

# 长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告

2022 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：2023 年 1 月 20 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 2023 年 01 月 19 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 2022 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	长盛盛世混合
基金主代码	002156
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 11 日
报告期末基金份额总额	155,656,363.45 份
投资目标	通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在有效控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	<p>（一）大类资产配置</p> <p>本基金将通过深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，动态调整基金资产在股票、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>（二）股票投资策略</p> <p>在新股投资方面，本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面，运用基金管理人的研究平台和股票估值体系，深入发掘新股内在价值，结合市场估值水平和股市投资环境，充分考虑中签率、锁定期等因素，有效识别并防范风险，以获取较好收益。</p> <p>在行业配置策略上，本基金通过对国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展的根本性因素进行分析，对处于稳定的中长期发展趋势和预期</p>

	进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置。 在个股配置策略上，本基金将通过定量与定性相结合的评估方法，对上市公司的增长前景进行分析，力争所选择的企业具备长期竞争优势。 同时，本基金将根据经济发展状况、产业结构升级、技术发展状况及国家相关政策因素对配置的行业和上市公司进行动态调整。此外，基于基金组合中单个证券的预期收益及风险特性，对投资组合进行优化，在合理风险水平下追求基金收益最大化。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%	
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	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C
下属分级基金的交易代码	002156	002157
报告期末下属分级基金的份额总额	152,258,530.36 份	3,397,833.09 份

注：长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金于 2015 年 12 月 11 日成立，后经《关于准予长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可【2021】1282 号）变更注册，并于 2021 年 6 月 21 日表决通过了《关于长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金选任新任基金托管人有关事项的议案》，修订后的《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2021 年 6 月 21 日生效。

### § 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（2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日）	
	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C
1. 本期已实现收益	-8,253,216.48	-200,291.04
2. 本期利润	-3,640,767.78	-86,015.86
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0201	-0.0223
4. 期末基金资产净值	165,998,113.22	3,679,363.07
5. 期末基金份额净值	1.0902	1.0829

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 2022 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、修订后的《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效日为 2021 年 6 月 21 日，本报告中的财务指标、图表、净值表现、投资组合报告等内容，不受该合同生效日变更影响，仍保持历史数据的延续性，以 2015 年 12 月 11 日（初始成立日）为起始日进行编制。

### 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

长盛盛世混合 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	-2.04%	0.46%	0.98%	0.64%	-3.02%	-0.18%
过去六个月	-5.37%	0.45%	-6.22%	0.55%	0.85%	-0.10%
过去一年	-6.39%	0.52%	-9.56%	0.64%	3.17%	-0.12%
过去三年	18.26%	0.55%	4.50%	0.65%	13.76%	-0.10%
过去五年	19.17%	0.71%	13.26%	0.64%	5.91%	0.07%
自基金合同生效起至今	41.14%	0.61%	22.39%	0.62%	18.75%	-0.01%

