

长盛同丰债券型证券投资基金 (LOF) 2015 年年度报告 摘要

2015 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

送出日期：2016 年 3 月 26 日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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
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
报告期末基金份额总额	118,688,847.31 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013-02-26

2.2 基金产品说明

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别配置进行个券选择，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化的操作策略。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-	95566

	62350088	
传真	010-82255988	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	5,989,810.38	6,514,381.86	19,789,900.85
本期利润	6,851,977.09	35,674,138.92	-7,553,523.52
加权平均基金份额本期利润	0.1008	0.0825	-0.0052
本期基金份额净值增长率	11.14%	9.37%	-3.74%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1148	0.0077	-0.0525
期末基金资产净值	138,526,486.87	43,769,182.36	703,460,634.48
期末基金份额净值	1.167	1.050	0.942

注：1、所述基金业绩指标不包括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、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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

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

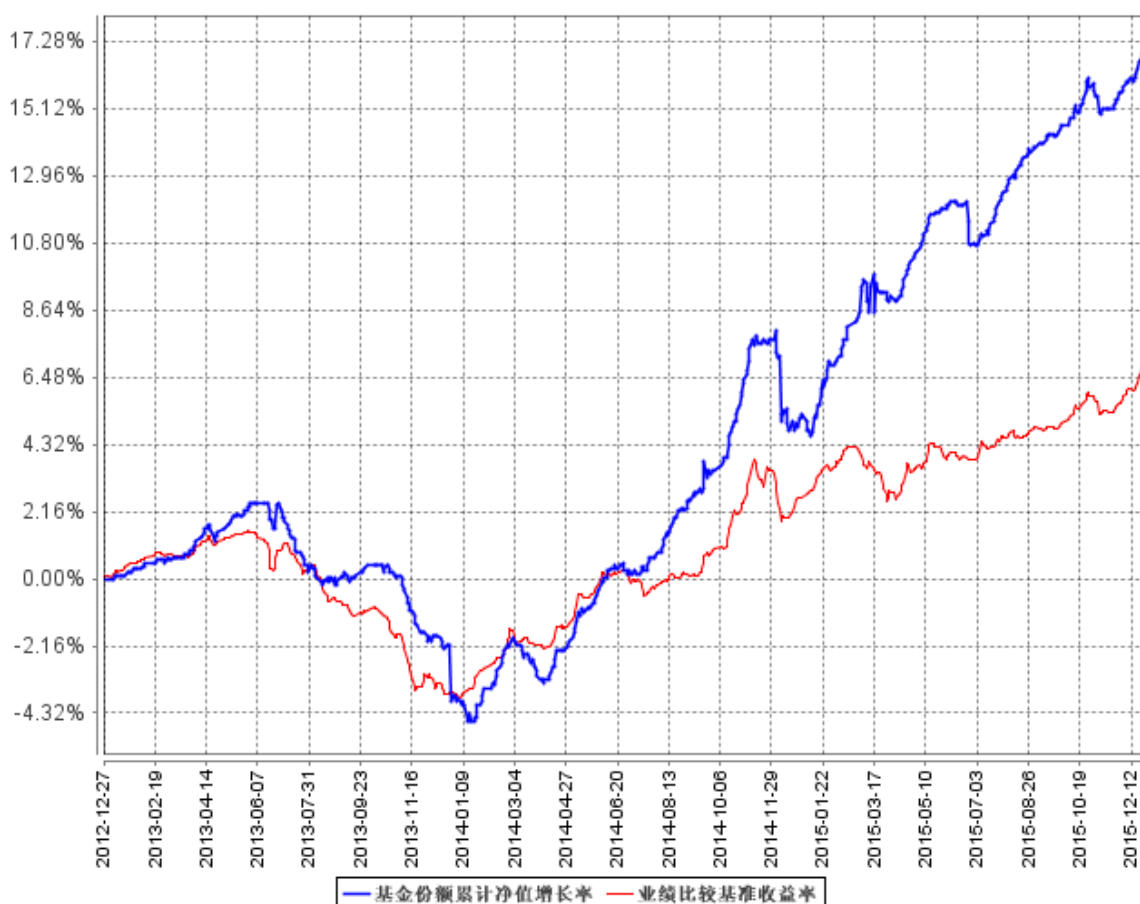
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.10%	0.11%	1.81%	0.08%	0.29%	0.03%
过去六个月	5.61%	0.09%	2.95%	0.07%	2.66%	0.02%
过去一年	11.14%	0.17%	4.19%	0.08%	6.95%	0.09%
过去三年	17.01%	0.18%	6.84%	0.10%	10.17%	0.08%
自基金合同生效起至今	17.01%	0.17%	6.91%	0.10%	10.10%	0.07%

