长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

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:2016年7月20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2016年7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2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛中证申万一带一路指数分级
场内简称	一带一路
基金主代码	502013
交易代码	502013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月29日
报告期末基金份额总额	1,633,433,893.24份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对中证申万一带一路主题指数的有效跟踪。
投资策略	1.股票投资策略 本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况(如成份股长期停牌,成份股发生变更,成份股权重由于自由流通量发生变化,成份股公司行为,市场流动性不足等)导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,尽量降低跟踪误差。 2.债券组合管理策略 基于流动性管理的需要,本基金可以投资于到期日在一年期以内的政府债券、央行票据和金融债,债券投资的目的是保证基金资产流动性并提高基金资产的投资收益。 3.金融衍生工具投资策略 在法律法规许可时,本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以控制并降低投资组合风险,提高投资效率,降低调仓成本与跟踪误差,从而更好地实现本基金的投资目标。 4.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	中证申万一带一路主题指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,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	中国银行股份有限公司
下属分级基金简称	长盛一带一A / 长盛一带一B / 长盛中证申万一带一路指数分级
下属分级场内简称	一带一A / 一带一B / 一带一路
下属分级基金交易代码	502014 / 502015 / 502013
下属分级基金报告期末基金份额总额	144,657,572.00份 / 144,657,572.00份 / 1,344,118,749.24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

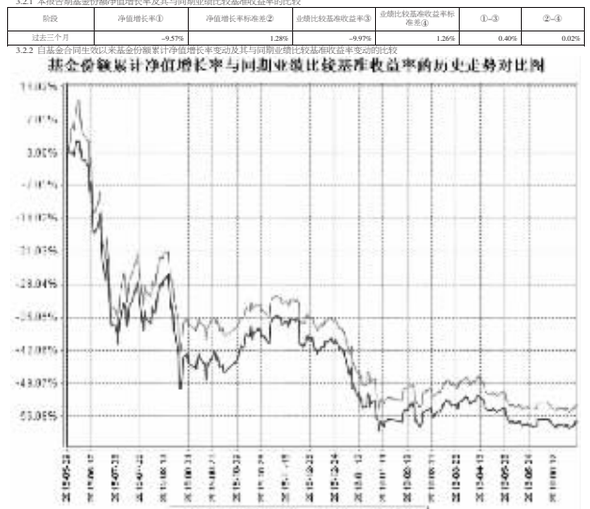
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日 - 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	-47,306.73
2.本期利润	-112,133,044.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0727
4.期末基金资产净值	1,158,681,272.84
5.期末基金份额净值	0.709

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2016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	-9.57%	1.28%	-9.97%	1.26%	0.40%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十五部分(二)投资范围、(七)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
冯雨生	本基金基金经理、长盛中证1000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、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛中证金融证券公司指数分级证券投资基金基金经理	2015年5月29日	-	8年	男,1983年11月出生,中国国籍,北京大学金融学硕士。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。现任长盛中证1000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、长盛中证金融证券公司指数分级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或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
二季度市场整体平幅波动,但结构性机会较多,热点不断,市场不乏赚钱效应,上证综指下跌2.47%,创业板下跌0.47%。进入二季度,市场前期偏慢的货币放水逐步得到证伪,通胀的担忧逐步缓解,周期股的表现略显疲弱,市场开始寻找新的主题,锂电池、OLED、芯片国产化、物联网、次新股等主题表现较为活跃,带动市场情绪。政策方面加强借壳重组监管等一系列政策更有利于市场的长期稳定。整体来看,市场并没有集中、统一的逻辑可以带动市场持续向上,投资者风险偏好波动较大,给投资带来一定难度。
4月本基金控制仓位处于中低水平,有限地避免4月及5月初的市场调整。根据市场情况,在5月下旬提高仓位,获取一定收益。基于基金规模特点,注重均衡配置。震荡走低过程中,加强"进向"操作。在有效调整仓位的同时,注重对持仓结构的优化。在经济环境不稳、熊市震荡期间,注重自下而上挖掘个股价值,及时跟踪公司动态。因而基金业绩基本与市场同步。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末,长盛转型升级混合份额净值为0.774元,本报告期份额净值增长率为-1.90%,同期业绩比较基准增长率为-0.72%。
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	1,058,090,500.11	88.89
	其中:股票	1,058,090,500.11	88.89
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	124,065,586.14	10.42
8	其他资产	8,203,721.90	0.69
9	合计	1,190,359,808.15	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	-	-
B	采矿业	80037122.52	6.91
C	制造业	435,159,807.43	37.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	346,990,037.51	29.95
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	170,462,818.85	14.71
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	20,171,171.80	1.74
	合计	1,052,820,958.11	90.86

