

长盛盛裕纯债债券型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 24 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 8 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 12 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 12 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 13 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 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 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 6.1 资产负债表..... | 17 |
| 6.2 利润表..... | 18 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 19 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 20 |
| §7 投资组合报告..... | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 38 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 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..... | 39 |
| 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..... | 39 |
| 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..... | 39 |
| 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..... | 39 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 39 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 40 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 41 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 41 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 41 |
| 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..... | 41 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 42 |
| §10 重大事件揭示..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 43 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 43 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 43 |
| 10.8 其他重大事件..... | 45 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 46 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况..... | 46 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 46 |

| | |
|-------------------------|-----------|
| §12 备查文件目录 | 47 |
| 12.1 备查文件目录..... | 47 |
| 12.2 存放地点..... | 47 |
| 12.3 查阅方式..... | 47 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|-------------|
| 基金名称 | 长盛盛裕纯债债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 长盛盛裕纯债 | |
| 基金主代码 | 003102 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 8 月 4 日 | |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,497,248,470.94 份 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 长盛盛裕纯债 A | 长盛盛裕纯债 C |
| 下属分级基金的交易代码: | 003102 | 003103 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,497,163,421.53 份 | 85,049.41 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，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。 |
| 投资策略 | （一）大类资产配置策略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。（二）债券组合管理策略 1、利率策略利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。2、类属配置策略债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况，货币市场及资本市场资金供求关系，以及不同时期市场投资热点，分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利差水平，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。3、信用策略信用品种的选择采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方式，在对宏观经济、利率走势、发行人经营及财务状况进行分析的基础上，结合信用品种的发行条款，建立信用债备选库，并以此为基础拟定信用品种的投资方法。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数（全价）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 | 兴业银行股份有限公司 |
| 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、 010-62350088 | 95561 |
| 传真 | 010-82255988 | 021-62159217 |
| 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 | 福州市湖东路 154 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 | 上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼（资产托管部办公地址） |
| 邮政编码 | 100088 | 200041 |
| 法定代表人 | 周兵 | 高建平 |

2.4 信息披露方式

| | |
|--------------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《中国证券报》 |
| 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 | 基金管理人和/或基金托管人的办公地址 |

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 | 长盛盛裕纯债 A | 长盛盛裕纯债 C |
|---------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日) | 报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 24,863,414.13 | 1,468.39 |
| 本期利润 | 659,158.91 | -125.29 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0004 | -0.0013 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.05% | -0.14% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.04% | -0.06% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | -29,465,292.09 | -1,579.25 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0197 | -0.0186 |
| 期末基金资产净值 | 1,467,698,129.44 | 83,470.16 |
| 期末基金份额净值 | 0.9803 | 0.9814 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2017年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | -1.97% | -1.86% |

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。

4、长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金合同生效日2016年8月4日，截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

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

长盛盛裕纯债 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 | 1.32% | 0.06% | 0.90% | 0.06% | 0.42% | 0.00% |
| 过去三个月 | 0.34% | 0.08% | -0.88% | 0.08% | 1.22% | 0.00% |
| 过去六个月 | 0.04% | 0.07% | -2.11% | 0.08% | 2.15% | -0.01% |
| 自基金合同 | -1.97% | 0.10% | -4.15% | 0.10% | 2.18% | 0.00% |

| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

长盛盛裕纯债 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 | 1.31% | 0.06% | 0.90% | 0.06% | 0.41% | 0.00% |
| 过去三个月 | 0.29% | 0.08% | -0.88% | 0.08% | 1.17% | 0.00% |
| 过去六个月 | -0.06% | 0.07% | -2.11% | 0.08% | 2.05% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -1.86% | 0.10% | -4.15% | 0.10% | 2.29% | 0.00% |

