# 长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人：长盛基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2018年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金简称 | 长盛中证证券公司分级 | | |
| 场内简称 | 券商分级 | | |
| 基金主代码 | 502053 | | |
| 交易代码 | 502053 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2015年8月13日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 89,057,875.90份 | | |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对中证全指证券公司指数的有效跟踪。 | | |
| 投资策略 | 1、股票投资策略<br>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。<br>在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。<br>2、债券组合管理策略<br>基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。<br>3、金融衍生工具投资策略<br>在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低调仓成本与跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。<br>4、资产支持证券投资策略<br>本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。 | | |
| 业绩比较基准 | 中证全指证券公司指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5% | | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金，风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。 | | |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长盛中证证券公司分级A | 长盛中证证券公司分级B | 长盛中证证券公司分级 |
| 下属分级基金场内简称 | 券商A | 券商B | 券商分级 |
| 下属分级基金的交易代码 | 502054 | 502055 | 502053 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 9,916,567.00份 | 9,916,567.00份 | 69,224,741.90份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 低风险、收益相对稳定 | 高风险、高预期收益 | 较高风险、较高预期收益 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2018年7月1日－2018年9月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -15,732,780.19 |
| 2.本期利润 | -4,618,031.28 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0260 |
| 4.期末基金资产净值 | 93,252,880.83 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.047 |

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到2018年9月30日。

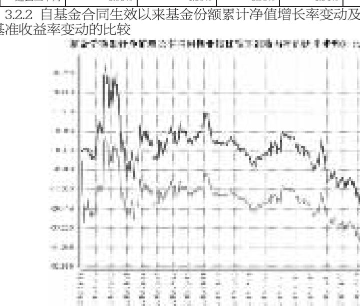
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -3.03% | 1.30% | -3.98% | 1.34% | 0.95% | -0.04% |

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



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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，长盛成长价值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，长盛盛世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，长盛同鑫行业配置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，长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金经理，量化投资部负责人。 | 2015年8月13日 | － | 11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。 |

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度股票市场一路走低，除少数板块外个股大幅下跌。行业上，家用电器、纺织服装和医药生物跌幅最大，银行、非银金融和采掘表现较好。概念板块上，页岩气概念、丝路概念和新疆区域振兴概念大幅跑赢市场，次新股、影视概念和创新药概念跌幅居前。风格上，三季度大盘价值股跑赢小盘成长股。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.047元；本报告期基金份额净值增长率为-3.03%，业绩比较基准收益率为-3.98%。本报告期内日均跟踪误差为0.1051%，年度化跟踪误差为1.6615%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 86,612,628.06 | 91.09 |
| | 其中：股票 | 86,612,628.06 | 91.09 |
| 2 | 基金投资 | － | － |
| 3 | 固定收益投资 | － | － |
| | 其中：债券 | － | － |
| | 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 | 8,404,203.47 | 8.84 |
| 8 | 其他资产 | 69,557.85 | 0.07 |
| 9 | 合计 | 95,086,389.38 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | － | － |
| B | 采矿业 | － | － |
| C | 制造业 | － | － |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | － | － |
| E | 建筑业 | － | － |
| F | 批发和零售业 | － | － |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | － | － |
| H | 住宿和餐饮业 | － | － |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | － | － |
| J | 金融业 | 86,612,628.06 | 92.88 |
| K | 房地产业 | － | － |
| L | 租赁和商务服务业 | － | － |
| M | 科学研究和技术服务业 | － | － |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | － | － |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | － | － |
| P | 教育 | － | － |
| Q | 卫生和社会工作 | － | － |
| R | 文化、体育和娱乐业 | － | － |
| S | 综合 | － | － |
| | 合计 | 86,612,628.06 | 92.88 |

5.2.2 报告期末积极投资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积极投资股票。

5.2.3 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。

5.3 报告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

5.3.1 报告期末指数投资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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600030 | 中信证券 | 909,200 | 15,174,548.00 | 16.27 |
| 2 | 600837 | 海通证券 | 979,088 | 8,772,628.48 | 9.41 |
| 3 | 601211 | 国泰君安 | 454,927 | 6,819,355.73 | 7.31 |
| 4 | 601688 | 华泰证券 | 395,123 | 6,223,187.25 | 6.67 |
| 5 | 000776 | 广发证券 | 356,145 | 4,932,608.25 | 5.29 |
| 6 | 600958 | 东方证券 | 436,733 | 3,900,025.69 | 4.18 |
| 7 | 000166 | 申万宏源 | 823,463 | 3,705,583.50 | 3.97 |
| 8 | 600999 | 招商证券 | 276,898 | 3,635,670.74 | 3.90 |
| 9 | 601901 | 方正证券 | 498,419 | 2,751,272.88 | 2.95 |
| 10 | 601377 | 兴业证券 | 561,099 | 2,547,389.46 | 2.73 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 6,913.60 |
| 2 | 应收证券清算款 | － |
| 3 | 应收股利 | － |
| 4 | 应收利息 | 4,897.90 |
| 5 | 应收申购款 | 57,746.35 |
| 6 | 其他应收款 | － |
| 7 | 待摊费用 | － |
| 8 | 其他 | － |
| 9 | 合计 | 69,557.85 |

