

长盛同禧债券型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 29 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。本半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 2018 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§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.....	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 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.....	45
7.7 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.....	45
7.8 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
7.9 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
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.11 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
11.1 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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55

§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同禧债券型证券投资基金	
基金简称	长盛同禧债券	
基金主代码	080009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 12 月 6 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	54,766,442.71 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C
下属分级基金的交易代码:	080009	080010
报告期末下属分级基金的份额总额	29,092,577.75 份	25,673,864.96 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	本基金通过对宏观经济形势、货币政策意图、证券市场政策导向、投资人行为、公司基本面和偿债能力等因素进行深入分析和研究，执行自上而下的债券资产期限配置与自下而上不同市场、期限品种选择相结合的组合动态构建过程。在有效控制风险和保持资产流动性的前提下，力求获取较高的超额收益。在债券类资产配置上，本基金通过积极投资配置以信用债为主的相对收益率较高的各类债券，并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策略积极把握固定收益证券市场中投资机会，以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上，通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票，来获取股票市场的积极收益。此外，本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。
业绩比较基准	40%×中证国债指数收益率+60%×中证企业债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均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	张利宁
	联系电话	010-82019988
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn
		王永民
		010-66594896
		fcid@bankofchina.com

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 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100088	100818
法定代表人	周兵	陈四清

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》《上海证券报》《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-881,043.21	-151,591.92
本期利润	-856,187.75	-181,039.43
加权平均基金份额本期利润	-0.0275	-0.0204
本期加权平均净值利润率	-2.75%	-2.04%
本期基金份额净值增长率	-2.76%	-2.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-396,712.60	-514,605.78
期末可供分配基金份额利润	-0.0136	-0.0200
期末基金资产净值	28,695,865.15	25,159,259.18
期末基金份额净值	0.986	0.980
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	28.68%	24.09%

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。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 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

长盛同禧债券 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
过去一个月	-0.20%	0.14%	0.46%	0.05%	-0.66%	0.09%
过去三个月	-0.60%	0.19%	1.76%	0.10%	-2.36%	0.09%
过去六个月	-2.76%	0.30%	3.96%	0.07%	-6.72%	0.23%

过去一年	-2.88%	0.22%	4.16%	0.06%	-7.04%	0.16%
过去三年	-3.89%	0.23%	12.45%	0.07%	-16.34%	0.16%
自基金合同生效起至今	28.68%	0.42%	35.35%	0.08%	-6.67%	0.34%

长盛同禧债券 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
过去一个月	-0.20%	0.13%	0.46%	0.05%	-0.66%	0.08%
过去三个月	-0.71%	0.19%	1.76%	0.10%	-2.47%	0.09%
过去六个月	-2.87%	0.30%	3.96%	0.07%	-6.83%	0.23%
过去一年	-3.28%	0.22%	4.16%	0.06%	-7.44%	0.16%
过去三年	-5.63%	0.23%	12.45%	0.07%	-18.08%	0.16%
自基金合同生效起至今	24.09%	0.41%	35.35%	0.08%	-11.26%	0.33%

注：本基金业绩比较基准： $40\% \times$ 中证国债指数收益率 $+60\% \times$ 中证企业债指数收益率。

中证国债指数是中证指数公司编制的，反映我国国债市场整体价格和投资回报情况的指数，样本券包括在银行间债券市场、上海证券交易所和深圳证券交易所流通的剩余期限在 1 年以上的国债。

