

# 长盛同禧信用增利债券型证券投资基金 2014 年年度报告 摘要

2014 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长盛同禧信用增利债券	
基金主代码	080009	
交易代码	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	33,034,980.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛同禧信用增利债券 A	长盛同禧信用增利债券 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	17,597,150.26 份	15,437,830.35 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	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研究和分析，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	中证企业债指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%
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	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

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址和基金托管人的住所

## § 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	2014 年		2013 年		2012 年	
	长盛同禧信用增利债券 A	长盛同禧信用增利债券 C	长盛同禧信用增利债券 A	长盛同禧信用增利债券 C	长盛同禧信用增利债券 A	长盛同禧信用增利债券 C
本期已实现收益	4,099,376.90	3,366,233.30	3,158,565.90	2,457,735.38	-395,537.37	-1,705,947.93
本期利润	9,054,030.61	7,264,796.82	-429,809.26	-542,358.86	1,280,035.21	-1,204,825.55
加权平均基金份额本期利润	0.2606	0.2706	-0.0076	-0.0115	0.0060	-0.0065
本期基金份额净值增长率	39.70%	39.08%	-2.23%	-2.67%	-5.89%	-6.59%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末		2013 年末		2012 年末	
	长盛同禧信用增利债券 A	长盛同禧信用增利债券 C	长盛同禧信用增利债券 A	长盛同禧信用增利债券 C	长盛同禧信用增利债券 A	长盛同禧信用增利债券 C
期末可供分配基金份额利润	0.1724	0.1538	-0.0779	-0.0886	-0.0719	-0.0789
期末基金资产净值	22,657,852.75	19,560,921.67	40,827,546.90	32,714,570.19	66,494,123.31	54,473,384.38
期末基金份额净值	1.288	1.267	0.922	0.911	0.943	0.936

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 12 月 31 日。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛同禧信用增利债券 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	23.37%	1.23%	3.18%	0.14%	20.19%	1.09%
过去六个月	30.89%	0.88%	4.66%	0.11%	26.23%	0.77%
过去一年	39.70%	0.65%	10.54%	0.09%	29.16%	0.56%
过去三年	28.54%	0.46%	15.60%	0.09%	12.94%	0.37%
自基金合同生效起至今	28.80%	0.45%	16.14%	0.09%	12.66%	0.36%

长盛同禧信用增利债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	23.13%	1.21%	3.18%	0.14%	19.95%	1.07%
过去六个月	30.62%	0.87%	4.66%	0.11%	25.96%	0.76%
过去一年	39.08%	0.65%	10.54%	0.09%	28.54%	0.56%
过去三年	26.45%	0.46%	15.60%	0.09%	10.85%	0.37%
自基金合同生效起至今	26.70%	0.45%	16.14%	0.09%	10.56%	0.36%

