

长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金

2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛战略新兴产业混合
基金主代码	080008
交易代码	080008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 10 月 26 日
报告期末基金份额总额	120,813,098.54 份
投资目标	重点关注国家战略性新兴产业发展过程中带来的投资机会，分享中国经济发展的长期收益，力争为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	(1) 本基金采用“自上而下”的战略资产配置体系，通过对宏观基本面及证券市场两个层面的因素定性、定量地分析，动态调整基金资产在各类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。(2) 本基金将战略性新兴产业相关股票和债券分别纳入战略性新兴产业股票库和债券库，投资于战略性新兴产业的股票及债券比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。(3) 战略新兴产业的行业配置上，本基金将深入分析判断各子行业的行业景气状况、产业政策变化、行业生命周期，结合行业可投资的规模和相对估值水平，适时调整各子行业的配置比例。
业绩比较基准	50%*中证新兴产业指数+50%*中证综合债券指数
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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C
下属分级基金的交易代码	080008	001834
报告期末下属分级基金的份额总额	6,058,679.65 份	114,754,418.89 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（2020年10月1日—2020年12月31日）	
	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C
1. 本期已实现收益	1,213,243.01	15,081,107.83
2. 本期利润	1,573,906.17	21,351,769.01
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2646	0.1325
4. 期末基金资产净值	16,405,619.38	175,439,503.15
5. 期末基金份额净值	2.708	1.529

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12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。

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

长盛战略新兴产业混合 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	10.62%	0.72%	8.17%	0.64%	2.45%	0.08%
过去六个月	24.68%	0.96%	12.85%	0.80%	11.83%	0.16%
过去一年	43.36%	1.15%	24.12%	0.86%	19.24%	0.29%
过去三年	29.69%	1.15%	28.24%	0.78%	1.45%	0.37%
过去五年	49.45%	0.90%	24.90%	0.74%	24.55%	0.16%
自基金合同 生效起至今	184.05%	0.94%	66.04%	0.88%	118.01%	0.06%

