

长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
2024 年第 2 季度报告

2024 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 19 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年07月18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2024年04月01日起至06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同益成长回报混合（LOF）
场内简称	长盛同益 LOF
基金主代码	160812
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月4日
报告期末基金份额总额	59,208,281.16份
投资目标	通过自上而下筛选增长预期良好或景气复苏的行业，结合挖掘目标行业的上市公司基本面，自下而上精选个股，为投资者实现资产长期增值，力争获得绝对回报。
投资策略	<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、股指期货、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>股票投资策略上，本基金将充分发挥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，采用定性和定量相结合的方式，以深入的基本面研究为基础，结合数据挖掘技术，密切跟踪市场景气变化，挖掘具有快速成长预期、且估值相对较低的个股进行投资，并通过对股票投资机会的精细操作，审慎选择投资时机，力争获取正回报。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</p>

	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。本基金的权证投资是以权证的市值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。
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	本基金属于混合型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 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（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	1,313,796.37
2. 本期利润	-1,019,503.51
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0171
4. 期末基金资产净值	95,184,803.46
5. 期末基金份额净值	1.608

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 2024 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、本基金由同益证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 4 月 4 日。

3.2 基金净值表现

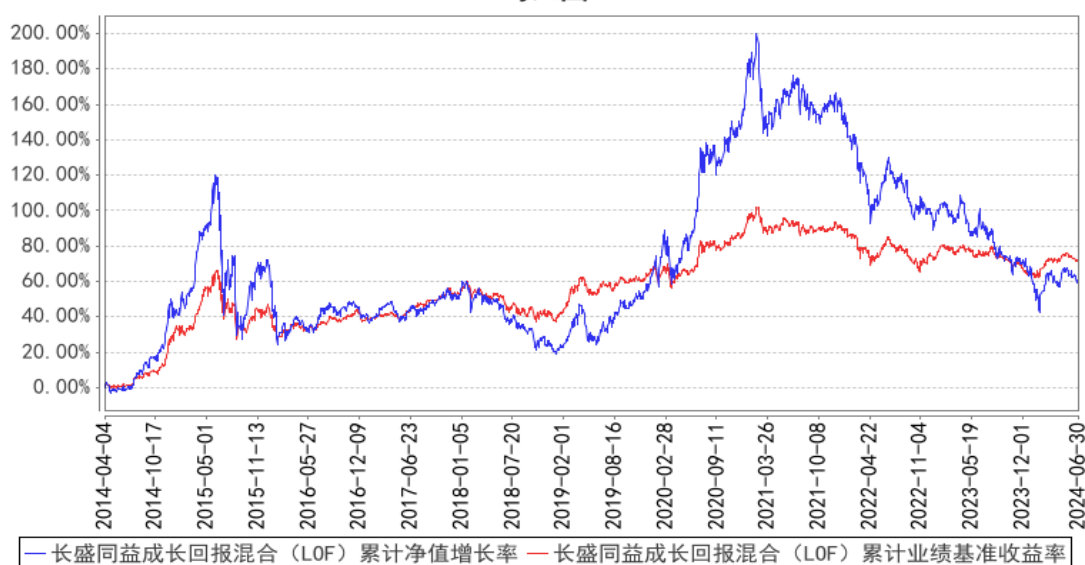
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	-1.05%	0.83%	-0.17%	0.36%	-0.88%	0.47%
过去六个月	-5.13%	1.09%	2.50%	0.44%	-7.63%	0.65%

过去一年	-16.94%	1.00%	-2.05%	0.43%	-14.89%	0.57%
过去三年	-41.82%	1.05%	-11.49%	0.52%	-30.33%	0.53%
过去五年	19.64%	1.19%	8.59%	0.57%	11.05%	0.62%
自基金转型起至今	59.50%	1.30%	71.49%	0.68%	-11.99%	0.62%

3.2.2 自基金转型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

长盛同益成长回报混合（LOF）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、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同益证券投资基金转型而来，转型日期为2014年4月4日（即基金合同生效日）。

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		

张 谊 然	本基金基金经理,长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金经理,长盛优势企业精选混合型证券投资基金基金经理,研究部行政负责人。	2019年 5月22 日	-	16年	张谊然女士,硕士。曾任中国国际金融股份有限公司基础研究员。2012年9月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、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

2024 年二季度，A 股市场整体先扬后抑，震荡调整。4 月到 5 月中上旬，国内海外双补库存的带动下，经济动能有所改善，市场延续修复的态势。5 月下旬，国内高频数据再次走弱，叠加海外贸易保护主义抬头、国内金融数据挤水分、M1 负增长等信息，整体风险偏好再次下行，市场调整。行业维度，二季度红利风格仍然相对占优，银行、电力、交运、煤炭等行业表现较好，电子行业受景气度改善的拉动，涨幅也比较靠前；消费者服务、传媒、商贸零售、计算机等行业跌幅靠前。

