

# 长安泓泽纯债债券型证券投资基金

## 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:长安基金管理有限公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2018 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

## 1.2 目录

|   |    |
|---|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 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                         | 8  |
| 2.4 信息披露方式                              | 8  |
| 2.5 其他相关资料                              | 9  |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况                 | 9  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 9  |
| 3.2 基金净值表现                              | 10 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 14 |
| §4 管理人报告                                | 14 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 14 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 15 |
| 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                 | 16 |
| 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                 | 17 |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明        | 17 |
| 4.10 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      | 17 |
| §5 托管人报告                                | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 17 |
| 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 | 18 |
| 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      | 18 |
| §6 审计报告                                 | 18 |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 18 |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 18 |
| §7 年度财务报表                               | 21 |
| 7.1 资产负债表                               | 21 |
| 7.2 利润表                                 | 23 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 24 |
| 7.4 报表附注                                | 26 |
| §8 投资组合报告                               | 50 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 50 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 51 |
| 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       | 51 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 51 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 51 |
| 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      | 52 |
| 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   | 52 |
| 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   | 52 |
| 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      | 52 |

|   |    |
|---|----|
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....          | 52 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....          | 53 |
| 8.12 投资组合报告附注.....                      | 53 |
| §9 基金份额持有人信息.....                       | 54 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 54 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 54 |
| 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情况.....   | 54 |
| §10 开放式基金份额变动.....                      | 55 |
| §11 重大事件揭示.....                         | 55 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 55 |
| 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.....   | 55 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 56 |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                     | 56 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 56 |
| 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.....      | 56 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 56 |
| 11.8 其他重大事件.....                        | 57 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 61 |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 61 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 62 |
| §13 备查文件目录.....                         | 63 |
| 13.1 备查文件目录.....                        | 63 |
| 13.2 存放地点.....                          | 63 |
| 13.3 查阅方式.....                          | 63 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                 |            |
|-----------------|-----------------|------------|
| 基金名称            | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金 |            |
| 基金简称            | 长安泓泽纯债          |            |
| 基金主代码           | 003731          |            |
| 基金运作方式          | 契约型开放式          |            |
| 基金合同生效日         | 2016年11月16日     |            |
| 基金管理人           | 长安基金管理有限公司      |            |
| 基金托管人           | 上海浦东发展银行股份有限公司  |            |
| 报告期末基金份额总额      | 237,525,506.22份 |            |
| 基金合同存续期         | 不定期             |            |
| 下属分级基金的基金简称     | 长安泓泽纯债债券A       | 长安泓泽纯债债券C  |
| 下属分级基金的交易代码     | 003731          | 003732     |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 237,496,378.60份 | 29,127.62份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求超越业绩比较基准的投资回报和长期稳健增值。   |
| 投资策略 | <p>1、久期策略</p> <p>久期是衡量债券价格变动对利率变动敏感性最重要和最主要的指标，也是影响组合收益率的重要因素。久期越长，债券价格对利率的变动就越敏感，债券价格的波动就越大。久期策略主要指综合各类经济和市场情况，确定债券组合的久期水平。</p> <p>2、类属配置策略</p> <p>类属配置策略即决定资金在不同类型债券间的分配，本基金类属配置策略包括两个层面：决定利率债和信用债的配置侧重和大概比例及细分类别债券的配置比例。</p> <p>本基金将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合市场上主要的债券配置机构资金的情况，</p> |

深入分析利率债和信用债的相对投资价值，确定利率债和信用债的配置侧重和大概比例，并根据市场的变化趋势，及时进行调整。

### 3、 期限结构策略

在对影响利率和信用风险变化的宏观和市场因素分析的基础上，本基金通过预测同一类型债券收益率曲线的形状和变化趋势，在久期策略和类属配置策略的基础上，确定债券组合最优的期限结构。具体来看，期限结构策略可细分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。骑乘策略是当收益率曲线比较陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，通过债券收益率的下滑，获得资本利得收益。

子弹策略是在收益率曲线较陡时，使投资组合中债券的久期集中于收益率曲线的一点；杠铃策略是在收益率曲线可能呈现两头下降较中间下降更多的蝶式变动时，使投资组合中债券的久期集中在收益率曲线的两端；梯式策略是在收益率曲线水平移动时，使投资组合中的债券久期均匀分布于收益率曲线上。

### 4、 信用债券投资策略

信用债券面临着债券本息无法按时兑付或无法部分或全部兑付的信用风险，同时信用风险带来了信用溢价，使信用债券的收益率高于同期限的利率债，因此信用债券成为决定债券组合收益率和风险水平的重要券种。

本基金拟通过承担适度的信用风险获取信用溢价收益以提升组合的收益率并控制组合的风险，信用债券投资策略包括个券精选、行业配置和动态调整三个层面。通过定性和定量分析，精选信用评级较高、信用风险小、收益率相对较高的个券，再通过筛选行业并在不同行业中分散配置以分散信用债券的风险，最后密切跟踪个券和发债主体的情况，对于经营或信用可能恶化的个券，及时卖出。

定性分析主要包括对企业性质和内部治理情况、财务管理的风格、企业的盈利模式、企业在产业链中的位

置和地位、产品竞争力和企业核心优势等企业内部因素分析，以及企业的股东背景、政府对企业的支持、银企关系、企业对国家或地方的重要程度等外部支持因素分析。定量分析主要包括资本结构分析、现金获取能力分析、盈利能力分析和偿债能力分析等。同时，关注个券的债券条款和特征，包括其信用评级、收益率（到期收益率、票面利率、利息支付方式和利息税务处理）、剩余期限、久期、凸性、流动性（发行总量、流通量、上市时间）等指标。综合上述因素决定是否将个券纳入备选债券库。

#### 5、 资产支持证券投资策略

本基金将深入研究资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率水平等基本因素，并且结合债券市场宏观分析的结果，评估资产支持证券的信用风险、利率风险、流动性风险和提前偿付风险，辅以量化模型分析，评估其内在价值进行投资。

#### 6、 证券公司短期公司债券投资策略

本基金将根据审慎原则，密切跟踪发行主体的资产负债率和现金流等基本因素以及债券的信用评级、收益率和投资人数及流动性情况，重点投资具有较好流动性和具有较高相对投资价值的品种，力求在控制风险的前提下提高投资收益。

#### 7、 中小企业私募债投资策略

本基金将根据审慎原则，密切跟踪中小企业私募债的信用风险变化和流动性情况，通过对中小企业私募债进行信用评级控制，通过对投资单只中小企业私募债的比例限制，严格控制风险，并充分考虑单只中小企业私募债对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。同时，本基金持续跟踪所投债券发债主体的经营情况和财务指标等，分析评估发债主体未来的偿债能力，对中小企业私募债的信用风险进行评估并及时作出反应。

#### 8、 国债期货投资策略

本基金主要利用国债期货管理债券组合的久期、流动

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>性和风险水平。基金管理人将根据法律法规的规定，结合对宏观经济运行情况和政策趋势的分析，预测债券市场变动趋势。通过对国债期货的流动性、波动水平、风险收益特征、国债期货和现货基差、套期保值的有效性等指标进行持续跟踪，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>9、 回购套利策略</p> <p>本基金将在考虑债券投资的风险收益情况以及回购成本等因素的情况下，在风险可控及法律法规允许的范围内，通过债券回购融入和滚动短期资金，投资于收益率高于融资成本的债券等其他金融工具，获得杠杆放大收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 中国债券综合全价指数的收益率。  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金，属于较低风险的投资品种。   |

### 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      | 长安基金管理有限公司             | 上海浦东发展银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名                     | 李永波                      |
|         | 联系电话                   | 021-20329700             |
|         | 电子邮箱                   | service@changanfunds.com |
| 客户服务电话  | 400-820-9688           | 95528                    |
| 传真      | 021-50598018           | 021-63602540             |
| 注册地址    | 上海市虹口区丰镇路806号3幢371室    | 上海市中山东一路12号              |
| 办公地址    | 上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹大厦16楼 | 上海市北京东路689号              |
| 邮政编码    | 201204                 | 200120                   |
| 法定代表人   | 万跃楠                    | 高国富                      |