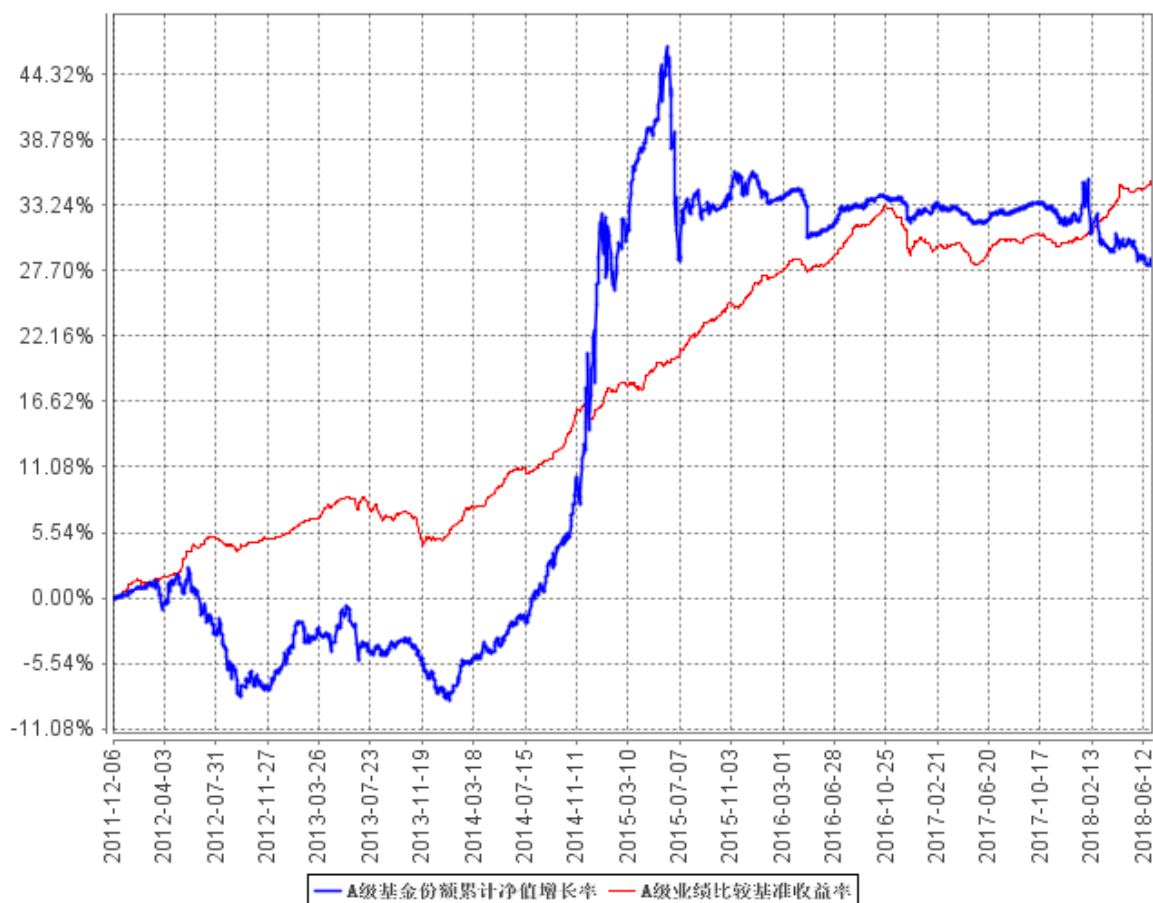
中证企业债指数是中证指数公司编制的，反映我国企业债市场整体价格和投资回报情况的指数，样本券包括在银行间债券市场、上海证券交易所和深圳证券交易所流通的剩余期限在 1 年以上的企业债。

这两个指数具有广泛的市场代表性，能够分别反映我国国债、企业债市场的总体走势。

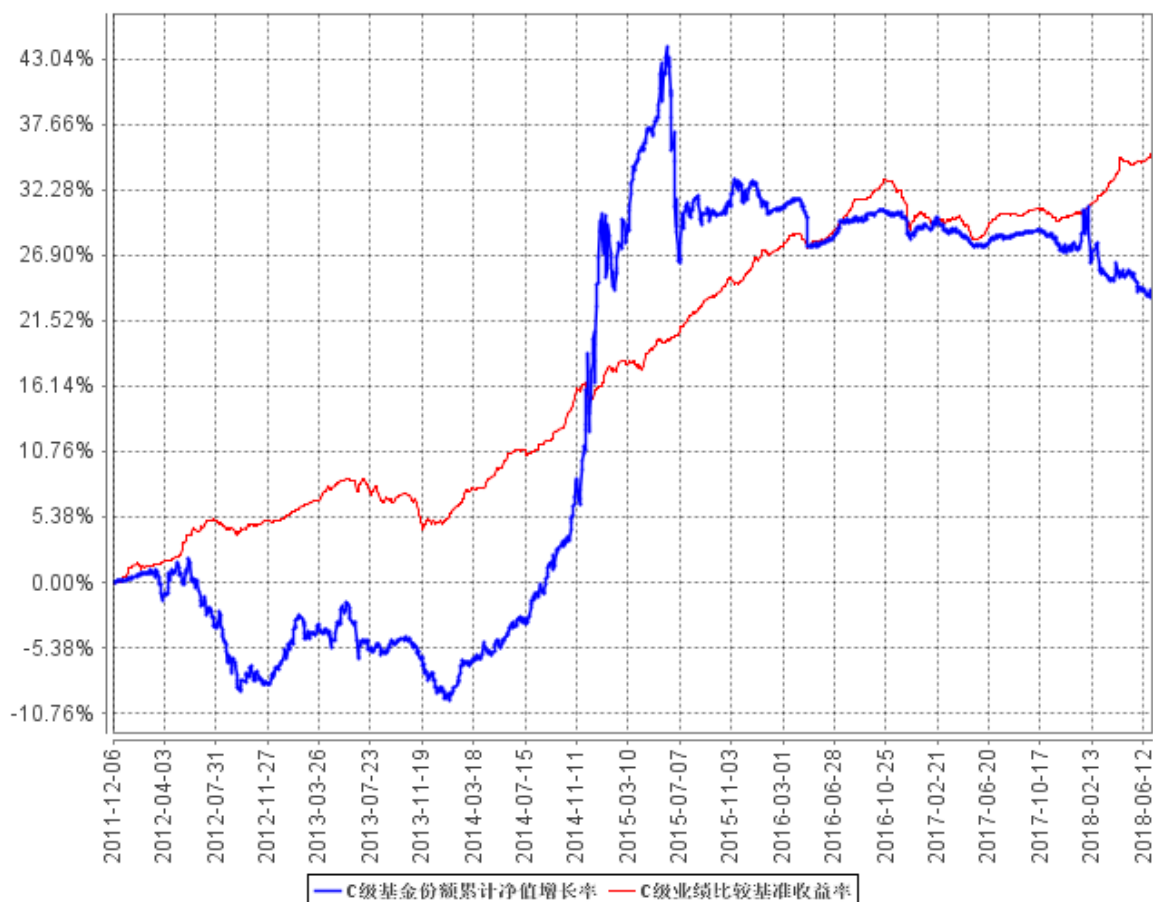
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 40%、60% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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的有关约定。

