长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金

【2017】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:2017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2017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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛盛琪一年债券
基金主代码	003199
交易代码	003199
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月27日
报告期末基金份额总额	2,204,781,151.29份
投资目标	本基金在控制风险和保持资产流动性的基础上,积极主动调整投资组合,追求基金资产的长期稳定增值,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 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。 (二)债券组合管理策略 1、利率策略 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。 2、类属配置策略 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。 3、信用策略 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,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	中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	长盛盛琪一年债券A	长盛盛琪一年债券C
下属分级基金的交易代码	003199	003200
报告期末下属分级基金的份额总额	2,180,279,164.85份	24,501,966.44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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	长盛盛琪一年债券A	长盛盛琪一年债券C
1. 本期已实现收益	10,820,246.87	103,519.66
2. 本期利润	9,968,110.52	93,964.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0046	0.0038
4. 期末基金资产净值	2,165,415,816.59	24,298,027.98
5. 期末基金份额净值	0.9932	0.9917

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2017年03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

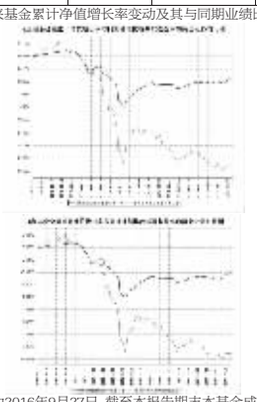
长盛盛琪一年债券A

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	0.47%	0.03%	-1.24%	0.07%	1.71%	-0.04%

长盛盛琪一年债券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	0.39%	0.03%	-1.24%	0.07%	1.63%	-0.04%

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:1、本基金合同生效日为2016年9月27日,截至本报告期末本基金成立未满一年。

2、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。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十三部分(二)投资范围、(四)投资限制的有关约定。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,长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理,长盛盛鹏新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛盛鹏灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016年9月27日	-	11年	李琪先生,1976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。

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

回顾一季度,国内经济相对平稳,工业企业利润同比有所改善。通胀方面,食品价格稳中有落,中上游涨价推动PPI同比继续上行,但工业品供给改善导致价格逐步趋弱。受汇率、资产价格以及金融监管去杠杆等因素制约,货币政策更趋于稳健,一季度央行两次上调公开市场操作利率,资金面总体呈现中性偏紧局面。

在海内外经济和政策等多重因素影响下,债券市场延续了去年四季度以来的调整走势,收益率曲线整体上行,10年期国开债一度上行至4.2%以上;3月中下旬以来,受美国加息落地、短期市场情绪回暖、地产调控加码、通胀预期回落等因素影响,现券利率有所下行,债市出现一波交易行情。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金总体上坚持稳健、审慎操作,主要布局短久期、中高等级债券资产,尽量规避利率风险和信用风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,长盛盛琪一年期定期开放债券型基金A的基金份额净值为0.9932元,本报告期份额净值增长率为0.47%,同期业绩比较基准增长率为-1.24%。

截止报告期末,长盛盛琪一年期定期开放债券型基金C的基金份额净值为0.9917元,本报告期份额净值增长率为0.39%,同期业绩比较基准增长率为-1.24%。

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	2,633,707,599.32	97.97
	其中:债券	2,633,707,599.32	97.97
	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	13,425,085.11	0.50
8	其他资产	41,023,062.75	1.53
9	合计	2,688,155,747.18	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。

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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。

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	58,737,513.00	2.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	43,184,492.00	1.97
	其中:政策性金融债	43,184,492.00	1.97
4	企业债券	623,108,594.32	28.46
5	企业短期融资券	1,300,135,000.00	59.37
6	中期票据	224,359,000.00	10.25
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	384,183,000.00	17.54
9	其他	-	-
10	合计	2,633,707,599.32	120.28

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	011698782	16海沧投资SCP003	1,000,000	100,080,000.00	4.57
2	011641005	16胶州SCP005	1,000,000	99,910,000.00	4.56
3	111711018	17平安银行CD018	1,000,000	99,010,000.00	4.52
4	111698404	16上海农商银行CD056	1,000,000	98,490,000.00	4.50
5	111698691	16中原银行CD130	1,000,000	98,320,000.00	4.49

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注: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

注: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

注:本基金本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	157,903.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,865,159.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,023,062.75

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处于转股期的可转换债券。

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。

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	长盛盛琪一年债券A	长盛盛琪一年债券C
报告期期初基金份额总额	2,180,279,164.85	24,501,966.44
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	2,180,279,164.85	24,501,966.44

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛盛琪一年期定期开放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。

8.2 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。

8.3 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
2017年4月22日

长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金

【2017】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:包商银行股份有限公司
报告送出日期:2017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。

基金托管人包商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3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	
交易代码	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	733,733,207.28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,前瞻性捕捉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追求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 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。本基金将通过深入分析上述指标与因素,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。 (二)股票投资策略 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,结合市场供给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。 1.行业配置策略 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。 2.个股配置策略 在行业配置的基础上,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。 3.动态调整和组合优化策略 本基金管理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	包商银行股份有限公司	
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	8,970,431.09份	724,762,776.19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(2017年1月1日 - 2017年3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	95,167.64	5,940,399.58
2. 本期利润	228,634.28	15,774,926.33
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0238	0.0209
4. 期末基金资产净值	9,821,644.01	754,611,181.62
5. 期末基金份额净值	1.095	1.041