5.11.4 报告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）。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长盛中证证券公司分级A | 长盛中证证券公司分级B | 长盛中证证券公司分级 |
|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 43,042,836.00 | 43,042,836.00 | 112,939,563.91 |
| 报告期期间基金总申购份额 | － | － | 12,348,019.19 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | － | － | 52,870,246.81 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | -33,126,269.00 | -33,126,269.00 | -3,192,594.39 |
| 报告期期末基金份额总额 | 9,916,567.00 | 9,916,567.00 | 69,224,741.90 |

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件；

2、《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》；

3、《长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金托管协议》；

4、《长盛中证全指证券公司指数分级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。

9.2 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。

9.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2018年10月24日

# 新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人：新疆前海联合基金管理有限公司
基金托管人：南京银行股份有限公司
报告送出日期：2018年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 前海联合泓鑫混合 |
| 场内简称 | － |
| 交易代码 | 002780 |
| 前端交易代码 | － |
| 后端交易代码 | － |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年2月26日 |
| 报告期末基金份额总额 | 243,297,956.76份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的基础上，通过对不同资产类别的优化配置及组合精选，力求实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金遵循价值投资的理念，研判市场情况精选标的，通过长期持有分享标的公司的成长，同时力争实现超越业绩基准的超额收益。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*50%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 |
| 基金管理人 | 新疆前海联合基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 南京银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2018年7月1日－2018年9月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -4,050,391.62 |
| 2.本期利润 | -3,949,411.27 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0163 |
| 4.期末基金资产净值 | 242,786,743.82 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9979 |

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或者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。

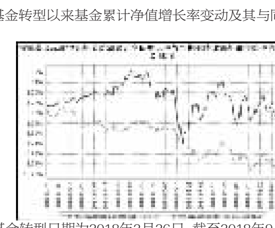
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -1.59% | 1.10% | -0.60% | 0.67% | -0.99% | 0.43% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*50%+中债综合全价指数收益率*50%。

3.2.2 自基金转型以来基金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：1、本基金转型日期为2018年2月26日，截至2018年9月30日止，本基金转型未满一年。

2、按照基金合同和招募说明书的约定，本基金自转型起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 林材 | 本基金的基金经理 | 2016年11月30日 | － | 11年 | 林材先生，理学硕士，11年证券基金投资研究经验。2011年10月至2015年7月任金元顺安基金经理，2008年11月至2011年10月任民生加银基金医药行业研究员、基金经理助理。2000年7月至2003年9月曾任职于广州医药集团。2015年9月加入前海联合基金。现任前海联合添利债券兼前海联合新思路混合、前海联合沪深300、前海联合泓鑫混合、前海联合国民健康混合和前海联合研究优选混合的基金经理。 |
| 何杰 | 本基金的基金经理 | 2018年4月12日 | － | 8年 | 何杰先生，经济数学硕士，8年证券、基金投资研究经验。2013年5月至2018年2月任前海人寿保险股份有限公司资产管理中心投资经理。2010年3月至2013年3月任华创证券股份有限责任公司研究所研究员。2018年3月加入前海联合基金，现任前海联合泓鑫混合兼前海联合研究优选混合的基金经理。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离任日期"为根据公司对外公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司对外公告的聘任日期和解聘日期。

2、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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了相应的制度和流程，通过系统和人工等各种方式在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个业务环节保证公平交易制度的严格执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，保护投资者合法权益。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内，未发生有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

从基本面看，高频数据印证宏观经济预期下修的判断，但经济失速风险不大；从市场估值看，市场估值也接近历史底部区域，货币政策持续偏宽松。宏观预期下调、信用风险、贸易战仍是中期影响市场主要矛盾。前期市场快速下跌后风险释放充分，且近期政策面释放明显宽松信号，短期贸易战和信用风险预期过度悲观有所修复，但中期压制因素并未明朗，预计市场仍处于中期筑底阶段，因此报告期内保持中等仓位水平。

