长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:2019年4月22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2019年4月19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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛量化多策略
基金主代码	003658
交易代码	003658
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年2月22日
报告期末基金份额总额	66,023,896.97份
投资目标	通过对多种策略超额收益进行历史有效性验证和持续监控,深度挖掘具备阶段性成长机会的上市公司,满足投资人长期稳健的投资收益需求。
投资策略	(一)大类资产配置策略 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。 (二)股票投资策略 1、量化策略相关子策略 基金管理人主要根据上市公司基本面数据、二级市场交易价格特征、分析师预期信息和行为特征、上市公司行为等数据和信息构建多个量化选股策略,并对组合中的相关策略,定期采用等权重配置进行再平衡,并在此基础上进行优化和调整。 (1)基于基本面的多因子选股策略 基金管理人对上市公司基本面数据进行因子化,并进行了历史回测,选择长期表现稳定的因子作为选股标准,主要选择盈利水平因子、成长性因子、盈利质量因子和估值因子等长期表现较好的因子。 (2)基于二级市场交易特征的多因子选股策略 基金管理人对二级市场交易特征数据进行因子化,并进行了历史回测,选择长期表现稳定的因子作为选股标准,主要选择股价冲击成本因子、价格弹性因子、价格动量因子、非线性市值等长期表现较好的因子。 (3)分析师羊群行为事件驱动策略 分析师对股票的推荐行为存在明显的羊群行为特征,会对股价形成持续的推动作用,基金管理人利用这一效应构建了与之相对应的事件驱动策略。 (4)上市公司盈利持续高增长事件驱动策略 上市公司业绩持续增长是上市公司二级市场价格上涨的最主要原因,基金管理人也基于上述效应构建了相应的事件驱动策略,对发布业绩预增等相关公告的上市公司进行重点跟踪分析和评估。 (三)债券投资策略 本基金在实际的投资管理运作中,将运用利率配置策略、类属配置策略、信用配置策略、相对价值策略及单个债券选择策略等多种策略,以获取债券市场的长期稳定收益。 (四)权证投资策略 本基金投资权证的原则是有利于基金资产增值和投资风险控制。 (五)股指期货投资策略 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,适当参与股指期货的投资。 (六)资产支持证券投资策略 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	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。
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

§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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	2,717,109.74
2.本期利润	13,556,680.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.1959
4.期末基金资产净值	68,341,216.39
5.期末基金份额净值	1.035

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2019年3月31日。

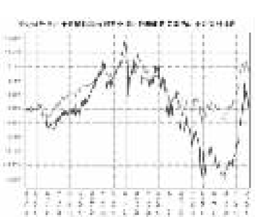
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	23.21%	1.39%	14.39%	0.77%	8.82%	0.62%

3.2.2 自基金合同生效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: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有关约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§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		
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,长盛中证金融指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,长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理,长盛多因子策略优选股票型证券投资基金基金经理,量化投资部负责人。	2019年3月18日	-	12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。
王超	本基金基金经理。	2017年2月22日	2019年3月18日	12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。 目前已离任。

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

一季度股票市场呈现大幅反弹走势,个股和行业分化严重。行业上,计算机、农林牧渔和食品饮料等行业表现较好,银行、公用事业和建筑装饰等行业表现较差。风格上,亏损股、高市净率股、高价股等风格表现较好,低市净率股、低市盈率股和大盘股等风格表现较差。

组合操作上,我们严格按照基金合同规定的投资流程,利用多种量化策略深度挖掘具备阶段性成长机会的股票构建投资组合,并根据市场环境变化和量化策略有效性,对投资组合进行调整和更新。

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1.035元;本报告期基金份额净值增长率为23.21%,业绩比较基准收益率为14.39%。

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	57,090,669.67	83.12
	其中:股票	57,090,669.67	83.12
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	11,447,365.21	16.67
8	其他资产	149,922.06	0.22
9	合计	68,687,956.94	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	1,660,540.00	2.43
B	采矿业	1,892,214.00	2.77
C	制造业	35,272,827.19	51.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,645,377.00	5.33
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	749,810.00	1.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	615,153.48	0.90
J	金融业	10,569,308.00	15.47
K	房地产业	742,400.00	1.09
L	租赁和商务服务业	1,254,000.00	1.83
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	689,040.00	1.01
S	综合	-	-
	合计	57,090,669.67	83.54

