

# 长盛纯债债券型证券投资基金 2015 年年度报告

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 重要提示及目录

### 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。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 9         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 13        |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>13</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 13        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 15        |
| 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.....             | 15        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 16        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 17        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 17        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 18        |
| 4.9 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.....       | 18        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>18</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 18        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 19        |
| 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.....      | 19        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>19</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 19        |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 19        |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>20</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 20        |
| 7.2 利润表.....                                 | 21        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 22        |
| 7.4 报表附注.....                                | 24        |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>44</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 44        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 45        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 45        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 45        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 45        |
| 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.....      | 46        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 46        |
| 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.....   | 46        |

|  |           |
|--|-----------|
| 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 ..... | 46        |
| 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 46        |
| 8.11 投资组合报告附注 .....                      | 47        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                | <b>47</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 47        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 48        |
| 9.3 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 .....  | 48        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>48</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                  | <b>49</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 49        |
| 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 .....   | 49        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 49        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                     | 49        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 50        |
| 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 .....      | 50        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 50        |
| 11.8 其他重大事件 .....                        | 52        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                  | <b>56</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 56        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 57        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 57        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 长盛纯债债券型证券投资基金    |                 |
| 基金简称            | 长盛纯债债券           |                 |
| 基金主代码           | 000050           |                 |
| 交易代码            | 000050           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2013 年 3 月 13 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      | 163,940,903.16 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称:    | 长盛纯债债券 A         | 长盛纯债债券 C        |
| 下属分级基金的交易代码:    | 000050           | 000052          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 126,656,411.63 份 | 37,284,491.53 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在控制风险和保持资产流动性的基础上，积极主动调整投资组合，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。   |
| 投资策略   | 在债券类属资产配置上以相对收益率较高的信用债为主，灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等多种策略积极把握市场投资机会，获取各类超额投资收益。此外，通过债券回购等工具适度匹配组合资产的流动性和杠杆性，提高资金使用效率。 |
| 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，属证券投资基金中的较低风险品种，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。   |

### 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                 |
|         | 联系电话                      | 010-82019988        |
|         | 电子邮箱                      | yejs@csfunds.com.cn |
| 客户服务电话  | 400-888-2666、010-62350088 | 95566               |
| 传真      | 010-82255988              | 010-66594942        |
| 注册地址    | 深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D | 北京市西城区复兴门内大街 1 号    |
| 办公地址    | 北京市海淀区北太平庄路               | 北京市西城区复兴门内大街        |

|       |                      |        |
|-------|----------------------|--------|
|       | 18 号城建大厦 A 座 20-22 层 | 1 号    |
| 邮政编码  | 100088               | 100818 |
| 法定代表人 | 高新                   | 田国立    |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》   |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人的办公地址和基金托管人的住所   |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                             |
|--------|----------------------|----------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼          |
| 注册登记机构 | 长盛基金管理有限公司           | 北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层 |

## §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 3 月 13 日(基金合同生效日)-2013 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|----------------|---------------|---------------|---------------|---|---------------|
|               | 长盛纯债债券 A       | 长盛纯债债券 C      | 长盛纯债债券 A      | 长盛纯债债券 C      | 长盛纯债债券 A                                  | 长盛纯债债券 C      |
| 本期已实现收益       | 7,332,537.84   | 2,545,626.54  | 3,843,584.60  | 2,337,925.11  | 13,183,577.18                             | 4,590,152.12  |
| 本期利润          | 7,480,806.64   | 2,297,171.33  | 23,971,029.18 | 5,753,424.15  | -5,496,910.28                             | 1,543,471.03  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1036         | 0.1037        | 0.1183        | 0.1194        | -0.0037                                   | 0.0044        |
| 本期加权平均净值利润率   | 8.82%          | 8.95%         | 11.62%        | 11.42%        | -0.37%                                    | 0.44%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 11.16%         | 10.96%        | 11.19%        | 10.82%        | -1.70%                                    | -2.00%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末        |               | 2014 年末       |               | 2013 年末                                   |               |
| 期末可供分配利润      | 21,068,350.45  | 5,802,326.22  | 1,984,054.53  | 1,652,846.80  | -10,206,054.95                            | -1,374,563.39 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1663         | 0.1556        | 0.0487        | 0.0416        | -0.0173                                   | -0.0202       |
| 期末基金资产净值      | 153,942,172.18 | 44,914,262.54 | 44,554,565.59 | 43,117,975.85 | 581,059,140.79                            | 66,771,674.58 |

|              |         |        |         |       |         |        |
|--------------|---------|--------|---------|-------|---------|--------|
| 期末基金份额净值     | 1.215   | 1.205  | 1.093   | 1.086 | 0.983   | 0.980  |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2015 年末 |        | 2014 年末 |       | 2013 年末 |        |
| 基金份额累计净值增长率  | 21.50%  | 20.50% | 9.30%   | 8.60% | -1.70%  | -2.00% |

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

长盛纯债债券 A

| 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%    | 0.10%       | 1.81%      | 0.08%         | 0.29%  | 0.02% |
| 过去六个月      | 5.19%    | 0.10%       | 2.95%      | 0.07%         | 2.24%  | 0.03% |
| 过去一年       | 11.16%   | 0.14%       | 4.19%      | 0.08%         | 6.97%  | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.50%   | 0.17%       | 6.12%      | 0.10%         | 15.38% | 0.07% |

长盛纯债债券 C

| 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      | 2.12%    | 0.10%       | 1.81%      | 0.08%         | 0.31%  | 0.02% |
| 过去六个月      | 5.06%    | 0.10%       | 2.95%      | 0.07%         | 2.11%  | 0.03% |
| 过去一年       | 10.96%   | 0.14%       | 4.19%      | 0.08%         | 6.77%  | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.50%   | 0.16%       | 6.12%      | 0.10%         | 14.38% | 0.06% |