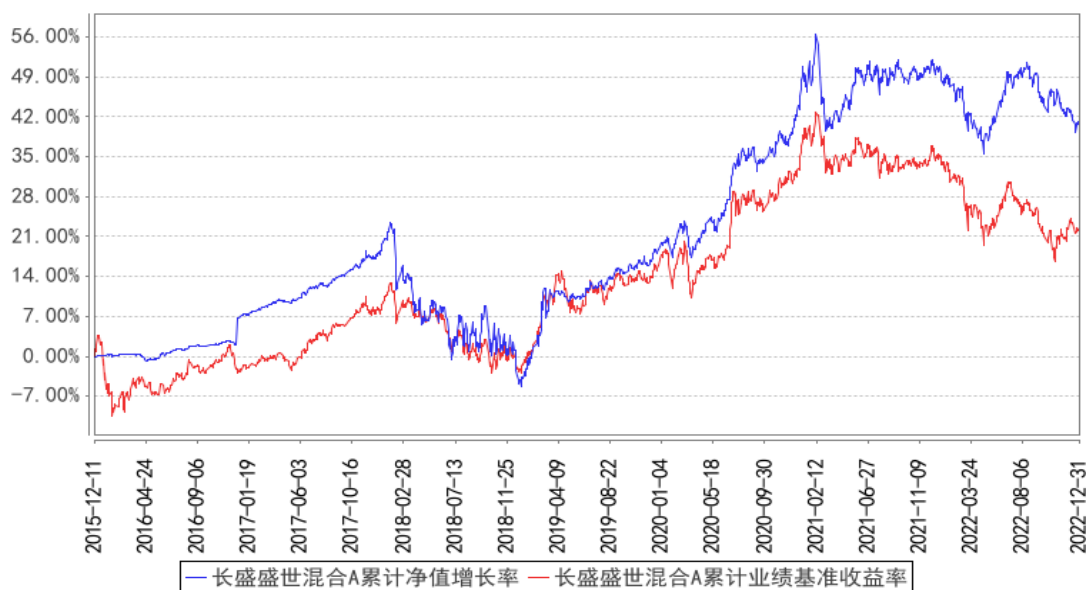
长盛盛世混合 C

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
过去三个月	-2.08%	0.46%	0.98%	0.64%	-3.06%	-0.18%
过去六个月	-5.46%	0.45%	-6.22%	0.55%	0.76%	-0.10%
过去一年	-6.56%	0.52%	-9.56%	0.64%	3.00%	-0.12%
过去三年	17.51%	0.55%	4.50%	0.65%	13.01%	-0.10%
过去五年	17.96%	0.71%	13.26%	0.64%	4.70%	0.07%
自基金合同生效起至今	32.63%	0.60%	22.39%	0.62%	10.24%	-0.02%

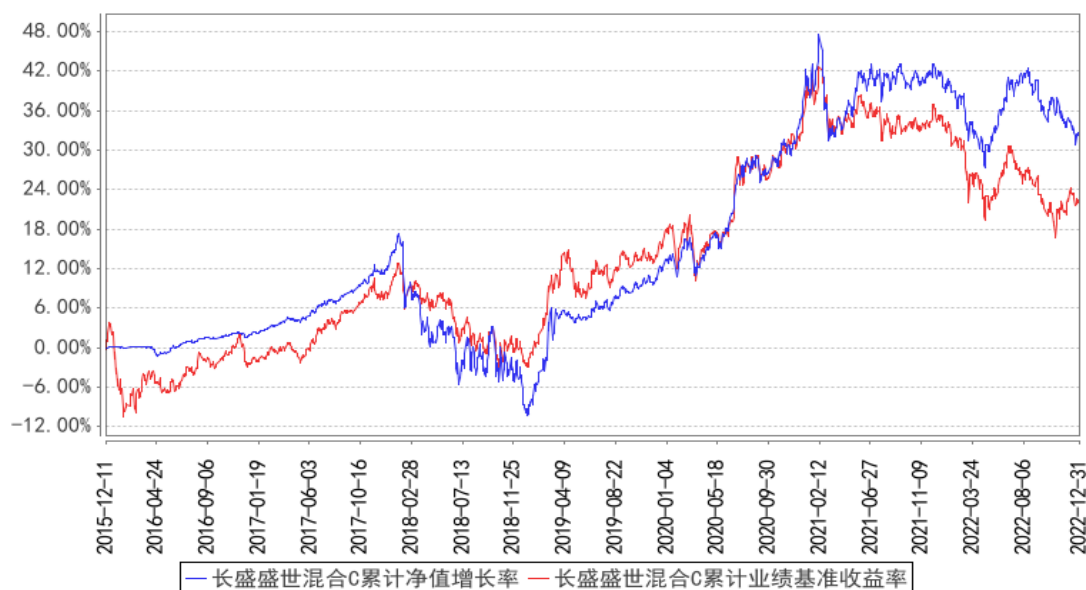
注：为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2015 年 12 月 11 日（初始成立日）为起始日进行编制。

#### 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

长盛盛世混合A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



长盛盛世混合C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、按照本基金合同规定，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有关约定。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。

2、为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2015 年 12 月 11 日（初始成立日）为起始日进行编制。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓	职务	任本基金	证	说明
---	----	------	---	----

