

# 长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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 10 月 26 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。

报告期内，本基金自 2021 年 7 月 8 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额，并自该日起接受投资者对 C 类基金份额的申购和赎回。C 类基金份额代码：012716，简称：长盛创新先锋混合 C。详情参阅本基金管理人于 2021 年 7 月 8 日披露的相关公告。

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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 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	48,239,341.36 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	
下属分级基金的基金简称	长盛创新先锋混合 A	长盛创新先锋混合 C

下属分级基金的交易代码	080002	012716
报告期末下属分级基金的份额总额	48,205,329.94 份	34,011.42 份

注：报告期内，本基金自 2021 年 7 月 8 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额，并自该日起接受投资者对 C 类基金份额的申购和赎回。详情参阅本基金管理人于 2021 年 7 月 8 日披露的相关公告。

### § 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（2021 年 7 月 1 日 — 2021 年 9 月 30 日）	
	长盛创新先锋混合 A	长盛创新先锋混合 C
1. 本期已实现收益	11,421,911.27	5,596.10
2. 本期利润	1,693,255.35	-13.47
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0346	-0.0008
4. 期末基金资产净值	84,638,458.66	59,633.55
5. 期末基金份额净值	1.7558	1.7533

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 2021 年 9 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

长盛创新先锋混合 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	1.96%	1.15%	-3.91%	0.78%	5.87%	0.37%
过去六个月	13.15%	1.00%	-1.39%	0.71%	14.54%	0.29%
过去一年	31.14%	1.23%	5.63%	0.79%	25.51%	0.44%
过去三年	86.47%	1.37%	33.08%	0.88%	53.39%	0.49%
过去五年	76.94%	1.22%	40.77%	0.78%	36.17%	0.44%
自基金合同生效起至今	397.86%	1.35%	59.99%	1.04%	337.87%	0.31%

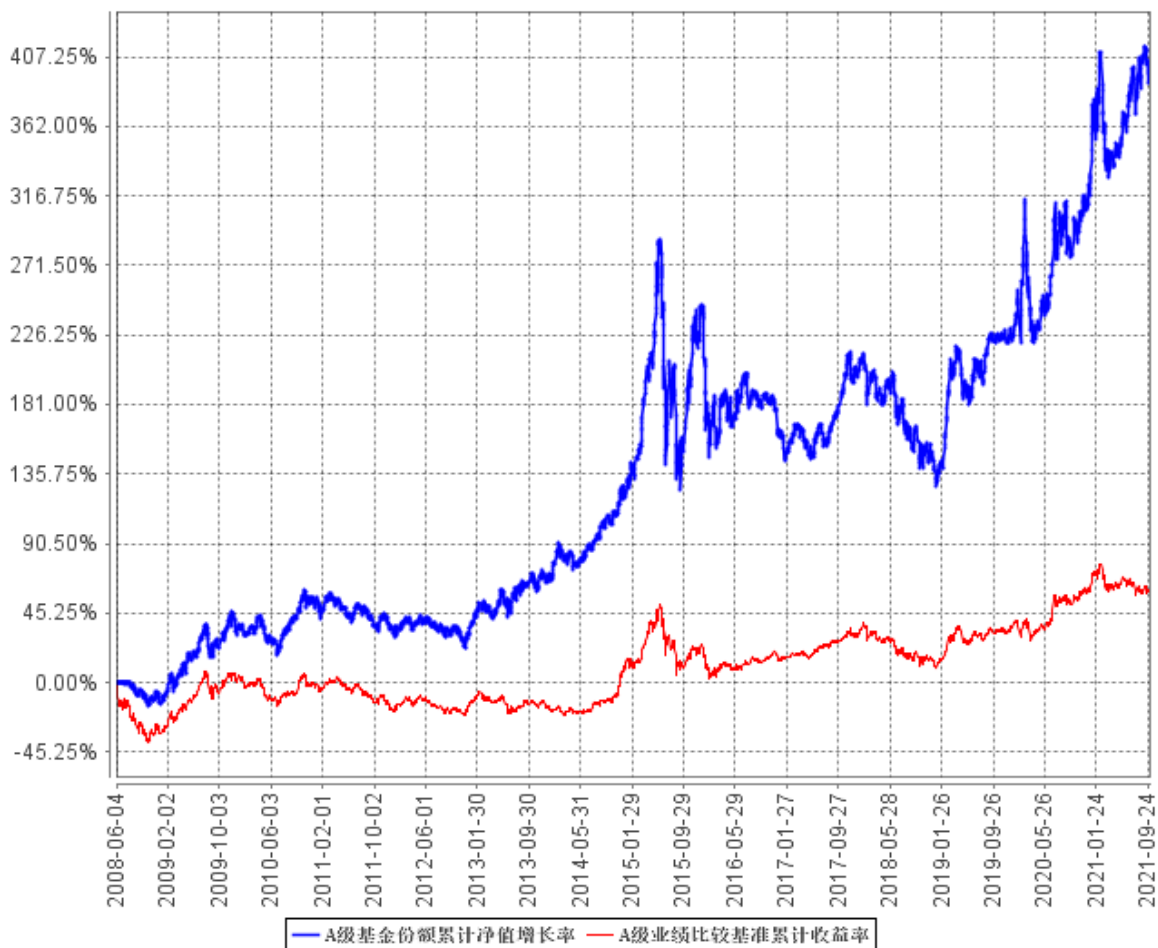
长盛创新先锋混合 C

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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

