

# 长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资 基金 2014 年半年度报告

2014 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：2014 年 8 月 28 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 2014 年 8 月 27 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 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	35
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.....	35
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.....	35
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.....	36
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.....	36
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	36
7.11 投资组合报告附注.....	36
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金份额总量区间的情况 .....	38
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>38</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>38</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	38
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 .....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4 基金投资策略的改变 .....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	39
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 .....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
10.8 其他重大事件 .....	41
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>43</b>
11.1 备查文件目录 .....	43
11.2 存放地点 .....	43
11.3 查阅方式 .....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	长盛季季红 1 年期债券	
基金主代码	000145	
交易代码	000145	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 6 月 14 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	222,358,335.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛季季红 1 年期债券 A	长盛季季红 1 年期债券 C
下属分级基金的交易代码:	000145	000146
报告期末下属分级基金的份额总额	180,439,407.87 份	41,918,927.37 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，力争获取高于业绩比较基准的投资收益，给投资者带来长期的现金红利收益。
投资策略	<p>本基金主要投资于固定收益类金融工具，不直接买入股票、权证等权益类金融工具。本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配。本基金的投资策略包括大类资产配置策略、债券组合管理策略和期限管理策略。</p> <p>本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。</p> <p>由于本基金封闭期为一年，基金规模相对稳定，但在开放期内本基金规模的不确定性增强。本基金将采用期限管理策略，分散化投资于不同剩余期限标的，临近开放期时，在最大限度保证收益的同时将组合剩余期限降低，保证开放期内具备足够流动性应对可能发生的组合规模变化。</p>
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

客户服务电话	400-888-2666 010-62350088	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	高新	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《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	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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	长盛季季红 1 年期债券 A	长盛季季红 1 年期债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	28,450,894.43	18,555,362.04
本期利润	47,238,816.69	31,540,724.20
加权平均基金份额本期利润	0.0612	0.0574
本期加权平均净值利润率	6.07%	5.69%
本期基金份额净值增长率	7.41%	7.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	3,818,418.97	878,937.74
期末可供分配基金份额利润	0.0212	0.0210
期末基金资产净值	184,615,758.16	42,880,887.31
期末基金份额净值	1.023	1.023
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	6.13%	5.82%

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

长盛季季红 1 年期债券 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	2.36%	0.14%	0.25%	0.01%	2.11%	0.13%
过去三个月	4.61%	0.10%	0.73%	0.01%	3.88%	0.09%
过去六个月	7.41%	0.10%	1.46%	0.01%	5.95%	0.09%
过去一年	6.23%	0.10%	3.00%	0.01%	3.23%	0.09%
自基金合同生效起至今	6.13%	0.10%	3.14%	0.01%	2.99%	0.09%