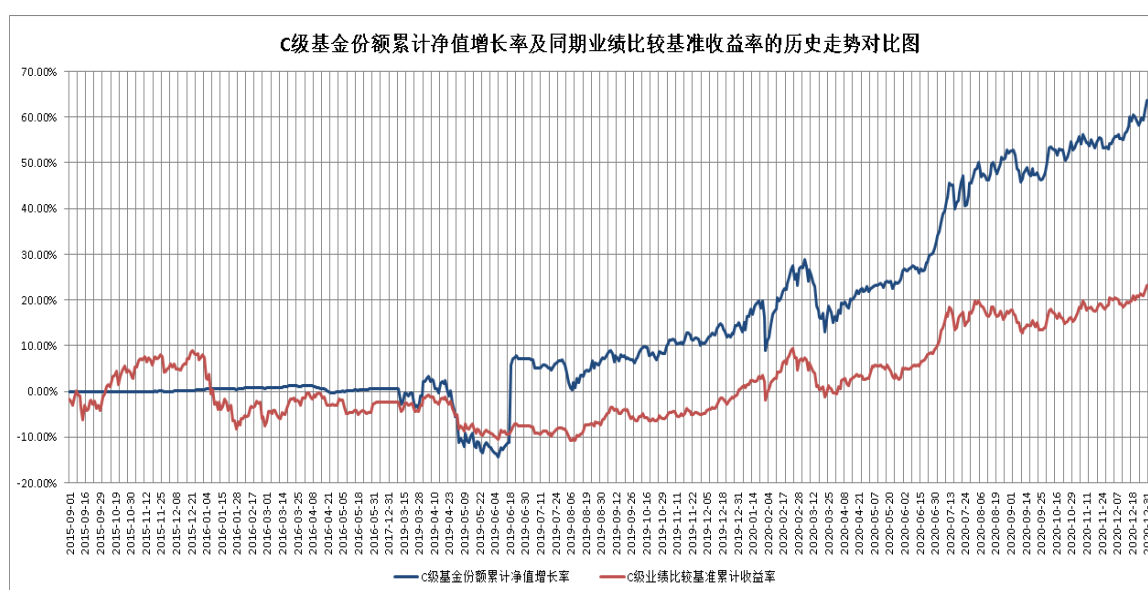
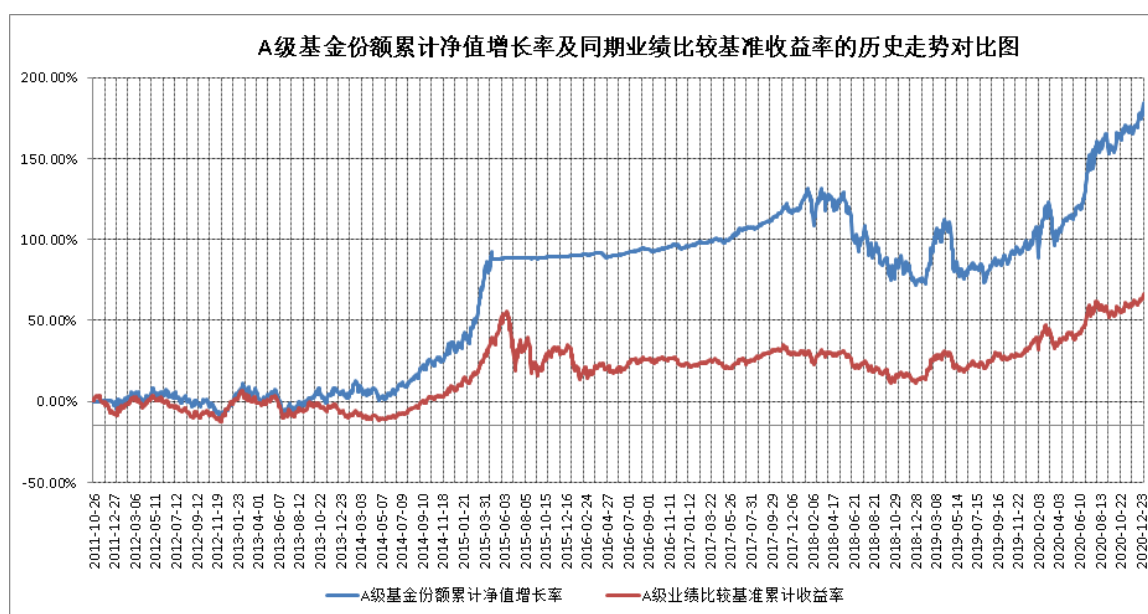
长盛战略新兴产业混合 C

阶段	净值增长 率①	净值增长 率标准差	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①—③	②—④

		②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	10.56%	0.72%	8.17%	0.64%	2.39%	0.08%
过去六个月	24.51%	0.96%	12.85%	0.80%	11.66%	0.16%
过去一年	43.03%	1.15%	24.12%	0.86%	18.91%	0.29%
过去三年	62.84%	1.45%	26.27%	0.78%	36.57%	0.67%
过去五年	63.00%	1.30%	14.88%	0.88%	48.12%	0.42%
自基金合同 生效起至今	63.65%	1.22%	23.25%	0.92%	40.40%	0.30%

注：长盛战略新兴产业混合 C 分别于 2016 年 6 月 3 日至 2019 年 3 月 12 日、2019 年 6 月 26 日至 2019 年 7 月 3 日期间未持有份额。

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



注：1、长盛战略新兴产业混合 C 分别于 2016 年 6 月 3 日至 2019 年 3 月 12 日、2019 年 6 月 26 日至 2019 年 7 月 3 日期间未持有份额。

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		
杨衡	本基金基金经理，长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2019年8月12日	-	13年	杨衡先生，博士、博士后。2007年7月进入长盛基金管理公司，历任固定收益研究员、社保组合组合经理助理、社保组合组合经理等职务。
孟棋	本基金基金经理，长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛信息安全量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理。	2019年8月12日	-	11年	孟棋先生，硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、光大永明资产管理公司研究员。2014年5月加入长盛基金管理有限公司，先后担任行业研究员、社保组合组合经理助理等。

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《证券业从业人员资格管理办法》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 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

报告期内，随着国内疫情控制趋于稳定，国内经济修复提速，显示出较强韧性。2020 年 11 月中国出口单月增长 21%，创下近两年单月最高增速，出口超预期增长对 GDP 增长的拉动处于过去几年较高水平。另一方面，海外整体处于 risk on 势头中。但是，近期 PMI 生产、新订单、库存等指标略低于预期，显示国内经济边际有所趋弱，体现了疫情反复压制消费及冷冬的影响。

