长安货币市场证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:长安基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:2017年04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。
基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20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	长安货币
基金主代码	740601
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年01月25日
报告期末基金份额总额	1,670,281,190.72份
投资目标	在保持基金资产的安全性和流动性的前提下,通过主动式管理,力求获得超过基金业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	1.整体配置策略 通过全面研究经济运行状况,预测货币政策、财政政策等政府宏观经济政策取向,分析资本市场资金供给状况的变动趋势,形成对市场利率水平变动趋势的判断。在此基础上,根据各类别资产的流动性、收益性和信用水平,决定各类资产的配置比例和期限匹配量。 2.久期策略 组合久期是反映利率风险的重要指标,在对市场利率水平变化趋势预测的前提下,制定组合的目标久期。预测利率将进入下降通道时,基金管理人将通过提高组合的久期,以最大程度获取债券价格上升带来的资本利得;预测市场利率将进入上升通道时,本基金将缩短组合久期,降低债券收益率上升带来的风险,并增加再投资收益。 3.个券选择策略 本基金将优先考虑安全性因素,选择高信用等级的债券品种进行投资。在个券选择上,本基金将在整体配置策略和久期策略的基础上,对影响个别债券定价的主要因素,包括信用等级、流动性、市场供求、票息及付息频率、税赋等因素进行分析,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。 4.套利策略 套利策略主要包括两方面:(1)跨市场套利。由于其中的投资群体、交易方式等市场要素不同,使得交易所市场和银行间市场的资金面、短期利率期限结构、流动性都存在着一定的差别。本基金将在充分论证套利机会可行性的基础上,寻找合理的介入时机,进行跨市场套利操作。(2)跨品种套利。由于投资群体存在一定的差异性,对期限相近的交易品种同样可能因为存在流动性、税收等市场因素的影响出现内在价值明显偏离的情况。本基金将在保证高流动性的基础上进行跨品种套利操作,以增加超额收益。 5.息差策略 息差策略是指利用市场回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。市场回购利率往往低于相对较长期限债券的收益率,为息差交易提供了机会。本基金将在考虑市场回购资金利率与债券收益率之间的关系,选择适当的杠杆比率,谨慎实施息差策略,以提高投资组合收益水平。 6.现金流管理策略 本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测,通过回购的滚动操作和银行存款、债券品种的期限结构搭配,动态调整基金的现金流,在保持充分流动性的基础上争取较高收益。
业绩比较基准	7天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
基金管理人	长安基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	长安货币A / 长安货币B
下属分级基金的交易代码	740601 / 740602
报告期末下属分级基金的份额总额	56,659,269.98份 / 1,613,628,920.74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

基金简称	报告期(2017年01月01日-2017年03月31日)	
	长安货币A	长安货币B
1.本期已实现收益	526,038.99	14,653,693.88
2.本期利润	526,038.99	14,653,693.88
3.期末基金资产净值	56,659,269.98	1,613,628,920.74

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、长安货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.8525%	0.0027%	0.3375%	0.0000%	0.5150%	0.0027%

注:本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)

2、长安货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9120%	0.0027%	0.3375%	0.0000%	0.5745%	0.0027%

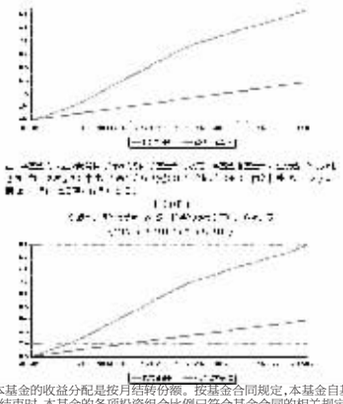
注:本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长安货币A

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年01月25日-2017年03月31日)



注:本基金的收益分配是按月结转份额。按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月为建仓期,截止到建仓期结束时,本基金的各项投资组合比例已符合基金合同的相关规定。图示日期为2013年1月25日至2017年3月31日。

§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		
乔哲	本基金的基金经理	2013年02月01日	-	20年	山东大学工商管理硕士学位,曾任中国农业发展银行山东省分行资金计划处资金科科长、中国农业发展银行总行资金计划部债券发行与资金交易负责人、东亚银行(中国)有限公司资金中心高级助理经理、法国巴黎银行(中国)有限公司固定收益部债券资本市场主管等职,2012年8月加入长安基金管理有限公司,现任长安基金管理有限公司联席投资总监、长安货币市场证券投资基金的基金、长安鑫益增强混合型证券投资基金、长安泓泽纯债债券型证券投资基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、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、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真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

本基金管理人树立价值投资理念,设置合理的组织架构和科学的投资决策体系,确保投资、研究、交易各个环节的独立性。同时,建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库,共享研究成果,在确保投资组合间的信息隔离与保密的情况下,保证建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度,并在交易系统中采用公平交易模块,保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节,并经过严格的报告和审批程序,防范和控制异常交易。