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。

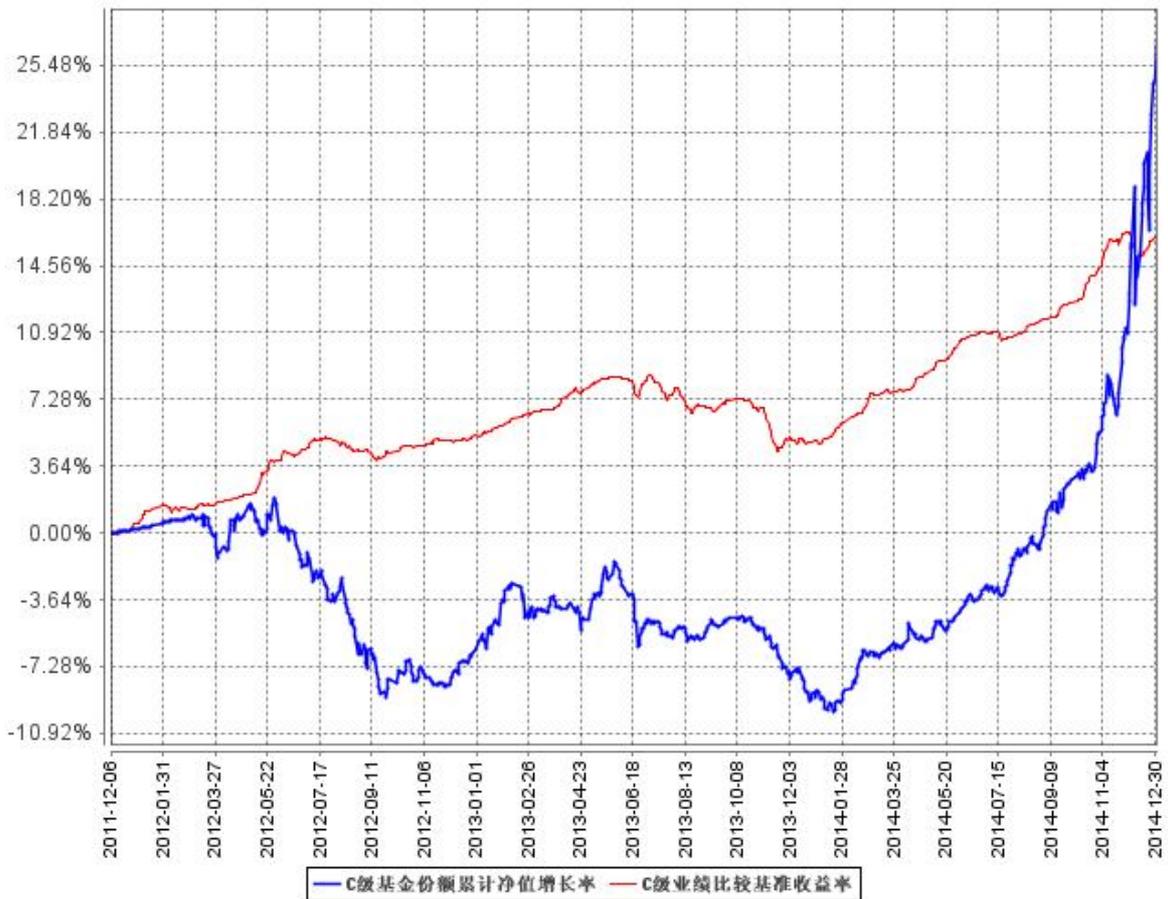
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 40%、60% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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**



