长盛积极配置债券型证券投资基金

2017年第四季度报告

2017年 12 月 31 日
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:2018 年 1 月 20 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 1 月 19 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛积极配置债券
基金主代码	080003
交易代码	080003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月8日
报告期末基金份额总额	462,152,723.77 份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,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	本基金为积极投资策略的债券型基金,不同于传统债券型基金的投资策略特点,本基金在债券类资产配置上更强调积极主动管理。在债券类资产配置上,本基金通过积极投资配置相对收益率较高的企业债、公司债、可转换债、可分离交易可转债、资产支持证券等创新债券品种,并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策略积极把握固定收益证券市场中投资机会,以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上,通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票,来获取股票市场的积极收益。此外,本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。
业绩比较基准	中证全债指数收益率× 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,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,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	中国建设银行股份有限公司

§ 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 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	9,169,273.98
2.本期利润	4,077,009.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0088
4.期末基金资产净值	502,125,166.67
5.期末基金份额净值	1.0865

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 12 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	0.82%	0.12%	- 0.12%	0.10%	0.94%	0.02%

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:按照本基金的基金合同规定,本基金基金管理人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本基金合同的约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十二条"(二)投资范围"、"(六)投资限制"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		
马文祥	本基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛可转债债券型证券投资基金基金经理,固定收益部副总监。	2016年1月20日	-	14年	马文祥先生,1977 年 7 月出生。清华大学经济管理学院经济学硕士。历任中国农业银行主任科员、工银瑞信金业年金基金经理、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013 年 8 月加入长盛基金管理有限公司。
冯雨生	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、长盛中证金指证券公司指数分级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、长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理、长盛信息安全主题量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛同德主题增长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	-	10年	冯雨生先生,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,同鑫基金经理助理等职务。

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。

公司对报告期内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

上季度宏观经济基本面持续稳中趋缓态势,资产投资、消费、工业生产等主要经济指标小幅回落,价格水平有所回升但仍在可控范围之内;供给侧改革及环保限产持续推进,在企业盈利修复持续的预期下,工业生产基本平稳。受资产价格、金融监管去杠杆等因素制约,货币政策保持稳健中性,资金面总体维持中性偏紧局面。

债券收益率震荡走高,收益率曲线平坦化上移。10-11 月在基本面、资金面和监管政策落地等因素综合影响下,债市收益率突破今年 4-5 月前期高点,持续大幅度调整。12 月以来,在央行释放稳定流动性预期信号,实体经济稳中稍弱等因素作用下,债券市场下跌趋缓,收益率整体维持高位震荡。信用债跟随利率债大幅调整,信用利差走阔。

同时期内,A 股市场呈现先涨后跌行情,上证综指小幅下跌 1.25%,沪深 300 指数上涨 5.07%,创业板指下跌 6.12%。市场延续年初以来的结构性行情,白马股、消费股、绩优蓝筹股显著跑赢市场,家电、食品饮料、保险等板块有不错的表现。

由于 10 月以后来转债发行大幅提速,叠加股市出现调整,二级市场存量转债估值压缩明显;但随着市场的逐步扩容,存量券及待发个券中不乏行业龙头及优质标的,预计后续转债市场也有一定的结构性机会。

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,控制组合久期,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。权益资产方面,根据市场风格变化,灵活调整权益资产比重,以避免净值大幅波动;精选具备估值优势和业绩成长潜力的股票和可转债,择机进行波段操作,提升组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0865 元;本报告期基金份额净值增长率为 0.82%,业绩比较基准收益率为 -0.12%。

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	72,493,609.91	14.38
	其中:股票	72,493,609.91	14.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	410,026,594.56	81.33
	其中:债券	410,026,594.56	81.33
	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	10,300,000.00	2.04
	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	4,949,616.76	0.98
8	其他资产	6,393,625.07	1.27
9	合计	504,163,446.30	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	25,160,075.51	5.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,824,030.00	0.36
E	建筑业	3,169,628.00	0.63
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,407,984.00	0.68
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	25,376,434.40	5.05
K	房地产业	10,126,437.00	2.02
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	3,429,021.00	0.68
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	72,493,609.91	14.44

