

# 长盛同禧信用增利债券型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 25 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 2016 年 8 月 24 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 2016 年 01 月 01 日起至 06 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
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
<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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.11 投资组合报告附注.....	41

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	43
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>43</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	46
<b>§11 备查文件目录</b> .....	<b>49</b>
11.1 备查文件目录.....	49
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同禧信用增利债券型证券投资基金	
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	384,900,408.11 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	381,010,053.56 份	3,890,354.55 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	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	叶金松
	联系电话	010-82019988
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666	95566

	010-62350088	
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	《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	长盛同禧信用增利债券 A	长盛同禧信用增利债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-8,379,667.07	-138,599.05
本期利润	-9,503,479.39	-180,329.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0281	-0.0416
本期加权平均净值利润率	-2.11%	-3.19%
本期基金份额净值增长率	-2.87%	-3.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	121,020,891.16	1,112,196.09
期末可供分配基金份额利润	0.3176	0.2859
期末基金资产净值	502,030,944.72	5,002,550.64
期末基金份额净值	1.318	1.286
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	31.80%	28.60%

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
过去一个月	0.53%	0.05%	0.66%	0.05%	-0.13%	0.00%
过去三个月	-2.08%	0.25%	0.23%	0.06%	-2.31%	0.19%
过去六个月	-2.87%	0.21%	1.85%	0.06%	-4.72%	0.15%
过去一年	-1.57%	0.31%	7.18%	0.06%	-8.75%	0.25%
过去三年	37.72%	0.55%	19.29%	0.09%	18.43%	0.46%
自基金合同生效起至今	31.80%	0.49%	29.01%	0.08%	2.79%	0.41%

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
过去一个月	0.47%	0.05%	0.66%	0.05%	-0.19%	0.00%
过去三个月	-2.21%	0.25%	0.23%	0.06%	-2.44%	0.19%
过去六个月	-3.16%	0.21%	1.85%	0.06%	-5.01%	0.15%
过去一年	-2.21%	0.31%	7.18%	0.06%	-9.39%	0.25%
过去三年	35.65%	0.55%	19.29%	0.09%	16.36%	0.46%
自基金合同生效起至今	28.60%	0.48%	29.01%	0.08%	-0.41%	0.40%

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。

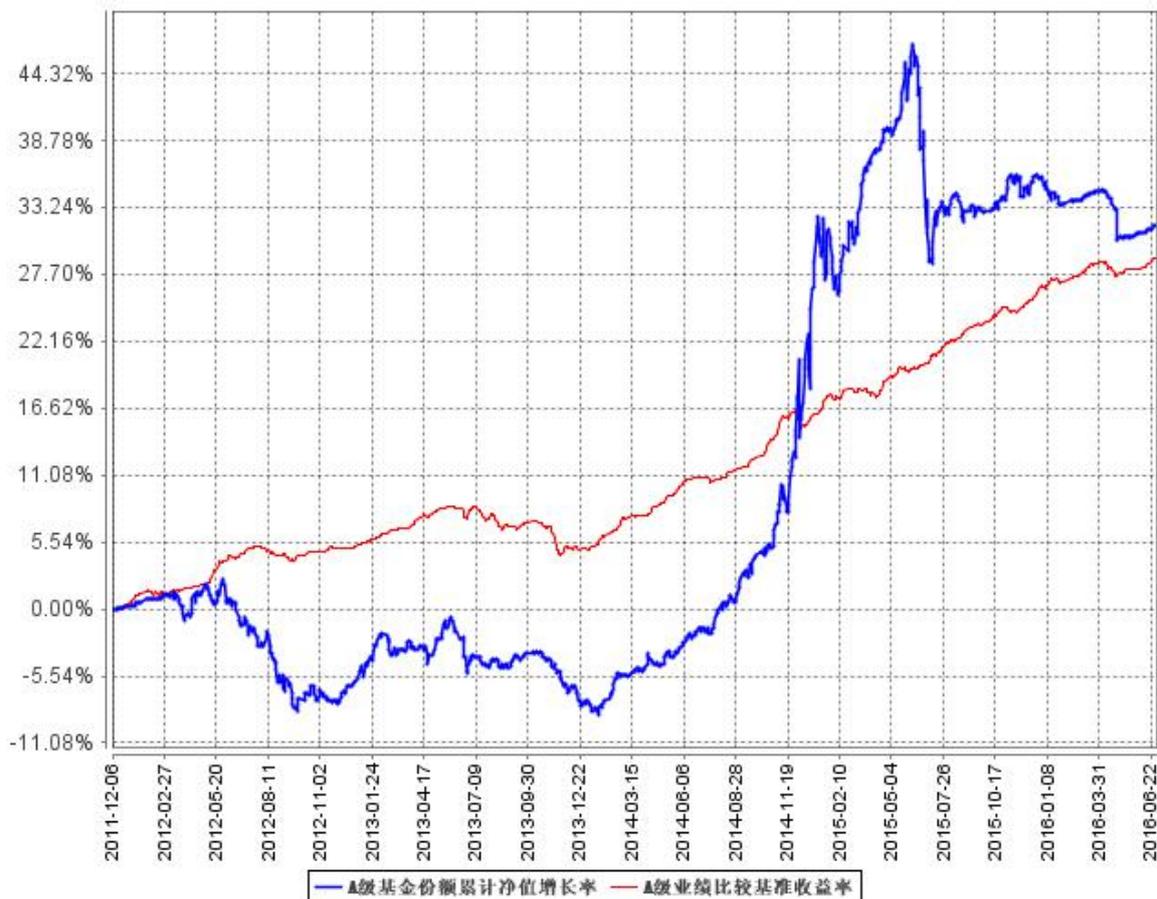
中证企业债指数是中证指数公司编制的，反映我国企业债市场整体价格和投资回报情况的指数，样本券包括在银行间债券市场、上海证券交易所和深圳证券交易所流通的剩余期限在 1 年以上的企业债。

