

长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

报告期内净值、微利跑、低价股等风格表现较好，绩优股、高市净率和高价股等风格表现较差

组合操作上，我们严格按照基金合同约定的投资流程，利用多种量化策略深度挖掘主题驱动型或成长型企业的股票构建投资组合，并根据市场环境变化和量化策略特性，对投资组合进行调仓和配置。

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0.840元；本报告期基金份额净值增长率为-10.84%，业绩比较基准收益率为-5.04%。

4.6 报告期内基金持有人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)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	95,411,299.28	92.06
2	固定收益投资	39,413,000.00	38.06
3	衍生品投资	—	—
4	金融资产公允价值变动损益	62,381.33	0.01
5	其他资产	62,381.33	0.01
6	其他负债	—	—
7	资产减值准备	—	—
8	其他	—	—
9	合计	134,873,680.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	867,220.00	0.09
B	采矿业	—	—
C	制造业	225,124,147.93	23.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,043,760.00	0.09
E	建筑业	1,087,000.00	0.09
F	批发和零售业	269,449.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	1,179,220.00	0.10
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,074,104.00	0.84
J	金融业	—	—
K	房地产业	496,000.00	0.05
L	租赁和商务服务业	3,096,120.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	卫生、社会保障和社会福利业	—	—
O	教育、文化和体育业	—	—
P	娱乐、休闲和旅游业	—	—
Q	综合类	203,360.00	0.06
合计	合计	39,413,000.00	69.05

5.2.2 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

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	000001	万科A	100,000	3,490,000.00	4.08
2	600046	东方明珠	100,000	3,286,000.00	3.90
3	300001	东方财富	100,000	1,940,000.00	2.30
4	600111	招商轮船	100,000	1,884,000.00	2.20
5	300022	通威股份	170,000	1,862,100.00	2.20
6	600263	天龙集团	100,000	1,490,000.00	1.74
7	000003	中兴通讯	75,000	1,459,352.12	1.74
8	000002	万科H	100,000	1,390,000.00	1.65
9	600260	凯撒旅游	100,000	1,185,000.00	1.40
10	000061	圣农发展	60,000	1,176,000.00	1.39

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投资。

5.4.2 报告期末按品种分类的国债期货投资组合

注:本基金本报告期末未持有国债期货投资。

5.4.3 报告期末按品种分类的股指期货投资组合

注:本基金本报告期末未持有股指期货投资。

5.4.4 报告期末按品种分类的期权投资组合

注:本基金本报告期末未持有期权投资。

5.4.5 报告期末按品种分类的权证投资组合

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

5.4.6 报告期末按品种分类的资产支持证券投资组合

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.4.7 报告期末按品种分类的贵金属投资组合

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.4.8 报告期末按品种分类的衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有衍生品投资。

5.4.9 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.10 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.11 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.12 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.13 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.14 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.15 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.16 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.17 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.18 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.19 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.20 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.21 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.22 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.23 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.24 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.25 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.26 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.27 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.28 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.29 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.30 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.31 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

5.4.32 报告期末按品种分类的其他衍生品投资组合

注:本基金本报告期末未持有其他衍生品投资。

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:2019年1月19日

§1 重要提示
基金管理人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2019年1月18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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称:长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金
基金代码:005906
基金简称:长盛量化多策略
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
基金合同生效日期:2018年11月13日

基金运作方式:契约型开放式
基金投资策略:本基金采用量化模型,通过数据挖掘和因子分析,结合基本面、技术面、市场面、资金面、情绪面等多种因素,构建量化模型,对股票、债券、商品、期货、期权等资产进行配置,并根据市场环境变化和量化策略特性,对投资组合进行调仓和配置。

基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×40%+中证500指数收益率×40%+中债综合指数收益率×20%
基金风险等级:中风险
基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3 主要财务指标和基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.1 主要财务指标

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2 自基金合同生效以来某基金资产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

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2.1 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2.2 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2.3 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2.4 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2.5 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2.6 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2.7 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2.8 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2.9 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2.10 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2.11 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

§3.2.2.12 基金净值表现

基金管理人承诺: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。

本报告期中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。

长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金

2018年第四季度报告

报告期内净值、微利跑、低价股等风格表现较好，绩优股、高市净率和高价股等风格表现较差

组合操作上，我们严格按照基金合同约定的投资流程，利用多种量化策略深度挖掘主题驱动型或成长型企业的股票构建投资组合，并根据市场环境变化和量化策略特性，对投资组合进行调仓和配置。

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1.354元；本报告期基金份额净值增长率为-10.39%，业绩比较基准收益率为-3.67%。

4.6 报告期内基金持有人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)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	92,520,325.84	67.67
2	固定收益投资	52,520,325.84	42.67
3	衍生品投资	—	—
4	金融资产公允价值变动损益	69,790.20	0.05
5	其他资产	69,790.20	0.05
6	其他负债	—	—
7	资产减值准备	—	—
8	其他	—	—
9	合计	145,180,232.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	8,562,240.00	0.5