

长盛高端装备制造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	长盛高端装备混合
基金主代码	000534
交易代码	000534
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 3 月 25 日
报告期末基金份额总额	75,062,962.09 份
投资目标	本基金的投资目标在于把握中国高端装备制造业发展带来的投资机会，分享高端装备制造相关上市公司的持续投资收益，在严格控制投资风险的基础上，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>在大类资产配置中，本基金将主要考虑：（1）宏观经济指标，包括 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；（2）微观经济指标，包括各行业主要企业的盈利变化情况及盈利预期等；（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；（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>本基金的股票投资策略，分为股票池初步构建、细分领域配置和个股精选三个方面。</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。本基</p>

	金的权证投资是以权证的市场价值分析为基础，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。对于股指期货，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。
业绩比较基准	50%×上证高端装备 60 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 10 月 1 日 — 2020 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	27,186,004.25
2. 本期利润	28,813,598.63
3. 加权平均基金份额本期利润	0.3457
4. 期末基金资产净值	230,183,849.91
5. 期末基金份额净值	3.067

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。

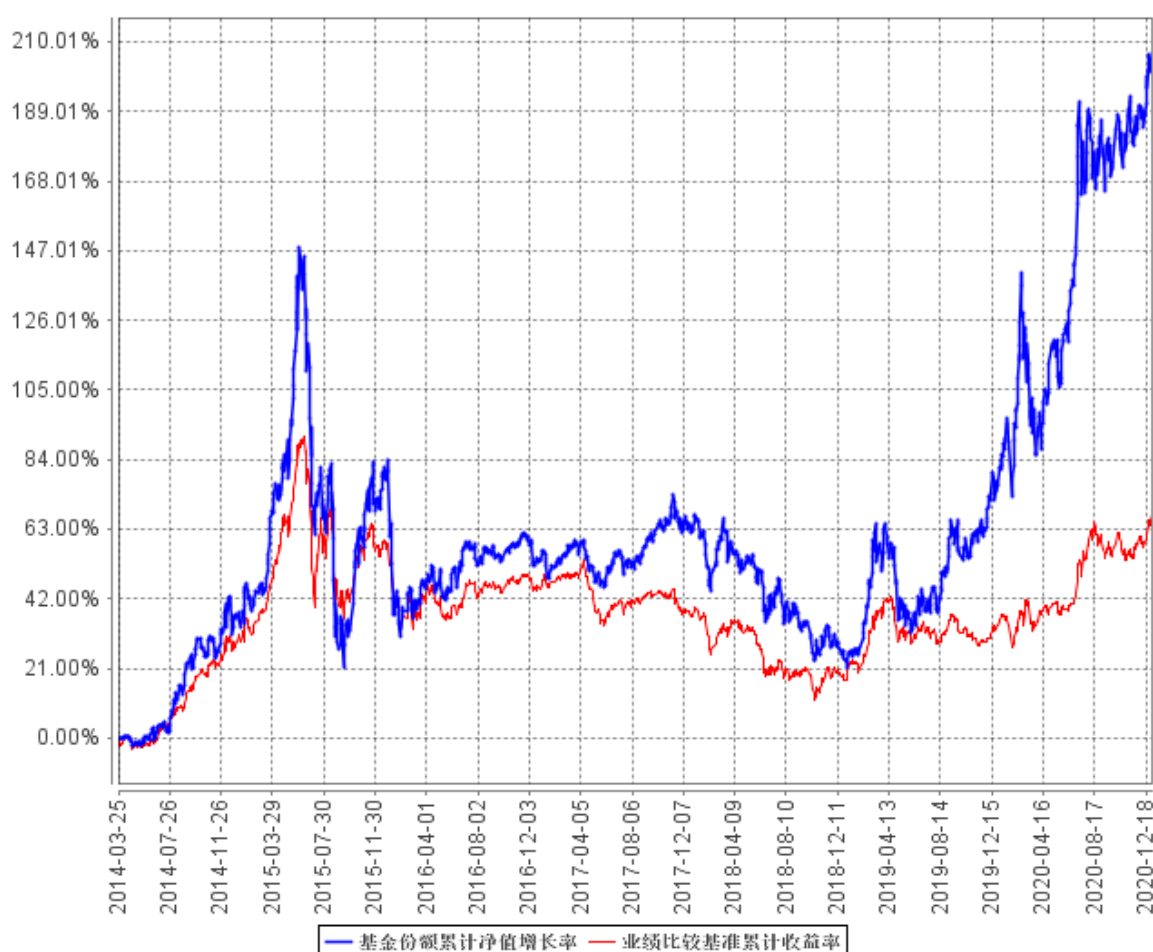
3.2 基金净值表现

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

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	12.67%	1.26%	7.09%	0.75%	5.58%	0.51%
过去六个月	26.16%	1.72%	18.29%	0.90%	7.87%	0.82%
过去一年	73.28%	2.08%	24.94%	0.89%	48.34%	1.19%
过去三年	87.81%	1.67%	21.82%	0.83%	65.99%	0.84%
过去五年	70.20%	1.48%	5.78%	0.82%	64.42%	0.66%
自基金合同 生效起至今	206.70%	1.64%	67.41%	0.95%	139.29%	0.69%

