

# 长盛中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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。

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       | 长盛中债 1-3 年政金债  |
| 基金主代码      | 008679   |
| 交易代码       | 008679   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2020 年 6 月 19 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 2,536,925.78 份   |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差控制在 4%以内。   |
| 投资策略       | <p>1、完全复制策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法构建基金债券投资组合，并根据标的指数成份债券及其权重的变动而进行相应的调整。</p> <p>2、替代性策略</p> <p>当成份债券市场流动性不足或因法规规定本基金不能投资关联方债券等情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资备选成份债券为主，并辅以非成份债券等金融工具来构建替代组合进行跟踪复制。</p> <p>在正常市场情况下，基金管理人力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> |
| 业绩比较基准     | 中债 1-3 年政策性金融债指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%  |
| 风险收益特征     | 本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。   |

|                 |                 |                 |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金管理人           | 长盛基金管理有限公司      |                 |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司    |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 长盛中债 1-3 年政金债 A | 长盛中债 1-3 年政金债 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 008679          | 008680          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,482,384.29 份  | 54,541.49 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（2021年7月1日—2021年9月30日） |                 |
|-----------------|---------------------------|-----------------|
|                 | 长盛中债 1-3 年政金债 A           | 长盛中债 1-3 年政金债 C |
| 1. 本期已实现收益      | 1,555,776.82              | 100,609.04      |
| 2. 本期利润         | 1,334,403.36              | 1,933.97        |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0119                    | 0.0176          |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,697,018.92              | 57,207.03       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0865                    | 1.0489          |

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。

#### 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

长盛中债 1-3 年政金债 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      | 5.42%  | 0.60%     | 0.33%      | 0.03%         | 5.09% | 0.57% |
| 过去六个月      | 6.49%  | 0.43%     | 0.63%      | 0.03%         | 5.86% | 0.40% |
| 过去一年       | 8.17%  | 0.31%     | 0.99%      | 0.04%         | 7.18% | 0.27% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.65%  | 0.27%     | 0.58%      | 0.04%         | 8.07% | 0.23% |