§ 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、成都设有分公司，在深圳设有营销中心，并拥有长盛基金（香港）有限公司、长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。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、特定客户资产管理业务资格和保险资产管理人资格。截至 2018 年 6 月 30 日，基金管理人共管理六十八只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理 (助理)期 限		证券 从 业 年 限	说明
		任职 日期	离 任 日期		
张帆	本基金基金经理，长盛纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛添利宝货币市场基金基金经理，长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理，FOF 业务部总监。	2016 年 1 月 20 日	-	11 年	张帆先生，1983 年 1 月出生。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。
李琪	本基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券型投资基金基金经理，长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资	2018 年 6 月 29 日	-	10 年	李琪先生，1975 年 2 月出生。天津大学管理学博士。历任大公国际资信评估有限公司信用分析师、信用评审委员会委

	资基金基金经理，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛可转债债券型证券投资基金基金经理。				员，泰康资产管理有限责任公司信用研究员。2011年3月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。
杨哲	本基金基金经理，长盛可转债债券型证券投资基金基金经理，长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理。	2018年6月29日	-	8年	杨哲先生，1984年2月出生，经济学硕士。曾任大公国际资信评估有限公司公司信用分析师、信用评审委员会委员。2013年9月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员等职务。

- 注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；
- 2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金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 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 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

回顾上半年，国内经济总体稳中趋缓，固定资产投资和消费均呈现下行趋势，其中房地产投资平稳，制造业投资小幅回升，投资下滑主要受基建投资放缓拖累，消费乏力主要是受房地产挤出效应；外需方面，则受贸易摩擦影响，进出口增速波动增大。受金融去杠杆、资管新规及规范地方举债等因素影响，5 月以来社融增速出现明显下滑。货币政策边际放松，流动性管理从合理稳定转为合理充裕，资金面整体相对宽松。

上半年，债市走出牛市行情，其中十年国开债收益率下行达 60BP。一季度，在经济基本面回落、央行定向降准、抵押补充贷款放量、银监会重要监管政策的落地等因素支撑下，债券收益率持续下行；4 月份，受资金面短期偏紧，叠加美联储加息预期、油价上涨等因素影响，债券收益率小幅回调。随后，受贸易战升级、融资收缩、货币政策边际放松、股市下跌等因素影响，利率重回下行。

上半年，A 股市场整体跌幅较大，上证综指跌幅 13.9%，创业板指数跌幅 8.3%。一月份，市场在以银行、地产、周期为主的大盘股拉动下走出一波上涨行情，二月以来 A 股市场呈震荡下跌

走势，尤其是 5 月中旬以来，受中美贸易摩擦升级、股权质押平仓、人民币贬值等因素影响，A 股市场加速下跌。行业上，食品饮料和休闲服务行业表现较好，通信、综合、电气设备等行业跌幅较大。风格上，受贸易战、股权质押平仓风险等因素影响，小盘成长股跌幅大于大盘价值股。

可转债方面，受股市大跌影响，可转债整体下跌，但跌幅明显小于 A 股；转股溢价率被动抬升，偏债型转债数量明显增加。

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，在资金面边际放松及违约风险增大的情况下，适度拉长久期，并增配利率债，严控信用风险；权益资产方面，股票资产比重保持在较低水平，但股市大幅下跌仍对基金收益产生较大不利影响；可转债方面，精选正股业绩增长确定、估值水平合理、流动性高的转债，在优化底层资产结构的基础上，把握市场交易时机，择机进行波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长盛同禧债券 A 基金份额净值为 0.986 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.76%，同期业绩比较基准收益率为 3.96%。

截至本报告期末，长盛同禧债券 C 基金份额净值为 0.980 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.87%，同期业绩比较基准收益率为 3.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内去杠杆和中美贸易摩擦背景下，投资和外贸两大支撑经济韧性的因素均受到削弱，经济面临下行压力；而积极财政政策将加大力度，通过基建投资、减税降费等措施以托底经济。货币政策方面，将保持流动性合理充裕，预计资金利率将继续维持较低水平。

债券市场方面，经济基本面和货币政策仍对债券牛市构成支撑，操作上需重视流动性充裕局面下中短端信用债的配置机会，同时，积极把握中美贸易摩擦反复等因素带来的长端利率的交易性机会。