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

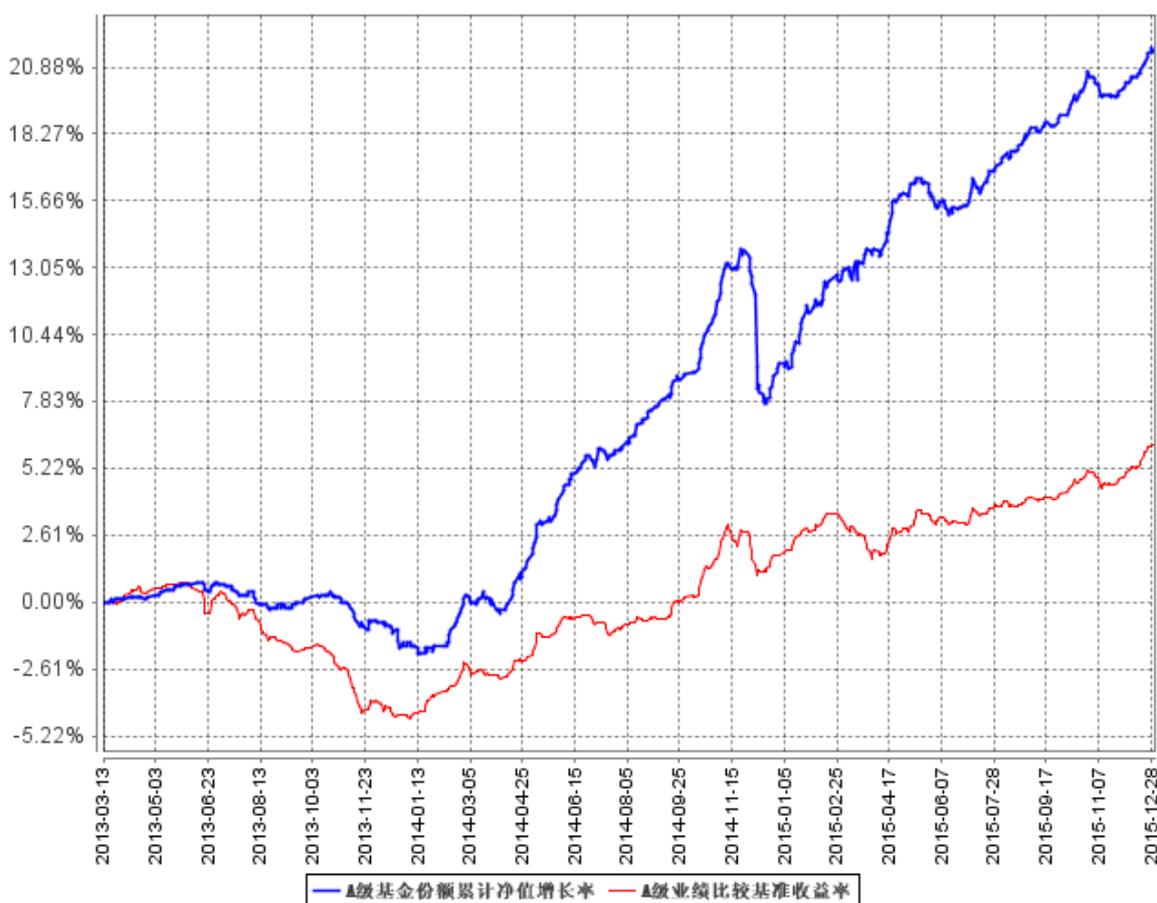
本基金业绩比较基准为中债综合指数（全价）。中债综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖了主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）。具体的编制规则和再平衡过程请参见中债综合指数（全价）编制说明。

(网址为: <http://indices.chinabond.com.cn/icbweb/doc/yieldZsdoc.htm>)

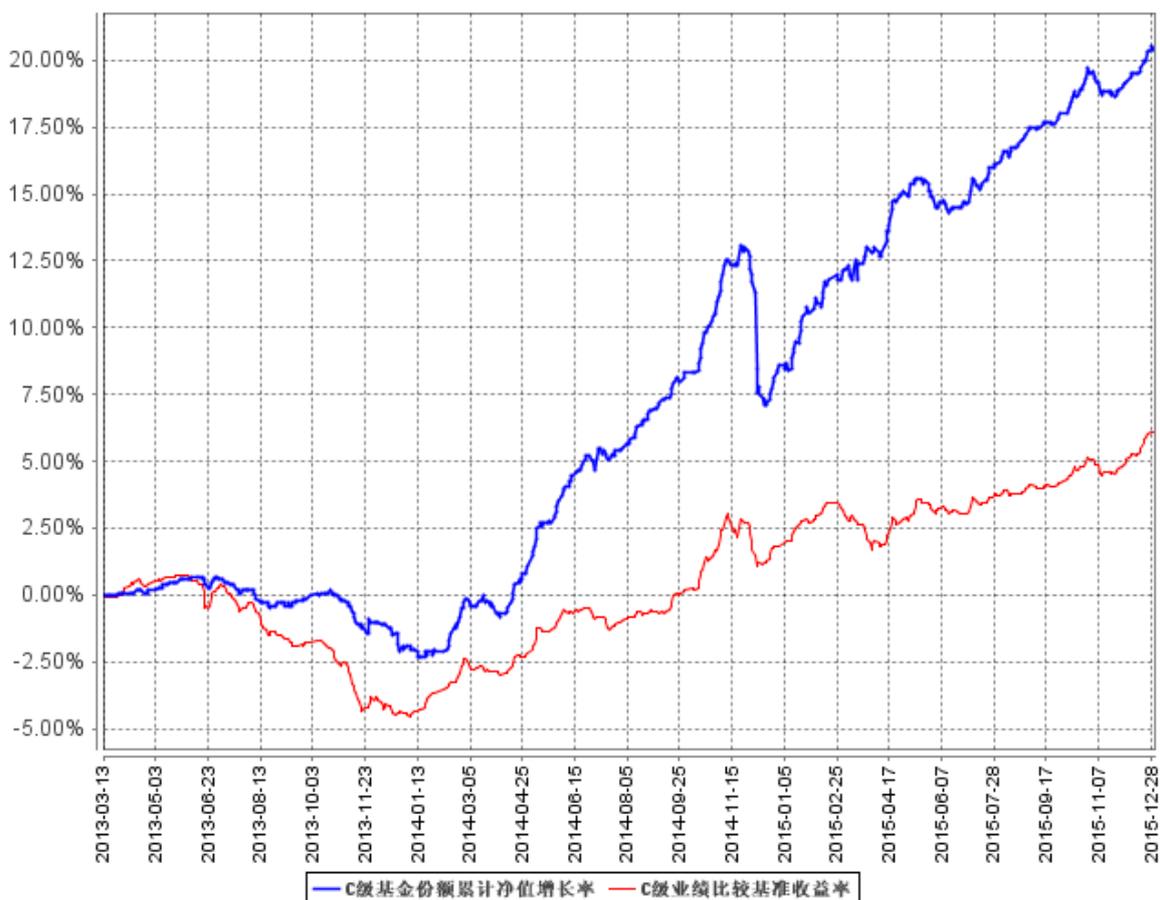
本基金为债券型基金, 投资范围为固定收益类金融工具, 且本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产, 也不参与一级市场新股申购和新股增发, 可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。鉴于中债综合指数能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况, 所以以其收益率作为本基金的业绩比较基准。

