长盛转型升级主题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	长盛转型升级混合
基金主代码	001197
交易代码	001197
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月21日
报告期末基金份额总额	2,419,033,561.79份
投资目标	本基金的投资目标在于把握中国经济转型升级过程中所蕴含的投资机会,在严格控制投资风险的基础上,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	(1)分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策等因素,动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。(2)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,选择转型升级主题概念的、具有竞争优势且估值具有吸引力的股票,组建并动态调整转型升级主题优选股票库。
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	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4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	-12,481,599.70
2.本期利润	-72,980,663.09
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0297
4.期末基金资产净值	1,990,713,969.04
5.期末基金份额净值	0.823

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。

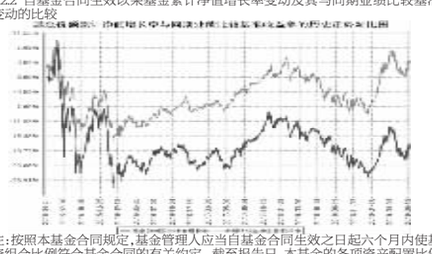
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-3.52%	0.99%	-0.11%	0.75%	-3.41%	0.24%

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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,长盛环球碳气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理,长盛环球复兴行业大盘精选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。	2018年5月21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;新加坡怡盛高级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 管理人对投资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

二季度市场受到流动性、国际争端等多种负面因素影响表现不佳,如部分股份制银行风险事件导致的银行间阶段性流动性紧张,中美贸易谈判二次陷入僵局,经济领先指标如PMI等数据持续低迷等。中美贸易摩擦引发股票市场自4月份开始的调整,其中科技板块受损,基于场内资金的避险需求,二季度必须消费板块、黄金板块表现领先于大盘。

经历了年初社会融资总量增速的迅速恢复后,央行的货币政策目标重新恢复稳健,控制宏观杠杆率过快增长仍然是主要目标之一,因此三季度货币政策仍然大概率保持稳健。国际方面,美国二季度经济增长如预期回落,美联储在6月议息会上态度表现得更加鸽派,市场预期下半年即开始降息周期,接下来国际货币环境相对有利于以中国为代表的新兴市场,从而打开更灵活运用货币政策的空间以支持实体经济。

报告期内本基金适当调整了组合结构,根据基金风格选择有长期成长空间且估值安全边际的板块及个股进行投资。

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0.823元;本报告期基金份额净值增长率为-3.52%,业绩比较基准收益率为-0.11%。

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	1,119,282,697.60	56.07
	其中:股票	1,119,282,697.60	56.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	120,036,000.00	6.01
	其中:债券	120,036,000.00	6.01
	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	752,547,894.41	37.70
8	其他资产	4,348,685.34	0.22
9	合计	1,996,215,277.35	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	48,583,056.28	2.44
B	采矿业	363,431.25	0.02
C	制造业	470,118,821.63	23.62
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	101,009,342.02	5.07
G	交通运输、仓储和邮政业	54,452,725.60	2.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	149,483,730.37	7.51
J	金融业	138,608,511.77	6.96
K	房地产业	72,439,751.30	3.64
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	40,549,642.12	2.04
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	43,673,685.26	2.19
S	综合	-	-
	合计	1,119,282,697.60	56.23

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	601318	中国平安	863,315	76,498,342.15	3.84
2	002475	立讯精密	2,498,462	61,936,872.98	3.11
3	002419	天虹股份	4,233,889	55,294,590.34	2.78
4	600004	白云机场	2,991,908	54,452,725.60	2.74
5	300498	温氏股份	1,354,798	48,583,056.28	2.44
6	603883	老百姓	781,716	45,714,751.68	2.30
7	300144	宋城演艺	1,886,369	43,650,578.66	2.19
8	002174	游族网络	2,529,270	42,694,077.60	2.14
9	300284	苏交科	4,393,244	40,549,642.12	2.04
10	000002	万 科A	1,442,680	40,120,930.80	2.02

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	120,036,000.00	6.03
	其中:政策性金融债	120,036,000.00	6.03
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	120,036,000.00	6.03

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	180209	18国开09	1,200,000	120,036,000.00	6.03

注:本基金本报告期末仅持有上述1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

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

游族网络:一、《关于对游族网络股份有限公司的监管函》(中小板监管函(2018)第124号)

1、主要内容

公司收到深圳证券交易所中小板公司管理部于2018年7月3日出具的《关于对游族网络股份有限公司的监管函》(中小板监管函(2018)第124号),指出公司存在非经营性资金占用、延迟履行关联交易审议程序和信息披露义务、业绩快报修正幅度较大的问题。

2、公司回复说明及整改情况

公司董事会充分重视上述问题,吸取教训,及时整改,将按照国家法律、法规、《股票上市规则》和《中小企业板上市公司规范运作指引》等规定,诚实守信,规范运作,认真和及时地履行信息披露义务。