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

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	002241	歌尔股份	487,200	5,115,600.00	7.49
2	002273	水晶光电	263,200	3,763,760.00	5.51
3	600030	中信证券	147,800	3,662,484.00	5.36
4	300690	双一科技	123,000	3,259,500.00	4.77
5	300393	中来股份	146,800	3,079,864.00	4.51
6	002051	中工国际	165,300	2,494,377.00	3.65
7	600837	海通证券	152,500	2,139,575.00	3.13
8	002124	天邦股份	117,700	2,057,396.00	3.01
9	601211	国泰君安	99,900	2,012,985.00	2.95
10	300498	温氏股份	40,900	1,660,540.00	2.43

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

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。

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	18,458.25
2	应收证券清算款	125,017.55
3	应收股利	-
4	应收利息	2,471.34
5	应收申购款	3,974.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	149,922.06

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

注: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	70,201,115.12
报告期期间基金总申购份额	666,093.30
减:报告期期间基金总赎回份额	4,843,311.45
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	66,023,896.97

§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、《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛量化多策略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。

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、010-86497888。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2019年4月22日

长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:2019年4月22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2019年4月19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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛生态环境混合
基金主代码	000598
交易代码	000598
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月10日
报告期末基金份额总额	132,645,055.30份
投资目标	本基金主要投资于从事或受益于生态环境主题的上市公司,通过精选个股和风险控制,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势,运用科学严谨、规范化的资产配置方法,灵活配置国内生态环境主题行业的上市公司股票和债券,谋求基金资产的长期稳定增长。本基金对生态环境主题上市公司股票的界定是:公司主营业务中从事与生态环境主题相关的业务,或者直接或间接受益于生态环境投资主题所带来的较高回报,相关股票具体包括:节能技术和装备;节能产品、节能建材和节能服务;环保技术和设备;环保服务及环保受益相关行业;清洁生产技术和清洁产品;资源回收及循环利用产业;与有效利用土地等自然资源、形成生态与经济良性循环主题相关的行业以及城市园林等相关行业上市公司。本基金将结合定性与定量分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队"自下而上"的主动选股能力,选择生态环境主题概念的、具有长期持续增长能力的公司。
业绩比较基准	50%*中证环保产业指数收益率+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。
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

§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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)
1.本期已实现收益	29,892,410.03
2.本期利润	52,157,203.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.3867
4.期末基金资产净值	230,963,363.57
5.期末基金份额净值	1.741

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、所列数据截止到2019年3月31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	28.58%	1.62%	14.02%	0.89%	14.56%	0.73%

3.2.2 自基金合同生效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:按照本基金合同规定,本基金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的有关约定。

§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		
乔培涛	本基金基金经理,长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛动态精选证券投资基金基金经理,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,长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,研究部执行总监。	2018年5月21日	-	11年	乔培涛先生,1979年12月出生。清华大学硕士。曾任长城证券研究员、行业研究部经理。2011年8月加入长盛基金管理有限公司。
代毅	本基金基金经理,长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理	2018年9月14日	-	9年	代毅先生,1984年1月出生。北京大学金融学硕士。2010年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任行业研究员、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

一季度全球主要经济体经济保持稳定,随着信贷宽松和改革深化,国内经济春节后特别是3月份形势好转,叠加中美贸易谈判顺利推进,A股市场表现较好。本基金在春节后加仓,主要方向是养殖、通讯、科技和周期优质个股,增加了组合弹性。

展望未来,二季度企业盈利处于筑底过程中,信用传导逐渐通畅,优质的上市公司会脱颖而出。本基金组合将坚持生态环境主题,集中配置行业内优质个股。

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1.741元;本报告期基金份额净值增长率为28.58%,业绩比较基准收益率为14.02%。

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	214,562,598.51	87.48
	其中:股票	214,562,598.51	87.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	77,414.31	0.03
	其中:债券	77,414.31	0.03
	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	30,271,671.58	12.34
8	其他资产	356,607.65	0.15
9	合计	245,268,292.05	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	21,108,822.36	9.14
B	采矿业	-	-
C	制造业	153,495,518.93	66.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,840,000.00	1.66
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	21,601,914.22	9.35
J	金融业	134,343.00	0.06
K	房地产业	14,382,000.00	6.23
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	214,562,598.51	92.90