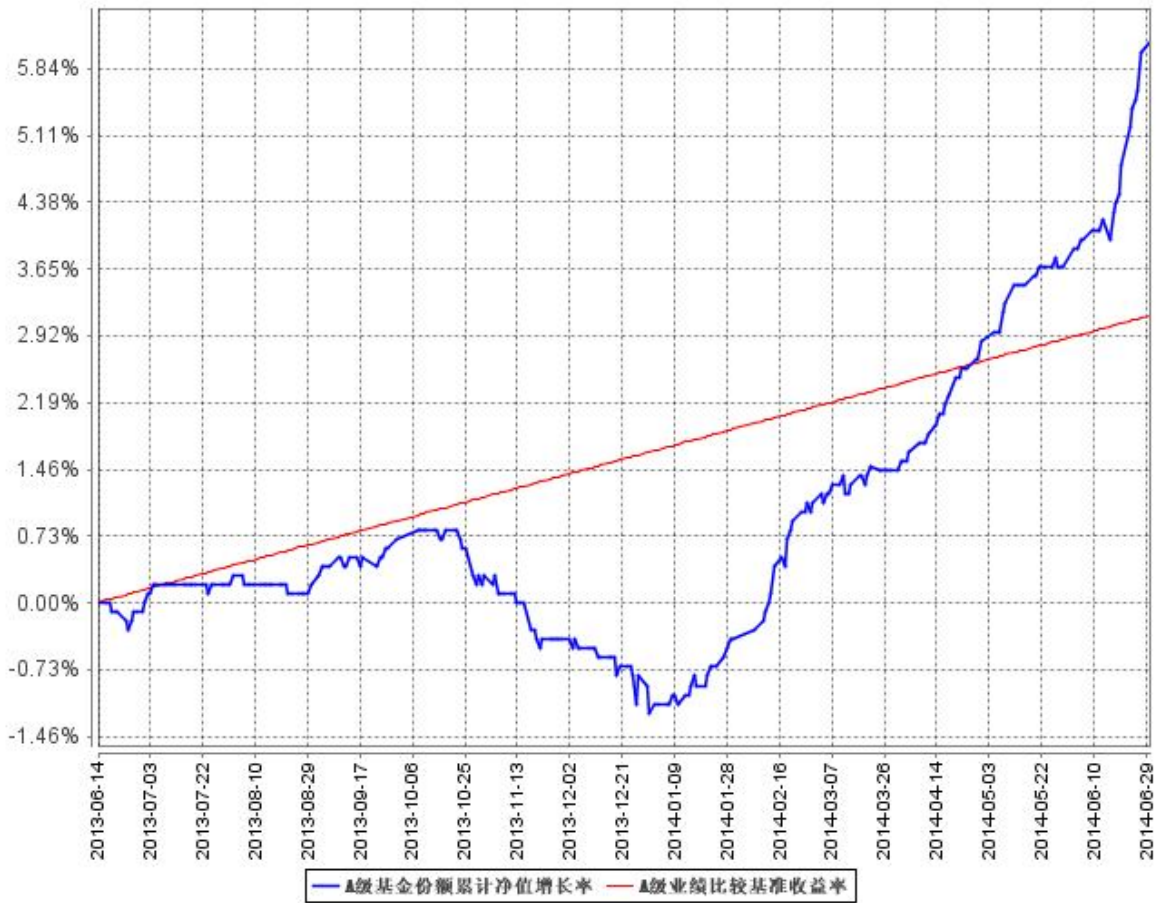
长盛季季红 1 年期债券 C

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	2.37%	0.16%	0.25%	0.01%	2.12%	0.15%
过去三个月	4.52%	0.11%	0.73%	0.01%	3.79%	0.10%
过去六个月	7.22%	0.10%	1.46%	0.01%	5.76%	0.09%
过去一年	5.93%	0.10%	3.00%	0.01%	2.93%	0.09%
自基金合同生效起至今	5.82%	0.10%	3.14%	0.01%	2.68%	0.09%

注：本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率。本基金是一年期定期开放债券型基金，以一年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量比较本基金的投资收益。