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

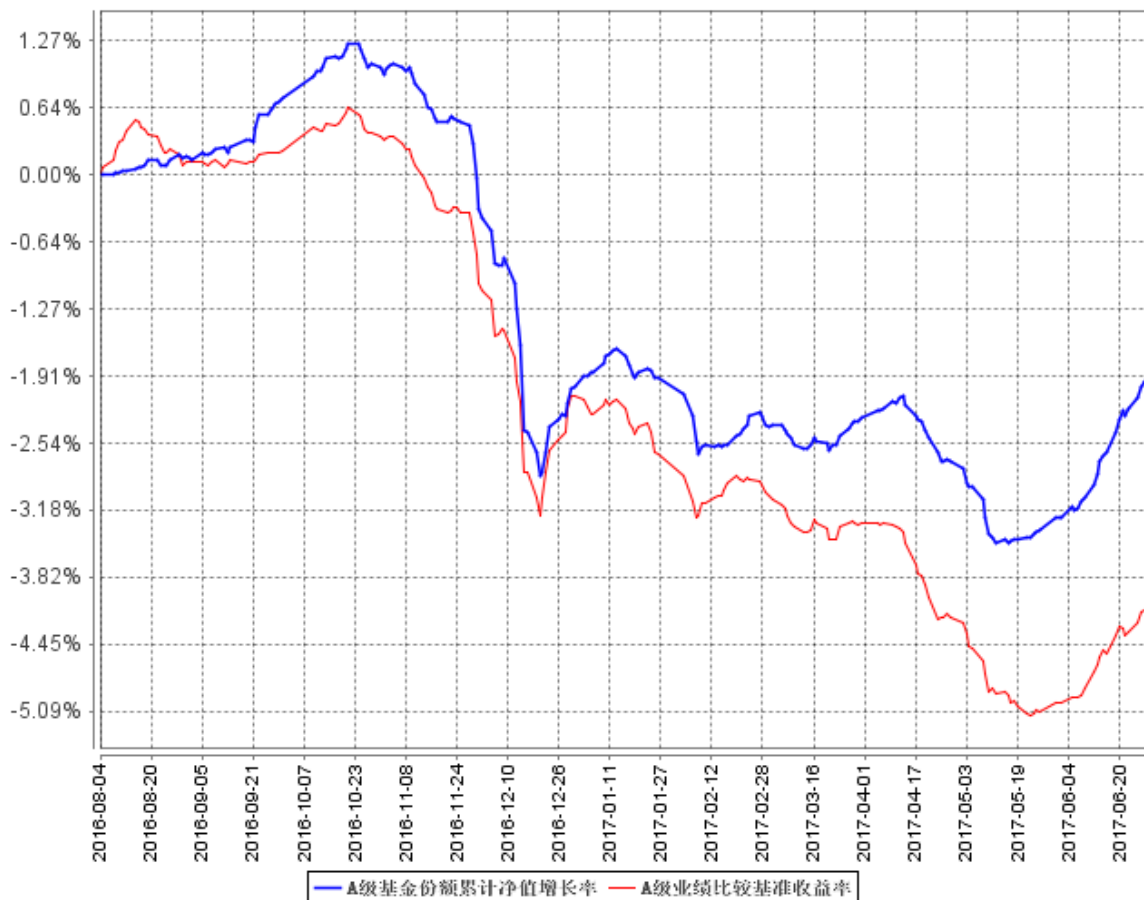
本基金业绩比较基准为中债综合指数（全价）。

中债综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖了主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）。

