长盛盛裕纯债债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:2019年3月29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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月28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,安永华明会计师事务所(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2018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	1,498,276,188.02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	1,497,165,387.50份	1,110,800.52份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产高动性的基础上,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	张利宁	龚小武
	联系电话	010-86497608	021-52629999-212056
	电子邮箱	zhanglin@csfunds.com.cn	011597@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-2666,010-86497888	95561
传真		010-86497999	021-62159217

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	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§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	2018年		2017年		2016年8月4日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	长盛盛裕纯债A	长盛盛裕纯债C	长盛盛裕纯债A	长盛盛裕纯债C	长盛盛裕纯债A	长盛盛裕纯债C
本期已实现收益	38,460,141.01	26,903.09	51,534,226.27	2,875.98	11,842,162.14	3,850.16
本期利润	107,354,099.67	78,294.29	5,510,770.33	78.50	-33,007,888.49	-6,304.66
加权平均基金份额本期利润	0.0717	0.1035	0.0037	0.0009	-0.0251	-0.0212
本期基金份额净值增长率	7.37%	7.21%	0.38%	0.17%	-2.01%	-1.80%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0229	0.0229	-0.0164	-0.0163	-0.0201	-0.0180
期末基金资产净值	1,531,454,367.63	1,136,217.67	1,472,512,636.88	82,590.66	1,467,042,303.24	119,227.72
期末基金份额净值	1.0229	1.0229	0.9836	0.9837	0.9799	0.9820

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到2018年12月31日。

3、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。

3.2 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
过去三个月	2.19%	0.05%	1.99%	0.05%	0.20%	0.00%
过去六个月	3.84%	0.06%	2.57%	0.06%	1.27%	0.00%
过去一年	7.37%	0.06%	4.79%	0.07%	2.58%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.61%	0.08%	-0.87%	0.08%	6.48%	0.00%

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
过去三个月	2.20%	0.05%	1.99%	0.05%	0.21%	0.00%
过去六个月	3.80%	0.06%	2.57%	0.06%	1.23%	0.00%
过去一年	7.21%	0.06%	4.79%	0.07%	2.42%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.47%	0.08%	-0.87%	0.08%	6.34%	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)。

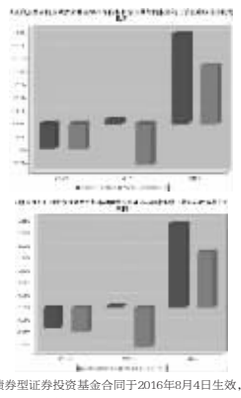
中债综合指数(全价)由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布,该指数样本具有广泛的市场代表性,涵盖了主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等)。

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

注: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六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

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



注:长盛盛裕纯债债券型证券投资基金合同于2016年8月4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

单位:人民币元

长盛盛裕纯债A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.3240	48,451,965.99	165.99	48,452,131.98	
合计	0.3240	48,451,965.99	165.99	48,452,131.98	

单位:人民币元

长盛盛裕纯债C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.3100	57,715.61	47.04	57,762.65	
合计	0.3100	57,715.61	47.04	57,762.65	

注:本基金于2017年度、2016年8月4日(基金合同生效日)至2016年12月31日未进行利润分配。

§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,在深圳设有营销中心,并拥有长盛基金(香港)有限公司、长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。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2018年12月31日,基金管理人共管理五十八只开放式基金,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、长盛盛银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。	2016年8月4日	-	11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、债券投资及资动性管理等工作。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

2018年,在前期政策收紧滞后影响、中美贸易摩擦、经济内生动能下降等多重因素影响下,国内经济增速缓慢回落,特别是进入下半年,回落速度有所加快。

在经济下行压力加大的背景下,政策开始逐步调整,去杠杆转向稳杠杆,宽货币和宽信用政策接连出台,但实际效果尚不明显。尽管期间有一定震荡,但全年来看,债券收益率明显下行。

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,到期再投资重点配置中短期高等级信用债,保持组合适中久期,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1.0229元,本报告期基金份额净值增长率为7.37%;截至本报告期末长盛盛裕纯债C基金份额净值为1.0229元,本报告期基金份额净值增长率为7.21%;同期业绩比较基准收益率为4.79%。

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2019年,基建投资有望企稳回升,但出口大概率维持弱势,同时房地产投资增速预计将下行,经济下行压力仍存。通胀方面,受猪瘟等因素影响,会有一定扰动,但总体预计低位运行。货币政策预计继续维持适度宽松。

债券市场方面,在基本面和政策等多重因素影响下,预计仍会有下行空间,但由于收益率绝对水平已经不高,如遇扰动,波动程度可能会有所加大。策略上,以中短久期为主要配置方向,同时,继续严控信用风险,规避盈利恶化的行业、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

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定,本基金本报告期内实施了利润分配,分配金额为48,509,894.63元。

