

# 长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 年第 4 季度报告

2019 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：2020 年 1 月 18 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 2020 年 1 月 17 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 2019 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	长盛创新先锋混合
基金主代码	080002
交易代码	080002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 6 月 4 日
报告期末基金份额总额	93,847,107.73 份
投资目标	选择具有创新能力和行业领先的上市公司，分享企业高速增长成果，在承担适度风险的基础上，追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金为混合型证券投资基金，在资产配置上会考虑宏观经济因素、政策因素及市场估值水平。在个股选择上将根据不同行业景气度、“长盛创新选股体系”和“长盛优势选股体系”的股票筛选原则和方法优化个股投资比重。
业绩比较基准	沪深 300 指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金强调精选投资价值较大的创新领先企业，突出资产配置的灵活性和主动性，风险收益略低于股票型基金，高于债券型基金和平衡型基金。
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( 2019 年 10 月 1 日 — 2019 年 12 月 31 日 )
1. 本期已实现收益	4,693,964.90
2. 本期利润	5,219,140.98
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0246
4. 期末基金资产净值	107,868,806.66
5. 期末基金份额净值	1.1494

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 2019 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。

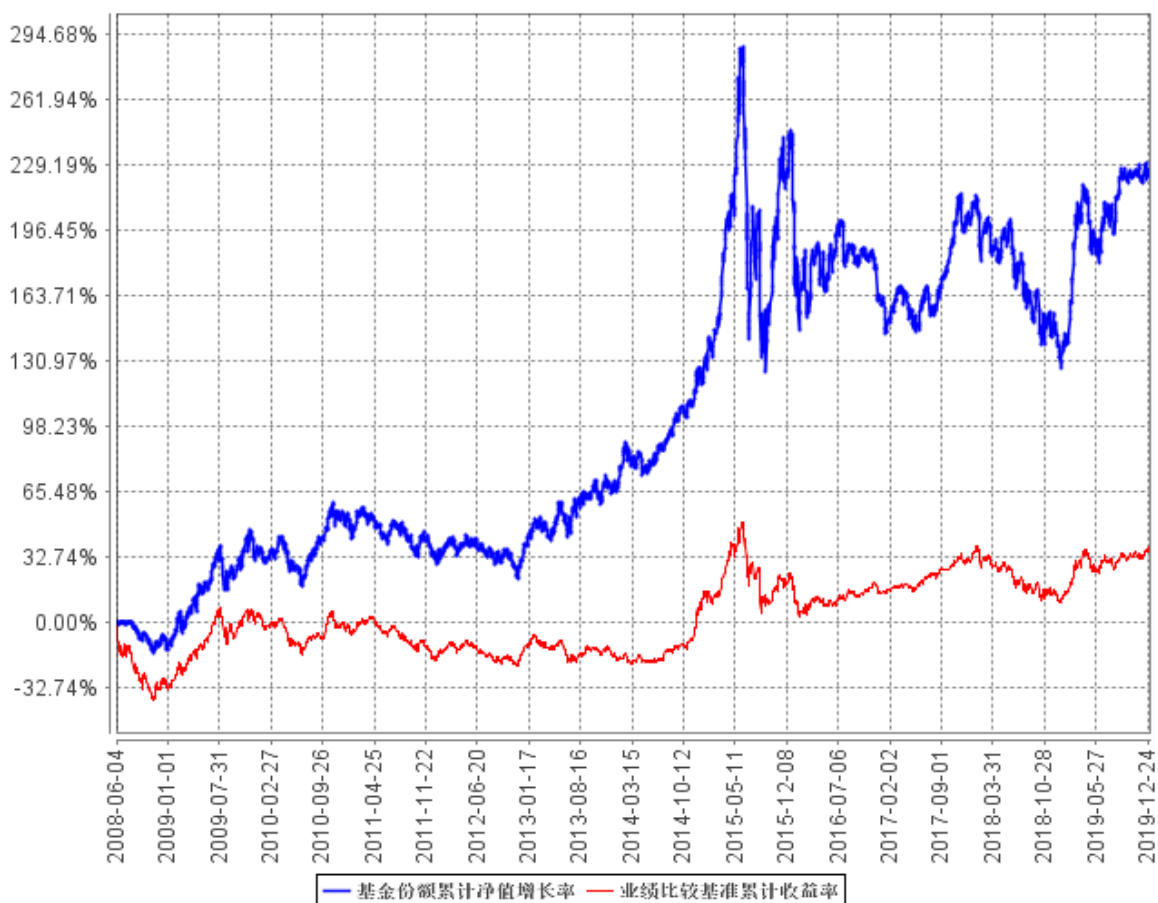
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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	1.26%	0.45%	5.15%	0.48%	-3.89%	-0.03%

### 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 6 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		
朱律	本基金基金经理，长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2019 年 8 月 12 日	-	11 年	朱律先生，硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员。2014 年 5 月加入长盛基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理等职务。

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”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 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、特定客户资产管理组合等。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

目前市场对于经济基本面企稳和流动性充裕的预期较高，经济方面表现为 10 月以来生产端已经企稳，但需求端并未有强劲信号。四季度主要上涨板块已有扩散并有暂时接过市场上涨接力大棒的趋势，地产、新能源汽车、传媒、有色等均有较好表现。但是马上进入年报业绩公告期，更要关注业绩本身。

