

长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金
2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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 10 月 24 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10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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

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	72,902,192.53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，风险和收益高于货币基金、

	债券基金。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股票型基金。
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

§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7月1日—2016年9月30日）
1. 本期已实现收益	1,801,859.27
2. 本期利润	7,644,546.95
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0870
4. 期末基金资产净值	79,592,283.16
5. 期末基金份额净值	1.092

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9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。

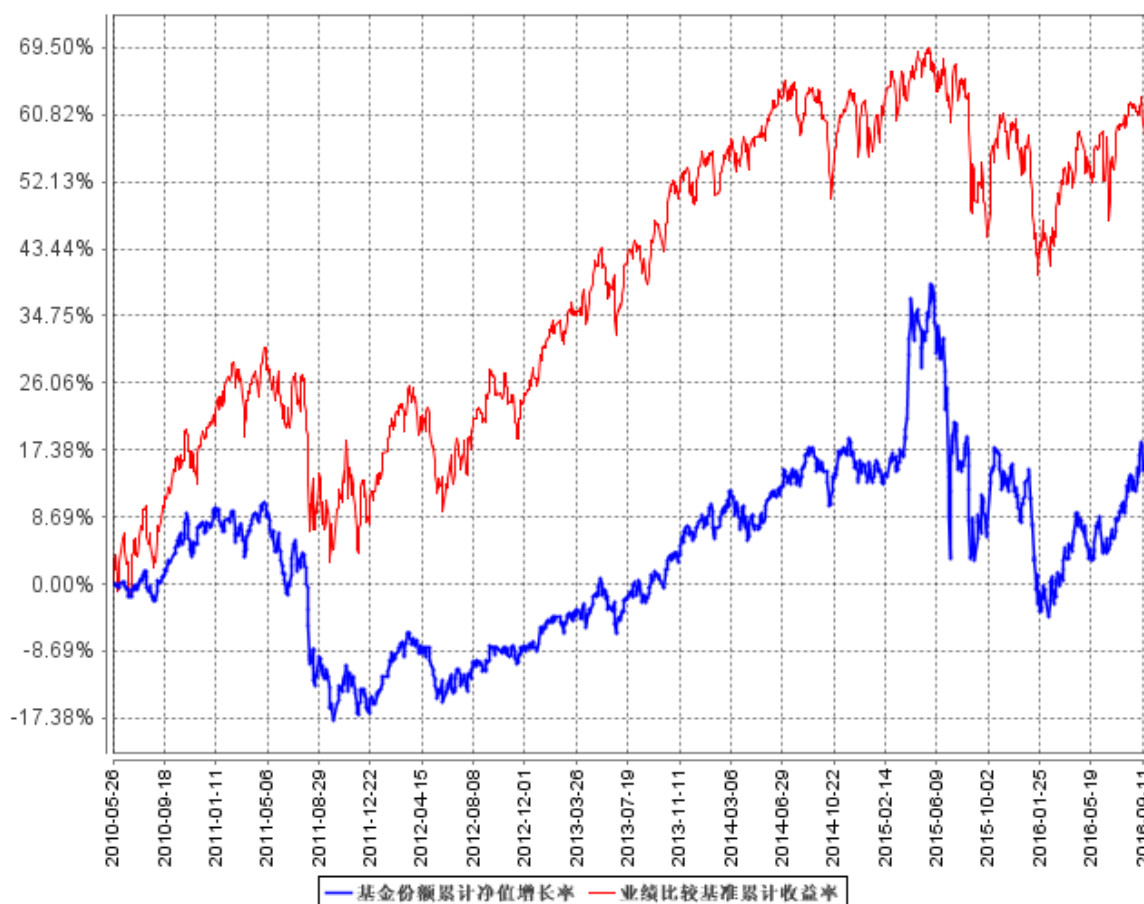
3.2 基金净值表现

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	8.12%	0.85%	4.97%	0.54%	3.15%	0.31%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，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约定。截至报告日，本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（三）投资范围、（九）投资限制的有关约定。

§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，现任国际业务部总	2010年5月26日	-	13年	男，1979年8月出生，中国国籍。伦敦政治经济学院金融经济学硕士，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、星展珊瑚全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理，专户投资组合

	监，兼任长盛基金（香港）有限公司副总经理，长盛创富资产管理有限公司总经理。				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。现任国际业务部总监，长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金（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，兼任长盛基金（香港）有限公司副总经理，长盛创富资产管理有限公司总经理。
黄成扬	本基金基金经理。	2015年7月21日	-	9年	男，1983年7月出生，中国国籍。北京大学金融学硕士，CFA（特许金融分析师）。历任金捷基金研究员，恒星资产管理公司研究员；2012年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任行业分析员等职务，现任长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金（本基金）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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本季度国际政治经济环境趋于维持稳定宽松的货币政策，6月末英国全民公投决定“脱欧”后，美国在9月份加息的概率迅速下降，而日本和欧洲则继续货币宽松；同时，中国总理李克强在8月16日宣布“深港通”获得国务院批准，并预期在11月正式开通，在上述因素推动下国际主要股指表现出色，而香港股指尤其强劲，恒生指数3季度上涨12.04%，国企指数3季度上涨9.97%。而我们亦抓住有利时机，精选了表现强劲的大盘股和TMT类个股，取得了不错的回报。