配置结构上，考虑到中国正处于新旧动能重要转换期：医药、计算机、新能源为代表的新经济板块，仍将是中期主线，但技术进步成长进程中，需精选引领行业的龙头个股；消费板块中，满足美好生活需求将贯穿主线，关注新业态、新产品等消费升级模式；周期板块中，关注低估值可持续现金分红的行业龙头。因此，在个股选择上，仍主要按上述思路精选基本面扎实、增长趋势明确的优质公司，坚守长期价值投资底线，与上市公司共同成长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.9979元；本报告期基金份额净值增长率为-1.59%，业绩比较基准收益率为-0.60%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 145,719,943.68 | 59.06 |
| | 其中：股票 | 145,719,943.68 | 59.06 |
| 2 | 基金投资 | － | － |
| 3 | 固定收益投资 | 26,064,600.00 | 10.56 |
| | 其中：债券 | 26,064,600.00 | 10.56 |
| | 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 | 63,000,000.00 | 25.53 |
| | 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 | 10,086,752.26 | 4.09 |
| 8 | 其他资产 | 1,869,046.87 | 0.76 |
| 9 | 合计 | 246,740,342.81 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | － | － |
| B | 采矿业 | － | － |
| C | 制造业 | 86,797,128.10 | 35.75 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | － | － |
| E | 建筑业 | － | － |
| F | 批发和零售业 | － | － |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | － | － |
| H | 住宿和餐饮业 | － | － |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 41,788,820.00 | 17.21 |
| J | 金融业 | － | － |
| K | 房地产业 | － | － |
| L | 租赁和商务服务业 | 7,639,920.58 | 3.15 |
| M | 科学研究和技术服务业 | － | － |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | － | － |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | － | － |
| P | 教育 | － | － |
| Q | 卫生和社会工作 | － | － |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 9,494,075.00 | 3.91 |
| S | 综合 | － | － |
| | 合计 | 145,719,943.68 | 60.02 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通机制投资港股。

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600570 | 恒生电子 | 350,000 | 19,323,500.00 | 7.96 |
| 2 | 000977 | 浪潮信息 | 760,000 | 18,300,800.00 | 7.54 |
| 3 | 300349 | 金卡股份 | 727,660 | 11,809,921.80 | 4.86 |
| 4 | 300144 | 宋城演艺 | 426,700 | 9,494,075.00 | 3.91 |
| 5 | 600563 | 法拉电子 | 200,000 | 8,858,000.00 | 3.65 |
| 6 | 300047 | 天源迪科 | 690,000 | 8,721,600.00 | 3.59 |
| 7 | 002332 | 仙琚制药 | 1,200,000 | 8,484,000.00 | 3.49 |
| 8 | 601012 | 隆基股份 | 569,871 | 8,092,168.20 | 3.33 |
| 9 | 600845 | 宝信软件 | 330,000 | 8,088,300.00 | 3.33 |
| 10 | 603517 | 绝味食品 | 187,000 | 7,835,300.00 | 3.23 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | － | － |
| 2 | 央行票据 | － | － |
| 3 | 金融债券 | 26,064,600.00 | 10.74 |
| | 其中：政策性金融债 | 26,064,600.00 | 10.74 |
| 4 | 企业债券 | － | － |
| 5 | 企业短期融资券 | － | － |
| 6 | 中期票据 | － | － |
| 7 | 可转债（可交换债） | － | － |
| 8 | 同业存单 | － | － |
| 9 | 其他 | － | － |
| 10 | 合计 | 26,064,600.00 | 10.74 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 180209 | 18国开09 | 200,000 | 20,034,000.00 | 8.25 |
| 2 | 018006 | 国开1702 | 60,000 | 6,030,600.00 | 2.48 |

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未参与投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未参与投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未参与投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 472,158.54 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,125,838.42 |
| 3 | 应收股利 | － |
| 4 | 应收利息 | 270,963.05 |
| 5 | 应收申购款 | 86.86 |
| 6 | 其他应收款 | － |
| 7 | 待摊费用 | － |
| 8 | 其他 | － |
| 9 | 合计 | 1,869,046.87 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 242,104,902.98 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,278,514.36 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 85,460.58 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | － |
| 报告期期末基金份额总额 | 243,297,956.76 |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | 2018年7月1日-2018年9月30日 | 96,710,831.72 | － | － | 96,710,831.72 | 39.75% |
| | 2 | 2018年7月1日-2018年9月30日 | 96,710,831.72 | － | － | 96,710,831.72 | 39.75% |
| | 3 | 2018年7月1日-2018年7月26日 | 48,487,400.00 | － | － | 48,487,400.00 | 19.93% |
| 个人 | － | － | － | － | － | － | － |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，单一投资者持有基金份额比例过于集中可能引起产品的流动性风险，本基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，有效防控产品流动性风险，公平对待投资者，保障中小投资者合法权益，本基金管理人拥有完全、独立的投资决策权，不受特定投资者的影响。 | | | | | | | |