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

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	300498	温氏股份	519,920	21,108,752.00	9.14
2	603186	华正新材	399,975	12,579,213.75	5.45
3	002567	唐人神	850,000	11,177,500.00	4.84
4	600277	亿利洁能	1,500,000	10,875,000.00	4.71
5	000002	万 科A	300,000	9,216,000.00	3.99
6	002157	正邦科技	550,000	8,959,500.00	3.88
7	000401	冀东水泥	500,000	8,795,000.00	3.81
8	603360	百傲化学	299,960	8,788,828.00	3.81
9	000063	中兴通讯	300,000	8,760,000.00	3.79
10	300059	东方财富	400,000	7,752,000.00	3.36

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	77,414.31	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	77,414.31	0.03

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	128047	光电转债	657	77,414.31	0.03

注:本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

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

注: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

注: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

根据中兴通讯公告,美国商务部工业与安全局(BIS)于美国时间6月8日通过《关于中兴通讯的替代命令》,批准《替代的和解协议》立即生效。根据协议,中兴通讯将支付合计14亿美元民事罚款,包括在6月8日后60日内一次性支付10亿美元,以及在6月8日后90日内支付至由中兴通讯选择、经BIS批准的美国银行托管账户并在为期十年的监察期内暂缓执行的额外4亿美元罚款。监察期内,若中兴通讯遵守协议约定的监察条件和2018年6月8日命令,监察期届满后4亿美元罚款将被豁免支付。在中兴通讯支付罚款后,BIS于7月13日终止了其于4月15日激活的拒绝令,将中兴通讯及中兴康讯从《禁止出口人员清单》移除。

中兴通讯是全球四大通信设备商之一,具备全球竞争力,未来将受益于5G大规模建设。基于相关研究,本基金判断,公司从禁止出口名单移除后,公司经营已逐步恢复正常。今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其业务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	238,058.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,242.86
5	应收申购款	111,306.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	356,607.65

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

注: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	135,621,414.75
报告期期间基金总申购份额	5,572,612.58
减:报告期期间基金总赎回份额	8,548,972.03
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	132,645,055.30

§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

注: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、《长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛生态环境主题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。

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、010-86497888。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2019年4月22日

长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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
报告送出日期:2019年4月22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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月19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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	242,225,580.25份	
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	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。 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。 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、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。 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。	
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。	
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	
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	52,108.05份	242,173,472.20份

§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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)	
	长盛盛丰混合A	长盛盛丰混合C
1. 本期已实现收益	-560.34	-2,143,797.13
2. 本期利润	1,632.32	5,594,512.49
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0320	0.0306
4. 期末基金资产净值	52,606.65	242,649,977.53
5. 期末基金份额净值	1.0096	1.0020

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2019年3月31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

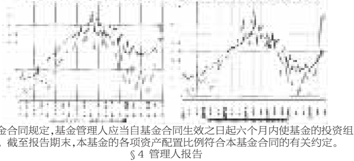
长盛盛丰混合A

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	3.25%	0.21%	14.39%	0.77%	-11.14%	-0.56%

长盛盛丰混合C

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	3.20%	0.21%	14.39%	0.77%	-11.19%	-0.56%

3.2.2 自基金合同生效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: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。截至报告期末,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		
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,长盛盛康纯债债券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,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

1、报告期内行情回顾

2019年3月5日,政府工作报告下调了经济增长预期,同时首次提及"实施就业优先政策",显示政策的主要目标是六稳,其中以稳就业最重要。财政政策方面,从赤字率、专项债推算,全年财政支出上升的力度有限,积极财政主要体现在减税方面。货币政策方面,主要目标是降低实体融资成本,为宽信用疏通政策传导机制。整体政府工作报告的基调以"稳"为主,对冲经济下行的压力。

2019年一季度,PMI等数据显示宏观经济改善较为全面,超预期回升的来源主要是生产指数,其中可能有增值税的影响。但总体来看仍然偏乐观。目前进入政策观察期,短期经济大幅下行的概率下降。

报告期内,市场走势也反映了股票与债券配置的性价比经历再平衡过程。A股市场整体呈现快速上涨走势,融资资金、成交量进一步显著放大。各类股票指数板块均有较好表现,科创板块相对表现更好。报告期内,诸多因素交织导致当前债市较为纠结,投资观望情绪较浓,债券收益率窄幅震荡。资金面上,1月流动性充裕,2月底央行表示,警惕市场主体形成"流动性幻觉",3月资金面中枢有所抬升,下旬短端略为紧张,资金面较2月边际有所收紧。