### 2.4 信息披露方式



|                     |                             |
|---------------------|-----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》                     |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.changanfunds.com |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹大厦16楼      |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                  | 办公地址                     |
|--------|---------------------|--------------------------|
| 会计师事务所 | 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市南京西路1266号恒隆广场1期50楼    |
| 注册登记机构 | 长安基金管理有限公司          | 上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16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 | 2017年        |           | 2016-11-16（基金合同生效日）<br>-2016年12月31日 |           |
|---------------|--------------|-----------|-------------------------------------|-----------|
|               | 长安泓泽纯债债券A    | 长安泓泽纯债债券C | 长安泓泽纯债债券A                           | 长安泓泽纯债债券C |
| 本期已实现收益       | 8,694,568.69 | -1,197.33 | 655,180.06                          | 166.61    |
| 本期利润          | 6,663,642.07 | -3,477.84 | 655,180.06                          | 166.61    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0355       | -0.0244   | 0.0033                              | 0.0032    |
| 本期加权平均净值利润率   | 3.49%        | -2.45%    | 0.33%                               | 0.32%     |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.77%        | -0.14%    | 0.33%                               | 0.32%     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017年末       |           | 2016年末                              |           |

|                     |                |           |                |           |
|---------------------|----------------|-----------|----------------|-----------|
| 期末可供分配利润            | 7,382,766.01   | 53.21     | 655,180.06     | 166.61    |
| 期末可供分配基金份额利润        | 0.0311         | 0.0018    | 0.0033         | 0.0032    |
| 期末基金资产净值            | 244,879,144.61 | 29,180.83 | 200,663,949.67 | 52,946.24 |
| 期末基金份额净值            | 1.0311         | 1.0018    | 1.0033         | 1.0032    |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | 2017年末         |           | 2016年末         |           |
| 基金份额累计净值增长率         | 3.11%          | 0.18%     | 0.33%          | 0.32%     |

1、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。

2、上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。

### 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

长安泓泽纯债债券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      | 0.39%    | 0.03%       | -1.15%     | 0.06%         | 1.54% | -0.03% |
| 过去六个月      | 1.58%    | 0.03%       | -1.30%     | 0.05%         | 2.88% | -0.02% |
| 过去一年       | 2.77%    | 0.17%       | -3.38%     | 0.06%         | 6.15% | 0.11%  |
| 自基金合同生效起至今 | 3.11%    | 0.16%       | -5.28%     | 0.09%         | 8.39% | 0.07%  |

本基金整体业绩比较基准为：中国债券综合全价指数的收益率。

长安泓泽纯债债券C

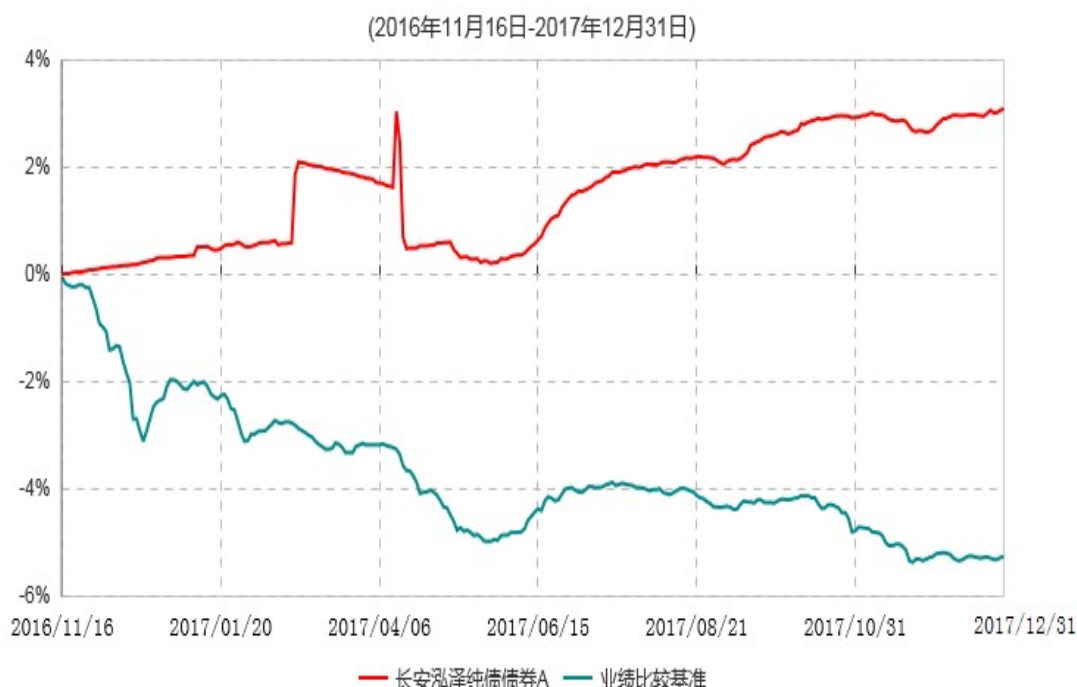
| 阶段 | 份额净 | 份额 | 业绩比较 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|-----|----|------|-------|-----|-----|
|----|-----|----|------|-------|-----|-----|

|            | 值增长率①  | 净值增长率标准差② | 基准收益率③ | 准收益率标准差④ |       |        |
|------------|--------|-----------|--------|----------|-------|--------|
| 过去三个月      | 0.43%  | 0.03%     | -1.15% | 0.06%    | 1.58% | -0.03% |
| 过去六个月      | 1.59%  | 0.03%     | -1.30% | 0.05%    | 2.89% | -0.02% |
| 过去一年       | -0.14% | 0.13%     | -3.38% | 0.06%    | 3.24% | 0.07%  |
| 自基金合同生效起至今 | 0.18%  | 0.12%     | -5.28% | 0.09%    | 5.46% | 0.03%  |

本基金整体业绩比较基准为：中国债券综合全价指数的收益率。

### 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

长安泓泽纯债债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



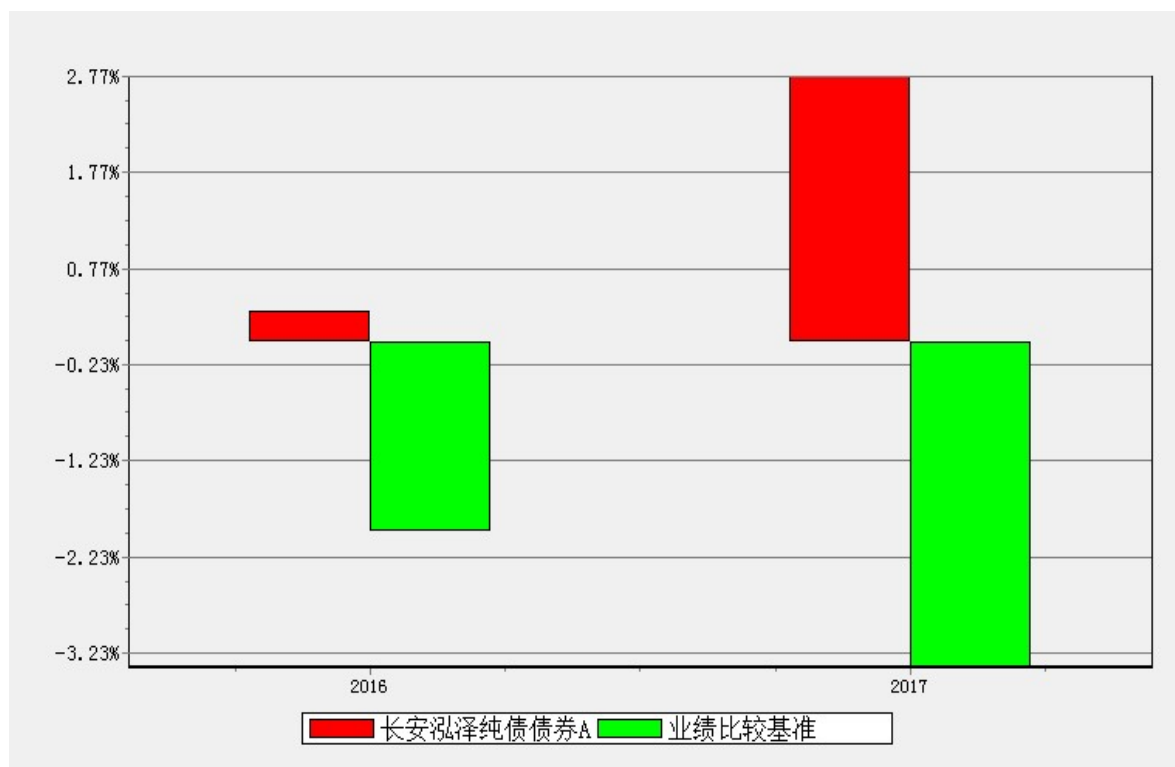
本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 16 日，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月为建仓期，截止到建仓期结束时，本基金的各项投资组合比例已符合基金合同的相关规定。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满一年，图示日期为 2016 年 11 月 16 日至 2017 年 12 月 31 日。