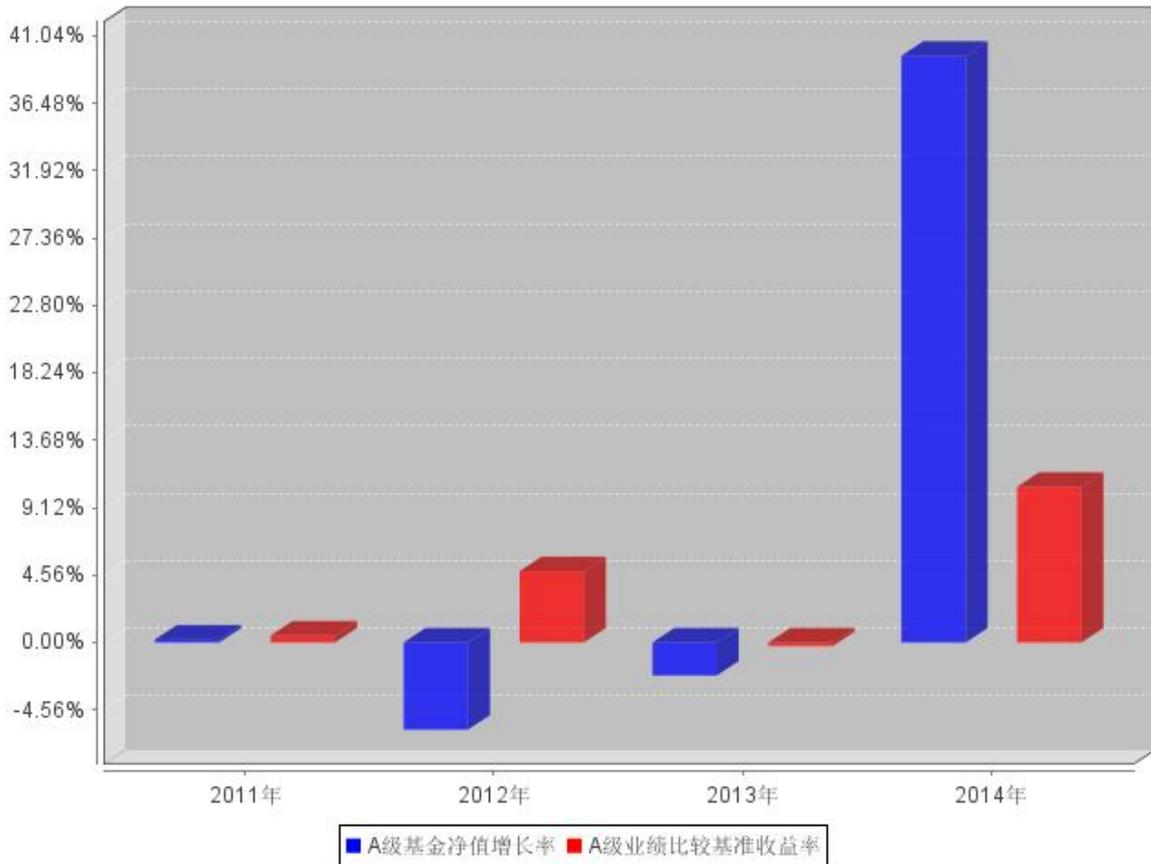
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



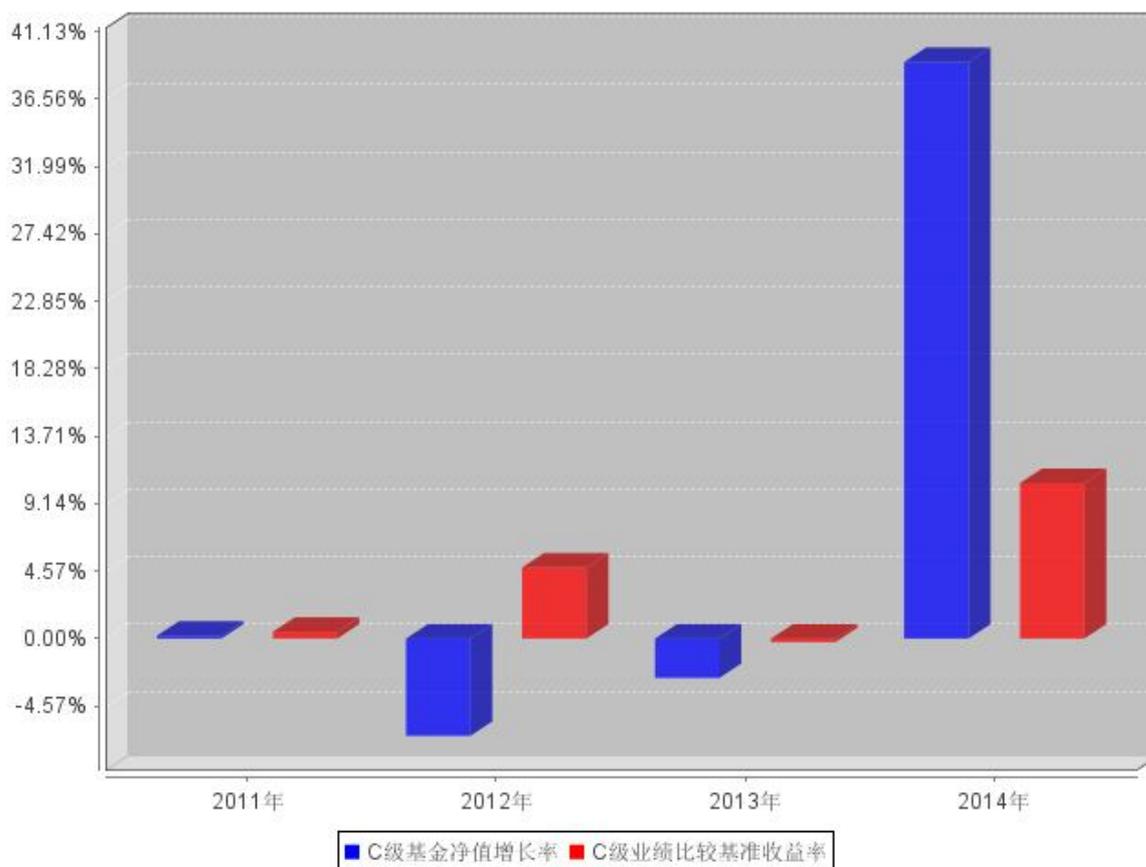
注：按基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同第十四条（二）投资范围、（八）投资禁止行为与限制的有关约定。