### 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

**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**



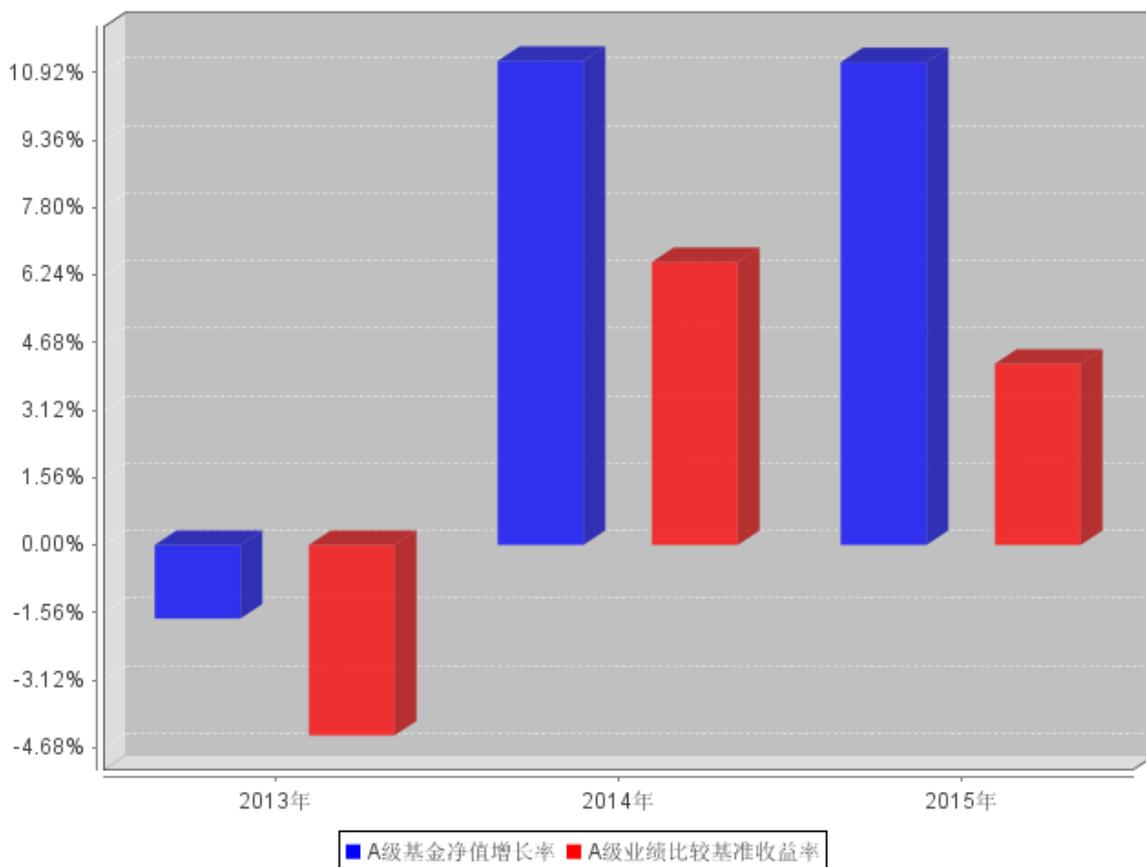
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



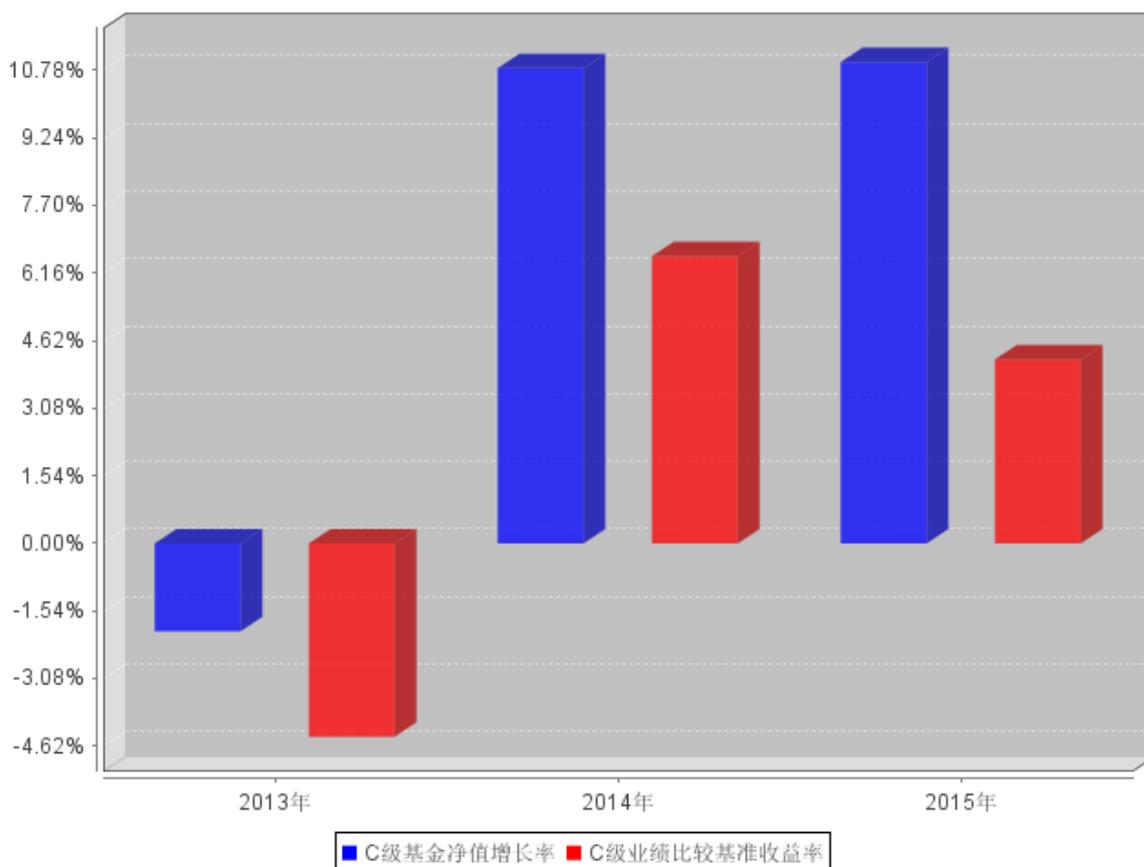
注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十四条（二）投资范围、（八）投资禁止行为与限制的有关约定。

### 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

**A级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**



**C级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：本基金合同于 2013 年 3 月 13 日生效，合同生效当年按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 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）基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。 | 2013 年 9 月 18 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（本基金）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）基金经理，长盛积极配置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

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，长盛纯债债券 A 的基金份额净值为 1.215 元，本报告期份额净值增长率为 11.16%，同期业绩比较基准增长率为 4.19%。

截止报告期末，长盛纯债债券 C 的基金份额净值为 1.205 元，本报告期份额净值增长率为 10.96%，同期业绩比较基准增长率为 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作，保障资产委托人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时敦促有关部门改进、完善，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

1、强调合规培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训等多种方式，有重点、有针对性地展开合规培训工作，强化员工合规理念，深化员工合规意识，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、强调制度/流程建设，扎实公司内控制度建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，保证公司制度/流程的合法合规、全面、适时、有效。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，确保制度/流程严肃性与执行力。报告期内，监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核工作，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、登记注册、产品开发等等；并根据业务发展需要，以及日常监督中发现问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题整改效率与效果，以保障公司制度/流程的严肃性与执行力。

5、加强员工行为合规的检查监督。报告期内，监察稽核部借助信息技术系统，通过完善员工投资报备系统、建设员工合规档案系统等，提高员工行为合规管理水平，督促员工自觉合规。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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十九条中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2015 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 26,870,676.67 元，其中：长盛纯债债券 A 期末可供分配利润为 21,068,350.45 元（长盛纯债债券 A 的未分配利润已实现部分为 21,068,350.45 元，未分配利润未实现部分为 6,217,410.10 元），长盛纯债债券 C 期末可供分配利润为 5,802,326.22 元（长盛纯债债券 C 的未分配利润已实现部分为 5,802,326.22 元，未分配利润未实现部分为 1,827,444.79 元）。

