

信息披露

disclosure

长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)

2017年第四季度报告

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
报告送出日期:2018年1月20日

§1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在虚假记载、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责任。

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1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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预示其未来表现,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。

本报告自2017年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金名称	长盛同盛成长优选混合
基金简称	长盛同盛
基金代码	160303
交易代码	160303
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年4月21日
报告期末基金份额总额	23,686,726.36元

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年10月1日至2017年12月31日)
1.本期已实现收益	3,571,640.26
2.本期利润	6,594,916.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0309
4.期末基金份额净值	200.2507,647
5.期末基金份额净值	0.836

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.本期数据截至到2017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 本报告期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

阶段	净值增长率A	净值增长率B	业绩比较基准收益C	业绩比较基准收益D	①-③	②-④
过去三个月	3.34%	0.79%	2.31%	0.44%	1.03%	0.35%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:1.长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)由盛盛证券投资基金转型而来,转型日期为2014年11月6日(即基金合同生效日)。

2.按照本基金合同约定,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。建仓期间,本基金的各项资产投资比例符合基金合同第十二条(二)投资范围、(四)投资限制的有关约定。截至报告日,本基金的各项资产投资比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
马强	本基金基金经理	2016年2月17日	9年	马强先生,1983年9月出生,中央财经大学硕士,历任国泰君安证券研究所研究员,现任长盛基金管理有限公司基金经理。2016年2月17日加入长盛基金担任基金经理,长盛同盛成长优选混合基金、长盛同盛成长优选混合基金(L-OF)基金经理。

注:1.上述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、《基金基金合同》和有关法律法规规定,监管部门的相关规定,恪尽职守,勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不存在违法违规情形。

4.3 公平交易专项说明

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员统一执行并委托交易,交易员按照《公平交易细则》的规定,场内交易,严格执行自研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,监督稽核,依照《公平交易细则》的规定,持续、动态监控公司投资管理行为,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现事项,保障公司旗下所有投资组合得到公平对待。

公司对报告期内不同交易方式进行数量分析,计算胜率、贡献率、占比等指标,使用双边90%置信水平对1月、3月、5日的交易进行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,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 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年四季度的市场呈现震荡走势,继白马股和其他股股的走势再次分化明显,上证指数上涨1.25%,沪深300指数上涨5.07%,创业板指下跌6.12%,中小板指下跌0.09%。同期,中证1000指数净值增长率中位数为1.34%,本基金同期净值增长率为3.34%,主要采用低吸高抛策略进行调仓,持仓中偏好与权益类股票,较好的获取持仓上涨中的收益。

展望未来市场,外部因素对国内市场的冲击有所缓和,供给侧改革的影响尚未完全体现,但国内经济下行压力依然较大,国内经济基本面,将会呈现经济稳中趋暖、通胀温和上升、货币保持宽松、企业盈利难以改善以财政政策宽松和积极的财政支出,对经济、企业盈利和通胀产生一定影响。在通胀压力下,机构投资者在资产配置和监管政策的金融融合的要求,推动股票资产波动率中下行,提高其风险调整后的回报率。另外从资产配置需求的角度,当前地产在“房住不炒”的政策下,以及资管新规对银行理财资金的约束下,未来地产对权益的吸引力或有所增强。有利于权益类资产配置。基于上述判断,我们将保持仓位稳定,继续维持权益类资产仓位在10%左右,在低波动低估值中长期持仓并市场稳定收益的基础上,利用强势行业轮动策略提高长期收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.836元;本报告期基金份额净值增长率为3.34%,业绩比较基准收益率为2.31%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期末无基金持有人人数或基金资产净值预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	186,606,767.53	76.32
2	固定收益	186,606,767.53	76.32
3	权益投资	11,957,761.09	5.75
4	固定收益	11,957,761.09	5.75
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	36,803,325.26	17.62
8	其他资产	63,373.37	0.31
9	合计	247,804,627.37	100.00

注:1.权益投资中股票投资占权益类资产的比例为100%。

2.“买入返售金融资产”中“证券融资”的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	农林、牧、渔	-	-
2	采矿业	-	-
3	制造业	-	-
4	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
5	建筑业	-	-
6	金融业	-	-
7	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
8	批发和零售业	-	-
9	交通运输、仓储和邮政业	-	-
10	住宿和餐饮业	-	-
11	房地产业	-	-
12	租赁和商务服务业	-	-
13	科学研究和技术服务业	-	-
14	水利、环境和公共设施管理业	-	-
15	文化、体育和娱乐业	-	-
16	综合	-	-
17	合计	11,957,761.09	5.75