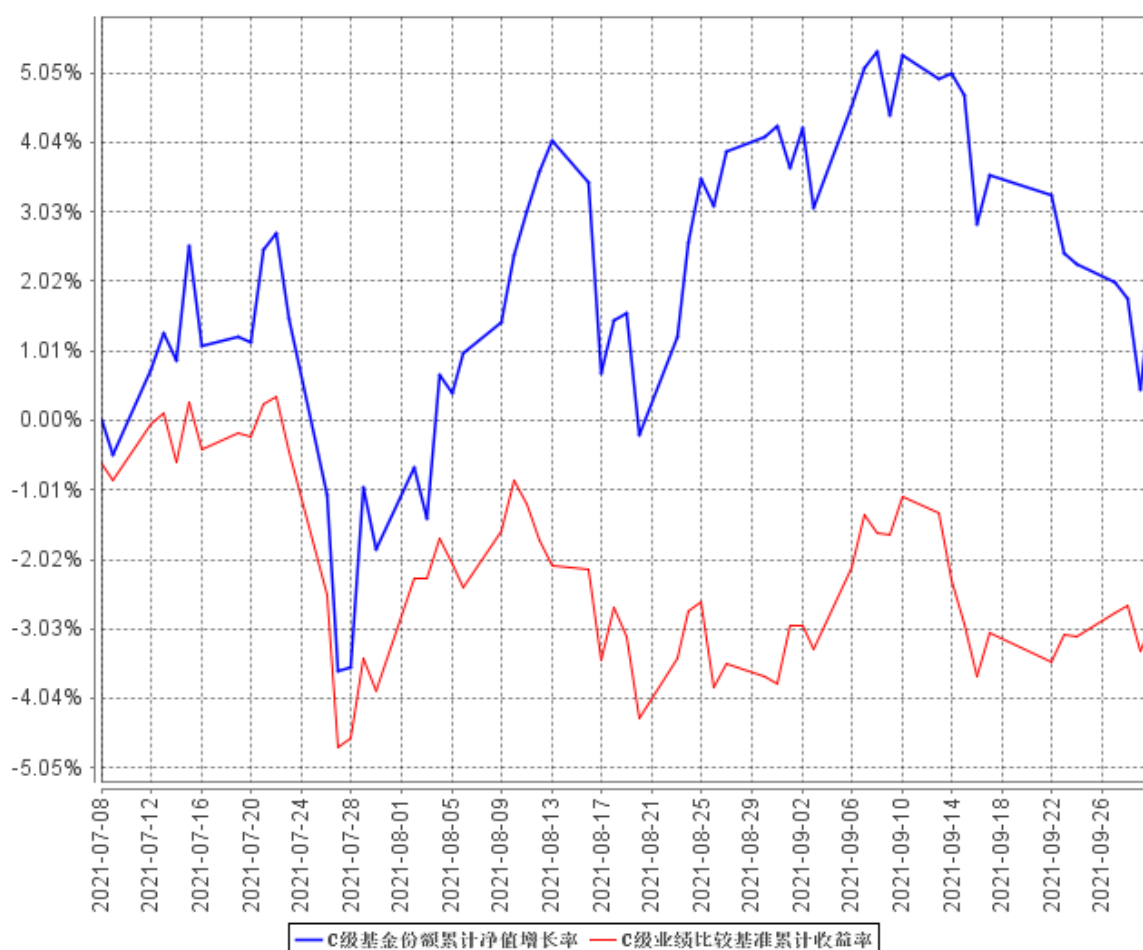
自基金新增 本类份额起 至今	2.04%	1.11%	-2.92%	0.77%	4.96%	0.34%
----------------------	-------	-------	--------	-------	-------	-------

### 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

A级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



C级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		
王远鸿	本基金基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2021年8月26日	-	11年	王远鸿先生，硕士。曾任华夏基金管理有限公司交易员、深圳千合资本管理有限公司交易员、江西铜业（北京）国际投资有限公司交易员与研究员、泓德基金管理有限公司高级研究员等。2021年4月加入长盛基金管