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长安基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年一季度,宏观经济有企稳迹象,部分数据有超预期的情况,CPI涨幅较缓,本币汇率稳定。但期间金融市场仍发生较大的动荡。主要体现在:春节前期和季度末货币市场流动性仍较紧张,在监管趋严情况下市场有所反应,债市持续动荡,权益类市场也有震荡,同时美联储加息的影响也继续传导至我国市场。根据宏观经济和货币政策发展趋势,以及金融市场流动性、市场风险、信用风险发生的变化,本基金在审慎控制风险的前提下,积极进行流动性管理和投资类别调整,把风险控制和流动性管理放在首位,及时调整各项资产配置比例,充分发挥了货币基金的避险和现金管理功能,较好地实现了基金资产安全性、流动性、收益性的平衡,保证了基金持有人的利益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金A类和B类分别上涨0.8525%和0.9120%,同期本基金的业绩比较基准上涨0.3375%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金无连续二十个工作日出现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情形。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下个季度,我们将密切观察宏观经济增长力度和货币政策执行情况,继续关注影响金融市场流动性和货币市场、债券市场的关键因素,以及其他资本市场的变化所带来的影响,审慎、积极地管理组合流动性和市场风险、信用风险,继续保持基金资产安全性、流动性、收益性的平衡,保障基金良好运营和投资者的利益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

姓名	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	210,025,720.73	12.52
	其中:债券	210,025,720.73	12.52
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	626,912,420.37	37.37
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	750,028,767.28	44.71
4	其他资产	90,487,281.68	5.39
5	合计	1,677,454,190.06	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.43	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	18
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	45
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	74.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	20.84	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		95.02	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余期限超过240天情况说明

注:报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	210,025,720.73	12.57
	其中:政策性金融债	210,025,720.73	12.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160211	16国开11	2,100,000	210,025,720.73	12.57

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0041%
报告期内偏离度的最低值	-0.029%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.01%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内负偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明。

本基金计价采用摊余成本法,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额资产净值保持在人民币1.00元。

5.9.2 本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体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。

5.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,376,399.68
4	应收申购款	81,110,882.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	90,487,281.68

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	长安货币A	长安货币B
报告期期初基金份额总额	50,287,045.81	1,393,871,049.05
报告期基金总申购份额	67,227,044.25	1,032,247,193.67
减:报告期基金总赎回份额	60,864,820.08	812,489,321.98
报告期期末基金份额总额	56,659,269.98	1,613,628,920.74

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2017年01月25日	385.00	385.00	-
2	赎回	2017年02月17日	1,200.00	1,200.00	-
3	赎回	2017年03月22日	25,000,000.00	25,000,000.00	-
4	赎回	2017年03月30日	25,000,000.00	25,000,000.00	-

基金管理人通过直销柜台申购和赎回本基金,申购费和赎回费按照合同约定为0。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,基金管理人根据《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定,在《中国证券报》及管理人网站进行了如下信息披露:

1、2017年1月21日,长安货币市场证券投资基金2016年第4季度报告;

2、2017年1月26日,关于长安货币市场证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告、长安货币市场证券投资基金基金合同更新(20170126)、长安货币市场证券投资基金托管协议更新(20170126);

3、2017年3月18日,关于旗下基金在金观诚、一路财富和晟视天下开通申购、赎回和定投业务并参与费率优惠活动的公告;

4、2017年3月23日,关于旗下基金在奕丰金融服务(深圳)有限公司开通申购、赎回、定投和基金转换业务并参与费率优惠活动的公告;

5、2017年3月28日,长安货币市场证券投资基金2016年年度报告及摘要;

6、2017年3月29日,关于开展长安货币市场证券投资基金A类网上直销基金转换费率优惠的公告。

§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、长安货币市场证券投资基金基金合同;

3、长安货币市场证券投资基金托管协议;

4、长安货币市场证券投资基金招募说明书;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人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。

投资者对本报告如有疑问,可咨询本管理人。

咨询电话:400-820-9688

公司网址:www.changanfunds.com。

长安基金管理有限公司
二〇一七年四月二十二日

长盛创新先锋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: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	长盛创新先锋混合
基金主代码	080002
交易代码	080002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月4日
报告期末基金份额总额	141,457,876.17份
投资目标	选择具有创新能力和行业领先的上市公司,分享企业高速增长成果,在承担适度风险的基础上,追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金为混合型证券投资基金,在资产配置上会考虑宏观经济因素、政策因素及市场估值水平。在个股选择上将根据不同行业景气度、"长盛创新选股体系"和"长盛优势选股体系"的股票筛选原则和方法优化个股投资比重。
业绩比较基准	沪深300指数×65%+上证国债指数×35%
风险收益特征	本基金强调精选投资价值较大的创新领先企业,突出资产配置的灵活性和主动性,风险收益略低于股票型基金,高于债券型基金和平衡型基金。
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