长安泓泽纯债债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

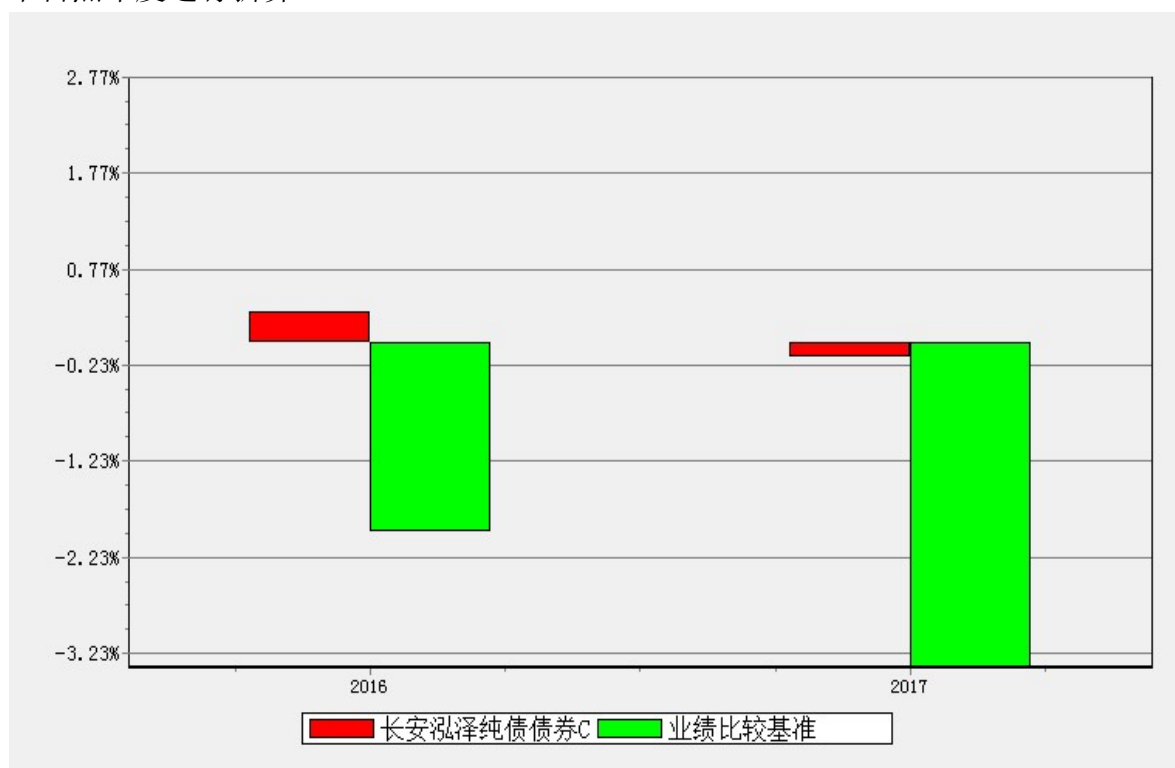


本基金基金合同生效日为 2016 年 11 月 16 日，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月为建仓期，截止到建仓期结束时，本基金的各项投资组合比例已符合基金合同的相关规定。基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间已满一年，图示日期为 2016 年 11 月 16 日至 2017 年 12 月 31 日。

### 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



本基金合同生效日为 2016 年 11 月 16 日，合同生效日当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



本基金合同生效日为 2016 年 11 月 16 日，合同生效日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

本基金过去二年未进行利润分配。

## § 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

长安基金管理有限公司成立于2011年9月5日，公司的股东分别为：长安国际信托股份有限公司、上海景林投资发展有限公司、上海恒嘉美联发展有限公司、五星控股集团有限公司、兵器装备集团财务有限责任公司。截至2017年12月31日，本基金管理人共管理长安宏观策略混合型证券投资基金、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安货币市场证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫益增强混合型证券投资基金、长安泓泽纯债债券型证券投资基金、长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫恒回报混合型证券投资基金、长安鑫珪主题轮动混合型证券投资基金、长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金、长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金、长安裕泰灵活配置混合型证券投资基金等14只证券投资基金。

#### 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<br>(助理) 期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明  |
|----|------|----------------------|------|------------|---|
|    |      | 任职日期                 | 离任日期 |            |   |
| 乔哲 | 基金经理 | 2016-11-16           | -    | 20年        | 山东大学工商管理硕士学位，曾任中国农业发展银行山东省分行资金计划处资金科科长、中国农业发展银行总行资金计划部债券发行与资金交易负责人、东亚银行（中国）有限公司资金中心高级助理经理、法国巴黎银行（中国）有限公司固定收益部债务资本市场主管等职，2012年8月加入长安基金管理有限公司，现任长安基金管理有限公司联席投资总监，长安鑫益增强混合型证券投资基金、长安泓泽纯债债券型证 |

|  |  |  |  |  |             |
|--|--|--|--|--|-------------|
|  |  |  |  |  | 券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|-------------|

- 1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会关于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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、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、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真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

在本报告期内，本基金严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，公平对待所管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人树立价值投资理念，设置合理的组织架构和科学的投资决策体系，确保投资、研究、交易各个环节的独立性。同时，建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库，共享研究成果，在确保投资组合间的信息隔离与保密的情况下，保证建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中采用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节，并经过严格的报告和审批程序，防范和控制异常交易。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长安基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 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

2017年，宏观经济继续稳定增长，CPI涨幅较缓，本币汇率稳中有升。但期间金融市场仍发生一些扰动因素。主要体现在：货币市场流动性仍较紧张，基本维持紧平衡状

态；市场在监管趋严情况下有所反应，债市持续动荡调整；权益类市场也在上升过程中发生震荡；同时美联储加息的影响也继续传导至我国市场。期间监管部门、中央银行采取措施稳定市场预期，并通过公开市场操作注入流动性，使得年末时市场趋于稳定。根据宏观经济和货币政策发展趋势，以及金融市场监管环境、流动性、市场风险、信用风险发生的变化，本基金把风险控制和流动性管理放在首位，尤其是流动性风险、信用风险和市场风险，及时调整各项资产配置比例，积极管理组合持仓，保证了基金正常运营和投资者利益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金A类份额和C类份额的单位净值增长率分别为2.77%和-0.14%，同期本基金的业绩比较基准的增长率为-3.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下个年度，我们将密切观察宏观经济增长力度和货币政策执行情况，继续关注影响金融市场流动性和货币市场、债券市场的关键因素，以及其他市场的变化所带来的影响，积极管理和控制组合中各类资产的流动性风险、信用风险、市场风险，根据宏观经济和金融市场演变情况，适时调整组合，保障基金良好运营和投资者的利益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层和上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 积极响应中国证监会关于加强市场监管的号召，采取外部法律顾问授课和内部监察部门培训相结合的方式，多次组织全体员工开展《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》及其配套法规、公司内控制度等的学习。通过上述学习宣传活动，使员工加深了对法律法规的认识，并进一步将法律法规与内控制度落实到日常工作中，确保其行为守法合规、严格自律，恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

(2) 继续完善公司治理结构，严格按照现代企业制度的要求，以规范经营运作、保护基金份额持有人利益为目标，建立、健全了组织结构和运行机制，明确界定董事会、监事会职责范围，认真贯彻了独立董事制度，重大经营决策的制定都征得了所有独立董



事的同意，保证了独立董事在公司法人治理结构中作用的切实发挥，保证了各项重大决策的客观公正。

(3) 不断完善规章制度体系，根据国家的有关法律法规和基金管理公司实际运作的要求，对现有的规章制度体系不断进行完善，对经营管理活动的决策、执行和监督程序进行规范，明确不同决策层和执行层的权利与责任，细化研究、投资、交易等各项工作流程，为杜绝人为偏差、合法合规运作、强化风险控制提供了制度保证。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和程序，清算登记部按照管理层批准后的估值政策进行估值。对于在交易所上市的证券(除固定收益品种外)，采用交易所发布的行情信息来估值。对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格进行估值。除了投资总监外，其他基金经理不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本基金本报告期审计报告为标准无保留意见审计报告。