#### 4.9 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

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

## §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”）在长盛纯债债券型证券投资基金（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合规守信、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

## 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2016)第 20235 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

| 审计报告标题       | 审计报告   |
|--------------|--|
| 审计报告收件人      | 长盛纯债债券型证券投资基金 全体基金份额持有人  |
| 引言段          | 我们审计了后附的长盛纯债债券型证券投资基金的财务报表，包括 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。   |
| 管理层对财务报表的责任段 | 编制和公允列报财务报表是长盛纯债债券型证券投资基金的基金管理人长盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：<br><br>(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；<br>(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 |
| 注册会计师的责任段    | 我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意  |

|           |   |
|-----------|---|
|           | <p>见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 审计意见段     | 我们认为，上述长盛纯债债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了长盛纯债债券型证券投资基金 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。   |
| 注册会计师的姓名  | 陈玲 沈兆杰  |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  |
| 会计师事务所的地址 | 中国·上海市  |
| 审计报告日期    | 2016 年 3 月 22 日   |

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 11,405,182.66           | 5,734,030.19             |
| 结算备付金      |         | 1,402,936.96            | 6,207,457.81             |
| 存出保证金      |         | 4,593.75                | 22,793.07                |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 212,345,924.60          | 125,026,375.10           |
| 其中：股票投资    |         | -                       | -                        |
| 基金投资       |         | -                       | -                        |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 债券投资            |            | 207,099,924.60             | 125,026,375.10              |
| 资产支持证券投资        |            | 5,246,000.00               | -                           |
| 贵金属投资           |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                          | -                           |
| 应收证券清算款         |            | 3,500,000.00               | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 4,662,591.23               | 3,093,946.36                |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | 1,929,230.25               | 2,411,555.55                |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 235,250,459.45             | 142,496,158.08              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2014年12月31日</b> |
| <b>负 债:</b>     |            |                            |                             |
| 短期借款            |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | 23,499,770.00              | 51,999,977.10               |
| 应付证券清算款         |            | -                          | 1,012,924.00                |
| 应付赎回款           |            | 12,562,927.26              | 1,343,326.18                |
| 应付管理人报酬         |            | 109,058.54                 | 55,822.06                   |
| 应付托管费           |            | 31,159.59                  | 15,949.19                   |
| 应付销售服务费         |            | 12,260.80                  | 11,922.50                   |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 6,893.74                   | 3,131.50                    |
| 应交税费            |            | 110,460.98                 | 110,460.98                  |
| 应付利息            |            | 3,243.80                   | -                           |
| 应付利润            |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 58,250.02                  | 270,103.13                  |
| 负债合计            |            | 36,394,024.73              | 54,823,616.64               |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 163,940,903.16             | 80,449,828.43               |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | 34,915,531.56              | 7,222,713.01                |
| 所有者权益合计         |            | 198,856,434.72             | 87,672,541.44               |
| 负债和所有者权益总计      |            | 235,250,459.45             | 142,496,158.08              |

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额总额 163,940,903.16 份，其中长盛纯债 A 类份额 126,656,411.63 份，份额净值 1.215 元，长盛纯债 C 类份额 37,284,491.53 份，份额净值 1.205 元。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛纯债债券型证券投资基金

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                         | 附注号        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|------------|---|--|
| <b>一、收入</b>                |            | 11,909,801.88                             | 38,607,393.45                                  |
| 1.利息收入                     |            | 6,888,582.24                              | 24,550,601.41                                  |
| 其中：存款利息收入                  | 7.4.7.11   | 116,242.15                                | 283,591.79                                     |
| 债券利息收入                     |            | 6,711,931.05                              | 24,265,269.62                                  |
| 资产支持证券利息收入                 |            | 58,976.49                                 | -  |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 1,432.55                                  | 1,740.00                                       |
| 其他利息收入                     |            | -   | -  |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |            | 5,057,314.07                              | -9,628,120.54                                  |
| 其中：股票投资收益                  | 7.4.7.12   | -   | -  |
| 基金投资收益                     |            | -   | -  |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.13   | 5,057,314.07                              | -9,628,120.54                                  |
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.13.3 | -   | -  |
| 贵金属投资收益                    |            | -   | -  |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.14   | -   | -  |
| 股利收益                       | 7.4.7.15   | -   | -  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 7.4.7.16   | -100,186.41                               | 23,542,943.62                                  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |            | -   | -  |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 7.4.7.17   | 64,091.98                                 | 141,968.96                                     |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 2,131,823.91                              | 8,882,940.12                                   |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.2.1 | 771,452.97                                | 1,829,191.13                                   |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.2.2 | 220,415.07                                | 522,626.03                                     |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.2.3 | 90,462.55                                 | 178,033.58                                     |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19   | 9,268.86                                  | 13,428.92                                      |
| 5. 利息支出                    |            | 846,414.06                                | 5,938,706.34                                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 846,414.06                                | 5,938,706.34                                   |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.20   | 193,810.40                                | 400,954.12                                     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 9,777,977.97                              | 29,724,453.33                                  |
| 减：所得税费用                    |            | -   | -  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 9,777,977.97                              | 29,724,453.33                                  |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛纯债债券型证券投资基金

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<br>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<br>(基金净值)                    | 80,449,828.43                               | 7,222,713.01   | 87,672,541.44   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -   | 9,777,977.97   | 9,777,977.97    |
| 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)      | 83,491,074.73                               | 17,914,840.58  | 101,405,915.31  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 343,576,340.02                              | 59,158,336.98  | 402,734,677.00  |
| 2. 基金赎回款                               | -260,085,265.29                             | -41,243,496.40 | -301,328,761.69 |
| 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<br>(基金净值)                    | 163,940,903.16                              | 34,915,531.56  | 198,856,434.72  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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<br>(基金净值)                    | 659,411,433.71                              | -11,580,618.34 | 647,830,815.37  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -   | 29,724,453.33  | 29,724,453.33   |
| 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)      | -578,961,605.28                             | -10,921,121.98 | -589,882,727.26 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 261,536,373.76                              | 19,680,566.82  | 281,216,940.58  |
| 2. 基金赎回款                               | -840,497,979.04                             | -30,601,688.80 | -871,099,667.84 |
| 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<br>(基金净值) | 80,449,828.43 | 7,222,713.01 | 87,672,541.44 |

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

长盛纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2013]第 145 号《关于核准长盛纯债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《长盛纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本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 3,333,588,146.05 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(2013)第 109 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 3 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,335,066,436.23 份基金份额(长盛纯债基金 A 类份额(以下简称“长盛纯债债券 A”)2,480,359,940.51 份,长盛纯债基金 C 类份额(以下简称“长盛纯债债券 C”)854,706,495.72 份),包含认购资金利息折合 1,478,290.18 份(长盛纯债债券 A 为 1,122,826.79 份,长盛纯债债券 C 为 355,463.39 份)。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。

