

长盛龙头双核驱动混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 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：2020 年 4 月 22 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 2020 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 2020 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛龙头双核混合
基金主代码	006198
交易代码	006198
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 4 日
报告期末基金份额总额	196,952,834.66 份
投资目标	本基金通过综合评估市场份额占比情况、盈利能力、持续增长能力、抗风险能力、估值水平等指标，选取综合实力在行业中具有明显优势的龙头上市公司进行投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金在综合分析国内外宏观经济市场形势、微观经济指标及货币财政政策的基础上，动态配置大类资产，同时在股票投资方面主要采用“双核驱动”投资策略精选市场最强龙头上市公司策略，双核驱动策略包括价值精选和趋势判断两个核心投资策略，即通过价值精选策略筛选出龙头上市公司，再通过趋势判断策略动态监控上市公司的价格变化趋势选择合适时机进行投资，最终通过综合评估机制确定投资组合并进行实时动态跟踪，根据市场变化及时调整组合配置。</p> <p>价值精选策略指通过基本面分析方法筛选价格低于其内在价值的上市公司股票进行投资；趋势判断策略使用技术面的指标，动态监控上市公司个股的成交量、换手率、波动率以及不同时间区间的价格动量趋势等方面，确定合适的投资时机。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑：</p> <p>（1）宏观经济指标，包括香港及国内 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口数据变化等；</p>

	<p>(2) 微观经济指标, 包括香港和国内市场各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期、估值比较优势等;</p> <p>(3) 市场指标, 包括股票市场与债券市场的涨跌及预期收益率、市场整体估值水平及与国外市场的比较、市场资金的供求关系及其变化等;</p> <p>(4) 政策因素, 包括财政政策、货币政策、产业政策及其它与证券市场密切相关的各种政策。</p> <p>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。</p> <p>(二) 龙头公司的界定</p> <p>本基金对龙头公司的界定如下:</p> <p>通过基本面指标的定性和定量分析, 筛选行业中市场份额、资产质量、营业利润等在行业中处于领先地位的龙头公司发行的证券。</p> <p>第一, 定性指标包括, 公司竞争优势评估、商业模式分析、供应链上下游产业分析、公司治理结构等; 同时本基金还重点关注有深度护城河的公司, 护城河一般源于专利技术, 服务质量, 产品质量或特许经营权等;</p> <p>第二, 定量指标, 主要关注销售毛利率、净资产收益率 (ROE) 和过去 2-3 年的营业收入复合增长率这三个指标。主要筛选方法是计算上市公司的上述三个指标, 国内上市公司根据申万行业一级分类计算的同业指标均值, 非国内上市公司根据彭博行业分类系统 (GICS) 计算的全球主要同业指标均值, 将上市公司指标与其所属同业的均值进行对比, 选取至少有两个指标大于同业均值的上市公司; 如果某个行业领先上市公司定量数据因周期原因暂时落后于同业, 将参考该行业内上市公司在中国的行业排名情况, 保留排名前 30% 的上市公司。此外, 还将根据市场份额占比情况分析 (营业收入和营业利润行业占比)、盈利能力分析 (销售收入、销售净利率等)、持续增长能力分析 (预售账款增长率等)、抗风险能力分析 (资金周转率、资产负债率、利息保障倍数等) 以及估值水平分析 (PEG、企业价值倍数 (EV/EBITDA) 等指标) 辅助筛选出单项指标在该行业内排在前 1/3 的上市公司。</p> <p>本基金将动态调整龙头主题的范畴, 如果未来基金管理人认为有更适当的龙头主题界定标准, 基金管理人有权对界定方法进行变更。本基金由于上述原因变更上市公司界定方法不须经基金份额持有人大会通过, 但应及时告知基金托管人并公告。若因基金管理人界定龙头主题上市公司的标准发生调整, 或者上市公司经营发生变化等原因导致本基金持有的龙头主题上市公司股票和债券的比例低于非现金基金资产的 80%, 本基金将在三十个交易日内进行调整。</p> <p>(三) 行业和个股精选策略</p> <p>本基金的双核驱动策略从行业和个股两个层面进行: 首先, 通过行业定性分析、行业定量分析等方法, 精选发展前景良好或</p>
--	---

