# 长盛盛辉混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

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:2018年10月24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2018年10月23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,投资者在做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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 长盛盛辉混合 | |
| 基金主代码 | 003169 | |
| 交易代码 | 003169 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年8月16日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 90,568,563.68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力争满足投资者实现资本增值的投资需求。 | |
| 投资策略 | (一)大类资产配置<br>在大类资产配置中,本基金将主要考虑:(1)宏观经济指标;(2)微观经济指标;(3)市场指标;(4)政策因素。<br>(二)股票投资策略<br>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。<br>(三)债券投资策略<br>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。 | |
| 业绩比较基准 | 50%*沪深300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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长盛盛辉混合A | 长盛盛辉混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003169 | 003170 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 90,227,899.68份 | 340,664.00份 |

§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(2018年7月1日 - 2018年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 长盛盛辉混合A | 长盛盛辉混合C |
| 1. 本期已实现收益 | -8,302,877.46 | -29,879.50 |
| 2. 本期利润 | -3,573,691.85 | -12,969.98 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0396 | -0.0380 |
| 4. 期末基金资产净值 | 89,800,488.84 | 342,671.46 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9953 | 1.0059 |

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2018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 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

长盛盛辉混合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 | -3.83% | 0.88% | -0.23% | 0.67% | -3.60% | 0.21% |

长盛盛辉混合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 | -3.87% | 0.88% | -0.23% | 0.67% | -3.64% | 0.21% |

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李琪 | 本基金基金经理,长盛双月红1年期定期开放债券型投资基金基金经理,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,长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理,长盛同瑞债券型证券投资基金基金经理,长盛可转债债券型证券投资基金基金经理。 | 2016年8月16日 | - | 10年 | 李琪先生,1975年2月出生。天津大学管理学博士。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。 |
| 杨衡 | 本基金基金经理,长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理。 | 2016年8月16日 | - | 11年 | 杨衡先生,1975年10月出生。中国科学院数学与系统科学研究院博士、博士后。2007年7月进入长盛基金管理公司,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,长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。 |

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

1、报告期内行情回顾

报告期内,中国经济虽然表现出较强韧性,但也显现一定的下行压力。市场存在对中美贸易战关税实施落地对出口的拖累、前期金融条件收紧的滞后效应、房地产下行压力等均可能导致经济增速进一步放缓的预期。宏观政策对冲式放松,如维持基建增速稳定、更大规模的减税降费、促进消费等,以防止经济出现失速风险。货币政策维持稳健中性,流动性相对充裕。

报告期内,基本面对债券市场的支持有所弱化。受通胀预期升温、地方专项债加速发行、宽信用和扩基建、美联储加息叠加人民币贬值压力制约等预期影响,债券市场8月初之后出现一定的调整,整体维持震荡格局。

报告期内,A股市场呈现振荡盘跌走势,深市弱于沪市,大盘强于中小盘,市场整体成交活跃度下降。报告期内,IPO发行基本延续每周一批的常态化发行节奏,但每批IPO家数和募集总金额明显减少。受权益市场调整和风格转换影响,股票底仓波动加大,上市新股平均开板涨幅整体较过去有明显下行,新股申购收益收敛。

2、报告期内本基金投资策略分析

本报告期内,本基金坚持稳健操作思路,有针对性地加强基金投资者结构与组合资产流动性的匹配管理,密切跟踪基金规模变化,积极应对可能存在的大额赎回。

本报告期内,固定收益资产配置抓住市场资金利率的有利时机,坚持以中短期利率债等标的配置为主,保持组合流动性,较好控制了利率风险、信用风险和流动性风险。

在股票配置上,本基金参照中证500指数,精选沪市成份股,进行底仓配置以参与新股网下申购。虽然股票配置相对稳定,但由于仓位仍不低,随着股票市场调整,基金组合净值波动较前期有所加大。本报告期内因股票底仓市值原因,未积极参与新股网下申购。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛辉混合A基金份额净值为0.9953元,本报告期基金份额净值增长率为-3.83%;截至本报告期末长盛盛辉混合C基金份额净值为1.0059元,本报告期基金份额净值增长率为-3.87%;同期业绩比较基准收益率为-0.23%。

