

长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金 2019 年半年度报告 摘要

2019 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：2019 年 8 月 27 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 2019 年 8 月 26 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 2019 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	63,116,434.16 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	60,499,746.60 份	2,616,687.56 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	张利宁
	联系电话	010-86497608
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666、010-	95566

	86497888	
传真	010-86497999	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(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,245,460.48	47,992.57
本期利润	1,421,989.71	55,478.58
本期加权平均净值利润率	1.90%	1.76%
本期基金份额净值增长率	1.96%	1.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1560	0.1424
期末基金资产净值	72,052,376.63	3,078,952.22
期末基金份额净值	1.191	1.177

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	0.50%	0.05%	0.12%	0.00%	0.38%	0.05%
过去三个月	0.50%	0.09%	0.37%	0.00%	0.13%	0.09%
过去六个月	1.96%	0.09%	0.74%	0.00%	1.22%	0.09%
过去一年	4.80%	0.08%	1.50%	0.00%	3.30%	0.08%
过去三年	2.94%	0.14%	4.50%	0.00%	-1.56%	0.14%
自基金合同生效起至今	27.75%	0.16%	11.53%	0.01%	16.22%	0.15%

长盛年年收益定期债券 C

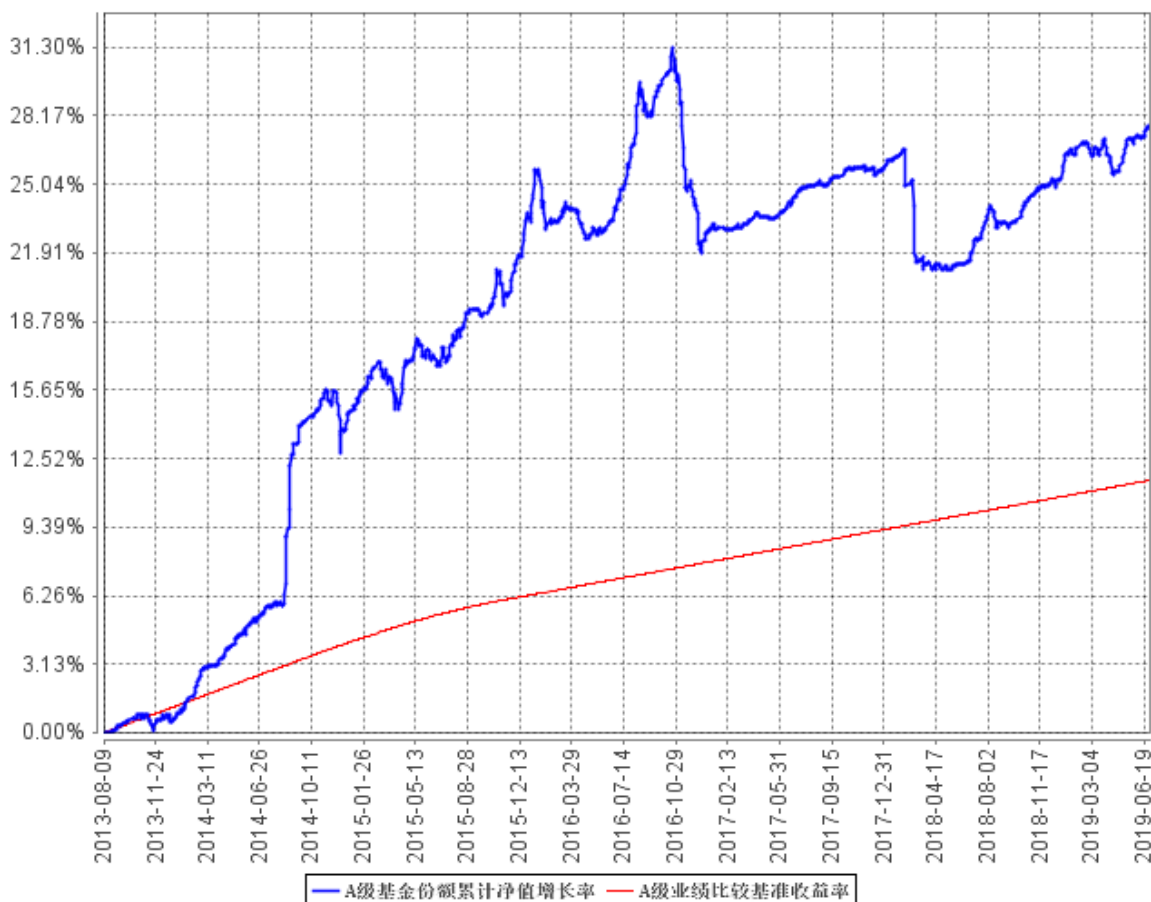
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.50%	0.05%	0.12%	0.00%	0.38%	0.05%
过去三个月	0.50%	0.09%	0.37%	0.00%	0.13%	0.09%
过去六个月	1.82%	0.09%	0.74%	0.00%	1.08%	0.09%
过去一年	4.53%	0.08%	1.50%	0.00%	3.03%	0.08%
过去三年	2.07%	0.14%	4.50%	0.00%	-2.43%	0.14%
自基金合同生效起至今	25.65%	0.16%	11.53%	0.01%	14.12%	0.15%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

