

# 长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金 2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	长盛盛琪一年债券	
基金主代码	003199	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年9月27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	335,862,006.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛盛琪一年债券 A	长盛盛琪一年债券 C
下属分级基金的交易代码:	003199	003200
报告期末下属分级基金的份额总额	327,669,191.86份	8,192,814.78份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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>(一) 大类资产配置策略</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。</p> <p>(二) 债券组合管理策略</p> <p>1、利率策略</p> <p>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。</p> <p>2、类属配置策略</p> <p>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。</p> <p>3、信用策略</p> <p>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。</p>
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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896

	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	、 95566
传真		010-82255988	010-66594942

#### 2.4 信息披露方式

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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年		2016 年 9 月 27 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日	
	长盛盛琪一年债券 A	长盛盛琪一年债券 C	长盛盛琪一年债券 A	长盛盛琪一年债券 C
本期已实现收益	23,424,854.81	225,372.35	-1,484,621.45	-35,659.76
本期利润	43,234,761.50	402,690.58	-24,831,458.78	-297,913.25
加权平均基金份额本期利润	0.0252	0.0197	-0.0114	-0.0122
本期基金份额净值增长率	1.60%	1.29%	-1.14%	-1.22%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末	
	长盛盛琪一年债券 A	长盛盛琪一年债券 C	长盛盛琪一年债券 A	长盛盛琪一年债券 C
期末可供分配基金份额利润	0.0044	0.0005	-0.0114	-0.0122
期末基金资产净值	329,103,616.58	8,196,915.66	2,155,447,706.07	24,204,073.19
期末基金份额净值	1.0044	1.0005	0.9886	0.9878

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 12 月 31 日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛盛琪一年债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.48%	0.05%	-1.15%	0.06%	0.67%	-0.01%
过去六个月	0.44%	0.04%	-1.30%	0.05%	1.74%	-0.01%
过去一年	1.60%	0.04%	-3.38%	0.06%	4.98%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.44%	0.05%	-5.60%	0.09%	6.04%	-0.04%

长盛盛琪一年债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.57%	0.05%	-1.15%	0.06%	0.58%	-0.01%
过去六个月	0.28%	0.04%	-1.30%	0.05%	1.58%	-0.01%
过去一年	1.29%	0.04%	-3.38%	0.06%	4.67%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.05%	0.05%	-5.60%	0.09%	5.65%	-0.04%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