注：本基金业绩比较基准为中债综合指数（全价）。中债综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖了主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）。具体的编制规则和再平衡过程请参见中债综合指数（全价）编制说明。

本基金为债券型基金，投资范围为固定收益类金融工具，且本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。鉴于中债综合指数能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，所以其收益率作为本基金的业绩比较基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

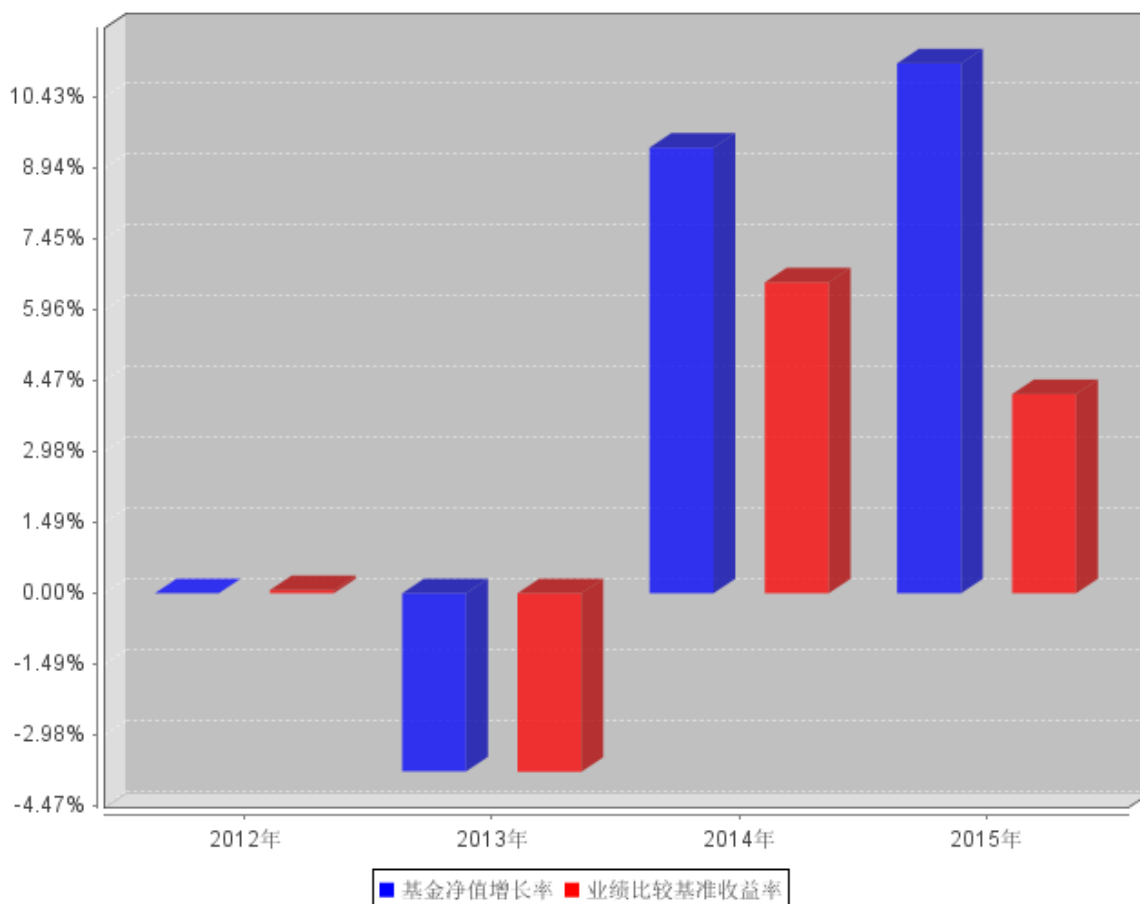
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2012 年 12 月 27 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2015 年度、2014 年度、2013 年度会计期间未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注