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,转债一级市场发行明显提速,随着正股市场上涨,转债市场投资机会和热度均有显著提升。此外,值得关注的是,科创板及注册制的各项相关工作加速推进之中。

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赎回。

本报告期内,固定收益资产配置抓住市场资金利率的有利时机,坚持以AAA高信用评级短期银行CD、短期利率债等标的配置为主,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,操作上积极波段,投资风格以绝对收益导向。

新股投资上保持紧密跟踪,优选投资标的,注重实操细节和各类风险控防,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。

4.5 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1.0096元,本报告期基金份额净值增长率为3.25%;截至本报告期末长盛盛丰混合C基金份额净值为1.0020元,本报告期基金份额净值增长率为3.20%;同期业绩比较基准收益率为14.39%。

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	25,097,292.35	9.89
	其中:股票	25,097,292.35	9.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	221,903,828.30	87.41
	其中:债券	221,903,828.30	87.41
	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	2,774,305.03	1.09
8	其他资产	4,102,979.15	1.62
9	合计	253,878,404.83	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	1,218,000.00	0.50
B	采矿业	780,600.00	0.32
C	制造业	10,982,853.62	4.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,419,100.00	0.58
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,357,800.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	3,541,800.00	1.46
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	4,414,738.73	1.82
K	房地产业	1,382,400.00	0.57
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	25,097,292.35	10.34

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

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	000002	万 科A	45,000	1,382,400.00	0.57
2	002262	恩华药业	100,000	1,255,000.00	0.52
3	300498	温氏股份	30,000	1,218,000.00	0.50
4	601398	工商银行	193,100	1,075,567.00	0.44
5	000423	东阿阿胶	20,000	949,000.00	0.39
6	600886	国投电力	110,000	913,000.00	0.38
7	000538	云南白药	10,000	855,000.00	0.35
8	601939	建设银行	120,000	834,000.00	0.34
9	002024	苏宁易购	60,000	753,000.00	0.31
10	000089	深圳机场	70,000	702,100.00	0.29

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	5,159,000.00	2.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,001,000.00	8.24
	其中:政策性金融债	20,001,000.00	8.24
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)	618,828.30	0.25
8	同业存单	196,125,000.00	80.81
9	其他	-	-
10	合计	221,903,828.30	91.43

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	111906099	19交通银行CD099	400,000	38,832,000.00	16.00
2	111812203	18北京银行CD203	300,000	29,064,000.00	11.98
3	111918044	19华夏银行CD044	220,000	21,362,000.00	8.80
4	111807187	18招商银行CD187	200,000	19,530,000.00	8.05
5	111908049	19中信银行CD049	200,000	19,416,000.00	8.00
5	111910143	19兴业银行CD143	200,000	19,416,000.00	8.00

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、18招商银行CD187

根据银监罚决字〔2018〕1号,招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")因电话销售欺骗投保人,被深圳保监局罚款30万元;根据银监罚决字〔2018〕1号,招商银行因违反内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款以及同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等行为,被中国银监会罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。对以上事件,本基金判断招商银行作为全国性的股份制银行,具有一定的系统重要性,具有较强的市场口碑和较强的市场竞争力,整体来看,上述处罚对公司影响极小。后续将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CD143/18兴业银行CD369

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、18民生银行CD455

根据银保监会2018年12月7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〕5号-中国民生银行股份有限公司》的公告,民生银行因贷款业务严重违反审慎经营规则,被罚款200万元。根据银保监会2018年12月7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〕8号-中国民生银行股份有限公司》的公告,民生银行因: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等原因,被罚款3160万元。

对以上事件,本基金判断,民生银行是全国性股份制商业银行之一,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。

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	31,127.41
2	应收证券清算款	1,782,088.84
3	应收股利	-
4	应收利息	2,289,762.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,102,979.15

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

注: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

项目	长盛盛丰混合A	长盛盛丰混合C
报告期期初基金份额总额	47,119.40	177,209,173.97
报告期期间基金总申购份额	5,185.01	64,965,198.94
减:报告期期间基金总赎回份额	196.36	900.71
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	52,108.05	242,173,472.20

§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

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	20190101~20190331	78,108,027.75	0.00	0.00	78,108,027.75	32.25%
	2	20190101~20190331	99,009,900.99	0.00	0.00	99,009,900.99	40.88%
	3	20190325~20190331	0.00	64,961,023.39	0.00	64,961,023.39	26.82%
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。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。							

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、《长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、《长盛盛丰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。

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、010-86497888。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2019年4月22日