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。

## § 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2016年6月30日，基金管理人共管理四十六只开

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，长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金经理。	2016 年 1 月 20 日	-	9 年	男，1983 年 1 月出生，中国国籍。华中科技大学硕士。曾在长江证券股份有限公司从事债券研究、债券投资工作。2012 年 4 月加入长盛基金管理有限公司，曾任非信用研究员，长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理等职务。现任长盛同禧信用增利债券型证券投资基金（本基金），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，长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金经理。
乔林建	本基金基金经理，长盛动态精选证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长混合	2016 年 1 月 20 日	-	14 年	男，1976 年 1 月出生，中国国籍。经济学硕士。历任新华人寿保险公司研究员、投资经理，新华资产管理公司高级投资经理，建信基金管理公司资深投资经理、基金经理助理、基金经理。2015 年 6 月加入长盛基金管理有限公司，现任权益投资部副总监，长盛动态精选证券投

	型证券投资基金基金经理，权益投资部副总监。				资基金基金经理，长盛同德主题增长混合型证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。
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，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛同泰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	2016 年 1 月 20 日	12 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，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛同泰债券型证券投资基金基金经理。自 2016 年 1 月 6 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

2016 年上半年，在基建和地产的传统引擎拉动下，宏观经济短期企稳，但是在“去产能、去杠杆”环境下，过低的投资回报导致企业投资意愿持续走弱，经济下行压力仍大。通胀方面，一季度食品价格超预期上涨叠加大宗商品价格反弹推升通胀预期，二季度随着季节性因素消退，食品价格回落带动通胀回落。货币政策更趋于稳健，央行利率调控机制由数量型向价格型转变，更倾向于通过逆回购、SLF、MLF、PSL 等工具投放流动性，而对于降准降息等全面投放流动性方式相对谨慎。

债券市场整体呈现先跌后涨的震荡走势。利率债收益率曲线总体有所上行，期限利差有所收窄；信用债收益率曲线平坦化，中高评级信用利差压缩至历史低位，而低评级债券信用利差仍保持在较高位置，主要是违约风险频发所致。

货币市场方面，央行运用回购及 MLF 等多种工具调节流动性，市场流动性整体保持相对宽松局面，各中短期限 Shibor 利率及银行间质押式回购利率维持在较低水平。

股票市场整体呈现快速下跌后震荡盘整走势。1 月份，受人民币贬值预期、股东减持、新股发行注册制改革加速等因素影响，叠加指数熔断机制的“磁吸效应”，股市连续快速下跌；2 月份以来，随着恐慌情绪修复，股市呈现震荡盘整走势。市场也孕育了一些主题和结构性的机会，如受益于短期稳增长的地产等周期性行业、白酒等涨价题材以及代表未来发展方向的新兴成长产业如节能环保、新能源汽车等。