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2018年7月21日及10月18日发布公告，李华先生自2018年7月21日起离任公司督察长职务，由总经理王晓耕女士代为履行督察长职务，代履行职务期限不超过2019年1月16日。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准新疆前海联合全民健康产业灵活配置混合型证券投资基金变更注册的文件；

2、《新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金合同》；

3、《新疆前海联合泓鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

4、法律意见书；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

9.2 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场所。

9.3 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、营业场所及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。

新疆前海联合基金管理有限公司
2018年10月24日

# 长盛中证金融地产指数分级证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2018年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金简称 | 长盛中证金融地产分级 | | |
| 场内简称 | 金融地产 | | |
| 基金主代码 | 160814 | | |
| 交易代码 | 160814 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2015年6月16日 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 235,337,381.30份 | | |
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，实现对中证金融地产指数的有效跟踪。 | | |
| 投资策略 | 1、股票投资策略<br>本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。<br>2、债券组合管理策略<br>基于流动性管理的需要，本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债，债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。<br>3、金融衍生工具投资策略<br>在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制并降低投资组合风险、提高投资效率，降低调仓成本与跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。 | | |
| 业绩比较基准 | 中证金融地产指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5% | | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型指数基金，风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。 | | |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长盛中证金融地产分级A | 长盛中证金融地产分级B | 长盛中证金融地产分级 |
| 下属分级基金场内简称 | 金融地A | 金融地B | 金融地产 |
| 下属分级基金的交易代码 | 150281 | 150282 | 160814 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 15,623,382.00份 | 15,623,382.00份 | 204,090,617.30份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 低风险、收益相对稳定 | 高风险、高预期收益 | 较高风险、较高预期收益 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2018年7月1日－2018年9月30日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 2,937,355.84 |
| 2.本期利润 | 11,956,916.25 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0503 |
| 4.期末基金资产净值 | 177,890,447.63 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.756 |

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到2018年9月30日。

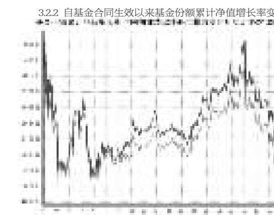
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 7.23% | 1.36% | 4.92% | 1.38% | 2.31% | -0.02% |

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，本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。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王超 | 本基金基金经理，长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理，长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）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，长盛盛鑫灵活配置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，长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金经理，长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛上证50指数分级证券投资基金基金经理。 | 2015年6月16日 | － | 11年 | 王超先生，1981年9月出生。中央财经大学硕士，CFA（特许金融分析师），FRM（金融风险管理师）。2007年7月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。 |

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略，尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响，将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.756元；本报告期基金份额净值增长率为7.23%，业绩比较基准收益率为4.92%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.07%，控制在0.35%之内；年化跟踪误差为1.46%，控制在4%之内。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 165,010,409.84 | 92.37 |
| | 其中：股票 | 165,010,409.84 | 92.37 |
| 2 | 基金投资 | － | － |
| 3 | 固定收益投资 | － | － |
| | 其中：债券 | － | － |
| | 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 | 12,671,438.12 | 7.09 |
| 8 | 其他资产 | 964,186.23 | 0.54 |
| 9 | 合计 | 178,646,034.19 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | － | － |
| B | 采矿业 | － | － |
| C | 制造业 | － | － |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | － | － |
| E | 建筑业 | － | － |
| F | 批发和零售业 | － | － |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | － | － |
| H | 住宿和餐饮业 | － | － |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | － | － |
| J | 金融业 | 141,990,599.57 | 79.82 |
| K | 房地产业 | 21,814,376.69 | 12.26 |
| L | 租赁和商务服务业 | － | － |
| M | 科学研究和技术服务业 | － | － |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | － | － |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | － | － |
| P | 教育 | － | － |
| Q | 卫生和社会工作 | － | － |
| R | 文化、体育和娱乐业 | － | － |
| S | 综合 | 310,000.00 | 0.17 |
| | 合计 | 164,114,976.26 | 92.26 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | － | － |
| B | 采掘业 | － | － |
| C | 制造业 | 56,842.41 | 0.03 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,433.96 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 108,232.20 | 0.06 |
| F | 批发和零售业 | － | － |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,005.10 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | － | － |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | － | － |
| J | 金融业 | 595,363.91 | 0.33 |
| K | 房地产业 | 130,556.00 | 0.07 |
| L | 租赁和商务服务业 | － | － |
| M | 科学研究和技术服务业 | － | － |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | － | － |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | － | － |
| P | 教育 | － | － |
| Q | 卫生和社会工作 | － | － |
| R | 文化、体育和娱乐业 | － | － |
| S | 综合 | － | － |
| | 合计 | 895,433.58 | 0.50 |