股票市场方面，对经济前景的隐忧使得市场风险偏好难以显著回升，但经过前期大幅调整，目前 A 股估值已处于历史低位，下半年随着积极财政加大力度和利率水平的下行，市场将出现阶段性机会和结构性机会。转债方面，预计下半年转债发行继续提速，关注估值修复后的配置机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，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。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2018 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-911,318.38 元，其中：长盛同禧债券型证券投资基金 A 期末可供分配利润为-396,712.60 元（长盛同禧债券型证券投资基金 A 的未分配利润已实现部分为-227,203.38 元，未分配利润未实现部分为-169,509.22 元），长盛同禧债券型证券投资基金 C 期末可供分配利润为-514,605.78 元（长盛同禧债券型证券投资基金 C 的未分配利润已实现部分为-295,582.63 元，未分配利润未实现部分为-219,023.15 元）。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2018 年 1 月 11 日至 2018 年 3 月 21 日、自 2018 年 4 月 3 日至 2018 年 6 月 19 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛同禧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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛同禧债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	599,254.59	944,262.93
结算备付金		121,816.30	1,568,926.21
存出保证金		7,558.92	10,724.96
交易性金融资产	6.4.7.2	54,173,900.70	134,813,756.45
其中：股票投资		1,652,750.00	8,636,652.65
基金投资		-	-
债券投资		52,521,150.70	126,177,103.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	200,000.00	-
应收证券清算款		1,096,218.07	29,855,235.07
应收利息	6.4.7.5	806,771.15	2,288,113.31
应收股利		-	-
应收申购款		2,984.12	410.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		57,008,503.85	169,481,428.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,000,000.00	1,800,000.00
应付证券清算款		712,680.95	-
应付赎回款		991.93	30,269,700.00
应付管理人报酬		23,507.97	104,344.38
应付托管费		6,268.82	27,825.15
应付销售服务费		3,105.90	29,284.62
应付交易费用	6.4.7.7	9,689.12	41,962.47

应交税费		127,003.23	126,797.56
应付利息		-245.35	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	270,376.95	365,411.59
负债合计		3,153,379.52	32,765,325.77
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	54,766,442.71	135,279,543.21
未分配利润	6.4.7.10	-911,318.38	1,436,559.95
所有者权益合计		53,855,124.33	136,716,103.16
负债和所有者权益总计		57,008,503.85	169,481,428.93

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 54,766,442.71 份，其中长盛同禧债券 A 类份额 29,092,577.75 份，份额净值 0.986 元，长盛同禧债券 C 类份额 25,673,864.96 份，份额净值 0.980 元。

6.2 利润表

会计主体：长盛同禧债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-544,669.46	2,817,257.07
1.利息收入		769,239.17	1,689,951.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	21,100.24	39,055.18
债券利息收入		694,201.75	1,590,816.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		53,937.18	60,080.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,319,690.54	-1,551,719.39
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-830,144.69	1,518,812.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-516,255.60	-3,070,531.81
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	26,709.75	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-4,592.05	2,624,651.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	10,373.96	54,373.63
减：二、费用		492,557.72	842,950.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	146,243.38	385,575.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	38,998.23	102,820.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	16,498.51	8,824.01
4. 交易费用	6.4.7.19	59,757.28	123,148.05
5. 利息支出		38,318.00	34,357.53
其中：卖出回购金融资产支出		38,318.00	34,357.53
6. 税金及附加		840.14	-
7. 其他费用	6.4.7.20	191,902.18	188,225.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,037,227.18	1,974,306.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,037,227.18	1,974,306.69

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同禧债券型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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）	135,279,543.21	1,436,559.95	136,716,103.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,037,227.18	-1,037,227.18
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）	-80,513,100.50	-1,310,651.15	-81,823,751.65
其中：1.基金申购款	45,306,354.16	-678,104.05	44,628,250.11
2.基金赎回款	-125,819,454.66	-632,547.10	-126,452,001.76

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）	54,766,442.71	-911,318.38	53,855,124.33
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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）	231,369,249.95	74,598,570.86	305,967,820.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,974,306.69	1,974,306.69
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）	-224,479,526.92	-74,454,570.42	-298,934,097.34
其中：1.基金申购款	34,078,919.61	10,360,865.65	44,439,785.26
2.基金赎回款	-258,558,446.53	-84,815,436.07	-343,373,882.60
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）	6,889,723.03	2,118,307.13	9,008,030.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

林培富	刁俊东	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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛同禧债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）（原长盛同禧信用增利债券型证券投资

基金)，系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[2011]1401 号文《关于核准长盛同禧信用增利债券型证券投资基金募集的批复》的批准，由长盛基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2011 年 12 月 6 日正式生效，于基金合同生效日，本基金规模为 3,700,861,505.32 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构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（以下简称“中国银行”）。

A 类基金份额在投资人认购、申购时收取前端认购、申购费用，赎回时收取赎回费用；C 类基金份额在投资人认购、申购时不收取前端或后端认购、申购费，而是从该类别基金资产中计提销售服务费，本基金管理人对持有 C 类基金份额期限少于 30 日的该类别基金份额的赎回收取赎回费，对于持有期限不少于 30 日的该类别基金份额不收取赎回费。