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	601318	中国平安	76,600	5,360,468.00	1.07
2	000651	格力电器	98,200	4,291,340.00	0.85
3	000002	万 科 A	104,900	3,258,194.00	0.65
4	600036	招商银行	111,100	3,224,122.00	0.64
5	601668	中国建筑	351,400	3,169,628.00	0.63
6	600887	伊利股份	88,600	2,852,034.00	0.57
7	601398	工商银行	453,900	2,814,180.00	0.56
8	000333	美的集团	48,600	2,693,898.00	0.54
9	600048	保利地产	187,100	2,647,465.00	0.53
10	001979	招商蛇口	125,000	2,445,000.00	0.49

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	26,960,300.00	5.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	73,122,000.00	14.56
	其中:政策性金融债	73,122,000.00	14.56
4	企业债券	12,983,560.00	2.59
5	企业短期融资券	240,761,000.00	47.95
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	56,199,734.56	11.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	410,026,594.56	81.66

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	011764063	17京能源 SCP002	400,000	40,160,000.00	8.00
2	011764127	17格力 SCP005	400,000	40,028,000.00	7.97
3	160213	16国开 13	400,000	34,676,000.00	6.91
4	011751029	17宁沪高 SCP001	300,000	30,174,000.00	6.01
5	011758018	17中核建 SCP001	300,000	30,105,000.00	6.00

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

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

本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记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2

基金的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	36,418.80
2	应收证券清算款	19,831.23
3	应收股利	-
4	应收利息	6,333,303.65
5	应收申购款	4,071.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,393,625.07

5.10.4 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	110034	九州转债	11,586,860.00	2.31
2	120001	16以岭 EB	5,222,000.00	1.04
3	110030	格力转债	2,631,500.00	0.52
4	127004	模塑转债	1,974,282.66	0.39
5	110033	国贸转债	380,093.70	0.08
6	113009	广汽转债	214,562.40	0.04
7	113012	骆驼转债	121,056.40	0.02

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:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	463,965,946.28
报告期期间基金总申购份额	1,564,077.42
减:报告期期间基金总赎回份额	3,377,299.93
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	462,152,723.77

§ 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	2017年10月1日至2017年12月31日	135,700,184.23	-	-	135,700,184.23	29.36%
	2	2017年10月1日至2017年12月31日	138,618,658.16	-	-	138,618,658.16	29.99%

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

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016]36 号)、《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》(财税 [2016]46 号)、《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》(财税[2016]70 号)、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税 [2016]140 号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税 [2017]56 号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税[2017]90 号)及《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规、部门规章和规范性文件的规定,自 2018 年 1 月 1 日(含)起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法,按照规定的税费率缴纳增值税及附加税费。

自 2018 年 1 月 1 日(含)起,本公司将对旗下存续及新增产品发生的增值税应税行为按照相关法律法规及税收政策计算和缴纳增值税及相应附加税费;前述税费金额是产品管理、运作和处分过程中发生的,将由产品资产承担,从产品资产中提取缴纳,可能会使相关产品净值或实际收益降低,敬请投资者知悉。

§ 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、《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛积极配置债券型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛积极配置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 1 月 20 日

长盛货币市场基金

2017年第四季度报告

2017年 12 月 31 日
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 1 月 20 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 1 月 19 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛货币
基金主代码	080011
交易代码	080011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年12月12日
报告期末基金份额总额	10,328,973,992.27 份
投资目标	在力争本金安全、保证资产高流动性的基础上,追求高于业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将根据宏观经济、微观经济运行状况,货币政策和财政政策执行情况,以及货币市场、证券市场运行状况制定投资策略。采用积极的投资策略,通过动态调整优化投资组合,追求当期收益最大化。在动态调整过程中,基金管理小组将全面考虑收益目标、交易成本、市场流动性等特征,实现收益与风险的平衡。
业绩比较基准	银行一年定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。
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	长盛货币 A	长盛货币 B
下属分级基金的交易代码	080011	005230
报告期末下属分级基金的份额总额	4,009,098,063.63 份	6,319,875,928.64 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 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日)	
	长盛货币 A	长盛货币 B
1.本期已实现收益	22,265,758.07	42,730,657.48
2. 本期利润	22,265,758.07	42,730,657.48
3. 期末基金资产净值	4,009,098,063.63	6,319,875,928.64

注:1、所列数据截止到 2017 年 12 月 31 日。

2、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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金于 2017 年 10 月 10 日起新增 B 份额,原有基金份额全部转为 A 类基金份额。

