长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2026 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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。

根据 2026 年 8 月 22 日披露的《长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，本基金的业绩比较基准自 2026 年 9 月 21 日起由“沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%”变更为“沪深 300 指数收益率*80%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%”。

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 2026 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛盛崇混合
基金主代码	003594
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 10 日
报告期末基金份额总额	162,517,979.23 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	本基金将通过宏观、微观经济指标，市场指标，政策因素等，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。 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。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。 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，适当参与股指债券、期货、国债期货及期权的投资。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%	
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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长盛盛崇混合 A	长盛盛崇混合 C
下属分级基金的交易代码	003594	003595
报告期末下属分级基金的份额总额	113,478,244.56 份	49,039,734.67 份

注：根据 2026 年 8 月 22 日披露的《长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，本基金的业绩比较基准自 2026 年 9 月 21 日起由“沪深 300 指数收益率*50%+中证综合债指数收益率*50%”变更为“沪深 300 指数收益率*80%+中债-综合财富（1-3 年）指数收益率*15%+活期存款基准利率*5%”。

§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（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	长盛盛崇混合 A	长盛盛崇混合 C
1.本期已实现收益	2,683,840.14	1,206,272.46
2.本期利润	-23,966,211.53	-16,260,158.33
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2111	-0.2580
4.期末基金资产净值	158,834,263.38	68,109,983.46
5.期末基金份额净值	1.3997	1.3889

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 2026 年 09 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。

