

# 长盛积极配置债券型证券投资基金

## [2016]第一季度报告

基金管理人：长盛基金管理有限公司  
基金托管人：中国建设银行股份有限公司  
报告送出日期：2016年4月22日

### § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本基金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报告所载资料对本基金报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容进行复核，保留在复核过程中发现的任何差异，应及时报告并予以纠正。

基金合同生效后，连续两个季度未在定期报告中披露，但不表示基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资人应在投资决策前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2016年1月1日起至3月31日止。

### § 2 基本产品概况

基金简称 长盛积极配置债券

基金主代码 069003

交易代码 069003

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2009年10月1日

报告期末基金份额总额 346,897,273.0份

在封闭期内和因资金申购赎回的基础上，通过长期主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超越行业基准的投资回报。

投资目标 本基金为积极配置类的债券型基金，不同于传统的债券型基金的投资策略，本基金将通过综合运用多种投资工具，结合宏观经济、行业、公司、信用等分析，寻找具有高性价比的债券品种，通过主动管理，把握市场机会，来获取股票市场的收益。此外，本基金还将通过债券投资手段高置基金资产的流动性和杠杆率，其期间风险和预期收益率低于混合型基金。

业绩比较基准 中证综合债指数×90%+沪深300指数收益率×10%

风险收益特征 本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金，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 中国建设银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

报告期(2016年1月1日 – 2016年3月31日)

1.本期已实现收益 662,152.67

2.本期利润 806,203.66

3.加权平均基金份额本期利润 0.0037

4.期末基金份额净值 401,647,74.20

5.期末基金份额净值 1,421.4

注：1.所列基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或申购基金的各项费用，计入费用后实际收益水平以所列数字为准。

2.月份数据截至到2016年3月31日。

3.本期利润指扣除管理费后的本期收入，投资收益，其收入（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入加上本期公允价值变动收益。

4.基金净值是指基金份额净值。

5.期末基金净值 1,421.4

注：本基金本报告期末持有的公允价值投资，计入费用后实际收益水平以所列数字为准。

6.3 报告期期末基金份额净值增长率为零时与同期行业业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率标准差③

过去三个月 -0.94% 0.19% -0.20% 0.26% -0.74% -0.00%

注：本基金本报告期末尚未持有上述七只股票。

6.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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 600271 新天燃气 15,000 0.018

2 002290 航天机电 26,700 0.035

3 300104 乐视网 5,000 0.002

4 000691 航天科技 5,000 0.000

5 000748 长信信息 6,000 0.002

6 601021 长信航空 2,000 0.002

7 000888 瑞康万山 800 0.000

注：本基金本报告期末尚未持有上述七只股票。

6.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600271 新天燃气 15,000 0.018

2 002290 航天机电 26,700 0.035

3 300104 乐视网 5,000 0.002

4 000691 航天科技 5,000 0.000

5 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

6 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

7 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

8 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

9 其他 - -

10 合计 489,539,269.57 90.05

注：按照基金合同规定，本基金合同约定的持有期限为6个月，因此本基金的投资者在持有期限内不能赎回。

6.6 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号 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 1,576,996.00 0.22

D 电力、热力、煤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 92,840.00 0.02

H 住宿和餐饮业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 232,060.00 0.06

J 银行业 - -

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、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 - -

T 交通运输、仓储和邮政业 - -

注：本基金本报告期末尚未持有上述行业分类的股票。

6.7 报告期末按行业分类的境外股票投资组合

序号 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、煤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 银行业 - -

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、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 - -

T 交通运输、仓储和邮政业 - -

注：本基金本报告期末尚未持有上述行业分类的股票。

6.8 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 600271 新天燃气 15,000 0.018

2 002290 航天机电 26,700 0.035

3 300104 乐视网 5,000 0.002

4 000691 航天科技 5,000 0.000

5 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

6 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

7 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

8 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

9 其他 - -

10 合计 489,539,269.57 90.05

注：按照基金合同规定，本基金合同约定的持有期限为6个月，因此本基金的投资者在持有期限内不能赎回。

6.9 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债券投资

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 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

2 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

3 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

4 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

5 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

6 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

7 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

8 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

9 其他 - -

10 合计 489,539,269.57 90.05

注：按照基金合同规定，本基金合同约定的持有期限为6个月，因此本基金的投资者在持有期限内不能赎回。

6.10 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

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 600271 新天燃气 15,000 0.018

2 002290 航天机电 26,700 0.035

3 300104 乐视网 5,000 0.002

4 000691 航天科技 5,000 0.000

5 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

6 110289 11中行MTN1 30,000 0.044

7 110289 1