#### 4.10 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

本基金从2017年2月28日至2017年5月4日连续45个工作日出现基金资产净值低于五千万情形。

本基金本报告期内未出现连续20个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。基金管理人已持续关注并拟采取适当措施。

## § 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，上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“本托管人”)在对长安泓泽纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

## 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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对长安泓泽纯债债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

## 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

本报告期内，由长安基金管理有限公司编制本托管人复核的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）、投资组合报告等内容真实、准确、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     | 毕马威华振审字第1801128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 | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金全体基金份额持有人   |
| 审计意见    | 我们审计了后附的长安泓泽纯债债券型证券投资基金(以下简称“长安泓泽纯债债券基金”)财务报表,包括2016年12月31日及2017年12月31日的资产负债表、自2016年11月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间及2017年度利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了长安泓泽纯 |

|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | <p>债债券基金2016年12月31日及2017年12月31日的财务状况以及自2016年11月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间及2017年度的经营成果及基金净值变动情况。</p>   |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于长安泓泽纯债债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。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>   |
| 强调事项            | -  |
| 其他事项            | -  |
| 其他信息            | <p>长安泓泽纯债债券基金管理人长安基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括长安泓泽纯债债券基金2017年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>长安泓泽纯债债券基金管理人长安基金管理有限公司管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、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。在编制财</p>  |

|                        |  |
|------------------------|--|
|                        | <p>务报表时，长安泓泽纯债债券基金管理人长安基金管理有限公司管理层负责评估长安泓泽纯债债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非长安泓泽纯债债券基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。长安泓泽纯债债券基金管理人长安基金管理有限公司治理层负责监督长安泓泽纯债债券基金的财务报告过程。</p>   |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，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。（3）评价长安泓泽纯债债券基金管理人长安基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对长安泓泽纯债债券基金管理人长安基金管理有限公司管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长安泓泽纯债债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在</p> |

|           |  |
|-----------|--|
|           | 重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长安泓泽纯债债券基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 |
| 会计师事务所的名称 | 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)  |
| 注册会计师的姓名  | 黄小熠 水青   |
| 会计师事务所的地址 | 上海市南京西路1266号恒隆广场1期50楼  |
| 审计报告日期    | 2018-03-29   |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长安泓泽纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 19,458,257.16      | 199,099,161.89      |
| 结算备付金      |         | -                  | 1,659,090.91        |
| 存出保证金      |         | 557.29             | -                   |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 226,929,560.00     | -                   |
| 其中：股票投资    |         | -                  | -                   |
| 基金投资       |         | -                  | -                   |
| 债券投资       |         | 207,225,560.00     | -                   |
| 资产支持证券投资   |         | 19,704,000.00      | -                   |
| 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      | 19,998,150.00              | -                           |
| 应收证券清算款         |              | -                          | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5      | 3,805,625.73               | 49,368.86                   |
| 应收股利            |              | -                          | -                           |
| 应收申购款           |              | 2,519.34                   | -                           |
| 递延所得税资产         |              | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6      | -                          | -                           |
| 资产总计            |              | 270,194,669.52             | 200,807,621.66              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b>   | <b>本期末<br/>2017年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2016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       |              | 24,999,762.50              | -                           |
| 应付证券清算款         |              | -                          | -                           |
| 应付赎回款           |              | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬         |              | 62,306.57                  | 50,939.58                   |
| 应付托管费           |              | 20,768.87                  | 16,979.87                   |
| 应付销售服务费         |              | 2.54                       | 6.30                        |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7      | 3,777.50                   | 900.00                      |
| 应交税费            |              | -                          | -                           |
| 应付利息            |              | 20,726.10                  | -                           |
| 应付利润            |              | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |              | -                          | -                           |
| 其他负债            | 7.4.7.8      | 179,000.00                 | 21,900.00                   |
| 负债合计            |              | 25,286,344.08              | 90,725.75                   |
| <b>所有者权益:</b>   |              |                            |                             |
| 实收基金            | 7.4.7.9      | 237,525,506.22             | 200,061,549.24              |
| 未分配利润           | 7.4.7.1<br>0 | 7,382,819.22               | 655,346.67                  |

|            |  |                |                |
|------------|--|----------------|----------------|
| 所有者权益合计    |  | 244,908,325.44 | 200,716,895.91 |
| 负债和所有者权益总计 |  | 270,194,669.52 | 200,807,621.66 |

1、报告截止日2017年12月31日，本基金A类份额和C类份额的单位净值分别为1.0311元和1.0018元，基金份额分别为237,496,378.60份和29,127.62份。

2、本基金基金合同生效日为2016年11月16日，本财务报表的实际编制期间为2017年1月1日至2017年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：长安泓泽纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号          | 本期2017年01月01日至2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年11月16日（基金合同生效日）至2016年12月31日 |
|-------------------|--------------|---------------------------|---|
| 一、收入              |              | 7,859,898.69              | 775,813.56                                  |
| 1. 利息收入           |              | 11,660,254.30             | 775,813.56                                  |
| 其中：存款利息收入         | 7.4.7.1<br>1 | 370,447.10                | 109,591.94                                  |
| 债券利息收入            |              | 9,809,243.25              | -   |
| 资产支持证券利息收入        |              | 932,458.36                | -   |
| 买入返售金融资产收入        |              | 548,105.59                | 666,221.62                                  |
| 其他利息收入            |              | -                         | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |              | -1,827,684.28             | -   |
| 其中：股票投资收益         | 7.4.7.1<br>2 | -                         | -   |
| 基金投资收益            |              | -                         | -   |
| 债券投资收益            | 7.4.7.1<br>3 | -1,827,684.28             | -   |

|                            |                |               |            |
|----------------------------|----------------|---------------|------------|
| 资产支持证券投资收益                 | 7.4.7.1<br>3.5 | -             | -          |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.1<br>4   | -             | -          |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.1<br>5   | -             | -          |
| 股利收益                       |                | -             | -          |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)     | 7.4.7.1<br>6   | -2,033,207.13 | -          |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)         |                | -             | -          |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列)         | 7.4.7.1<br>7   | 60,535.80     | -          |
| <b>减：二、费用</b>              |                | 1,199,734.46  | 120,466.89 |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.<br>2.1 | 573,416.04    | 73,909.18  |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.<br>2.2 | 191,138.72    | 24,636.41  |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.<br>2.3 | 147.28        | 6.30       |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.1<br>8   | 5,812.14      | -          |
| 5. 利息支出                    |                | 238,328.26    | -          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |                | 238,328.26    | -          |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.1<br>9   | 190,892.02    | 21,915.00  |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |                | 6,660,164.23  | 655,346.67 |
| 减：所得税费用                    |                | -             | -          |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |                | 6,660,164.23  | 655,346.67 |

## 7.3 所有者权益(基金净值)变动表



会计主体：长安泓泽纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                                    | 本期<br>2017年01月01日至2017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)                        | 200,061,549.24                              | 655,346.67    | 200,716,895.91  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -   | 6,660,164.23  | 6,660,164.23    |
| 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)      | 37,463,956.98                               | 67,308.32     | 37,531,265.30   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 241,198,408.62                              | 1,323,093.89  | 242,521,502.51  |
| 2. 基金赎回款                               | -203,734,451.64                             | -1,255,785.57 | -204,990,237.21 |
| 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)                        | 237,525,506.22                              | 7,382,819.22  | 244,908,325.44  |
| 项 目                                    | 上年度可比期间<br>2016年11月16日(基金合同生效日)至2016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)                        | 200,061,549.24                              | -             | 200,061,549.24  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -   | 655,346.67    | 655,346.67      |
| 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)      | -   | -             | -               |

|  |                |            |                |
|--|----------------|------------|----------------|
| 其中：1. 基金申购款                            | -              | -          | -              |
| 2. 基金赎回款                               | -              | -          | -              |
| 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）                        | 200,061,549.24 | 655,346.67 | 200,716,895.91 |

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：

袁丹旭

李卫

欧鹏

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

长安泓泽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”）《关于核准长安泓泽纯债债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2016] 2513号文）的批准，由长安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长安泓泽纯债债券型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2016年11月16日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为200,061,549.24份基金份额。本基金的基金管理人为长安基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安泓泽纯债债券型证券投资基金基金合同》和《长安泓泽纯债债券型证券投资基金招募说明书》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，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、证券公司短期公司债券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、国债期货、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金债券资产占基金资产的比例不低于80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金所持有的现金或者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国债券综合全价指数的收益率。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年12月31日及2017年12月31日的财务状况、自2016年11月16日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间及2017年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2017年1月1日至2017年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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金目前持有的债券投资和资产支持证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变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