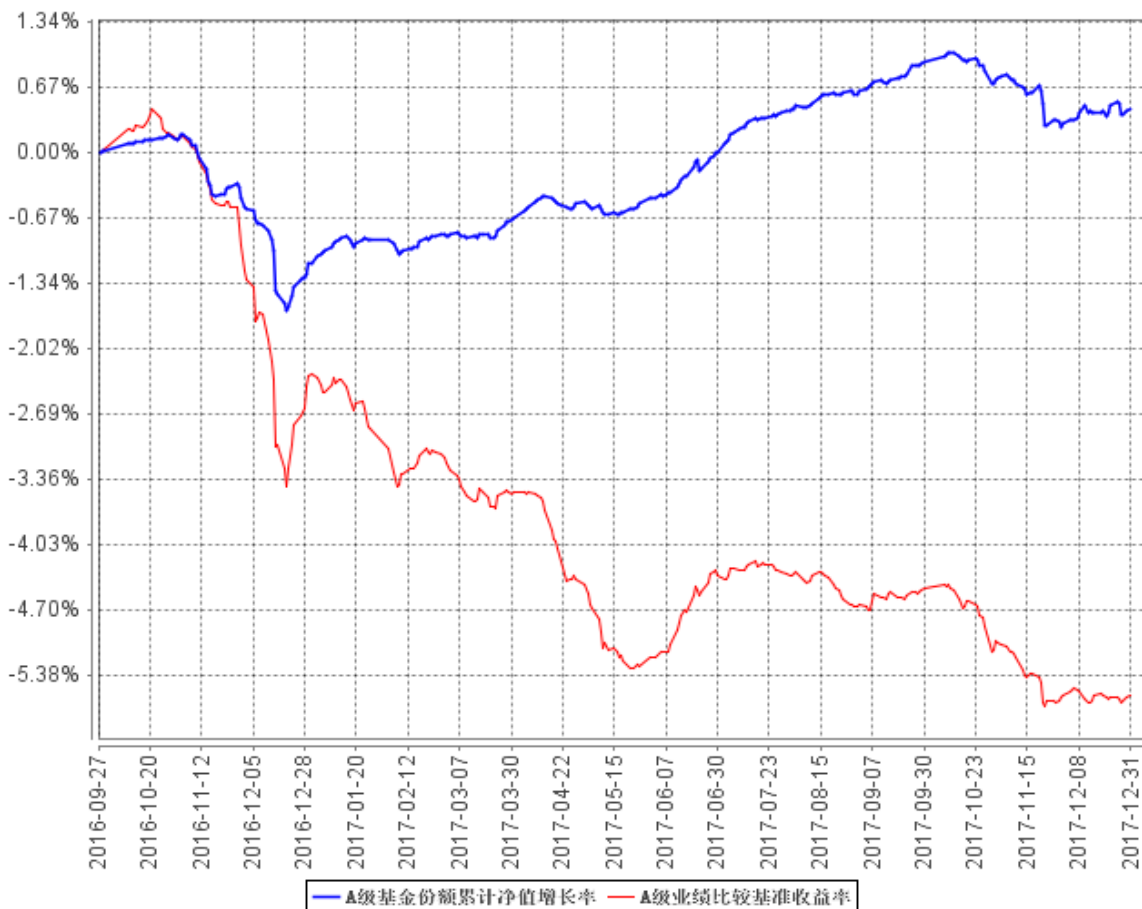
本基金业绩比较基准为中债综合指数（全价）。

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）。

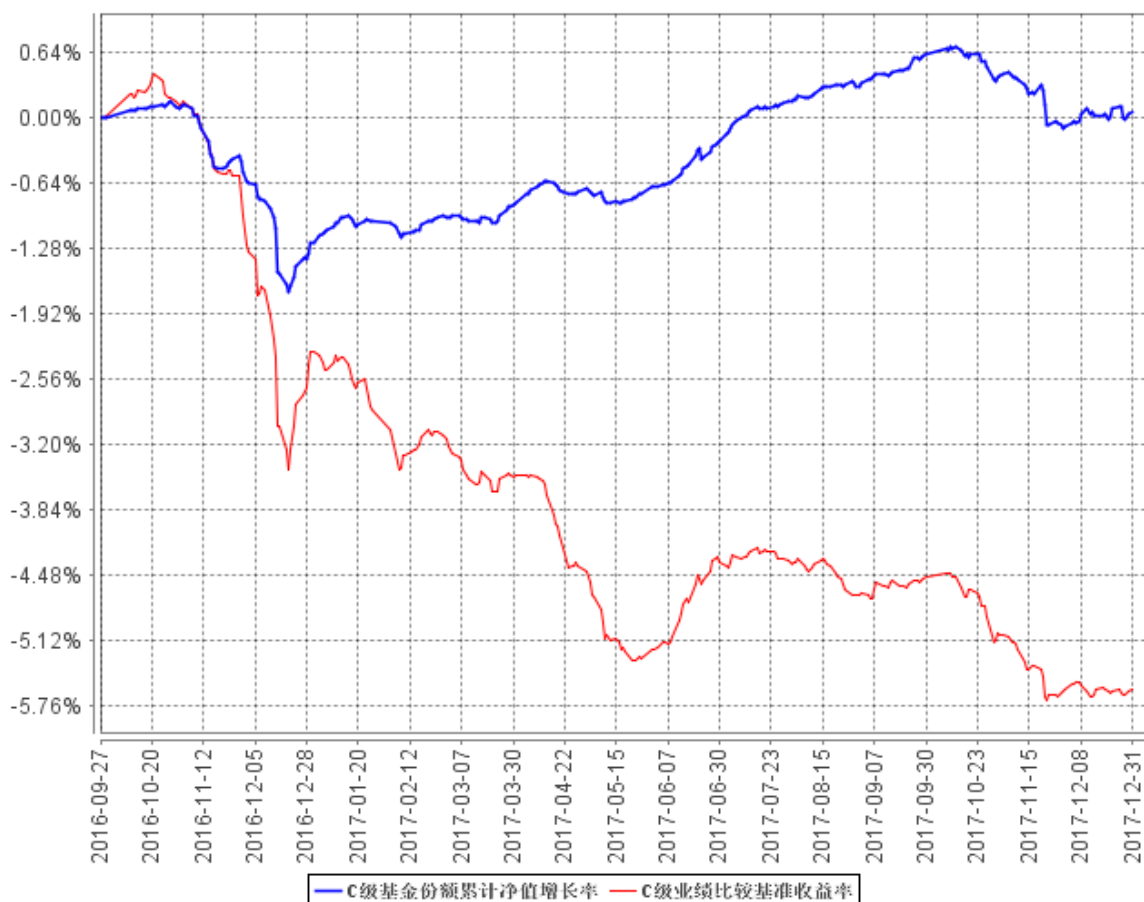
本基金为债券型基金，投资范围为固定收益类金融工具，且本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转换债券仅投资可分离交易可转债的纯债部分。鉴于中债综合指数（全价）能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，所以以其收益率作为本基金的业绩比较基准。