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 | 55,866,524.19 | 61.77 |
| | 其中:股票 | 55,866,524.19 | 61.77 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 30,473,568.80 | 33.69 |
| | 其中:债券 | 30,473,568.80 | 33.69 |
| | 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 | 3,224,471.10 | 3.57 |
| 8 | 其他资产 | 876,498.27 | 0.97 |
| 9 | 合计 | 90,441,062.36 | 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 | 2,191,438.16 | 2.43 |
| C | 制造业 | 35,781,869.85 | 39.69 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,091,396.00 | 2.32 |
| E | 建筑业 | 715,217.20 | 0.79 |
| F | 批发和零售业 | 2,992,328.32 | 3.32 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,239,148.00 | 2.48 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,359,974.95 | 2.62 |
| J | 金融业 | 1,924,656.00 | 2.14 |
| K | 房地产业 | 2,598,091.00 | 2.88 |
| L | 租赁和商务服务业 | 564,373.00 | 0.63 |
| 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 | 194,326.00 | 0.22 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,213,705.71 | 2.46 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 55,866,524.19 | 61.98 |

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 | 603019 | 中科曙光 | 58,900 | 2,761,232.00 | 3.06 |
| 2 | 600718 | 东软集团 | 156,200 | 1,811,920.00 | 2.01 |
| 3 | 600580 | 卧龙电气 | 237,600 | 1,805,760.00 | 2.00 |
| 4 | 600021 | 上海电力 | 224,620 | 1,684,650.00 | 1.87 |
| 5 | 600426 | 华鲁恒升 | 75,328 | 1,296,394.88 | 1.44 |
| 6 | 600183 | 生益科技 | 119,075 | 1,253,859.75 | 1.39 |
| 7 | 600521 | 华海药业 | 54,400 | 1,190,816.00 | 1.32 |
| 8 | 600823 | 世茂股份 | 257,400 | 1,099,098.00 | 1.22 |
| 9 | 600643 | 爱建集团 | 111,700 | 1,081,256.00 | 1.20 |
| 10 | 600338 | 西藏珠峰 | 45,300 | 1,060,020.00 | 1.18 |

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 | 30,355,000.00 | 33.67 |
| | 其中:政策性金融债 | 30,355,000.00 | 33.67 |
| 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) | 118,568.80 | 0.13 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 30,473,568.80 | 33.81 |

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 | 170212 | 17国开12 | 200,000 | 20,338,000.00 | 22.56 |
| 2 | 180209 | 18国开09 | 100,000 | 10,017,000.00 | 11.11 |
| 3 | 127005 | 长证转债 | 1,240 | 118,568.80 | 0.13 |

注:本基金本报告期末仅持有上述三只债券。

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

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,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 | 7,274.11 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 869,224.16 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 876,498.27 |

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 | 127005 | 长证转债 | 118,568.80 | 0.13 |

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 | 长盛盛辉混合A | 长盛盛辉混合C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 90,283,456.05 | 447,481.86 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,285.98 | 41,079.98 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 56,842.35 | 147,897.84 |
| 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 | 90,227,899.68 | 340,664.00 |

§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 | 20180701~20180930 | 90,089,189.19 | 0.00 | 0.00 | 90,089,189.19 | 99.47% |
| 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、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛盛辉混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛盛辉混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛盛辉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、010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司

2018年10月24日

# 长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

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:2018年10月24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规定,于2018年10月23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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 长盛盛康混合 | |
| 基金主代码 | 003922 | |
| 交易代码 | 003922 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017年2月13日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 49,773,366.77份 | |
| 投资目标 | 通过优化的资产配置,前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会,在严格控制风险的前提下力争实现基金资产的稳健增值。 | |
| 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。<br>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。在行业配置的基础上,通过定性分析和定量分析相结合的办法,挑选具备较大投资价值的上市公司。<br>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。本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素,构造债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。<br>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、国债期货及期权的投资。 | |
| 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 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长盛盛康混合A | 长盛盛康混合C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003922 | 003923 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 42,627.57份 | 49,730,739.20份 |

