

# 长盛中信全债指数增强型债券投资基金 2014 年第 3 季度报告

2014 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：2014 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 10 月 24 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 2014 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	129,679,053.61 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	中信标普全债指数收益率×92%+中信标普 A 股综合指数收益率×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（2014年7月1日—2014年9月30日）
1. 本期已实现收益	4,650,152.75
2. 本期利润	8,342,702.83
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0612
4. 期末基金资产净值	162,973,830.78
5. 期末基金份额净值	1.2567

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2014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。

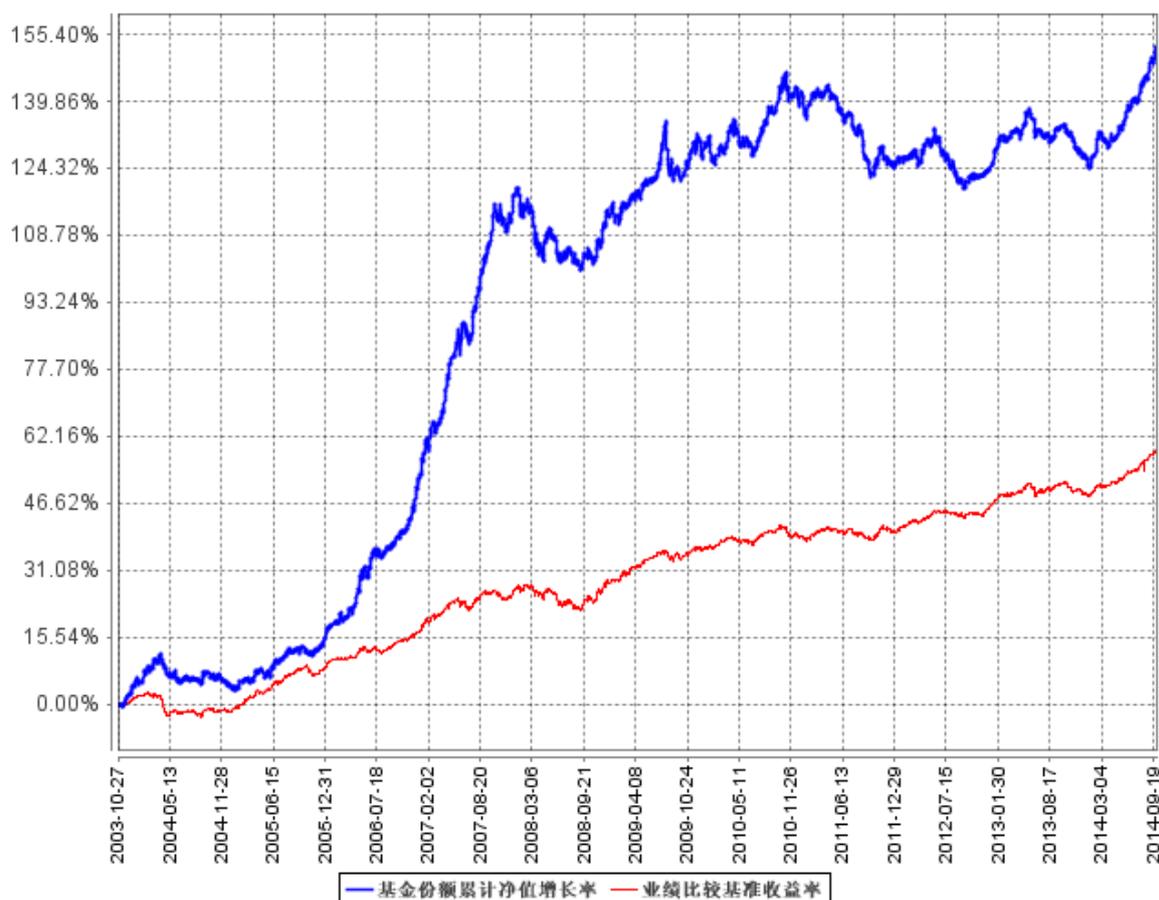
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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	5.20%	0.18%	3.07%	0.24%	2.13%	-0.06%

### 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



## § 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		
贾志敏	本基金基金经理，长盛货币市场基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资	2013 年 3 月 21 日	-	8 年	男，1982 年 3 月出生，中国国籍。北京大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作。2012 年 11 月底加入长盛基金管理有限公司，现任固定收益部副总监，长盛货币市场基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛中信全债指数增强型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛积极配置债券型证

