

# 长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金 2016 年半年度报告 摘要

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

### 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长盛年年收益定期债券	
基金主代码	000225	
交易代码	000225	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年8月9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	56,107,723.55份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛年年收益定期债券 A	长盛年年收益定期债券 C
下属分级基金的交易代码:	000225	000226
报告期末下属分级基金的份额总额	41,473,820.12份	14,633,903.43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	<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
----	--------------	--------------

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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	长盛年年收益定期债券 A	长盛年年收益定期债券 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	965,301.14	311,591.08
本期利润	201,617.13	43,797.83
加权平均基金份额本期利润	0.0049	0.0030
本期基金份额净值增长率	0.40%	0.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.2315	0.2222
期末基金资产净值	51,451,640.34	18,012,418.74
期末基金份额净值	1.241	1.231

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（为期末余额，不是当期发生数）。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

长盛年年收益定期债券 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	0.98%	0.09%	0.12%	0.00%	0.86%	0.09%
过去三个月	0.16%	0.09%	0.37%	0.00%	-0.21%	0.09%
过去六个月	0.40%	0.15%	0.75%	0.00%	-0.35%	0.15%

过去一年	6.25%	0.15%	1.62%	0.00%	4.63%	0.15%
自基金合同生效起至今	24.10%	0.18%	7.03%	0.01%	17.07%	0.17%

长盛年年收益定期债券 C

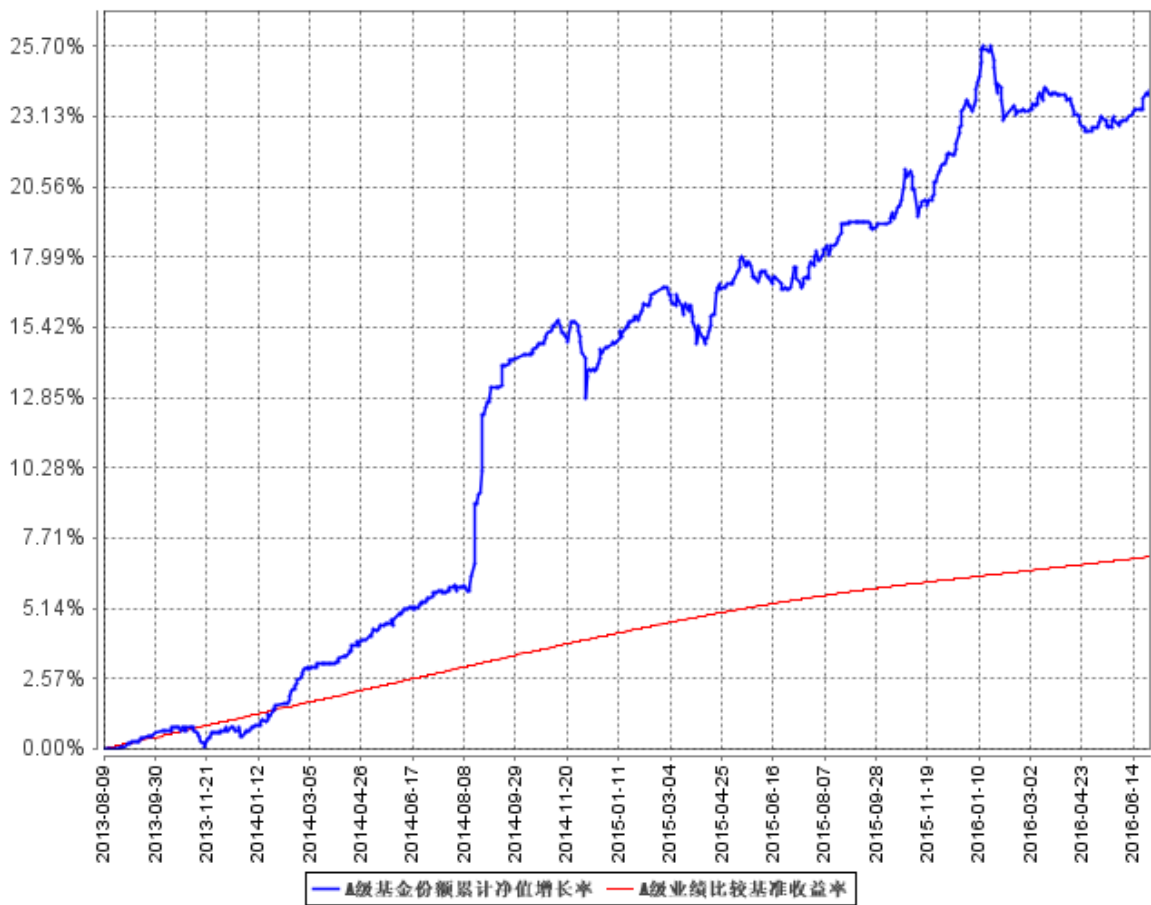
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.90%	0.08%	0.12%	0.00%	0.78%	0.08%
过去三个月	0.08%	0.09%	0.37%	0.00%	-0.29%	0.09%
过去六个月	0.24%	0.14%	0.75%	0.00%	-0.51%	0.14%
过去一年	5.85%	0.15%	1.62%	0.00%	4.23%	0.15%
自基金合同生效起至今	23.10%	0.18%	7.03%	0.01%	16.07%	0.17%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