	<p>景气程度向好的行业；其次，在对行业价值面进行分析的基础上，对上市公司个股进行价值精选和趋势判断分析，遴选龙头上市公司进行投资。</p> <p>1、行业价值精选策略</p> <p>（1）行业分析定性指标</p> <p>包括对行业所处生命周期、影响行业发展的因素及宏观经济周期进行分析，可了解行业的周期性特征和未来的发展潜力。重点配置的是处于生命周期的快速增长阶段的行业、受外部因素影响、前景看好的行业，例如国家政策鼓励的行业、经济发展趋势中受益的行业和符合社会发展趋势的行业，以及得益于科技发展及技术进步的产业等。此外，本基金还将结合波特五力分析方法，对拟投资行业的新的竞争对手入侵、替代品的威胁、客户的议价能力、供应商的议价能力和现有竞争对手之间的竞争进行深度研究分析等进行深度研究分析。</p> <p>（2）行业定量分析指标</p> <p>本基金将对行业的主营收入增长率、主营业务利润增长率、相对估值等情况进行深入定量分析，遴选增长前景持续向好、经济周期影响下的行业景气恢复或上升的行业，并加强对有吸引力行业的配置，并结合行业的定性分析情况，最终决定本基金的行业配置比例。</p> <p>2、上市公司个股精选策略</p> <p>（1）上市公司价值分析策略</p> <p>1) 定性分析</p> <p>本基金对上市公司的竞争优势进行定性评估。上市公司在行业中的相对竞争力是决定投资价值的重要依据，主要包括以下四个方面：技术资源和垄断优势、国际宏观经济政策和产业相关政策的支持力度和未来预期发展情况、市场竞争优势和盈利模式、上市公司的市场地位和市场份额、产品或渠道优势；本基金还对上市公司经营状况和公司治理情况进行定性分析，主要考察上市公司是否有明确、合理的发展战略；是否拥有较为清晰的经营策略和经营模式等。</p> <p>2) 定量分析</p> <p>本基金将对反映上市公司质量和增长潜力的主要财务和估值指标进行定量分析。在对上市公司盈利增长前景进行分析时，本基金将充分利用上市公司的财务数据，通过上市公司的成长能力指标进行量化筛选，主要包括每股收益增长率、净资产增长率等。</p> <p>（2）上市公司趋势分析策略</p> <p>本基金对上市公司的趋势判断主要强调使用与判断趋势相关的量化指标，动态跟踪相关上市公司股票的成交量，换手率，波动率，股价的新高点或新低点等价格趋势，以及不同时间段的大单买入卖出情况等相关指标，从而对上市公司股票的短期价格和波动性趋势进行分析预判。</p> <p>3、综合评估和动态调整策略</p> <p>通过对拟投资龙头上市公司的价值和趋势的双核策略</p>
--	---

分析，我们将对基础池的相关上市公司进行综合评估打分，选择综合评分前 20%的上市公司作为核心股票池进行重点投资。同时，由于宏观经济政策及微观市场环境的不断变化，本基金还将动态监控拟投资龙头上市公司的具体情况，进行动态调整。

（四）债券投资策略

（1）普通债券投资策略

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。本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、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。

（2）中小企业私募债投资策略

本基金将在严格控制信用风险的基础上，通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险，实现投资收益的最大化。本基金依靠信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，结合定性和定量方法，注重对企业未来偿债能力的分析评估，以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度，并及时跟踪其信用风险的变化。

（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。利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，在市场向下带动净值走低时，通过股指期货快速降低投资组合的仓位，从而调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特性；并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时，通过股指期货快速提高投资组合的仓位，从而提高基金资产收益。

（六）国债期货投资策略

基于国债期货标准化合约、保证金交易和流动性较高的特点，通过配置国债期货优化债券组合久期，快速提高债券配置的效率和杠杆水平。基于国债期货多空交易，通过国债期货对债券现券进行套期保值，对冲现券组合的利率风险。此外，根据国债期货交易和交割规则，计算比较一篮子相关债券交割时点内部收益率 IRR、交割时点发票价格与现货价格差值等指标，确定最便宜交割债券 CTD，进行套利交易。