	基金基金经理，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，固定收益部副总监。				券投资基金基金经理，长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。
马文祥	本基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，固定收益部副总监。	2014 年 9 月 10 日	-	11 年	男，1977 年 7 月出生，中国国籍。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、工银瑞信信用纯债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，现任固定收益部副总监，长盛中信全债指数增强型债券投资基金（本基金）基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券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、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，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%的交易共有 2 次，为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 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 2014 年第三季度，经济增速有所下滑，通胀水平处于低位，货币政策定向放松，资金面呈现持续宽松局面，债券市场延续了牛市行情。利率债方面，长端收益率下行幅度较大，收益率曲线有所平坦化。信用债方面，收益率曲线平坦化下行，信用利差有所收窄。

货币市场方面，受央行公开市场操作引导利率下行及定向宽松的货币政策影响，市场流动性保持宽松局面，各中短期限 Shibor 利率及银行间质押式回购利率总体呈震荡下行走势。

纯债资产以外，三季度权益市场强势反弹，投资者心态从极冷到极热，全市场季度涨幅超过

30%的股票接近四成。从行业和主题角度看，军工、农业、小市值、低价股、资产重组个股表现最好，所有行业指数均实现了正收益；受正股强势反弹行情影响，可转债在三季度总体呈现震荡上涨走势。

## 2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金始终控制配置节奏，根据市场变动调整组合久期，优化持仓结构，保持组合流动性。密切关注高收益债券的信用风险暴露，严格控制其持仓比例，防控信用风险。同时，密切关注权益市场变化以及转债个券可能存在的条款博弈机会，调整权益资产占比，择机进行波段操作，参与新股网上申购，进一步提升组合收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.2567 元，本报告期份额净值增长率为 5.20%，同期业绩比较基准增长率为 3.07%。

## § 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	14,047,701.32	7.94
	其中：股票	14,047,701.32	7.94
2	固定收益投资	150,027,078.22	84.80
	其中：债券	150,027,078.22	84.80
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,993,894.97	5.08
7	其他资产	3,844,184.56	2.17
8	合计	176,912,859.07	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	10,582,721.32	6.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	2,942,000.00	1.81
F	批发和零售业	508,500.00	0.31
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	14,480.00	0.01
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	14,047,701.32	8.62

### 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	000748	长城信息	184,917	5,436,559.80	3.34
2	601800	中国交建	400,000	1,896,000.00	1.16
3	002454	松芝股份	100,000	1,593,000.00	0.98
4	002179	中航光电	49,948	1,285,661.52	0.79
5	600600	青岛啤酒	30,000	1,173,600.00	0.72
6	601186	中国铁建	200,000	1,046,000.00	0.64
7	300003	乐普医疗	25,000	587,500.00	0.36
8	600998	九州通	30,000	508,500.00	0.31
9	600686	金龙汽车	40,000	506,400.00	0.31
10	603126	中材节能	1,000	14,480.00	0.01

### 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	12,475,689.00	7.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,674,000.00	18.21
	其中：政策性金融债	29,674,000.00	18.21
4	企业债券	80,264,417.42	49.25
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,955,000.00	6.11
7	可转债	17,657,971.80	10.83

8	其他	-	-
9	合计	150,027,078.22	92.06

### 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	110233	11 国开 33	200,000	19,702,000.00	12.09
2	010213	02 国债(3)	111,780	10,770,003.00	6.61
3	122703	12 鞍城投	100,000	10,550,000.00	6.47
4	112013	09 亿城债	100,000	10,152,826.03	6.23
5	1280202	12 开封发 投债	100,000	10,151,000.00	6.23

### 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

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

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	336,814.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,481,173.98
5	应收申购款	26,196.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,844,184.56

### 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	113003	重工转债	9,578,800.00	5.88

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002454	松芝股份	1,593,000.00	0.98	重大事项停牌

### 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	168,686,333.27
报告期期间基金总申购份额	5,958,660.92
减：报告期期间基金总赎回份额	44,965,940.58
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	129,679,053.61

## § 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	29,937,118.12
------------------	---------------

报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	29,937,118.12
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-

## 7.2 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	2014 年 7 月 4 日	29,937,118.12	35,819,761.83	0.00%
合计			29,937,118.12	35,849,761.83	

## § 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、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛中信全债指数增强型债券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛中信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。

### 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  
2014 年 10 月 27 日