

长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金
2020 年中期报告

2020 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

送出日期：2020 年 8 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	7
2.5 信息披露方式.....	7
2.6 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	40
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	43
7.7 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.....	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	43
7.9 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.....	43
7.10 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.....	43
7.11 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
11.1 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.....	50

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金
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
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
报告期末基金份额总额	15,509,077.20份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	许俊
	联系电话	010-86497608	010-66594319
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-	95566

	86497888	
传真	010-86497999	010-66594942
注册地址	深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100029	100818
法定代表人	周兵	刘连舸

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	BANK OF CHINA (HONG KONG) LIMITED
	中文	中国银行(香港)有限公司
注册地址		香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		香港花园道 1 号中银大厦

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼 中建财富国际中心 3-5 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	-121,275.53
本期利润	1,860,729.78
加权平均基金份额本期利润	0.1156
本期加权平均净值利润率	8.55%
本期基金份额净值增长率	9.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	6,568,844.79
期末可供分配基金份额利润	0.4235
期末基金资产净值	22,815,250.98
期末基金份额净值	1.471
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	54.17%

注：1、所述基金业绩指标不包括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、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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	8.08%	0.97%	2.59%	1.57%	5.49%	-0.60%
过去三个月	14.74%	1.07%	18.24%	1.85%	-3.50%	-0.78%
过去六个月	9.21%	1.47%	-5.91%	2.62%	15.12%	-1.15%
过去一年	22.07%	1.16%	2.09%	1.87%	19.98%	-0.71%
过去三年	22.38%	1.12%	16.91%	1.22%	5.47%	-0.10%
自基金合同生效起至今	54.17%	0.98%	110.42%	1.01%	-56.25%	-0.03%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

业绩比较基准 = 摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index) × 100% (以下简称 MSCI 世界指数)。

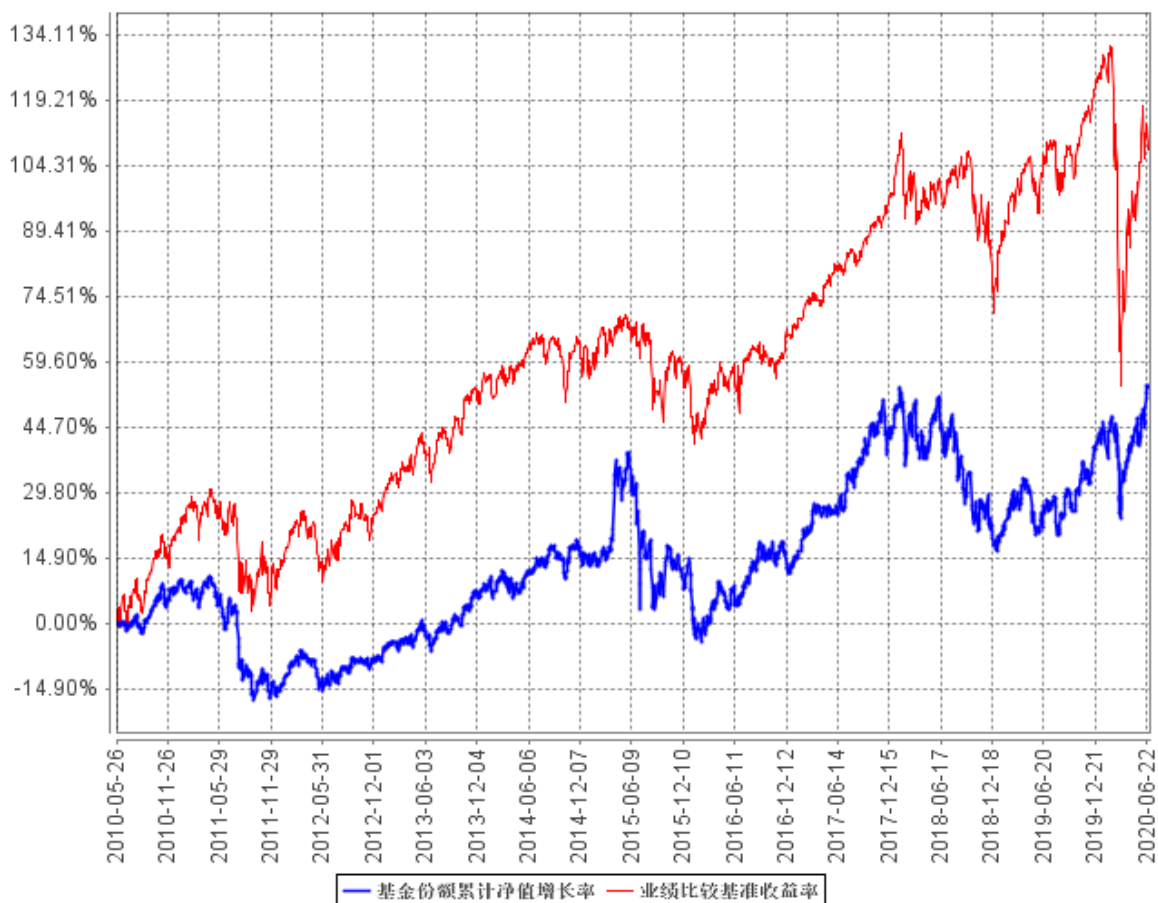
本基金为混合型基金，主要投资范围为全球主要发达地区股票市场大盘类股票，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后选取上述指数。