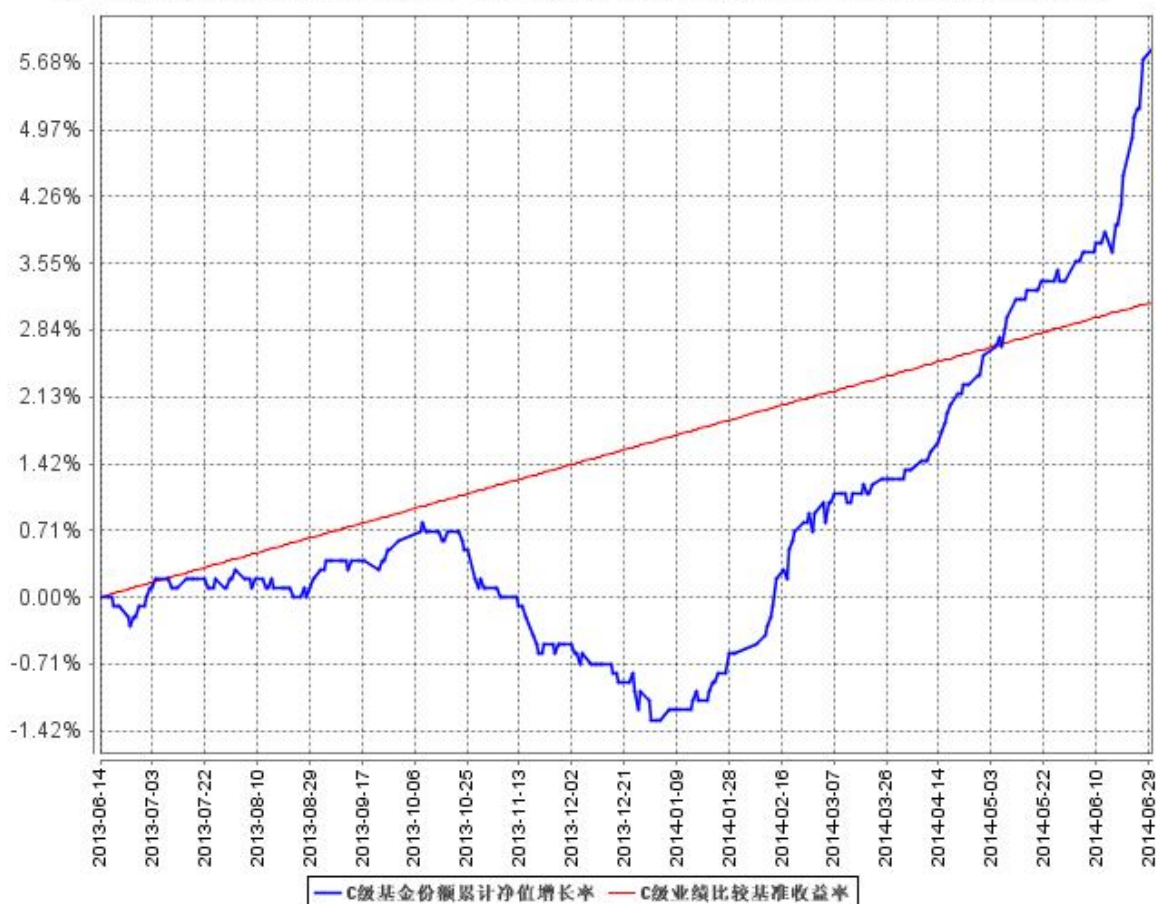
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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：按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十四条（二）投资范围、（八）投资禁止行为与限制的有关约定。截止报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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 15000 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2014 年 6 月 30 日，基金管理人共管理一只封闭式

基金、三十四只开放式基金，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		
贾志敏	本基金基金经理，长盛货币市场基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，固定收益部副总监。	2013 年 6 月 14 日	—	8 年	男，1982 年 3 月出生，中国国籍。北京大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作。2012 年 11 月底加入长盛基金管理有限公司，现任固定收益部副总监，长盛货币市场基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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，共发生 4 次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 2014 年上半年，经济基本面相对疲弱，通胀水平处于相对低位，货币政策定向放松，资金面呈现持续宽松局面，债券市场总体呈现牛市行情。利率债方面，收益率曲线整体下行，其中短端收益率下行幅度大于长端收益率。信用债方面，收益率曲线短端下行幅度大于长端，低评级

债券收益率下行幅度小于中高评级债券，主要是受信用风险事件频发及交易所低评级债券质押回购标准变动等不利影响所致。

货币市场方面，受央行公开市场操作趋于温和及定向宽松的货币政策影响，市场流动性保持相对宽松局面，各中短期 Shibor 利率及银行间质押式回购利率均保持在较低水平。

## 2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金始终控制配置节奏，根据市场变动调整组合久期，优化持仓结构，保持组合流动性。密切关注高收益债券的信用风险暴露，严格控制其持仓比例，防控信用风险。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，长盛季季红 1 年期债券 A 的基金份额净值为 1.023 元，本报告期份额净值增长率为 7.41%，同期业绩比较基准增长率为 1.46%。

截止报告期末，长盛季季红 1 年期债券 C 的基金份额净值为 1.023 元，本报告期份额净值增长率为 7.22%，同期业绩比较基准增长率为 1.46%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着稳增长政策措施的逐步落实，预计经济将逐渐企稳，短期内将对债市表现形成一定压力；通胀水平预计继续处于相对低位，低于政府调控目标，短期内不会对货币政策形成约束。从中长期看，随着短期刺激政策的淡出，房地产投资增速下降及企业融资成本高企等因素对实体经济的拖累将继续显现，经济仍然可能重归于回落。

