

长盛恒盛利率债债券型证券投资基金(A类份额)

基金产品资料概要

编制日期：2022年6月13日

送出日期：2022年6月14日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	长盛恒盛利率债	基金代码	016016
下属基金简称	长盛恒盛利率债A	下属基金交易代码	016016
基金管理人	长盛基金管理有限公司	基金托管人	恒丰银行股份有限公司
基金合同生效日	-	上市交易所及上市日期	-
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	张建	开始担任本基金基金经理的日期	-
		证券从业日期	2013年7月1日
其他	《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续50个工作日出现上述情形的，基金管理人可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

(投资者阅读《招募说明书》中“基金的投资”章节了解详细情况)

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。
投资范围	<p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括利率债（包括国债、政策性金融债、央行票据）、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券、可交换债券、信用债和国债期货。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于利率债资产的比例不低于非现金基金资产的80%；本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>

<p>主要投资策略</p>	<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>1、利率策略</p> <p>利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。通过全面研究国民经济运行状况, 分析宏观经济运行的可能情景, 预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向, 分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构, 在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势, 以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。</p> <p>2、骑乘策略</p> <p>基金管理人将通过分析收益率曲线各期限段的期限利差情况, 买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券, 随着持有债券时间的延长, 该债券的剩余期限将缩短, 到期收益率将下降, 届时卖出该债券可获得资本利得收入。该策略的关键是收益率曲线的陡峭程度, 若收益率曲线较为陡峭, 则随着债券剩余期限的缩短, 债券的收益率水平将会有较大下滑, 进而获得较高的资本利得。</p> <p>3、息差放大策略</p> <p>该策略是利用债券回购收益率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。该策略的基本模式即是利用买入债券进行正回购, 再利用回购融入资金购买收益率较高债券品种。在执行息差放大策略时, 基金管理人将密切关注债券收益率与回购收益率的相互关系, 并始终保持回购利率低于债券收益率。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中债-国债及政策性银行债指数收益率</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为债券型基金, 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。</p>

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取:

费用类型	份额(S)或金额(M) /持有期限(N)	收费方式/费率
认购费	M<100万	0.3%
	100万≤M<200万	0.2%
	200万≤M<500万	0.1%
	M≥500万	1,000元/笔
申购费 (前收费)	M<100万	0.4%
	100万≤M<200万	0.3%
	200万≤M<500万	0.2%
	M≥500万	1,000元/笔
赎回费	N<7天	1.5%
	N≥7天	0%

注:养老金费率等相关内容详见本基金招募说明书。

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.3%
托管费	0.08%
其他费用	会计师费、律师费、信息披露费等

注:本基金交易证券、基金等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。本基金的其他费用详见招募说明书。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金面临的常规风险:市场风险、管理风险、信用风险、流动性风险(包括但不限于拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估,巨额赎回情形下的流动性风险管理措施,实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响,实施侧袋机制对投资者的影响等)等。

本基金面临的特定风险包括:1、投资债券资产的风险;2、发生巨额赎回的风险;3、投资流动性资产受限证券的风险;4、基金合同直接终止的风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的,基金管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,基金管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后,如需及时、准确获取基金的相关信息,敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

关于本基金争议解决方式详见本基金基金合同,请投资者务必仔细阅读相关内容。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址:www.csfunds.com.cn][客服电话:400-888-2666]

1. 基金合同、托管协议、招募说明书;2. 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告;
3. 基金份额净值;4. 基金销售机构及联系方式;5. 其他重要资料