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	采掘业	-	-
C	制造业	594,660.00	0.05
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	2,125,692.00	0.18
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	2,549,190.00	0.22
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	5,269,542.00	0.45

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。
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	601766	中国中车	11,298,872	103,610,656.24	8.94
2	601668	中国建筑	14,583,600	77,584,752.00	6.70
3	601390	中国中铁	8,783,363	61,220,040.11	5.28
4	601186	中国铁建	5,421,077	53,993,926.92	4.66
5	601018	宁波港	8,221,095	40,694,420.25	3.51
6	601919	中国远洋	7,729,358	39,265,138.64	3.39
7	601669	中国电建	6,483,140	37,018,729.40	3.19
8	601727	上海电气	4,643,606	35,105,661.36	3.03
9	600089	特变电工	4,083,288	34,789,613.76	3.00
10	002018	华信国际	3,342,816	31,756,752.00	2.74

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	000610	西安旅游	208,950	2,549,190.00	0.22
2	000582	北部湾港	129,300	2,125,692.00	0.18
3	300103	达刚路机	31,800	594,660.00	0.05

注:本基金本报告期末仅持有上述三只积极投资股票。
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
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	46,265.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,939.50
5	应收申购款	8,137,517.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,203,721.90

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。
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情况的说明
注:本基金本报告期末前十名指数投资股票未存在流通受限情况。
5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000610	西安旅游	2,549,190.00	0.22	重大事项停牌
2	000582	北部湾港	2,125,692.00	0.18	重大事项停牌

5.11.6 报告期末持有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	长盛一带一A	长盛一带一B	长盛中证申万一带一路指数分级
报告期期初基金份额总额	81,232,072.00	81,232,072.00	1,381,119,862.95
报告期期间基金总申购份额	-	-	179,972,712.99
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	90,122,826.70
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	63,425,500.00	63,425,500.00	-126,851,000.00
报告期期末基金份额总额	144,657,572.00	144,657,572.00	1,344,118,749.24

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1.中国证监会核准基金募集的文件;
2.《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》;
3.《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金托管协议》;
4.《长盛中证申万一带一路主题指数分级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。
8.2 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。
8.3 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:400-888-2666,010-62350088。
网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2016年7月20日

长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

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:2016年7月20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2016年7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2016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	4,984,561,076.52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按照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好,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

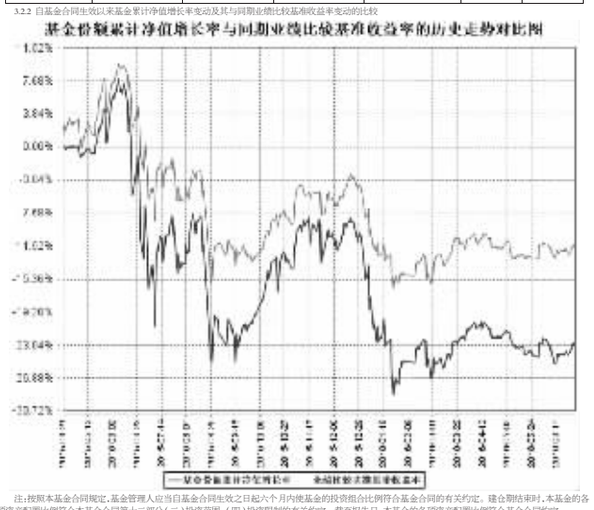
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年4月1日 - 2016年6月30日)
1.本期已实现收益	-195,265,415.65
2.本期利润	-80,000,612.98
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0156
4.期末基金资产净值	3,855,640,658.41
5.期末基金份额净值	0.774