#### 2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金坚持稳健操作思路，在信用风险可控的前提下重点配置中短期信用债，保持组合流动性，适度参与利率品种的投资机会。权益资产方面，以绝对收益理念为导向，根据市场行情变化灵活调整权益资产比重，以避免净值大幅波动；同时，精选股票，择机进行波段操作，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 1.318 元，本报告期份额净值增长率为-2.87%，同期业绩比较基准增长率为 1.85%。

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 1.286 元，本报告期份额净值增长率为-3.16%，同期业绩比较基准增长率为 1.85%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经济结构转型和供给侧改革背景下，宏观经济稳中有忧，制造业与民间投资单月负增长，房地产销量和投资增速见顶回落，均预示下半年经济依然承压。在经济疲弱和积极财政基调下，稳健的货币政策转向可能性不大。从需求层面看，银行理财等资管规模扩大以及到期高票息资产再配置压力仍大，资产荒局面仍未改变。总体来看，疲弱的基本面、相对充裕的流动性、较低的通胀水平及旺盛的配置需求将继续为债市提供有利支撑，但同时也要密切关注财政政策加码、金融监管排风险去杠杆、贬值压力对货币政策的制约、美联储加息预期、信用风险爆发等风险因素的影响。

股票市场方面，对中长期经济前景的隐忧使得市场风险偏好难以显著回升，存量资金博弈格局短期难以得到实质性扭转。当前股市不具备较强的趋势性机会，股指运行上下空间均较为有限，但随着经济结构转型及供给侧改革的推进，未来市场将孕育出一些结构性机会。投资方向上，把握经济转型过程中新兴行业的高成长机会，以及消费升级、并购重组等机会。

#### 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（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

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

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，

由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

#### 4.7 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 2016 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 122,133,087.25 元，其中：长盛同禧信用增利债券 A 期末可供分配利润为 121,020,891.16 元（长盛同禧信用增利债券 A 的未分配利润已实现部分为 133,842,023.97 元，未分配利润未实现部分为-12,821,132.81 元），长盛同禧信用增利债券 C 期末可供分配利润为 1,112,196.09 元（长盛同禧信用增利债券 C 的未分配利润已实现部分为 1,250,430.19 元，未分配利润未实现部分为-138,234.10 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

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛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：长盛同禧信用增利债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	24,720,468.78	20,691,114.29
结算备付金		700,979.69	98,426.42
存出保证金		41,776.35	8,510.26
交易性金融资产	6.4.7.2	610,883,681.44	18,220,417.95
其中：股票投资		22,472,542.24	1,740,413.00
基金投资		-	-
债券投资		588,411,139.20	16,480,004.95
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	-	40,045,150.07
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	6,760,133.92	639,820.35
应收股利		-	-
应收申购款		5,525.75	181,251.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		643,112,565.93	79,884,691.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 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		114,699,495.45	-
应付证券清算款		20,648,632.53	20,117,010.38
应付赎回款		69,922.21	28,684.75
应付管理人报酬		310,674.54	13,123.42
应付托管费		82,846.53	3,499.57
应付销售服务费		1,615.28	2,122.61
应付交易费用	6.4.7.7	42,241.81	36,161.51
应交税费		126,797.56	126,797.56
应付利息		14,538.15	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	82,306.51	152,686.59
负债合计		136,079,070.57	20,480,086.39
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	384,900,408.11	43,878,096.03
未分配利润	6.4.7.10	122,133,087.25	15,526,508.79
所有者权益合计		507,033,495.36	59,404,604.82
负债和所有者权益总计		643,112,565.93	79,884,691.21

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，长盛同禧信用增利债券 A 类基金份额净值人民币 1.318 元，长盛同禧信用增利债券 C 类基金份额净值人民币 1.286 元；基金份额总额 384,900,408.11 份，其中，长盛同禧信用增利债券 A 类基金份额 381,010,053.56 份；长盛同禧信用增利债券 C 类基金份额 3,890,354.55 份

