	0.35%	2.89%	-0.05%
自基金合同生效起至今	12.10%	0.25%	2.90%	0.61%	9.20%	-0.36%

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	1.62%	0.13%	3.01%	0.34%	-1.39%	-0.21%
过去三个月	2.31%	0.13%	3.16%	0.32%	-0.85%	-0.19%
过去六个月	4.41%	0.11%	5.36%	0.29%	-0.95%	-0.18%
过去一年	5.86%	0.10%	8.32%	0.35%	-2.46%	-0.25%
自基金合同生效起至今	6.50%	0.09%	2.90%	0.61%	3.60%	-0.52%

注：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第十二部分“二、投资范围”和“四、投资限制”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、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）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和特定客户资产管理业务资格，截至2017年6月30日，基金管理人共管理十二只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品，公司同时兼任境内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、长盛双月红1年期定期开放债券型投资基金基金经理、长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理、长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛祺一年期定期开放债券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。	2016年9月12日	–	11年	李琪先生，1975年2月出生。天津大学管理学博士。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。
冯雨生	本基金基金经理、长盛中证100指数证券投资基金基金经理、长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理、长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛中证申万一带一路主题指数分级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、长盛中证金融证券公司指数分级证券投资基金基金经理、长盛战略新兴产业灵活配置混合型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、长盛同鑫行业优选混合型证券投资基金基金经理、长盛信息安全主题量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理、量化投资部负责人。	2016年9月12日	–	9年	冯雨生先生，1983年11月出生，毕业于光华管理学院金融系，北京大学经济学硕士、CFA（特许金融分析师）。2007年7月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程研究员，同盛基金经理助理等职务。
杨衡	本基金基金经理、长盛鼎睿灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛鼎祥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、长盛盛世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、长盛盛利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛腾灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛荣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、长盛盛益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛盈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。	2015年12月11日	2017年2月28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。

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 管理人对投资决策的说明

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，公司风控管理部、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

回顾上半年，新一轮库存周期对经济基本面形成支撑，生产平稳、外需改善，宏观经济总体平稳；通胀方面，食品价格稳中有落，中上游价格走弱带动PPI高位回落，通胀预期回落；受汇率、资产价格以及金融监管去杠杆等因素制约，货币政策更趋于稳健，央行两次上调公开市场操作利率，资金面总体呈现中性偏紧局面。

1月至5月初，债券市场延续了去年四季度以来的调整走势，收益率曲线整体上行，10年期国开债一度上行至4.38%的近期高点；5月中旬以来，经济下行压力逐步显现，叠加汇率压力减弱、金融去杠杆节奏放缓、央行释放稳定流动性预期信号等因素，市场预期修复，现券利率有所下行，债券收益率曲线平坦化下移。

上半年，A股市场总体呈现震荡走势，上证综指上涨2.86%，沪深300指数上涨10.78%，创业板指下跌7.34%。一季度，经济延续改善和企业盈利持续好转，推动A股市场走出漫牛行情；4月初至5月上旬，受金融监管去杠杆、央行上调逆回购利率等因素影响，股市呈现下跌走势；5月中下旬以来，随着金融去杠杆节奏放缓、央行释放稳定流动性信号，叠加新股发行、股东减持等新规的出台，市场走出一波反弹行情。从市场结构来看，行情分化明显，白马股、消费股、绩优蓝筹股显著跑赢市场，而估值较高的成长股则表现较弱。

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，在信用风险可控的前提下重点配置高信用评级的中短期信用债，保持组合流动性和安全性，适度参与利率品种的投资机会，通过不同期限品种逆回购等货币类工具的组合操作，提升资金使用效率和灵活性。权益资产方面，根据市场行情变化，灵活调整权益资产比重，以避免净值大幅波动和回撤。此外，本基金紧密跟踪新股发行，积极准备新股网下申购底仓配置，通过参与新股申购，以提升组合收益。

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1.121元，本报告期基金份额净值增长率为4.67%；截至本报告期末长盛盛世混合C基金份额净值为1.065元，本报告期基金份额净值增长率为4.41%；同期业绩比较基准收益率为5.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着供给侧改革价格效应消退、补库存周期结束，叠加房地产投资增速见顶回落和地方政府融资监管趋严等因素影响，经济下行压力渐显，受资产价格、金融去杠杆及汇率等因素制约，货币政策将维持稳健中性，预计资金面将呈现中性偏紧局面。

在海内外经济和政策等多重因素影响下，预计债市波动将加大。投资操作上需重视信用债的票息价值，同时谨慎把握经济基本面再次转弱、流动性边际放松、人民币贬值压力暂缓等带来的利率债交易性机会。