配置策略：对优质高成长的业绩高度跟踪，对行业的供需改善保持密切关注，减少净值回撤和过大波动，保持风格的同时对股票的仓位进行灵活调整。结构方面，以成长出发，以业绩为根本，精选个股，配置业绩好、成长性好的、估值不太高或经过调整的成长标的。成长为为本基金第一出发点，

#### 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 1.1494 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.26%，业绩比较基准收益率为 5.15%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

## § 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	76,940,954.55	70.58
	其中：股票	76,940,954.55	70.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,086,487.50	17.51
	其中：债券	19,086,487.50	17.51
	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	12,578,972.51	11.54
8	其他资产	411,384.83	0.38
9	合计	109,017,799.39	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	40,090,108.56	37.17
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	1,428,306.00	1.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,957,262.15	12.94
J	金融业	15,184,386.10	14.08
K	房地产业	2,814,716.40	2.61
L	租赁和商务服务业	1,526,559.90	1.42
M	科学研究和技术服务业	1,933,037.40	1.79
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	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	76,940,954.55	71.33

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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	600036	招商银行	197,800	7,433,324.00	6.89
2	601318	中国平安	51,900	4,435,374.00	4.11
3	000725	京东方 A	908,500	4,124,590.00	3.82
4	601966	玲珑轮胎	169,800	3,893,514.00	3.61
5	600519	贵州茅台	3,100	3,667,300.00	3.40
6	600845	宝信软件	110,275	3,628,047.50	3.36
7	002555	三七互娱	123,500	3,325,855.00	3.08
8	688018	乐鑫科技	19,071	3,199,541.67	2.97
9	603605	珀莱雅	35,600	3,134,580.00	2.91
10	600887	伊利股份	100,600	3,112,564.00	2.89

### 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	8,660,685.00	8.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,425,802.50	9.67
	其中：政策性金融债	10,425,802.50	9.67
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	19,086,487.50	17.69

### 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	010303	03 国债(3)	83,250	8,479,845.00	7.86
2	018007	国开 1801	68,620	6,913,465.00	6.41
3	018006	国开 1702	34,250	3,512,337.50	3.26
4	010107	21 国债(7)	1,760	180,840.00	0.17

注：本基金本报告期末仅持有上述四只债券。



## 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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

#### (1) 招商银行

2019 年 7 月 2 日，招商银行和平安银行在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09% 的异常利率交易，经自查，为交易员操作失误所致，全国银行间同业拆借中心现对平安银行和招商银行进行通报批评，要求两家机构加强风险控制和内部管理，并依据《银行间本币市场交易员管理办法（试行）》（中汇交发〔2014〕196 号），暂停平安银行和招商银行相关交易员的银行间本币市场交易员资格 1 年。对以上事件，本基金判断，招商银行作为大型全国性股份制银行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。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。

#### (2) 三七互娱

## 一、违规行为

经查明，芜湖三七互娱网络科技集团股份有限公司（以下简称三七互娱）股东吴绪顺、吴卫东、吴卫红存在以下违规行为：2017 年 12 月 28 日，三七互娱披露公告称，截至公告日，吴绪顺及其一致行动人吴卫东、吴卫红（以下简称吴氏家族）合计持有三七互娱 25.37% 的股份，为三七互娱控股股东、实际控制人。2019 年 2 月 28 日，吴绪顺通过本所证券交易系统以大宗交易方式减持了 3000 万股，占三七互娱总股本的 1.41%，该次交易完成后吴氏家族的持股比例下降至 19.63%，自首次披露减持计划累计减持比例达到 5%，但吴氏家族未停止减持，也未披露《简式权益变动报告书》。2019 年 3 月 12 日，吴绪顺通过本所证券交易系统以大宗交易方式和集中竞价方式分别减持 770 万股和 2120 万股，合计占三七互娱总股本的 1.36%，该次交易完成后吴氏家族自首次披露减持计划累计减持比例达到 7.1%，合计持有三七互娱 18.27% 的股份，变成三七互娱第二大股东。吴氏家族超比例减持比例为 2.1%，直至 2019 年 4 月 11 日才补充披露《简式权益变动报告书》。吴绪顺、吴卫东、吴卫红的上述行为违反了本所《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 1.4 条、第 2.3 条、第 11.8.1 条的规定。

## 二、处罚决定

2019 年 8 月 15 日，深圳证券交易所鉴于上述违规事实及情节，依据《股票上市规则（2018 年 11 月修订）》第 17.2 条的规定，经本所纪律处分委员会审议通过，作出如下处分决定：对芜湖三七互娱网络科技集团股份有限公司股东吴绪顺、吴卫东、吴卫红给予通报批评的处分。对于芜湖三七互娱网络科技集团股份有限公司股东吴绪顺、吴卫东、吴卫红的上述违规行为和本所给予的上述处分，本所将记入上市公司诚信档案，并向社会公开。

## 三、本基金做出如下说明：

三七互娱是游戏行业的龙头公司之一，具有较强的发行竞争力，基本面情况良好。基于相关研究，本基金判断，该项处分主要针的吴氏家族目前已非上市公司控股股东，对三七互娱的日常经营影响较小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其信息披露等公司合规风控问题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股票。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
----	----	-------

1	存出保证金	59,012.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	266,739.77
5	应收申购款	85,632.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	411,384.83

#### 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

注：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	253,107,204.52
报告期期间基金总申购份额	3,494,327.89
减：报告期期间基金总赎回份额	162,754,424.68
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	93,847,107.73

## § 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

注：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

注：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	20191001~20191218	90,651,800.22	-	90,651,700.00	100.22	0.00%
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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛创新先锋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

2020 年 1 月 18 日