长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛沪港深混合
基金主代码	002732
交易代码	002732
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年7月5日
报告期末基金份额总额	16,107,060.74份
投资目标	通过把握国内宏观经济政策和市场发展趋势，深入发掘A股和港股两个市场上的高成长上市公司，全面把握中国经济的投资机会。
投资策略	（一）大类资产配置策略 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 本基金将适时调整国内A股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例及投资策略，主要依据包括但不限于宏观经济因素、政策因素、两地估值折溢价因素、资金利差、市场情绪以及流动性趋势等。 1.A股投资策略 在A股投资方面，本基金主要突出“自下而上”的个股精选策略，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。 2.港股通标的股票投资策略 在对A/H股溢价水平进行重点分析和趋势预测的前提下，本基金管理人将优选香港市场与国内A股在部分行业形成有效互补的行业和上市公司。 最后，本基金将利用两地市场在估值水平、投资者群体结构、交易规则等方面的差异，通过估值套利、事件套利等多重策略获取收益。 （三）债券投资策略 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，综合考虑不同债券种收益率水平、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。 （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×30%+恒生综合指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中等风险收益特征的基金品种。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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4月1日 - 2019年6月30日）
1.本期已实现收益	-14,398.37
2.本期利润	-227,491.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0130
4.期末基金资产净值	16,046,132.04
5.期末基金份额净值	0.996

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6月30日。

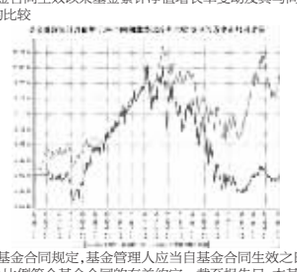
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-1.29%	0.22%	-0.79%	0.69%	-0.50%	-0.47%

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6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		
吴达	本基金基金经理,长盛环球景气行业大盘精选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,长盛新型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛研发回报混合型证券投资基金基金经理,国际业务部总监,长盛基金（香港）有限公司副总经理。	2016年7月5日	-	17年	吴达先生,博士,CFA（特许金融分析师）,历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理,专户投资组合经理;新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理,资产配置委员会成员;华夏基金管理有限公司国际策略分析师,固定收益投资经理;2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。

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

二季度初国际市场受到美国经济增速放缓、利率曲线长端倒挂等因素影响开始调整,中美贸易摩擦对股票市场的调整有加速器的作用,科技股尤其与中国通讯设备需求相关的个股受损最大,防御性板块如必须消费板块、黄金板块的表现领先于大盘。经过了年初以来的反弹之后,香港市场二季度也跟随国际发达市场大幅回调,消费品行业、服务类行业基于相对稳定的业绩预期回调幅度较小。

报告期内本基金适当调整了仓位结构,根据基金风格选择两地具备估值空间的个股进行投资。

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0.996元；本报告期基金份额净值增长率为-1.29%,业绩比较基准收益率为-0.79%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自2018年7月2日至2019年6月30日期间出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。

§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	2,188,426.53	13.45
	其中:股票	2,188,426.53	13.45
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	14,061,241.51	86.42
8	其他资产	20,838.69	0.13
9	合计	16,270,506.73	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为655,786.53元,占期末资产净值比例为4.09%。

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	358,600.00	2.23
B	采矿业	-	-
C	制造业	319,440.00	1.99
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	391,800.00	2.44
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	-	-
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	462,800.00	2.88
S	综合	-	-
	合计	1,532,640.00	9.55

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	0.00	0.00
原材料	0.00	0.00
工业	340,868.25	2.12
非日常生活消费品	0.00	0.00
日常消费品	0.00	0.00
医疗保健	0.00	0.00
金融	314,918.28	1.96
信息技术	0.00	0.00
电信业务	0.00	0.00
公用事业	0.00	0.00
房地产	0.00	0.00
合计	655,786.53	4.09

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	300144.SZ	宋城演艺	20,000	462,800.00	2.88
2	002419.SZ	天虹股份	30,000	391,800.00	2.44
3	300498.SZ	温氏股份	10,000	358,600.00	2.23
4	00152.HK	深圳国际	25,000	340,868.25	2.12
5	002236.SZ	大华股份	22,000	319,440.00	1.99
6	06818.HK	中国光大银行	100,000	314,918.28	1.96

注:本基金本报告期末仅持有上述6只股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期未未持有债券。

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:本基金本报告期未未持有债券。

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:本基金本报告期未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 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

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,840.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	12,880.00
4	应收利息	2,576.10
5	应收申购款	542.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,838.69

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:本基金本报告期末投资前十名股票不存在流通受限情况。

5.11.6 报告期内基金投资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	18,740,773.10
报告期期间基金总申购份额	305,507.10
减:报告期期间基金总赎回份额	2,939,219.46
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	16,107,060.74

§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、《长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛沪港深优势精选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地址和/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7月18日