### 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

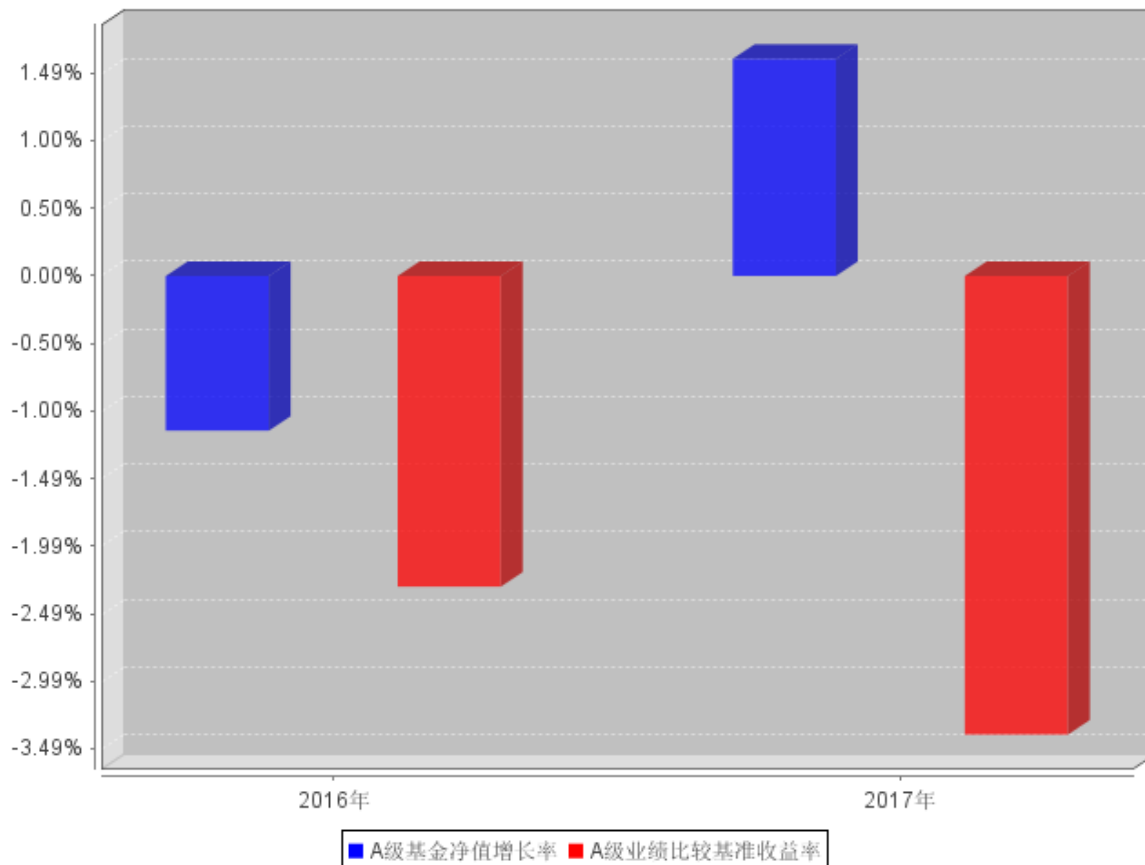


注：1、按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的约定。

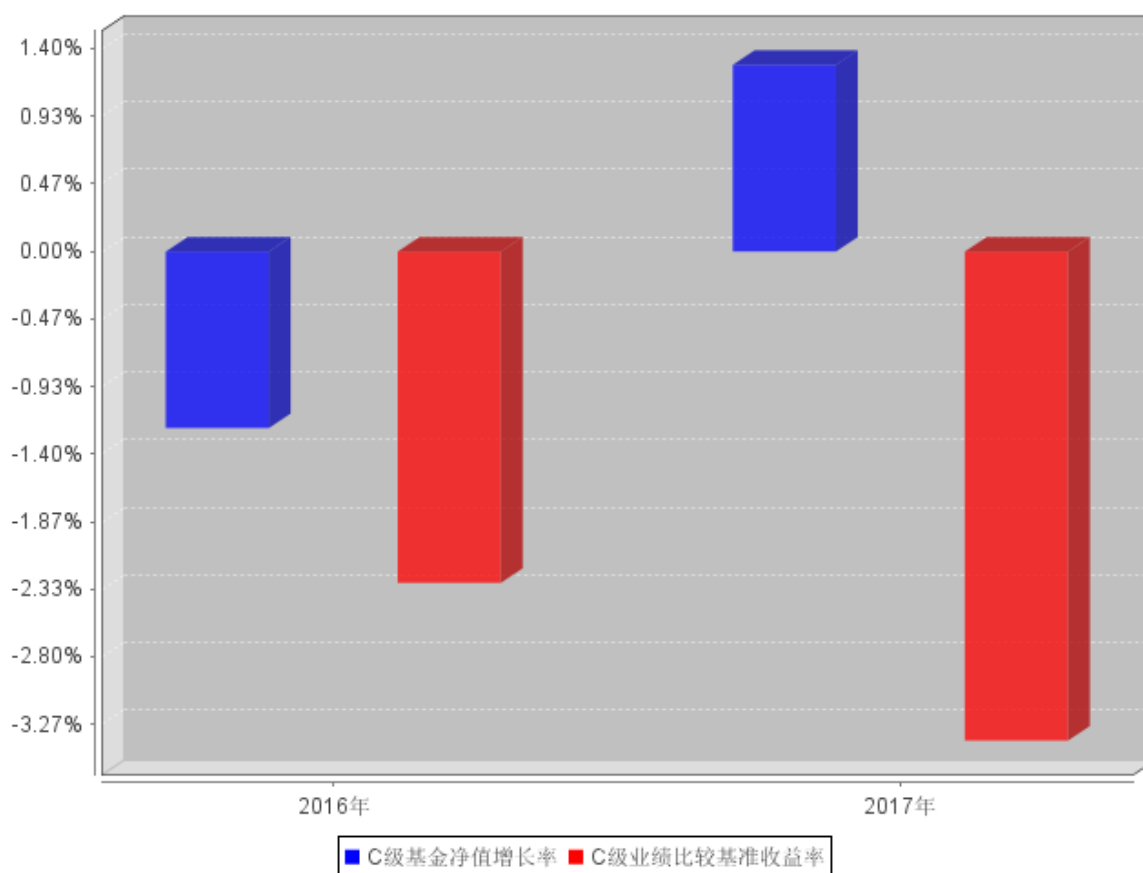


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



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



注：本基金基金合同于 2016 年 9 月 27 日生效，合同生效当年按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2017 年度、2016 年度会计期间未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、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 12 月 31 日，基金管理人共管理七十四只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李琪	本基金基金经理，长盛双月红 1 年期定期开放债券型投资基金基金经理，长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016 年 9 月 27 日	-	10 年	李琪先生，1975 年 2 月出生。天津大学管理学博士。历任大公国际资信评估有限公司信用分析师、信用评审委员会委员，泰康资产管理有限责任公司信用研究员。2011 年 3 月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。

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 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 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，未发现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，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