MSCI 世界指数已经成为全球市场投资工具的基准标尺之一，并且由 MSCIBARRA 每日在市场发布。MSCI 世界指数样本覆盖了与证监会已经订立合作谅解备忘录的主要国家，并为许多国际著名股票投资基金选用为投资比较基准，具有良好的市场代表性。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准比较合适。

本基金的股票资产占基金资产的 60%-95%。在正常的市场情况下，基金的平均股票仓位约为 85%，所以，业绩基准中的这一资产配置比例可以反映本基金的风险收益特征。

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

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



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。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金总部办公地位于北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，并拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、私募资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格。截至 2020 年 6 月 30 日，基金管理人共管理六十三只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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，长盛龙头双核驱动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。	2010 年 5 月 26 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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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、本基金的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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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、私募资产管理计划等。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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 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因为疫情导致大幅波动，新冠疫情爆发给全球的经济活动带来较大冲击，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。受益于全球央行大幅降息或实施 QE，尤其是美联储果断的无限 QE 操作以及政府补贴和转移支付的配合，全球股市自 3 月下旬低点快速反弹，纳斯达克指数甚至在互联网巨头的带领下创出了历史新高。随着欧美市场的风险偏好恢复，流动性效应开始向新兴市场扩散，推动亚太市场有所恢复，AH 两地股市部分优质龙头白马也都创出新高。从行业板块上看，受益于疫情的医疗与基础消费行业、景气度较高的互联网基础建设以及在线应用板块、金融改革相关领域的标的表现优于市场。报告期内本基金根据市场波动调整了组合结构，对在全球经济活动减缓过程受损的行业标的进行了减配，增配了受影响小的基础消费医药、在线办公服务器需求增长等相关标的，根据基金风格整体结构上仍然偏重港股蓝筹与美股科技板块。

4.4.2 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 1.471 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.21%，业绩比较基准收益率为-5.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美国三季度仍将大规模发行国债纾解经济困难，市场预期美联储仍将坚持无限 QE 操作，释放流动性。另一方面，随着疫情后欧美开启复工，基本面开始修复。宽松与修复共振将相对有利于权益型资产的表现。虽然欧美市场复工复产进度受到疫情影响颇为曲折，国内疫情略有反复，中美贸易争端与地缘政治因素也时常扰动市场，但国内外流动性充沛、政府大力推动金融市场改革开放的举措成为主导力量，市场风险偏好也将继续抬升。下半年市场的基本面仍然存在不确定性，从 6 月 PMI 数据可以看出国内复工复产显著好于境外，适宜继续关注国际互联网巨头，海外中概中代表国内互联网通信技术升级推动的生产力提高、居民消费增长等领域的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、

估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2020 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 6,568,844.79 元，未分配利润已实现部分为 6,568,844.79 元，未分配利润未实现部分为 737,328.99 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2019 年 3 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,478,915.37	1,042,921.96
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	18,615,141.27	15,594,523.04
其中：股票投资		18,615,141.27	15,594,523.04
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	230,545.38
应收利息	6.4.7.5	560.22	68.52
应收股利		50,227.65	-
应收申购款		54,244.10	15,856.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		23,199,088.61	16,883,915.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		140,685.13	-
应付赎回款		168,795.92	207,062.29
应付管理人报酬		32,950.60	25,000.72
应付托管费		5,491.80	4,166.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	35,914.18	122,242.78
负债合计		383,837.63	358,472.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	15,509,077.20	12,272,527.80
未分配利润	6.4.7.10	7,306,173.78	4,252,914.79
所有者权益合计		22,815,250.98	16,525,442.59
负债和所有者权益总计		23,199,088.61	16,883,915.18

