

长盛安逸纯债债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 27 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 2021 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。

报告期内，本基金自 2021 年 9 月 2 日起增加 D 类基金份额，并自该日起接受投资者对 D 类基金份额的申购和赎回。D 类基金份额代码：013456，简称：长盛安逸纯债 D。详情参阅本基金管理人于 2021 年 9 月 2 日披露的相关公告。

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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛安逸纯债
基金主代码	007744
交易代码	007744
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 1 月 20 日
报告期末基金份额总额	236,398,054.65 份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
投资策略	<p>（一）大类资产配置策略</p> <p>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。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。</p> <p>（二）债券组合管理策略</p> <p>本基金的债券组合管理策略包含：利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略、资产支持证券等品种投资策略、国债期货投资策略。</p>
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，属证券投资基金中的较低风险品种，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	长盛安逸纯债 A	长盛安逸纯债 C	长盛安逸纯债 D
下属分级基金的交易代码	007744	007745	013456
报告期末下属分级基金的份额总额	234,535,207.63 份	1,862,847.02 份	0.00 份

注：报告期内，本基金自 2021 年 9 月 2 日起增加 D 类基金份额，并自该日起接受投资者对 D 类基金份额的申购和赎回。详情参阅本基金管理人于 2021 年 9 月 2 日披露的相关公告。

§ 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（2021 年 7 月 1 日 — 2021 年 9 月 30 日）		
	长盛安逸纯债 A	长盛安逸纯债 C	长盛安逸纯债 D
1. 本期已实现收益	2,187,790.51	273,389.98	-
2. 本期利润	6,414,729.22	810,704.94	-
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0435	0.0373	-
4. 期末基金资产净值	250,122,766.71	1,971,844.03	-
5. 期末基金份额净值	1.0665	1.0585	1.0665

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 2021 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、本基金自 2021 年 9 月 2 日起增加 D 类基金份额，并自该日起接受投资者对 D 类基金份额的申购和赎回。自 2021 年 9 月 2 日至 2021 年 9 月 30 日期间 D 类基金份额未发生申购业务，D 类基金份额为 0，D 类基金份额净值参考 A 类基金份额净值披露。

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

长盛安逸纯债 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	4.16%	0.07%	0.83%	0.06%	3.33%	0.01%
过去六个月	6.34%	0.07%	1.28%	0.05%	5.06%	0.02%
过去一年	8.44%	0.07%	2.13%	0.04%	6.31%	0.03%
自基金合同生效起至今	6.65%	0.11%	1.25%	0.08%	5.40%	0.03%

长盛安逸纯债 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	3.97%	0.07%	0.83%	0.06%	3.14%	0.01%
过去六个月	5.96%	0.07%	1.28%	0.05%	4.68%	0.02%
过去一年	7.85%	0.07%	2.13%	0.04%	5.72%	0.03%
自基金合同生效起至今	5.85%	0.11%	1.25%	0.08%	4.60%	0.03%

长盛安逸纯债 D

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
自基金新增本类份额起至今	1.36%	0.04%	-0.23%	0.02%	1.59%	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

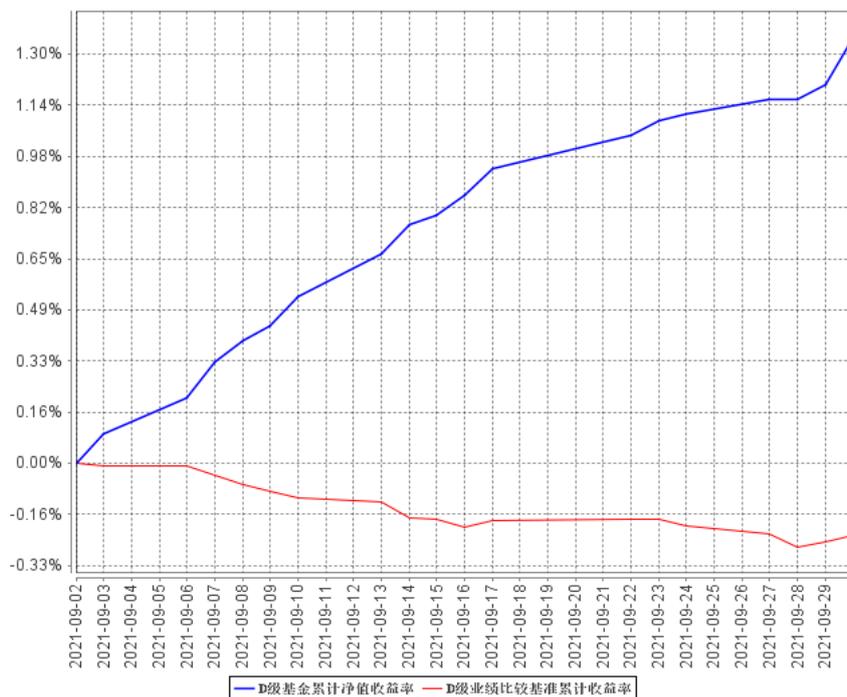
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