##### 1、报告期内行情回顾

2017 年，全球经济温和复苏。欧美经济整体向好，国内经济平稳运行，总体表现出超预期的较强韧性，为国内强监管、去杠杆政策推进提供了空间。供给侧结构性改革和环保限产推动企业特别是中上游企业盈利和现金流改善，经济整体显示出较为强劲的内生动力。

债券市场持续大幅调整，收益率明显上行。2017 年债市延续 2016 年 10 月下旬以来的调整，调整幅度和时间跨度总体上强于 2013 年。在经济基本面平稳、资金面中性偏紧和监管政策不断强化等因素综合影响下，债市收益率分别在 4-5 月、9-10 月出现大幅上行，四季度也基本维持高位震荡。在金融去杠杆、防风险政策下，央行持续抬升政策利率，并控制流动性投放量，债券收益率曲线平坦化趋势明显。

## 2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金总体上坚持稳健、审慎操作，主要配置高等级信用债，保持短久期操作策略，严控利率风险和信用风险。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，长盛盛琪定期债券 A 的基金份额净值为 1.0044 元，本报告期份额净值增长率为 1.60%，同期业绩比较基准增长率为-3.38%。

截止报告期末，长盛盛琪定期债券 C 的基金份额净值为 1.0005 元，本报告期份额净值增长率为 1.29%，同期业绩比较基准增长率为-3.38%。

## 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 2018 年，国内宏观经济韧性短期仍将延续，消费对 GDP 增长贡献率逐步提升，供给侧结构性改革和环保限产大环境仍利于企业盈利改善，旧城棚户区改造及基建投资托底下预计经济增速难以出现明显下跌。通胀方面，猪肉价格出现回升，CPI 非食品项持续走高，通胀预期有所抬头。受汇率、资产价格以及金融监管政策等因素制约，货币政策更趋于稳健中性。全球主要海外经济体经济温和复苏，通胀有所分化。

债券市场方面，在海内外经济和政策等多重因素影响下，预计债券收益率短期仍将维持高位震荡，同时不排除继续创新高的可能性。在经济平稳环境下，强监管、去杠杆政策将继续推进，货币政策短期难以放松。同时，叠加通胀预期抬头、海外市场减税加息等因素，债券收益率短期难现趋势性下行。但另一方面，伴随债市大幅调整，债券配置价值逐步显现，可以关注经济基本面再次转弱等因素带来的投资机会。信用债配置方面，融资环境收缩和企业盈利分化下预计部分民企及中小型国企信用风险将上升，信用风险控制仍是着力点，在实际操作中尽量规避盈利恶化的企业、低评级信用债以及财政实力偏弱地区的城投债。

#### 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

根据本基金基金合同中对基金利润分配原则的约定，2017 年度未实施利润分配。

本基金截至 2017 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 1,438,525.60 元（其中：长盛盛琪一年期定期开放债券 A 期末可供分配利润为 1,434,424.72 元，长盛盛琪一年期定期开放债券 C 期末可供分配利润为 4,100.88 元），未分配利润已实现部分为 4,833,734.57 元（其中：长盛盛琪一年期定期开放债券 A 期末未分配利润已实现部分为 4,746,905.98 元，长盛盛琪一年期定期开放债券 C 期末未分配利润已实现部分为 86,828.59 元），未分配利润未实现部分为-3,395,208.97 元（其中：长盛盛琪一年期定期开放债券 A 期末未分配利润未实现部分为-3,312,481.26 元，长盛盛琪一年期定期开放债券 C 期末未分配利润未实现部分为-82,727.71 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”）在长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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



## § 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师薛竞、顾卓毅于 2018 年 3 月 27 对本基金 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附出具了普华永道中天审字(2018)第 22105 号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2017 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	385,166.58	1,975,321.77
结算备付金	736,505.25	15,127,359.40
存出保证金	90,682.61	117,089.66
交易性金融资产	400,508,218.40	2,168,179,707.12
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	400,508,218.40	2,168,179,707.12
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	175,947.26	26,099,400.00
应收利息	7,128,583.89	24,781,915.59
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	409,025,103.99	2,236,280,793.54
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 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	70,922,000.00	27,000,000.00