## 6.2 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-5,831,994.80	2,084,032.16
1.利息收入		9,682,289.63	1,002,414.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	106,743.14	20,470.11
债券利息收入		9,516,274.11	980,420.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		59,272.38	1,523.86
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-14,360,948.31	6,910,535.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,169,997.50	2,940,968.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-12,275,579.11	3,937,396.91
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	84,628.30	32,169.94
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,165,542.61	-5,844,983.52
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	12,206.49	16,066.09
<b>减：二、费用</b>		3,851,813.93	496,282.03

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,701,706.31	123,651.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	453,788.31	32,973.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	11,230.18	29,450.15
4. 交易费用	6.4.7.19	120,876.57	87,010.31
5. 利息支出		1,463,517.51	143,623.15
其中：卖出回购金融资产支出		1,463,517.51	143,623.15
6. 其他费用	6.4.7.20	100,695.05	79,573.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-9,683,808.73	1,587,750.13
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-9,683,808.73	1,587,750.13

### 6.3 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：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	43,878,096.03	15,526,508.79	59,404,604.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,683,808.73	-9,683,808.73
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）	341,022,312.08	116,290,387.19	457,312,699.27
其中：1.基金申购款	377,287,646.42	129,034,110.49	506,321,756.91
2.基金赎回款	-36,265,334.34	-12,743,723.30	-49,009,057.64
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）	384,900,408.11	122,133,087.25	507,033,495.36
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	33,034,980.61	9,183,793.81	42,218,774.42
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	1,587,750.13	1,587,750.13
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)	-13,967,084.70	-4,459,297.05	-18,426,381.75
其中：1.基金申购款	43,812,661.18	15,168,444.26	58,981,105.44
2.基金赎回款	-57,779,745.88	-19,627,741.31	-77,407,487.19
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)	19,067,895.91	6,312,246.89	25,380,142.80

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

\_\_\_\_\_  
杨思乐

\_\_\_\_\_  
龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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： $40\% \times \text{中证国债指数收益率} + 60\% \times \text{中证企业债指数收益率}$ 。

#### 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 2016 年 06 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期不存在会计估计政策变更。

##### 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 营业税、增值税

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；

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，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值

税；

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，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

#### 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[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、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；

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。

## 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	24,720,468.78
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	24,720,468.78

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,804,563.27	22,472,542.24	-1,332,021.03
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	113,778,863.61	113,735,139.20
	银行间市场	474,437,771.75	474,676,000.00
	合计	588,216,635.36	588,411,139.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	612,021,198.63	610,883,681.44	-1,137,517.19

### 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

注：本基金本期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.1 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
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,999.85
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	283.86
应收债券利息	6,755,833.29
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	16.92
合计	6,760,133.92

#### 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 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	31,660.24
银行间市场应付交易费用	10,581.57
合计	42,241.81

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3.10
其他	12,686.59
预提费用	69,616.82
合计	82,306.51

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛同禧信用增利债券 A		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,161,127.13	39,161,127.13
本期申购	375,425,089.62	375,425,089.62
本期赎回(以“-”号填列)	-33,576,163.19	-33,576,163.19
- 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	381,010,053.56	381,010,053.56

金额单位：人民币元

长盛同禧信用增利债券 C		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	4,716,968.90	4,716,968.90
本期申购	1,862,556.80	1,862,556.80
本期赎回(以“-”号填列)	-2,689,171.15	-2,689,171.15
- 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	3,890,354.55	3,890,354.55

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

长盛同禧信用增利债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,028,861.34	-1,049,233.76	13,979,627.58
本期利润	-8,379,667.07	-1,123,812.32	-9,503,479.39
本期基金份额交易产生的变动数	127,192,829.70	-10,648,086.73	116,544,742.97
其中：基金申购款	140,029,779.19	-11,566,938.12	128,462,841.07
基金赎回款	-12,836,949.49	918,851.39	-11,918,098.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,842,023.97	-12,821,132.81	121,020,891.16

