

长盛纯债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监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。

基金经理王莹对本基金合同规定,于2016年4月21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。

本报告书除基金费用未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

货币市场方面,受央行运用多种流动性调节工具释放流动性及降准等宽松货币政策影响,市场流动性整体保持相对宽松局面,各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率维持在较低水平。

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信用债,保持组合流动性和参与利率品种的投资机会,提升组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,长盛纯债债券A的基金份额净值为1.228元,本报告期份额净值增长率为10.7%,同期业绩比较基准增长率为6.31%。

截至报告期末,长盛纯债债券C的基金份额净值为1.216元,本报告期份额净值增长率为0.91%,同期业绩比较基准增长率为0.31%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额净值预警说明

本基金本报告期无基金份额净值预警说明。

§ 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	权证投资	-	-
2	基金投资	-	-
3	定期存款投资	291,904,400.00	89.80
4	货币市场基金	280,352,300.00	80.71
5	其他投资	3,562,000.00	1.00
6	货币市场基金	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	银行存款	7,013,340.72	2.16
9	其他资产	26,143,085.00	8.04
10	合计	326,000,824.52	100.00

6.2 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。

6.3 报告期末按行业分类的沪港通股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

6.4 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	36,386,080.00	15.34
2	企业债券	-	-
3	金融债券	121,093,000.00	52.91
4	政策性金融债	121,093,000.00	52.91
5	企业债券	60,950,514.60	26.41
6	企业短期融资券	70,210,000.00	30.47
7	可转换债券(含分离交易可转债)	-	-
8	中小企业私募债	-	-
9	资产支持证券	-	-
10	合计	280,352,000.00	126.13

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五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

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组合

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

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十名贵金属投资组合

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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十名保险投资组合

注:本基金本报告期末未持有保险投资。

5.9 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股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.10 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债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.11 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组合

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.12 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贵金属投资组合

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.13 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保险投资组合

注:本基金本报告期末未持有保险投资。

5.14 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组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.15 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组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.16 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组合

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.17 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贵金属投资组合

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.18 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保险投资组合

注:本基金本报告期末未持有保险投资。

5.19 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组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.20 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组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.21 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组合

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.22 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贵金属投资组合

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.23 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保险投资组合

注:本基金本报告期末未持有保险投资。

5.24 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组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.25 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组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.26 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组合

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.27 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贵金属投资组合

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.28 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保险投资组合

注:本基金本报告期末未持有保险投资。

5.29 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组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.30 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组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.31 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组合

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.32 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贵金属投资组合

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.33 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保险投资组合

注:本基金本报告期末未持有保险投资。

5.34 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组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.35 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组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.36 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组合

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.37 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贵金属投资组合

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.38 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保险投资组合

注:本基金本报告期末未持有保险投资。

5.39 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组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.40 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组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.41 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组合

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.42 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贵金属投资组合

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.43 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保险投资组合

注:本基金本报告期末未持有保险投资。

5.44 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组合

注:本基金本报告期末未持有股票投资。

5.45 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组合

注:本基金本报告期末未持有债券投资。

5.46 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组合

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券投资。

5.47 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贵金属投资组合

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.48 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保险投资组合

注:本基金本报告期末未持有保险投资。

5.49 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组合