名		的基金经		券从	业年
		理期	限		
		任职日	离任日	期	期
李琪	本基金基金经理, 长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理, 长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金经理。	2016年9月12日	-	17年	李琪先生, 博士。历任大公国际资信评估有限公司信用分析师、信用评审委员会委员, 泰康资产管理有限责任公司信用研究员。2011年3月加入长盛基金管理有限公司, 曾任信用研究员、基金经理助理等职务。
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, 长盛创新先锋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, 长盛新兴成长主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2021年12月27日	-	12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。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

权益方面，四季度市场环境依旧是多重不利因素叠加，海外通胀高企，外需下行压力大，国内经济受到疫情冲击。这个过程中，大消费、大金融板块受预期疫后经济复苏的影响，有较为明显的反弹，本基金偏重的成长性行业，表现较弱。这个阶段，加大布局的主要是更长周期上受益于疫后复苏、或后疫情时代需求的制造业公司，对锂电板块从风险控制的角度有所减持，对疫情防控相关的公司进行了获利了结。整体上，我认为大部分标的的估值具备明显的吸引力，一些优质公司通过持续的业绩增长消化了早前的偏高估值，目前对应 2023 年的估值已经下降到具备吸引力的阶段，因此四季度股票仓位有所提高，季末提升到全年较高的位置，预留了少部分仓位，用于捕捉其他的投资机会。重点关注的仍然是成长性行业，选股的大方向仍是“自主可控”、“能源安全”，重点在于未来生产、生活的供需矛盾焦点，重点关注的院内分子检测、储能、自主可控芯片、部分军工细分行业等皆属于此类。

债券方面，债市先扬后抑。10 月，国内疫情呈多点散发、局地加剧之势，市场对经济基本面

担忧和宽货币预期升温，下旬公布的 9 月经济数据延续弱修复，消费和地产依旧疲弱，10 月末公布的 PMI 数据超季节性回落，同时稳汇率政策令人民币贬值预期缓解，10 年期国债收益率下行至 2.64%附近。11 月至 12 月上旬，资金价格中枢抬升，防疫政策持续优化，地产维稳政策相继出台，债市预期明显转向，经济修复“强预期”持续施压债市，由此引发的赎回潮负反馈效应进一步加剧债市下跌，10 年期国债收益率快速攀升至 2.92%的年内高点。12 月中下旬，公布的 11 月金融经济数据不及预期，疲弱的经济基本面未现明显改善，债市震荡回暖，10 年期国债收益率震荡回落至 2.84%附近。债券投资上，本基金延续稳健操作风格，主要投资于中短久期高等级信用债，并通过调整组合久期和杠杆应对市场变化。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛世混合 A 的基金份额净值为 1.0902 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.04%，同期业绩比较基准收益率为 0.98%；截至本报告期末长盛盛世混合 C 的基金份额净值为 1.0829 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.08%，同期业绩比较基准收益率为 0.98%。

#### 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	46,380,416.29	27.27
	其中：股票	46,380,416.29	27.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	97,713,027.59	57.45
	其中：债券	97,713,027.59	57.45
	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	16,109,030.71	9.47
8	其他资产	9,893,380.04	5.82
9	合计	170,095,854.63	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	1,283,878.00	0.76
C	制造业	44,443,850.30	26.19
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	652,687.99	0.38
J	金融业	-	-
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	46,380,416.29	27.33

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	88,200	7,038,360.00	4.15
2	603606	东方电缆	52,000	3,527,160.00	2.08
3	300760	迈瑞医疗	9,000	2,843,730.00	1.68
4	300124	汇川技术	39,000	2,710,500.00	1.60
5	603658	安图生物	39,300	2,430,705.00	1.43
6	603345	安井食品	11,600	1,877,808.00	1.11
7	688116	天奈科技	21,113	1,628,656.82	0.96
8	002709	天赐材料	33,900	1,486,854.00	0.88
9	603063	禾望电气	53,000	1,477,640.00	0.87
10	603290	斯达半导	4,300	1,415,990.00	0.83

#### 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	8,106,459.32	4.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	64,420,568.95	37.97
	其中：政策性金融债	44,096,231.97	25.99
4	企业债券	2,068,986.30	1.22
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	21,415,444.76	12.62
7	可转债（可交换债）	1,701,568.26	1.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	97,713,027.59	57.59