在后期投资策略上，我们将控制久期和信用风险，提升组合流动性及整体信用资质，择机把握利率债的投资机会，品种上以中高等级信用债为主。密切关注高收益债券的信用风险暴露，严格控制其持仓比例，防控信用风险。

总之，无论市场如何发展变化，在操作方面，我们都将继续秉承谨慎原则，在组合流动性得到保证的前提下，通过灵活的资产配置和深入的个券甄别分析，做好组合配置，力求确保基金资产在维持价值底线基础上实现持续的稳定增值。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、

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

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

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

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十九条中对基金利润分配原则的约定，本基金于 2014 年 3 月 24 日和 2014 年 6 月 17 日进行了两次利润分配，分配金额分别为 9,332,024.37 元和 13,410,628.04 元。

本基金截至 2014 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 4,697,356.71 元，其中：长盛季季红 1 年期债券 A 期末可供分配利润为 3,818,418.97 元（长盛季季红 1 年期债券 A 的未分配利润已实现部分为 3,818,418.97 元，未分配利润未实现部分为 357,931.32 元）；长盛季季红 1 年期债券 C 期末可供分配利润为 878,937.74 元（长盛季季红 1 年期债券 C 的未分配利润已实现部分为 878,937.74 元，未分配利润未实现部分为 83,022.20 元）。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

## 5.3 托管人对本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：长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,950,274.48	250,131,342.07
结算备付金		8,156,844.79	27,291,658.85
存出保证金		59,815.26	277,976.30
交易性金融资产	6.4.7.2	321,973,877.50	1,850,545,950.94
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		321,973,877.50	1,850,545,950.94
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	8,800,002.10	-
应收证券清算款		53,779,878.22	1,563,164.80
应收利息	6.4.7.5	8,763,689.47	41,293,820.05
应收股利		-	-
应收申购款		1,658,868.83	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		408,143,250.65	2,171,103,913.01
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2013 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		151,700,000.00	790,890,855.78
应付证券清算款		8,800,002.10	27,431.91
应付赎回款		19,223,368.90	-
应付管理人报酬		481,263.36	706,540.04
应付托管费		144,378.98	211,962.01
应付销售服务费		95,591.29	147,788.31
应付交易费用	6.4.7.7	18,878.27	25,571.18
应交税费		4,598.36	4,598.36
应付利息		-	289,452.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	178,523.92	225,000.00
负债合计		180,646,605.18	792,529,200.07
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	222,358,335.24	1,396,003,609.71
未分配利润	6.4.7.10	5,138,310.23	-17,428,896.77
所有者权益合计		227,496,645.47	1,378,574,712.94
负债和所有者权益总计		408,143,250.65	2,171,103,913.01

注：报告截止日2014年6月30日，长盛季季红1年期债券A类基金份额净值人民币1.023元，长盛季季红1年期债券C类基金份额净值人民币1.023元；基金份额总额222,358,335.24份，其中，长盛季季红1年期债券A类基金份额180,439,407.87份；长盛季季红1年期债券C类基金份额41,918,927.37份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2014年1月1日至 2014年6月30日	2013年6月14日(基金 合同生效日)至2013年6 月30日
<b>一、收入</b>		97,789,305.91	-612,742.24
1. 利息收入		59,247,149.28	3,296,413.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,978,385.48	300,928.72
债券利息收入		54,255,456.65	807,834.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,307.15	2,187,650.03

其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		6,768,872.21	-221,189.11
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,768,872.21	-221,189.11
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	-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	31,773,284.42	-3,687,966.13
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	-	-
<b>减: 二、费用</b>		19,009,765.02	867,179.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,969,187.47	366,796.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,190,756.20	110,038.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	825,227.29	76,788.27
4. 交易费用	6.4.7.19	12,650.85	650.30
5. 利息支出		12,799,817.65	291,811.97
其中: 卖出回购金融资产支出		12,799,817.65	291,811.97
6. 其他费用	6.4.7.20	212,125.56	21,092.96
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		78,779,540.89	-1,479,921.27
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		78,779,540.89	-1,479,921.27

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金

本报告期: 2014年1月1日至2014年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	1,396,003,609.71	-17,428,896.77	1,378,574,712.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	78,779,540.89	78,779,540.89



