

# 长盛均衡回报混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告

2023 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 21 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 07 月 20 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 2023 年 04 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	长盛均衡回报混合
基金主代码	015737
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 1 月 17 日
报告期末基金份额总额	184,709,382.70 份
投资目标	在严格控制风险、保证基金资产流动性的前提下，通过对优质企业的全面深入研究，均衡兼顾价值和成长风格，精选优质上市公司，分享其在中国经济增长大背景下的可持续性增长，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金将通过宏观、微观经济指标，市场指标，政策因素等，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>本基金主要采取自上而下和自下而上相结合的选股策略，通过定量分析和定性分析相结合的方法挖掘优质上市公司，筛选其中安全边际较高的个股构建投资组合。在风格配置上，本基金采取均衡风格配置，兼顾价值和成长风格，密切关注市场风格切换带来的投资机会，追求最佳的风险收益比，以实现较好的中长期投资回报。</p> <p>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>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。</p>

	本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的参与股指期货、国债期货、股票期权交易。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×70%+人民币计价的恒生综合指数收益率×10%+中证综合债指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，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。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长盛均衡回报混合 A	长盛均衡回报混合 C
下属分级基金的交易代码	015737	015738
报告期末下属分级基金的份额总额	3,336,014.67 份	181,373,368.03 份

### § 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（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）	
	长盛均衡回报混合 A	长盛均衡回报混合 C
1. 本期已实现收益	182,848.17	50,652.06
2. 本期利润	188,027.14	73,136.10
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0374	0.0013
4. 期末基金资产净值	3,451,816.11	187,249,879.09
5. 期末基金份额净值	1.0347	1.0324

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、所列数据截止到 2023 年 06 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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 2023 年 01 月 17 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 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

长盛均衡回报混合 A

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

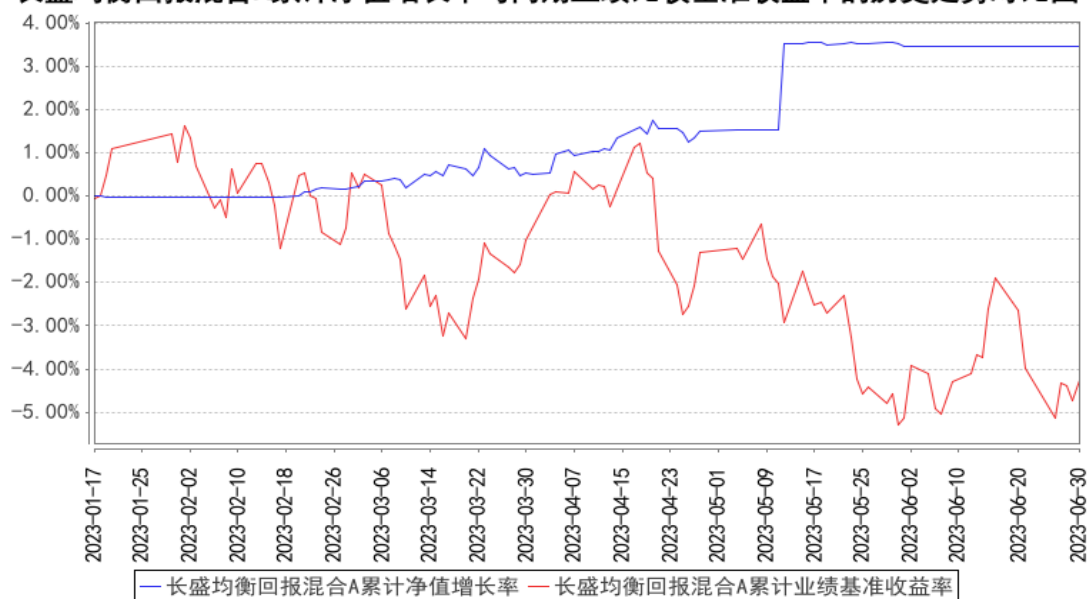
过去三个月	2.93%	0.27%	-3.59%	0.65%	6.52%	-0.38%
自基金合同生效起至今	3.47%	0.22%	-4.27%	0.65%	7.74%	-0.43%

长盛均衡回报混合 C

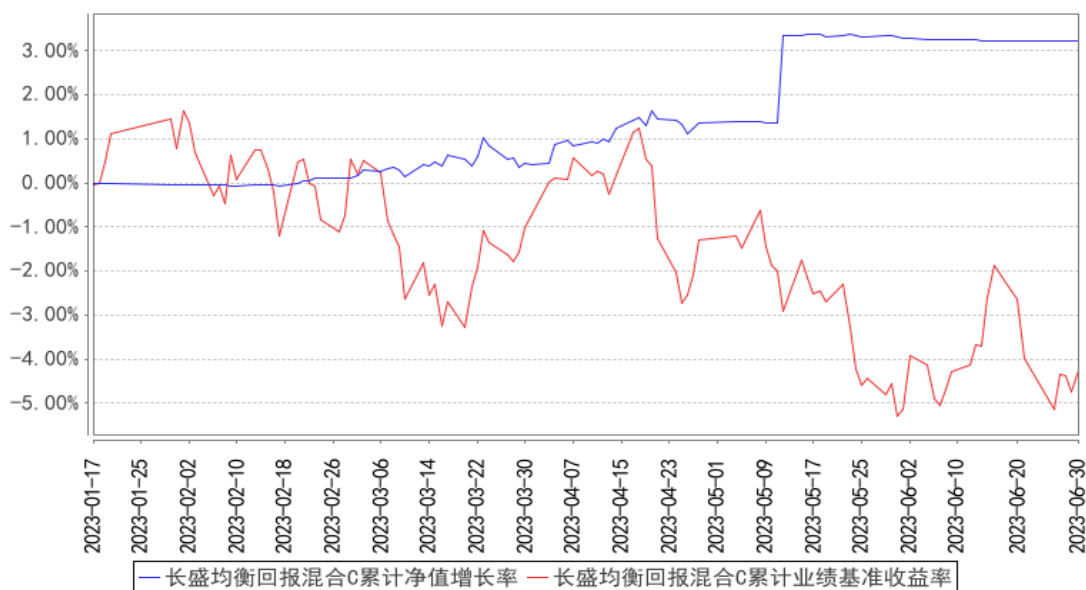
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.81%	0.27%	-3.59%	0.65%	6.40%	-0.38%
自基金合同生效起至今	3.24%	0.21%	-4.27%	0.65%	7.51%	-0.44%