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.471 元，基金份额总额 15,509,077.20 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		2,163,300.21	3,366,289.73
1.利息收入		11,320.29	9,235.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,320.29	9,235.73
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		175,779.00	1,150,101.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	54,359.68	987,431.06
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	121,419.32	162,670.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,982,005.31	2,509,448.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-7,403.38	-312,745.84
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,598.99	10,250.34
减：二、费用		302,570.43	492,205.21

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	195,058.44	241,588.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	32,509.79	40,264.83
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	34,205.38	141,844.96
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	40,796.82	68,506.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,860,729.78	2,874,084.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,860,729.78	2,874,084.52

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	12,272,527.80	4,252,914.79	16,525,442.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,860,729.78	1,860,729.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,236,549.40	1,192,529.21	4,429,078.61
其中：1.基金申购款	5,893,043.47	2,138,313.43	8,031,356.90
2.基金赎回款	-2,656,494.07	-945,784.22	-3,602,278.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	15,509,077.20	7,306,173.78	22,815,250.98
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	40,682,813.98	5,441,756.53	46,124,570.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	2,874,084.52	2,874,084.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-26,844,184.27	-5,476,270.30	-32,320,454.57
其中：1.基金申购款	2,495,924.67	515,434.56	3,011,359.23
2.基金赎回款	-29,340,108.94	-5,991,704.86	-35,331,813.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	13,838,629.71	2,839,570.75	16,678,200.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>林培富</u>	<u>刁俊东</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金(原名为长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2009]第1501号《关于核准长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币339,898,507.52元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第122号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于2010年5月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为340,041,384.63份基金份额,其中认购资金利息折合142,877.11份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银

行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 16 日公告后更名为长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《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》的有关规定，本基金的投资范围为在全球证券市场公开发行上市的股票、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中对股票及其他权益类证券投资占本基金基金资产的目标比例为 60%-95%，其中投资于业绩比较基准内 23 个全球发达地区市场大盘类上市公司股票的部分不低于本基金股票资产总额的 80%；投资现金、货币市场工具及中国证监会允许投资的其他金融工具占基金资产净值的 5%-40%。本基金的业绩比较基准为：摩根斯坦利世界大盘股指数(MSCI World Large Cap Index)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2020 年 6 月 30 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	4,478,915.37
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	4,478,915.37

注：银行存款中包括以下币种余额：

	本期末 2020年6月30日		
	原币金额	汇率	折合人民币
人民币	2,813,264.92	1	2,813,264.92
港币	577,916.33	0.91344	527,891.90
美元	160,711.14	7.0795	1,137,754.51
英镑	0.25	8.7144	2.18
瑞士法郎	0.25	7.4434	1.86
合计			4,478,915.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	14,526,177.05	18,615,141.27	4,088,964.22
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		14,526,177.05	18,615,141.27	4,088,964.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	280.99
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	279.23
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	560.22

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	111.14
应付证券出借违约金	-
预提费用	35,803.04
合计	35,914.18

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,272,527.80	12,272,527.80
本期申购	5,893,043.47	5,893,043.47
本期赎回(以“-”号填列)	-2,656,494.07	-2,656,494.07
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	15,509,077.20	15,509,077.20

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,268,517.73	-1,015,602.94	4,252,914.79
本期利润	-121,275.53	1,982,005.31	1,860,729.78
本期基金份额交易产生的变动数	1,421,602.59	-229,073.38	1,192,529.21
其中：基金申购款	2,547,943.12	-409,629.69	2,138,313.43
基金赎回款	-1,126,340.53	180,556.31	-945,784.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,568,844.79	737,328.99	7,306,173.78

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,041.06
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	279.23

合计	11,320.29
----	-----------

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	7,639,187.62
减：卖出股票成本总额	7,584,827.94
买卖股票差价收入	54,359.68

6.4.7.13 基金投资收益

无。

6.4.7.14 债券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	121,419.32
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	121,419.32