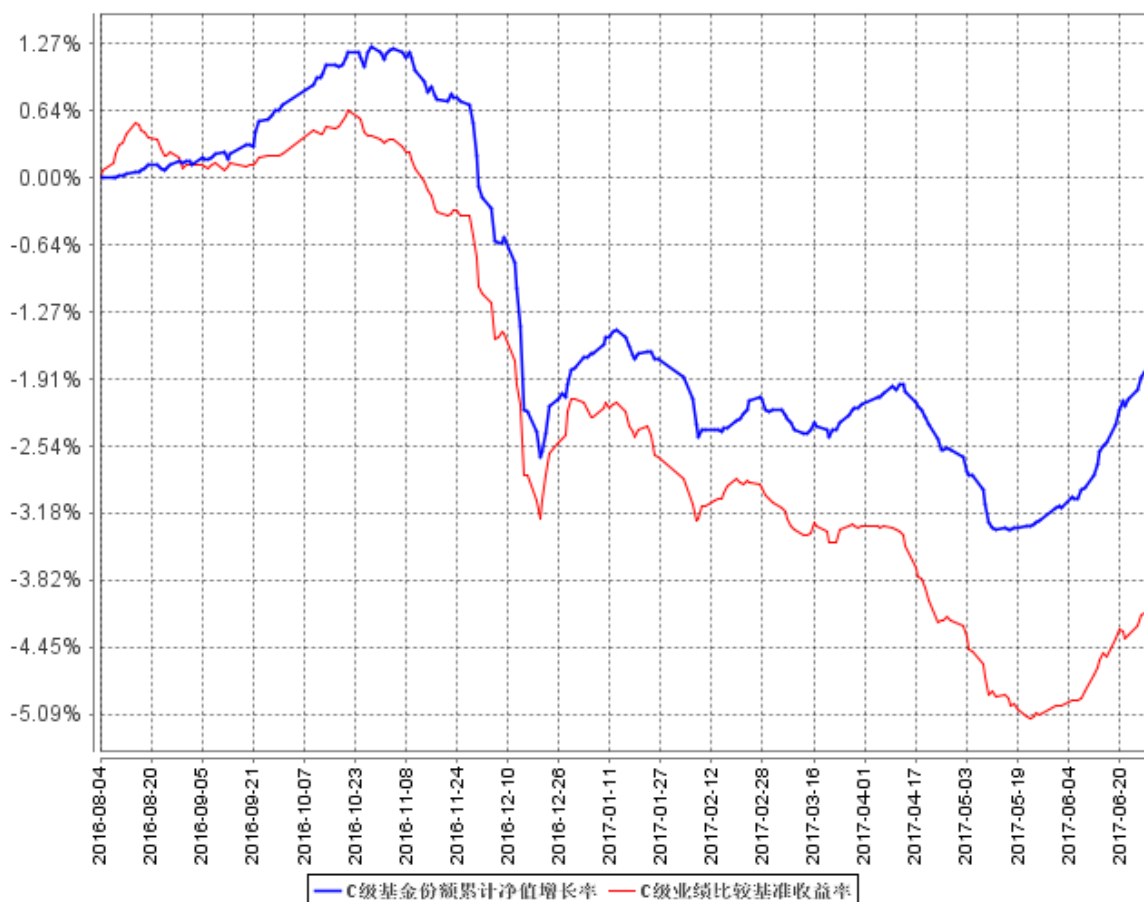
本基金为债券型基金，投资范围为固定收益类金融工具，且本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转换债券仅投资可分离交易可转债的纯债部分。鉴于中债综合指数（全价）能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，所以以其收益率作为本基金的业绩比较基准。

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：1、长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金合同生效日 2016 年 8 月 4 日，截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，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有关约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十二条（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。截止报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 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 2017 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十二只开放式基金，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，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛景纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛通纯债债券型证券投资基金基金经理。 | 2016年8月4日 | - | 10年 | 段鹏先生，1982年12月出生。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。 |

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

回顾上半年，新一轮库存周期对经济基本面形成支撑，生产平稳，外需改善，宏观经济总体平稳；通胀方面，食品价格稳中有落，中上游价格走弱带动 PPI 高位回落，通胀预期回落；受汇率、资产价格以及金融监管去杠杆等因素制约，货币政策更趋于稳健，央行两次上调公开市场操

作利率，资金面总体呈现中性偏紧局面。

1 月至 5 月初，债券市场延续了去年四季度以来的调整走势，收益率曲线整体上行，10 年期国债一度上行至 4.38% 的近期高点；5 月中旬以来，经济下行压力逐步显现，叠加汇率压力减弱、金融去杠杆节奏放缓、央行释放稳定流动性预期信号等因素，市场预期修复，现券利率有所下行，债券收益率曲线平坦化下移。