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

长盛货币 A

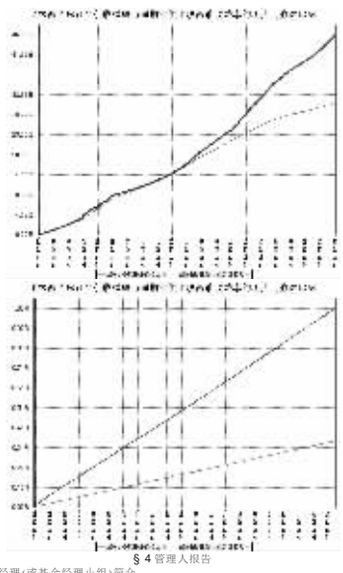
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0604%	0.0006%	0.3781%	0.0000%	0.6823%	0.0006%

长盛货币 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	1.0233%	0.0004%	0.3411%	0.0000%	0.6822%	0.0004%

注:长盛货币 B 级为 2017 年 10 月 10 日新增份额,过去三个月的数据仅为 2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日的数据。

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



§ 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		
乔培涛	本基金基金经理、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理、长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理、长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、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、研究部副总监。	2017 年 10 月 9 日	-	9年	乔培涛先生,1979 年 12 月出生。清华大学硕士。曾任长城证券研究员、行业研究部经理。2011 年 8 月加入长盛基金管理有限公司。
王超	本基金基金经理、长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理、长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)基金经理、长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理、长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理、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、长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、长盛中小盘精选混合型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、长盛同辉深证 100 等权重指数证券投资基金(LOF)基金经理、长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理、长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理、长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理。	2015 年 4 月 27 日	2017 年 10 月 9 日	10年	王超先生,1981 年 9 月出生。中央财经大学经济学硕士,CFA(特许金融分析师),FRM(金融风险管理师)。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。

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。

公司对报告期内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

四季度,经济韧性仍较强,表现在:投资、消费、工业生产等主要经济指标大体平稳,通胀预期有所抬头;与此同时,金融监管去杠杆持续推进,货币政策保持稳健中性,资金面总体中性偏紧。

债券收益率整体上行幅度较大,收益率曲线平坦化。10 月下旬至 11 月在基本面和监管政策等因素综合影响下,中长端债券收益率突破前期高点,持续大幅度调整。12 月,市场表现有所分化,中长端波动幅度不大,收益率整体维持高位震荡,但受跨年等因素影响,短端大幅波动,收益率显著上升。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金始终控制资产配置节奏,保持组合流动性,确保年末流动性安全,同时优化组合结构,合理调整协存、存单和债券配置比例,努力提高组合整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期长盛货币 A 的基金份额净值收益率为 1.0604%,同期业绩比较基准收益率为 0.3781%,本报告期长盛货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0233%,同期业绩比较基准收益率为 0.3411%。(长盛货币 B 的本报告期自 2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日)

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	固定收益投资	7,269,799,564.79	68.35
	其中:债券	7,269,799,564.79	68.35
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	339,519,349.28	3.19
	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	2,899,605,018.70	27.26
4	其他资产	127,279,763.30	1.20
5	合计	10,636,203,696.07	100.00

注:本报告期内,根据流动性管理的需要,本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的存款。

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	14.38
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	300,575,649.71	2.91
	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基金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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2017年10月11日	22.81	基金规模变动	4
2	2017年10月12日	27.62	基金规模变动	3
3	2017年10月13日	31.88	基金规模变动	2
4	2017年10月16日	27.00	基金规模变动	1

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	52
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	69
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注:报告期内无投资组合平均剩余存续期超过 120 天情况。

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	34.43	2.91
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)- 60 天	29.71	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)- 90 天	28.18	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)- 120 天	0.96	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)- 397 天(含)	8.46	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		101.74	2.91

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注:报告期内无投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	209,223,254.57	2.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	729,743,584.61	7.07
	其中:政策性金融债	729,743,584.61	7.07
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	200,124,083.42	1.94
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	6,130,708,642.19	59.35
8	其他	-	-
9	合计	7,269,799,564.79	70.38
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序的前十名债券投资明细

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	111713085	17浙商银行 CD085	2,500,000	249,148,779.93	2.41
2	170203	17国开 03	2,400,000	239,854,855.26	2.32
3	111709483	17浦发银行 CD483	2,400,000	237,927,214.14	2.30
4	111713076	17浙商银行