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	1,982,005.31
——股票投资	1,982,005.31
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减： 应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	1,982,005.31

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	1,598.99
基金转换费收入	-
合计	1,598.99

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	34,205.38
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	34,205.38

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	35,803.04

信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费用	4,993.78
合计	40,796.82

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金公司”)	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	195,058.44	241,588.89
其中：支付销售机构的客户维护费	37,192.95	41,591.22

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.80%的年费率计提，逐

日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	32,509.79	40,264.83

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国银行	2,813,283.62	11,041.06	1,303,417.79
中银香港	1,665,631.75	-	1,583,096.56	-
合计	4,478,915.37	11,041.06	2,886,514.35	9,077.33

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管。其中，中国银行保管部分的资金按适用利率或约定利率计息，中银香港保管部分的资金不计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
00940 HK	CHINA ANIMAL HEALTHCARE LIMITED	2015年3月30日	重大事项停牌	0.00	-	-	100,000	415,121.80	0.00	期末估值单价为0.00元港币
00967 HK	SOUND GLOBAL LTD.	2016年4月12日	重大事项停牌	2.09	-	-	210,000	1,022,896.97	439,273.30	期末估值单价为2.29元港币

注：1、上述期末估值单价为备注中所列示的原币估值单价与2020年6月30日该原币兑换人民币的汇率计算而来，2020年6月30日港币兑人民币汇率为0.91344。

2、本基金截至2020年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金主要投资于全球证券市场。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、基金投资及衍生工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上

上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有流动性受限的资产的估值占基金资产净值的比例符合上述要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,813,283.62	-	-	1,665,631.75	4,478,915.37
交易性金融资产	-	-	-	18,615,141.27	18,615,141.27
应收利息	-	-	-	560.22	560.22
应收股利	-	-	-	50,227.65	50,227.65
应收申购款	-	-	-	54,244.10	54,244.10
资产总计	2,813,283.62	-	-	20,385,804.99	23,199,088.61
负债					
应付证券清算款	-	-	-	140,685.13	140,685.13
应付赎回款	-	-	-	168,795.92	168,795.92
应付管理人报酬	-	-	-	32,950.60	32,950.60
应付托管费	-	-	-	5,491.80	5,491.80
其他负债	-	-	-	35,914.18	35,914.18
负债总计	-	-	-	383,837.63	383,837.63
利率敏感度缺口	2,813,283.62	-	-	20,001,967.36	22,815,250.98
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	219,506.03	-	-	823,415.93	1,042,921.96
交易性金融资产	-	-	-	15,594,523.04	15,594,523.04
应收证券清算款	-	-	-	230,545.38	230,545.38
应收利息	-	-	-	68.52	68.52
应收申购款	-	-	-	15,856.28	15,856.28
资产总计	219,506.03	-	-	16,664,409.15	16,883,915.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	207,062.29	207,062.29
应付管理人报酬	-	-	-	25,000.72	25,000.72
应付托管费	-	-	-	4,166.80	4,166.80
其他负债	-	-	-	122,242.78	122,242.78
负债总计	-	-	-	358,472.59	358,472.59
利率敏感度缺口	219,506.03	-	-	16,305,936.56	16,525,442.59

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2019 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	1,137,754.51	527,891.90	4.04	1,665,650.45
交易性金融资产	4,314,608.35	14,300,532.92	-	18,615,141.27
应收股利	-	46,442.65	-	46,442.65
资产合计	5,452,362.86	14,874,867.47	4.04	20,327,234.37
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	140,685.13	-	140,685.13
负债合计	-	140,685.13	-	140,685.13
资产负债表外汇风险敞口净额	5,452,362.86	14,734,182.34	4.04	20,186,549.24
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	208,085.96	615,334.57	4.09	823,424.62
交易性金融资产	3,014,325.33	12,580,197.71	-	15,594,523.04
应收证券清算款	-	230,545.38	-	230,545.38
资产合计	3,222,411.29	13,426,077.66	4.09	16,648,493.04
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	3,222,411.29	13,426,077.66	4.09	16,648,493.04

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
所有外币相对人民币升值5%		1,009,327.46	832,424.65
所有外币相对人民币贬值5%		-1,009,327.46	-832,424.65

