

长盛全债指数增强型债券投资基金 2020 年第 3 季度报告

2020 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 10 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 27 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛全债指数增强债券
基金主代码	510080
交易代码	510080
前端交易代码	510080
后端交易代码	511080
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 10 月 25 日
报告期末基金份额总额	67,195,531.75 份
投资目标	本基金为开放式债券型基金，将运用增强的指数化投资策略，在力求本金安全的基础上，追求基金资产当期收益和超过比较基准的长期稳定增值
投资策略	本基金采用“自上而下”的投资策略对各类资产进行合理配置。通过指数化债券投资策略确保债券资产的长期稳定增值，同时运用一些积极的、低风险的投资策略来提高债券投资组合的收益
业绩比较基准	标普中国全债指数收益率×92%+沪深 300 指数收益率×8%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均风险和预期收益均低于股票型基金
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§ 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（2020年7月1日—2020年9月30日）
1. 本期已实现收益	4,553,116.28
2. 本期利润	2,493,726.03
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0369
4. 期末基金资产净值	88,959,902.20
5. 期末基金份额净值	1.3239

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2020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。

3.2 基金净值表现

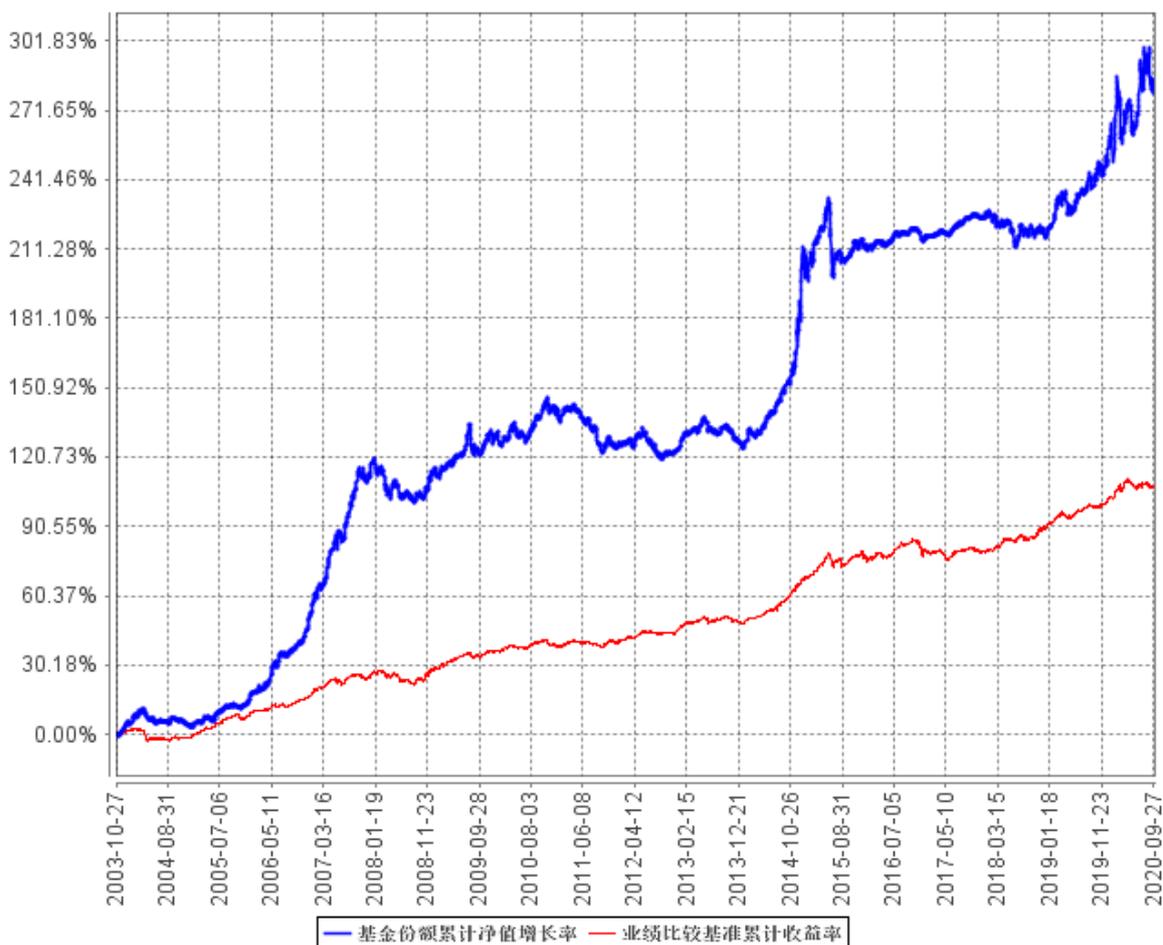
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.79%	0.80%	-0.07%	0.15%	2.86%	0.65%
过去六个月	5.71%	0.66%	0.17%	0.16%	5.54%	0.50%
过去一年	13.31%	0.67%	4.35%	0.15%	8.96%	0.52%
过去三年	17.87%	0.44%	14.68%	0.15%	3.19%	0.29%
过去五年	24.85%	0.36%	19.13%	0.16%	5.72%	0.20%
自基金合同 生效起至今	282.97%	0.37%	107.58%	0.17%	175.39%	0.20%

