

# 长盛同丰债券型证券投资基金 (LOF) 2017 年第 4 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。

2018 年 1 月 15 日，长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）召开了基金份额持有人大会，大会审议并通过了《关于终止长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，大会决议自 2018 年 1 月 15 日起生效。自该决议生效后，基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则申请长盛同丰（LOF）终止上市等业务。本基金将于 2018 年 1 月 23 日成立基金财产清算组，进入基金财产清算程序。详情请见登载于基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）的《长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》全文。

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       | 长盛同丰债券（LOF）   |
| 场内简称       | 长盛同丰  |
| 基金主代码      | 160810  |
| 交易代码       | 160810  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2012 年 12 月 27 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 10,475,069.19 份   |
| 投资目标       | 通过分析影响债券市场的各类要素，进行积极主动的投资管理，追求基金资产的稳定增值，以最大程度上取得超越业绩比较基准的收益。  |
| 投资策略       | 以利率风险管理为核心，以久期配置为关键技术，在满足组合流动性要求上，结合不同类型债券流动性、税收和信用风险等因素，综合确定债券组合的类属配置进行个券选择，控制风险、获取超额的投资收益。具体投资运作中将运用换券利差交易策略、凸性套利 |

|        |   |
|--------|---|
|        | 交易策略以及骑乘收益率曲线策略等多样的操作策略。                                      |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数（全价）  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于较低风险的证券投资基金品种，其长期预期收益和平均风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |
| 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      | 18,598.19                       |
| 2. 本期利润         | 56,051.98                       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0052                          |
| 4. 期末基金资产净值     | 12,491,134.09                   |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.192                           |

