# 长盛货币市场基金

## 2018 第二季度 报告

2018年6月30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7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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7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2018年4月1日起至6月30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 | 2006年12月12日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 6,412,808,617.56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 | 941,708,509.57份 | 5,471,100,107.99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(2018年4月1日 — 2018年6月30日) | |
|---|---|---|
| | 长盛货币A | 长盛货币B |
| 1. 本期已实现收益 | 10,534,725.22 | 49,414,920.60 |
| 2. 本期利润 | 10,534,725.22 | 49,414,920.60 |
| 3. 期末基金资产净值 | 941,708,509.57 | 5,471,100,107.99 |

注:1、所列数据截止到2018年6月30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

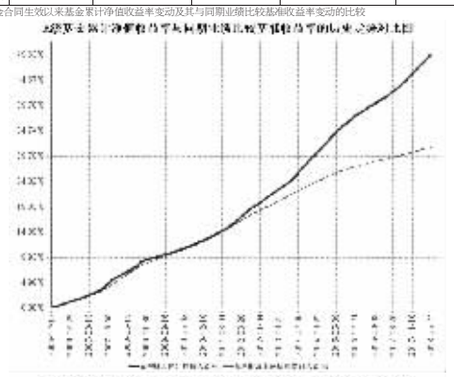
长盛货币A

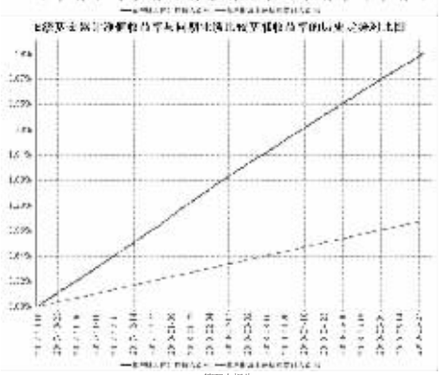
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.9687% | 0.0011% | 0.3740% | 0.0000% | 0.5947% | 0.0011% |

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 | 1.0293% | 0.0011% | 0.3740% | 0.0000% | 0.6553% | 0.0011% |

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 | | |
| 段鹏 | 本基金基金经理、长盛环球市盈定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛惠和纯债债券型证券投资基金基金经理、长盛盛赢纯债债券型证券投资基金基金经理、长盛盛利宝债券市场基金基金经理、长盛盛利纯债债券型证券投资基金基金经理、长盛盛利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。 | 2014年4月10日 | – | 11年 | 段鹏先生,1982年12月出生。中央财经大学经济学硕士,曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易,债券投资及流动性管理等工作,2013年12月加入长盛基金管理有限公司。 |

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》及其各项实施细则、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或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

二季度股票市场呈现震荡下跌走势,个股和行业分化严重。行业上,食品饮料、休闲服务和医药生物等行业表现较好,通信、综合和电气设备等行业表现较差。风格上,高价股、绩优股、高市净率等风格表现较好,微利股、亏损股、和中价股等风格表现较差。

组合操作上,我们严格按照基金合同规定的投资流程,利用多种量化策略深度挖掘具备阶段性或长机会的股票构建投资组合,并根据市场环境变化和量化策略有效性,对投资组合进行调整和更新。

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0.9687%,本报告期长盛货币B的基金份额净值收益率为1.0293%,同期业绩比较基准收益率为0.3740%。

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 | 1,515,641,243.11 | 21.72 |
| | 其中:债券 | 1,515,641,243.11 | 21.72 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,546,137,479.21 | 22.16 |
| | 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 | 3,558,672,858.25 | 51.01 |
| 4 | 其他资产 | 356,406,481.13 | 5.11 |
| 5 | 合计 | 6,976,858,061.70 | 100.00 |

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 | 1.99 |
| | 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 | 558,498,816.74 / 8.71 |
| | 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

注: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 | 54 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 58 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 35 |

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 | 37.99 | 8.71 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | – | – |
| 2 | 30天(含)—60天 | 15.76 | – |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | – | – |
| 3 | 60天(含)—90天 | 40.02 | – |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | – | – |
| 4 | 90天(含)—120天 | 2.34 | – |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | – | – |
| 5 | 120天(含)—397天(含) | 7.13 | – |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | – | – |
| 合计 | | 103.24 | 8.71 |