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)	-1,173,645,274.47	-20,682,088.88	-1,194,327,363.35
其中：1. 基金申购款	97,818,407.43	2,351,182.49	100,169,589.92
2. 基金赎回款	-1,271,463,681.90	-23,033,271.37	-1,294,496,953.27
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)	-	-35,530,245.01	-35,530,245.01
五、期末所有者权益(基金净值)	222,358,335.24	5,138,310.23	227,496,645.47
项目	上年度可比期间 2013年6月14日(基金合同生效日)至2013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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,403,133.00	-1,403,133.00
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)	1,396,003,609.71	-	1,396,003,609.71
其中：1. 基金申购款	1,396,003,609.71	-	1,396,003,609.71
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)	1,396,003,609.71	-1,403,133.00	1,394,600,476.71

注：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：

周兵  
基金管理人负责人

林培富  
主管会计工作负责人

龚珉  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第 367 号《关于核准长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,395,112,946.72 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司(事务所的性质已变更为特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 344 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 6 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,396,003,609.71 份基金份额(长盛季季红 1 年期定期开放基金 A 类份额(以下简称“长盛季季红 1 年期债券 A”)811,480,378.28 份,长盛季季红 1 年期定期开放基金 C 类份额(以下简称“长盛季季红 1 年期债券 C”)584,523,231.43 份),包含认购资金利息折合 890,662.99 份(长盛季季红 1 年期债券 A 为 528,246.96 份,长盛季季红 1 年期债券 C 为 362,416.03 份)。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从该类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

本基金自基金合同生效日起每封闭一年集中开放申购与赎回一次,开放期为 5 至 20 个工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。本基金以定期开放方式运作,其封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起一年。首个封闭期结束之后第一个工作日起进入 5 至 20 个工作日的首个开放期,如封闭期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的,开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。如在开放期内发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回业务的,开放期时间中止计算,在不可抗力或其他情形影响因素消除之日次日起,继续计算该开放期时间。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起的一年,以此类推。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、次级债、中期票据(MTN)、短期融资券(CP)、超短期融资券(SCP)、资产支持证券(ABS)、银行存款以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期，本基金持有的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%，在非开放期，本基金不受该比例的限制。本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款税后收益率。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金 基金合同》和在中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **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**

本基金本报告期无会计估计变更。

### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

### 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 2014年6月30日
活期存款	4,950,274.48
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	4,950,274.48

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30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	327,471,882.51	321,973,877.50
	银行间市场	-	-
	合计	327,471,882.51	321,973,877.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	327,471,882.51	321,973,877.50	-5,498,005.01

#### 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 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_深圳	8,800,002.10	-
合计	8,800,002.10	-

##### 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 2014年6月30日
应收活期存款利息	4,974.27
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	3,303.54
应收债券利息	8,755,387.45
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	24.21
合计	8,763,689.47

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本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 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	18,878.27
合计	18,878.27

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	178,523.92
合计	178,523.92

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

长盛季季红 1 年期债券 A		
项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	811,480,378.28	811,480,378.28
本期申购	91,105,703.21	91,105,703.21
本期赎回（以“-”号填列）	-722,146,673.62	-722,146,673.62
本期末	180,439,407.87	180,439,407.87

金额单位：人民币元

长盛季季红 1 年期债券 C		
项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	584,523,231.43	584,523,231.43
本期申购	6,712,704.22	6,712,704.22
本期赎回（以“-”号填列）	-549,317,008.28	-549,317,008.28
本期末	41,918,927.37	41,918,927.37

注：根据《长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的封闭期为自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）或自每一开放期结束之日次日起（包括该日）一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起一年。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起的一年，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金办理申购与赎回业务的开放期为本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起 5 至 20 个工作日的期间。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

长盛季季红 1 年期债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	12,095,360.09	-21,675,046.80	-9,579,686.71
本期利润	28,450,894.43	18,787,922.26	47,238,816.69
本期基金份额交易产生的变动数	-13,985,183.14	3,245,055.86	-10,740,127.28
其中：基金申购款	2,723,551.70	-481,764.99	2,241,786.71
基金赎回款	-16,708,734.84	3,726,820.85	-12,981,913.99
本期已分配利润	-22,742,652.41	-	-22,742,652.41
本期末	3,818,418.97	357,931.32	4,176,350.29