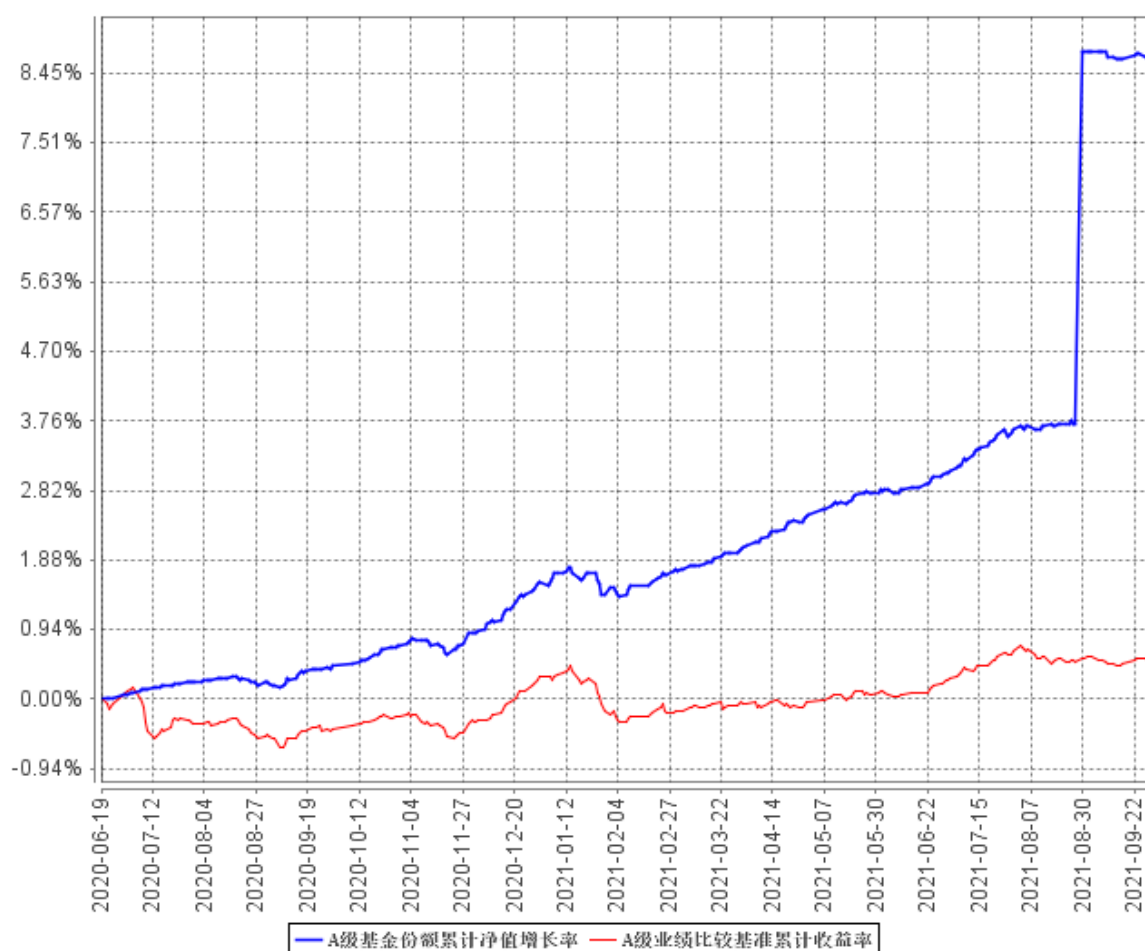
长盛中债 1-3 年政金债 C

| 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 | 1.91%  | 0.17%     | 0.33%      | 0.03%         | 1.58% | 0.14% |

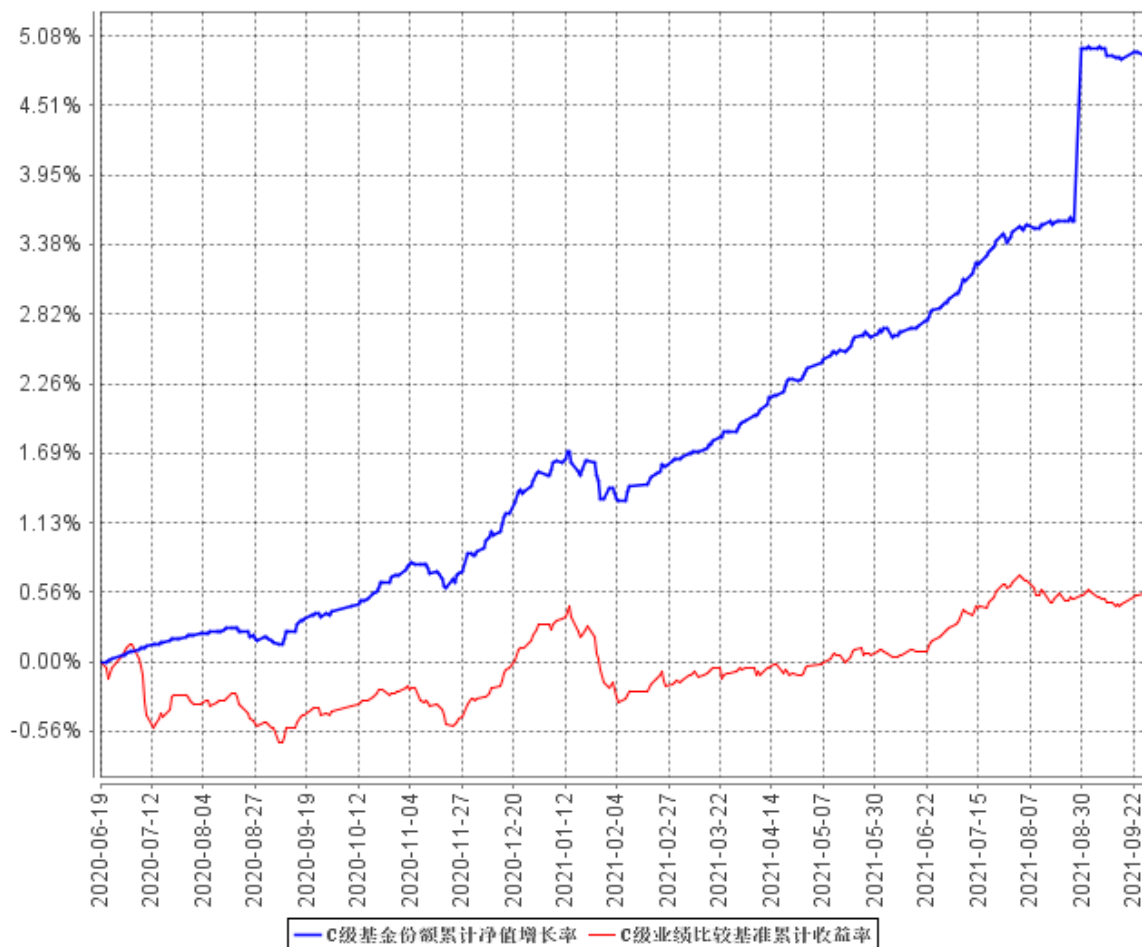
|            |       |       |       |       |       |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去六个月      | 2.91% | 0.12% | 0.63% | 0.03% | 2.28% | 0.09% |
| 过去一年       | 4.46% | 0.09% | 0.99% | 0.04% | 3.47% | 0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.89% | 0.08% | 0.58% | 0.04% | 4.31% | 0.04% |