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 | 40,016,521.44 | 0.62 |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 370,118,999.73 | 5.77 |
| | 其中:政策性金融债 | 370,118,999.73 | 5.77 |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 企业短期融资券 | 439,930,944.55 | 6.86 |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 同业存单 | 665,674,777.39 | 10.38 |
| 8 | 其他 | – | – |
| 9 | 合计 | 1,515,641,243.11 | 23.63 |
| 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 | 170410 | 17农发10 | 1,300,000 | 130,047,750.07 | 2.03 |
| 2 | 011800492 | 18大唐集SCP004 | 1,200,000 | 120,328,336.31 | 1.88 |
| 3 | 170207 | 17国开07 | 1,000,000 | 100,007,070.83 | 1.56 |
| 4 | 111891144 | 18宁波银行CD020 | 1,000,000 | 99,669,038.95 | 1.55 |
| 5 | 111818126 | 18华夏银行CD126 | 1,000,000 | 99,381,591.84 | 1.55 |
| 6 | 111810296 | 18兴业银行CD296 | 1,000,000 | 99,041,221.71 | 1.54 |
| 7 | 110311 | 11进出11 | 900,000 | 90,053,227.09 | 1.40 |
| 8 | 011801170 | 18中化股SCP010 | 800,000 | 80,001,927.03 | 1.25 |
| 9 | 011801114 | 18湖仓江SCP003 | 700,000 | 70,000,106.44 | 1.09 |
| 10 | 111783160 | 17广州农村商业银行CD150 | 600,000 | 59,661,057.25 | 0.93 |

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)—0.50%间的次数 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1233% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0307% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0708% |

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%情况。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | – |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收利息 | 34,340,135.33 |
| 4 | 应收申购款 | 322,066,345.80 |
| 5 | 其他应收款 | – |
| 6 | 待摊费用 | – |
| 7 | 其他 | – |
| 8 | 合计 | 356,406,481.13 |

5.9.4 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 | 长盛货币A | 长盛货币B |
|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,168,736,924.64 | 3,361,769,495.61 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 446,059,940.40 | 7,400,572,968.55 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 673,088,355.47 | 5,291,242,356.17 |
| 报告期期末基金份额总额 | 941,708,509.57 | 5,471,100,107.99 |

注:申购份额含红利再投,转换入份额和因份额升降级导致的强制调增份额,赎回份额含转换出份额和因份额升降级导致的强制调减份额。

§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 | 2018年5月30日 | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 | – |
| 合计 | | | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 | |

§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

注:本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛货币市场基金基金合同》;

3、《长盛货币市场基金托管协议》;

4、《长盛货币市场基金招募说明书》;

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
2018年7月20日

# 长盛积极配置债券型证券投资基金

## 2018 第二季度 报告

2018年6月30日

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7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7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2018年4月1日起至6月30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 | 389,426,331.93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和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,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(2018年4月1日 — 2018年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 2,936,974.32 |
| 2.本期利润 | −4,249,054.38 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | −0.0109 |
| 4.期末基金资产净值 | 416,046,331.99 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0684 |

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2018年6月30日。

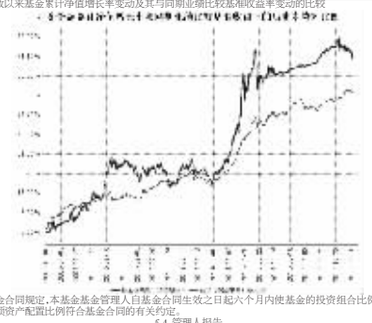
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | −1.01% | 0.28% | 0.92% | 0.14% | −1.93% | 0.14% |

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六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。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 | | |
| 段鹏 | 本基金基金经理、长盛环球中证500指数分级证券投资基金基金经理、长盛环球沪深300指数证券投资基金(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、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛盛利纯债债券型证券投资基金基金经理、长盛盛赢纯债债券型证券投资基金基金经理、长盛盛利宝债券市场基金基金经理、长盛盛利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。 | 2018年6月22日 | – | 11年 | 段鹏先生,1982年12月出生。中央财经大学经济学硕士,曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易,债券投资及流动性管理等工作,2013年12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500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、长盛盛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 | – | 11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),FRM(金融风险管理师),2007年7月加入长盛基金管理有限公司,曾任金融工程研究员,同盛基金经理助理等职务。 |
| 王赛飞 | 本基金基金经理。长盛添利宝货币市场基金基金经理。 | 2018年6月22日 | – | 6年 | 王赛飞女士,1987年10月出生。中国人民大学金融学硕士,曾任大公国际资信评估有限公司分析师,信用评审委员会委员,2015年7月加入长盛基金管理有限公司固定收益部,曾任信用研究员、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理等职务。 |
| 马文祥 | 本基金基金经理。 | 2016年1月26日 | 2018年6月22日 | 15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、工银瑞信企业年金基金经理,工银瑞信投用收益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。 |