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：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		
乔培涛	本基金基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，研究部执行总监。	2017年10月23日	-	12年	乔培涛先生，硕士。曾任长城证券研究员、行业研究部经理。2011年8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

2020 年四季度市场依然延续了结构化行情的特征，四季度前半段市场表现较为平稳，后半段则逐渐抬升，尤其是年底阶段表现较为亮眼。高端装备领域中的新能源板块、通用及专用设备板块在四季度景气度较高，在资本市场也表现出色。

本基金在四季度继续延续专注于投资泛高端装备领域的投资思路，加大了高景气品种的投资。虽然疫情对全球经济造成了一定影响，但也对我国的制造业带来一定的发展机遇。一方面，各国为应对疫情展开了庞大的金融和财政刺激政策，尤其是新能源的应用成为各国未来发展的共识。另一方面，在海外刺激需求的同时，其供给端迟迟不能恢复，给我国制造业出口带来宝贵机遇期，出口持续处于高景气状态。本基金在四季度尤其重视在上述领域的投资，取得较好收益。展望未来，伴随新能源革命、5G 等先进技术的应用，全球逐渐进入新的技术发展周期，高端装备仍将有广阔的发展空间。

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 3.067 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.67%，业绩

比较基准收益率为 7.09%。

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	211,103,985.75	81.15
	其中：股票	211,103,985.75	81.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	119,294.84	0.05
	其中：债券	119,294.84	0.05
	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	48,454,140.43	18.63
8	其他资产	460,217.56	0.18
9	合计	260,137,638.58	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	179,897,180.81	78.15
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	-	-
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	28,982,841.61	12.59

J	金融业	-	-
K	房地产业	10,186.25	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,203,604.12	0.96
N	水利、环境和公共设施管理业	10,172.96	0.00
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	211,103,985.75	91.71

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	002601	龙鳞佰利	502,069	15,448,663.13	6.71
2	600438	通威股份	360,000	13,838,400.00	6.01
3	600176	中国巨石	600,000	11,976,000.00	5.20
4	600699	均胜电子	430,000	10,904,800.00	4.74
5	002555	三七互娱	280,000	8,744,400.00	3.80
6	300724	捷佳伟创	59,900	8,721,440.00	3.79
7	002597	金禾实业	250,000	8,107,500.00	3.52
8	002475	立讯精密	140,096	7,862,187.52	3.42
9	603218	日月股份	253,725	7,675,181.25	3.33
10	603185	上机数控	54,957	7,608,796.65	3.31

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	-	-
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）	119,294.84	0.05
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	119,294.84	0.05

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	128136	立讯转债	938	119,294.84	0.05

注：本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

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

龙麟佰利：2020年2月，龙麟佰利集团股份有限公司（简称“公司”）收到河南省生态环境厅出具的《行政处罚决定书》（豫环罚决字【2019】5号）、河南省生态环境厅出具的《行政处罚决定书》（豫环罚决字【2019】7号）、焦作市应急管理局出具的《行政处罚决定书》（焦安监罚

【2019】72 号)。处罚书认定公司存在年产 12 万吨硫酸法钛白粉生产线未经竣工环境保护验收即投入生产的违法行为;公司年产 30 万吨硫氯耦合钛材料绿色制造项目主体工程已建成,配电设施、电器仪表系统和管线工程尚未建成,未依法报批建设项目环境影响评价文件;公司组织建设的 100 万吨/年高盐废水深度治理项目,前期焦作市应急管理局已要求停止建设,在项目未取得建设项目安全审查书的情况下,项目仍有开工行为。

本基金做出如下说明:公司是国内唯一能够生产氯化法钛白粉的龙头企业,产能国内第一;钛白粉行业格局稳定,新进入者较少;钛白粉价格有成本支撑,需求恢复后有涨价空间,看好公司氯化法全产业链布局及销量增长。本基金认为,公司收到“处罚决定书”不影响公司长期基本面向好,不影响公司经营业绩。今后,我们将继续加强与该公司的沟通,密切关注其在环保、安全生产等方面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	162,109.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,555.84
5	应收申购款	294,552.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	460,217.56

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(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	90,551,478.08
报告期期间基金总申购份额	5,030,232.88
减：报告期期间基金总赎回份额	20,518,748.87
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	75,062,962.09

§ 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、长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛高端装备制造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

2021 年 1 月 22 日