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采取战略性资产配置和战术性资产配置相结合的配置策略，在宏观经济与地区经济分析、掌握全球经济趋势的基础上，通过量化分析，确定资产种类与权重，并定期进行回顾和动态调整。本基金将全球股票市场分为成熟市场和新兴市场两类，根据全球经济以及区域化经济发展，结合全球范围的资本流动，确定两类市场具体的资产配置比例并定期进行调整，争取构建具备中长期发展潜力的资产组合。在成熟市场和新兴市场中根据不同国家和地区经济发展及证券市场的发展变化对资产进行国家及区域配置，在不同国家或地区的配置比例上采用“全球资产配置量化”模型进行配置和调整。由于短期市场会受到一些非理性或者非基本面因素的影响而产生波动，基金经理将根据对不同因素的研究与判断，对基金投资组合进行调整，以降低投资组合的投资风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票和其他权益类投资比例为基金资产的60%-95%，货币市场工具及其他金融工具占基金资产的5%-40%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产-股票投资	18,615,141.27	81.59	15,594,523.04	94.37
合计	18,615,141.27	81.59	15,594,523.04	94.37

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2020年6月30日)	上年度末(2019年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	441,318.78	502,793.24
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-441,318.78	-502,793.24	

注:上述其他价格敞口按股票发行方主要业务地分析如下:

金额单位:人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	14,300,532.92	62.68
美国	4,314,608.35	18.91
合计	18,615,141.27	81.59
项目	上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	12,580,197.71	76.13
美国	3,014,325.33	18.24
合计	15,594,523.04	94.37

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中

属于第一层次的余额为 18,175,867.97 元，无属于第二层次的余额，属于第三层次的余额为 439,273.30 元(2019 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 15,033,048.14 元，属于第二层次的余额为 560,579.12 元，属于第三层次的余额为 895.78 元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

项目	交易性金融资产					
	本期			上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	债券投资	权益工具投资	合计	债券投资	权益工具投资	合计
期初	-	895.78	895.78	-	51,520.56	51,520.56
购买	-	-	-	-	-	-
出售	-	-	-	-	-	-
转入第三层次	-	436,844.75	436,844.75	-	-	-
转出第三层次	-	-	-	-	-	-
当期利得或损失总额	-	1,532.77	1,532.77	-	203.45	203.45
计入损益的利得或损失	-	1,532.77	1,532.77	-	203.45	203.45
期末	-	439,273.30	439,273.30	-	51,724.01	51,724.01
期末仍持有的资产计入上半年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,532.77	1,532.77	-	203.45	203.45

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的第三层次权益工具投资包括 CHINA ANIMAL HEALTHCARE LIMITED 和 SOUND GLOBAL LTD. 两只股票，分别按单价 0.00 元港币和 2.29 元港币进行估值。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月

31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	18,615,141.27	80.24
	其中:普通股	16,588,209.63	71.50
	存托凭证	2,026,931.64	8.74
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,478,915.37	19.31
8	其他各项资产	105,031.97	0.45
9	合计	23,199,088.61	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	14,300,532.92	62.68
美国	4,314,608.35	18.91
合计	18,615,141.27	81.59

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
非日常生活消费品	2,971,236.41	13.02
日常消费品	315,684.86	1.38
通信服务	1,366,657.32	5.99
房地产	996,563.04	4.37

金融	1,982,859.01	8.69
医疗保健	2,460,792.74	10.79
工业	2,164,204.63	9.49
信息技术	5,239,640.76	22.97
原材料	678,229.20	2.97
公用事业	439,273.30	1.93
合计	18,615,141.27	81.59

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

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	占基金资产净值比例(%)
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股有限公司	00700 HK	香港证券交易所	中国香港	3,000	1,366,323.55	5.99
2	Kingsoft Corporation Limited	金山软件有限公司	03888 HK	香港证券交易所	中国香港	34,000	1,119,603.41	4.91
3	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	纽约证券交易所	美国	600	916,228.89	4.02
4	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Limited	山东威高集团医用高分子制品股份有限公司	01066 HK	香港证券交易所	中国香港	58,000	913,366.92	4.00
5	MICROSOFT CORP	微软公司	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	600	864,449.43	3.79
6	Country Garden Services Holdings Company Limited	碧桂园服务控股有限公司	06098 HK	香港证券交易所	中国香港	26,000	854,979.84	3.75
7	China Yongda Automobiles Services Holdings Limited	中国永达汽车服务控股有限公司	03669 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	850,412.64	3.73
8	Ping An Insurance (Group)	中国平安保险(集团)股份	02318 HK	香港证券交易所	中国香港	12,000	849,499.20	3.72