注：由于标普道琼斯指数有限公司停止计算标普中国 A 股综合指数行情数据，经履行适当程序，自2020年9月14日起，本基金业绩比较基准变更为“标普中国全债指数收益率*92%+沪深300指数收益率*8%”。

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：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。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 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		
杨哲	本基金经理，长盛可转债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛杰混合型证券投资基金基	2018年6月29日	-	10年	杨哲先生硕士。曾任大公国际资信评估有限公司公司信用分析师、信用评审委员会委员。2013年9月加入长盛基金管理有限公司，曾任信

金经理，固定收益部副总监。				用研究员等职务。
---------------	--	--	--	----------

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、私募资产管理计划等。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

报告期内，经济延续修复态势，制造业投资和消费增速边际改善，出口增速也持续超出预期。货币政策维持稳健中性，更重视支持实体经济结构性货币政策，社融规模持续扩张，信贷质量有所改善。

债券市场方面，受经济边际改善、货币政策回归中性、供给增大、股市回暖等因素影响，各期限债券收益率持续上行。

股票市场呈现快速上涨后的振荡盘整走势。从行业看，申万一级行业中，仅通信、贸易、计算机指数为下跌，其余行业指数均实现上涨，其中休闲服务、军工、电气设备、汽车、食品饮料、化工等行业涨幅较大。

可转债方面，中证转债指数整体小幅上涨。7 月和 8 月，转债跟随正股上涨后进入盘整走势；9 月份，股票市场风险偏好下降，转债市场成交清淡，多数转债价格有所回落。

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，实现了一定的收益。在经济延续修复、逆周期调节政策逐步加码和资金面合理充裕局面下，债券资产适度缩短久期；权益资产方面，灵活调整股票和可转债资产仓位，精选配置盈利增长确定、估值水平合理的个股和转债，减持了部分涨幅过高品种以锁定收益；同时，积极参与可转债新券的发行申购，增厚组合收益。

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 1.3239 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.79%，业绩比较基准收益率为-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

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日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的情形。

§ 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	14,249,867.86	11.43
	其中：股票	14,249,867.86	11.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	104,437,142.18	83.80
	其中：债券	104,437,142.18	83.80
	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	4,231,883.04	3.40
8	其他资产	1,712,749.78	1.37
9	合计	124,631,642.86	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	9,740,357.40	10.95
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	1,060,263.00	1.19
J	金融业	1,340,639.46	1.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,601,108.00	1.80
M	科学研究和技术服务业	507,500.00	0.57
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	14,249,867.86	16.02