单位：人民币元

长盛同禧信用增利债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,671,041.95	-124,160.74	1,546,881.21
本期利润	-138,599.05	-41,730.29	-180,329.34
本期基金份额交易产生的变动数	-282,012.71	27,656.93	-254,355.78
其中：基金申购款	633,601.69	-62,332.27	571,269.42
基金赎回款	-915,614.40	89,989.20	-825,625.20
本期已分配利润	-	-	-

本期末	1, 250, 430. 19	-138, 234. 10	1, 112, 196. 09
-----	-----------------	---------------	-----------------

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	78, 865. 45
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	9, 728. 69
其他	18, 149. 00
合计	106, 743. 14

#### 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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	26, 705, 499. 56
减：卖出股票成本总额	28, 875, 497. 06
买卖股票差价收入	-2, 169, 997. 50

#### 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 2016年1月1日至2016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	-12, 275, 579. 11
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	-12, 275, 579. 11

##### 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 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	602, 809, 531. 96
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	604, 819, 187. 44

减：应收利息总额	10,265,923.63
买卖债券差价收入	-12,275,579.11

#### 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 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	84,628.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	84,628.30

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,165,542.61
——股票投资	-1,321,951.14
——债券投资	156,408.53
——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	-
合计	-1,165,542.61

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	10,387.74
基金转换费收入	1,818.75
合计	12,206.49

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	106,926.57
银行间市场交易费用	13,950.00
合计	120,876.57

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	44,753.80
银行汇划费	17,478.23
上清所帐户维护费	4,600.00
银行间账户维护费	9,000.00
合计	100,695.05

#### 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

本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 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

##### 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：本基金无关联方交易单元，未发生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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,701,706.31	123,651.24
其中：支付销售机构的客户维护费	31,939.89	58,139.17

注：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

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 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
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	453,788.31	32,973.63

注：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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

#### 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		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛同禧信用增利债券 A	长盛同禧信用增利债券 C	合计
中国银行	-	4,708.02	4,708.02
长盛基金管理有限公司	-	609.84	609.84
合计	-	5,317.86	5,317.86

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛同禧信用增利 债券 A	长盛同禧信用增利 债券 C	合计
中国银行	-	15,523.54	15,523.54
长盛基金管理有限公司	-	1,230.90	1,230.90
合计	-	16,754.44	16,754.44

注：基金销售服务费可用于本基金持续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 类基金份额销售服务费年费率为 0.40%。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 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

单位：人民币元

银行间市场交易 的各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	21,402,993.34	-	-	-	-	-

注：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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 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	24,720,468.78	78,865.45	905,785.76	10,750.34

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。

#### 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

注：本基金本期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2016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的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

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 69,699,495.45 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011699370	16 佛公用 SCP003	2016 年 7 月 5 日	100.09	200,000	20,018,000.00
041559068	15 常州投资 CP002	2016 年 7 月 5 日	100.50	200,000	20,100,000.00
041562068	15 平发投 CP001	2016 年 7 月 5 日	100.69	200,000	20,138,000.00
041658009	16 株洲国投 CP001	2016 年 7 月 5 日	99.74	100,000	9,974,000.00
合计				700,000	70,230,000.00

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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 45,000,000.00 元，于 2016 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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	149,905,000.00	-
合计	149,905,000.00	-

注：未评级债券为短期融资券、国债。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	上年度末
--------	-----	------

	2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
AAA	134,868,032.20	-
AAA 以下	182,229,352.00	13,479,704.95
未评级	121,408,755.00	3,000,300.00
合计	438,506,139.20	16,480,004.95

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。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 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。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

### 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财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出权证保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							