册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2015 年 12 月 31 日，基金管理人共管理四十二只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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。	2014 年 6 月 27 日	-	8 年	男，1983 年 1 月出生，中国国籍。华中科技大学硕士。曾在长江证券股份有限公司从事债券研究、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。现任长盛纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛添利宝货币市场基金基金经理，长盛同丰债券型证券投资基金（LOF，本基金）基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。
李琪	本基金基金经理助理。	2014 年 6 月 27 日	2015 年 6 月 16 日	10 年	男，1975 年 2 月出生，中国国籍。天津大学管理学博士。历任大公国际资信评估有限公司信用分析师、信用评审委员会委员，泰康资产管理有限责任公司信用研究员。2011 年 3 月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。现任长盛双月红 1 年期定期开放债券型投资基金基金经理等职务。自 2015 年 6 月 16 日起不

					再担任长盛同丰债券型 证券投资基金（LOF） 基金经理助理。
--	--	--	--	--	--------------------------------------

注：1、上表基金经理及基金经理助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、本基金的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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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 2015 年，经济增速有所下滑，通胀处于较低水平；货币政策方面，央行进行了多次降准降息，资金面呈现持续宽松局面，债券市场总体上仍处于牛市进程中。尤其是下半年以来，受股市连续大跌及新股发行暂停等因素影响，大规模资金由权益市场流入债券市场，各债券品种收益率均呈现趋势性下行走势。利率债方面，收益率曲线陡峭化下行，10 年与 1 年国开债期限利差由年初的 12bp 走阔至年末的 73bp，十年国债和十年国开债收益率均下行至 2009 年初的历史低位；信用债方面，收益率曲线整体下行，受信用风险加速暴露及流动性等因素影响，高评级信用债收益率下行幅度明显大于中低评级信用债。

货币市场方面，受央行公开市场操作引导利率下行及降准降息等宽松货币政策影响，市场流动性总体保持宽松局面，各中短期限 Shibor 利率及银行间质押式回购利率总体大幅下行，并维持在较低水平。

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信用债，保持组合流动性，适度参与利率品种的交易性机会。

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 1.167 元，本报告期份额净值增长率为 11.14%，同期业绩比较基准收益率 4.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，在经济调结构背景下，受去产能、工业品价格低迷、内外需不足等多重因素影响，国内经济仍面临一定下行压力；另外，相对宽松的货币政策、较低的通胀水平以及旺盛

的配置需求预计将继续为债市提供有利支撑。但同时也要密切关注财政政策加码、人民币贬值压力对货币政策的制约、美联储加息预期、信用风险爆发、利率债供给冲击等风险因素的影响。

在流动性相对充裕和配置需求较强的局面下，我们依然看好中短期债券的表现；对于长期债券品种，总体持谨慎乐观态度，需要在波动中寻找机会，这种波段性的操作机会可能在于人民币汇率暂稳、稳增长压力和地方政府债务置换压力下货币政策的继续放松，以及稳增长效果低于预期和经济增速进一步下行的预期。信用债配置方面，我们将严控信用风险，规避产能过剩行业的低评级产业债以及财政实力偏弱地区的城投债。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第二十三条中对基金利润分