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；

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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

所转移金融资产的账面价值

因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等)，并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

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的事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，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。

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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于年末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)、债券投资收益/(损失)和衍生工具收益/(损失)按相关金融资产于处置日以成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间、存款本金和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《长安泓泽纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金同份额类别每份基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下,基金管理人可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动

转为相应类别的基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

#### 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

本基金在本年度及自2016年11月16日（基金合同生效日）至2016年12月31日止期间未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（以下简称“估值指引”）的处理标准，本基金自2017年12月28日起，对本基金持有的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票的估值方法进行调整，参考估值指引进行估值。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度及自2016年11月16日（基金合同生效日）至2016年12月31日止期间均未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015]125号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起, 在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点, 建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人, 纳入试点范围, 由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日(含)以后, 资管产品管理人(以下称管理人)运营基金过程中发生的增值税应税行为, 以管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人)通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价, 暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入, 由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起, 对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: 持股期限在1个月以内(含1个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在1个月以上至1年(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的, 暂减按25%计入应纳税所得额, 股权登记日在2015年9月8日及以后的, 暂免征收个人所得税。

(e) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得, 暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益, 由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时, 对香港市场投资者按照10%的税率代扣所得税; 或发行债券的企业向该内地基金分配利息时, 对香港市场投资者按照7%的税率代扣所得税, 并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时, 不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(f) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

(g) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入, 暂不征收企业所得税。

## 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>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 19,458,257.16      | 199,099,161.89      |
| 定期存款         | -                  | -                   |
| 其中：存款期限1-3个月 | -                  | -                   |
| 其他存款         | -                  | -                   |
| 合计           | 19,458,257.16      | 199,099,161.89      |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末2017年12月31日  |                |               |
|---------------|-------|-----------------|----------------|---------------|
|               |       | 成本              | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | -               | -              | -             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -               | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 27,602,201.42   | 27,155,560.00  | -446,641.42   |
|               | 银行间市场 | 181,367,201.32  | 180,070,000.00 | -1,297,201.32 |
|               | 合计    | 208,969,402.74  | 207,225,560.00 | -1,743,842.74 |
| 资产支持证券        |       | 19,993,364.39   | 19,704,000.00  | -289,364.39   |
| 基金            |       | -               | -              | -             |
| 其他            |       | -               | -              | -             |
| 合计            |       | 228,962,767.13  | 226,929,560.00 | -2,033,207.13 |
| 项目            |       | 上年度末2016年12月31日 |                |               |
|               |       | 成本              | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | -               | -              | -             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -               | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | -               | -              | -             |
|               | 银行间市场 | -               | -              | -             |
|               | 合计    | -               | -              | -             |

|        |   |   |   |
|--------|---|---|---|
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金     | - | - | - |
| 其他     | - | - | - |
| 合计     | - | - | - |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末2017年12月31日  |           |
|-------|-----------------|-----------|
|       | 账面余额            | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -               | -         |
| 银行间市场 | 19,998,150.00   | -         |
| 合计    | 19,998,150.00   | -         |
| 项目    | 上年度末2016年12月31日 |           |
|       | 账面余额            | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -               | -         |
| 银行间市场 | -               | -         |
| 合计    | -               | -         |

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|----------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 9,282.02           | 48,547.60           |
| 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  | 0.33         | 821.26    |
| 应收债券利息     | 3,730,732.77 | -         |
| 应收买入返售证券利息 | 19,659.78    | -         |
| 应收申购款利息    | 28,854.94    | -         |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -            | -         |
| 其他         | 17,095.89    | -         |
| 合计         | 3,805,625.73 | 49,368.86 |

其他为应收资产支持证券利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 900.00             | 900.00              |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,877.50           | -                   |
| 合计          | 3,777.50           | 900.00              |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | -                  | -                   |
| 预提费用        | 179,000.00         | 21,500.00           |
| 其他应付        | -                  | 400.00              |
| 合计          | 179,000.00         | 21,900.00           |

预提费用包含预提信息披露费110,000.00元、预提审计费60,000.00元和预提账户维护费9,000.00元。

## 7.4.7.9 实收基金

## 7.4.7.9.1 长安泓泽纯债债券A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(长安泓泽纯债债券A) | 本期2017年01月01日至2017年12月31日 |                 |
|-------------------|---------------------------|-----------------|
|                   | 基金份额(份)                   | 账面金额            |
| 上年度末              | 200,008,769.61            | 200,008,769.61  |
| 本期申购              | 239,856,747.47            | 239,856,747.47  |
| 本期赎回(以“-”号填列)     | -202,369,138.48           | -202,369,138.48 |
| 本期末               | 237,496,378.60            | 237,496,378.60  |

## 7.4.7.9.2 长安泓泽纯债债券C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(长安泓泽纯债债券C) | 本期2017年01月01日至2017年12月31日 |               |
|-------------------|---------------------------|---------------|
|                   | 基金份额(份)                   | 账面金额          |
| 上年度末              | 52,779.63                 | 52,779.63     |
| 本期申购              | 1,341,661.15              | 1,341,661.15  |
| 本期赎回(以“-”号填列)     | -1,365,313.16             | -1,365,313.16 |
| 本期末               | 29,127.62                 | 29,127.62     |

1、申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金于2016年11月11日至2016年11月11日募集，募集期间净认购资金人民币200,061,549.24元，认购资金在募集期间产生的利息人民币0元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计200,061,549.24份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验资，并出具了毕马威华振验字第1600961号验资报告。

## 7.4.7.10 未分配利润

## 7.4.7.10.1 长安泓泽纯债债券A

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----|-------|-------|---------|
|    |       |       |         |

|                |               |               |               |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| (长安泓泽纯债债券A)    |               |               |               |
| 上年度末           | 655,180.06    | -             | 655,180.06    |
| 本期利润           | 8,694,568.69  | -2,030,926.62 | 6,663,642.07  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 231,632.86    | -167,688.98   | 63,943.88     |
| 其中：基金申购款       | 1,496,404.77  | -175,454.93   | 1,320,949.84  |
| 基金赎回款          | -1,264,771.91 | 7,765.95      | -1,257,005.96 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 9,581,381.61  | -2,198,615.60 | 7,382,766.01  |

## 7.4.7.10.2 长安泓泽纯债债券C

单位：人民币元

| 项目<br>(长安泓泽纯债债券C) | 已实现部分     | 未实现部分     | 未分配利润合计   |
|-------------------|-----------|-----------|-----------|
| 上年度末              | 166.61    | -         | 166.61    |
| 本期利润              | -1,197.33 | -2,280.51 | -3,477.84 |
| 本期基金份额交易产生的变动数    | 1,344.78  | 2,019.66  | 3,364.44  |
| 其中：基金申购款          | 2,410.32  | -266.27   | 2,144.05  |
| 基金赎回款             | -1,065.54 | 2,285.93  | 1,220.39  |
| 本期已分配利润           | -         | -         | -         |
| 本期末               | 314.06    | -260.85   | 53.21     |

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期2017年01月01日至2017年12月31日 | 上年度可比期间2016年11月16日（基金合同生效日）至2016年12月31日 |
|----------|---------------------------|---|
| 活期存款利息收入 | 322,854.80                | 107,352.16                              |
| 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 | 18,658.59  | 2,239.78   |
| 其他        | 28,933.71  | -          |
| 合计        | 370,447.10 | 109,591.94 |

其他包括应收申购款利息收入人民币28,854.94元和存出保证金利息收入人民币78.77元。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内未持有股票资产。

#### 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>2017年01月01日至2<br>017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年11月16日（基金合同生效<br>日）至2016年12月31日 |
|---------------------------------------|-----------------------------------|---|
| 债券投资收益——买卖债券<br>（、债转股及债券到期兑付）<br>差价收入 | -1,827,684.28                     | -   |
| 债券投资收益——赎回差价<br>收入                    | -                                 | -   |
| 债券投资收益——申购差价<br>收入                    | -                                 | -   |
| 合计                                    | -1,827,684.28                     | -   |

##### 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>2017年01月01日至2<br>017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年11月16日（基金合同生效<br>日）至2016年12月31日 |
|---------------------------|-----------------------------------|---|
| 卖出债券（、债转股及债券<br>到期兑付）成交总额 | 185,820,104.97                    | -   |
| 减：卖出债券（、债转股及              | 179,530,054.33                    | -   |

|              |                  |   |
|--------------|------------------|---|
| 债券到期兑付) 成本总额 |                  |   |
| 减: 应收利息总额    | 8, 117, 734. 92  | - |
| 买卖债券差价收入     | -1, 827, 684. 28 | - |