应付证券清算款	174,331.70	28,019,132.61
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	171,812.88	1,108,499.99
应付托管费	57,270.96	369,499.99
应付销售服务费	2,087.93	6,155.50
应付交易费用	8,117.18	12,794.93
应交税费	-	-
应付利息	28,951.10	431.26
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	360,000.00	112,500.00
负债合计	71,724,571.75	56,629,014.28
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	335,862,006.64	2,204,781,151.29
未分配利润	1,438,525.60	-25,129,372.03
所有者权益合计	337,300,532.24	2,179,651,779.26
负债和所有者权益总计	409,025,103.99	2,236,280,793.54

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 335,862,006.64 份，其中盛琪一年期定期开放基金 A 类份额 327,669,191.86 份，份额净值 1.0044 元，长盛盛琪一年期定期开放基金 C 类份额 8,192,814.78 份，份额净值 1.0005 元。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 9 月 27 日(基金合同生效日) 至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	72,702,682.45	-19,803,752.96
1.利息收入	92,108,164.65	17,845,525.42
其中：存款利息收入	652,664.59	252,269.52
债券利息收入	89,341,746.31	12,513,484.88
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,113,753.75	5,079,771.02
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-39,392,707.12	-14,040,187.56
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-39,392,707.12	-14,040,187.56
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“-”号填列）	19,987,224.92	-23,609,090.82
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>	<b>29,065,230.37</b>	<b>5,325,619.07</b>
1. 管理人报酬	10,436,483.13	3,421,100.81
2. 托管费	3,478,827.75	1,140,366.91
3. 销售服务费	61,297.00	19,002.33
4. 交易费用	37,986.23	13,877.21
5. 利息支出	14,606,993.24	606,150.61
其中：卖出回购金融资产支出	14,606,993.24	606,150.61
6. 其他费用	443,643.02	125,121.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>43,637,452.08</b>	<b>-25,129,372.03</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>43,637,452.08</b>	<b>-25,129,372.03</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,204,781,151.29	-25,129,372.03	2,179,651,779.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,637,452.08	43,637,452.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	-1,868,919,144.65	-17,069,554.45	-1,885,988,699.10
其中：1. 基金申购款	62,443.88	441.08	62,884.96
2. 基金赎回款	-1,868,981,588.53	-17,069,995.53	-1,886,051,584.06
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）	335,862,006.64	1,438,525.60	337,300,532.24

项目	上年度可比期间 2016 年 9 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益 (基金净值)	2,204,781,151.29	-	2,204,781,151.29
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数(本期利润)	-	-25,129,372.03	-25,129,372.03
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)	2,204,781,151.29	-25,129,372.03	2,179,651,779.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____	_____	_____
林培富	刁俊东	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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第 1560 号《关于准予长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金注册的批复》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《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,203,702,306.50 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(2016)第 1240 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,204,781,151.29 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,078,844.79 份基金份额。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。

本基金为定期开放式基金,自基金合同生效之日(含)起或自每一开放期结束之日次日(含)起一年的期间封闭运作。自封闭期结束之后第一个工作日(含)起进入 5 至 20 个工作日的开放期,开

放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

根据《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费用、申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购费、申购费，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；不收取认购费、申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。A 类基金份额与 C 类基金份额分别设置基金代码，并且由于基金费用的不同，分别计算和公告基金份额净值。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、同业存单、可转换债券(含可分离交易可转债)、债券回购、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可交换债券、资产支持证券、中小企业私募债、银行存款、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。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，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%，在封闭期，本基金不受该比例的限制。本基金的业绩比较基准为中债综合指数(全价)收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2018 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年期年度报告相一致。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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政策的补充通知》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债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及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，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金”）	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、基金销售机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

## 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017 年12月31日	上年度可比期间 2016年9月27日(基金合同生 效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,436,483.13	3,421,100.81
其中：支付销售机构的客户维护费	6,528,990.56	2,050,543.67

注：支付基金管理人长盛基金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。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年9月27日(基金合同生效日) 至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,478,827.75	1,140,366.91

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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 X 0.20% / 当年天数。

## 7.4.8.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛琪一年债券 A	长盛盛琪一年债券C	合计
长盛基金	-	606.29	606.29
中国银行	-	41,329.36	41,329.36
合计	-	41,935.65	41,935.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年9月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛盛琪一年债券 A	长盛盛琪一年债券C	合计
长盛基金	-	191.68	191.68
中国银行	-	12,751.45	12,751.45
合计	-	12,943.13	12,943.13