报告期内，债市延续震荡走势，整体偏弱。资金面持续偏宽松，带动短端利率阶段性下行。

此外，风险资产走势偏强，风险偏好强化对债市形成一定压制。

报告期内，A 股市场震荡中逐级向上，新能源、白酒、军工等板块涨幅较大。龙头抱团的趋势显著，呈现机构化、价值化倾向，风格分化过程有不同程度持续。

报告期内，IPO 发行基本延续每周常态化发行节奏，科创板、创业板注册制实施后，新股发行上市有所提速，一级市场扩容明显。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，投资策略上，本基金根据契约要求，构建积极资产配置组合。报告期内，在控制一定风险边际条件下，本基金将股票仓位维持到相对中性水平，股票底仓行业和个股选择上，优选行业景气度较好的消费医药赛道，偏重大盘蓝筹，个股持仓相对集中。年末随着赎回增加，权益仓位和个股集中度有所提升。

报告期内，积极参与科创板、创业板等新股网下申购，新股投资上坚持紧密跟踪，优选投资标的，注重实操细节和各类风险控制，上市后及时变现锁定收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛战略新兴产业混合 A 基金份额净值为 2.708 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.62%；截至本报告期末长盛战略新兴产业混合 C 基金份额净值为 1.529 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.56%；同期业绩比较基准收益率为 8.17%。

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	134,538,965.46	69.28
	其中：股票	134,538,965.46	69.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,334,723.20	9.96
	其中：债券	19,334,723.20	9.96
	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	31,000,000.00	15.96
	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	8,701,523.00	4.48
8	其他资产	622,925.30	0.32
9	合计	194,198,136.96	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	98,661,265.51	51.43
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	11,467,970.68	5.98
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	1,531,062.75	0.80
J	金融业	5,757,249.91	3.00
K	房地产业	17,095,786.25	8.91
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,004.12	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	11,626.24	0.01
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	134,538,965.46	70.13

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 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	600519	贵州茅台	9,500	18,981,000.00	9.89
2	000858	五粮液	65,000	18,970,250.00	9.89
3	600048	保利地产	1,080,000	17,085,600.00	8.91
4	300760	迈瑞医疗	26,000	11,076,000.00	5.77
5	300750	宁德时代	25,500	8,953,305.00	4.67

6	300529	健帆生物	125,000	8,477,500.00	4.42
7	600276	恒瑞医药	50,000	5,573,000.00	2.90
8	600887	伊利股份	85,000	3,771,450.00	1.97
9	300142	沃森生物	90,000	3,470,400.00	1.81
10	000568	泸州老窖	14,000	3,166,240.00	1.65

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	14,326,567.20	7.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,998,000.00	2.61
	其中：政策性金融债	4,998,000.00	2.61
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）	10,156.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	19,334,723.20	10.08

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	019627	20 国债 01	143,280	14,326,567.20	7.47
2	018013	国开 2004	50,000	4,998,000.00	2.61
3	110076	华海转债	80	10,156.00	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 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受到调查以及处罚的情况的说明

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，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	64,165.33
2	应收证券清算款	158,435.27
3	应收股利	-
4	应收利息	398,438.83
5	应收申购款	1,885.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	622,925.30

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处于转股期的可转换债券（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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	长盛战略新兴产业混合 A	长盛战略新兴产业混合 C
报告期期初基金份额总额	5,950,773.92	161,916,023.74
报告期期间基金总申购份额	773,204.44	56,592,371.62
减：报告期期间基金总赎回份额	665,298.71	103,753,976.47
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	6,058,679.65	114,754,418.89

§ 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	20201001~20201126、 20201214~20201231	35,648,821.57	0.00	0.00	35,648,821.57	29.51%
	2	20201127~20201231	0.00	55,904,961.57	0.00	55,904,961.57	46.27%
	3	20201001~20201214	103,412,616.34	0.00	103,412,616.34	0.00	0.00%
产品特有风险							

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。

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、长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛战略新兴产业灵活配置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

2021 年 1 月 22 日