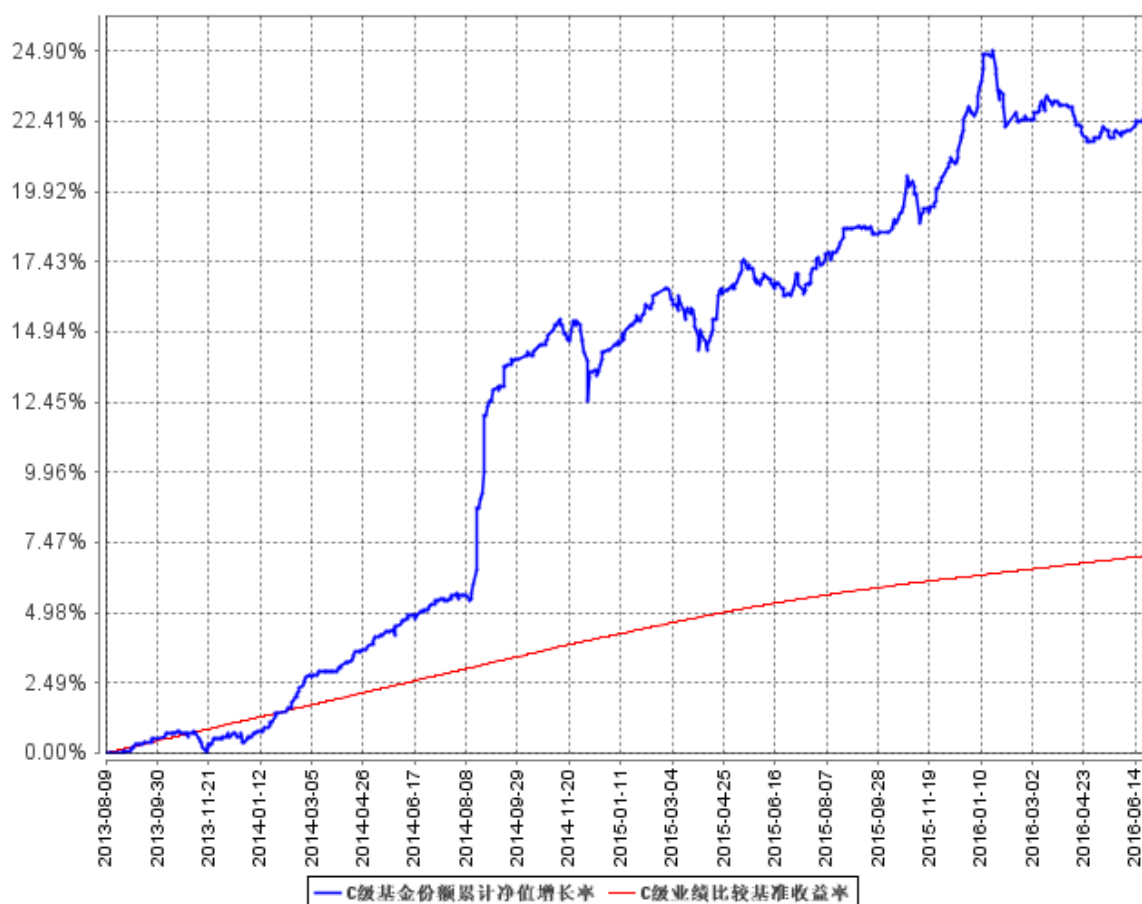
本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率。本基金是一年期定期开放债券型基金，以一年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量比较本基金的投资收益。

### 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：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓结束时，本基金的各项资产配置比例符合合同的约定。本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的约定。