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

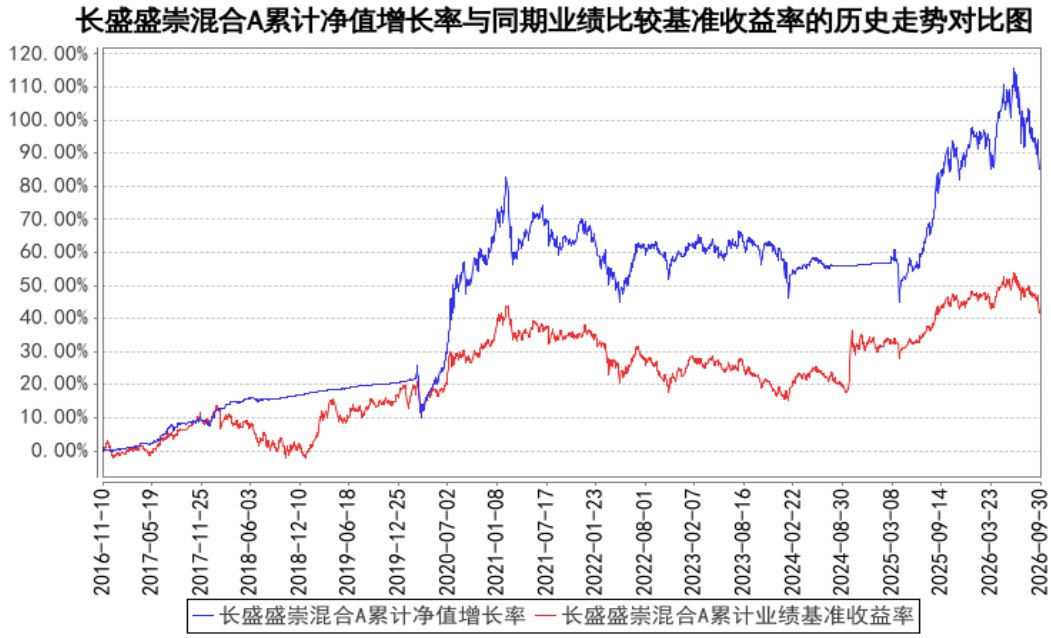
长盛盛崇混合 A

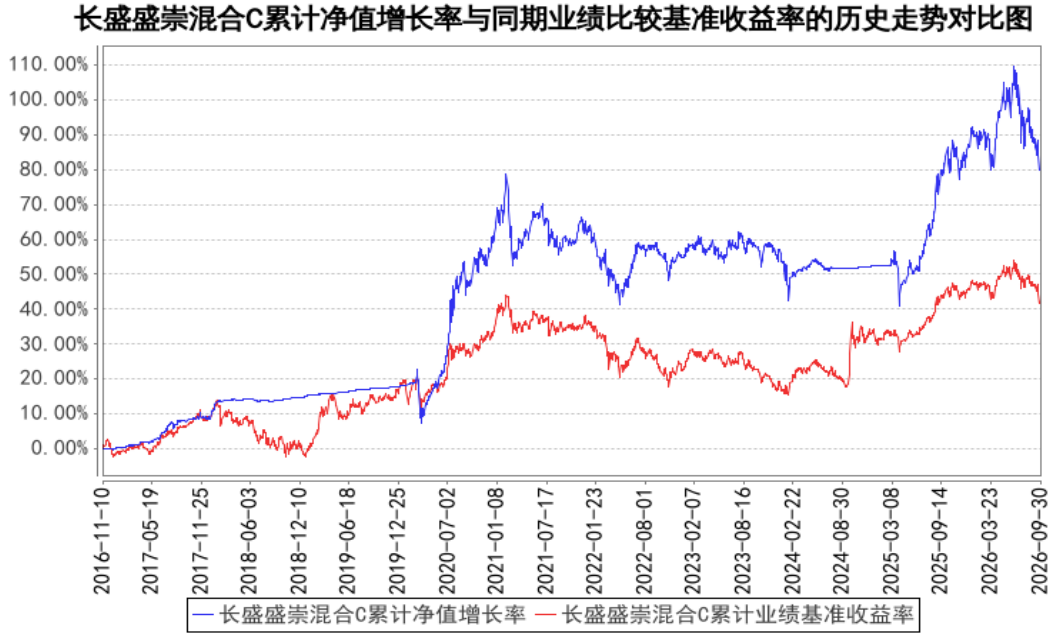
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-13.11%	1.42%	-6.83%	0.68%	-6.28%	0.74%
过去六个月	-0.33%	1.33%	-0.74%	0.66%	0.41%	0.67%
过去一年	-1.83%	1.14%	-2.01%	0.58%	0.18%	0.56%
过去三年	14.46%	0.81%	15.98%	0.57%	-1.52%	0.24%
过去五年	12.88%	0.73%	5.82%	0.56%	7.06%	0.17%
过去七年	54.61%	0.78%	25.73%	0.58%	28.88%	0.20%
自基金合同生效起至今	85.57%	0.66%	42.34%	0.58%	43.23%	0.08%

长盛盛崇混合 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	-13.12%	1.42%	-6.83%	0.68%	-6.29%	0.74%
过去六个月	-0.39%	1.33%	-0.74%	0.66%	0.35%	0.67%
过去一年	-1.93%	1.14%	-2.01%	0.58%	0.08%	0.56%
过去三年	14.10%	0.81%	15.98%	0.57%	-1.88%	0.24%
过去五年	12.31%	0.73%	5.82%	0.56%	6.49%	0.17%
过去七年	53.54%	0.78%	25.73%	0.58%	27.81%	0.20%
自基金合同生效起至今	80.20%	0.66%	42.34%	0.58%	37.86%	0.08%

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：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	离		

		期	任日期		
杨衡	本基金基金经理，长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016 年 11 月 10 日	-	19 年	杨衡先生，博士、博士后。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，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。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

2026 年三季度，中国宏观经济延续"动能向新、结构向优"的弱修复格局，呈现明显的"K 型"分化，结构上表现为“外需偏强、内需偏弱、价格回升、政策加码、资产表现分化”的典型组合。增长层面，三季度实际 GDP 的主流前瞻普遍与二季度 4.3%大体相近或小幅改善，核心支撑来自出口和工业生产，主要拖累仍是房地产、投资和偏弱的实物消费。价格层面，8 月 CPI 已回升至 0.8%、PPI 升至 3.8%，9 月制造业 PMI 回升至 50.1%、综合 PMI 回升至 50.7%，表明经济景气在季末边际修复，但修复更多来自供给和外需改善，而非内需全面转强。资产表现上，三季度 A 股经历明显再平衡，科技成长大幅回撤，红利、资源、防御板块占优；债市则在“弱基本面现实+宽松预期”驱动下走强，呈现长端下行、短端偏稳偏上、信用利差收窄、转债承压的格局；IPO 和新股市场显著提速，尤其北交所成为发行主力，但受理端和排队审核结构分化，体现出“发行加快、审核趋严、硬科技导向强化”的制度特征。

2026 年三季度，中国经济宏观运行的主线是总量平稳、结构分化。对于三季度，多个前瞻口径预计维持与二季度持平，但也有观点认为在出口拉动下小幅修复。这一分歧本身就说明，三季度经济并非全面改善，而是供给端好于需求端、名义变量好于实际内需的修复。从景气指标看，三季度制造业 PMI 边际向上，9 月重回扩张区间；同期非制造业商务活动指数和综合 PMI 产出指数也明显回升，显示生产和需求同步改善，但改善强度有限；高技术制造业、装备制造业 PMI 相对略强，说明增长动能继续向新经济和出口链集中。价格方面，数据显示三季度通胀有所回升，但驱动力更多来自油价、原材料和输入性因素，而不是消费需求显著走强。价格改善对企业名义