5.2.3 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。

5.3 报告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

5.3.1 报告期末指数投资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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 427,057 | 29,253,404.50 | 16.44 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 427,602 | 13,123,105.38 | 7.38 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 476,588 | 7,601,578.60 | 4.27 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 1,181,894 | 7,493,207.96 | 4.21 |
| 5 | 601328 | 交通银行 | 1,146,850 | 6,697,604.00 | 3.77 |
| 6 | 601288 | 农业银行 | 1,681,034 | 6,539,222.26 | 3.68 |
| 7 | 601939 | 建设银行 | 798,747 | 5,782,928.28 | 3.25 |
| 8 | 601398 | 工商银行 | 900,149 | 5,193,859.73 | 2.92 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 309,806 | 5,170,662.14 | 2.91 |
| 10 | 600000 | 浦发银行 | 441,352 | 4,687,158.24 | 2.63 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601577 | 长沙银行 | 17,329 | 196,510.86 | 0.11 |
| 2 | 600901 | 江苏租赁 | 23,435 | 157,717.55 | 0.09 |
| 3 | 601066 | 中信建投 | 18,690 | 147,837.90 | 0.08 |
| 4 | 000897 | 津滨发展 | 51,400 | 130,556.00 | 0.07 |
| 5 | 601068 | 中铝国际 | 13,770 | 108,232.20 | 0.06 |

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

1、兴业银行：本基金跟踪的标的指数为中证金融地产指数，配置了中证金融地产指数成分股兴业银行。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。兴业金融租赁因违规向非融资租赁业务进行补足承诺，另外违规向地方政府提供融资等情况，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授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体系。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。

2、浦发银行：本基金跟踪的标的指数为中证金融地产指数，配置了中证金融地产指数成分股浦发银行。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，强化合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。

3、农业银行：本基金跟踪的标的指数为中证金融地产指数，配置了中证金融地产指数成分股农业银行。根据2018年5月15日农业银行股份有限公司发布的"非公开发行股票申请文件反馈意见的回复"中提到"农业银行及境内分支机构报告期内（2015年至2017年）存在被税务机关处以的单笔金额为10万元（含）以上的税务处罚共计44笔，涉及罚款金额共计约2,320.43万元，主要涉及的处罚事由为少申报税款、未按规定代扣代缴个人所得税等。"其中涉及湖北省分行、浙江省分行、广东省分行等。对此事件，本基金做出如下说明：

农业银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，上述行政处罚种类主要为罚款，且未导致农业银行或境内分支机构之合法存续受到重大不利影响或业务经营所需之批准、许可、授权或备案被撤销，包括但不限于被吊销《金融许可证》或营业执照等重大后果。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。

5.11.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 11,621.20 |
| 2 | 应收证券清算款 | 936,251.54 |
| 3 | 应收股利 | － |
| 4 | 应收利息 | 2,306.77 |
| 5 | 应收申购款 | 14,006.72 |
| 6 | 其他应收款 | － |
| 7 | 待摊费用 | － |
| 8 | 其他 | － |
| 9 | 合计 | 964,186.23 |

5.11.4 报告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）。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末积极投资股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长盛中证金融地产分级A | 长盛中证金融地产分级B | 长盛中证金融地产分级 |
|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 15,368,619.00 | 15,368,619.00 | 209,997,406.05 |
| 报告期期间基金总申购份额 | － | － | 1,833,410.67 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | － | － | 7,230,673.42 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列） | 254,763.00 | 254,763.00 | -509,526.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 15,623,382.00 | 15,623,382.00 | 204,090,617.30 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件；

2、《长盛中证金融地产分级证券投资基金基金合同》；

3、《长盛中证金融地产分级证券投资基金托管协议》；

4、《长盛中证金融地产分级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。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/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、010-62350088。

网址：http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2018年10月24日