报告期内，本组合季初维持高仓位，5 月下旬，随着基本面预期走弱以及市场不确定性提升，逐步降低至中高仓位。组合整体风格相对均衡，略偏成长。行业维度，降低医药与大宗周期的配置，适度提升地产链及大金融的配置，同时基于行业景气度改善，提升电子的配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末基金份额净值为 1.608 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.05%，同期业绩比较基准收益率为-0.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	78,275,793.12	80.64
	其中：股票	78,275,793.12	80.64
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	18,670,496.10	19.24
8	其他资产	116,185.43	0.12
9	合计	97,062,474.65	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	1,674,790.00	1.76
B	采矿业	2,264,663.00	2.38
C	制造业	49,561,046.84	52.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,637,498.00	1.72
E	建筑业	707,154.00	0.74
F	批发和零售业	-	-
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	5,359,071.69	5.63
J	金融业	13,978,228.58	14.69
K	房地产业	1,641,720.00	1.72
L	租赁和商务服务业	1,347.01	0.00
M	科学研究和技术服务业	893,532.00	0.94
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	556,742.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	78,275,793.12	82.24

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	688008	澜起科技	81,466	4,656,596.56	4.89
2	002475	立讯精密	104,300	4,100,033.00	4.31
3	688575	亚辉龙	149,543	3,487,342.76	3.66
4	002142	宁波银行	138,900	3,064,134.00	3.22
5	601728	中国电信	491,400	3,022,110.00	3.17
6	600036	招商银行	82,082	2,806,383.58	2.95
7	603986	兆易创新	28,400	2,715,608.00	2.85
8	002371	北方华创	7,400	2,367,186.00	2.49
9	601601	中国太保	83,700	2,331,882.00	2.45
10	601336	新华保险	74,700	2,243,241.00	2.36

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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**

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

宁波银行：

2023年12月初，国家金融监督管理总局宁波监管局披露行政处罚决定书，宁波银行因多项违法违规事实，例如标准化数据交叉核验不一致、漏报、错报，以及虚假受托支付、企业划型不准确等，被连续开出4张罚单，合计处罚金额约620万元。2024年4月7日，宁波银行台州分行，因贷款管理不审慎，信贷资金被挪用于股权投资；贷款管理不审慎，信贷资金被挪用于购买土地；办理无真实贸易背景的商业承兑汇票贴现等事项，被国家金融监督管理总局台州监管分局罚款90万元。2024年6月7日，宁波银行绍兴分行，因固定资产贷款管理违反审慎经营规则；项目贷款发放管理严重不审慎，贷款“三查”不到位，贷后管理不到位等事项，被国家金融监督管理总局绍兴监管分局罚款165万元。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

招商银行：

2023年11月，招商银行因违反规定办理结汇、售汇业务行为、违反规定办理资本项目资金收付行为，被国家外汇管理局深圳市分局没收违法所得89.03万元，并罚款475万元。2023年12月1日，招商银行宁波分行因“为环保不达标企业办理贴现业务；违规收费；员工行为管理存在薄弱环节；房地产业务管理不审慎；个人经营性贷款用于置换按揭贷款；贷款“三查”不尽职；贸易背景真实性审查不到位；投后管理不尽职导致理财投资资金被挪用”，被国家金融监督管理总局宁波监管局合计罚款285万元，没收未退费的违法所得1,516.68元。2023年12月15日，招商银行因“未按规定承担小微企业押品评估费；未按规定承担房屋抵押登记费；未落实价格目录，向小微企业收取委托贷款手续费；小微企业规模划型依据不足”，被国家金融监督管理总局深圳监管局罚款160万元。2024年6月28日，招商银行因“理财业务存在以下违法违规行为：一、未能有效穿透识别底层资产，二、信息披露不规范”，被国家金融监督管理总局罚款350万元。本基

金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

中国太保：

2024年1月30日，中国太平洋保险(集团)公司因“1、超范围经营外汇保险业务 2、未按规定报送资料报表 3、直接申报数据错报、漏报、多报”，收到国家外汇管理局上海市分局罚没合计459.42万元的处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

新华保险：

2024年1月，新华人寿保险公司被中国人民银行北京市分行处以罚款428.74万元（银京罚决字（2024）9号）。主要违法违规事实为：“1、未按照规定履行客户身份识别义务；2、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告。”本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

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

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	30,052.25
2	应收证券清算款	85,492.13
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	641.05
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	116,185.43

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

报告期期初基金份额总额	59,983,589.90
报告期期间基金总申购份额	25,297.47
减：报告期期间基金总赎回份额	800,606.21
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	59,208,281.16

§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

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、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)相关批准文件；
- 2、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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

2024 年 7 月 19 日