收入和上游利润有支撑，但对居民端购买力和终端需求的改善仍需观察。另一方面，需求结构的分化更为突出。房地产投资同比持续下降，是主要拖累项；制造业和基建累计增速也较前期回落，反映投资内生动能偏弱。消费方面，高频数据显示三季度线下消费支付金额同比弱增长，说明服务消费和场景消费边际回暖，但并不足以改变商品消费和地产链消费偏弱的格局。金融数据同样验证“宽货币、弱信用”，社融存量同比或回落，表明流动性环境并不紧，但信用扩张斜率偏弱，资金更多停留在金融体系和债券配置链条，而不是快速转化为实体部门的高强度融资需求。综合判断，三季度经济不是衰退式下滑，而是弱修复、强分化。工业、出口和新动能行业保持韧性，消费和服务在季末略有修复，但房地产、传统投资和信用扩张仍偏弱，因此经济改善的稳定性更多依赖政策后续落地速度与财政传导效率。

2026 年三季度，宏观政策主线可以概括为：货币维持宽松基调，财政强调加快落地，产业政策继续向科技创新和新基建集中，季末稳增长信号有所增强。货币政策方面，人民银行三季度货币政策委员会例会延续“适度宽松”基调，并新增“综合运用并适时调整货币政策工具”表述，同时强调“加力扩大内需、优化供给、加快推动新旧动能转换”，政策语气较二季度更积极。公开市场操作和跨季流动性呵护较为明显，债市资料显示，央行重启 14 天逆回购、超额续作 MLF，并在季末维护资金面稳定。其含义在于，一方面压低融资成本、稳定预期；另一方面并未转向强刺激，仍保留观察窗口，因此形成“流动性宽松、但信用扩张不强”的现实。财政政策方面，7 月政治局会议提出及时谋划出台增量政策、加大逆周期调节力度，三季度政策重点落在加快各类债券发行使用进度、用好地方政府债务结存限额、推进专项债和超长期特别国债落地。这意味着财政并非没有发力，而是发力偏后置、落地重实物工作量转化。对宏观的意义是，三季度财政更多起到底部托举作用，对四季度形成更直接支撑。产业政策方面，导向继续集中在科技、安全、先进制造和新型基础设施。相关政策框架强调制造、科技与安全并重，重点方向包括先进集成电路、具身智能、下一代电池、商业航天、低空基础设施、算力网络、数据基础设施等。这种政策组合的实质影响是：短期对总需求拉动有限，但会持续提升高技术制造、设备更新和科技融资的政策确定性，也解释了为何即便 A 股三季度科技回调，IPO 供给和资本市场制度仍明显向硬科技倾斜。总体看，三季度政策并非“大水漫灌”，而是宽货币托底、财政后置加速、地产边际修复、产业定向加码。其直接结果是债券市场受益最明显，股票市场则更多体现为行业结构再定价，而宏观增长的改善仍需等待政策向信用、投资和消费的更充分传导。

2026 年三季度，A 股市场行情的核心特征是先急跌、后反弹、再震荡，风格从科技成长显著切向红利与资源。主要宽基指数普遍收跌，科创跌幅居前。节奏上，7 月是情绪杀伤最强阶段，AI 链和前期高拥挤科技板块集中调整，成长风格估值快速出清；8 月出现超跌修复，农业、煤炭、

医药轮番走强，小微盘反弹明显；9 月市场再度转入缩量震荡，成交额中枢环比下移。行业层面，资源与防御板块全面占优。申万一级行业中，煤炭、石油石化、农林牧渔、银行、医药、等表现较强，电子、通信等成长板块相对回撤较大。这一结构并非简单的风险偏好下降，而是资金从“估值扩张”转向“盈利验证”的再定价过程：上半年科技股涨幅过大、拥挤度过高，在三季度业绩与外部流动性扰动下集体去估值，而高股息低波红利、资源和部分低位周期板块承接避险与补涨资金。热点和概念层面，三季度并未形成单一强主线，资金结构也体现谨慎。随着 AI 链整体退潮，农林牧渔受涨价逻辑和低位修复推动，煤炭、油气受商品上涨与高股息属性支撑，医药则在估值低位和部分创新方向催化下走强。市场本质上进入多板块轮动、主线弱化、交易集中度下降的新阶段。这也意味着四季度若要出现指数级修复，需要看到成交回暖和盈利预期同步改善。