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内未进行贵金属投资交易。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未持有衍生工具。

#### 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>2017年01月01日至<br>2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年11月16日(基金合同生效<br>日)至2016年12月31日 |
|------------|-----------------------------------|---|
| 1. 交易性金融资产 | -2, 033, 207. 13                  | -   |
| ——股票投资     | -                                 | -   |
| ——债券投资     | -1, 743, 842. 74                  | -   |
| ——资产支持证券投资 | -289, 364. 39                     | -   |
| ——基金投资     | -                                 | -   |
| ——贵金属投资    | -                                 | -   |
| ——其他       | -                                 | -   |

|         |               |   |
|---------|---------------|---|
| 2. 衍生工具 | -             | - |
| ——权证投资  | -             | - |
| 3. 其他   | -             | - |
| 合计      | -2,033,207.13 | - |

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2017年01月01日至<br>2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年11月16日（基金合同生效<br>日）至2016年12月31日 |
|------------|-----------------------------------|---|
| 基金赎回费收入    | 51,260.04                         | -   |
| 其他收入_其他    | 9,180.00                          | -   |
| 其他收入_转换费收入 | 95.76                             | -   |
| 合计         | 60,535.80                         | -   |

本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额最少25%归入基金资产。

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年01月01日至<br>2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年11月16日（基金合同生效<br>日）至2016年12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|---|
| 交易所市场交易费用 | 89.64                             | -   |
| 银行间市场交易费用 | 5,722.50                          | -   |
| 合计        | 5,812.14                          | -   |

## 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2017年01月01日至<br>2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年11月16日（基金合同生效<br>日）至2016年12月31日 |
|-------|-----------------------------------|---|
| 审计费用  | 60,000.00                         | -   |
| 信息披露费 | 90,000.00                         | 20,000.00                                       |



|       |            |           |
|-------|------------|-----------|
| 汇划手续费 | 5,667.02   | 15.00     |
| 账户维护费 | 34,500.00  | -         |
| 其他费用  | 725.00     | 400.00    |
| 帐户维护费 | -          | 1,500.00  |
| 合计    | 190,892.02 | 21,915.00 |

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

2018年1月，经长安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]2440号文批复同意，本公司原股东上海景林投资发展有限公司将其持有的本公司25.93%股权转让给杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）。本次股权转让后，本公司的股东及股权比例为：长安国际信托股份有限公司持有本公司全部股权的29.63%，杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）持有本公司全部股权的25.93%，上海恒嘉美联发展有限公司持有本公司全部股权的24.44%，五星控股集团有限公司持有本公司全部股权的13.33%，兵器装备集团财务有限责任公司持有本公司全部股权的6.67%。

#### 7.4.9 关联方关系

本基金本报告期内未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

| 关联方名称          | 与本基金的关系               |
|----------------|-----------------------|
| 长安基金管理有限公司     | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 长安国际信托股份有限公司   | 基金管理人的股东              |
| 上海景林投资发展有限公司   | 基金管理人的股东              |
| 上海恒嘉美联发展有限公司   | 基金管理人的股东              |
| 五星控股集团有限公司     | 基金管理人的股东              |
| 兵器装备集团财务有限责任公司 | 基金管理人的股东              |
| 长安财富资产管理有限公司   | 基金管理人的子公司             |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 基金托管人                 |

|                   |              |
|-------------------|--------------|
| 长安裕丰港股通精选1号资产管理计划 | 基金管理人管理的专户产品 |
|-------------------|--------------|

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。并以一般交易价格为定价基础。

#### 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

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无应支付给关联方的佣金。

###### 7.4.10.1.4 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.10.1.5 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 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<br>2017年01月01日<br>至2017年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2016年11月16日（基金合同<br>生效日）至2016年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 573,416.04                            | 73,909.18                                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 168.71                                | -   |

1、支付基金管理人长安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.3%/当年天数；

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2017年01月01日<br>至2017年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2016年11月16日（基金合同生<br>效日）至2016年12月31日 |
|----------------|---------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 191,138.72                            | 24,636.41                                       |

支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/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<br>联方名称 | 本期<br>2017年01月01日至2017年12月31日               |           |       |
|--------------------|---|-----------|-------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |           |       |
|                    | 长安泓泽纯债债券A                                   | 长安泓泽纯债债券C | 合计    |
| 长安基金管理有限公司         | -   | 64.91     | 64.91 |
| 合计                 | -   | 64.91     | 64.91 |
| 获得销售服务费的各关<br>联方名称 | 上年度可比期间<br>2016年11月16日（基金合同生效日）至2016年12月31日 |           |       |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                            |           |       |
|                    | 长安泓泽纯债债券A                                   | 长安泓泽纯债债券C | 合计    |
| 长安基金管理有限公司         | -   | 6.30      | 6.30  |
| 合计                 | -   | 6.30      | 6.30  |

本基金A类不计算基金销售服务费。本基金C类支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.1%/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

本基金自2017年1月1日至2017年12月31日止没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金本报告期末无其他关联方投资本基金的情况。

#### 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>2017年01月01日至<br>2017年12月31日 |                | 上年度可比期间<br>2016年11月16日(基金合同生<br>效日)至2016年12月31日 |            |
|----------------|-----------------------------------|----------------|---|------------|
|                | 期末余<br>额                          | 当期利<br>息收入     | 期末余额  | 当期利息收<br>入 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 19,458,<br>257.16                 | 322,85<br>4.80 | 199,099,161.<br>89                              | 107,352.16 |

本基金通过“浦发银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2017年12月31日的相关余额为人民币0.00元(2016年12月31日：人民币1,659,090.91元)。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金自2017年1月1日至2017年12月31日止未在承销期内购入由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内无其他关联交易事项说明。

#### 7.4.11 利润分配情况—非货币市场基金

本基金在本报告期末进行过利润分配。

#### 7.4.12 期末(2017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

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

### 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

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        |
|-----------|--------------|------------|--------|---------|---------------|
| 101759042 | 17碧水源MTN002  | 2018-01-03 | 98.80  | 200,000 | 19,760,000.00 |
| 101556051 | 15岳阳城投MTN001 | 2018-01-03 | 97.26  | 50,000  | 4,863,000.00  |
| 合计        |              |            |        | 250,000 | 24,623,000.00 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

### 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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人按照“健全、合理、制衡、独立”的原则，建立了合规与风险管理委员会（董事会层面）、督察长、监察稽核部和相关部门构成的全方位、多层级的合规风险管理架构。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理贯穿日常经营活动的整个过程，渗透到各个业务环节，覆盖所有部门和岗位，建立了集风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告为一体的风险管理机制，全面、及时识别、分析和评估各类风险，有效防范日常经营和基金运作过程中可能面临的各种风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。包括：

1、债务人违约风险：本基金投资于债券市场，如遇发债主体信用状况恶化，信用评级下降，会导致债券价格下降进而影响基金财产收益水平。严重的，甚至出现到期不能履行合约进行兑付，将给本基金带来损失。

2、交易对手方违约风险：当固定收益证券交易对手违约时，将直接导致基金资产的损失，或导致本基金不能及时抓住市场机会，对投资收益产生影响。

#### 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>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | 19,934,000.00      | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 3,295,380.00       | -                   |
| 合计     | 23,229,380.00      | -                   |

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等免评级债券。

根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。其中，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

#### 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>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 50,759,880.00      | -                   |
| AAA以下  | 152,940,300.00     | -                   |
| 未评级    | -                  | -                   |
| 合计     | 203,700,180.00     | -                   |

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等免评级债券。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

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，因此除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金主要投资于在交易所、银行间市场正常交易的债券、资产支持证券、逆回购等。基金组合资产中的主要投资标的属于《公开募集证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“流动性新规”）中定义的7个工作日可变现资产的范围，基金管理人每日对基金组合资产中的7个工作日可变现资产的可变价值进行审慎评估和测算，保证该基金每日净赎回申请不超过基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值。本基金主动投资于流动性新规中定义的流动性受限资产的市值不超过基金的资产净值的15%。本基金根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和流动性新规的要求严格执行开放式基金资金头寸管理的相关规定，每日保持不低于5%的现金和到期日在一年以内的政府债券（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等），以备支付基金份额持有人的赎回款。报告期内本基金组合资产的流动性和变现能力较强，流动性风险较小。