股票市场方面，对中长期经济前景的隐忧使得市场风险偏好难以显著回升，股市存量资金博弈局面难改，但随着经济结构转型及供给侧改革的推进，未来市场将孕育出一些结构性机会，比如，二线蓝筹股、低估值高分红的金融板块以及改革深化、供给侧改革、消费升级等主题机会。

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《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至2017年6月30日，期末可供分配利润为15,695,358.33元，其中：长盛盛世混合A期末可供分配利润为649,513.01元（未分配利润已实现部分为649,513.01元，未分配利润未实现部分为320,700.06元），长盛盛世混合C期末可供分配利润为15,045,845.32元（未分配利润已实现部分为15,045,845.32元，未分配利润未实现部分为21,397,434.68元）。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，包商银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为，该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由长盛基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：		
银行存款	76,714,357.54	5,180,269.52
结算备付金	400,000.00	4,041,192.57
存出保证金	77,700.45	48,792.40
交易性金融资产	484,949,755.66	681,941,687.83
其中：股票投资	132,756,448.20	90,719,899.31
基金投资	–	–
债券投资	352,193,307.46	591,221,788.52
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	79,946,134.97	85,000,647.50
应收证券清算款	77,436.26	–
应收利息	6,630,659.45	5,970,672.74
应收股利	–	–
应收申购款	499.25	80,711.64
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	648,796,543.58	782,263,974.20
负债和所有者权益	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债：		
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	44,781,251.14	120.00
应付赎回款	7,806.69	7,641.86
应付管理人报酬	305,378.30	381,315.52
应付托管费	101,792.76	127,105.19
应付销售服务费	100,313.39	115,251.76
应付交易费用	9,224.65	38,689.51
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	127,949.41	60,000.00
负债合计	45,433,716.34	730,123.84
所有者权益：		
实收基金	565,949,334.17	765,522,553.32
未分配利润	37,413,493.07	16,011,297.04
所有者权益合计	603,362,827.24	781,533,850.36
负债和所有者权益总计	648,796,543.58	782,263,974.20

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额总额565,949,334.17份，其中长盛盛世混合A类份额8,014,592.60份，份额净值1.121元，长盛盛世混合C类份额557,934,741.57份，份额净值1.065元。

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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入	34,030,380.42	1,601,362.82
1.利息收入	8,922,953.09	3,951,478.49
其中：存款利息收入	101,942.93	333,553.19
债券利息收入	8,218,566.12	2,680,064.81
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	602,444.04	937,860.49
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	6,367,506.48	-5,289,390.07
其中：股票投资收益	5,255,968.57	-165,298.99
基金投资收益	–	–
债券投资收益	-151,574.95	-5,448,156.17
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	1,263,112.86	324,065.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	18,726,478.87	2,927,618.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	13,441.98	11,656.23
减：二、费用	3,900,812.07	1,636,071.19
1. 管理人报酬	2,203,954.19	901,225.92
2. 托管费	734,651.39	300,408.70
3. 销售服务费	724,862.64	289,566.16
4. 交易费用	55,965.64	61,279.38
5. 利息支出	34,812.55	3,073.97
其中：卖出回购金融资产支出	34,812.55	3,073.97
6. 其他费用	146,565.66	80,517.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	30,129,568.35	-34,708.37
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	30,129,568.35	-34,708.37

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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1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）	765,522,553.32	16,011,297.04	781,533,850.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	30,129,568.35	30,129,568.35
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）	-199,573,219.15	-8,727,372.32	-208,300,591.47
其中：1.基金申购款	2,571,694.16	175,997.71	2,747,691.87
2.基金赎回款	-202,144,913.31	-8,903,370.03	-211,048,283.34
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）	565,949,334.17	37,413,493.07	603,362,827.24
	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
项目	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）	382,216,462.07	394,446.00	382,610,908.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-34,708.37	-34,708.37
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）	-13,978,880.28	1,706,797.80	-12,272,082.48
其中：1.基金申购款	684,707,463.73	567,477.07	685,274,940.80
2.基金赎回款	-698,686,344.01	1,139,320.73	-697,547,023.28
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）	368,237,581.79	2,066,535.43	370,304,117.22

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：

林晓富　　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募集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，其中认购资金利息折合11,308.07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，基金托管人为包商银行股份有限公司。

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。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的，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。

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60%-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%。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。

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2017年6月30日的财务状况以及2017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[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号文《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号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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 。

(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。

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

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。

6.4.7.2 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
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

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：本基金未开通关联方交易单元。

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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,203,954.19	901,225.92
其中：支付销售机构的客户维护费	6,513.76	18,111.77

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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	734,651.39	300,408.70

注：支付基金托管人包商银行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。

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 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应