本基金的基金管理人和注册登记机构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《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及基金合同的有关规定，并报中国证监会备案，自 2016 年 9 月 13 日起，本基金名称由“长盛同禧信用增利债券型证券投资基金”更名为“长盛同禧债券型证券投资基金”。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、国债期货、资产支持证券、权证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（但需符合中国证监会相关规定）。本基金主要投资国债、央行票据、金融债（含政策性金融债）、企业债、公司债、短期融资券、地方政府债、正回购、逆回购、可转换公司债券（含可分离交易的可转换债券）、中小企业私募债、银行存款、同业存单，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。本基金投资于债券的资产比例不低于基金资产的 80%。本基金还可参与一级市场新股申购或增发新股、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它权益类金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%，其中权证的投资比例不高于基金资产净值的 3%。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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为： $40\% \times \text{中证国债指数收益率} + 60\% \times \text{中证企业债指数收益率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3%调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的

股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
活期存款	599,254.59
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	599,254.59

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,768,873.00	1,652,750.00	-116,123.00
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	31,783,150.70	105,601.79
	银行间市场	20,738,000.00	123,620.00
	合计	52,521,150.70	229,221.79
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	54,060,801.91	54,173,900.70	113,098.79

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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
----	-----

	2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所市场	200,000.00	-
买入返售证券_银行间市场	-	-
合计	200,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	423.85
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	49.32
应收债券利息	806,319.39
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-24.47
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3.06
合计	806,771.15

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	9,339.12
银行间市场应付交易费用	350.00
合计	9,689.12

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.23
其他	12,686.59
预提费用	257,688.13
合计	270,376.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛同禧债券 A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,655,646.54	49,655,646.54
本期申购	21,174,865.75	21,174,865.75
本期赎回(以“-”号填列)	-41,737,934.54	-41,737,934.54
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	29,092,577.75	29,092,577.75

金额单位：人民币元

长盛同禧债券 C		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	85,623,896.67	85,623,896.67
本期申购	24,131,488.41	24,131,488.41
本期赎回(以“-”号填列)	-84,081,520.12	-84,081,520.12
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	25,673,864.96	25,673,864.96

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长盛同禧债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,022,242.41	-343,329.41	678,913.00
本期利润	-881,043.21	24,855.46	-856,187.75
本期基金份额交易产生的变动数	-368,402.58	148,964.73	-219,437.85
其中：基金申购款	115,143.67	-241,681.88	-126,538.21
基金赎回款	-483,546.25	390,646.61	-92,899.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-227,203.38	-169,509.22	-396,712.60

单位：人民币元

长盛同禧债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,577,848.04	-820,201.09	757,646.95
本期利润	-151,591.92	-29,447.51	-181,039.43
本期基金份额交易产生的变动数	-1,721,838.75	630,625.45	-1,091,213.30
其中：基金申购款	-196,148.46	-355,417.38	-551,565.84
基金赎回款	-1,525,690.29	986,042.83	-539,647.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-295,582.63	-219,023.15	-514,605.78

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	16,293.75
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	4,703.12
其他	103.37
合计	21,100.24

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	20,638,079.90
减：卖出股票成本总额	21,468,224.59
买卖股票差价收入	-830,144.69

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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	-516,255.60
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	-516,255.60

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	187,790,565.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	184,954,865.26
减：应收利息总额	3,351,956.11
买卖债券差价收入	-516,255.60

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本期未取得衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	26,709.75
基金投资产生的股利收益	-
合计	26,709.75

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,592.05
——股票投资	-653,730.92
——债券投资	649,138.87
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-4,592.05

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,355.90
基金转换费收入	18.06
合计	10,373.96

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

交易所市场交易费用	58,507.28
银行间市场交易费用	1,250.00
合计	59,757.28

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	133,892.94
银行汇划费	5,614.05
上清所帐户维护费	14,100.00
银行间账户维护费	13,500.00
合计	191,902.18

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期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

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	146,243.38	385,575.53
其中：支付销售机构的客户维护费	10,878.72	17,087.13

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	38,998.23	102,820.09

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 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		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C	合计
中国银行	-	1,845.96	1,845.96

长盛基金管理有限公司	-	12,842.21	12,842.21
合计	-	14,688.17	14,688.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C	合计
中国银行	-	3,323.98	3,323.98
长盛基金管理有限公司	-	489.36	489.36
合计	-	3,813.34	3,813.34

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	599,254.59	16,293.75	500,773.46	34,328.67

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 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须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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为人民币 200,000.00 元，于 2018 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

6.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	10,031,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	82,715,879.60
合计	-	92,746,879.60

注：表中所列示的债券投资为短期融资券、超短期融资券及政策性金融债，其中超短期融资券及政策性金融债无信用评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	6,308,011.40	11,537,580.00
AAA 以下	544,736.20	11,828,394.20
未评级	45,668,403.10	10,064,250.00
合计	52,521,150.70	33,430,224.20