### 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

长盛均衡回报混合A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



长盛均衡回报混合C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 2023 年 01 月 17 日，截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、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。截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

## §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		
王宁	本基金基金经理, 长盛量化红利策略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, 长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金经理, 公司首席投资官。	2023 年 1 月 17 日	-	25 年	王宁先生, 硕士。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理, 基金经理等职务。2005 年 8 月加入长盛基金管理有限公司, 曾任基金经理助理、基金经理、权益投资部总监、总经理助理、副总经理等。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 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合规守信情况的说明

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、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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年二季度，全球市场对利率和物价承受能力预期明显提高，英国、法国、日本、德国、印度等国股票市场明显活跃，人工智能 AI 等创新科技的刺激下，美国市场的科技龙头公司不断创新高，英伟达成为一万亿美元的人工智能公司的代表。

国内市场 2023 年二季度表现整体相对平淡，日成交金额基本保持在一万亿水平，机构行情分化十分剧烈，电子、计算机、通信、传媒等与人工智能相关的行业聚集了市场相当大的成交量，市场表现十分活跃，但是赚钱效应明显降低。央企产业链股票热度逐渐回落。

均衡回报基金目前仍处于管理组合的建仓阶段，基金继续根据动态均衡的原则设计组合，对价值和成长的阶段性优化，在建仓阶段努力保持绝对收益的思路，争取为持有人提供长期稳定的复利回报。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛均衡回报混合 A 的基金份额净值为 1.0347 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.93%，同期业绩比较基准收益率为-3.59%；截至本报告期末长盛均衡回报混合 C 的基金份额净值为 1.0324 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.81%，同期业绩比较基准收益率为-3.59%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自 2023 年 2 月 22 日至 2023 年 5 月 4 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## §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	1,372,347.00	0.72
	其中：股票	1,372,347.00	0.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,017,978.90	0.53
	其中：债券	1,017,978.90	0.53

	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	74,357,371.63	38.86
	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	113,715,944.39	59.42
8	其他资产	900,182.48	0.47
9	合计	191,363,824.40	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	653,408.00	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	188,339.00	0.10
E	建筑业	228,347.00	0.12
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	98,819.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,648.00	0.05
J	金融业	100,786.00	0.05
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	-	-
	合计	1,372,347.00	0.72

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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	002401	中远海科	3,900	102,648.00	0.05
2	601939	建设银行	16,100	100,786.00	0.05
3	601800	中国交建	9,100	99,281.00	0.05
4	600795	国电电力	25,900	99,197.00	0.05
5	603043	广州酒家	3,500	98,910.00	0.05
6	601006	大秦铁路	13,300	98,819.00	0.05
7	000895	双汇发展	4,000	97,960.00	0.05
8	600085	同仁堂	1,700	97,852.00	0.05
9	600600	青岛啤酒	900	93,267.00	0.05
10	600905	三峡能源	16,600	89,142.00	0.05

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,017,978.90	0.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,017,978.90	0.53

#### 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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019679	22 国债 14	10,000	1,017,978.90	0.53

注：本基金本报告期末仅持有上述 1 只债券。

#### 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

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

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

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

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

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是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

建设银行：

2022 年 10 月 28 日，银保监罚决字(2022)51 号显示，中国建设银行股份有限公司理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹的违法违规事实，被处罚款 200 万元。2022 年 11 月 4 日，银保监罚决字(2022)44 号显示，中国建设银行股份有限公司存在个人经营贷款“三查”不到位等 3 项违法违规事实，被处罚款 260 万元。2023 年 2 月 17 日，银保监罚决字(2023)10 号显示，中国建设银行股份有限公司存在公司治理和内部控制制度与监管规定不符等 38 项违法违规事实，被处罚没违法所得并处罚款合计 19,891.5626 万元。对以上事件，本基金判断，中国建设银行股份有限公司经营稳健，上述处罚对公司影响可控。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

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是否超出基金合同规定的备选股票库

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	2,589.34
2	应收证券清算款	877,868.71
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	19,724.43
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	900,182.48

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告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。

### 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

项目	长盛均衡回报混合 A	长盛均衡回报混合 C
报告期期初基金份额总额	6,700,187.38	6,792,811.61
报告期期间基金总申购份额	224,788.84	219,553,855.84
减：报告期期间基金总赎回份额	3,588,961.55	44,973,299.42
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	3,336,014.67	181,373,368.03

## §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

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

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

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	20230505~20230511	0.00	21,696,252.47	21,696,252.47	0.00	0.00
个人	1	20230516~20230601	2,000,088.89	0.00	0.00	2,000,088.89	1.08
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>							

### 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、长盛均衡回报混合型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛均衡回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛均衡回报混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛均衡回报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和/或基金托管人的办公地址。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/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

2023 年 7 月 21 日