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

**A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**



**C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**



注：长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金合同于 2011 年 12 月 6 日生效，合同生效当年净值增长率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2014 年度、2013 年度、2012 年度会计期间未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2014 年 12 月 31 日，基金管理人共管理三十七只开放式基金，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		
马文祥	本基金基金经理，长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放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基金经理，固定收益部副总监。	2014 年 9 月 10 日	-	11 年	男，1977 年 7 月出生，中国国籍。清华大学经济管理学院经济学硕士。历任中国农业银行主任科员，工银瑞信企业年金基金经理、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理；2013 年 8 月加入长盛基金管理有限公司，现任固定收益部副总监，长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛同禧信用增利债券型证券投资基金（本基金）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，长盛季季红 1 年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。
贾志敏	本基金基金经理，长盛货币市场基金基金经理，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基金经理，长盛年年收益	2013 年 2 月 7 日	2014 年 10 月 24 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

	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。			放债券型证券投资基金基金经理等职务。自 2014 年 10 月 24 日起不再担任长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理。
--	---	--	--	---

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

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司对该基金过去 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

##### 1、报告期内行情回顾

回顾 2014 年，经济增速有所下滑，通胀水平总体呈下降走势，定向放松的货币政策及相对宽松的资金面驱动市场利率中枢持续下行，债券市场走出一波较强的趋势性牛市行情。利率债方面，收益率曲线整体下行，10 年期国债收益率下行 93BP 至 3.62%，10 年期国开行债收益率大幅下行 173BP 至 4.09%；信用债方面，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债券质押回购规则变动等因素影响所致。

货币市场方面，2014 年资金面总体呈现相对宽松格局。一季度受春节因素影响，资金利率呈现先升后降走势；4 月份开始，央行通过定向降准降息、MLF、PSL 等多种工具向市场投放资金，资金面相对宽松，各中短期限 Shibor 利率及银行间质押式回购利率总体处于相对低位；其中，7 月和 11 月银行间资金利率小幅上行，但央行后续均投放资金平抑资金利率波动；十二月中旬以来，随着年末资金需求高峰来临，银行收紧流动性，同时受央行公开市场延续空窗操作及新一轮 IPO 等因素影响，货币市场各中短期资金利率呈现阶段性上升局面。

权益资产方面，上半年 A 股市场维持震荡格局；下半年以来，受益于无风险利率下行、沪港通政策、国企改革预期以及货币政策放松预期等多重利好因素影响，增量资金加速流入 A 股市场，驱动 A 股市场形成持续上涨的牛市行情；受正股快速上涨及可转债稀缺性凸显等因素影响，下半年可转债总体呈现持续上涨行情。

##### 2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金始终把握配置节奏，根据市场变化调整组合久期，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状况，严格控制其持仓比例，防控信用风险。同时，下半年紧跟市场变化，增配股票和可转债配置，全面提升权益资产占比，择机进行波段操作，进一步提升组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，长盛同禧信用增利债券 A 的基金份额净值为 1.288 元，本报告期份额净值增长率为 39.70%，同期业绩比较基准增长率为 10.54%。