#### 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

利率的波动会导致证券价格和收益率的波动；同时，利率直接影响着债券的价格和收益率，从而影响着企业的融资成本和利润。本基金投资于债券，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末2017年12月<br>31日 | 1年以内              | 1-5年               | 5年以<br>上 | 不计息 | 合计                 |
|--------------------|-------------------|--------------------|----------|-----|--------------------|
| 资产                 |                   |                    |          |     |                    |
| 银行存款               | 19,458,25<br>7.16 | -                  | -        | -   | 19,458,25<br>7.16  |
| 存出保证金              | 557.29            | -                  | -        | -   | 557.29             |
| 交易性金融资产            | 66,215,68<br>0.00 | 160,713,88<br>0.00 | -        | -   | 226,929,56<br>0.00 |
| 买入返售金融资产           | 19,998,15<br>0.00 | -                  | -        | -   | 19,998,15<br>0.00  |

|                 |                    |                    |      |                  |                    |
|-----------------|--------------------|--------------------|------|------------------|--------------------|
| 应收利息            | -                  | -                  | -    | 3,805.62<br>5.73 | 3,805,625.<br>73   |
| 应收申购款           | -                  | -                  | -    | 2,519.34         | 2,519.34           |
| 资产总计            | 105,672,64<br>4.45 | 160,713,88<br>0.00 | -    | 3,808,14<br>5.07 | 270,194,66<br>9.52 |
| 负债              |                    |                    |      |                  |                    |
| 卖出回购金融资产款       | 24,999,76<br>2.50  | -                  | -    | -                | 24,999,76<br>2.50  |
| 应付管理人报酬         | -                  | -                  | -    | 62,306.57        | 62,306.57          |
| 应付托管费           | -                  | -                  | -    | 20,768.87        | 20,768.87          |
| 应付销售服务费         | -                  | -                  | -    | 2.54             | 2.54               |
| 应付交易费用          | -                  | -                  | -    | 3,777.50         | 3,777.50           |
| 应付利息            | -                  | -                  | -    | 20,726.10        | 20,726.10          |
| 其他负债            | -                  | -                  | -    | 179,000.0<br>0   | 179,000.00         |
| 负债总计            | 24,999,76<br>2.50  | -                  | -    | 286,581.5<br>8   | 25,286,34<br>4.08  |
| 利率敏感度缺口         | 80,672,88<br>1.95  | 160,713,88<br>0.00 | -    | 3,521,56<br>3.49 | 244,908,32<br>5.44 |
| 上年度末2016年12月31日 | 1年以内               | 1-5年               | 5年以上 | 不计息              | 合计                 |
| 资产              |                    |                    |      |                  |                    |
| 银行存款            | 199,099,16<br>1.89 | -                  | -    | -                | 199,099,16<br>1.89 |
| 结算备付金           | 1,659,090.<br>91   | -                  | -    | -                | 1,659,090.<br>91   |
| 交易性金融资产         | -                  | -                  | -    | -                | -                  |
| 应收利息            | -                  | -                  | -    | 49,368.86        | 49,368.86          |
| 资产总计            | 200,758,25<br>2.80 | -                  | -    | 49,368.86        | 200,807,62<br>1.66 |
| 负债              |                    |                    |      |                  |                    |
| 应付管理人报酬         | -                  | -                  | -    | 50,939.58        | 50,939.58          |



|         |                    |   |   |                |                    |
|---------|--------------------|---|---|----------------|--------------------|
| 应付托管费   | -                  | - | - | 16,979.87      | 16,979.87          |
| 应付销售服务费 | -                  | - | - | 6.30           | 6.30               |
| 应付交易费用  | -                  | - | - | 900.00         | 900.00             |
| 其他负债    | -                  | - | - | 21,900.00      | 21,900.00          |
| 负债总计    | -                  | - | - | 90,725.75      | 90,725.75          |
| 利率敏感度缺口 | 200,758.25<br>2.80 | - | - | -41,356.8<br>9 | 200,716.89<br>5.91 |

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

| 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影响金额（单位：人民币元） |                     |
|-----------|-------------|-----------------------------|---------------------|
|           |             | 本期末<br>2017年12月31日          | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|           | 利率下降25个基点   | 754,073.34                  | -                   |
| 利率上升25个基点 | -751,620.31 | -                           |                     |

#### 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

其他价格风险主要是本基金所面临的市场价格风险。市场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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2017年12月31日 |                          | 上年度末<br>2016年12月31日 |                  |
|----|--------------------|--------------------------|---------------------|------------------|
|    | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允<br>价值            | 占基金资产净值<br>比例(%) |
|    |                    |                          |                     |                  |

|               |                |       |   |   |
|---------------|----------------|-------|---|---|
| 交易性金融资产-股票投资  | -              | -     | - | - |
| 交易性金融资产-基金投资  | -              | -     | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资  | 207,225,560.00 | 84.61 | - | - |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | -              | -     | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资   | -              | -     | - | - |
| 其他            | 19,704,000.00  | 8.05  | - | - |
| 合计            | 226,929,560.00 | 92.66 | - | - |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

#### 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) 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。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层级的余额，属于第二层级的余额为 226,929,560.00 元，无属于第三层级的余额。

##### (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

##### (iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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 | 基金投资              | -              | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 226,929,560.00 | 83.99  |
|   | 其中：债券             | 207,225,560.00 | 76.69  |
|   | 资产支持证券            | 19,704,000.00  | 7.29   |
| 4 | 贵金属投资             | -              | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | 19,998,150.00  | 7.40   |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 19,458,257.16  | 7.20   |
| 8 | 其他各项资产            | 3,808,702.36   | 1.41   |
| 9 | 合计                | 270,194,669.52 | 100.00 |

## 8.2 报告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

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港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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

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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 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      | 3,295,380.00   | 1.35         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 105,333,180.00 | 43.01        |
| 5  | 企业短期融资券   | 19,934,000.00  | 8.14         |
| 6  | 中期票据      | 78,663,000.00  | 32.12        |
| 7  | 可转债(可交换债) | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 207,225,560.00 | 84.61        |

#### 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  | 122323    | 14凤凰债        | 200,000 | 19,978,000.00 | 8.16         |
| 2  | 041768004 | 17山东公用CP002  | 200,000 | 19,934,000.00 | 8.14         |
| 3  | 1480554   | 14新供销债       | 200,000 | 19,838,000.00 | 8.10         |
| 4  | 101759042 | 17碧水源MTN002  | 200,000 | 19,760,000.00 | 8.07         |
| 5  | 101655009 | 16中山城投MTN001 | 200,000 | 19,594,000.00 | 8.00         |

#### 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

| 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  | 142280 | 美吉特32 | 200,000 | 19,704,000.00 | 8.05         |

#### 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

本基金本报告期末持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行股指期货交易。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未进行国债期货交易。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货交易。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本基金本报告期末未持有股票。

### 8.12.3 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   | 557.29       |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 3,805,625.73 |
| 5  | 应收申购款   | 2,519.34     |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,808,702.36 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.12.6 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  |
| 长安泓泽纯债债券A | 54       | 4,398,081.09 | 237,488,703.02 | 100.00% | 7,675.58  | -       |
| 长安泓泽纯债债券C | 149      | 195.49       | -              | -       | 29,127.62 | 100.00% |
| 合计        | 203      | 1,170,076.39 | 237,488,703.02 | 99.98%  | 36,803.20 | 0.02%   |

### 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 | 长安泓泽纯债债券A | 1,321.48  | -        |
|                  | 长安泓泽纯债债券C | 6,751.39  | 23.18%   |
|                  | 合计        | 8,072.87  | -        |

### 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 | 长安泓泽纯债债券 A | 0~10              |
|                                | 长安泓泽纯债债券 C | 0~10              |
|                                | 合计         | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 长安泓泽纯债债券 A | 0~10              |
|                                | 长安泓泽纯债债券 C | 0~10              |
|                                | 合计         | 0~10              |

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 长安泓泽纯债债券A      | 长安泓泽纯债债券C    |
|----------------------------|----------------|--------------|
| 基金合同生效日(2016年11月16日)基金份额总额 | 200,008,769.61 | 52,779.63    |
| 本报告期期初基金份额总额               | 200,008,769.61 | 52,779.63    |
| 本报告期基金总申购份额                | 239,856,747.47 | 1,341,661.15 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 202,369,138.48 | 1,365,313.16 |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -              | -            |
| 本报告期期末基金份额总额               | 237,496,378.60 | 29,127.62    |