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短久期信用债和同业存单，保持组合流动性，提升组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛裕纯债 A 基金份额净值为 0.9803 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.04%；截至本报告期末长盛盛裕纯债 C 基金份额净值为 0.9814 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.06%；同期业绩比较基准收益率为 -2.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着供给侧改革价格效应消退、补库存周期结束，叠加房地产投资增速见顶回落和地方政府融资监管趋严等因素影响，经济下行压力渐显。受资产价格、金融去杠杆及汇率等因素制约，货币政策将维持稳健中性，预计资金面将呈现中性偏紧局面。

在海内外经济和政策等多重因素影响下，预计债市波动将加大。投资操作上需重视信用债的票息价值，同时谨慎把握经济基本面再次转弱、流动性边际放松、人民币贬值压力暂缓等带来的利率债交易性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风

险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。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十六部分中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期末未实施利润分配。

本基金截至 2017 年 6 月 30 日，长盛盛裕纯债 A 期末可供分配利润为-29,465,292.09 元（长盛盛裕纯债 A 的未分配利润已实现部分为 38,375,592.92 元，未分配利润未实现部分为 -67,840,885.01 元），长盛盛裕纯债 C 期末可供分配利润为-1,579.25 元（长盛盛裕纯债 C 的未分配利润已实现部分为 2,290.17 元，未分配利润未实现部分为-3,869.42 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：长盛盛裕纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 43,289,380.31 | 151,721,883.94 |
| 结算备付金 | | 11,346,786.32 | 4,037,609.88 |
| 存出保证金 | | 382.52 | 44,109.27 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,682,811,020.00 | 1,448,465,800.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,682,811,020.00 | 1,448,465,800.00 |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 608,069.01 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 23,014,640.00 | 20,614,558.37 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 99.95 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,761,070,278.16 | 1,624,884,061.41 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 292,800,000.00 | 157,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 359,243.51 | 374,373.99 |
| 应付托管费 | | 179,621.77 | 187,187.00 |
| 应付销售服务费 | | 13.76 | 27.71 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 3,369.75 | 12,938.44 |
| 应交税费 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利息 | | -127,953.99 | 98,003.31 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 74,383.76 | 50,000.00 |
| 负债合计 | | 293,288,678.56 | 157,722,530.45 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,497,248,470.94 | 1,497,288,238.60 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -29,466,871.34 | -30,126,707.64 |
| 所有者权益合计 | | 1,467,781,599.60 | 1,467,161,530.96 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,761,070,278.16 | 1,624,884,061.41 |

注：（1）报告截止日 2017 年 6 月 30 日，长盛盛裕纯债 A 类基金份额净值人民币 0.9803 元，长盛盛裕纯债 C 类基金份额净值人民币 0.9814 元；基金份额总额 1,497,248,470.94 份，其中长盛盛裕纯债 A 类基金份额 1,497,163,421.53 份，长盛盛裕纯债 C 类基金份额 85,049.41 份。

（2）本基金合同于 2016 年 8 月 4 日生效，上年度财务报表的实际编制期间为 2016 年 8 月 4 日至 2016 年 12 月 31 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：长盛盛裕纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|---------------------------------------|
| 一、收入 | | 9,111,141.57 |
| 1.利息收入 | | 33,893,669.52 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 2,562,759.58 |
| 债券利息收入 | | 31,242,059.21 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 88,850.73 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -576,680.95 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | -576,680.95 |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -24,205,848.90 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 1.90 |

| | | |
|----------------------------|------------|--------------|
| 减：二、费用 | | 8,452,107.95 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,171,807.95 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,085,903.97 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 92.10 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 1,053.56 |
| 5. 利息支出 | | 5,097,113.63 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 5,097,113.63 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.19 | 96,136.74 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 659,033.62 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 659,033.62 |

注：本基金合同于 2016 年 8 月 4 日生效，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛盛裕纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | |
|--|---------------------------------------|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,497,288,238.60 | -30,126,707.64 | 1,467,161,530.96 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 659,033.62 | 659,033.62 |
| 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） | -39,767.66 | 802.68 | -38,964.98 |
| 其中：1.基金申购款 | 7,465.42 | -164.98 | 7,300.44 |
| 2.基金赎回款 | -47,233.08 | 967.66 | -46,265.42 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,497,248,470.94 | -29,466,871.34 | 1,467,781,599.60 |