配原则的约定，本基金 2015 年度未实施利润分配。

本基金截至 2015 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 13,624,956.56 元，其中：未分配利润已实现部分为 13,624,956.56 元，未分配利润未实现部分为 3,805,795.01 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2015 年 1 月 5 日至 2015 年 3 月 23 日、自 2015 年 3 月 26 日至 2015 年 5 月 13 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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师陈玲、沈兆杰于 2016 年 3 月 22 日对本基金 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2016)第 20234 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛同丰债券型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	19,184,440.19	2,819,675.76
结算备付金	1,054,346.47	6,873,080.91
存出保证金	1,371.70	46,618.38
交易性金融资产	132,529,067.55	83,127,997.90
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	127,283,067.55	83,127,997.90
资产支持证券投资	5,246,000.00	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	16,000,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	3,056,073.81	2,282,035.73
应收股利	-	-
应收申购款	13,017,070.56	132,371.22
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	184,842,370.28	95,281,779.90
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	29,999,755.00	50,499,958.80
应付证券清算款	16,000,000.00	127,107.75
应付赎回款	84,611.51	509,101.80
应付管理人报酬	74,174.05	35,509.82
应付托管费	21,192.56	10,145.66
应付销售服务费	31,788.85	15,218.50
应付交易费用	4,619.05	609.95
应交税费	44,887.00	44,887.00

应付利息	4,837.12	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	50,018.27	270,058.26
负债合计	46,315,883.41	51,512,597.54
所有者权益：		
实收基金	121,095,735.30	42,493,018.41
未分配利润	17,430,751.57	1,276,163.95
所有者权益合计	138,526,486.87	43,769,182.36
负债和所有者权益总计	184,842,370.28	95,281,779.90

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.167 元，基金份额总额 118,688,847.31 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛同丰债券型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	8,545,445.49	46,259,076.56
1. 利息收入	4,724,935.95	30,983,450.10
其中：存款利息收入	85,419.91	1,024,685.34
债券利息收入	4,559,680.53	29,930,199.66
资产支持证券利息收入	62,181.73	-
买入返售金融资产收入	17,653.78	28,565.10
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,923,984.98	-13,910,298.94
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,923,984.98	-13,910,298.94
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	862,166.71	29,159,757.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	34,357.85	26,168.34

减：二、费用	1,693,468.40	10,584,937.64
1. 管理人报酬	538,608.34	2,957,008.09
2. 托管费	153,887.99	844,859.48
3. 销售服务费	230,832.08	1,267,289.24
4. 交易费用	4,421.23	21,499.40
5. 利息支出	516,809.50	5,052,601.51
其中：卖出回购金融资产支出	516,809.50	5,052,601.51
6. 其他费用	248,909.26	441,679.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	6,851,977.09	35,674,138.92
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	6,851,977.09	35,674,138.92

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同丰债券型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	42,493,018.41	1,276,163.95	43,769,182.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,851,977.09	6,851,977.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	78,602,716.89	9,302,610.53	87,905,327.42
其中：1. 基金申购款	243,623,155.10	26,261,949.21	269,885,104.31
2. 基金赎回款	-165,020,438.21	-16,959,338.68	-181,979,776.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	121,095,735.30	17,430,751.57	138,526,486.87
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	742,698,117.66	-39,237,483.18	703,460,634.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,674,138.92	35,674,138.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-700,205,099.25	4,839,508.21	-695,365,591.04
其中：1. 基金申购款	4,540,242.09	151,750.91	4,691,993.00
2. 基金赎回款	-704,745,341.34	4,687,757.30	-700,057,584.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	42,493,018.41	1,276,163.95	43,769,182.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵

杨思乐

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛同丰债券型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是由长盛同丰分级债券型证券投资基金(以下简称“原基金”)根据《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定变更运作模式而来。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]1543号《关于核准长盛同丰分级债券型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,996,890,217.99元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第534号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》于2012年12月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,997,372,126.07份基金份额(长盛同丰分级债券型证券投资基金A类份额(以下简称“长盛同丰A”))1,350,433,974.59份,长盛同丰分级债券型证券投资基金B类份额(以下简称“长盛同

丰 B”)646, 938, 151. 48 份，其中认购资金利息折合 481, 908. 08 份基金份额(长盛同丰 A 为 164, 633. 60 份，长盛同丰 B 为 317, 274. 48 份)。

根据《长盛同丰分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)和《长盛同丰分级债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)的有关规定，基金合同生效后 18 个月内(含 18 个月)为基金分级运作期；基金分级运作期届满，基金名称变更为“长盛同丰债券型证券投资基金(LOF)”，运作方式转为上市开放式基金(LOF)。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