截止报告期末，长盛同禧信用增利债券 C 的基金份额净值为 1.267 元，本报告期份额净值增长率为 39.08%，同期业绩比较基准增长率为 10.54%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在深化改革和调整经济结构的背景下，政府对经济增长容忍度有所提高，国内经济的潜在增长率不断下降，2015 年预计中国经济将维持相对疲弱的态势。12 月中国 PMI 连续下滑至 50.1% 的年内低值，制造业新订单和产出指数双双走弱，反映制造业景气度持续弱化，经济下行压力依然存在。通胀方面，12 月 CPI 同比上涨 1.5%，通胀延续弱势。房地产投资增速继续下降，未来房地产销售仍面临较大不确定性。在经济仍面临较大下行压力的背景下，货币政策有望进一步宽松。

在后期投资策略上，对利率债，维持谨慎乐观态度，密切关注经济基本面、货币政策和资金面的各种变化，在仓位和久期上根据市场形势变化灵活应对；对信用债，深入研究行业及个券信用利差变化，积极发掘信用风险可控、持有期收益较高的个券，并且密切跟踪持仓债券的信用风险状况，严防信用风险。同时，密切关注权益市场变化以及转债个券可能存在的条款博弈机会，择机进行波段操作，有效提升组合收益。

#### 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，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2014 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 5,407,186.61 元，其中：长盛同禧信用增利债券 A 期末可供分配利润为 3,033,332.76 元（长盛同禧信用增利债券 A 的未分配利润已实现部分为 3,033,332.76 元，未分配利润未实现部分为 2,027,369.73 元）；长盛同禧信用增利债券 C 期末可供分配利润为 2,373,853.85 元（长盛同禧信用增利债券 C 的未分配利润已实现部分为 2,373,853.85 元，未分配利润未实现部分为 1,749,237.47 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 2014 年 10 月 16 日至 2014 年 12 月 31 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长盛同禧信用增利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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师汤 骏、王珊珊于 2015 年 3 月 24 日对本基金 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注出具了安永华明（2015）审字第 60468688\_A06 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛同禧信用增利债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	4,736,060.13	3,843,105.05
结算备付金	1,323,366.76	2,460,442.65
存出保证金	18,913.82	15,020.23
交易性金融资产	59,613,642.72	113,739,078.32
其中：股票投资	8,315,315.35	1,694,577.25
基金投资	-	-
债券投资	51,298,327.37	112,044,501.07
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-

衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	480,740.31
应收利息	1,219,744.61	2,705,492.13
应收股利	-	-
应收申购款	738,521.35	4,130.96
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	67,650,249.39	123,248,009.65
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2014年12月31日</b>	<b>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	-	-
卖出回购金融资产款	21,399,988.30	48,862,932.10
应付证券清算款	2,920,828.86	37,929.16
应付赎回款	586,569.52	247,007.96
应付管理人报酬	24,877.43	47,714.95
应付托管费	6,633.97	12,723.98
应付销售服务费	6,312.91	11,307.41
应付交易费用	26,515.25	4,740.13
应交税费	126,797.56	126,797.56
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	332,951.17	354,739.31
负债合计	25,431,474.97	49,705,892.56
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	33,034,980.61	80,171,351.85
未分配利润	9,183,793.81	-6,629,234.76
所有者权益合计	42,218,774.42	73,542,117.09
负债和所有者权益总计	67,650,249.39	123,248,009.65