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2016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	-1.90%	0.69%	-0.72%	0.51%	-1.18%	0.18%

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。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十二部分(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
刘旭明	本基金基金经理、长盛生态环境主题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、长盛转型升级灵活配置混合型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、长盛中证金融证券公司指数分级证券投资基金基金经理、长盛中证金融证券投资基金(LOF)基金经理。	2015年4月21日	-	14年	男,1977年5月出生,中国国籍,清华大学管理学硕士,曾任中信证券研究部首席分析师,国信证券经济研究所首席分析师。2013年7月加入长盛基金管理有限公司,现任研究部总监,现任长盛生态环境主题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、长盛转型升级主题灵活配置混合型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(体基金)基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛中证金融证券投资基金(LOF)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或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
二季度市场整体平幅波动,但结构性机会较多,热点不断,市场不乏赚钱效应,上证综指下跌2.47%,创业板下跌0.47%。进入二季度,市场前期偏慢的货币放水逐步得到证伪,通胀的担忧逐步缓解,周期股的表现略显疲弱,市场开始寻找新的主题,锂电池、OLED、芯片国产化、物联网、次新股等主题表现较为活跃,带动市场情绪。政策方面加强借壳重组监管等一系列政策更有利于市场的长期稳定。整体来看,市场并没有集中、统一的逻辑可以带动市场持续向上,投资者风险偏好波动较大,给投资带来一定难度。
4月本基金控制仓位处于中低水平,有限地避免4月及5月初的市场调整。根据市场情况,在5月下旬提高仓位,获取一定收益。基于基金规模特点,注重均衡配置。震荡走低过程中,加强"进向"操作。在有效调整仓位的同时,注重对持仓结构的优化。在经济环境不稳、熊市震荡期间,注重自下而上挖掘个股价值,及时跟踪公司动态。因而基金业绩基本与市场同步。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末,长盛转型升级混合份额净值为0.774元,本报告期份额净值增长率为-1.90%,同期业绩比较基准增长率为-0.72%。
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	2,165,875,463.48	55.94
	其中:股票	2,165,875,463.48	55.94
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	1,692,021,857.90	43.70
8	其他资产	13,685,486.33	0.35
9	合计	3,871,582,807.71	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	41,388,562.60	1.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,313,163,509.20	34.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	99,068,055.72	2.57
E	建筑业	775,274.28	0.02
F	批发和零售业	216,749,018.38	5.62
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	177,776,622.92	4.61
J	金融业	3,300,000.00	0.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	42,448,992.75	1.10
M	科学研究和技术服务业	2,609,768.10	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	203,084,576.16	5.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	25,787,172.00	0.67
R	文化、体育和娱乐业	39,723,911.37	1.03
S	综合	-	-
	合计	2,165,875,463.48	56.17

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。
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	002085	万丰奥威	20,499,864	352,392,662.16	9.14
2	002236	大华股份	16,799,608	220,074,864.80	5.71
3	300070	碧水源	13,648,157	203,084,576.16	5.27
4	002415	海康威视	9,368,779	201,053,997.34	5.21
5	600406	国电南瑞	13,135,186	175,617,436.82	4.55
6	600617	国新能源	8,644,682	99,068,055.72	2.57
7	600104	上汽集团	4,043,007	82,032,612.03	2.13
8	600703	三安光电	3,979,580	79,472,212.60	2.06
9	600887	伊利股份	4,667,471	77,806,741.57	2.02
10	601607	上海医药	4,115,251	74,280,280.55	1.93

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	1,740,129.88
2	应收证券清算款	11,506,464.86
3	应收股利	-
4	应收利息	311,258.42
5	应收申购款	127,633.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,685,486.33

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。
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 报告期末持有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	5,243,782,217.83
报告期期间基金总申购份额	6,312,900.10
减:报告期期间基金总赎回份额	265,534,041.41
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	4,984,561,076.52

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	11,847,156.40
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,847,156.40
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.24

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 备查文件目录

8.1 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