					理有限公司。
付海宁	本基金基金经理。	2020年7月6日	2021年8月26日	12年	付海宁先生，硕士。曾任职于美国摩根士丹利、美银美林、标准普尔资产管理等公司。曾任前海开源基金管理有限公司基金经理，2019年12月加入长盛基金管理有限公司。目前已离任。

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

注：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 报告期内基金投资策略和运作分析

短期来看，三季度，由于疫情对不同国家地区的经济活动影响差异，海外需求激增，且原材料受到前期产能建设、能耗双控、地缘政治等各种制约因素影响，许多大宗原材料价格不断上涨，给中游制造业带来较高成本压力和供应链安全威胁，这些不利因素在四季度也可能持续。国内教育、医疗、互联网等领域的政策变化，也给这些行业带来挑战，在此基础上消费表现也相对较弱。

从长期来看，疫情的影响终归会逐渐消散，疫苗、药物等应对手段也会越来越完善。在较复杂的外部环境中，我国的经济结构转型在不断推进，在全球电子、自动化、汽车、新能源、医药等高附加值产业中的地位也越来越强，我们对优秀公司在这些领域的长期成长保持乐观。

投资标的的选择，也是投资者价值观的反映。本基金重点关注上述行业的投资机会，寻找其中最具有行业竞争力的公司，坚持长期投资，在长期投资的过程中，既有机会给持有人带来可观的回报，也在金融资源配置的过程中服务了实体经济。

对于选择的大部分制造业企业，会重点关注其在行业内与竞争对手的差距，我们特别青睐于具有全球竞争力的优质制造业公司。在这些行业中，我们认为目前新能源赛道的投资相对拥挤，整体估值水平较高，三季度的持仓中我们相对配置不多；电子、汽车零部件由于行业短期遇到一些逆风，也有一些非常有竞争力的公司目前处于不被市场关注的境遇，是这个阶段我们更倾向于去选择的。略偏周期类的标的中，我们选择的是定位高端，具有全球竞争力，并且仍有成长空间的公司。本基金三季度阶段性的持有了一些上游原材料的标的，获取了一定收益。债券部分，三季度开始我们逐步配置一些当前不受关注，但是对应上市公司质地优秀的可转债标的，以期在不确定的未来获得较好的回报。

总体上，这个阶段，本基金的持有集中度并不算高，仓位适中，可以一定程度的分散风险，如果未来市场有所波动，反而会带来非常好的投资机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛创新先锋混合 A 基金份额净值为 1.7558 元，本报告期基金份额净值增长

率为 1.96%，同期业绩比较基准收益率为-3.91%；截至本报告期末长盛创新先锋混合 C 基金份额净值为 1.7533 元，本报告期(2021 年 7 月 8 日至 2021 年 9 月 30 日)基金份额净值增长率为 2.04%，同期业绩比较基准收益率为-2.92%。

#### 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	64,930,560.91	76.24
	其中：股票	64,930,560.91	76.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,319,797.24	16.81
	其中：债券	14,319,797.24	16.81
	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	5,672,741.89	6.66
8	其他资产	243,613.70	0.29
9	合计	85,166,713.74	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	2,630,978.00	3.11
C	制造业	58,203,093.36	68.72
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	-	-



J	金融业	4,096,489.55	4.84
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	64,930,560.91	76.66

### 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 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	603596	伯特利	107,000	4,788,250.00	5.65
2	600036	招商银行	81,199	4,096,489.55	4.84
3	300628	亿联网络	50,300	4,086,875.00	4.83
4	601799	星宇股份	20,900	3,782,900.00	4.47
5	300760	迈瑞医疗	7,900	3,044,818.00	3.59
6	300750	宁德时代	5,300	2,786,369.00	3.29
7	600309	万华化学	26,100	2,786,175.00	3.29
8	300408	三环集团	70,800	2,626,680.00	3.10
9	002475	立讯精密	73,200	2,613,972.00	3.09
10	688065	凯赛生物	15,900	2,479,605.00	2.93

### 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	12,989,680.20	15.34
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）	1,330,117.04	1.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	14,319,797.24	16.91
----	----	---------------	-------

### 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	019654	21 国债 06	84,080	8,415,567.20	9.94
2	019645	20 国债 15	45,700	4,574,113.00	5.40
3	128136	立讯转债	11,746	1,330,117.04	1.57

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

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

本报告期内本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	23,513.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	203,813.68
5	应收申购款	16,286.08
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	243,613.70

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128136	立讯转债	1,330,117.04	1.57

### 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

项目	长盛创新先锋混合 A	长盛创新先锋混合 C
报告期期初基金份额总额	50,108,877.50	-
报告期期间基金总申购份额	1,915,509.35	51,014.34
减：报告期期间基金总赎回份额	3,819,056.91	17,002.92
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	48,205,329.94	34,011.42

## § 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

注：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、长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件；
- 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

2021 年 10 月 27 日