根据《长盛纯债债券型证券投资基金基金合同》和《长盛纯债债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从该类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛纯债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固定收益类金融工具,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、中

期票据(MTN)、短期融资券(CP)、超短期融资券(SCP)、资产支持证券(ABS)、银行存款以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。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:固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%,现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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》、《长盛纯债债券型证券投资基金 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相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 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金承担的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》提供的现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公

允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 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)，按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2015年12月31日 | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 11,405,182.66      | 5,734,030.19        |
| 定期存款         | -                  | -                   |
| 其中：存款期限1-3个月 | -                  | -                   |
| 其他存款         | -                  | -                   |
| 合计：          | 11,405,182.66      | 5,734,030.19        |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2015年12月31日  |                |                |
|-------------------|---------------------|----------------|----------------|
|                   | 成本                  | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票                | -                   | -              | -              |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                   | -              | -              |
| 债券                | 交易所市场               | 62,681,341.09  | 62,509,924.60  |
|                   | 银行间市场               | 142,747,424.10 | 144,590,000.00 |
|                   | 合计                  | 205,428,765.19 | 207,099,924.60 |
| 资产支持证券            | 5,201,570.75        | 5,246,000.00   | 44,429.25      |
| 基金                | -                   | -              | -              |
| 其他                | -                   | -              | -              |
| 合计                | 210,630,335.94      | 212,345,924.60 | 1,715,588.66   |
| 项目                | 上年度末<br>2014年12月31日 |                |                |
|                   | 成本                  | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票                | -                   | -              | -              |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                   | -              | -              |
| 债券                | 交易所市场               | 92,604,872.06  | 94,433,375.10  |
|                   | 银行间市场               | 30,605,727.97  | 30,593,000.00  |
|                   | 合计                  | 123,210,600.03 | 125,026,375.10 |
| 资产支持证券            | -                   | -              | -              |
| 基金                | -                   | -              | -              |
| 其他                | -                   | -              | -              |
| 合计                | 123,210,600.03      | 125,026,375.10 | 1,815,775.07   |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产及衍生金融负债。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

注：本基金本期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015年12月31日 | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 2,585.77           | 663.64              |
| 应收定期存款利息   | -                  | -                   |
| 应收其他存款利息   | -                  | -                   |
| 应收结算备付金利息  | 631.30             | 2,793.40            |
| 应收债券利息     | 4,573,504.23       | 3,090,419.11        |
| 应收买入返售证券利息 | -                  | -                   |
| 应收申购款利息    | 608.34             | 60.01               |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                  | -                   |
| 其他         | 85,261.59          | 10.20               |
| 合计         | 4,662,591.23       | 3,093,946.36        |

**7.4.7.6 其他资产**

注：本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015年12月31日 | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                  | -                   |
| 银行间市场应付交易费用 | 6,893.74           | 3,131.50            |
| 合计          | 6,893.74           | 3,131.50            |

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015年12月31日 | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 8,250.02           | 103.13              |
| 预提费用        | 50,000.00          | 270,000.00          |
| 合计          | 58,250.02          | 270,103.13          |

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 长盛纯债债券 A |    |
|----------|----|
| 项目       | 本期 |

|                | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |                 |
|----------------|----------------------------------|-----------------|
|                | 基金份额 (份)                         | 账面金额            |
| 上年度末           | 40,751,079.07                    | 40,751,079.07   |
| 本期申购           | 217,129,354.07                   | 217,129,354.07  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -131,224,021.51                  | -131,224,021.51 |
| 本期末            | 126,656,411.63                   | 126,656,411.63  |

金额单位: 人民币元

| 长盛纯债债券 C       |  |                 |
|----------------|--|-----------------|
| 项目             | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |                 |
|                | 基金份额 (份)                               | 账面金额            |
| 上年度末           | 39,698,749.36                          | 39,698,749.36   |
| 本期申购           | 126,446,985.95                         | 126,446,985.95  |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -128,861,243.78                        | -128,861,243.78 |
| 本期末            | 37,284,491.53                          | 37,284,491.53   |

注: 申购含转换入份额; 赎回含转换出份额。

**7.4.7.10 未分配利润**

单位: 人民币元

| 长盛纯债债券 A       |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 1,984,054.53   | 1,819,431.99  | 3,803,486.52   |
| 本期利润           | 7,332,537.84   | 148,268.80    | 7,480,806.64   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 11,751,758.08  | 4,249,709.31  | 16,001,467.39  |
| 其中: 基金申购款      | 28,642,342.20  | 9,455,206.71  | 38,097,548.91  |
| 基金赎回款          | -16,890,584.12 | -5,205,497.40 | -22,096,081.52 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 21,068,350.45  | 6,217,410.10  | 27,285,760.55  |

单位: 人民币元

| 长盛纯债债券 C       |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 1,652,846.80   | 1,766,379.69  | 3,419,226.49   |
| 本期利润           | 2,545,626.54   | -248,455.21   | 2,297,171.33   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,603,852.88   | 309,520.31    | 1,913,373.19   |
| 其中: 基金申购款      | 15,452,167.06  | 5,608,621.01  | 21,060,788.07  |
| 基金赎回款          | -13,848,314.18 | -5,299,100.70 | -19,147,414.88 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 5,802,326.22   | 1,827,444.79  | 7,629,771.01   |

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015年1月1日至2015年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12月<br>31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 61,433.33                       | 70,120.48                            |
| 定期存款利息收入  | -                               | -                                    |
| 其他存款利息收入  | -                               | -                                    |
| 结算备付金利息收入 | 51,635.32                       | 211,136.75                           |
| 其他        | 3,173.50                        | 2,334.56                             |
| 合计        | 116,242.15                      | 283,591.79                           |

**7.4.7.12 股票投资收益**

注：本基金本期及上年度可比期间无股票投资收益。

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年<br>12月31日 |
|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 5,057,314.07                    | -9,628,120.54                        |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                               | -                                    |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                               | -                                    |
| 合计                            | 5,057,314.07                    | -9,628,120.54                        |

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年<br>12月31日 |
|-------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 320,900,081.69                  | 919,686,236.87                       |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 310,767,444.80                  | 905,281,069.93                       |
| 减：应收利息总额                | 5,075,322.82                    | 24,033,287.48                        |
| 买卖债券差价收入                | 5,057,314.07                    | -9,628,120.54                        |

**7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

注：本基金本期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 衍生工具收益**

注：本基金本期及上年度可比期间未取得衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

注：本基金本期及上年度可比期间未取得股利收益。

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年<br>12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -100,186.41                     | 23,542,943.62                        |
| ——股票投资     | -                               | -                                    |
| ——债券投资     | -144,615.66                     | 23,542,943.62                        |
| ——资产支持证券投资 | 44,429.25                       | -                                    |
| ——贵金属投资    | -                               | -                                    |
| ——其他       | -                               | -                                    |
| 2. 衍生工具    | -                               | -                                    |
| ——权证投资     | -                               | -                                    |
| 3. 其他      | -                               | -                                    |
| 合计         | -100,186.41                     | 23,542,943.62                        |