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额总额 33,034,980.61 份，其中长盛同禧信用增利债券 A 类基金份额 17,597,150.26 份，份额净值 1.288 元，长盛同禧信用增利债券 C 类基金份额 15,437,830.35 份，份额净值 1.267 元。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛同禧信用增利债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年 12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013 年12月31日
<b>一、收入</b>	18,482,023.11	2,125,406.90
1.利息收入	4,325,453.98	4,669,531.66
其中：存款利息收入	47,287.39	83,612.79
债券利息收入	4,263,480.82	4,576,243.74
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	14,685.77	9,675.13
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	5,292,193.95	4,040,190.83
其中：股票投资收益	3,490,779.02	2,969,650.71
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,750,551.92	1,033,471.79
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	50,863.01	37,068.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	8,853,217.23	-6,588,469.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	11,157.95	4,153.81
<b>减：二、费用</b>	2,163,195.68	3,097,575.02
1. 管理人报酬	454,000.91	746,768.73
2. 托管费	121,066.95	199,138.38
3. 销售服务费	105,166.91	180,214.21
4. 交易费用	115,036.11	137,379.23
5. 利息支出	1,036,677.90	1,509,340.45
其中：卖出回购金融资产支出	1,036,677.90	1,509,340.45
6. 其他费用	331,246.90	324,734.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	16,318,827.43	-972,168.12
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	16,318,827.43	-972,168.12

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同禧信用增利债券型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日
----	-----------------------------

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	80,171,351.85	-6,629,234.76	73,542,117.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,318,827.43	16,318,827.43
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）	-47,136,371.24	-505,798.86	-47,642,170.10
其中：1. 基金申购款	42,674,902.11	1,905,565.94	44,580,468.05
2. 基金赎回款	-89,811,273.35	-2,411,364.80	-92,222,638.15
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）	33,034,980.61	9,183,793.81	42,218,774.42
	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		
项目	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）	128,651,010.08	-7,683,502.39	120,967,507.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-972,168.12	-972,168.12
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）	-48,479,658.23	2,026,435.75	-46,453,222.48
其中：1. 基金申购款	4,148,763.46	-172,502.38	3,976,261.08
2. 基金赎回款	-52,628,421.69	2,198,938.13	-50,429,483.56
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）	80,171,351.85	-6,629,234.76	73,542,117.09

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：

<u>周兵</u>	<u>林培富</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛同禧信用增利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），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》的注册，由长盛基金管理有限公司于 2011 年 10 月 31 日至 2011 年 12 月 2 日向社会公开募集，首次设立募集规模为 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。

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。

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、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）、资产支持证券、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。本基金投资于固定收益类金融工具的资产比例不低于基金资产的 80%，其中信用债券投资不低于本基金固定收益类资产的 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%。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%。信用债券指金融债（政策性金融债除外）、企业债、公司债、短期融资券、地方政府债、可转换公司债券（含可分离交易的可转换债券）、资产支持证券，以及法律法规或监管部门允许基金投资的其他非国家信用的固定收益类金融工具。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： $40\% \times$  中证国债指数收益率  $+60\% \times$  中证企业债指数收益率。

#### 7.4.2 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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

会计政策变更的说明可参见 7.4.2 会计报表的编制基础。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

### 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。

### 2、营业税、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，继续免征营业税和企业所得税；

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。

### 3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

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《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。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	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”）	基金管理人股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司
长盛基金（香港）有限公司	基金管理人子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未开立关联方交易单元。

##### 7.4.8.1 关联方报酬

###### 7.4.8.1.1 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 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	454,000.91	746,768.73
其中：支付销售机构的客户维护费	224,850.45	371,149.19

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

#### 7.4.8.1.2 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 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	121,066.95	199,138.38

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

#### 7.4.8.1.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛同禧信用增利债券 A	长盛同禧信用增利债券 C	合计
中国银行	-	91,430.88	91,430.88
长盛基金管理有限公司	-	529.55	529.55
国元证券	-	-	-
合计	-	91,960.43	91,960.43
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛同禧信用增利债券 A	长盛同禧信用增利债券 C	合计
中国银行	-	155,620.84	155,620.84
长盛基金管理有限公司	-	551.55	551.55
国元证券	-	5.75	5.75
合计	-	156,178.14	156,178.14

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

#### 7.4.8.2 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均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.8.3.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 7.4.8.4 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		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	4,736,060.13	22,664.99	3,843,105.05	43,647.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于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。