注：本基金合同于 2016 年 8 月 4 日生效，无上年度可比期间。

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：

| | | |
|------------|------------|-----------|
| <u>林培富</u> | <u>刁俊东</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 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛盛裕纯债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[2016]1482 号《关于准予长盛盛裕纯债债券型证券投资基金注册的批复》的注册，由长盛基金管理有限公司于 2016 年 8 月 2 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明（2016）验字第 60468688_A10 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 8 月 4 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。截至 2016 年 8 月 4 日止，本基金 A 类已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 1,000,002,197.00 元，折合 1,000,002,197.00 份 A 类基金份额；本基金 A 类有效认购资金在募集期间未产生利息。本基金 C 类已收到首次募集的有效净认购金额为人民币 46,802.00 元，折合 46,802.00 份 C 类基金份额；本基金 C 类募集资金在募集期间未产生利息。本基金 A 类及 C 类收到的实收基金合计人民币 1,000,048,999.00 元，分别折合成 A 类和 C 类基金份额，合计折合 1,000,048,999.00 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为长盛基金管理有限公司，基金托管人兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、同业存单、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、中小企业私募债、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具及国债期货，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（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票、权证等权益类资产。如法律法规或监管机构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。本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数（全价）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

会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，

暂免征收印花税。

6.4.6.2 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以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

| | |
|----------------|---------------|
| 活期存款 | 1,289,380.31 |
| 定期存款 | 42,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他期限定期存款 | 42,000,000.00 |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 43,289,380.31 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | | |
|---------------|------------------------|------------------|------------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 461,236,130.40 | 434,261,520.00 |
| | 银行间市场 | 1,290,640,943.95 | 1,248,549,500.00 |
| | 合计 | 1,751,877,074.35 | 1,682,811,020.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 1,751,877,074.35 | 1,682,811,020.00 | -69,066,054.35 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告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：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 13,327.80 |
| 应收定期存款利息 | 274,166.50 |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 4,595.49 |
| 应收债券利息 | 22,722,549.89 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | 0.14 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 0.18 |

| | |
|----|---------------|
| 合计 | 23,014,640.00 |
|----|---------------|

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 3,369.75 |
| 合计 | 3,369.75 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2017年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 预提费用 | 74,383.76 |
| 合计 | 74,383.76 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 长盛盛裕纯债 A | | |
|---------------|----------------------------|------------------|
| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,497,166,826.13 | 1,497,166,826.13 |
| 本期申购 | 717.82 | 717.82 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -4,122.42 | -4,122.42 |
| - 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 | 1,497,163,421.53 | 1,497,163,421.53 |

金额单位：人民币元

| 长盛盛裕纯债 C | | |
|----------|----------------------------|------|
| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
| | 基金份额(份) | 账面金额 |

| | | |
|---------------|------------|------------|
| 上年度末 | 121,412.47 | 121,412.47 |
| 本期申购 | 6,747.60 | 6,747.60 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -43,110.66 | -43,110.66 |
| - 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 | 85,049.41 | 85,049.41 |

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 长盛盛裕纯债 A | | | |
|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 13,512,216.91 | -43,636,739.80 | -30,124,522.89 |
| 本期利润 | 24,863,414.13 | -24,204,255.22 | 659,158.91 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -38.12 | 110.01 | 71.89 |
| 其中：基金申购款 | 13.42 | -30.80 | -17.38 |
| 基金赎回款 | -51.54 | 140.81 | 89.27 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 38,375,592.92 | -67,840,885.01 | -29,465,292.09 |

单位：人民币元

| 长盛盛裕纯债 C | | | |
|----------------|----------|-----------|-----------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 1,362.99 | -3,547.74 | -2,184.75 |
| 本期利润 | 1,468.39 | -1,593.68 | -125.29 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -541.21 | 1,272.00 | 730.79 |
| 其中：基金申购款 | 130.18 | -277.78 | -147.60 |
| 基金赎回款 | -671.39 | 1,549.78 | 878.39 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,290.17 | -3,869.42 | -1,579.25 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 56,799.85 |
| 定期存款利息收入 | 2,438,916.43 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 66,886.47 |
| 其他 | 156.83 |

| | |
|----|--------------|
| 合计 | 2,562,759.58 |
|----|--------------|

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

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 2017年1月1日至2017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 | -576,680.95 |
| 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 | -576,680.95 |