D级基金累计净值收益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本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		
王贵君	本基金基金经理，长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理。	2020 年 12 月 17 日	-	9 年	王贵君先生，硕士。曾任中债资信评估有限责任公司评级分析师，上投摩根基金管理有限公司债券研究员，2017 年 6 月加入长盛基金管理有限公司，历任投资经理、专户理财部副总监、基金经理等。

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

注：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、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

2021 年三季度，债市继续上涨，收益率曲线呈现平坦化下行态势。

报告期内，债市走势大致可分为两个阶段：

三季度开始，数据显示国内经济基本面逐渐走弱，7 月初央行超预期降准，资金利率进一步下降，做多情绪被激发，收益率快速下降，在此阶段，市场以交易“衰退”模式为主，前期上涨犹豫的长债品种收益率下降更为明显，期限利差压缩，整条收益率曲线呈现平坦化下行态势。8 月份开始，全球能源和国内工业品价格上涨，PPI 持续攀升，市场通胀预期开始升温，由此引发对“滞涨”风险的担心，前期获利盘逐渐降低仓位，市场收益率缓慢上行。

三季度信用债行业分化剧烈，产业国企收益率趋势性下降，15 号文对城投债估值冲击有限，值得关注的是，三季度开始，地产企业的内外部现金流均出现明显恶化，行业风险增加，恐慌情绪发酵，国内和离岸地产债跌幅都较为明显。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金在操作中严格遵守基金合同要求构建投资组合，根据组合以及市场的情况

在保证流动性的前提下继续优化组合结构，一方面适当参与了利率债的交易性机会，另一方面，面对信用债市场的剧烈波动，组合积极优化信用债持仓结构，在信用债选择上更加偏向行业和区域分析，以求优化组合配置、规避信用风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长盛安逸纯债 A 基金份额净值为 1.0665 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.16%；长盛安逸纯债 C 基金份额净值为 1.0585 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.97%；长盛安逸纯债 A 和长盛安逸纯债 C 同期业绩比较基准收益率为 0.83%。

截至本报告期末，长盛安逸纯债 D 基金份额净值为 1.0665 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.36%，长盛安逸纯债 D 同期业绩比较基准收益率为-0.23%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	305,641,314.90	97.40
	其中：债券	305,641,314.90	97.40
	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	2,107,640.53	0.67
8	其他资产	6,035,690.75	1.92
9	合计	313,784,646.18	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境内股票。

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	14,010,500.00	5.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,703,000.00	1.87
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	107,945,894.90	42.82
5	企业短期融资券	51,103,000.00	20.27
6	中期票据	127,878,920.00	50.73
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	305,641,314.90	121.24

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	012102277	21 电网 SCP019	200,000	20,032,000.00	7.95
2	155656	19 保利 01	150,000	15,066,000.00	5.98
3	019628	20 国债 02	130,000	12,996,100.00	5.16
4	122365	14 昊华 01	105,800	10,636,074.00	4.22
5	102101317	21 河钢集 MTN002	100,000	10,253,000.00	4.07

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

一、14 昊华 01：

2021 年 8 月 31 日，公司收到中国证券监督管理委员会北京监管局《行政处罚及市场禁入事先告知书》，一、对昊华能源给予警告，并处以 60 万元罚款；二、对耿养谋给予警告，并处以 30 万元罚款；三、对关杰给予警告，并处以 20 万元罚款；四、对田会、张伟、于福国给予警告，并分别处以 10 万元罚款。此外，拟决定：对耿养谋、关杰、鲍霞采取 3 年证券市场禁入措施，自我局宣布决定之日起，在禁入期间内，除不得继续在原机构从事证券业务或者担任原上市公司、非上市公众公司董事、监事、高级管理人员职务外，也不得在其他任何机构中从事证券业务或者担任其他上市公司、非上市公众公司董事、监事、高级管理人员职务。后续关注其制度建设与执行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	9,980.23
2	应收证券清算款	1,450,147.11
3	应收股利	-
4	应收利息	4,515,824.51
5	应收申购款	59,738.90
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,035,690.75

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可转换债券（可交换债券）。

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	长盛安逸纯债 A	长盛安逸纯债 C	长盛安逸纯债 D
报告期期初基金份额总额	11,714,713.72	2,060,480.86	-
报告期期间基金总申购份额	225,658,429.94	49,785,003.16	-
减：报告期期间基金总赎回份额	2,837,936.03	49,982,637.00	-
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	234,535,207.63	1,862,847.02	-

§ 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	20210719~20210823	0.00	48,718,698.24	48,718,698.24	0.00	0.00%
	2	20210719~20210930	0.00	48,434,563.60	0.00	48,434,563.60	20.49%
	3	20210719~20210930	0.00	96,870,095.90	0.00	96,870,095.90	40.98%
	4	20210824~20210930	0.00	47,718,075.97	0.00	47,718,075.97	20.19%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

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、长盛安逸纯债债券型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛安逸纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛安逸纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛安逸纯债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的办公地址和/或基金托管人的住所。

9.3 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印件或复印件。

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

2021 年 10 月 27 日