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值 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，再由长盛基金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 类基金份额资产净值 X 0.30% / 当年天数。

## 7.4.8.3 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 2017年1月1日至2017年12月31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	99,097,688.89	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2016年9月27日(基金合同生效日)至2016年12月31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
-	-	-	-	-	-	-



**7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无。

**7.4.8.4.2 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：无。

**7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2016年9月27日(基金合同生效日)至 2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	385,166.58	514,167.11	1,975,321.77	179,486.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：无。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：无。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 70,922,000.00 元，于 2018 年 1 月 3 日先后到期。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。

#### 7.4.10 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) 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

于 2017 年 12 月 31 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一层次的余额为 14,393,371.50 元，属于第二层次的余额为 386,114,846.90 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第二层次 2,168,179,707.12 元，无属于第一层次以及第三层次的余额)。

###### (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 12 月 31 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	400,508,218.40	97.92
	其中：债券	400,508,218.40	97.92
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,121,671.83	0.27
8	其他各项资产	7,395,213.76	1.81
9	合计	409,025,103.99	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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。

#### 8.2.2 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港股通投资股票。

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本基金本报告期内未进行股票投资。

#### 8.4.2 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：本基金本报告期末内未进行持有股票投资。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末内未进行持有股票投资。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	46,617,370.20	13.82
	其中：政策性金融债	46,617,370.20	13.82
4	企业债券	90,151,476.70	26.73
5	企业短期融资券	80,171,000.00	23.77
6	中期票据	169,175,000.00	50.16
7	可转债（可交换债）	14,393,371.50	4.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	400,508,218.40	118.74

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	170206	17 国开 06	300,000	29,097,000.00	8.63
2	101455009	14 浦发集 MTN001	200,000	20,244,000.00	6.00
3	122295	13 川投 01	200,000	20,202,000.00	5.99
4	101455023	14 豫投资 MTN001	200,000	20,200,000.00	5.99
5	011758128	17 北方凌云 SCP001	200,000	20,020,000.00	5.94
6	011770027	17 苏州经济 SCP003	200,000	20,020,000.00	5.94

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1 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	90,682.61
2	应收证券清算款	175,947.26
3	应收股利	-
4	应收利息	7,128,583.89
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,395,213.76

#### 8.11.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	2,504,880.00	0.74
2	110033	国贸转债	1,155,300.00	0.34
3	110032	三一转债	1,091,880.00	0.32

#### 8.11.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期内未持有股票。

#### 8.11.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长盛盛琪一年债券 A	2,839	115,417.12	10,397,082.31	3.17%	317,272,109.55	96.83%
长盛盛琪一年债券 C	177	46,287.09	-	-	8,192,814.78	100.00%
合计	3,016	111,360.08	10,397,082.31	3.10%	325,464,924.33	96.90%

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

### 9.2 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	长盛盛琪一年债券 A	0.00	0.0000%
	长盛盛琪一年债券 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。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长盛盛琪一年债券 A	0
	长盛盛琪一年债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛盛琪一年债券 A	0
	长盛盛琪一年债券 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛盛琪一年债券 A	长盛盛琪一年债券 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 27 日）基金份额总额	2,180,279,164.85	24,501,986.44
本报告期期初基金份额总额	2,180,279,164.85	24,501,986.44
本报告期基金总申购份额	5,333.24	57,110.64
减:本报告期基金总赎回份额	1,852,615,306.23	16,366,282.30
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	327,669,191.86	8,192,814.78



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

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。

根据公司 2017 年第一次临时股东会议决议，同意张良庆先生不再担任公司第七届董事会独立董事职务，选举朱慈蕴女士担任公司第七届董事会独立董事。以上独立董事人员变更，已于 2018 年 1 月 9 日向中国证监会北京监管局报备。

#### 11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 90,000.00 元。已连续提供审计服务 2 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国金证券	1,374,796,189.92	88.34%	13,880,300,000.00	81.21%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
光大证券	181,378,564.29	11.66%	3,210,786,000.00	18.79%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	国信证券	上海	1
2	国信证券	深圳	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	民族证券	深圳	1

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 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。

长盛基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日