## § 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		
段鹏	本基金基金经理，长盛货币市场基金基金经理。	2014年10月24日	-	9年	男，1982年12月出生，中国国籍。中央财经大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易、债券投资及流动性管理等工作。2013年12月加入长盛基金管理有限公司，现任长盛货币市场基金基金经理，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金（本基金）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 Shibor 利率及银行间质押式回购利率维持在较低水平。

## 2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金坚持稳健操作思路，在信用风险可控的前提下重点配置中等久期信用债，保持组合流动性，适度参与利率品种的投资机会。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，长盛年年收益定期债券 A 的基金份额净值为 1.241 元，本报告期份额净值增长率为 0.40%，同期业绩比较基准增长率为 0.75%。

截止报告期末，长盛年年收益定期债券 C 的基金份额净值为 1.231 元，本报告期份额净值增长率为 0.24%，同期业绩比较基准增长率为 0.75%。

## 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。

## 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十八条中对基金利润分配原则的约定，2016 年上半年度未实施利润分配。

本基金截至 2016 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 12,850,847.70 元，其中：长盛年年收益定期债券 A 期末可供分配利润为 9,599,697.41 元（长盛年年收益定期债券 A 的未分配利润已实现部分为 9,599,697.41 元，未分配利润未实现部分为 378,122.81 元），长盛年年收益定期债券 C 期末可供分配利润为 3,251,150.29 元（长盛年年收益定期债券 C 的未分配利润已实现部分为 3,251,150.29 元，未分配利润未实现部分为 127,365.02 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”）在长盛年年收益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：长盛年年收益定期开放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	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	250,067.91	1,886,224.34
结算备付金	2,598,370.75	2,273,737.07
存出保证金	14,082.68	1,548.27
交易性金融资产	135,956,135.50	81,347,217.60
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	135,956,135.50	81,347,217.60
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	1,993,244.35	-
应收利息	2,532,353.62	1,829,211.61
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	143,344,254.81	87,337,938.89
<b>负债和所有者权益</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	-	-
卖出回购金融资产款	71,749,867.62	16,500,000.00
应付证券清算款	2,002,558.37	1,503,276.89

应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	33,958.99	34,867.10
应付托管费	10,187.70	10,460.14
应付销售服务费	4,403.32	4,526.05
应付交易费用	3,056.70	11,649.39
应交税费	4,515.20	4,515.20
应付利息	2,031.01	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	69,616.82	50,000.00
负债合计	73,880,195.73	18,119,294.77
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	56,107,723.55	56,107,723.55
未分配利润	13,356,335.53	13,110,920.57
所有者权益合计	69,464,059.08	69,218,644.12
负债和所有者权益总计	143,344,254.81	87,337,938.89

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 56,107,723.55 份，其中长盛年年收益定期开放基金 A 类份额 41,473,820.12 份，份额净值 1.241 元，长盛年年收益定期开放基金 C 类份额 14,633,903.43 份，份额净值 1.231 元。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛年年收益定期开放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	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
<b>一、收入</b>	991,970.67	2,299,576.25
1.利息收入	2,014,380.42	2,520,393.69
其中：存款利息收入	37,186.32	10,474.98
债券利息收入	1,965,529.80	2,509,918.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,664.30	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	9,067.51	-797,957.69
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	9,067.51	-797,957.69
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	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”	-1,031,477.26	577,140.25

号填列)		
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
<b>减: 二、费用</b>	746,555.71	830,309.34
1. 管理人报酬	206,479.62	240,659.18
2. 托管费	61,943.90	72,197.80
3. 销售服务费	26,785.61	35,977.79
4. 交易费用	8,794.30	2,000.00
5. 利息支出	341,857.95	377,346.25
其中: 卖出回购金融资产支出	341,857.95	377,346.25
6. 其他费用	100,694.33	102,128.32
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>	245,414.96	1,469,266.91
减: 所得税费用	-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	245,414.96	1,469,266.91

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 长盛年年收益定期开放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)	56,107,723.55	13,110,920.57	69,218,644.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	245,414.96	245,414.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	56,107,723.55	13,356,335.53	69,464,059.08

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)	69,568,150.50	10,138,102.43	79,706,252.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,469,266.91	1,469,266.91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	69,568,150.50	11,607,369.34	81,175,519.84

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

杨思乐

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

长盛年年收益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 607 号《关于核准长盛年年收益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《长盛年年收益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 592,298,637.63 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 447 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2013 年 8 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 592,654,154.16 份基金份额(长盛年年收益