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2017年03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	2.24%	0.09%	2.13%	0.26%	0.11%	-0.17%

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	2.06%	0.09%	2.13%	0.26%	-0.07%	-0.17%

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

§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、长盛盛世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、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛鹏灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛展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、长盛盛璟灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛淳灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理。	2015年12月11日	2017年2月28日	11年	杨衡先生,1976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。
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、长盛盛辉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、长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2016年9月12日	-	11年	李琪先生,1976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。
冯雨杰	本基金基金经理,长盛中证100指数证券投资基金基金经理,长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)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、长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛中证金融证券公司指数分级证券投资基金基金经理、长盛盛鑫基金基金经理、长盛信息产业混合型证券投资基金基金经理、长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理、长盛同瑞行业配置混合型证券投资基金基金经理,量化投资部负责人。	2016年9月12日	-	9年	冯雨先生,1983年11月出生。毕业于光华管理学院金融系,北京大学经济学硕士,CFA(特许金融分析师)。2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程研究员,同盛基金经理助理等职务。

注:1、长盛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

回顾一季度,国内经济相对平稳,工业企业利润同比有所改善。通胀方面,食品价格稳中有落,中上游涨价推动PPI同比继续上行,但工业品供给改善导致价格逐步趋弱。受汇率、资产价格以及金融监管去杠杆等因素制约,货币政策更趋于稳健,一季度央行两次上调公开市场操作利率,资金面总体呈现中性偏紧局面。

在海内外经济和政策等多重因素影响下,债券市场延续了去年四季度以来的调整走势,收益率曲线整体上行,10年期国开债一度上行至4.21%的近期高点;3月中下旬以来,受美国加息落地、短期市场情绪回暖、地产调控加码、通胀预期回落等因素影响,现券利率有所下行,债市出现一波交易行情。

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,适度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

截止报告期末,长盛盛裕纯债A的基金份额净值为0.9770元,本报告期份额净值增长率为-0.30%,同期业绩比较基准增长率为0.07%。

截止报告期末,长盛盛裕纯债C的基金份额净值为0.9786元,本报告期份额净值增长率为-0.35%,同期业绩比较基准增长率为0.07%。

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	1,622,384,440.00	91.14
	其中:债券	1,622,384,440.00	91.14
	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	2,000,000.00	0.11
	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	125,817,484.76	7.07
8	其他资产	29,943,157.34	1.68
9	合计	1,780,145,082.10	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沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	172,862,000.00	11.82
	其中:政策性金融债	172,862,000.00	11.82
4	企业债券	436,101,440.00	29.81
5	企业短期融资券	49,856,000.00	3.41
6	中期票据	516,738,000.00	35.33
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	446,828,000.00	30.55
9	其他	-	-
10	合计	1,622,384,440.00	110.91

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	111713015	17浙商银行CD015	1,400,000	138,446,000.00	9.46
2	136085	15金茂投	1,300,000	127,556,000.00	8.72
3	111610479	16兴业CD479	1,200,000	115,932,000.00	7.93
4	111698883	16徽商银行CD099	1,000,000	96,230,000.00	6.58
5	111607231	16招行CD231	1,000,000	96,220,000.00	6.58
6	111610479	16兴业CD479	1,000,000	96,220,000.00	6.58
7	111698404	16上海农商银行CD056	1,000,000	96,210,000.00	6.58
8	111610479	16兴业CD479	1,000,000	96,210,000.00	6.58
9	111698404	16上海农商银行CD056	1,000,000	96,210,000.00	6.58
10	111610479	16兴业CD479	1,000,000	96,210,000.00	6.58

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国债期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

注:报告期末未持有沪港通投资股票投资组合。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	124,436,232.16
	其中:股票	124,436,232.16
2	基金投资	-
3	固定收益投资	577,794,385.70
	其中:债券	577,794,385.70
	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	48,800,000.00
	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	10,794,716.45
8	其他资产	11,739,915.41
9	合计	773,565,249.72

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	1,148,000.00	0.15
C	制造业	65,755,021.63	8.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,846,500.00	0.76
E	建筑业	8,336,309.46	1.09
F	批发和零售业	4,113,660.00	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	3,264,279.00	0.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,350,011.65	0.44
J	金融业	24,903,590.42	3.26
K	房地产业	4,762,140.00	0.62
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	779,200.00	0.10
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	2,177,520.00	0.28
	合计	124,436,232.16	16.28

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:报告期末未持有沪港通投资股票投资组合。

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	601988	中国银行	1,362,800	5,042,360.00	0.66
2	601398	工商银行	931,900	4,510,396.00	0.59
3	000963	华东医药	44,400	4,113,660.00	0.54
4	600886	国投电力	500,000	3,765,000.00	0.49
5	300258	精锻科技	212,129	3,638,012.35	0.48
6	600690	青岛海尔	297,700	3,625,986.00	0.47
7	000001	平安银行	391,240	3,587,670.80	0.47
8	601939	建设银行	596,000	3,540,240.00	0.46
9	002035	华帝股份	99,467	3,320,208.46	0.43
10	600741	华域汽车	181,900	3,312,398.00	0.43

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	39,934,000.00	5.22
	其中:政策性金融债	39,934,000.00	5.22
4	企业债券	35,666,770.70	4.67
5	企业短期融资券	499,183,000.00	65.30
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	3,010,615.00	0.39
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	577,794,385.70	75.58

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