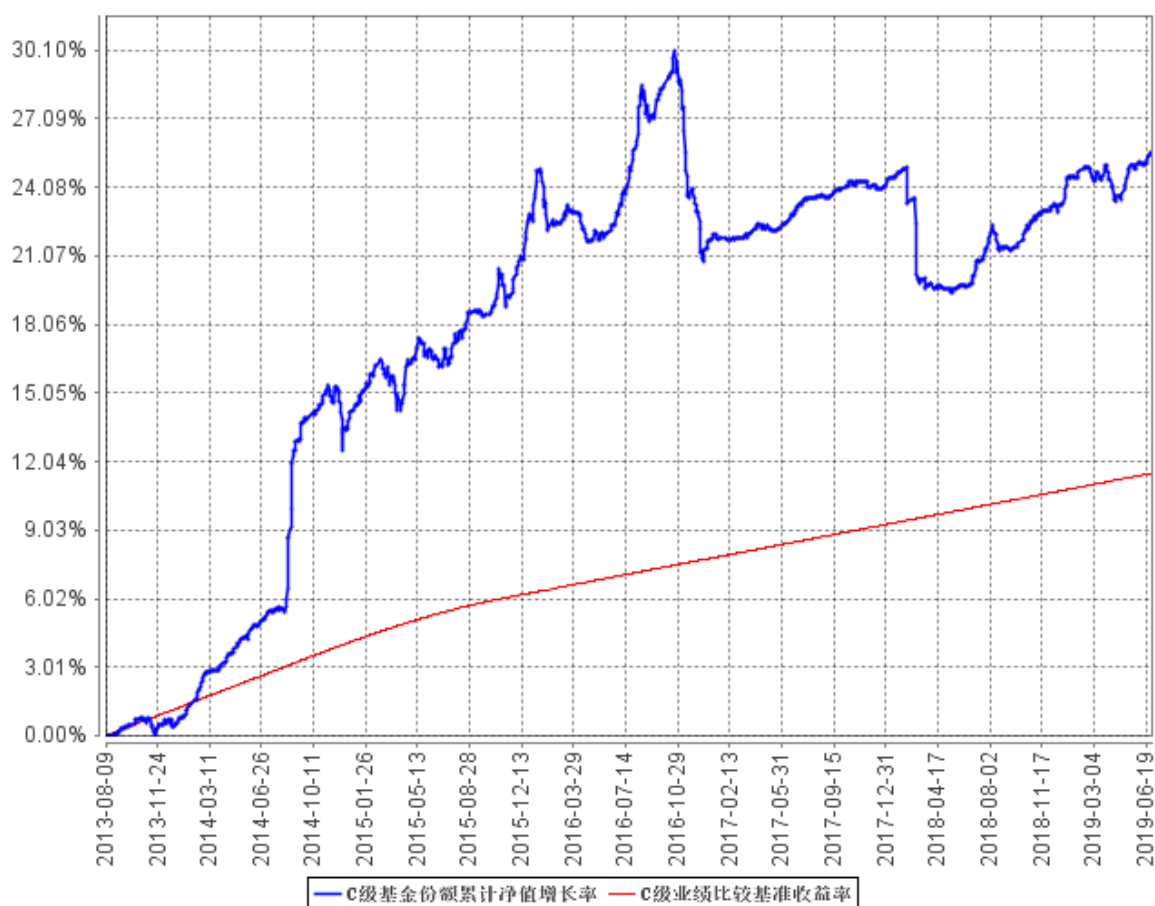
本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率。本基金是一年期定期开放债券型基金，以一年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使投资者理性判断本基金产品的风险收益特征，合理衡量比较本基金的投资收益。