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》及其各项实施细则、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或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

在报告期内,本基金坚持稳健操作思路,在资金面边际放松的情况下,重点配置中短期高等级信用债,适当提升杠杆水平;在利率水平上升空间有限的情况下,适当参与了利率的交易性机会;权益资产方面,根据市场风格变化,灵活调整权益资产比重,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1.0684元;本报告期基金份额净值增长率为−1.01%,业绩比较基准收益率为0.92%。

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 | 51,932,523.03 | 11.32 |
| | 其中:股票 | 51,932,523.03 | 11.32 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 383,175,069.64 | 83.54 |
| | 其中:债券 | 383,175,069.64 | 83.54 |
| | 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 | 7,980,529.01 | 1.74 |
| 8 | 其他资产 | 15,569,364.32 | 3.39 |
| 9 | 合计 | 458,657,486.00 | 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 | 17,213,570.76 | 4.14 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 6,909,771.96 | 1.66 |
| 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 | 14,347,049.56 | 3.45 |
| K | 房地产业 | 13,462,130.75 | 3.24 |
| 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 | 51,932,523.03 | 12.48 |

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 | 601668 | 中国建筑 | 1,265,526 | 6,909,771.96 | 1.66 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 132,940 | 6,268,121.00 | 1.51 |
| 3 | 600887 | 伊利股份 | 206,521 | 5,761,935.90 | 1.38 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 211,162 | 5,583,125.28 | 1.34 |
| 5 | 000002 | 万 科A | 215,567 | 5,302,948.20 | 1.27 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 99,263 | 5,183,513.86 | 1.25 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 85,702 | 5,020,423.16 | 1.21 |
| 8 | 001979 | 招商蛇口 | 243,007 | 4,629,283.35 | 1.11 |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 703,666 | 3,745,503.12 | 0.90 |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 289,336 | 3,529,899.20 | 0.85 |

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 | – | – |
| 2 | 央行票据 | – | – |
| 3 | 金融债券 | 252,557,000.00 | 60.70 |
| | 其中:政策性金融债 | 252,557,000.00 | 60.70 |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | 50,904,000.00 | 12.24 |
| 7 | 可转债(可交换债) | 79,714,069.64 | 19.16 |
| 8 | 同业存单 | – | – |
| 9 | 其他 | – | – |
| 10 | 合计 | 383,175,069.64 | 92.10 |

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 | 170210 | 17国开10 | 800,000 | 78,192,000.00 | 18.79 |
| 2 | 018005 | 国开1701 | 600,000 | 60,228,000.00 | 14.48 |
| 3 | 160302 | 16进出02 | 500,000 | 48,705,000.00 | 11.71 |
| 4 | 160213 | 16国开13 | 400,000 | 36,404,000.00 | 8.75 |
| 5 | 101353003 | 13中国MTN001 | 300,000 | 30,582,000.00 | 7.35 |

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 | 96,972.13 |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,128,017.28 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 5,340,041.73 |
| 5 | 应收申购款 | 4,333.18 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 15,569,364.32 |

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 | 113011 | 光大转债 | 14,115,868.00 | 3.39 |
| 2 | 120001 | 16证券EB | 12,844,752.20 | 3.09 |
| 3 | 110034 | 九州转债 | 11,710,500.00 | 2.81 |
| 4 | 128029 | 太阳转债 | 5,453,550.00 | 1.31 |
| 5 | 128010 | 顺昌转债 | 4,732,724.64 | 1.14 |
| 6 | 110032 | 三一转债 | 3,927,680.00 | 0.94 |
| 7 | 123004 | 铁汉转债 | 1,825,800.00 | 0.44 |
| 8 | 110030 | 格力转债 | 1,822,975.00 | 0.44 |
| 9 | 123002 | 国祯转债 | 1,569,385.30 | 0.38 |
| 10 | 110033 | 国贸转债 | 901,940.10 | 0.22 |
| 11 | 113015 | 隆基转债 | 546,700.80 | 0.13 |
| 12 | 113009 | 广汽转债 | 183,448.00 | 0.04 |

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 | 391,193,115.58 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 304,376.97 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 2,071,160.62 |
| 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 | 389,426,331.93 |

§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

注:本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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、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7月20日

# 长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

## 2018 第二季度 报告

2018年6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:2018年7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