

长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资  
基金  
2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 10 月 27 日

## § 1 重要提示

基金管理人长盛基金管理有限公司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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 26 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告会计期自 2017 年 7 月 1 日起至 2017 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	长盛盛杰一年期
基金主代码	004466
交易代码	004466
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 5 月 2 日
报告期末基金份额总额	362,274,064.11 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，前瞻性把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，在严格控制风险的前提下满足投资者实现资本增值的投资需求。
投资策略	<p>本基金将通过宏观、微观经济指标，市场指标，政策因素等，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。</p> <p>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。在行业配置的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的办法，挑选具备较大投资价值的上市公司。</p> <p>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规</p>

	<p>避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向，综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券投资组合。在实际的投资运作中，本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略，获取债券市场的长期稳定收益。</p> <p>本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指债券、国债期货及期权的投资。</p>
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	中国工商银行股份有限公司

### §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7月1日—2017年9月30日）
1. 本期已实现收益	1,766,541.10
2. 本期利润	2,801,406.38
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0077
4. 期末基金资产净值	366,735,153.89
5. 期末基金份额净值	1.0123

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 9 月 30 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。

4、本基金基金合同生效日为 2017 年 5 月 2 日，截至本报告期末本基金成立未满一年。

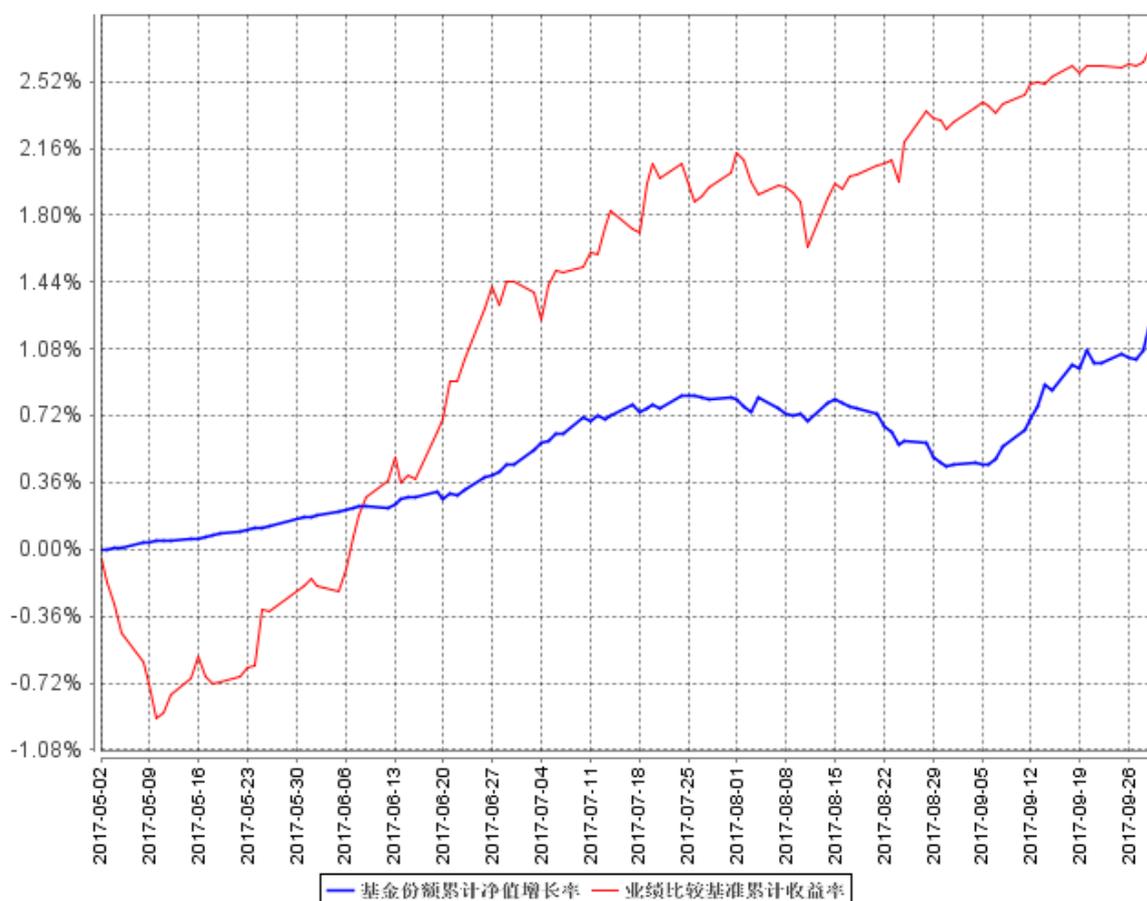
## 3.2 基金净值表现

### 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	0.77%	0.05%	1.24%	0.09%	-0.47%	-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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金合同生效日 2017 年 5 月 2 日，截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，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有关约定。截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0-30%；开放期内每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政