单位：人民币元

长盛季季红 1 年期债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,747,032.57	-15,596,242.63	-7,849,210.06
本期利润	18,555,362.04	12,985,362.16	31,540,724.20
本期基金份额交易产生的变动数	-12,635,864.27	2,693,902.67	-9,941,961.60
其中：基金申购款	81,641.74	27,754.04	109,395.78
基金赎回款	-12,717,506.01	2,666,148.63	-10,051,357.38
本期已分配利润	-12,787,592.60	-	-12,787,592.60
本期末	878,937.74	83,022.20	961,959.94

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	35,353.99
定期存款利息收入	4,766,271.89
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	176,485.70
其他	273.90
合计	4,978,385.48

#### 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

注：本基金本期未取得股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,904,996,599.29

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,842,256,907.21
减：应收利息总额	55,970,819.87
债券投资收益	6,768,872.21

#### 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

注：本基金本期未取得股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	31,773,284.42
——股票投资	-
——债券投资	31,773,284.42
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	31,773,284.42

#### 6.4.7.18 其他收入

注：本基金本期未取得其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	1,525.85
银行间市场交易费用	11,125.00
合计	12,650.85

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元



项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	133,892.94
其他	400.00
上清所账户维护费	9,000.00
银行汇划费	15,201.64
银行间账户维护费	9,000.00
合计	212,125.56

#### 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

本基金并无需作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需作披露的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（“长盛基金公司”）	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
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本期未通过关联方交易单元进行的交易。

##### 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
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 6 月 14 日(基金合同生效日)至 2013 年 12 月 31 日

	月 30 日	至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,969,187.47	366,796.55
其中：支付销售机构的客户维护费	1,798,236.56	-

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

#### 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
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年6月14日(基金合同生效日)至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,190,756.20	110,038.98

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.18%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.18% / 当年天数。

#### 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		
	2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛季季红1年期债券A	长盛季季红1年期债券C	合计
长盛基金管理有限公司	-	224.33	224.33
中国银行	-	790,920.21	790,920.21
国元证券	-	3.32	3.32
合计	-	791,147.86	791,147.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛季季红1年期债券A	长盛季季红1年期债券C	合计
长盛基金管理有限公司	-	17.71	17.71
中国银行	-	64,395.12	64,395.12
国元证券	-	0.26	0.26
合计	-	64,413.09	64,413.09

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计

至每月月底，按月支付给长盛基金管理有限公司，再由长盛基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.30%/当年天数。

#### 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：基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年6月14日(基金合同生效日)至 2013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	4,950,274.48	35,353.99	5,254,014.16	115,071.25

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

长盛季季红1年期债券A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分 配合计	备注
1	2014年6月17日	2014年6月17日	0.257	13,410,628.04	-	13,410,628.04	
2	2014年3月24日	2014年3月24日	0.115	9,332,024.37	-	9,332,024.37	
合计	-	-	0.372	22,742,652.41	-	22,742,652.41	

## 长盛季季红 1 年期债券 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每 10 份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备 注
1	2014 年 6 月 17 日	2014 年 6 月 17 日	0.248	7,234,622.65	-	7,234,622.65	
2	2014 年 3 月 24 日	2014 年 3 月 24 日	0.095	5,552,969.95	-	5,552,969.95	
合计	-	-	0.343	12,787,592.60	-	12,787,592.60	

**6.4.12 期末（2014 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：本基金本期末未持有因认购新发/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**

注：本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2014 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 151,700,000.00 元，于 2014 年 7 月 1 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**

本基金是债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金的投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、次级债、中期票据 (MTN)、短期融资券 (CP)、超短期融资券 (SCP)、资产支持证券 (ABS)、银行存款以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股

增发，可转换债券仅投资二级市场可分离交易可转债的纯债部分。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险和合理保持流动性的基础上，力争为投资者谋求稳健的投资收益。