银行存款	24,720,468.78	-	-	-	-	-	24,720,468.78
结算备付金	700,979.69	-	-	-	-	-	700,979.69
存出保证金	41,776.35	-	-	-	-	-	41,776.35
交易性金融资产	20,788,300.00	40,071,000.00	271,273,501.00	213,177,765.00	43,100,573.20	22,472,542.24	610,883,681.44
应收利息	-	-	-	-	-	6,760,133.92	6,760,133.92
应收申购款	600.00	-	-	-	-	4,925.75	5,525.75
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	46,252,124.82	40,071,000.00	271,273,501.00	213,177,765.00	43,100,573.20	29,237,601.91	643,112,565.93
负债							
卖出回购金融资产款	114,699,495.45	-	-	-	-	-	114,699,495.45
应付证券清算款	-	-	-	-	-	20,648,632.53	20,648,632.53
应付赎回款	-	-	-	-	-	69,922.21	69,922.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	310,674.54	310,674.54
应付托管费	-	-	-	-	-	82,846.53	82,846.53
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,615.28	1,615.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	42,241.81	42,241.81
应付利息	-	-	-	-	-	14,538.15	14,538.15
应交税费	-	-	-	-	-	126,797.56	126,797.56
其他负债	-	-	-	-	-	82,306.51	82,306.51
负债总计	114,699,495.45	-	-	-	-	21,379,575.12	136,079,070.57
利率敏感度缺口	-68,447,370.63	40,071,000.00	271,273,501.00	213,177,765.00	43,100,573.20	7,858,026.79	507,033,495.36
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	20,691,114.29	-	-	-	-	-	20,691,114.29
结算备付金	98,426.42	-	-	-	-	-	98,426.42
存出保证金	8,510.26	-	-	-	-	-	8,510.26
交易性金融资产	3,200,380.00	-	3,339,210.00	9,940,414.95	-	1,740,413.00	18,220,417.95
买入返售金融资产	40,045,150.07	-	-	-	-	-	40,045,150.07
应收证券清算款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	-	-	639,820.35	639,820.35
应收申购款	-	-	-	-	-	181,251.87	181,251.87
资产总计	64,043,581.04	-	3,339,210.00	9,940,414.95	-	2,561,485.22	79,884,691.21

负债							
应付证券清算款						20,117,010.38	20,117,010.38
应付赎回款						28,684.75	28,684.75
应付管理人报酬						13,123.42	13,123.42
应付托管费						3,499.57	3,499.57
应付销售服务费						2,122.61	2,122.61
应付交易费用						36,161.51	36,161.51
应交税费						126,797.56	126,797.56
其他负债						152,686.59	152,686.59
负债总计						20,480,086.39	20,480,086.39
利率敏感度缺口	64,043,581.04	0.00	3,339,210.00	9,940,414.95		-17,918,601.17	59,404,604.82

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的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	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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	+25个基准点	-2,662,462.46	-63,712.45
	-25个基准点	2,662,462.46	63,712.45

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

在资产类别配置上，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、持有可转换股所得的股票、投资二级市场股票以及权证等权益类工具，但上述权益类金

融工具的投资比例合计不得超过基金资产的 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%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	22,472,542.24	4.43	1,740,413.00	2.93
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	22,472,542.24	4.43	1,740,413.00	2.93

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2016 年 6 月 30 日及 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产权益类工具公允价值占基金资产净值的比例分别为 4.43% 和 2.93%，因此除市场利率和外汇汇率以外的其他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

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 25,559,115.44 元，属于第二层次的余额为人民币 585,324,566.00 元，属于第三层次的余额为人民币零元。(2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,567,693.00 元，第二层次 16,652,724.95 元，无第三层次)。于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债均属于第一层次(2015 年 12 月 31 日：同)。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

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。

#### 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

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	22,472,542.24	3.49
	其中：股票	22,472,542.24	3.49
2	固定收益投资	588,411,139.20	91.49
	其中：债券	588,411,139.20	91.49
	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	25,421,448.47	3.95
7	其他各项资产	6,807,436.02	1.06
8	合计	643,112,565.93	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	-	-
C	制造业	13,674,168.00	2.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	-	-
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	4,615,374.24	0.91
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	4,183,000.00	0.82
	合计	22,472,542.24	4.43

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 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	600518	康美药业	612,000	9,296,280.00	1.83
2	300070	碧水源	310,173	4,615,374.24	0.91
3	600572	康恩贝	675,600	4,377,888.00	0.86
4	600175	美都能源	890,000	4,183,000.00	0.82

注：本基金本报告期末仅持有上述 4 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	600518	康美药业	11,240,502.40	18.92
2	002008	大族激光	5,053,133.08	8.51
3	600175	美都能源	4,970,600.00	8.37