#### 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	210203	21 国开 03	200,000	20,955,698.63	12.35
2	102001232	20 晋焦煤 MTN005A	100,000	10,212,900.82	6.02
3	2228003	22 兴业银行二级 01	100,000	10,208,169.86	6.02
4	102101516	21 鲁能源 MTN004	100,000	10,161,620.27	5.99
5	220208	22 国开 08	100,000	10,125,660.27	5.97

#### 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

#### 1、21 国开 03、22 国开 08、22 国开 20

2022 年 3 月 25 日，银保监罚决字（2022）8 号显示，国家开发银行存在未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据等 17 项违法违规事实，被处罚款 440 万元。对以上事件，本基金判断，国家开发银行经营稳健，上述处罚对公司影响可控。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、22 兴业银行二级 01

2022 年 3 月 25 日，银保监罚决字（2022）22 号显示，兴业银行股份有限公司存在漏报贸易融资业务 EAST 数据等 14 项违法违规事实，被处罚款 350 万元。2022 年 10 月 28 日，银保监罚决字（2022）50 号显示，兴业银行股份有限公司理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹等 5 项违法违规事实，被处罚款 450 万元。2022 年 11 月 4 日，银保监罚决字（2022）41 号显示，兴业银行股份有限公司存在债券承销业务严重违反审慎经营规则的违法违规事实，被处罚款 150 万元。对以上事件，本基金判断，兴业银行股份有限公司经营较为稳健，上述处罚对公司影响可控。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。

#### 3、21 鲁能源 MTN004

山东能源作为贵州盘江精煤股份有限公司股东，未按规定在持股变动比例达到公司已发行股份的 5%时停止买卖，也未及时披露权益变动报告书，而是继续主动减持公司股份，直至减持累计达到 5.74%时才履行权益变动披露义务。上海证券交易所对贵州盘江精煤股份有限公司股东山东能源集团有限公司予以监管警示。对以上事件，本基金判断，上述处罚对公司影响可控。

#### 4、22 国联 C1

国联证券股份有限公司（以下简称“公司”）子公司华英证券有限责任公司（以下简称“华英

证券”)于 2022 年 9 月 16 日收到中国证券监督管理委员会云南监管局(以下简称“云南证监局”)《关于对华英证券采取出具警示函措施的决定》。因华英证券作为“21 楚雄 01”公司债券的受托管理人,未能采取有效措施督促该债券发行人按照募集说明书约定使用募集资金,不符合募集说明书和受托管理协议关于受托管理人监督募集资金使用的约定,违反了《公司债券发行与交易管理办法》第六十条的规定。根据《公司债券发行与交易管理办法》第六十八条的规定,云南证监局决定对华英证券采取出具警示函的行政监管措施。

对以上事件,本基金判断,国联证券经营相对稳健,行业内竞争优势仍在,上述处罚对公司影响可控。

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,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

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	24,747.85
2	应收证券清算款	9,868,632.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	9,893,380.04

### 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	113013	国君转债	711,596.55	0.42
2	113052	兴业转债	411,330.11	0.24
3	110079	杭银转债	347,449.14	0.20
4	113050	南银转债	119,814.65	0.07
5	118005	天奈转债	19,946.75	0.01

### 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

项目	长盛盛世混合 A	长盛盛世混合 C
报告期期初基金份额总额	206,007,133.41	4,056,195.06
报告期期间基金总申购份额	37,207,654.52	16,888.67
减：报告期期间基金总赎回份额	90,956,257.57	675,250.64
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	152,258,530.36	3,397,833.09

## § 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

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	20221001~20221231	59,586,507.94	0.00	0.00	59,586,507.94	38.28
	2	20221001~20221122	51,812,435.23	0.00	51,812,435.23	0.00	0.00
	3	20221001~20221231	55,200,000.00	0.00	0.00	55,200,000.00	35.46
	4	20221123~20221221、 20221226~20221231	39,122,809.95	37,194,532.27	39,122,809.95	37,194,532.27	23.90

#### 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、长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛世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

2023 年 1 月 20 日