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 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 464,456,600.00 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 459,718,340.95 |
| 减：应收利息总额 | 5,314,940.00 |
| 买卖债券差价收入 | -576,680.95 |

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期未取得衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -24,205,848.90 |
| ——股票投资 | - |

| | |
|------------|----------------|
| ——债券投资 | -24,205,848.90 |
| ——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 | -24,205,848.90 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 1.90 |
| 合计 | 1.90 |

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 交易所市场交易费用 | 3.56 |
| 银行间市场交易费用 | 1,050.00 |
| 合计 | 1,053.56 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------|----------------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 44,630.98 |
| 银行汇划费 | 3,152.98 |
| 上清所帐户维护费 | 9,000.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 银行间账户维护费 | 9,000.00 |
| 合计 | 96,136.74 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|-----------------------|
| 长盛基金管理有限公司（“长盛基金”） | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 基金托管人 |

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,171,807.95 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 338,765.83 |

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,085,903.97 |

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2017年1月1日至2017年6月30日 | | |
|----------------|----------------------------|----------|-------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长盛盛裕纯债 A | 长盛盛裕纯债 C | 合计 |
| 长盛基金管理有限公司 | 0.00 | 18.08 | 18.08 |
| 合计 | 0.00 | 18.08 | 18.08 |

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本基金管理人于本报告期内未运用固有资金投资本基金份额。

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：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未持有本基金份额。

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 2017年1月1日至2017年6月30日 | |
|-------|----------------------------|--------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 兴业银行 | 43,289,380.31 | 2,495,716.28 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率/约定利率计息。

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：本基金于本报告期末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

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 292,800,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 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。

本基金管理人的风险管理机构由董事会合规与审计委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。

同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程

以及风险控制措施；第二道监控防线由公司监察稽核部和风险管理部构成，监察稽核部负责对公司业务的法律合规风险和运作风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险控制委员会构成，公司管理层通过风险控制委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，在公司督察长的指导下，监察稽核部和风险管理部对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门总监、风险控制委员会、公司总经理、风险控制管理委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会及其下设风险控制管理委员会构成，风险控制管理委员会通过督察长、监察稽核部和风险管理部的工作，掌握整体风险状况并进行决策。风险控制管理委员会负责审查公司风险控制体系及其有效性、公司内控制度的实施情况。

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；本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 2017年6月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 60,042,000.00 | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 558,361,800.00 | 387,784,000.00 |
| 合计 | 618,403,800.00 | 387,784,000.00 |

注：未评级债券为国债、短期融资券、政策性金融债及同业存单。

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 2017年6月30日 | 上年度末 2016年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
|--------|-------------------|---------------------|

| | | |
|--------|------------------|------------------|
| AAA | 892,509,220.00 | 914,421,800.00 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 171,898,000.00 | 146,260,000.00 |
| 合计 | 1,064,407,220.00 | 1,060,681,800.00 |

注：未评级债券为政策性金融债。

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

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| | | | | | |
|-----|-------|-------|-------|-----|----|
| 本期末 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----|-------|-------|-------|-----|----|