本基金截至2018年12月31日,期末可供分配利润为34,314,397.28元,其中:长盛盛裕纯债A期末可供分配利润为34,288,980.13元(长盛盛裕纯债A的未分配利润已实现部分为55,054,084.92元,未分配利润未实现部分为-20,765,104.79元),长盛盛裕纯债C期末可供分配利润为25,417.15元(长盛盛裕纯债C的未分配利润已实现部分为41,053.12元,未分配利润未实现部分为-15,635.97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;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本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 审计报告

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师王珊珊、马剑英2019年3月27日对本基金2018年12月31日的资产负债表和2018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注出具了安永华明(2019)审字第60468688_A20号标准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:长盛盛裕纯债债券型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	1,413,758.45	1,071,433.09
结算备付金	6,379,774.90	3,172,414.52
存出保证金	2,470.64	996.54
交易性金融资产	1,899,120,600.00	1,508,474,380.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,899,120,600.00	1,508,474,380.00
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	967,800.20	61,804.40
应收利息	28,206,662.10	22,508,333.96
应收股利	-	-
应收申购款	2,000.00	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,936,093,066.29	1,535,289,362.51
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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	402,399,458.90	61,929,814.25
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	48,248.46	98.32
应付管理人报酬	389,624.13	375,091.98
应付托管费	194,812.05	187,546.01
应付销售服务费	210.67	139.5
应付交易费用	8,990.61	5,093.00
应交税费	233,067.83	-
应付利息	39,060.77	46,477.46
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	189,007.57	150,000.00
负债合计	403,502,480.99	62,694,134.97
所有者权益:		
实收基金	1,498,276,188.02	1,497,209,911.16
未分配利润	34,314,397.28	-24,614,683.62
所有者权益合计	1,532,590,585.30	1,472,595,227.54
负债和所有者权益总计	1,936,093,066.29	1,535,289,362.51

注:报告截止日2018年12月31日,长盛盛裕纯债A类基金份额净值人民币1.0229元,长盛盛裕纯债C类基金份额净值人民币1.0229元;基金份额总额1,498,276,188.02份,其中长盛盛裕纯债A类基金份额1,497,165,387.50份,长盛盛裕纯债C类基金份额1,110,800.52份。

7.2 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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	123,581,202.90	22,095,769.73
1.利息收入	71,954,679.23	67,165,875.54
其中:存款利息收入	202,821.24	3,220,644.43
债券利息收入	71,576,244.73	63,819,170.86
资产支持证券利息收入	100,956.41	-
买入返售金融资产收入	74,656.85	126,060.25
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-17,319,604.96	956,138.78
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-17,319,604.96	956,138.78
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)	68,945,349.86	-46,026,253.42
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	778.76	8.83
减:二、费用	16,148,808.94	16,584,920.90
1. 管理人报酬	4,531,826.75	4,405,134.56
2. 托管费	2,265,913.27	2,202,567.25
3. 销售服务费	1,494.57	174.94
4. 交易费用	13,035.60	6,738.52
5. 利息支出	8,875,617.62	9,773,211.32
其中:卖出回购金融资产支出	8,875,617.62	9,773,211.32
6. 税金及附加	219,553.86	-
7. 其他费用	241,377.27	197,094.31
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	107,432,393.96	5,510,848.83
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	107,432,393.96	5,510,848.83

7.3 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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	1,497,209,911.16	-24,614,683.62	1,472,595,227.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	107,432,393.96	107,432,393.96
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)	1,066,276.86	6,581.57	1,072,858.43
其中:1.基金申购款	5,840,157.65	85,478.55	5,925,636.20
2.基金赎回款	-4,773,880.79	-78,896.98	-4,852,777.77
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)	-	-48,509,894.63	-48,509,894.63
五、期末所有者权益(基金净值)	1,498,276,188.02	34,314,397.28	1,532,590,585.30
项目	上年度可比期间 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)	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)	-	5,510,848.83	5,510,848.83
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)	-78,327.44	1,175.19	-77,152.25
其中:1.基金申购款	15,098.82	-302.38	14,796.44
2.基金赎回款	-93,426.26	1,477.57	-91,948.69
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)	1,497,209,911.16	-24,614,683.62	1,472,595,227.54

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向社会公开募集,基金合同于2016年8月4日生效,于基金合同生效日,本基金规模为1,000,048,999.00份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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A类基金份额在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用,C类基金份额在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费。本基金管理人对持有C类基金份额期限少于30日的,该类别基金份额的赎回收取赎回费,对持有期限不少于30日的该类别基金份额不收取赎回费。

本基金的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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 增值税

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,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]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(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,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;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、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股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额;

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加,以实际缴纳的增值税税额为计税依据,分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.2 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[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。

7.4.6.3 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。

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	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
国元证券股份有限公司("国元证券")	基金管理人股东
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人子公司

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。

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

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 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,531,826.75	4,405,134.56
其中:支付销售机构的客户维护费	34.04	338,788.05

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.30%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.30%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,265,913.27	2,202,567.25

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.15%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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 2018年1月1日至2018年12月31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	-	33.26	33.26
合计	-	33.26	33.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	长盛盛裕纯债A	长