§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(2018年7月1日 - 2018年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 长盛盛康混合A | 长盛盛康混合C |
| 1. 本期已实现收益 | -1,008.57 | -8,420,821.92 |
| 2. 本期利润 | -44.82 | 231,748.38 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0009 | 0.0013 |
| 4. 期末基金资产净值 | 45,271.37 | 52,023,597.78 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0620 | 1.0461 |

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2018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 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

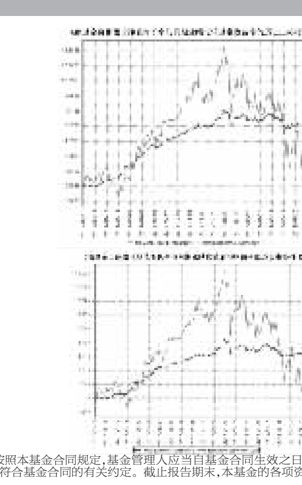
长盛盛康混合A

| 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 | -0.08% | 0.11% | -0.23% | 0.67% | 0.15% | -0.56% |

长盛盛康混合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 | -0.13% | 0.11% | -0.23% | 0.67% | 0.10% | -0.56% |

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,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。截止报告期末,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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 | | |
| 杨衡 | 本基金基金经理,长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理,长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛崇灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理。 | 2017年2月13日 | - | 11年 | 杨衡先生,1975年10月出生。中国科学院数学与系统科学研究院博士、博士后。2007年7月进入长盛基金管理公司,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,长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理等职务。 |

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

1、报告期内行情回顾

报告期内,中国经济虽然表现出较强韧性,但也显现一定的下行压力。市场存在对中美贸易战关税实施落地对出口的拖累、前期金融条件收紧的滞后效应、房地产下行压力等均可能导致经济增速进一步放缓的预期。宏观政策对冲式放松,如维持基建增速稳定、更大规模的减税降费、促进消费等,以防止经济出现失速风险。货币政策维持稳健中性,流动性相对充裕。

报告期内,基本面对债券市场的支持有所弱化。受通胀预期升温、地方专项债加速发行、宽信用和扩基建、美联储加息叠加人民币贬值压力制约等预期影响,债券市场8月初之后出现一定的调整,整体维持震荡格局。

报告期内,A股市场呈现振荡盘跌走势,深市弱于沪市,大盘强于中小盘,市场整体成交活跃度下降。报告期内,IPO发行基本延续每周一批的常态化发行节奏,但每批IPO家数和募集总金额明显减少。受权益市场调整和风格转换影响,股票底仓波动加大,上市新股平均开板涨幅整体较过去有明显下行,新股申购收益收敛。

2、报告期内本基金投资策略分析

本报告期内,本基金坚持稳健操作思路,有针对性地加强基金投资者结构与组合资产流动性的匹配管理,密切跟踪基金规模变化,积极应对可能存在的大额赎回。

本报告期内,固定收益资产配置抓住市场资金利率的有利时机,坚持以AAA高信用评级短期银行存单、短期利率债等标的配置为主,并进一步降低组合久期,保持组合流动性,较好控制了利率风险、信用风险和流动性风险。

本报告期内,本基金7月中旬清空了股票(除停牌股票外),之后未参与新股网下申购。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛康混合A基金份额净值为1.0620元,本报告期基金份额净值增长率为-0.08%;截至本报告期末长盛盛康混合C基金份额净值为1.0461元,本报告期基金份额净值增长率为-0.13%;同期业绩比较基准收益率为-0.23%。