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年<br>12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 43,023.60                       | 128,351.84                           |
| 基金转换费收入 | 21,068.38                       | 13,617.12                            |
| 合计      | 64,091.98                       | 141,968.96                           |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年<br>12月31日 |
|-----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 868.86                          | 7,913.92                             |
| 银行间市场交易费用 | 8,400.00                        | 5,515.00                             |
| 合计        | 9,268.86                        | 13,428.92                            |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2015年1月1日至<br>2015年12月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年<br>12月31日 |
|----------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用     | 50,000.00                       | 50,000.00                            |
| 信息披露费    | 90,000.00                       | 270,000.00                           |
| 银行汇划费    | 17,610.40                       | 31,054.12                            |
| 上清所帐户维护费 | 18,200.00                       | 22,500.00                            |
| 银行间账户维护费 | 18,000.00                       | 27,000.00                            |
| 开户费      | -                               | 400.00                               |
| 合计       | 193,810.40                      | 400,954.12                           |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 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、注册登记机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)   | 基金托管人、基金代销机构        |
| 国元证券股份有限公司(“国元证券”)   | 基金管理人的股东、基金代销机构     |
| 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。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 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  | 771,452.97            | 1,829,191.13          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 242,352.18            | 774,225.38            |

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。

#### 7.4.10.2.2 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 | 220,415.07            | 522,626.03            |

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 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      |           |           |
|                | 长盛纯债债券 A              | 长盛纯债债券 C  | 合计        |
| 中国银行           | -                     | 23,042.28 | 23,042.28 |
| 长盛基金公司         | -                     | 14,446.28 | 14,446.28 |
| 国元证券           | -                     | 51.88     | 51.88     |

|                |                                  |            |            |
|----------------|----------------------------------|------------|------------|
| 合计             | -                                | 37,540.44  | 37,540.44  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>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                 |            |            |
|                | 长盛纯债债券 A                         | 长盛纯债债券 C   | 合计         |
| 中国银行           | -                                | 104,687.28 | 104,687.28 |
| 长盛基金公司         | -                                | 5,915.50   | 5,915.50   |
| 国元证券           | -                                | -          | -          |
| 合计             | -                                | 110,602.78 | 110,602.78 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.35% 的年费率计提，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。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 X 0.35% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 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<br>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                             | -      | 10,074,580.93 | -     | -    | -              | -         |
| 上年度可比期间<br>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                             | -      | -             | -     | -    | 153,812,000.00 | 77,530.37 |

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 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<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>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  | 11,405,182.66                          | 61,433.33 | 5,734,030.19                                | 70,120.48 |

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。

**7.4.10.6 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。

**7.4.10.7 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其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

注：本基金本期无利润分配事项。

**7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**7.4.12.2 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。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，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 19,999,770.00 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        |
|--------|----------|----------------|--------|---------|---------------|
| 150202 | 15 国开 02 | 2016 年 1 月 6 日 | 100.12 | 100,000 | 10,012,000.00 |
| 150207 | 15 国开 07 | 2016 年 1 月 6 日 | 103.39 | 100,000 | 10,339,000.00 |
| 合计     |          |                |        | 200,000 | 20,351,000.00 |

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出

回购证券款余额 3,500,000.00 元，于 2016 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，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。本基金的投资范围为固定收益类金融工具，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、中期票据 (MTN)、短期融资券 (CP)、超短期融资券 (SCP)、资产支持证券 (ABS)、银行存款以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险和合理保持流动性的基础上，力争为投资者谋求稳健的投资收益。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。公司设立金融工程部，负责进行风险的实时监控和定期计算，并定期出具基金投资业绩和风险分析报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2015年12月31日 | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1 以下 | -                  | -                   |
| 未评级    | 40,121,000.00      | 10,006,000.00       |
| 合计     | 40,121,000.00      | 10,006,000.00       |

注：未评级债券为政策性金融债和短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2015年12月31日 | 上年度末<br>2014年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 3,963,600.00       | 12,060,000.00       |
| AAA 以下 | 55,526,533.00      | 68,166,505.50       |
| 未评级    | 107,488,791.60     | 34,793,869.60       |
| 合计     | 166,978,924.60     | 115,020,375.10      |

注：未评级债券为国债和政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额 23,499,770.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

|                    |       |       |       |     |    |
|--------------------|-------|-------|-------|-----|----|
| 本期末<br>2015 年 12 月 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|--------------------|-------|-------|-------|-----|----|

| 31 日                        |               |               |               |               |                |
|-----------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| 资产                          |               |               |               |               |                |
| 银行存款                        | 11,405,182.66 | -             | -             | -             | 11,405,182.66  |
| 结算备付金                       | 1,402,936.96  | -             | -             | -             | 1,402,936.96   |
| 存出保证金                       | 4,593.75      | -             | -             | -             | 4,593.75       |
| 交易性金融资产                     | 48,797,500.00 | 95,666,427.30 | 67,881,997.30 | -             | 212,345,924.60 |
| 应收证券清算款                     | -             | -             | -             | 3,500,000.00  | 3,500,000.00   |
| 应收利息                        | -             | -             | -             | 4,662,591.23  | 4,662,591.23   |
| 应收申购款                       | 407,806.00    | -             | -             | 1,521,424.25  | 1,929,230.25   |
| 其他资产                        | -             | -             | -             | -             | -              |
| 资产总计                        | 62,018,019.37 | 95,666,427.30 | 67,881,997.30 | 9,684,015.48  | 235,250,459.45 |
| 负债                          |               |               |               |               |                |
| 卖出回购金融资产款                   | 23,499,770.00 | -             | -             | -             | 23,499,770.00  |
| 应付赎回款                       | -             | -             | -             | 12,562,927.26 | 12,562,927.26  |
| 应付管理人报酬                     | -             | -             | -             | 109,058.54    | 109,058.54     |
| 应付托管费                       | -             | -             | -             | 31,159.59     | 31,159.59      |
| 应付销售服务费                     | -             | -             | -             | 12,260.80     | 12,260.80      |
| 应付交易费用                      | -             | -             | -             | 6,893.74      | 6,893.74       |
| 应付利息                        | -             | -             | -             | 3,243.80      | 3,243.80       |
| 应交税费                        | -             | -             | -             | 110,460.98    | 110,460.98     |
| 其他负债                        | -             | -             | -             | 58,250.02     | 58,250.02      |
| 负债总计                        | 23,499,770.00 | -             | -             | 12,894,254.73 | 36,394,024.73  |
| 利率敏感度缺口                     | 38,518,249.37 | 95,666,427.30 | 67,881,997.30 | -3,210,239.25 | 198,856,434.72 |
| 上年度末<br>2014 年 12 月<br>31 日 | 1 年以内         | 1-5 年         | 5 年以上         | 不计息           | 合计             |
| 资产                          |               |               |               |               |                |
| 银行存款                        | 5,734,030.19  | -             | -             | -             | 5,734,030.19   |
| 结算备付金                       | 6,207,457.81  | -             | -             | -             | 6,207,457.81   |
| 存出保证金                       | 22,793.07     | -             | -             | -             | 22,793.07      |
| 交易性金融资产                     | 27,229,550.00 | 47,634,009.50 | 50,162,815.60 | -             | 125,026,375.10 |
| 应收利息                        | -             | -             | -             | 3,093,946.36  | 3,093,946.36   |
| 应收申购款                       | -             | -             | -             | 2,411,555.55  | 2,411,555.55   |
| 资产总计                        | 39,193,831.07 | 47,634,009.50 | 50,162,815.60 | 5,505,501.91  | 142,496,158.08 |
| 负债                          |               |               |               |               |                |
| 卖出回购金融资产款                   | 51,999,977.10 | -             | -             | -             | 51,999,977.10  |
| 应付证券清算款                     | -             | -             | -             | 1,012,924.00  | 1,012,924.00   |
| 应付赎回款                       | -             | -             | -             | 1,343,326.18  | 1,343,326.18   |
| 应付管理人报酬                     | -             | -             | -             | 55,822.06     | 55,822.06      |
| 应付托管费                       | -             | -             | -             | 15,949.19     | 15,949.19      |