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

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

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

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

##### 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	上年度末
--------	-----	------

	2014 年 6 月 30 日	2013 年 12 月 31 日
A-1	-	925,215,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	29,847,000.00
合计	-	955,062,000.00

注：未评级债券主要为短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.2.2 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 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
AAA	-	3,050,000.00
AAA 以下	321,973,877.50	892,433,950.94
未评级	-	-
合计	321,973,877.50	895,483,950.94

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

于 2014 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 151,700,000.00 元将在一月内到期且计息

(该利息金额不重大)外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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

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

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

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2014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	4,950,274.48	-	-	-	4,950,274.48
结算备付金	8,156,844.79	-	-	-	8,156,844.79
存出保证金	59,815.26	-	-	-	59,815.26
交易性金融资产	33,057,775.10	139,656,569.80	149,259,532.60	-	321,973,877.50
买入返售金融资产	8,800,002.10	-	-	-	8,800,002.10
应收证券清算款	-	-	-	53,779,878.22	53,779,878.22
应收利息	-	-	-	8,763,689.47	8,763,689.47
应收申购款	-	-	-	1,658,868.83	1,658,868.83
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	55,024,711.73	139,656,569.80	149,259,532.60	64,202,436.52	408,143,250.65
负债					
卖出回购金融资产款	151,700,000.00	-	-	-	151,700,000.00

应付证券清算款	-	-	-	8,800,002.10	8,800,002.10
应付赎回款	-	-	-	19,223,368.90	19,223,368.90
应付管理人报酬	-	-	-	481,263.36	481,263.36
应付托管费	-	-	-	144,378.98	144,378.98
应付销售服务费	-	-	-	95,591.29	95,591.29
应付交易费用	-	-	-	18,878.27	18,878.27
应交税费	-	-	-	4,598.36	4,598.36
其他负债	-	-	-	178,523.92	178,523.92
负债总计	151,700,000.00	-	-	28,946,605.18	180,646,605.18
利率敏感度缺口	-96,675,288.27	139,656,569.80	149,259,532.60	35,255,831.34	227,496,645.47
上年度末 2013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	250,131,342.07	-	-	-	250,131,342.07
结算备付金	27,291,658.85	-	-	-	27,291,658.85
存出保证金	277,976.30	-	-	-	277,976.30
交易性金融资产	1,090,329,877.84	228,179,144.40	532,036,928.70	-	1,850,545,950.94
应收证券清算款	-	-	-	1,563,164.80	1,563,164.80
应收利息	-	-	-	41,293,820.05	41,293,820.05
资产总计	1,368,030,855.06	228,179,144.40	532,036,928.70	42,856,984.85	2,171,103,913.01
负债					
卖出回购金融资产	790,890,855.78	-	-	-	790,890,855.78
应付证券清算款	-	-	-	27,431.91	27,431.91
应付管理人报酬	-	-	-	706,540.04	706,540.04
应付托管费	-	-	-	211,962.01	211,962.01
应付销售服务费	-	-	-	147,788.31	147,788.31
应付交易费用	-	-	-	25,571.18	25,571.18
应交税费	-	-	-	4,598.36	4,598.36
应付利息	-	-	-	289,452.48	289,452.48
其他负债	-	-	-	225,000.00	225,000.00
负债总计	790,890,855.78	-	-	1,638,344.29	792,529,200.07



利率敏感度缺口	577, 139, 999. 28	228, 179, 144. 40	532, 036, 928. 70	41, 218, 640. 56	1, 378, 574, 712. 94
---------	-------------------	-------------------	-------------------	------------------	----------------------

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014年6月30日）	上年度末（2013年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-1, 890, 643. 00	-8, 309, 217. 61
	市场利率下降 25 个基点	1, 890, 643. 00	8, 309, 217. 61

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 6.4.14 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) 各层级金融工具公允价值

于 2014 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 321,973,877.50，无属于第二层级和第三层级的余额（2013 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 823,493,550.94 元，属于第二层级的余额为 1,027,052,400.00 元，无属于第三层级的余额）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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) 第三层级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。

## § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	321,973,877.50	78.89
	其中：债券	321,973,877.50	78.89
	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	8,800,002.10	2.16
	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	13,107,119.27	3.21
7	其他各项资产	64,262,251.78	15.75
8	合计	408,143,250.65	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	321,973,877.50	141.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	321,973,877.50	141.53