2026 年三季度，债券市场表现明显强于股票，行情主线清晰：基本面偏弱、货币宽松预期升温、流动性呵护持续，带来利率中枢下移和信用利差压缩。利率债方面，三季度收益率曲线呈平坦化。从变动幅度看，30 年期下行幅度更大，反映短端受资金价格约束略偏硬，而长端受配置力量和降息预期推动更强。信用债方面，收益率整体随国债下行，且低等级、长久期信用债下行更明显。这说明三季度信用市场交易的不是违约恐慌，而是资产荒下的信用下沉和利差压缩。资金面稳定、配置需求释放，是利差收窄的核心原因。流动性层面，央行跨季呵护较强，构成债市偏强运行的重要支撑。三季度债市虽数次受出口、通胀和稳增长预期扰动，但并未改变利率下行趋势，反而在政策表述更宽松时形成阶段性突破。这也解释了为何中国债市在全球利率上行环境中保持相对独立。可转债是三季度债市中相对弱的一环，高价高溢价品种压力尤为明显。原因在于正股走弱导致转股弹性下降，而此前固收+配置带来的高估值又需要消化，结果形成“正股回调+估值压缩”双杀。三季度转债市场的供给和存量结构都在加速重塑，更像是权益弱势环境下的估值修正，而非传统意义上的稳健防御资产。

2026 年三季度，IPO 及新股市场最鲜明的特征是发行提速显著、募资恢复较快、北交所成为核心增量、审核结构呈“受理偏冷、上会注册提速”分化。数据显示，2026 年三季度 A 股 IPO 发行数量及融资规模同比、环比均明显增加，新股融资显著回暖，其中服务创新型中小企业差异化定位的北交所是三季度重要增量来源。新股首日平均涨幅整体仍非常可观，打新热度维持高位。审核与排队情况则显示监管节奏并未放松，但更强调优中选优与存量项目出清。结构上，沪深市场则继续强化对硬科技、未盈利优质企业的支持，部分百亿级募资项目仍在排队，显示资本市场融资功能正向新质生产力进一步倾斜。总体而言，三季度 IPO 市场并非简单回暖，而是在审核趋严前提下的结构性扩容：发行和募资恢复，北交所贡献主要增量，硬科技和专精特新成为供给核心，但受理端偏冷、审核周期仍有波动，意味着后续市场节奏仍将受政策导向、财务更新周期和

二级市场风险偏好共同影响。

2、报告期内本基金投资策略分析

根据基金合同约定，本基金为灵活配置混合型基金，股票投资仓位范围为 0%－95%。本报告期内，结合市场运行态势，我们延续了上一季度的策略思路，转向以沪深 300 指数化优化策略为核心的稳健配置。具体操作上，一方面，依据沪深 300 指数、中证 A500 指数成份股的定期调整公告，及时对组合策略的成份股持仓进行了相应调整；另一方面，参照沪深 300 指数成份股权重进行沪深均衡配置优化，构建创新指数策略的权益底仓组合，整体权益仓位保持在 90%以上。同时，在满足新股网下申购所需的沪深两市股票市值要求后，我们积极参与新股网下申购，力求通过打新收益为组合贡献稳健增强回报。

2025 年 11 月中下旬，经过持续跟踪与审慎评估，我们将原有的沪深 300 指数化策略逐步优化为“沪深 300Ultra”策略，即沪深均衡优化版。以 2025 年 11 月 28 日的数据为例，原沪深 300 指数中沪市与深市的权重约为 64%：36%，我们将其优化为 50%：50%的均衡配置。设沪市收益为 Rsh，深市收益为 Rsz，则不同策略收益及超额收益分别为：

沪深 300 R300=0.64xRsh+0.36xRsz

沪深 300Ultra R300u=0.50xRsh+0.50xRsz

相对超额收益 R300u-R300=0.14x(Rsz-Rsh)