总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

### § 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

一、基金管理人于2017年7月31日披露了《长安基金管理有限公司关于由王健代为履行总经理职务的公告》，原总经理黄陈先生辞去总经理职务，由副总经理王健代行总经理职务。

二、基金管理人于2017年12月28日披露了《长安基金管理有限公司总经理袁丹旭任职公告》，自2017年12月28日袁丹旭先生正式履行基金管理人总经理职务，副总经理王健不再代行总经理职务。

本报告期，基金托管人的专门托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)(原“毕马威华振会计师事务所”)自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务，本基金报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币陆万元整。

### 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

报告期内无基金管理人、基金托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

### 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 |    |
| 万联证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源证券 | 4      | -    | -            | -         | -          | -  |

1、基金租用席位的选择标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (3) 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；
- (4) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批



准。

2、本基金本报告期内无新增交易单元；本基金本报告期内无退租交易单元。

### 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 |              | 基金交易 |              |
|--------|---------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|        | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 万联证券   | -             | -            | -              | -              | -    | -            | -    | -            |
| 申万宏源证券 | 87,940,593.00 | 100.00%      | 975,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                | 法定披露方式 | 法定披露日期     |
|----|-------------------------------------|--------|------------|
| 1  | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金封闭期内每周净值公告（20170106） | 上海证券报  | 2017-01-06 |
| 2  | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金封闭期内每周净值公告（20170113） | 上海证券报  | 2017-01-13 |
| 3  | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金封闭期内每周净值公告（20170120） | 上海证券报  | 2017-01-20 |
| 4  | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金封闭期内每周净值公告（20170126） | 上海证券报  | 2017-01-26 |
| 5  | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金封闭期内每周净值公告（20170203） | 上海证券报  | 2017-02-03 |

|    |   |       |            |
|----|---|-------|------------|
| 6  | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金封闭期内每周净值公告(20170210)               | 上海证券报 | 2017-02-10 |
| 7  | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金封闭期内每周净值公告(20170214)               | 上海证券报 | 2017-02-14 |
| 8  | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回(转换、定期定额投资)业务的公告          | 上海证券报 | 2017-02-14 |
| 9  | 关于长安泓泽纯债债券型证券投资基金A类在网上直销推出申购及定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告 | 上海证券报 | 2017-02-15 |
| 10 | 关于增加长安泓泽纯债债券型证券投资基金代理销售机构的公告                      | 上海证券报 | 2017-02-25 |
| 11 | 关于增加中信证券(山东)有限责任公司代理销售长安鑫富领先混合基金、长安泓泽纯债债券基金的公告    | 上海证券报 | 2017-03-03 |
| 12 | 关于旗下基金在金观诚、一路财富和晟视天下开通申购、赎回和定投业务并参与费率优惠活动的公告      | 上海证券报 | 2017-03-28 |
| 13 | 关于旗下基金在上海基煜基金开通申购和定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告            | 上海证券报 | 2017-03-18 |
| 14 | 关于旗下基金在奕丰金融服务(深圳)有限公司开通申购、赎回、定投和基金转换业务并参与费率优惠活动的  | 上海证券报 | 2017-03-23 |

|    |  |       |            |
|----|--|-------|------------|
|    | 公告   |       |            |
| 15 | 关于开展长安货币市场证券投资基金A类网上直销基金转换费率优惠的公告                              | 上海证券报 | 2017-03-29 |
| 16 | 关于调整公司旗下开放式基金申购（含定期定额投资）、赎回等业务规则的公告                            | 上海证券报 | 2017-04-06 |
| 17 | 关于新增蚂蚁基金代销长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金和长安泓泽纯债债券型证券投资基金并开通旗下开放式基金转换业务的公告 | 上海证券报 | 2017-04-06 |
| 18 | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金2017年第1季度报告                                     | 上海证券报 | 2017-04-22 |
| 19 | 长安基金管理有限公司关于旗下基金参加代销机构费率优惠的公告                                  | 上海证券报 | 2017-04-22 |
| 20 | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金招募说明书(2017年第1次更新)及摘要                            | 上海证券报 | 2017-06-24 |
| 21 | 长安基金管理有限公司关于旗下基金2017年6月30日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告            | 上海证券报 | 2017-06-30 |
| 22 | 关于旗下基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司开通基金转换业务并参加费率优惠活动的公告                      | 上海证券报 | 2017-07-07 |
| 23 | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金2017年第二季度报告                                     | 上海证券报 | 2017-07-19 |
| 24 | 长安基金管理有限公司关于由王健代为履行公司总经理                                       | 上海证券报 | 2017-07-31 |

|    |  |       |            |
|----|--|-------|------------|
|    | 职务的公告  |       |            |
| 25 | 关于旗下所有开放式证券投资基金参与一路财富(北京)信息科技股份有限公司费率优惠活动的公告             | 上海证券报 | 2017-08-17 |
| 26 | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金2017年半年度普通报告及摘要                           | 上海证券报 | 2017-08-24 |
| 27 | 关于旗下基金在天津万家财富资产管理有限公司开通认购、申购、赎回、基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告    | 上海证券报 | 2017-09-13 |
| 28 | 关于旗下基金在广发证券股份有限公司开通认购、申购、赎回、基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告        | 上海证券报 | 2017-09-27 |
| 29 | 关于长安基金管理有限公司旗下基金在交通银行股份有限公司开通申购、赎回、基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告 | 上海证券报 | 2017-10-20 |
| 30 | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金2017年第三季度普通报告                             | 上海证券报 | 2017-10-27 |
| 31 | 关于旗下基金在上海证券有限责任公司开通认购、申购和赎回并参与费率优惠活动的公告                  | 上海证券报 | 2017-11-08 |
| 32 | 关于旗下基金在北京蛋卷基金销售有限公司开通认购、申购、赎回、基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告      | 上海证券报 | 2017-11-10 |

|    |  |       |            |
|----|--|-------|------------|
| 33 | 关于旗下基金在上海基煜基金销售有限公司开通认购、申购、赎回、基金转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告  | 上海证券报 | 2017-12-07 |
| 34 | 长安泓泽纯债债券型证券投资基金招募说明书(2017年第2次更新)及摘要                  | 上海证券报 | 2017-12-16 |
| 35 | 关于开展长安货币市场证券投资基金网上直销基金转换费率优惠的公告                      | 上海证券报 | 2017-12-28 |
| 36 | 长安基金管理有限公司总经理袁丹旭任职公告                                 | 上海证券报 | 2017-12-28 |
| 37 | 关于旗下证券投资基金于2018年1月1日起缴纳增值税的提示性公告                     | 上海证券报 | 2017-12-30 |
| 38 | 长安基金管理有限公司关于旗下基金2017年12月31日基金资产净值、基金份额净值及基金份额累计净值的公告 | 上海证券报 | 2017-12-31 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |                |      |                | 报告期末持有基金情况 |       |
|-------|----------------|------------------------|----------------|------|----------------|------------|-------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额 | 赎回份额           | 持有份额       | 份额占比  |
| 机构    | 1              | 20170101-2017041       | 199,999,000.00 | -    | 199,999,000.00 | 0.00       | 0.00% |

|    |   |                       |      |                |              |                |        |
|----|---|-----------------------|------|----------------|--------------|----------------|--------|
|    |   | 2                     |      |                |              |                |        |
|    | 2 | 20170505<br>-20171231 | 0.00 | 99,203,777.33  | 1,000,000.00 | 98,203,777.33  | 41.34% |
|    | 3 | 20170505<br>-20171231 | 0.00 | 119,343,755.09 | 0.00         | 119,343,755.09 | 50.24% |
| 个人 | 1 | 20170413<br>-20170417 | 0.00 | 19,571.07      | 19,571.07    | 0.00           | 0.00%  |
|    | 2 | 20170418<br>-20170504 | 0.00 | 29,767.64      | 29,767.64    | 0.00           | 0.00%  |

#### 产品特有风险

本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：

（1）当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；

（2）在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；

（3）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；

（4）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；

（5）当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录.

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、长安泓泽纯债债券型证券投资基金基金合同；
- 3、长安泓泽纯债债券型证券投资基金托管协议；
- 4、长安泓泽纯债债券型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

地点为管理人地址：上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹大厦16楼

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9688

公司网址：www.changanfunds.com。

长安基金管理有限公司  
二〇一八年三月三十一日