长盛同丰 A 的每次开放日，基金管理人将对长盛同丰 A 进行基金份额折算，长盛同丰 A 的基金份额参考净值调整为 1. 000 元，基金份额持有人持有的长盛同丰 A 份额数按折算比例相应增减。原基金净资产优先分配予长盛同丰 A 的本金及约定应得收益，剩余净资产分配予长盛同丰 B。在基金分级运作期内，长盛同丰 A 根据基金合同的规定获取约定收益，约定年化基准收益率为 4. 25%。基金合同生效后，基金管理人在长盛同丰 A 的开放日计算长盛同丰 A 的基金份额参考净值，在长盛同丰 B 的封闭期届满日分别计算长盛同丰 A 与长盛同丰 B 的基金份额参考净值。基金管理人在基金资产净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则计算并公告长盛同丰 A 和长盛同丰 B 的基金份额参考净值。

长盛同丰 A 在基金合同生效后每满 6 个月开放一次，接受投资者在场外的申购与赎回；同丰 B 的封闭期为自基金合同生效之日起至 18 个月后对应日止，如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。在同丰 B 的封闭期内，同丰 B 可上市交易，但不接受申购赎回。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2013]63 号文核准，长盛同丰 B 基金份额于 2013 年 2 月 26 日在深交所挂牌交易。未上市交易的同丰 B 份额托管在场外(注册登记系统)，份额持有人需将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内(证券登记结算系统)后方可上市流通。

本基金转换基准日为 2014 年 6 月 27 日。在转换基准日日终，同丰 A、同丰 B 的基金份额以各自的基金份额净值为基准转换为本基金的基金份额。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2014]第 233 号文审核同意，本基金 118, 613, 944. 00 份基金份额于 2014 年 7 月 11 日在深交所挂牌交易并于同日开放申购、赎回以及转托管业务。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人将其跨系统转托管至场内后，方可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同丰债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、次级

债、短期融资券、资产支持证券、中期票据、银行存款等固定收益类金融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。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。本基金投资组合中：固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于 80%，持有现金和到期日不超过一年的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数（全价）。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2016 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明。

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(3)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(4)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(5)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	538,608.34	2,957,008.09
其中：支付销售机构的客户维护费	70,008.72	612,202.17

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.70% ÷ 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	153,887.99	844,859.48

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% ÷ 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国银行	39,392.92
长盛基金公司	62,626.92
国元证券	389.96
合计	102,409.80
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中国银行	556,672.11
长盛基金公司	415,356.07
国元证券	2,369.78
合计	974,397.96

注：1. 支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.3% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给长盛基金公司，再由长盛基金公司计算并支付给各基金销售机构。销售服

务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值 X0.3% / 当年天数。

2. 上年度可比期间(含分级运作期)发生的基金应支付的销售服务费总额中含 A 类基金份额应支付的销售服务费 2,396,434.75 元和 B 类基金份额应支付的销售服务费 1,327,340.31 元。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	72,876,573.56	-	-	144,100,000.00	93,824.53

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	19,184,440.19	44,772.96	2,819,675.76	92,004.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 29,999,755.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
150016	15 付息国债 16	2016 年 1 月 6 日	105.73	100,000	10,573,000.00
150202	15 国开 02	2016 年 1 月 6 日	100.12	100,000	10,012,000.00
150206	15 国开 06	2016 年 1 月 6 日	100.43	100,000	10,043,000.00
合计				300,000	30,628,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 127,283,067.55 元，属于第三层次的余额为 5,246,000.00（2014 年 12 月 31 日：第一层次 82,170,077.30 元，第二层次 957,920.60，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的不含权固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于 2015 年 3 月 24 日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 5,246,000.00 元(2014 年 12 月 31 日：无)。本基金本期净转入第三层次的金额为 5,246,000.00 元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为 45,230.56 元（2014 年度：无）。

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产	
资产支持证券投资	
2015 年 1 月 1 日	-
购买	5,200,769.44
出售	-
转入第三层级	5,200,769.44
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	45,230.56
——计入损益的利得或损失	45,230.56
2015 年 12 月 31 日	5,246,000.00
2015 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2015 年度损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动收益	45,230.56