（七）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，具体权证投资的策略是：

1、考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率及无风险收益率等要素，利用 Black - Scholes 模型、二叉树模型及其它权证定价模型计算权证合理价值。

2、根据权证合理价值与其市场价格间的差幅即“估值差价(Value Price)”以及权证合理价值对定价参数的敏感性，

	结合标的股票合理价值考量，决策买入、持有或沽出权证。 (八) 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*70%+中证综合债指数收益率*30%
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（2020年1月1日—2020年3月31日）
1. 本期已实现收益	39,745,542.37
2. 本期利润	18,629,918.54
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0401
4. 期末基金资产净值	196,661,349.12
5. 期末基金份额净值	0.9985

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 2020 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。

4、本基金基金合同生效日为 2019 年 11 月 4 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

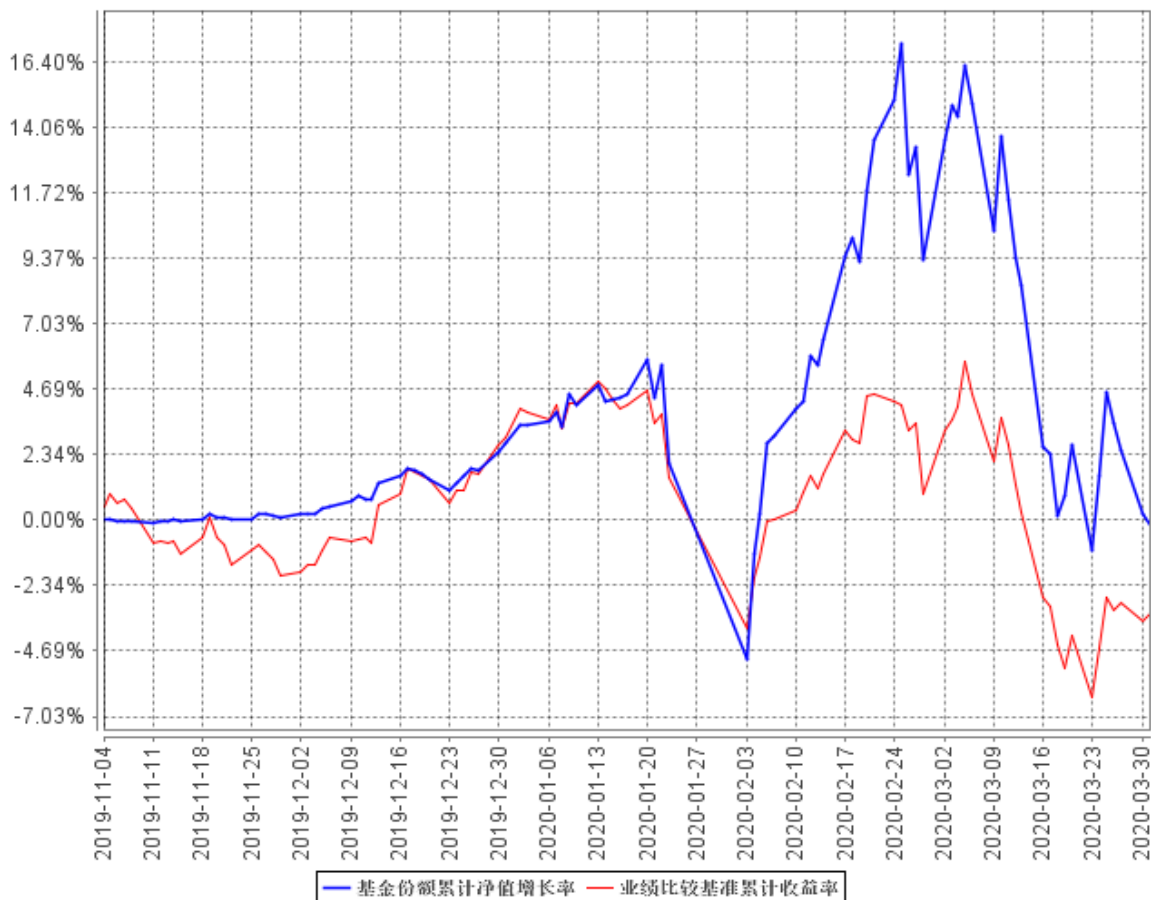
3.2 基金净值表现

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	-2.85%	2.19%	-6.17%	1.35%	3.32%	0.84%