我们认为，眼下人民币的全球化配置需求愈发强烈，香港市场作为其全球化的第一站，其战略意义不言而喻，通过“沪港通”流入香港股市的内地资金近期源源不断，经常一天达到40-50亿港元，占到港股市场单日成交金额的5%以上，内地资金已经成为左右港股的一股重要力量。

但我们也意识到，国际政治经济格局尚存在各种不确定因素，欧洲的银行问题仍在愈演愈烈，美国12月份的加息概率持续升高，全球的量化宽松浪潮似乎已到尾声，我们所主要关注的香港和美国股市调整与机遇并存，我们目前的策略是精选个股，控制仓位，灵活应对。

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.092 元，本报告期份额净值增长率为 8.12%，同期业绩比较基准增长率为 4.97%

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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	59,954,266.61	74.99
	其中：普通股	59,954,266.61	74.99
	优先股	-	0.00
	存托凭证	-	0.00
	房地产信托凭证	-	0.00
2	基金投资	2,188,982.84	2.74
3	固定收益投资	-	0.00
	其中：债券	-	0.00
	资产支持证券	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
	其中：远期	-	0.00
	期货	-	0.00
	期权	-	0.00
	权证	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	货币市场工具	-	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	17,664,791.50	22.09
8	其他资产	143,667.61	0.18
9	合计	79,951,708.56	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（%）
美国	1,308,347.97	1.64
香港	58,645,918.64	73.68
合计	59,954,266.61	75.33

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（%）
CD 非必需消费品	3,675,660.09	4.62

CS 必需消费品	13,726,875.20	17.25
EN 能源	511,416.18	0.64
FN 金融	7,099,989.11	8.92
HC 医疗	9,785,957.21	12.30
IN 工业	7,337,358.54	9.22
IT 信息技术	11,036,860.53	13.87
MA 材料	1,298,687.15	1.63
TS 电信服务	1,633,271.09	2.05
UT 公用事业	3,848,191.51	4.83
合计	59,954,266.61	75.33

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	YUNNAN WATER INVESTMENT CO., LIMITED	云南水务	6839 HK	Hongkong Exchange	中国香港	1,400,000	5,110,717.92	6.42
2	HI SUN TECHNOLOGY (CHINA) LTD	高阳科技	818 HK	Hongkong Exchange	中国香港	3,540,000	4,114,575.63	5.17
3	PW MEDTECH GROUP LIMITED	普华和顺	1358 HK	Hongkong Exchange	中国香港	1,800,000	3,626,405.64	4.56
4	PHOENIX HEALTHCARE GROUP CO LTD	凤凰医疗	1515 HK	Hongkong Exchange	中国香港	300,000	3,559,249.98	4.47
5	CHINASOFT INTERNATIONAL LIMITED	中国软件国际	354 HK	Hongkong Exchange	中国香港	1,100,000	3,381,029.19	4.25
6	BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD	北控水务集团	371 HK	Hongkong Exchange	中国香港	700,000	3,158,037.96	3.97
7	CONCORD NEW ENERGY GROUP LIMITED	协和新能源	182 HK	Hongkong Exchange	中国香港	8,000,000	2,789,542.80	3.50
8	PING AN INSURANCE (GROUP) COMPANY OF CHINA, LTD	平安保险	2318 HK	Hongkong Exchange	中国香港	70,000	2,422,769.58	3.04
9	TENCENT HLDS LTD	腾讯控股	700 HK	Hongkong Exchange	中国香港	12,500	2,292,332.63	2.88
10	HAITONG INTL	海通	665	Hongkong	中国	500,000	2,216,997.75	2.79

	SECURITIES	国际	HK	Exchange	香港			
--	------------	----	----	----------	----	--	--	--

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	PRO ULTSHRT S&P	-	-	-	2,188,982.84	2.75

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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，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	-
3	应收股利	129,433.00
4	应收利息	1,688.84
5	应收申购款	12,545.77
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	143,667.61

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可转换债券。

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	91,592,409.28
报告期期间基金总申购份额	1,219,041.83
减：报告期期间基金总赎回份额	19,909,258.58
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	72,902,192.53

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2016年9月 12日	18,003,410.00	19,821,754.41	-
合计			18,003,410.00	19,821,754.41	

§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。

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10月24日