府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。

## §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		
张帆	本基金基金经理，长盛纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛添利宝货币市场基金基金经理，长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同禧债券型证券投资基金基金经理，长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金经理，养老金业务部负责人。	2017年5月2日	-	10年	张帆先生，1983年1月出生。华中科技大学硕士。曾在长江证券股份有限公司从事债券研究、债券投资工作。2012年4月加入长盛基金管理有限公司，曾任非信用研究员，长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理等职务。
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，长盛盛崇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，长盛盛腾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，长盛盛泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛兴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，长盛盛享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛禧灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛德灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛乾灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛泰灵活配	2017年5月2日	-	11年	杨衡先生，1975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有限公司，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。

置混合型证券投资基金基金经理.				
-----------------	--	--	--	--

- 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

回顾三季度，国内经济稳中趋缓，经济韧性仍较强；固定资产投资、房地产投资、民间投资增速比二季度略有回落；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。通胀方面，食品价格稳中有落，中上游价格维持高位，通胀预期略有回升；受资产价格、金融监管去杠杆等因素制约，货币政策更趋于稳健，资金面总体呈现中性偏紧局面。

债券收益率震荡为主，收益率曲线较为平坦，整体略有上行。8月中下旬在资金面偏紧，经济基本面数据强势背景下，债市收益率一度接近今年4-5月前期高点。9月以来，在央行释放稳定流动性预期信号，外汇压力明显缓解，金融去杠杆节奏放缓等因素作用下，市场预期修复，现券利率有所下行，债券收益率曲线整体略有下移。

三季度，A股市场呈现震荡上行行情，新股发行节奏常态化。上证综指涨幅4.90%，沪深300指数上涨4.63%，创业板指上涨2.69%。年中以来，在中上游及周期行业盈利大幅改善背景下，叠加减持限制新规的出台，市场走出持续温和上涨行情，周期股、白马股、消费股、绩优蓝筹股显著跑赢市场，有色、家电、金融、汽车等板块有不错的表现。

##### 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，以高信用资质的中短期信用债和银行同业存单为主要投资标的。在股票底仓配置上，通过量化手段精选个股，构建低波动组合，通过充分分散、优化持仓结构，控制权益下行风险；同时，紧密跟踪新股和可转债、可交换债发行，积极参与申购，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1.0123元；本报告期基金份额净值增长率为0.77%，业绩比较基准收益率为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	17,921,118.00	2.99
	其中：股票	17,921,118.00	2.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	551,975,852.60	92.08
	其中：债券	551,975,852.60	92.08
	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	23,291,997.21	3.89
8	其他资产	6,255,031.06	1.04
9	合计	599,443,998.87	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	17,921,118.00	4.89
D	电力、热力、燃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	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,921,118.00	4.89

### 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	600176	中国巨石	692,000	7,930,320.00	2.16
2	600702	沱牌舍得	100,000	3,909,000.00	1.07
3	600066	宇通客车	150,000	3,690,000.00	1.01
4	300021	大禹节水	334,050	2,391,798.00	0.65

注：本基金本报告期末仅持有上述四只股票。

### 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	14,597,986.30	3.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	26,329,000.00	7.18
	其中：政策性金融债	26,329,000.00	7.18
4	企业债券	183,050,530.80	49.91
5	企业短期融资券	170,431,000.00	46.47
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,800,335.50	0.76
8	同业存单	154,767,000.00	42.20
9	其他	-	-
10	合计	551,975,852.60	150.51

### 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	111714189	17 江苏银行 CD189	400,000	38,652,000.00	10.54
2	011760096	17 大唐新能 SCP004	300,000	30,033,000.00	8.19

3	111781266	17 宁波银行 CD128	300,000	29,334,000.00	8.00
4	136323	16 越交 01	300,000	29,118,000.00	7.94
5	136642	16 国航 01	300,000	29,061,000.00	7.92

## 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

注：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的股票。

**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	21,163.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,233,867.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,255,031.06

**5.11.4 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	110031	航信转债	151,061.00	0.04

**5.11.5 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。

**5.11.6 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	362,274,064.11
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	362,274,064.11

## §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、《长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛杰一年期定期开放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和/或基金托管人的办公地址。

### 8.3 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10月27日