#### 7.4.8.6 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2014 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告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。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 21, 399, 988. 30 元, 于 2015 年 1 月 5 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。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、应收利息、卖出回购金融资产款、应付证券清算款等, 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 47, 292, 962. 72 元, 属于第二层次的余额为人民币 12, 320, 680. 00 元, 属于第三层次的余额为人民币零元。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

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。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具, 由第一层次转入第二层次的金额为人民币 12, 044, 930. 00 元, 由第二层次转入第一层次的金额为人民币 7, 824, 950. 00 元。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

#### 7.4.14.2 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。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2015 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	8,315,315.35	12.29
	其中：股票	8,315,315.35	12.29
2	固定收益投资	51,298,327.37	75.83
	其中：债券	51,298,327.37	75.83
	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	-	-
	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	6,059,426.89	8.96
7	其他各项资产	1,977,179.78	2.92
8	合计	67,650,249.39	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	324,384.00	0.77
B	采矿业	347,130.00	0.82
C	制造业	1,821,917.14	4.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	488,219.61	1.16
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	4,528,006.60	10.73
K	房地产业	805,658.00	1.91
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	8,315,315.35	19.70

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601398	工商银行	328,300	1,598,821.00	3.79
2	601601	中国太保	28,322	914,800.60	2.17
3	000528	柳 工	66,208	832,896.64	1.97
4	600271	航天信息	16,600	506,466.00	1.20
5	601800	中国交建	35,149	488,219.61	1.16
6	000748	长城信息	12,405	482,554.50	1.14
7	601336	新华保险	9,600	475,776.00	1.13
8	000002	万 科 A	32,900	457,310.00	1.08
9	600837	海通证券	16,500	396,990.00	0.94
10	601939	建设银行	58,500	393,705.00	0.93

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.csfunds.com.cn> 网站的年度报告正文。

### 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

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	601766	中国南车	3,547,500.00	4.82
2	600585	海螺水泥	2,922,600.00	3.97
3	002454	松芝股份	2,670,446.19	3.63
4	600837	海通证券	2,198,775.00	2.99
5	601318	中国平安	2,180,481.00	2.96
6	601186	中国铁建	1,822,900.00	2.48

7	601398	工商银行	1,523,312.00	2.07
8	000748	长城信息	1,404,678.73	1.91
9	002118	紫鑫药业	1,375,398.00	1.87
10	600600	青岛啤酒	1,272,765.14	1.73
11	601118	海南橡胶	1,129,260.00	1.54
12	000024	招商地产	1,089,909.00	1.48
13	601225	陕西煤业	1,064,038.00	1.45
14	000528	柳 工	1,029,862.00	1.40
15	601800	中国交建	986,400.00	1.34
16	300248	新开普	805,343.00	1.10
17	601688	华泰证券	801,000.00	1.09
18	601601	中国太保	732,990.28	1.00
19	600125	铁龙物流	727,677.99	0.99
20	600303	曙光股份	677,122.00	0.92

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601766	中国南车	3,293,858.92	4.48
2	002454	松芝股份	3,118,915.71	4.24
3	600585	海螺水泥	3,068,022.48	4.17
4	601186	中国铁建	2,573,400.00	3.50
5	601318	中国平安	2,194,667.67	2.98
6	600837	海通证券	2,063,910.10	2.81
7	002118	紫鑫药业	1,570,057.95	2.13
8	600303	曙光股份	1,548,310.47	2.11
9	000748	长城信息	1,538,371.22	2.09
10	601800	中国交建	1,357,916.40	1.85
11	600600	青岛啤酒	1,228,928.90	1.67
12	300248	新开普	1,191,911.00	1.62
13	000024	招商地产	1,021,740.53	1.39
14	002138	顺络电子	901,134.50	1.23
15	601118	海南橡胶	872,882.00	1.19
16	601225	陕西煤业	820,247.00	1.12
17	601688	华泰证券	720,700.00	0.98
18	600125	铁龙物流	665,000.00	0.90
19	300339	润和软件	619,405.93	0.84