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

本基金上年末无第三层次公允价值余额，上年度可比期间无变动金额。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2014 年 12 月 31 日：同）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	132,529,067.55	71.70
	其中：债券	127,283,067.55	68.86
	资产支持证券	5,246,000.00	2.84
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	16,000,000.00	8.66
	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	20,238,786.66	10.95
7	其他各项资产	16,074,516.07	8.70
8	合计	184,842,370.28	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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。

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

8.3 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未买入股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未卖出股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,573,000.00	7.63
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,530,000.00	44.42
	其中：政策性金融债	61,530,000.00	44.42
4	企业债券	45,146,067.55	32.59
5	企业短期融资券	10,034,000.00	7.24
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	127,283,067.55	91.88

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	150016	15 付息国债 16	100,000	10,573,000.00	7.63
2	150405	15 农发 05	100,000	10,557,000.00	7.62
3	150218	15 国开 18	100,000	10,502,000.00	7.58
4	150212	15 国开 12	100,000	10,216,000.00	7.37
5	150312	15 进出 12	100,000	10,200,000.00	7.36

8.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	123501	PR 隧道 02	100,000	5,246,000.00	3.79
---	--------	----------	---------	--------------	------

8.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

本基金报告期内未进行股票投资。

8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,371.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,056,073.81
5	应收申购款	13,017,070.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,074,516.07

8.11.4 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。

8.11.5 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。

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
487	243,714.27	96,711,628.69	81.48%	21,977,218.62	18.52%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	北京千石创富—光大银行—千石资本—道冲套利 8 号资产管理计	13,946,242.00	19.08%
2	北京千石创富—兴业银行—千石资本—道冲套利 12 号资产管理计	12,385,964.00	16.94%
3	富安达基金—广发银行—利可 6 号资产管理计划	5,295,675.00	7.24%
4	易方达资产—广发银行—易方达资产利可 1 号分级资产管理计划	4,424,778.00	6.05%
5	北京千石创富—光大银行—千石资本—道冲套利 9 号资产管理计	4,385,964.00	6.00%
6	北京千石创富—光大银行—千石资本—道冲套利 11 号资产管理计	4,385,964.00	6.00%
7	北京千石创富—光大银行—千石资本—道冲套利 10 号资产管理计	4,385,964.00	6.00%
8	宁波鼎锋海川投资管理中心（有限合伙）—祥驰鼎锋多策略套利 1	4,330,754.00	5.92%

9	宁波鼎锋海川投资管理中心 （有限合伙）—鼎锋另类策 略1期基	4,284,490.00	5.86%
10	宁波鼎锋海川投资管理中心 （有限合伙）—鼎锋另类策 略5期基	4,284,490.00	5.86%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	902.53	0.0008%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究 部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年12月27日）基金份额总额	646,938,151.48
本报告期期初基金份额总额	41,668,168.17
本报告期基金总申购份额	238,806,794.40
减：本报告期基金总赎回份额	161,786,115.26
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	118,688,847.31

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司第六届董事会第七次会议决议，公司聘任林培富、王宁、蔡宾担任公司副总经理；聘任孙杰、刁俊东为公司高管人员。以上三名副总经理于2015年4月22日通过中国证券投资

基金业协会（以下简称基金业协会）组织的高级管理人员证券投资法律知识考试，公司已及时向基金业协会进行备案。

11.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 50,000.00 元，已连续提供审计服务 4 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

中信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	44,241,012.91	40.64%	-	-	-	-

国信证券	20,426,091.74	18.77%	1,304,700,000.00	28.75%		
上海证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	44,184,969.52	40.59%	3,233,900,000.00	71.25%	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

（1）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

（2）资力雄厚，信誉良好。

（3）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

（4）经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

（5）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

（6）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

（1）研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

（2）研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

（3）研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

（4）试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

（5）本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

（6）交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

（1）本基金报告期内新增租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	德邦证券	深圳	1
2	东莞证券	深圳	1
3	日信证券	深圳	1
4	安信证券	上海	1

（2）本基金报告期内停止租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	五矿证券	深圳	1

长盛基金管理有限公司
2016年3月26日