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 | 497,448.00 | 0.95 |
| | 其中:股票 | 497,448.00 | 0.95 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 42,423,600.00 | 81.04 |
| | 其中:债券 | 42,423,600.00 | 81.04 |
| | 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 | 5,500,000.00 | 10.51 |
| | 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 | 2,990,901.59 | 5.71 |
| 8 | 其他资产 | 934,804.30 | 1.79 |
| 9 | 合计 | 52,346,753.89 | 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 | - | - |
| 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 | 497,448.00 | 0.96 |
| 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 | - | - |
| 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 | 497,448.00 | 0.96 |

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 | 600122 | 宏图高科 | 126,900 | 497,448.00 | 0.96 |

注:本基金本报告期末仅持有1只股票。

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 | 3,621,600.00 | 6.96 |
| | 其中:政策性金融债 | 3,621,600.00 | 6.96 |
| 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 | 38,802,000.00 | 74.52 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 42,423,600.00 | 81.48 |

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 | 111896789 | 18宁波银行CD080 | 100,000 | 9,801,000.00 | 18.82 |
| 2 | 111816105 | 18上海银行CD105 | 100,000 | 9,786,000.00 | 18.79 |
| 3 | 111809122 | 18浦发银行CD122 | 100,000 | 9,630,000.00 | 18.49 |
| 4 | 111892301 | 18南京银行CD027 | 100,000 | 9,585,000.00 | 18.41 |
| 5 | 018005 | 国开1701 | 36,000 | 3,621,600.00 | 6.96 |

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投资。

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

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,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 | 27,869.46 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,413.70 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 904,521.14 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 934,804.30 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600122 | 宏图高科 | 497,448.00 | 0.96 | 重大事项停牌 |

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 | 长盛盛康混合A | 长盛盛康混合C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 46,740.60 | 430,733,955.62 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,569.92 | 2,477.42 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 7,682.95 | 381,005,693.84 |
| 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 | 42,627.57 | 49,730,739.20 |

§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 | 20180701~20180930 | 430,663,221.36 | - | 381,000,000.00 | 49,663,221.36 | 99.78% |
| 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、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛盛康灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛盛康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场所及/或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、010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司

2018年10月24日

# 长盛盛裕纯债债券型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2018年10月24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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月23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,投资者在做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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 长盛盛裕纯债 | |
| 基金主代码 | 003102 | |
| 交易代码 | 003102 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016年8月4日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,497,224,593.04份 | |
| 投资目标 | 在控制风险和保持资产流动性的基础上,追求基金资产的长期稳健增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。 | |
| 投资策略 | (一)大类资产配置策略<br>本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上,结合政策分析,确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。<br>(二)债券组合管理策略<br>1、利率策略<br>利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。<br>2、类属配置策略<br>债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况,货币市场及资本市场资金供求关系,以及不同时期市场投资热点,分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利差水平,评定不同债券类属的相对投资价值,确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。<br>3、信用策略<br>信用品种的选择采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方式,在对宏观经济、利率走势、发行人经营及财务状况进行分析的基础上,结合信用品种的发行条款,建立信用债备选库,并以此为基础拟定信用品种的投资方法。 | |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数(全价)收益率 | |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长盛盛裕纯债A | 长盛盛裕纯债C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003102 | 003103 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,497,138,649.37份 | 85,943.67份 |

§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(2018年7月1日 - 2018年9月30日) | |
|---|---|---|
| | 长盛盛裕纯债A | 长盛盛裕纯债C |
| 1. 本期已实现收益 | 13,053,204.91 | 12,340.27 |
| 2. 本期利润 | 24,233,165.50 | 40,664.05 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0162 | 0.0301 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,521,484,997.57 | 87,308.21 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0163 | 1.0159 |

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2018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 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