4	600572	康恩贝	4,848,630.40	8.16
5	300070	碧水源	4,637,908.47	7.81
6	300199	翰宇药业	2,100,468.50	3.54
7	601311	骆驼股份	2,004,440.09	3.37
8	601888	中国国旅	2,001,782.92	3.37
9	601021	春秋航空	1,989,867.10	3.35
10	002308	威创股份	1,934,707.96	3.26
11	300146	汤臣倍健	1,925,111.03	3.24
12	600485	信威集团	1,917,409.00	3.23
13	600289	亿阳信通	1,905,482.00	3.21
14	603555	贵人鸟	1,455,036.49	2.45
15	000860	顺鑫农业	951,554.00	1.60
16	600887	伊利股份	786,216.00	1.32
17	002579	中京电子	284,995.00	0.48
18	002527	新时达	136,900.00	0.23
19	000705	浙江震元	126,683.00	0.21
20	002510	天汽模	99,750.00	0.17

#### 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	002008	大族激光	5,137,823.85	8.65
2	601888	中国国旅	1,853,992.00	3.12
3	300199	翰宇药业	1,852,120.78	3.12
4	600485	信威集团	1,793,244.74	3.02
5	601311	骆驼股份	1,786,594.00	3.01
6	600518	康美药业	1,781,334.00	3.00
7	600289	亿阳信通	1,756,429.00	2.96
8	601021	春秋航空	1,720,227.00	2.90
9	300146	汤臣倍健	1,715,984.30	2.89
10	002308	威创股份	1,663,610.26	2.80
11	603555	贵人鸟	1,196,271.81	2.01
12	000860	顺鑫农业	1,055,040.00	1.78
13	600887	伊利股份	850,800.00	1.43
14	002142	宁波银行	263,704.00	0.44
15	002579	中京电子	258,919.82	0.44

16	600730	中国高科	239,616.00	0.40
17	000777	中核科技	223,300.00	0.38
18	600118	中国卫星	188,426.00	0.32
19	300133	华策影视	150,060.00	0.25
20	002527	新时达	128,480.00	0.22

### 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	50,929,577.44
卖出股票收入（成交）总额	26,705,499.56

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	51,250,755.00	10.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,046,000.00	9.87
	其中：政策性金融债	50,046,000.00	9.87
4	企业债券	60,649,811.00	11.96
5	企业短期融资券	260,511,000.00	51.38
6	中期票据	122,967,000.00	24.25
7	可转债（可交换债）	3,086,573.20	0.61
8	同业存单	-	-
9	其他	39,900,000.00	7.87
10	合计	588,411,139.20	116.05

### 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	101553006	15 铁道 MTN001	400,000	42,392,000.00	8.36
2	011699221	16 农垦 SCP001	400,000	40,032,000.00	7.90
3	041655005	16 中山兴中 CP001	400,000	40,028,000.00	7.89
4	101652024	16 铁道 MTN002	300,000	30,357,000.00	5.99
5	101660003	16 建安投资 MTN001	300,000	30,072,000.00	5.93

**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投资。

**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**

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。

**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	41,776.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,760,133.92
5	应收申购款	5,525.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,807,436.02

**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
长盛同禧信用增利债券 A	281	1,355,907.66	372,523,178.20	97.77%	8,486,875.36	2.23%
长盛同禧信用增利债券 C	267	14,570.62	0.00	0.00%	3,890,354.55	100.00%
合计	548	1,370,478.28	372,523,178.20	96.78%	12,377,229.91	3.22%

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）。

**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	长盛同禧信用增利债券 A	0.00	0.0000%

	长盛同禧信用增利债券 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

## § 9 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	39,161,127.13	4,716,968.90
本报告期基金总申购份额	375,425,089.62	1,862,556.80
减：本报告期基金总赎回份额	33,576,163.19	2,689,171.15
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	381,010,053.56	3,890,354.55

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

**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**

本报告期本基金管理人的高级管理人员未曾变动。

**10.2.2 基金经理变动情况**

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**

本报告期内，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	46,841,072.95	60.33%	43,623.21	60.33%	-
华创证券	1	30,794,004.05	39.67%	28,678.64	39.67%	-

**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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权证

		成交总额的比例		券回购成交总额的比例		成交总额的比例
宏源证券	64,909,849.06	54.19%	1,641,500,000.00	95.69%	-	-
华创证券	54,864,201.43	45.81%	74,000,000.00	4.31%	-	-

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，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。