| | | | | | |
|--------------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 2017 年 6 月 30 日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 43,289,380.31 | - | - | - | 43,289,380.31 |
| 结算备付金 | 11,346,786.32 | - | - | - | 11,346,786.32 |
| 存出保证金 | 382.52 | - | - | - | 382.52 |
| 交易性金融资产 | 698,411,800.00 | 428,416,720.00 | 555,982,500.00 | - | 1,682,811,020.00 |
| 应收证券清算款 | | | | 608,069.01 | 608,069.01 |
| 应收利息 | | | | 23,014,640.00 | 23,014,640.00 |
| 资产总计 | 753,048,349.15 | 428,416,720.00 | 555,982,500.00 | 23,622,709.01 | 1,761,070,278.16 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 292,800,000.00 | - | - | - | 292,800,000.00 |
| 应付管理人报酬 | | | | 359,243.51 | 359,243.51 |
| 应付托管费 | | | | 179,621.77 | 179,621.77 |
| 应付销售服务费 | | | | 13.76 | 13.76 |
| 应付交易费用 | | | | 3,369.75 | 3,369.75 |
| 应付利息 | | | | -127,953.99 | -127,953.99 |
| 其他负债 | | | | 74,383.76 | 74,383.76 |
| 负债总计 | 292,800,000.00 | - | - | 488,678.56 | 293,288,678.56 |
| 利率敏感度缺口 | 460,248,349.15 | 428,416,720.00 | 555,982,500.00 | 23,134,030.45 | 1,467,781,599.60 |
| 上年度末 2016 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 151,721,883.94 | - | - | - | 151,721,883.94 |
| 结算备付金 | 4,037,609.88 | - | - | - | 4,037,609.88 |
| 存出保证金 | 44,109.27 | - | - | - | 44,109.27 |
| 交易性金融资产 | 437,874,000.00 | 433,534,800.00 | 577,057,000.00 | - | 1,448,465,800.00 |
| 应收利息 | | | | 20,614,558.37 | 20,614,558.37 |
| 应收申购款 | | | | 99.95 | 99.95 |
| 资产总计 | 593,677,603.09 | 433,534,800.00 | 577,057,000.00 | 20,614,658.32 | 1,624,884,061.41 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 157,000,000.00 | - | - | - | 157,000,000.00 |

| | | | | | |
|---------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 应付管理人报酬 | | - | - | 374,373.99 | 374,373.99 |
| 应付托管费 | | - | - | 187,187.00 | 187,187.00 |
| 应付销售服务费 | | - | - | 27.71 | 27.71 |
| 应付交易费用 | | - | - | 12,938.44 | 12,938.44 |
| 应付利息 | | - | - | 98,003.31 | 98,003.31 |
| 其他负债 | | - | - | 50,000.00 | 50,000.00 |
| 负债总计 | 157,000,000.00 | - | - | 722,530.45 | 157,722,530.45 |
| 利率敏感度缺口 | 436,677,603.09 | 433,534,800.00 | 577,057,000.00 | 19,892,127.87 | 1,467,161,530.96 |

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（2017年6月30日） | 上年度末（2016年12月31日） |
| | 市场利率下降25个基点 | 13,222,493.54 | 13,041,623.95 |
| | 市场利率上升25个基点 | -13,222,493.54 | -13,041,623.95 |

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及银行间的债券，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。

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。于2017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 2017年6月30日 | | 上年度末 2016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 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-债券投资 | 1,682,811,020.00 | 114.65 | 1,448,465,800.00 | 98.73 |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,682,811,020.00 | 114.65 | 1,448,465,800.00 | 98.73 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金主要投资于固定收益品种，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（2016 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**(1)公允价值****(a)金融工具公允价值计量的方法**

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具**(i)各层次金融工具公允价值**

2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为人民币 1,682,811,020.00 元，无属于第三层次的余额。（2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为人民币 1,448,465,800.00 元，无属于第三层次的余额。）

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d)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。

(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 | 1,682,811,020.00 | 95.56 |
| | 其中：债券 | 1,682,811,020.00 | 95.56 |
| | 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 | 54,636,166.63 | 3.10 |
| 7 | 其他各项资产 | 23,623,091.53 | 1.34 |
| 8 | 合计 | 1,761,070,278.16 | 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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票投资。

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：本基金本报告期内未进行股票投资。

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：本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

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 | 1,997,800.00 | 0.14 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 171,898,000.00 | 11.71 |
| | 其中：政策性金融债 | 171,898,000.00 | 11.71 |
| 4 | 企业债券 | 432,263,720.00 | 29.45 |
| 5 | 企业短期融资券 | 110,137,000.00 | 7.50 |
| 6 | 中期票据 | 460,245,500.00 | 31.36 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 506,269,000.00 | 34.49 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,682,811,020.00 | 114.65 |