	Company of China, Ltd.	有限公司						
9	Hua Hong Semiconductor Limited	华虹半导体有限公司	01347 HK	香港证券交易所	中国香港	34,000	835,432.22	3.66
10	NVIDIA CORP	英伟达公司	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	300	806,871.85	3.54
11	Wuxi Biologics (Cayman) Inc	药明生物技术有限公司	02269 HK	香港证券交易所	中国香港	6,000	777,154.75	3.41
12	CSPC Pharmaceutical Group Limited	石药集团有限公司	01093 HK	香港证券交易所	中国香港	57,600	770,271.07	3.38
13	China Yuhua Education Corporation Limited	中国宇华教育集团有限公司	06169 HK	香港证券交易所	中国香港	128,000	743,613.24	3.26
14	China Jinmao Holdings Group Limited	中国金茂控股集团有限公司	00817 HK	香港证券交易所	中国香港	140,000	696,954.72	3.05
15	China National Building Material Company Limited	中国建材股份有限公司	03323 HK	香港证券交易所	中国香港	90,000	678,229.20	2.97
16	Weichai Power Co., Ltd.	潍柴动力股份有限公司	02338 HK	香港证券交易所	中国香港	50,000	659,503.68	2.89
17	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	03968 HK	香港证券交易所	中国香港	20,000	651,282.72	2.85
18	ZTO Express (Cayman) Inc.	中通快递	ZTO US	纽约证券交易所	美国	2,500	649,721.11	2.85
19	ZTE Corporation	中兴通讯股份有限公司	00763 HK	香港证券交易所	中国香港	30,000	649,455.84	2.85
20	Adobe Inc	奥多比公司	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	200	616,355.43	2.70
21	CITIC Securities Company	中信证券股份有限公司	06030 HK	香港证券交易所	中国香港	36,000	482,077.09	2.11

	Limited							
22	New Oriental Education & Technology Group Inc.	新东方教育科技集团	EDU US	纽约证券交易所	美国	500	460,981.64	2.02
23	Sound Global Ltd.	桑德国际有限公司	00967 HK	香港证券交易所	中国香港	210,000	439,273.30	1.93
24	AAC Technologies Holdings Inc.	瑞声科技控股有限公司	02018 HK	香港证券交易所	中国香港	8,000	347,472.58	1.52
25	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	华润啤酒(控股)有限公司	00291 HK	香港证券交易所	中国香港	8,000	315,684.86	1.38
26	China Overseas Property Holdings Limited	中海物业集团有限公司	02669 HK	香港证券交易所	中国香港	40,000	299,608.32	1.31
27	China Literature Limited	阅文集团	00772 HK	香港证券交易所	中国香港	7	333.77	0.00
28	China Animal Healthcare Ltd.	中国动物保健品有限公司	00940 HK	香港证券交易所	中国香港	100,000	0.00	0.00

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	China National Building Material Company Limited	03323 HK	683,479.00	4.14
2	China Jinmao Holdings Group Limited	00817 HK	681,932.25	4.13
3	China Yongda Automobiles Services Holdings Limited	03669 HK	621,753.80	3.76
4	China International	03908 HK	531,416.79	3.22

	Capital Corporation Limited			
5	Tencent Holdings Ltd	00700 HK	523,232.57	3.17
6	Hua Hong Semiconductor Limited	01347 HK	514,556.44	3.11
7	Shandong Weigao Group Medical Polymer Co. Limited	01066 HK	507,524.65	3.07
8	New Oriental Education & Technology Group Inc.	EDU US	454,079.13	2.75
9	NVIDIA CORP	NVDA US	439,494.58	2.66
10	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	02382 HK	362,532.65	2.19
11	AAC Technologies Holdings Inc.	02018 HK	312,520.42	1.89
12	Country Garden Services Holdings Company Limited	06098 HK	306,902.13	1.86
13	China Yuhua Education Corporation Limited	06169 HK	294,071.98	1.78
14	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	00291 HK	290,116.44	1.76
15	Yihai International Holding Ltd.	01579 HK	286,708.37	1.73
16	PICC Property and Casualty Company Limited	02328 HK	271,880.30	1.65
17	Minth Group Limited	00425 HK	266,839.56	1.61
18	CSPC Pharmaceutical Group Limited	01093 HK	261,841.20	1.58
19	China Resources Cement Holdings Limited	01313 HK	247,497.19	1.50
20	Sunac China Holdings Limited	01918 HK	238,104.15	1.44