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 2.06 亿元。长盛基金总部办公地址位于北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，并拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。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%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格。截至 2019 年 6 月 30 日，基金管理人共管理五十七只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
段鹏	本基金基金经理，长盛货币市场基金基金经理，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，长盛盛裕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，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，固定收益部副总监。	2014 年 10 月 24 日	-	12 年	段鹏先生，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

上半年，社融增速企稳，地产投资表现较强，基建投资有所改善，制造业投资相对低迷，国内经济基本面基本平稳，呈现缓慢下行，二季度较一季度增长势头略微放缓；受猪瘟、水果涨价

等因素影响，通胀有所上行；货币政策保持稳健。

上半年债券收益率波动有所加大，一季度随着权益市场转暖、社融和投资数据回暖等因素，收益率整体震荡；4 月份随着经济企稳预期不断加强，收益率大幅上行；5 月份随着经济数据小幅转弱，中美贸易再起波澜等因素影响，收益率转为下行，6 月份呈现震荡走势。

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高等级信用债，同时适度参与利率债波段交易，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年年收益定期债券 A 基金份额净值为 1.191 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.96%；截至本报告期末长盛年年收益定期债券 C 基金份额净值为 1.177 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.82%；同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

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，中美贸易摩擦扰动或将继续，外围经济体面临下行压力，下半年出口仍将承压；基建投资或将上行，但地产投资逐步转弱；经济基本面基本平稳或有缓慢下行；货币政策下半年大概率保持稳健基调。

总体来看，下半年国内经济基本面和政策面对债券市场仍然偏友好，但随着绝对收益水平降低，以及政策对冲等因素，市场仍可能会有波动。

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债金融估值中心有限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对基金利润分配原则的约定，2019 年上半年度实施利润分配，分配金额为 5,397,771.84 元。

本基金截至 2019 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 9,808,982.92 元，其中：长盛年年收益定期债券 A 期末可供分配利润为 9,436,414.80 元（长盛年年收益定期债券 A 的未分配利润已实现部分为 9,436,414.80 元，未分配利润未实现部分为 2,116,215.23 元），长盛年年收益定期债券 C 期末可供分配利润为 372,568.12 元（长盛年年收益定期债券 C 的未分配利润已实现部分为 372,568.12 元，未分配利润未实现部分为 89,696.54 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”）在对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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	224,104.72	2,216,497.67
结算备付金	380,191.12	216,389.86
存出保证金	3,877.70	3,015.56
交易性金融资产	83,717,027.40	75,128,538.80
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	83,717,027.40	75,128,538.80
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	-	1,500,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	1,449,568.16	1,393,310.78
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	85,774,769.10	80,457,752.67
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		
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	10,500,000.00	-
应付证券清算款	-	1,500,000.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	37,850.85	33,691.02
应付托管费	11,355.25	10,107.33
应付销售服务费	771.21	811.10
应付交易费用	741.25	3,240.52
应交税费	11,325.87	11,334.07

应付利息	2,606.34	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	78,789.48	69,150.00
负债合计	10,643,440.25	1,628,334.04
所有者权益：		
实收基金	63,116,434.16	62,931,492.60
未分配利润	12,014,894.69	15,897,926.03
所有者权益合计	75,131,328.85	78,829,418.63
负债和所有者权益总计	85,774,769.10	80,457,752.67

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 63,116,434.16 份，其中长盛年年收益定期开放基金 A 类份额 60,499,746.60 份，份额净值 1.191 元，长盛年年收益定期开放基金 C 类份额 2,616,687.56 份，份额净值 1.177 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	2,100,144.55	-945,190.00
1.利息收入	1,818,989.78	1,224,530.85
其中：存款利息收入	8,195.33	6,867.38
债券利息收入	1,808,441.24	1,217,663.47
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,353.21	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	97,139.53	-2,799,469.69
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	97,139.53	-2,799,469.69
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“-”号填列）	184,015.24	629,748.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	622,676.26	621,252.87
1. 管理人报酬	231,734.37	148,746.89
2. 托管费	69,520.32	44,624.02
3. 销售服务费	4,704.21	9,697.29
4. 交易费用	1,930.69	3,525.58
5. 利息支出	217,599.56	311,604.79
其中：卖出回购金融资产支出	217,599.56	311,604.79
6. 税金及附加	5,635.70	2,280.28
7. 其他费用	91,551.41	100,774.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,477,468.29	-1,566,442.87
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,477,468.29	-1,566,442.87