### 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



C级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，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有关约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。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 |        |  |
| 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，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。 | 2020年6月19日  | -    | 9年     | 王赛飞女士，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、基金经理助理等职务。 |

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《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，经济基本面下行压力较大。工业方面，受到出口拉动，相关行业生产活动较为活跃，但后续受到能耗双控及电力约束的影响，多地出现限产限电，部分高耗能企业拖累工业生产。服务业方面，南京、福建等地疫情爆发有所扩散，相关管控措施约束下，餐饮、旅游等下滑明显。价格层面，PPI 大幅上升创出新高的同时，CPI 低位运行。7 月央行进行全面降准，从资金面上看，报告期内整体较为宽松平稳，其中 9 月略有上行。

从指数表现看，1~3 年政策性金融债收益率在 7 月经历快速下行，主要是受到降准、南京疫情等影响，8 月以来逐步震荡上行。

##### 2、报告期内本基金投资策略分析

作为被动指数型债券型基金，本基金在操作中严格遵守基金合同要求构建投资组合，以实现对标指数的跟踪，力争跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛中债 1-3 年政金债 A 基金份额净值为 1.0865 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.42%；截至本报告期末长盛中债 1-3 年政金债 C 基金份额净值为 1.0489 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.91%；同期业绩比较基准收益率为 0.33%。

#### 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 2021 年 08 月 17 日至 2021 年 09 月 30 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 | 2,287,920.00 | 78.47        |
|    | 其中：债券  | 2,287,920.00 | 78.47        |
|    | 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      | 599,092.97   | 20.55  |
| 8 | 其他资产              | 28,805.40    | 0.99   |
| 9 | 合计                | 2,915,818.37 | 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 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      | -            | -            |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | 2,287,920.00 | 83.07        |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,287,920.00 | 83.07        |
| 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） | -            | -            |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 2,287,920.00 | 83.07        |

## 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  | 200402 | 20 农发 02 | 21,000 | 2,085,090.00 | 75.71        |
| 2  | 180204 | 18 国开 04 | 1,000  | 102,930.00   | 3.74         |
| 3  | 210404 | 21 农发 04 | 1,000  | 99,900.00    | 3.63         |

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 只债券。



## 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) 18 国开 04

2021 年 1 月 8 日，银保监会银保监罚决字〔2020〕67 号显示，国家开发银行存在为违规的政府购买服务项目提供融资等 24 项违法违规事实，对其处以罚款 4880 万元。对以上事件，本基金判断，国家开发银行经营稳健，上述处罚对公司影响可控。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，本报告期内本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   | -         |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 26,543.65 |
| 5  | 应收申购款   | 2,261.75  |

|   |       |           |
|---|-------|-----------|
| 6 | 其他应收款 | -         |
| 7 | 其他    | -         |
| 8 | 合计    | 28,805.40 |

#### 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处于转股期的可转换债券（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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 长盛中债 1-3 年政金债 A | 长盛中债 1-3 年政金债 C |
|---------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 217,770,354.09  | 203,200.07      |
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,632,072.06    | 35,259.34       |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 217,920,041.86  | 183,917.92      |
| 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               | 2,482,384.29    | 54,541.49       |

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

| 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  | 20210812~20210829        | 17,741,744.70  | 0.00 | 17,741,744.70  | 0.00      | 0.00% |
|  | 2  | 20210701~20210816        | 199,999,000.00 | 0.00 | 199,999,000.00 | 0.00      | 0.00% |
| 个人   | 1  | 20210830~20210830        | 30,000.00      | 0.00 | 0.00           | 30,000.00 | 1.18% |
| 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、长盛中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛中债 1-3 年政策性金融债指数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地址和/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、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2021 年 10 月 27 日