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	002475	立讯精密	28,000	1,599,640.00	1.80
2	002938	鹏鼎控股	17,000	972,230.00	1.09
3	002271	东方雨虹	17,000	916,300.00	1.03
4	601012	隆基股份	12,200	915,122.00	1.03
5	002027	分众传媒	110,000	887,700.00	1.00
6	000858	五粮液	4,000	884,000.00	0.99
7	600276	恒瑞医药	9,720	873,050.40	0.98
8	000333	美的集团	11,200	813,120.00	0.91
9	601336	新华保险	12,300	763,584.00	0.86
10	601888	中国中免	3,200	713,408.00	0.80

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	20,672,642.10	23.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	42,106,000.00	47.33
	其中：政策性金融债	42,106,000.00	47.33
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）	41,658,500.08	46.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	104,437,142.18	117.40

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	180204	18 国开 04	100,000	10,331,000.00	11.61
2	180210	18 国开 10	100,000	10,200,000.00	11.47
3	190004	19 附息国债 04	100,000	10,097,000.00	11.35
4	180208	18 国开 08	100,000	10,067,000.00	11.32
5	160421	16 农发 21	100,000	10,011,000.00	11.25

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

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

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

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

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

浦发转债：

2019 年 10 月 12 日，银保监罚决字〔2019〕7 号显示，上海浦东发展银行股份有限公司（一）对成都分行授信业务及整改情况严重失察；（二）重大审计发现未向监管部门报告；（三）轮岗制度执行不力，中国银行保险监督管理委员会对其罚款合计 130 万元。2020 年 8 月 10 日，沪银保监银罚决字〔2020〕12 号显示，上海浦东发展银行股份有限公司存在（一）未按专营部门制规定开展同业业务；（二）同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；（三）延迟支付同业投资资金吸收存款；（四）为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；（五）未按规定进行贷款资金支付管理与控制；（六）个人消费贷款贷后管理未尽职；（七）通过票据转贴现业务调节信贷规模；（八）银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；（九）办理无真实贸易背景的贴现业务；（十）委托贷款资金来源审查未尽职；（十一）未按权限和程序办理委托贷款业务；（十二）未按权限和程序办理非融资性保函业务等问题，对其责令改正，并罚款合计 2,100 万元。

对以上事件，本基金判断，浦发银行作为大型股份制银行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，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，无在

报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	310,330.03
2	应收证券清算款	461,740.87
3	应收股利	-
4	应收利息	927,509.63
5	应收申购款	13,169.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,712,749.78

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	127006	敖东转债	3,741,245.90	4.21
2	110059	浦发转债	2,148,510.00	2.42
3	128058	拓邦转债	1,772,664.44	1.99
4	110051	中天转债	1,303,858.00	1.47
5	113550	常汽转债	1,022,162.00	1.15
6	110053	苏银转债	997,740.00	1.12
7	128057	博彦转债	892,897.29	1.00
8	128098	康弘转债	769,740.00	0.87
9	113563	柳药转债	709,860.00	0.80
10	128028	赣锋转债	705,400.00	0.79
11	132018	G 三峡 EB1	581,000.00	0.65
12	110056	亨通转债	441,360.00	0.50
13	127015	希望转债	434,640.00	0.49
14	123017	寒锐转债	376,500.00	0.42
15	113525	台华转债	348,390.00	0.39
16	110061	川投转债	336,074.20	0.38
17	128017	金禾转债	288,500.00	0.32

18	110067	华安转债	284,188.00	0.32
19	113032	桐 20 转债	279,809.70	0.31
20	128019	久立转 2	247,820.00	0.28
21	128102	海大转债	178,627.68	0.20
22	113548	石英转债	140,270.00	0.16

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	68,425,190.21
报告期期间基金总申购份额	4,467,478.42
减：报告期期间基金总赎回份额	5,697,136.88
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	67,195,531.75

§ 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

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

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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
---	----------------	------------

资 者 类 别	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	20200806~20200809; 20200812~20200930	13,501,890.36	0.00	0.00	13,501,890.36	20.09%
个 人	-	-	-	-	-	-	-
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

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、长盛全债指数增强型债券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛全债指数增强型债券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛全债指数增强型债券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛全债指数增强型债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地址和/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、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2020 年 10 月 28 日