

# 长盛新兴成长主题灵活配置混合型证券投资基金 [2017]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：2017年4月22日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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2017年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容，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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。投资人收益在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告中财务资料未经审计。

本报告告期自2017年1月1日起至3月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	长盛新兴成长混合
基金主代码	000892
交易代码	000892
基金成立日	2015年11月6日
报告期末基金份额总额	671,911,765.00份
投资目标	本基金主要投资于具有良好发展前景的新兴产业股票，通过深入研究，精选具有持续增长潜力的公司，谋求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要投资于具有良好发展前景的新兴产业股票，通过深入研究，精选具有持续增长潜力的公司，谋求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为：沪深300指数×60%+中证新兴产业指数×40%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。
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

## § 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

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -67,264,700.75

2.本期利润 -37,767,540.67

3.期末未分配利润 540,162,560.02

4.期末可供分配基金份额总额 0.066

5.期末基金资产净值 671,911,765.00

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，计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

2. 所列数据截止到2017年3月31日。

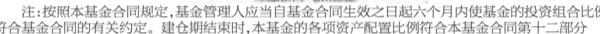
3. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	①-③	②-④	
过去三个月	-3.73%	0.07%	2.13%	0.36%	-3.89%	0.01%

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：按本基金合同的规定，基金管理人应当在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。建仓完成后，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的第二部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的规定。

5.4 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
赵福	本基金基金经理	2015年11月6日	-	10年

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”的含义从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

该报告期间，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其他各项法律法规，本基金合同及其他有关法律法规、基金合同、基金托管协议、特定客户资产管理合同等，严格执行操作流程，遵循相关法律法规的规定，依照相关法律法规的规定，勤勉尽责地运用基金管理人的各项资源，严格控制操作风险，保护基金份额持有人利益。

3. 公平交易专项说明

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：

研究报告：公司所有投资组合共享研究报告，由研究部投资研究员根据研究报告向所有投资组合提供。

交易授权：公司实行集中交易制度，所有投资组合统一执行交易部统一执行的交易授权。

交易执行：公司设有集中交易制度，场内交易、强制开盘恒生交易系统公平交易交易、场外交易，严格执行恒生交易系统公平交易交易、场外交易，严格遵守公平交易和利益输送的有关交易行为。

投资决策：公司对过去4个季度的股票进行适当数量分析，计算盈亏率、贡献率、占比等指标，使用双边交易量下限2%、日均5,000手的交易量下限，日均5,000手的交易量下限，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合与交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的双边交易量超过该证券当日成交量的2%以上。

3.2 公平交易制度的实施表现

报告期内，本基金份额净值为0.956元，本报告期份额净值增长率为-3.73%，同期业绩比较基准净值增长率为-0.02%。

4. 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度股票市场呈现延续了2016年的震荡格局，结构性的走势，主要的几个指数之间表现分化，创业板表现最好，中证500上涨0.38%，沪深300指数上涨0.41%，中小板指上涨0.42%，创业板指涨幅最大，达到4.22%，创业板指出现小幅下跌，跌幅居所有指数之首，其中创业板指涨幅最大，达到4.22%，创业板指涨幅最小，跌幅居所有指数之末，创业板指跌幅达-10%，其中两个板块自1月份场调整，复牌之后股价下跌，第3季度以来配置了一定比例的计算机、传媒板块的股票部分公司股价表现不佳；

上证综指和金融企业的涨幅相对较低。

投资管理人的判断：我们认为目前市场整体估值偏高，但结构性机会仍然存在，建议关注金融、消费、医药、电子等行业的龙头股，同时关注受益于供给侧结构性改革的周期类品种，如钢铁、有色等。

从结构方面，行业、周同比来看，行业的表现依然分化，宏观政策对行业的影响，近期的经济形势对行业的影响，更应该关注行业自身的经营情况，从而选择行业配置，更加侧重时间的把握。

4.5 报告期内基金的估值政策

本基金报告期无基金净值预警说明。

5. 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位：人民币元

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -26,822,026.00

2.本期利润 -2,303,771.36

3.期末未分配利润 306,303,059.00

4.期末可供分配基金份额总额 0.066

5.期末基金资产净值 671,911,765.00

注：本基金报告期无基金净值预警说明。

6. 投资组合报告

6.1 主要财务指标

单位：人民币元

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.本期已实现收益 -26,822,026.00

2.本期利润 -2,303,771.36

3.期末未分配利润 306,303,059.00

4.期末可供分配基金份额总额 0.066

5.期末基金资产净值 671,911,765.00

注：本基金报告期无基金净值预警说明。

6. 投资组合报告

6.2 报告期内按行业分类的境内股票投资组合

单位：人民币元

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.权证投资 333,164,692.92

2.基金投资 -

3.固定收益投资 -

4.银行存款 -

5.贵金属投资 -

6.黄金投资 -

7.货币市场基金 119,092,698.71

8.其他资产 96,419,272.58

9.合计 649,796,524.21

注：本基金报告期无按行业分类的境内股票投资组合。

6.3 报告期内按行业分类的境内债券投资组合

单位：人民币元

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.权证投资 -

2.基金投资 -

3.固定收益投资 -

4.银行存款 -

5.贵金属投资 -

6.黄金投资 -

7.货币市场基金 21,099,423.00

8.其他资产 226,360.04

9.合计 226,360.04

注：本基金报告期无按行业分类的境内债券投资组合。

6.4 报告期内按行业分类的资产配置情况

单位：人民币元

报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)

1.权证投资 333,164,692.92

2.基金投资 -

3.固定收益投资 -

4.银行存款 -

5.贵金属投资 -

6.黄金投资 -

7.货币市场基金 119,092,698.71

8.其他资产 96,419,272.58

9.合计 649,796,524.21

注：本基金报告期无按行业分类的资产配置情况。

6.5 报告期内股票投资组合的重大变化

注：本基金报告期无股票投资组合的重大变化。

6.6 报告期内债券投资组合的重大变化

注：本基金报告期无债券投资组合的重大变化。

6.7 报告期内贵金属及商品买卖的重大变化

注：本基金报告期无贵金属及商品买卖的重大变化。

6.8 报告期内基金投资组合的重大变化

注：本基金报告期无基金投资组合的重大变化。

6.9 报告期内外汇买卖的重大变化

注：本基金报告期无外汇买卖的重大变化。

6.10 报告期内其他重要事项

注：本基金报告期无其他重要事项。

6.11 报告期内基金投资组合的重大变化

注：本基金报告期无基金投资组合的重大变化。

6.12 报告期内基金投资组合的重大变化

注：本基金报告期无基金投资组合的重大变化。

6.13 报告期内基金投资组合的重大变化

注：本基金报告期无基金投资组合的重大变化。