§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)
1.本期已实现收益	2,317,371.72
2.本期利润	309,753.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0021
4.期末基金资产净值	129,853,024.35
5.期末基金份额净值	0.9180

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3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

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	0.20%	0.82%	2.95%	0.34%	-2.75%	0.48%

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:按照基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6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十四条(二)投资范围、(七)投资禁止行为与限制的有关约定。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		
赵宏宇	本基金基金经理,长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理,长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理,长盛上证50指数分级证券投资基金基金经理,长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金经理,FOF业务部总监。	2015年9月24日	-	9年	赵宏宇先生,1972年6月出生。四川大学工商管理学院管理学(金融投资研究方向)博士。历任美国晨星公司投资顾问部门数量分析师,积商银行博士后工作站博士后研究员。2007年8月加入长盛基金管理公司,历任金融工程研究员、产品开发经理、首席产品开发师、金融工程与量化投资部副总监、长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接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。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投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

本基金为创新主题基金,投资目标主要是收益于技术创新驱动业绩增长的相关龙头行业及公司,基本反映其技术创新驱动行业及公司业绩增长的主题投资收益和风险特征。

2017年一季度市场经过了震荡调整后,监筹股票市场逐步恢复,尽管创新驱动型行业及公司基本面仍稳步增长,但整体市场震荡的情况下,特别是创新板块中的信息技术、医药医疗以及其它技术创新板块同时出现较大向下波动,对本基金净值增长带来一定的负面影响。

本基金在基金合同允许的主题投资范围内,最大程度投资并跟踪分享技术创新主题相关股票增长的红利。在报告期内操作中,基金管理人严格遵守基金合同,按照主题投资所定义的范围内精选个股,并进行灵活配置创新行业,尽而实现基金投资的目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为0.9180元,本报告期份额净值增长率为0.20%,同期业绩比较基准增长率为2.95%。

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	99,176,600.23	76.06
	其中:股票	99,176,600.23	76.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,313,600.00	18.65
	其中:债券	24,313,600.00	18.65
	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	6,679,598.94	5.12
8	其他资产	229,840.20	0.18
9	合计	130,399,639.37	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	28,226.70	0.02
C	制造业	40,872,878.33	31.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,537,528.38	5.80
F	批发和零售业	4,620,560.83	3.56
G	交通运输、仓储和邮政业	1,058,400.00	0.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,826,790.26	24.51
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,545,800.00	3.50
L	租赁和商务服务业	29,334.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	2,788,646.54	2.15
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	1,436,226.00	1.11
R	文化、体育和娱乐业	4,432,209.19	3.41
S	综合	-	-
	合计	99,176,600.23	76.38

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

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	300017	网宿科技	80,159	3,246,439.50	2.50
2	002055	得润电子	148,300	3,231,457.00	2.49
3	002456	欧菲光	80,747	3,057,081.42	2.35
4	300383	光环新网	122,800	2,953,340.00	2.27
5	603888	新华网	35,000	2,936,850.00	2.26
6	300182	捷成股份	300,000	2,922,000.00	2.25
7	000963	华东医药	30,000	2,779,500.00	2.14
8	300493	润欣科技	65,000	2,727,400.00	2.10
9	000938	紫光股份	47,768	2,717,521.52	2.09
10	600721	百花村	150,000	2,595,000.00	2.00

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	24,313,600.00	18.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,313,600.00	18.72

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	010107	21国债(7)	80,000	8,317,600.00	6.41
2	010213	02国债(13)	80,000	8,002,400.00	6.16
3	010303	03国债(3)	80,000	7,993,600.00	6.16

注:本基金本报告期末仅持有上述3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	13,451.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	188,245.58
5	应收申购款	28,143.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	229,840.20

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

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	000938	紫光股份	2,717,521.52	2.09	重大事项停牌

5.11.6 报告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

报告期期初基金份额总额	146,754,020.30
报告期期间基金总申购份额	5,921,028.48
减:报告期期间基金总赎回份额	11,217,172.61
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	141,457,876.17

§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、《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛创新先锋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。

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

长盛纯债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	长盛纯债债券
基金主代码	000050
交易代码	000050
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年3月13日
报告期末基金份额总额	57,959,255.37份
投资目标	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	在债券类属资产配置上以相对收益率较高的信用债为主,灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等多种策略积极把握市场投资机会,获取各类超额投资收益。此外,通过债券回购等工具适度匹配组合资产的流动性和杠杆性,提高资金使用效率。
业绩比较基准	中债综合