长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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7月18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7月17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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛环球行业混合(QDII)
基金主代码	080006
交易代码	080006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月26日
报告期末基金份额总额	13,838,629.71份
投资目标	本基金主要投资于全球证券市场，把握全球经济趋势,精选景气投资行业,并在此基础上投资于其中的优势公司，实现充分分享全球经济增长收益的目标;同时在投资国家或地区配置上,有效实现全球分散化投资,力争充分分散风险,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金投资组合的构建采用了自上而下的行业配置和自下而上的个股精选相结合的方法，运用Black-Litterman资产配置模型实现行业层面的风险最优配置,在行业内部,运用全球量化选股模型精选个股,投资管理人将两者进行有机结合,构建最优化的投资组合。
业绩比较基准	摩根斯坦利世界大盘股指数（MSCI World Large Cap Index）
风险收益特征	本基金为混合型基金，风险和收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。同时,本基金为全球混合型证券投资基金,除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国别风险、新兴市场风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。此外,由于投资国家与地区市场的分散,风险低于投资单一市场的混合型基金。
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
境外资产托管人	英文名称:BANK OF CHINA (HONG KONG LIMITED) 中文名称:中国银行(香港)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4月1日 - 2019年6月30日）
1.本期已实现收益	-81,271.77
2.本期利润	-298,268.03
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0215
4.期末基金资产净值	16,678,200.46
5.期末基金份额净值	1.205

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6月30日。

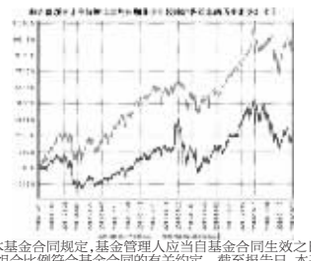
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-1.79%	0.99%	3.38%	0.66%	-5.17%	0.33%

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		
吴达	本基金基金经理,长盛沪港深优势精选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,长盛新型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛研发回报混合型证券投资基金基金经理,国际业务部总监,长盛基金（香港）有限公司副总经理。	2010年5月26日	-	17年	吴达先生,博士,CFA（特许金融分析师）,历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理,专户投资组合经理;新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理,资产配置委员会成员;华夏基金管理有限公司国际策略分析师,固定收益投资经理;2007年8月起加入长盛基金管理有限公司，曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。

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

二季度初国际市场受到美国经济增速放缓、利率曲线长端倒挂等因素影响开始调整,中美贸易摩擦对股票市场的调整有加速器的作用,科技股尤其与中国通讯设备需求相关的个股受损最大,防御性板块如必须消费板块、黄金板块的表现领先于大盘。经过了年初以来的反弹之后,香港市场二季度也跟随国际发达市场大幅回调,消费品行业、服务类行业基于相对稳定的业绩预期回调幅度较小。

报告期内本基金适度调整了组合结构,对稳健分红标的进行了增配,根据基金风格,整体结构上仍然偏重港股蓝筹与美国大盘科技股。

4.4.2 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1.205元；本报告期基金份额净值增长率为-1.79%,业绩比较基准收益率为3.38%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自2019年3月1日至2019年6月30日期间出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形,本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。

§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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	13,745,814.16	81.86
	其中:普通股	13,745,814.16	81.86
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,886,514.35	17.19
8	其他资产	159,006.30	0.95
9	合计	16,791,334.81	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	11,373,245.19	68.19
美国	2,372,568.97	14.23
合计	13,745,814.16	82.42

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	1,106,120.56	6.63
日常消费品	600,279.98	3.60
通信服务	842,518.65	5.05
能源	144,967.97	0.87
房地产	860,747.31	5.16
金融	4,613,077.79	27.66
医疗	732,053.05	4.39
工业	1,846,364.50	11.07
信息技术	2,449,193.12	14.68
公用事业	550,491.23	3.30
合计	13,745,814.16	82.42

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	00939 HK	香港证券交易所	中国香港	140,000	828,815.65	4.97
2	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	02318 HK	香港证券交易所	中国香港	10,000	825,121.08	4.95
3	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	00700 HK	香港证券交易所	中国香港	2,200	682,369.86	4.09
4	New China Life Insurance Company Ltd.	新华人寿保险股份有限公司	01336 HK	香港证券交易所	中国香港	20,000	668,541.60	4.01
5	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	03968 HK	香港证券交易所	中国香港	18,000	616,729.63	3.70
6	CITIC Securities Company Limited	中信证券股份有限公司	06030 HK	香港证券交易所	中国香港	42,000	601,476.32	3.61
7	China Railway Construction Corporation Limited	中国铁建股份有限公司	01186 HK	香港证券交易所	中国香港	70,000	589,900.00	3.54
8	China CITIC Bank Corporation Limited	中信银行股份有限公司	00998 HK	香港证券交易所	中国香港	150,000	587,173.05	3.52
9	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约证券交易所	美国	500	582,458.96	3.49
10	Kingsoft Corporation Limited	金山软件有限公司	03888 HK	香港证券交易所	中国香港	38,000	564,917.65	3.39

注:此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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。

5.8 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金融衍生品投资明细

注:本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

注:本基金本报告期末未持有基金资产。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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

中信银行股份有限公司:根据交易商协会2019年4月15日的自律处分信息,公司作为江苏宏图高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《江苏宏图高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,未督导发行人就不真实内容予以纠正,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。依据相关自律规定,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。

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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	57,494.64
3	应收股利	95,621.61
4	应收利息	260.19
5	应收申购款	5,629.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	159,006.30

5.10.4 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）。

5.10.5 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。

5.10.6 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	13,938,522.34
报告期期间基金总申购份额	428,434.47
减:报告期期间基金总赎回份额	528,327.10
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	13,838,629.71

§7 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	20190401-20190630	3,914,643.70	0.00	0.00	3,914,643.70	28.29%
产品持有风险							
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、《长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛环球景气行业大盘精选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7月18日

长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公