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：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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）	62,931,492.60	15,897,926.03	78,829,418.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,477,468.29	1,477,468.29
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）	184,941.56	37,272.21	222,213.77
其中：1.基金申购款	184,941.56	37,272.21	222,213.77
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）	-	-5,397,771.84	-5,397,771.84

五、期末所有者权益 (基金净值)	63,116,434.16	12,014,894.69	75,131,328.85
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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)	40,726,214.72	10,385,179.91	51,111,394.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-1,566,442.87	-1,566,442.87
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)	40,726,214.72	8,818,737.04	49,544,951.76

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：

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

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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；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。

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 2019 年 8 月 26 日批准报出。

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》、《长盛年年收益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。

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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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[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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。

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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	231,734.37	148,746.89
其中：支付销售机构的客户维护费	31,707.88	81,909.03

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	69,520.32	44,624.02

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 0.18% 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 0.18% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 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
长盛基金	-	1.56	1.56

中国银行	-	3,054.28	3,054.28
合计	-	3,055.84	3,055.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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
长盛基金	-	15.30	15.30
中国银行	-	6,612.63	6,612.63
合计	-	6,627.93	6,627.93

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。

6.4.8.3 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

本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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	20,808,203.84	10,306,497.40	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	224,104.72	4,975.83	280,694.08	4,619.18

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中国银行	101900298	19 金隅 MTN001	簿记建档	50,000	5,000,000.00
上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2019 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：无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日，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 10,500,000.00 元，于 2019 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) 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 2019 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 83,717,027.40 元，无属于第一层次以及第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：属于第二层次的余额为 75,128,538.80 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的债券，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 2019 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(2018 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	83,717,027.40	97.60
	其中：债券	83,717,027.40	97.60
	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	604,295.84	0.70
8	其他各项资产	1,453,445.86	1.69
9	合计	85,774,769.10	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。

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港股通投资股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,512,170.00	15.32
	其中：政策性金融债	11,512,170.00	15.32
4	企业债券	30,531,957.40	40.64
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	41,672,900.00	55.47
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	83,717,027.40	111.43

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	190205	19 国开 05	100,000	9,795,000.00	13.04
2	143360	17 川发 01	71,000	7,377,610.00	9.82
3	101761006	17 首钢 MTN002	70,000	7,283,500.00	9.69
4	101754027	17 河钢集 MTN003	70,000	7,239,400.00	9.64
5	101900292	19 首创集 MTN001	70,000	7,042,700.00	9.37

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	3,877.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,449,568.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,453,445.86

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处于转股期的可转换债券（可交换债券）。

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	205	295,120.72	47,198,299.05	78.01%	13,301,447.55	21.99%
长盛年年收益定期债券 C	110	23,788.07	0.00	0.00%	2,616,687.56	100.00%
合计	315	200,369.63	47,198,299.05	74.78%	15,918,135.11	25.22%

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	0.00	0.0000%
	长盛年年收益定期债券 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	长盛年年收益定期债券 A	0
	长盛年年收益定期债券 C	0

	合计	0
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	0
	合计	0

§ 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	60,348,408.41	2,583,084.19
本报告期期间基金总申购份额	151,338.19	33,603.37
减：本报告期期间基金总赎回份额	-	-
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	60,499,746.60	2,616,687.56

§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

根据公司 2019 年第一次临时股东大会决议，同意钱力不再担任公司第七届董事会董事，选举严琛担任公司第七届董事会董事。以上董事人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

因个人原因，杨思乐向公司申请辞去副总经理职务，根据公司第七届董事会第十二次会议决议，杨思乐不再担任公司副总经理职务。以上公司高级管理人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

根据公司第七届董事会第十三次会议决议，聘任张壬午担任首席信息官。以上公司高级管理人员变更，已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 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	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	6,442,237.27	45.91%	506,300,000.00	100.00%	-	-
招商证券	7,588,853.84	54.09%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

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：无。

(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	东海证券	深圳	1
2	东海证券	上海	1
3	西部证券	深圳	1

§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	20190101~20190630	31,174,260.59	0.00	0.00	31,174,260.59	49.39%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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。

长盛基金管理有限公司

2019 年 8 月 27 日