|         |                |               |               |              |               |
|---------|----------------|---------------|---------------|--------------|---------------|
| 应付销售服务费 | -              | -             | -             | 11,922.50    | 11,922.50     |
| 应付交易费用  | -              | -             | -             | 3,131.50     | 3,131.50      |
| 应交税费    | -              | -             | -             | 110,460.98   | 110,460.98    |
| 其他负债    | -              | -             | -             | 270,103.13   | 270,103.13    |
| 负债总计    | 51,999,977.10  | -             | -             | 2,823,639.54 | 54,823,616.64 |
| 利率敏感度缺口 | -12,806,146.03 | 47,634,009.50 | 50,162,815.60 | 2,681,862.37 | 87,672,541.44 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                    |                                 |                   |
|----|--------------------|---------------------------------|-------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                   |
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |                    | 本期末（2015年12月31日）                | 上年度末（2014年12月31日） |
|    | 下降25个基点            | 1,909,789.65                    | 1,135,023.87      |
|    | 上升25个基点            | -1,909,789.65                   | -1,135,023.87     |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 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 207,099,924.60 元，属于第三层次的余额为 5,246,000.00 元 (2014 年 12 月 31 日：第一层次 94,433,375.10 元，第二层次 30,593,000.00，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)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和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，确定相关股票和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(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 44,429.25 元 (2014 年度：无)。

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            | 212,345,924.60 | 90.26         |
|    | 其中：债券             | 207,099,924.60 | 88.03         |
|    | 资产支持证券            | 5,246,000.00   | 2.23          |
| 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      | 12,808,119.62  | 5.44          |
| 7  | 其他各项资产            | 10,096,415.23  | 4.29          |
| 8  | 合计                | 235,250,459.45 | 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投资。

#### 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所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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：本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 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进行股票投资。

#### 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      | 3,019,791.60   | 1.52          |
| 2  | 央行票据      | -              | -             |
| 3  | 金融债券      | 114,481,000.00 | 57.57         |
|    | 其中：政策性金融债 | 114,481,000.00 | 57.57         |
| 4  | 企业债券      | 59,490,133.00  | 29.92         |
| 5  | 企业短期融资券   | 30,109,000.00  | 15.14         |
| 6  | 中期票据      | -              | -             |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -             |
| 8  | 同业存单      | -              | -             |
| 9  | 其他        | -              | -             |
| 10 | 合计        | 207,099,924.60 | 104.15        |

## 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  | 150218 | 15 国开 18 | 400,000 | 42,008,000.00 | 21.12         |
| 2  | 150207 | 15 国开 07 | 300,000 | 31,017,000.00 | 15.60         |
| 3  | 150405 | 15 农发 05 | 100,000 | 10,557,000.00 | 5.31          |
| 4  | 150216 | 15 国开 16 | 100,000 | 10,466,000.00 | 5.26          |
| 5  | 150213 | 15 国开 13 | 100,000 | 10,421,000.00 | 5.24          |

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 | 2.64          |

注：本基金本报告期末仅持有上述一只资产支持证券。

## 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

本基金本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   | 4,593.75      |
| 2  | 应收证券清算款 | 3,500,000.00  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 4,662,591.23  |
| 5  | 应收申购款   | 1,929,230.25  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 10,096,415.23 |

### 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投资。

### 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

| 份额级别     | 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 |
| 长盛纯债债券 A | 2,396    | 52,861.61 | 59,796,495.72 | 47.21% | 66,859,915.91 | 52.79% |
| 长盛纯债债券 C | 652      | 57,184.80 | 16,752,078.06 | 44.93% | 20,532,413.47 | 55.07% |
| 合计       | 3,048    | 53,786.39 | 76,548,573.78 | 46.69% | 87,392,329.38 | 53.31% |

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别     | 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 | 长盛纯债债券 A | 344.56    | 0.0003%  |
|                  | 长盛纯债债券 C | -         | -        |
|                  | 合计       | 344.56    | 0.0002%  |

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 9.3 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                             | 份额级别     | 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 | 长盛纯债债券 A | 0                 |
|                                | 长盛纯债债券 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 长盛纯债债券 A | 0~10              |
|                                | 长盛纯债债券 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0~10              |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                 | 长盛纯债债券 A         | 长盛纯债债券 C       |
|------------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2013 年 3 月 13 日）基金<br>份额总额 | 2,480,359,940.51 | 854,706,495.72 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 40,751,079.07    | 39,698,749.36  |
| 本报告期基金总申购份额                        | 217,129,354.07   | 126,446,985.95 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                      | 131,224,021.51   | 128,861,243.78 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”<br>填列）       | -                | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 126,656,411.63   | 37,284,491.53  |

## §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

本报告期无涉及本基金管理人、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

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 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 3 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 |    |
| 国泰君安 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 招商证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 西南证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 安信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东兴证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华福证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长城证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国联证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华安证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 申银宏源 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华融证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 五矿证券 | 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 |
| 国泰君安 | 76,138,237.57 | 63.01%       | 5,014,300,000.00 | 82.68%         | -    | -            |
| 国信证券 | 9,831,227.51  | 8.14%        | 1,050,213,000.00 | 17.32%         | -    | -            |
| 招商证券 | 34,856,940.24 | 28.85%       | -                | -              | -    | -            |
| 中信证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东北证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 西南证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 安信证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东兴证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 华福证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 长城证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国联证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 华安证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 申银宏源 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 华融证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 广发证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中金公司 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 上海证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 东海证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |
| 华泰证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |
| 五矿证券 | - | - | - | - | - | - |

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) 资历雄厚，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：无。