注：未评级债券为国债及政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

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，除在附注 6.4.12 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，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。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	599,254.59	-	-	-	599,254.59
结算备付金	121,816.30	-	-	-	121,816.30
存出保证金	7,558.92	-	-	-	7,558.92
交易性金融资产	8,459,750.00	32,584,390.70	11,477,010.00	1,652,750.00	54,173,900.70
买入返售金融资产	200,000.00	-	-	-	200,000.00
应收证券清算款	-	-	-	1,096,218.07	1,096,218.07
应收利息	-	-	-	806,771.15	806,771.15
应收申购款	-	-	-	2,984.12	2,984.12
资产总计	9,388,379.81	32,584,390.70	11,477,010.00	3,558,723.34	57,008,503.85
负债					
卖出回购金融资产款	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	712,680.95	712,680.95
应付赎回款	-	-	-	991.93	991.93
应付管理人报酬	-	-	-	23,507.97	23,507.97
应付托管费	-	-	-	6,268.82	6,268.82
应付销售服务费	-	-	-	3,105.90	3,105.90
应付交易费用	-	-	-	9,689.12	9,689.12
应付利息	-	-	-	-245.35	-245.35
应交税费	-	-	-	127,003.23	127,003.23
其他负债	-	-	-	270,376.95	270,376.95
负债总计	2,000,000.00	-	-	1,153,379.52	3,153,379.52
利率敏感度缺口	7,388,379.81	32,584,390.70	11,477,010.00	2,405,343.82	53,855,124.33
上年度末 2017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	944,262.93	-	-	-	944,262.93
结算备付金	1,568,926.21	-	-	-	1,568,926.21
存出保证金	10,724.96	-	-	-	10,724.96

交易性金融资产	113,263,222.60	2,051,240.00	10,862,641.20	8,636,652.65	134,813,756.45
应收证券清算款	-	-	-	-29,855,235.07	29,855,235.07
应收利息	-	-	-	2,288,113.31	2,288,113.31
应收申购款	-	-	-	410.00	410.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	115,787,136.70	2,051,240.00	10,862,641.20	40,780,411.03	169,481,428.93
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,800,000.00	-	-	-	1,800,000.00
应付赎回款	-	-	-	-30,269,700.00	30,269,700.00
应付管理人报酬	-	-	-	104,344.38	104,344.38
应付托管费	-	-	-	27,825.15	27,825.15
应付销售服务费	-	-	-	29,284.62	29,284.62
应付交易费用	-	-	-	41,962.47	41,962.47
应交税费	-	-	-	126,797.56	126,797.56
其他负债	-	-	-	365,411.59	365,411.59
负债总计	1,800,000.00	-	-	-30,965,325.77	32,765,325.77
利率敏感度缺口	113,987,136.70	2,051,240.00	10,862,641.20	9,815,085.26	136,716,103.16

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进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-514,181.33	-232,886.63
市场利率下降 25 个基点	514,181.33	232,886.63	

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,652,750.00	3.07	8,636,652.65	6.32
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,652,750.00	3.07	8,636,652.65	6.32

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末及上年度末未持有非固定收益类投资或持有的非固定收益类投资占比并不重大，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 7,505,997.60 元，属于第二层次的余额为人民币 46,667,903.10 元，无属于第三层次的余额（2017 年 12 月 31 日：第一层次 10,617,223.85 元，第二层次 124,196,532.60 元，无属于第三层次的余额）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（2017年：无）。

(3) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产		合计
	债券投资	权益工具投资	
2017年12月31日	-	-	-
购买	-	-	-
出售	-	-	-
转入第三层级	-	313,100.00	313,100.00
转出第三层级	-	-253,600.00	-253,600.00
计入损益的利得或损失	-	-59,500.00	-59,500.00
2018年6月30日	-	0.00	0.00
2018年6月30日仍持有的资产计入2018年半年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	0.00	0.00

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

注：于本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元的情况，出现该情况的时间范围为2018年1月11日至2018年3月21日、自2018年4月3日至2018年6月19日。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,652,750.00	2.90
	其中：股票	1,652,750.00	2.90
2	固定收益投资	52,521,150.70	92.13
	其中：债券	52,521,150.70	92.13
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	200,000.00	0.35
	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	721,070.89	1.26
7	其他各项资产	1,913,532.26	3.36
8	合计	57,008,503.85	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	194,700.00	0.36
C	制造业	460,960.00	0.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	196,000.00	0.36
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	801,090.00	1.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,652,750.00	3.07

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000725	京东方 A	100,000	354,000.00	0.66
2	601288	农业银行	82,500	283,800.00	0.53
3	000001	平安银行	30,000	272,700.00	0.51
4	600027	华电国际	50,000	196,000.00	0.36
5	600028	中国石化	30,000	194,700.00	0.36
6	601336	新华保险	3,000	128,640.00	0.24
7	601009	南京银行	15,000	115,950.00	0.22
8	000538	云南白药	1,000	106,960.00	0.20

注：本基金本报告期末仅持有上述八只股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601009	南京银行	1,653,529.66	1.21
2	601939	建设银行	1,600,704.00	1.17
3	000001	平安银行	1,537,857.20	1.12
4	600019	宝钢股份	1,076,600.00	0.79
5	601336	新华保险	942,040.00	0.69
6	600036	招商银行	939,112.00	0.69
7	601398	工商银行	850,316.00	0.62
8	000651	格力电器	535,100.00	0.39

9	601318	中国平安	514,170.00	0.38
10	601328	交通银行	444,100.00	0.32
11	601111	中国国航	388,100.00	0.28
12	601998	中信银行	362,800.00	0.27
13	601288	农业银行	348,853.00	0.26
14	000725	京东方 A	343,000.00	0.25
15	000063	中兴通讯	314,853.00	0.23
16	002142	宁波银行	292,135.00	0.21
17	300316	晶盛机电	286,667.00	0.21
18	601088	中国神华	277,100.00	0.20
19	300251	光线传媒	240,100.00	0.18
20	600028	中国石化	220,700.00	0.16