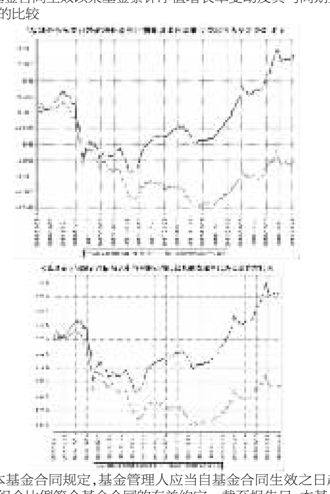
长盛盛裕纯债A

| 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 | 1.62% | 0.07% | 0.57% | 0.07% | 1.05% | 0.00% |

长盛盛裕纯债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 | 1.57% | 0.07% | 0.57% | 0.07% | 1.00% | 0.00% |

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,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本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本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 | | |
| 段鹏 | 本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理,长盛盛景纯债债券型证券投资基金基金经理,长盛添利宝货币市场基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。 | 2016年8月4日 | - | 11年 | 段鹏先生,1982年12月出生。中央财经大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易、债券投资及流动性管理等工作。2013年12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

1、报告期内行情回顾

三季度,国内经济基本面继续缓慢回落;通胀有所上行但绝对水平保持低位;在经济下行压力有所加大的背景下,监管层大力推动宽信用进程,货币政策维持稳健中性基调,实质中性偏松。

三季度债券收益率震荡有所加大,在6月末降准引导下,7月份市场明显回暖,进入8月份,受宽信用政策、债券供给提速等影响,市场出现明显回调。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金坚持稳健操作思路,在信用风险可控的前提下重点配置中短期高等级信用债,保持组合一定久期,提升组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛裕纯债A基金份额净值为1.0163元,本报告期基金份额净值增长率为1.62%;截至本报告期末长盛盛裕纯债C基金份额净值为1.0159元,本报告期基金份额净值增长率为1.57%;同期业绩比较基准收益率为0.57%。

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 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,731,358,320.00 | 96.69 |
| | 其中:债券 | 1,728,949,320.00 | 96.55 |
| | 资产支持证券 | 2,409,000.00 | 0.13 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 22,000,153.00 | 1.23 |
| | 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 | 6,343,241.91 | 0.35 |
| 8 | 其他资产 | 30,950,632.69 | 1.73 |
| 9 | 合计 | 1,790,652,347.60 | 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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

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 | 102,415,200.00 | 6.73 |
| | 其中:政策性金融债 | 102,415,200.00 | 6.73 |
| 4 | 企业债券 | 499,500,760.00 | 32.83 |
| 5 | 企业短期融资券 | 549,624,600.00 | 36.12 |
| 6 | 中期票据 | 548,476,760.00 | 36.05 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | 28,932,000.00 | 1.90 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,728,949,320.00 | 113.63 |

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 | 136085 | 15金茂投 | 1,300,000 | 129,727,000.00 | 8.53 |
| 2 | 136819 | 16川发01 | 1,000,000 | 93,810,000.00 | 6.17 |
| 3 | 101652025 | 16赣高速MTN002 | 900,000 | 86,652,000.00 | 5.69 |
| 4 | 101661025 | 16皖交控MTN002B | 900,000 | 86,013,000.00 | 5.65 |
| 5 | 136196 | 16龙湖02 | 800,000 | 77,752,000.00 | 5.11 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 1889112 | 18上和1A1 | 100,000 | 2,409,000.00 | 0.16 |

注:本基金本报告期末仅持有上述1只资产支持证券。

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国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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。

5.10.2

本基金报告期末未持有股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,000,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 29,950,308.49 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 324.20 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 30,950,632.69 |

5.10.4 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)。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10.6 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 | 长盛盛裕纯债A | 长盛盛裕纯债C |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,497,126,049.13 | 126,749.11 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 12,698.95 | 2,952,770.08 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 98.71 | 2,993,575.52 |
| 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 | 1,497,138,649.37 | 85,943.67 |

§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

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 | 20180701~20180930 | 1,497,114,728.77 | 0.00 | 0.00 | 1,497,114,728.77 | 99.99% |
| 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、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛盛裕纯债债券型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛盛裕纯债债券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场所及/或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、010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司

2018年10月24日