20	600686	金龙汽车	575,874.89	0.78
----	--------	------	------------	------

### 8.4.3 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	38,206,119.33
卖出股票收入（成交）总额	36,523,363.48

注：本项中 8.4.1、8.4.2 和 8.4.3 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。

### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	31,822,937.00	75.38
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	19,475,390.37	46.13
8	其他	-	-
9	合计	51,298,327.37	121.51

### 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

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	110023	民生转债	28,520	3,943,460.40	9.34
2	112077	12 天沃债	34,950	3,540,435.00	8.39
3	112172	13 普邦债	35,000	3,447,500.00	8.17
4	122703	12 鞍城投	30,000	3,207,000.00	7.60
5	111052	09 哈城投	30,000	3,105,000.00	7.35

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.11 投资组合报告附注

### 8.11.1

根据中国证监会 2014 年 5 月 29 日发布的《中国证监会对新股发行承销违规机构和个人采取监管措施》显示，海通证券因向禁止配售的配售对象配售股票、向投资者提供超出招股书范围的发行人信息等事项受到中国证监会“出具警示函”、“监管谈话”的监管措施。本基金做出如下说明：

海通证券是国内成立最早、综合实力最强的大型券商之一，基本面良好。基于相关研究，本基金认为：证监会的监管措施对于公司整体经营业绩不构成重大影响。因此，我们审慎地将海通证券在配置上作为组合的阶段性重要投资品种。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，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，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 8.11.2

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。

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	18,913.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	1,219,744.61
5	应收申购款	738,521.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,977,179.78

#### 8.11.4 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	110023	民生转债	3,943,460.40	9.34
2	110015	石化转债	2,744,272.80	6.50
3	113002	工行转债	1,855,923.60	4.40
4	113005	平安转债	1,493,877.60	3.54
5	127002	徐工转债	1,272,204.69	3.01
6	110018	国电转债	1,038,996.00	2.46
7	110020	南山转债	984,250.50	2.33
8	110019	恒丰转债	819,739.20	1.94
9	128005	齐翔转债	197,216.96	0.47
10	113006	深燃转债	193,208.40	0.46

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长盛同禧信用增利债券 A	364	48,343.82	0.70	0.00%	17,597,149.56	100.00%
长盛同禧信用增利债券 C	468	32,986.82	-	-	15,437,830.35	100.00%

合计	832	39,705.51	0.70	0.00%	33,034,979.91	100.00%
----	-----	-----------	------	-------	---------------	---------

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	长盛同禧信用增利债券 A	-	-
	长盛同禧信用增利债券 C	1,000.77	0.0065%
	合计	1,000.77	0.0030%

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

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	长盛同禧信用增利债券 A	0
	长盛同禧信用增利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	长盛同禧信用增利债券 A	0
	长盛同禧信用增利债券 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛同禧信用增 利债券 A	长盛同禧信用增 利债券 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	44,277,274.47	35,894,077.38
本报告期基金总申购份额	30,638,514.56	12,036,387.55
减：本报告期基金总赎回份额	57,318,638.77	32,492,634.58
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	17,597,150.26	15,437,830.35

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

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。

#### 11.2.2 基金经理的变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2014 年 9 月 10 日起，马文祥同志兼任长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理；自 2014 年 10 月 24 日起，贾志敏同志不再兼任长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理。

#### 11.2.3 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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为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，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 50,000.00 元，已连续提供审计服务 3 年。

**11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

**11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
宏源证券	1	50,201,262.17	67.43%	45,703.23	67.43%	-
华创证券	1	24,246,425.64	32.57%	22,074.16	32.57%	-

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
宏源证券	137,205,881.77	64.08%	1,733,900,000.00	52.34%	-	-
华创证券	76,906,963.30	35.92%	1,578,732,000.00	47.66%	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资历雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

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

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

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

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

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

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

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、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。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

长盛基金管理有限公司  
2015年3月28日