7.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601336	新华保险	6,620,318.00	4.84
2	600754	锦江股份	2,206,484.90	1.61
3	601939	建设银行	1,511,091.00	1.11
4	601009	南京银行	1,456,950.00	1.07
5	000001	平安银行	1,166,900.00	0.85
6	600019	宝钢股份	1,074,882.00	0.79
7	600036	招商银行	927,452.00	0.68
8	601398	工商银行	786,610.00	0.58
9	000651	格力电器	522,718.00	0.38
10	601318	中国平安	493,092.00	0.36
11	601328	交通银行	427,000.00	0.31
12	601998	中信银行	401,539.00	0.29
13	601111	中国国航	357,953.00	0.26
14	002142	宁波银行	296,808.00	0.22
15	300316	晶盛机电	246,546.00	0.18
16	601088	中国神华	234,037.00	0.17
17	300251	光线传媒	221,650.00	0.16
18	600031	三一重工	174,200.00	0.13
19	300161	华中数控	173,965.00	0.13

20	600048	保利地产	162,604.00	0.12
----	--------	------	------------	------

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	15,138,052.86
卖出股票收入（成交）总额	20,638,079.90

注：本项中 7.4.1、7.4.2 和 7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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	15,122,679.60	28.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,545,723.50	56.72
	其中：政策性金融债	30,545,723.50	56.72
4	企业债券	999,500.00	1.86
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	5,853,247.60	10.87
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	52,521,150.70	97.52

7.6 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	180205	18 国开 05	100,000	10,487,000.00	19.47
2	180204	18 国开 04	100,000	10,251,000.00	19.03
3	010107	21 国债(7)	88,000	8,993,600.00	16.70
4	018002	国开 1302	73,500	7,460,250.00	13.85
5	010303	03 国债(3)	61,810	6,129,079.60	11.38

7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

（一）南京银行：

根据 2018 年 1 月 3 日南京银行股份有限公司发布的《关于非公开发行股票申请文件反馈意见的回复》的公告，2017 年 11 月 9 日公司收到人民银行南京分行营业管理部《南银营罚字（2017）4 号》，处罚事项为 1、下属支行作为异地存款银行的开户银行，涉及 47 户银行同业账户； 2、未见存款银行经营范围批准文件，涉及 48 户银行同业账户； 3、未采取多种措施对开户证明文件的真实性、完整性和合规性以及存款银行开户意愿真实性进行审核，涉及 48 户银行同业账户； 4、对账地址（联系地址）不是存款银行经营所在地或工商注册地址，涉及 34 户银行同业账户； 5、未执行开户生效日制度，涉及 1 户银行同业账户； 6、未执行久悬制度，涉及 6 户银行同业账户。处罚内容为警告并处罚款 30 万元。

根据 2018 年 1 月 30 日南京银行股份有限公司发布的《关于镇江分行行政处罚事项公告》，公司镇江分行收到中国银行业监督管理委员会江苏监管局行政处罚决定书（苏银监罚决字【2018】1 号），对镇江分行违规办理票据业务违反审慎经营原则的行为罚款 3230 万元人民币。

对以上事件，本基金做出如下说明：南京银行是中国最优秀的城商行之一，基本面良好，针对南银营罚字（2017）4 号处罚，南京银行开展以下措施：1、组织文件制度的学习，并再次对异地账户开户、三个工作日付款及同业账户首次开户面签提出严格要求； 2、运营管理部开展了账

户风险视图的梳理工作，对各类账户的风险点查漏补缺，完善检查计划、丰富培训内容，加强账户风险管理；3、资产托管部组织南京分行营业部，在近一个月时间内对问题清单中的账户开展逐户上门走访、照片补拍、法人面签等工作，确保了此类账户真实性；4、自收到通报起，立即停止了同业银行结算账户的开立。针对苏银监罚决字【2018】1号，公司已责成镇江分行按要求完成整改，对相关责任人严肃问责，分行现经营正常有序。公司将进一步加强风险管控，确保合规安全经营。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司业务和财务状况无重大不利影响。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

（二）农业银行：

根据2018年5月15日中国农业银行股份有限公司发布的“非公开发行股票申请文件反馈意见的回复”中提到“农业银行及境内分支机构报告期内(2015年至2017年)存在被税务机关处以的单笔金额为10万元(含)以上的税务处罚共计44笔,涉及罚款金额共计约2,320.43万元,主要涉及的处罚事由为少申报税款、未按规定代扣代缴个人所得税等。”其中涉及湖北省分行、浙江省分行、广东省分行等。对此事件，本基金做出如下说明：

农业银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，上述行政处罚种类主要为罚款，且未导致农业银行或境内分支机构之合法存续受影响或业务经营所需之批准、许可、授权或备案被撤销，包括但不限于被吊销《金融许可证》或营业执照等重大后果。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，本报告期内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。