这一调整背后的逻辑意味着，在深市表现相对强于沪市的市场环境下，该优化策略有望获得明确的相对超额收益。

从更深层次看，尽管沪市在沪深两市的市值权重占比中占据较高份额，但市场每天成交金额的分布却显示出不同的偏好——深市往往更为活跃，成交金额占比更高。资本市场的资金流向，本身就是最真实的选择。超配深市，实质上是在组合中增加了创业板和中小板等相对更具活力与弹性的因子。我们相信，长期而言，沪深 300Ultra 沪深均衡优化版策略有望展现出更好的风险收益特征。我们利用 Wind PMS 系统进行历史模拟回测，数据显示自 2019 年 6 月以来，沪深 300Ultra 相对原沪深 300 指数的年化超额收益超过 3%。

本报告期内，我们沿续沪深 300Ultra 指数化优化策略，持股范围从沪深 300 指数成份股、向沪深 300 指数和中证 A500 指数共有的成份股集中，即和中证 A500 指数两个成分股集合求交集（237 只），然后再进行沪深 50%：50%的均衡配置，既有沪深 300 指数规模属性（大），又有中证 A500 指数龙头属性（优），持仓集中度和优度明显上升。

本报告期内，我们积极参与沪深两市新股网下申购，在新股投资中坚持紧密跟踪、优选标的，注重实操细节与各类风险防控，新股上市后及时变现以锁定收益。

我们将继续恪守勤勉尽责的原则，在控制风险的前提下，动态优化组合，力争为持有人创造稳健、可持续的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛崇混合 A 的基金份额净值为 1.3997 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.11%，同期业绩比较基准收益率为-6.83%；截至本报告期末长盛盛崇混合 C 的基金份额净值为 1.3889 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.12%，同期业绩比较基准收益率为-6.83%。

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	211,582,116.48	92.52
	其中：股票	211,582,116.48	92.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,302,890.50	5.82
	其中：债券	13,302,890.50	5.82
	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	1,450,000.00	0.63
	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	2,233,041.22	0.98
8	其他资产	129,924.45	0.06
9	合计	228,697,972.65	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	1,298,970.00	0.57
B	采矿业	12,321,043.23	5.43
C	制造业	139,737,488.93	61.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	5,769,612.84	2.54

	业		
E	建筑业	2,774,857.00	1.22
F	批发和零售业	356,934.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	6,179,653.00	2.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,566,133.08	4.22
J	金融业	27,366,622.40	12.06
K	房地产业	799,798.00	0.35
L	租赁和商务服务业	1,156,600.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	3,547,608.00	1.56
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	564,186.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	142,610.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	211,582,116.48	93.23

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	300308	中际旭创	12,100	9,782,124.00	4.31
2	300750	宁德时代	31,400	9,140,854.00	4.03
3	600519	贵州茅台	5,100	6,418,962.00	2.83
4	300502	新易盛	13,976	5,436,664.00	2.40
5	000333	美的集团	58,900	4,717,890.00	2.08
6	601899	紫金矿业	141,400	4,212,306.00	1.86
7	601318	中国平安	72,200	3,847,538.00	1.70
8	603259	药明康德	21,200	3,547,608.00	1.56
9	002475	立讯精密	65,000	3,212,950.00	1.42
10	002371	北方华创	5,060	3,116,808.20	1.37

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	9,138,886.55	4.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,032,745.21	1.78
	其中：政策性金融债	4,032,745.21	1.78

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）	131,258.74	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,302,890.50	5.86

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	019827	26 国债 01	45,000	4,538,956.44	2.00
2	260411	26 农发 11	40,000	4,032,745.21	1.78
3	269956	26 贴现国债 56	40,000	3,991,907.69	1.76
4	019792	25 国债 19	3,000	304,011.21	0.13
4	102317	国债 2519	3,000	304,011.21	0.13
5	113708	曙 26 转债	950	131,258.74	0.06

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

26 农发 11：

2026 年 7 月 21 日，京汇罚(2026)24 号显示，中国农业发展银行存在办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等违法违规事实，被处警告、罚款、没收违法所得，罚没合计 176.19 万元。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

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是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票，均为基金合同约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	62,830.04
2	应收证券清算款	66,652.37
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	442.04
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	129,924.45

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。

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	长盛盛崇混合 A	长盛盛崇混合 C
报告期期初基金份额总额	113,703,744.69	97,206,996.91
报告期期间基金总申购份额	32,826.11	107,867.44
减:报告期期间基金总赎回份额	258,326.24	48,275,129.68
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	113,478,244.56	49,039,734.67

§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	20260701~20260714、20260731~20260930	42,932,227.56	0.00	6,600,000.00	36,332,227.56	22.36
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、长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件；

2、《长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

4、《长盛盛崇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

2026 年 10 月 27 日