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：1、本基金基金合同生效日为 2019 年 11 月 4 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金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。截至本报告期末本基金仍处于建仓期。

本基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的 60%–95% 投资于股票资产（其中投资于国内依法发行上市的股票比例占基金资产的 60%–95%，投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%），其中投资于龙头上市公司的股票和债券不低于非现金基金资产的 80%；权证投资比例不超过基金资产净值的 3%，每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

§ 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。	2019年11月4日	-	18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。

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

报告期内国内与全球市场都经历了大幅波动，年初在科技与后周期制造业企业较好年报预告的推动下，市场风险偏好继续抬升。然而新冠疫情爆发，全球的经济活动都受到了较大冲击，虽然国内采取了有效的防控措施，也对一季度经济活动的影响较大，股市的风险偏好急剧降低。为应对金融市场风险，美联储采纳了快速降息与量化宽松的货币环境，全球资金回流避险资产，美元指数升至近年来的高点。未来市场的基本面将取决于各国纾困政策的推进，以及复工复产的进度，并继续受疫情演进的影响，但受益互联网通信科技推动的生产力提高、居民消费升级等领域的长期机会值得关注。

报告期内本基金完成了建仓，后续根据市场情况对结构继续调整，针对 5G 互联网建设推动的通信行业和部分港股科技板块低估标的进行增持，并对在全球经济活动减缓过程受损的行业标的进行了减配，风格上依然偏重稳健性价比的行业龙头。

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 0.9985 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.85%，业绩比较基准收益率为-6.17%。

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	177,405,980.06	87.15
	其中：股票	177,405,980.06	87.15
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	25,468,255.29	12.51
8	其他资产	698,475.74	0.34
9	合计	203,572,711.09	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 13,208,045.17 元，占期末资产净值比例为 6.72%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	113,764,052.19	57.85
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	19,147.31	0.01
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	13,212,377.75	6.72

J	金融业	14,843,163.52	7.55
K	房地产业	15,695,684.02	7.98
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,532,832.98	3.32
N	水利、环境和公共设施管理业	130,677.12	0.07
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	164,197,934.89	83.49

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（%）
非必需消费品	-	-
日常消费品	-	-
通信服务	4,446,575.87	2.26
能源	-	-
房地产	-	-
金融	-	-
医疗保健	3,545,156.00	1.80
工业	-	-
信息技术	5,216,313.30	2.65
公用事业	-	-
合计	13,208,045.17	6.72

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	300122	智飞生物	160,000	10,782,400.00	5.48
2	300059	东方财富	640,000	10,272,000.00	5.22
3	300003	乐普医疗	280,000	10,141,600.00	5.16
4	000002	万科A	380,000	9,747,000.00	4.96
5	000063	中兴通讯	208,080	8,905,824.00	4.53
6	600519	贵州茅台	7,000	7,777,000.00	3.95
7	002007	华兰生物	160,009	7,667,631.28	3.90
8	600703	三安光电	350,052	6,703,495.80	3.41
9	603259	药明康德	72,000	6,515,280.00	3.31
10	600406	国电南瑞	320,009	6,320,177.75	3.21

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

(一) 乐普医疗

2019 年 8 月，国家税务总局合肥高新技术产业开发区税务局责令整改公司补充缴纳个人所得税。本基金判断，该事项对公司经营及信用水平影响有限，但会持续关注。

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	149,123.44
2	应收证券清算款	468,405.61
3	应收股利	-
4	应收利息	4,247.62
5	应收申购款	76,699.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	698,475.74

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	896,792,790.91
报告期期间基金总申购份额	23,313,794.12
减：报告期期间基金总赎回份额	723,153,750.37
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	196,952,834.66

§ 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、《长盛龙头双核驱动混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛龙头双核驱动混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛龙头双核驱动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

2020 年 4 月 22 日