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。

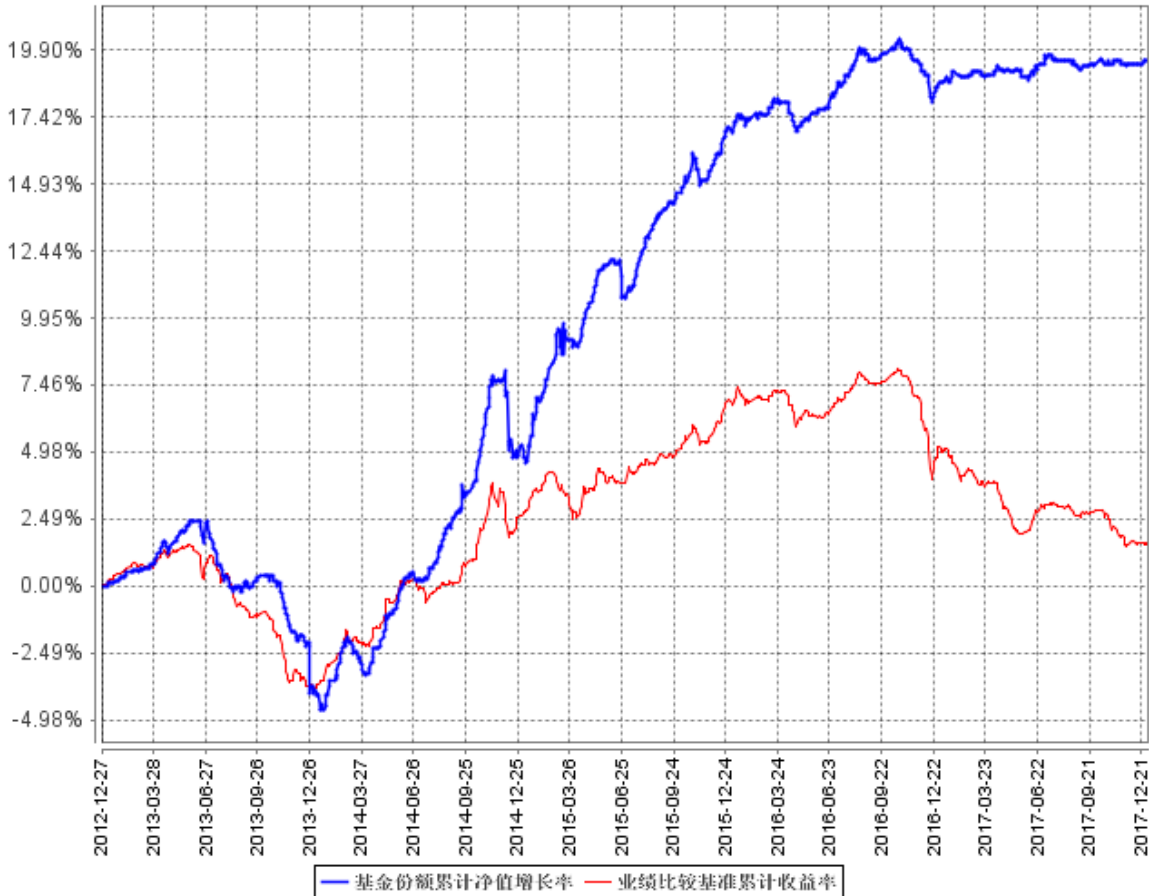
#### 3.2 基金净值表现

##### 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<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③   | ②—④    |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.08%      | 0.04%         | -1.15%         | 0.06%                 | 1.23% | -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

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。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十八条（二）投资范围、（七）投资禁止行为与限制的有关约定。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 |        |   |
| 张帆 | 本基金基金经理，长盛纯债债券型证券投资<br>基金基金经理，长盛添利宝货币市场基金基 | 2014 年 6 月 27 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 |

|  |   |  |  |  |
|--|---|--|--|--|
|  | 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，长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理，养老金业务部负责人。 |  |  | 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。 |
|--|---|--|--|--|

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

四季度来看，国内经济稳中趋缓，但经济韧性仍较强，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；资产投资、消费、工业生产等主要经济指标小幅回落，CPI 小幅回升，猪肉价格出现回升，中上游价格维持高位，通胀预期有所抬头；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，收益率曲线较为平坦，整体上行幅度较大；信用债整体亦跟随利率债大幅调整，信用利差较三季度末有所走阔。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。

##### 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，在信用风险可控的前提下重点配置中短期债券，保持组合流动性，适度参与较长久期利率品种的投资机会，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 1.192 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.08%，业绩比较基准收益率为-1.15%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自 2017 年 10 月 10 日至 2018 年 1 月 9 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 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            | 4,136,882.70  | 31.85        |
|    | 其中：债券             | 4,136,882.70  | 31.85        |
|    | 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          | 6,000,000.00  | 46.20        |
|    | 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      | 2,713,697.41  | 20.89        |
| 8  | 其他资产              | 137,223.07    | 1.06         |
| 9  | 合计                | 12,987,803.18 | 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 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      | 23,004.00    | 0.18         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | 1,995,600.00 | 15.98        |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,995,600.00 | 15.98        |
| 4  | 企业债券      | 2,118,278.70 | 16.96        |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -            | -            |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |

|    |    |              |       |
|----|----|--------------|-------|
| 9  | 其他 | -            | -     |
| 10 | 合计 | 4,136,882.70 | 33.12 |

### 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  | 108601 | 国开 1703 | 20,000 | 1,995,600.00 | 15.98        |
| 2  | 122846 | 11 渝富债  | 7,000  | 700,070.00   | 5.60         |
| 3  | 124279 | 13 海拉尔  | 10,000 | 599,100.00   | 4.80         |
| 4  | 122790 | 11 诸暨债  | 10,760 | 432,444.40   | 3.46         |
| 5  | 122366 | 14 武钢债  | 1,900  | 188,917.00   | 1.51         |

### 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

注：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

注：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

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   | 1,288.19 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |



|   |       |            |
|---|-------|------------|
| 3 | 应收股利  | -          |
| 4 | 应收利息  | 135,634.88 |
| 5 | 应收申购款 | 300.00     |
| 6 | 其他应收款 | -          |
| 7 | 待摊费用  | -          |
| 8 | 其他    | -          |
| 9 | 合计    | 137,223.07 |

#### 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

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 46,363,172.55 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 5,584,172.40  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 41,472,275.76 |
| 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               | 10,475,069.19 |

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

| 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  | 20171026~20171101      | 1,680,672.27 | 0.00 | 1,680,672.27 | 0.00 | 0.00% |
| 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、《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同丰分级债券型证券投资基金托管协议》；

- 4、《长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）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