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 | 136085 | 15 金茂投 | 1,300,000 | 127,634,000.00 | 8.70 |
| 2 | 111610479 | 16 兴业 CD479 | 1,200,000 | 116,376,000.00 | 7.93 |
| 3 | 111698883 | 16 徽商银行 CD099 | 1,000,000 | 96,590,000.00 | 6.58 |
| 4 | 111607231 | 16 招行 CD231 | 1,000,000 | 96,540,000.00 | 6.58 |
| 5 | 160210 | 16 国开 10 | 1,000,000 | 91,890,000.00 | 6.26 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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

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 | 382.52 |
| 2 | 应收证券清算款 | 608,069.01 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 23,014,640.00 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 23,623,091.53 |

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投资。

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 |
| 长盛盛裕纯债 A | 5 | 299,432,684.31 | 1,497,114,728.77 | 100.00% | 48,692.76 | 0.00% |
| 长盛盛裕纯债 C | 230 | 369.78 | - | - | 85,049.41 | 100.00% |
| 合计 | 235 | 6,371,270.09 | 1,497,114,728.77 | 99.99% | 133,742.17 | 0.01% |

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 | 长盛盛裕纯债 A | 102.14 | 0.0000% |
| | 长盛盛裕纯债 C | 2,100.00 | 2.4692% |
| | 合计 | 2,202.14 | 0.0001% |

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 | 长盛盛裕纯债 A | 0 |
| | 长盛盛裕纯债 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 长盛盛裕纯债 A | 0 |
| | 长盛盛裕纯债 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长盛盛裕纯债 A | 长盛盛裕纯债 C |
|-------------------------------|------------------|------------|
| 基金合同生效日（2016 年 8 月 4 日）基金份额总额 | 1,000,002,197.00 | 46,802.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,497,166,826.13 | 121,412.47 |
| 本报告期基金总申购份额 | 717.82 | 6,747.60 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 4,122.42 | 43,110.66 |
| 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 | 1,497,163,421.53 | 85,049.41 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

由于任期届满，高新不再担任公司董事长，周放生不再担任公司独立董事。根据公司 2016 年度股东会议决议，选举林培富为公司董事，选举张良庆为公司独立董事；根据公司第七届董事会第一次会议决议，选举周兵担任公司董事长；根据公司第七届董事会第二次会议决议，聘任林培富担任公司总经理，周兵不再担任公司总经理，同时林培富不再担任公司副总经理。以上公司高级管理人员变更，已于 2017 年 3 月 30 日向中国证监会北京监管局报备。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动情况。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内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 | |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 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 |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 3,494,650.00 | 100.00% | 11,772,400,000.00 | 100.00% | - | - |

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要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

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

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

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

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

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

10.8 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下：

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|---------------|------------|
| 1 | 长盛基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》和《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告 | 《中国证券报》及本公司网站 | 2017年4月27日 |
| 2 | 长盛盛裕纯债债券型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告 | 同上 | 2017年4月22日 |
| 3 | 长盛基金管理有限公司高级管理人员董事长变更的公告 | 同上 | 2017年3月28日 |
| 4 | 长盛基金管理有限公司高级管理人员副总经理变更的公告 | 同上 | 2017年3月28日 |
| 5 | 长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告 | 同上 | 2017年3月28日 |
| 6 | 长盛盛裕纯债债券型证券投资基金 2016 年度报告 | 同上 | 2017年3月27日 |
| 7 | 长盛盛裕纯债债券型证券投资基金 2016 年度报告 摘要 | 同上 | 2017年3月27日 |
| 8 | 长盛盛裕纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要 | 同上 | 2017年3月11日 |
| 9 | 长盛盛裕纯债债券型基金招募说明书（更新） | 同上 | 2017年3月11日 |
| 10 | 长盛盛裕纯债债券型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告 | 同上 | 2017年1月21日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|---------------------------------|------------------|------|------|------------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 1,497,114,728.77 | - | - | 1,497,114,728.77 | 99.99% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。</p> | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛盛裕纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛盛裕纯债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。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人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

2017年8月24日