二、《关于对游族网络股份有限公司采取出具警示函措施的决定》((2018)20号)

1、主要内容

中国证券监督管理委员会福建监管局(以下简称"福建证监局")于2018年8月17日出具《关于对游族网络股份有限公司采取出具警示函措施的决定》((2018)20号),指出公司未及时履行关联交易信息披露义务,公司应采取切实有效的措施进行改正。

2、公司回复说明及整改情况

公司充分重视上述问题,将采取有效措施提升公司的规范运作和信息披露水平;公司董事、监事、高级管理人员将加强对有关证券法律法规的学习,切实履行勤勉尽责义务;公司将开展内部问责,督促有关人员勤勉尽责,认真和及时地履行信息披露义务。

三、本基金做出如下说明:游族网络是游戏行业的领先公司之一,手游研发具有竞争力,基本面情况良好。基于相关研究,本基金判断,《警示函》对游族网络的日常经营影响较小。今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其信息披露等公司合规风控问题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	321,005.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,019,914.13
5	应收申购款	7,765.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,348,685.34

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	2,526,578,450.28
报告期期间基金总申购份额	1,408,790.27
减:报告期期间基金总赎回份额	108,953,678.76
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	2,419,033,561.79

§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、《长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛转型升级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7月18日

长盛中证100指数证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	长盛中证100指数
基金主代码	519100
交易代码	519100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月22日
报告期末基金份额总额	306,367,733.22份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律的束和数量化风险管理手段,力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的平跟踪误差在4%以下,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金,原则上采用复制指数投资策略,按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合,并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪基准指数。
业绩比较基准	中证100指数收益率×95%+一年期银行储蓄存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金,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	15,037,617.00份 / 15,037,617.00份 / 95,786,185.12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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	-2,052,655.33
2.本期利润	-7,197,725.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0565
4.期末基金资产净值	111,788,911.04
5.期末基金份额净值	0.888

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。

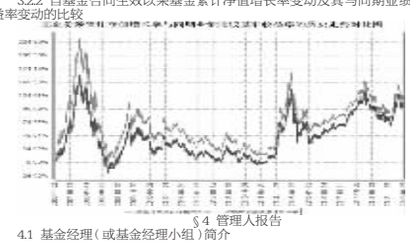
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	3.03%	1.44%	1.84%	1.44%	1.19%	0.00%

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



§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
冯雨生	本基金基金经理,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,长盛量化红利策略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。	2015年8月13日	-	12年	冯雨生先生,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 管理人对投资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

二季度股票市场宽幅震荡,先大幅下跌后略有反弹。行业上,食品饮料、家用电器和银行略有上涨,传媒、钢铁和轻工制造跌幅靠前。概念板块上,人造肉、稀土永磁和乡村振兴等概念表现较好,工业大麻、低价股和智能电视等概念大幅下跌。风格上,二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1.2928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1.84%。本报告期内日均跟踪误差为0.0459%,年度化跟踪误差为0.7262%。

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	371,670,417.74	93.63
	其中:股票	371,670,417.74	93.63
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	24,919,431.21	6.28
8	其他资产	359,630.95	0.09
9	合计	396,949,479.90	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	5,762,702.00	1.45
B	采矿业	13,017,009.86	3.29
C	制造业	122,922,582.48	31.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,596,060.22	2.17
E	建筑业	13,150,360.35	3.32
F	批发和零售业	3,729,277.36	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	10,474,801.11	2.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,565,407.45	1.91
J	金融业	162,287,164.23	40.97
K	房地产业	16,925,460.14	4.27
L	租赁和商务服务业	6,229,196.60	1.57
M	科学研究和技术服务业	433,400.00	0.11
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	371,093,421.80	93.69

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	采矿业	-	-
C	制造业	576,995.94	0.15
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	-	-
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	576,995.94	0.15

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	601318	中国平安	467,984	41,468,062.24	10.47
2	600519	贵州茅台	21,830	21,480,720.00	5.42
3	600036	招商银行	445,566	16,031,464.68	4.05
4	601166	兴业银行	628,105	11,488,040.45	2.90
5	000651	格力电器	207,842	11,431,310.00	2.89
6	000333	美的集团	199,796	10,361,420.56	2.62
7	000858	五粮液	83,943	9,901,076.85	2.50
8	600887	伊利股份	268,420	8,967,912.20	2.26
9	600276	恒瑞医药	133,826	8,832,516.00	2.23
10	600030	中信证券	344,731	8,208,045.11	2.07

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	600485	*ST信威	92,914	576,995.94	0.15

注:本基金本报告期末仅持有上述1只积极投资股票。

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

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

本基金跟踪的标的指数为中证100指数,配置了中证100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。

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	312,846.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,533.42
5	应收申购款	37,251.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	359,630.95

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