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	PICC Property and Casualty Company Limited	02328 HK	858,405.31	5.19
2	China Construction Bank Corporation	00939 HK	850,003.01	5.14

3	Shenzhen International Holdings Limited	00152 HK	635,607.21	3.85
4	Sunac China Holdings Limited	01918 HK	477,043.30	2.89
5	China International Capital Corporation Limited	03908 HK	462,865.80	2.80
6	Yuexiu Transport Infrastructure Limited	01052 HK	361,977.39	2.19
7	VISA INC.	V US	351,562.66	2.13
8	Yihai International Holding Ltd.	01579 HK	317,601.94	1.92
9	Great Wall Motor Company Limited	02333 HK	306,931.87	1.86
10	China Overseas Property Holdings Limited	02669 HK	286,083.75	1.73
11	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	02382 HK	285,348.51	1.73
12	China Resources Cement Holdings Limited	01313 HK	279,590.65	1.69
13	APPLIED MATERIALS INC /DE	AMAT US	274,112.16	1.66
14	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	02601 HK	257,355.48	1.56
15	China East Education Holdings Limited	00667 HK	251,874.91	1.52
16	Tencent Holdings Ltd	00700 HK	242,148.77	1.47
17	AAC Technologies Holdings Inc.	02018 HK	231,874.45	1.40
18	Kingsoft Corporation Limited	03888 HK	231,166.10	1.40
19	CITIC Securities Company Limited	06030 HK	186,737.14	1.13
20	Minth Group Limited	00425 HK	169,457.06	1.03

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	8,623,440.85
卖出收入（成交）总额	7,639,187.62

注：本项中 7.5.1、7.5.2、7.5.3 表中的“买入金额”（或“买入成本（成交）总额”）、“卖出金额”（或“卖出收入（成交）总额”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 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

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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

本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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	50,227.65
4	应收利息	560.22
5	应收申购款	54,244.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,031.97

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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）。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,945	7,973.82	9,027,464.21	58.21%	6,481,612.99	41.79%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	2,964.85	0.0191%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年5月26日）基金份额总额	340,041,384.63
本报告期期初基金份额总额	12,272,527.80
本报告期基金总申购份额	5,893,043.47
减：本报告期基金总赎回份额	2,656,494.07
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	15,509,077.20

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本报告期本基金管理人的高级管理人员无重大人事变动。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券 (HK-HTIS)	-	14,515,246.06	89.26%	15,540.80	83.87%	-
招商证券 (CMS)	-	1,747,382.41	10.74%	2,988.67	16.13%	-
大和资本 (HK-DAIWA)	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛环球行业混合(QDII)节假日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年6月30日
2	长盛环球行业混合(QDII)节假日暂停申购、赎回及定期定额投	中国证券报、本公司网站、中国证监	2020年6月29日

	资业务的公告	会基金电子披露网站	
3	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(更新)	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年6月24日
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(更新)摘要	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年6月24日
5	长盛环球行业混合(QDII)节假日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年5月21日
6	长盛环球行业混合(QDII)节假日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年5月6日
7	长盛基金管理有限公司关于取消旗下部分开放式基金在中信证券(华南)申购费率优惠的公告	中国证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月28日
8	长盛环球行业混合(QDII)节假日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月28日
9	长盛基金管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司销售旗下部分基金并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月22日
10	长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金2020年第1季度报告	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月22日
11	长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金2019年度报告	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月21日
12	长盛环球行业混合(QDII)节假日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月8日
13	长盛基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金2019年年度报告的公告	中国证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年3月25日
14	长盛环球行业混合(QDII)节假日暂停申购、赎回及定期定额投	中国证券报、本公司网站、中国证监	2020年2月13日

	资业务的公告	会基金电子披露网站	
15	长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 18 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200101~20200630	3,914,643.70	0.00	0.00	3,914,643.70	25.24%
	2	20200114~20200630	0.00	5,112,820.51	0.00	5,112,820.51	32.97%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。</p>							

11.2 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。

§12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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。

12.3 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8月29日