7.11.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.11.3 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	7,558.92
2	应收证券清算款	1,096,218.07
3	应收股利	-
4	应收利息	806,771.15
5	应收申购款	2,984.12
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,913,532.26

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132008	17 山高 EB	957,145.00	1.78
2	123006	东财转债	360,810.00	0.67
3	128024	宁行转债	209,220.00	0.39
4	113011	光大转债	206,004.40	0.38
5	123004	铁汉转债	182,580.00	0.34

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
长盛同禧债券 A	186	156,411.71	25,414,027.85	87.36%	3,678,549.90	12.64%
长盛同禧债券 C	186	138,031.53	23,541,453.43	91.69%	2,132,411.53	8.31%
合计	372	147,221.62	48,955,481.28	89.39%	5,810,961.43	10.61%

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。

8.2 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	长盛同禧债券 A	0.00	0.0000%
	长盛同禧债券 C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

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。

8.3 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	长盛同禧债券 A	0
	长盛同禧债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛同禧债券 A	0
	长盛同禧债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C
基金合同生效日（2011 年 12 月 6 日）基金份额总额	1,919,811,572.88	1,781,049,932.44
本报告期期初基金份额总额	49,655,646.54	85,623,896.67
本报告期基金总申购份额	21,174,865.75	24,131,488.41
减：本报告期基金总赎回份额	41,737,934.54	84,081,520.12
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	29,092,577.75	25,673,864.96

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 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

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

原督察长叶金松先生因退休离任，由张利宁女士担任本公司督察长。

上述变更事项已经公司第七届董事会第七次会议审议通过，并按规定向相关监管机构备案。2018 年 4 月 27 日，中国证券监督管理委员会北京监管局作出《关于对长盛基金管理有限公司拟任合规负责人任职资格的意见》（京证监发〔2018〕136 号），对张利宁女士担任本公司督察长无异议。

10.2.2 基金经理变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2018 年 6 月 29 日起，李琪同志和杨哲同志担任长盛同禧债券型证券投资基金基金经理。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
宏源证券	1	28,391,291.56	79.36%	26,440.63	79.36%	-
华创证券	1	7,384,841.20	20.64%	6,877.49	20.64%	-

10.7.2 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
宏源证券	117,880,127.52	70.29%	296,500,000.00	66.24%	-	-
华创证券	49,833,664.78	29.71%	151,100,000.00	33.76%	-	-

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) 资质雄厚，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要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

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、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

10.8 其他重大事件

除上述事项之外，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	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》及本公司网站	2018年6月30日
2	长盛基金管理有限公司关于调整长盛同禧债券型证券投资基金基金经理的公告	同上	2018年6月30日
3	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金开通南京苏宁基金销售有限公司定投业务并参加定投申购优惠活动的公告	同上	2018年6月15日
4	长盛基金管理有限公司关于上海基煜基金销售有限公司参加费率优惠活动的公告	同上	2018年6月12日
5	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加银河证券申购（含定投）费率优惠活动的公告	同上	2018年5月21日
6	关长盛基金旗下在徽商银行代销、托管基金暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	同上	2018年5月17日

7	长盛基金管理有限公司高级管理人员督察长变更的公告	同上	2018 年 5 月 3 日
8	长盛同禧债券型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	同上	2018 年 4 月 20 日
9	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东海证券申购费率优惠活动的公告	同上	2018 年 4 月 2 日
10	长盛同禧债券型证券投资基金 2017 年度报告摘要	同上	2018 年 3 月 31 日
11	长盛同禧债券型证券投资基金 2017 年度报告	同上	2018 年 3 月 31 日
12	长盛基金管理有限公司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优惠活动的公告	同上	2018 年 3 月 31 日
13	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	同上	2018 年 3 月 30 日
14	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加展恒基金费率优惠活动的公告	同上	2018 年 3 月 26 日
15	关于修改长盛同禧债券型证券投资基金基金合同等法律文件的公告	同上	2018 年 3 月 23 日
16	长盛同禧债券型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2018 年 3 月 23 日
17	长盛同禧债券型证券投资基金基金合同	同上	2018 年 3 月 23 日
18	长盛同禧债券型证券投资基金托管协议	同上	2018 年 3 月 23 日
19	长盛同禧债券型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	同上	2018 年 1 月 20 日
20	长盛同禧债券型证券投资基金招募说明书更新（摘要）	同上	2018 年 1 月 18 日
21	长盛同禧债券型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2018 年 1 月 18 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20180101~20180110	83,800,623.06	0.00	83,800,623.06	0.00	0.00%
	2	20180101~20180630	45,414,027.15	0.00	20,000,000.00	25,414,027.15	46.40%
	3	20180620~20180630	0.00	23,541,453.43	0.00	23,541,453.43	42.99%
个人	1	20180322~20180402	0.00	15,089,537.22	15,089,537.22	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 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、《长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同禧信用增利债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同禧信用增利债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、《长盛同禧债券型证券投资基金基金合同》；
- 6、《长盛同禧债券型证券投资基金托管协议》；
- 7、《长盛同禧债券型证券投资基金招募说明书》；
- 8、法律意见书；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 10、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

2018年8月29日