## 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增加汇成基金为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	《证券时报》及本公司网站	2016年6月22日
2	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加联泰资产费率优惠活动的公告	同上	2016年6月20日
3	长盛基金管理有限公司关于增加广源达信为旗下基金销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016年6月15日
4	长盛基金管理有限公司关于增加首创证券为旗下部分开放式基金代销机构以及开通基金定投业务及转换业务的公告	同上	2016年6月8日
5	长盛基金管理有限公司关于增加晟视天下为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016年6月6日
6	长盛基金管理有限公司关于增加金斧子为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016年6月3日
7	长盛基金管理有限公司关于增加中证金牛为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016年5月27日
8	长盛基金管理有限公司关于增加大泰金石为旗下基金销售机构并推出转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016年5月25日
9	长盛基金管理有限公司关于增加浦发银行为长盛同裕纯债债券型证券投资基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	同上	2016年5月23日

10	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行基金通优惠活动的公告	同上	2016 年 5 月 17 日
11	长盛基金管理有限公司关于增加盈米财富为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 5 月 9 日
12	长盛基金管理有限公司关于大连网金金融为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 4 月 27 日
13	长盛基金管理有限公司关于增加北京格上富信为旗下部分基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 4 月 26 日
14	长盛同禧信用增利债券型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	同上	2016 年 4 月 22 日
15	长盛基金管理有限公司关于增加中国农业银行为长盛新兴成长主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构以及开通定投 转换业务并参加基金申购费率优惠活动的公告	同上	2016 年 4 月 14 日
16	长盛基金管理有限公司关于增加新兰德为部分基金销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016 年 4 月 5 日
17	长盛基金管理有限公司关于参加泰信财富费率优惠活动的公告	同上	2016 年 4 月 5 日
18	长盛同禧信用增利债券型证券投资基金 2015 年度报告	同上	2016 年 3 月 26 日
19	长盛同禧信用增利债券型证券投资基金 2015 年度报告摘要	同上	2016 年 3 月 26 日
20	长盛基金管理有限公司关于联讯证券开通旗下部分开放式基金定投业务的公告	同上	2016 年 3 月 25 日
21	长盛基金管理有限公司关于在包商银行开通旗下部分基	同上	2016 年 3 月 25 日

	金转换业务的公告		
22	长盛基金管理有限公司关于增加民生银行为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	同上	2016年3月23日
23	长盛基金管理有限公司关于增加长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	同上	2016年3月17日
24	长盛基金管理有限公司关于增加奕丰金融为旗下基金销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2016年3月17日
25	长盛基金管理有限公司关于增加君德汇富为旗下部分基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2016年3月17日
26	长盛基金管理有限公司关于增加浦发银行为长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金代销机构并开通基金定投及转换业务的公告	同上	2016年3月11日
27	关于长盛同禧信用增利债券型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	同上	2016年2月15日
28	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加诺亚正行和金观诚基金费率优惠活动的公告	同上	2016年1月29日
29	关于暂停旗下部分基金在恒宇天泽的基金销售业务的公告	同上	2016年1月26日
30	关于调整长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理的公告	同上	2016年1月22日
31	关于增加恒宇天泽为旗下部分基金销售机构并开通定投及转换业务的公告	同上	2016年1月21日
32	关于增加泰信财富为旗下部分基金销售机构并开通转换	同上	2016年1月21日

	业务的公告		
33	长盛同禧信用增利债券型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	同上	2016 年 1 月 20 日
34	长盛新兴成长主题灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购 赎回 转换及定期定额投资业务的公告	同上	2016 年 1 月 8 日
35	长盛同禧信用增利债券型证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2016 年 1 月 8 日
36	长盛同禧信用增利债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2016 年 1 月 8 日
37	关于交易所指数熔断后相关基金业务办理时间调整的公告	同上	2016 年 1 月 7 日
38	长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购 赎回 转换及定期定额投资业务的公告	同上	2016 年 1 月 7 日
39	长盛基金关于旗下开放式基金指数熔断发生后相关业务处理规则的公告	同上	2016 年 1 月 4 日
40	长盛基金关于交易所指数熔断后相关基金业务办理时间调整的公告	同上	2016 年 1 月 4 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、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的办公地址和/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的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司  
2016年8月25日