定期开放基金 A 类份额(以下简称“长盛年年收益定期债券 A”)260,245,282.55 份,长盛年年收益定期开放基金 C 类份额(以下简称“长盛年年收益定期债券 C”)332,408,871.61 份),包含认购资金利息折合 355,516.53 份(长盛年年收益定期债券 A 为 171,384.92 份,长盛年年收益定期债券 C 为 184,131.61 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《长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《长盛年年收益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《长盛年年收益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》、《长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》和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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

## 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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)于2016年5月1日前,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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对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)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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

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

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

### 6.4.8.1 关联方报酬

#### 6.4.8.1.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	206,479.62	240,659.18
其中：支付销售机构的客户维护费	65,516.61	78,983.38

注：支付基金管理人 长盛基金管理有限公司 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 X 0.60% / 当年天数。

#### 6.4.8.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	61,943.90	72,197.80

#### 6.4.8.1.3 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		
	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		
	长盛年年收益定期债券 A	长盛年年收益定期债券 C	合计
中国银行	-	25,448.96	25,448.96
合计	-	25,448.96	25,448.96
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		
	长盛年年收益定期债券 A	长盛年年收益定期债券 C	合计
中国银行	-	33,764.18	33,764.18
合计	-	33,764.18	33,764.18

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。

#### 6.4.8.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人于本报告期及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金份额。

#### 6.4.8.3.2 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：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。

#### 6.4.8.4 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	250,067.91	15,865.52	355,409.48	4,426.19

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。

#### 6.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.6 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其他需作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 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。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 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24,749,867.62元，是以如下债券作为抵押：

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
160210	16国开10	2016年7月1日	99.95	250,000	24,987,500.00
合计				250,000	24,987,500.00

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，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 47,000,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

#### 6.4.10 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 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资产中属于第二层次的余额为 135,956,135.50，无属于第一层次以及第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次 81,347,217.60，无第一层次、第三层次)。

##### (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	135,956,135.50	94.85
	其中：债券	135,956,135.50	94.85
	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	2,848,438.66	1.99
7	其他各项资产	4,539,680.65	3.17
8	合计	143,344,254.81	100.00

注：本报告期内，根据流动性管理的需求，本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的存款。

### 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 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前十名股票投资明细

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	10,391,675.20	14.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	52,459,920.00	75.52
	其中：政策性金融债	52,459,920.00	75.52
4	企业债券	60,019,740.30	86.40
5	企业短期融资券	13,084,800.00	18.84
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	135,956,135.50	195.72

### 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	160210	16 国开 10	500,000	49,975,000.00	71.94
2	019518	15 国债 18	54,000	5,399,460.00	7.77
3	041562053	15 黑牡丹 CP002	50,000	5,038,000.00	7.25
4	041551052	15 杭钢铁 CP002	50,000	5,027,000.00	7.24
5	010107	21 国债(7)	46,190	4,992,215.20	7.19

### 7.7 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。

### 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

本基金本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	14,082.68
2	应收证券清算款	1,993,244.35
3	应收股利	-
4	应收利息	2,532,353.62
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,539,680.65

### 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
长盛年年收益定期债券 A	212	195,631.23	16,777,684.56	40.45%	24,696,135.56	59.55%
长盛年年收益定期债券 C	139	105,279.88	-	-	14,633,903.43	100.00%
合计	351	159,851.06	16,777,684.56	29.90%	39,330,038.99	70.10%

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	长盛年年收益定期债券 A	273,587.83	0.6597%
	长盛年年收益定期债券 C	-	-
	合计	273,587.83	0.4876%

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	长盛年年收益定期债券 A	10~50

有本开放式基金	长盛年年收益定期债券 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛年年收益定期债券 A	0
	长盛年年收益定期债券 C	-
	合计	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛年年收益定期债券 A	长盛年年收益定期债券 C
基金合同生效日（2013 年 8 月 9 日）基金份额总额	260,245,282.55	332,408,871.61
本报告期期初基金份额总额	41,473,820.12	14,633,903.43
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	41,473,820.12	14,633,903.43

## § 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

本报告期内本基金管理人的高级管理人员无重大人事变动。

#### 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

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	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-

国联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	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	86,453,297.97	61.80%	2,338,600,000.00	70.44%	-	-
国信证券	41,743,813.32	29.84%	981,300,000.00	29.56%	-	-
招商证券	11,702,033.50	8.36%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	西部证券	深圳	1
2	民族证券	深圳	1
3	五矿证券	深圳	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

长盛基金管理有限公司  
2016年8月25日