## 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	122682	12 营口债	315,000	32,949,000.00	14.48
2	124193	13 文城资	295,890	29,293,110.00	12.88
3	122545	12 蒙高新	265,010	26,967,417.60	11.85
4	122727	12 东胜债	256,670	26,306,108.30	11.56
5	124318	13 滨城投	260,000	25,688,000.00	11.29

## 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**

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**

本基金报告期内未进行股票投资。

**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	59,815.26
2	应收证券清算款	53,779,878.22
3	应收股利	-
4	应收利息	8,763,689.47
5	应收申购款	1,658,868.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,262,251.78

**7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

**7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末未持有股票。

**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
长盛季季红 1 年期 债券 A	428	421, 587. 40	123, 124, 234. 20	68. 24%	57, 315, 173. 67	31. 76%
长盛季季红 1 年期 债券 C	343	122, 212. 62	1, 476, 377. 95	3. 52%	40, 442, 549. 42	96. 48%
合计	771	288, 402. 51	124, 600, 612. 15	56. 04%	97, 757, 723. 09	43. 96%

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	长盛季季红 1 年期债 券 A	-	-
	长盛季季红 1 年期债 券 C	-	-
	合计	-	-

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）
高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金	长盛季季红 1 年期债券 A	0
	长盛季季红 1 年期债券 C	0
	合计	0
基金经理持有本基金	长盛季季红 1 年期债券 A	0
	长盛季季红 1 年期债券 C	0
	合计	0

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	长盛季季红 1 年期债券 A	长盛季季红 1 年期债券 C
基金合同生效日（2013 年 6 月 14 日）基金份额总额	811,480,378.28	584,523,231.43
本报告期期初基金份额总额	811,480,378.28	584,523,231.43
本报告期基金总申购份额	91,105,703.21	6,712,704.22
减：本报告期基金总赎回份额	722,146,673.62	549,317,008.28
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	180,439,407.87	41,918,927.37

**§ 10 重大事件揭示****10.1 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。

**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**

本基金管理人于 2014 年 4 月 16 日发布公告，经公司第五届董事会第五十七次会议以及第六届董事会第一次会议审议通过，并报中国证监会审核批准，由高新先生担任公司董事长，凤

良志先生因年龄原因不再担任公司董事长职务。根据公司章程相关规定，“董事长为公司的法定代表人”。公司已于 2014 年 4 月 14 日完成相关工商登记变更手续。

#### 10.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2014 年 2 月 14 日中国银行股份有限公司公告，自 2014 年 2 月 13 日起，陈四清先生担任本行行长。

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。

### 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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 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	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

东北证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

### 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
国泰君安	565,141,388.86	88.37%	18,613,000,000.00	91.31%	-	-
国信证券	49,814,797.17	7.79%	1,771,567,000.00	8.69%	-	-
招商证券	24,525,285.09	3.84%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-



国联证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

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

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

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

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

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

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的

服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：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	关于增加上海证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购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	2014年6月16日
2	长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金收益分配公告	同上	2014年6月16日
3	长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金开放申购 赎回业务的公告	同上	2014年6月10日
4	长盛基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	同上	2014年4月16日
5	长盛基金管理有限公司关于董事长变更的公告	同上	2014年4月16日
6	关于增加中信银行为旗下部分基金代销机构以及开通基金定投业务的公告	同上	2014年4月4日
7	关于增加旗下部分开放式基金代销机构并推出部分代销机构申购费率优惠活动的公告	同上	2014年3月27日
8	关于增加钱景为旗下开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2014年3月24日
9	关于增加恒天明泽为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率	同上	2014年3月24日

	优惠活动的公告		
10	长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金收益分配公告	同上	2014 年 3 月 20 日
11	关于增加徽商银行作为旗下部分基金代销机构以及开通基金定投业务的公告	同上	2014 年 3 月 17 日
12	长盛季季红 1 年期定期开放债券型招募说明书(更新)摘要	同上	2014 年 1 月 23 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或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.csfund.com.cn>。

长盛基金管理有限公司  
2014 年 8 月 28 日