## 11.8 其他重大事件

除上述事项外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下：

| 序号 | 公告事项  | 法定披露方式            | 法定披露日期           |
|----|---|-------------------|------------------|
| 1  | 关于长盛基金指数熔断机制实施后基金配套工作安排的公告  | 《中国证券报》及<br>本公司网站 | 2015 年 12 月 31 日 |
| 2  | 关于增加金观诚为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告                              | 同上                | 2015 年 12 月 15 日 |
| 3  | 关于增加国信证券为旗下部分开放式基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务的公告                            | 同上                | 2015 年 12 月 15 日 |
| 4  | 长盛基金管理有限公司关于参加长量基金费率优惠活动并开通转换业务的公告                                  | 同上                | 2015 年 11 月 30 日 |
| 5  | 关于增加凯石财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及费率优惠活动的公告                               | 同上                | 2015 年 11 月 24 日 |
| 6  | 关于增加盈米财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及费率优惠活动的公告                               | 同上                | 2015 年 11 月 24 日 |
| 7  | 关于增加富济财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及费率优惠活动的公告                               | 同上                | 2015 年 11 月 24 日 |
| 8  | 关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定投及转换业务的公告                          | 同上                | 2015 年 11 月 16 日 |
| 9  | 关于增加工商银行作为长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构以及开通基金转换业务并参加个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告 | 同上                | 2015 年 11 月 2 日  |
| 10 | 关于增加中国农业银行为旗下部分开放式基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务并参加基金申购费率优惠活动的公告             | 同上                | 2015 年 10 月 29 日 |
| 11 | 长盛纯债债券型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告  | 同上                | 2015 年 10 月 23 日 |

|    |   |    |                  |
|----|---|----|------------------|
| 12 | 关于增加交通银行为长盛电子信息主题混合型基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务并参与基金申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015 年 10 月 22 日 |
| 13 | 关于旗下基金参加好买基金费率优惠活动的公告                                     | 同上 | 2015 年 10 月 20 日 |
| 14 | 关于旗下部分开放式基金参加平安证券申购（含定投）费率优惠活动的公告                         | 同上 | 2015 年 10 月 20 日 |
| 15 | 关于增加微动利为旗下部分基金代销机构并开通定投业务及转换业务的公告                         | 同上 | 2015 年 10 月 19 日 |
| 16 | 关于旗下部分基金增加代销机构的公告   | 同上 | 2015 年 10 月 15 日 |
| 17 | 长盛纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）-摘要                                 | 同上 | 2015 年 10 月 14 日 |
| 18 | 长盛纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）                                    | 同上 | 2015 年 10 月 14 日 |
| 19 | 关于长盛纯债基金和长盛新兴成长基金增加代销机构的公告                                | 同上 | 2015 年 10 月 13 日 |
| 20 | 关于增加利得基金为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠活动的公告                      | 同上 | 2015 年 10 月 8 日  |
| 21 | 关于旗下部分开放式基金参加中金公司网上交易 电话委托及柜台委托申购（不含定投）费率优惠活动的公告          | 同上 | 2015 年 9 月 24 日  |
| 22 | 关于增加泰诚财富为旗下部分基金代销机构并开通定投及转换业务的公告                          | 同上 | 2015 年 9 月 23 日  |
| 23 | 关于在网上直销渠道开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告                             | 同上 | 2015 年 9 月 11 日  |
| 24 | 关于增加大连银行为旗下部分基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务并参与基金申购费率优惠活动的公告        | 同上 | 2015 年 9 月 7 日   |
| 25 | 关于增加陆金所为旗下部分基金代销机构并参加费率优惠活动的公告                            | 同上 | 2015 年 9 月 1 日   |
| 26 | 关于中信证券（浙江）有限  | 同上 | 2015 年 9 月 1 日   |

|    |   |    |                 |
|----|---|----|-----------------|
|    | 责任公司整体迁移并入中信证券股份有限公司涉及相关基金业务影响的公告                 |    |                 |
| 27 | 长盛纯债债券型证券投资基金 2015 年半年度报告摘要                       | 同上 | 2015 年 8 月 27 日 |
| 28 | 长盛纯债债券型证券投资基金 2015 年半年度报告                         | 同上 | 2015 年 8 月 27 日 |
| 29 | 关于参加天天基金费率优惠活动的公告                                 | 同上 | 2015 年 8 月 26 日 |
| 30 | 关于长盛纯债债券基金参加代销机构费率优惠活动的公告                         | 同上 | 2015 年 8 月 26 日 |
| 31 | 关于在中信银行开通旗下部分基金转换业务的公告                            | 同上 | 2015 年 8 月 6 日  |
| 32 | 关于旗下部分开放式基金参加第一创业证券网上交易 电话委托及柜台委托申购（含定投）费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015 年 8 月 3 日  |
| 33 | 关于旗下部分开放式基金参加上海浦东发展银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告       | 同上 | 2015 年 7 月 31 日 |
| 34 | 关于开展网上直销金算盘转换费率优惠活动的公告                            | 同上 | 2015 年 7 月 29 日 |
| 35 | 长盛纯债债券型证券投资基金 2015 年第 2 季度报告                      | 同上 | 2015 年 7 月 21 日 |
| 36 | 长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在部分代销机构开通转换业务的公告                | 同上 | 2015 年 7 月 10 日 |
| 37 | 长盛基金管理有限公司关于在直销柜台开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告             | 同上 | 2015 年 7 月 7 日  |
| 38 | 关于增加浦发银行为长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告 | 同上 | 2015 年 7 月 1 日  |
| 39 | 关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告           | 同上 | 2015 年 6 月 30 日 |
| 40 | 关于增加汇付金融和增财基金为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠              | 同上 | 2015 年 6 月 19 日 |

|    | 活动的公告  |    |                 |
|----|--|----|-----------------|
| 41 | 关于增加中经北证和品今财富为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠活动的公告    | 同上 | 2015 年 6 月 19 日 |
| 42 | 关于我公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2015 年 6 月 1 日  |
| 43 | 关于旗下部分基金参加一路财富（北京）信息科技有限公司网上费率优惠活动的公告        | 同上 | 2015 年 5 月 28 日 |
| 44 | 关于在直销柜台开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告                  | 同上 | 2015 年 5 月 27 日 |
| 45 | 长盛基金管理有限公司关于子公司法定代表人、执行董事及高管变更情况的公告          | 同上 | 2015 年 5 月 15 日 |
| 46 | 关于增加中国农业银行为旗下部分开放式基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务的公告   | 同上 | 2015 年 5 月 15 日 |
| 47 | 长盛基金管理有限公司关于新任副总经理的公告                        | 同上 | 2015 年 4 月 24 日 |
| 48 | 长盛纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）                       | 同上 | 2015 年 4 月 16 日 |
| 49 | 长盛纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要                     | 同上 | 2015 年 4 月 16 日 |
| 50 | 关于开展网上直销金算盘定期定额计划费率优惠活动的公告                   | 同上 | 2015 年 4 月 9 日  |
| 51 | 关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告          | 同上 | 2015 年 4 月 1 日  |
| 52 | 关于旗下部分基金参加大连银行基金申购费率优惠活动的公告                  | 同上 | 2015 年 4 月 1 日  |
| 53 | 关于在工商银行开通旗下部分基金转换业务的公告                       | 同上 | 2015 年 3 月 6 日  |

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛纯债债券型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。

### 12.2 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。

### 12.3 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  
2016年3月26日