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000036	招商银行	440,700	12,799,114.00	6.39
2	000044	长江电力	445,000	9,491,880.00	4.74
3	600899	紫光股份	256,449	9,064,279.58	4.54
4	300733	炬光科技	296,000	8,900,020.00	4.47
5	600856	中信证券	400,100	7,015,530.00	3.50
6	002412	宁波银行	378,630	6,734,840.30	3.37
7	601006	大秦铁路	600,700	5,848,627.00	2.94
8	002156	通威股份	409,300	5,111,609.00	2.70
9	600583	江山股份	71,900	4,745,400.00	2.37
10	000048	华发股份	400,000	4,600,000.00	2.34

注:1.权益投资中股票投资占权益类资产的比例为100%。

2.“买入返售金融资产”中“证券融资”的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000036	招商银行	440,700	12,799,114.00	6.39
2	000044	长江电力	445,000	9,491,880.00	4.74
3	600899	紫光股份	256,449	9,064,279.58	4.54
4	300733	炬光科技	296,000	8,900,020.00	4.47
5	600856	中信证券	400,100	7,015,530.00	3.50
6	002412	宁波银行	378,630	6,734,840.30	3.37
7	601006	大秦铁路	600,700	5,848,627.00	2.94
8	002156	通威股份	409,300	5,111,609.00	2.70
9	600583	江山股份	71,900	4,745,400.00	2.37
10	000048	华发股份	400,000	4,600,000.00	2.34

注:1.权益投资中股票投资占权益类资产的比例为100%。

2.“买入返售金融资产”中“证券融资”的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000036	招商银行	440,700	12,799,114.00	6.39
2	000044	长江电力	445,000	9,491,880.00	4.74
3	600899	紫光股份	256,449	9,064,279.58	4.54
4	300733	炬光科技	296,000	8,900,020.00	4.47
5	600856	中信证券	400,100	7,015,530.00	3.50
6	002412	宁波银行	378,630	6,734,840.30	3.37
7	601006	大秦铁路	600,700	5,848,627.00	2.94
8	002156	通威股份	409,300	5,111,609.00	2.70
9	600583	江山股份	71,900	4,745,400.00	2.37
10	000048	华发股份	400,000	4,600,000.00	2.34

注:1.权益投资中股票投资占权益类资产的比例为100%。

2.“买入返售金融资产”中“证券融资”的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

5.6 报告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

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000036	招商银行	440,700	12,799,114.00	6.39
2	000044	长江电力	445,000	9,491,880.00	4.74
3	600899	紫光股份	256,449	9,064,279.58	4.54
4	300733	炬光科技	296,000	8,900,020.00	4.47
5	600856	中信证券	400,100	7,015,530.00	3.50
6	002412	宁波银行	378,630	6,734,840.30	3.37
7	601006	大秦铁路	600,700	5,848,627.00	2.94
8	002156	通威股份	409,300	5,111,609.00	2.70
9	600583	江山股份	71,900	4,745,400.00	2.37
10	000048	华发股份	400,000	4,600,000.00	2.34

注:1.权益投资中股票投资占权益类资产的比例为100%。

2.“买入返售金融资产”中“证券融资”的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000036	招商银行	440,700	12,799,114.00	6.39
2	000044	长江电力	445,000	9,491,880.00	4.74
3	600899	紫光股份	256,449	9,064,279.58	4.54
4	300733	炬光科技	296,000	8,900,020.00	4.47
5	600856	中信证券	400,100	7,015,530.00	3.50
6	002412	宁波银行	378,630	6,734,840.30	3.37
7	601006	大秦铁路	600,700	5,848,627.00	2.94
8	002156	通威股份	409,300	5,111,609.00	2.70
9	600583	江山股份	71,900	4,745,400.00	2.37
10	000048	华发股份	400,000	4,600,000.00	2.34

注:1.权益投资中股票投资占权益类资产的比例为100%。

2.“买入返售金融资产”中“证券融资”的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000036	招商银行	440,700	12,799,114.00	6.39
2	000044	长江电力	445,000	9,491,880.00	4.74
3	600899	紫光股份	256,449	9,064,279.58	4.54
4	300733	炬光科技	296,000	8,900,020.00	4.47
5	600856	中信证券	400,100	7,015,530.00	3.50
6	002412	宁波银行	378,630	6,734,840.30	3.37
7	601006	大秦铁路	600,700	5,848,627.00	2.94
8	002156	通威股份	409,300	5,111,609.00	2.70
9	600583	江山股份	71,900	4,745,400.00	2.37
10	000048	华发股份	400,000	4,600,000.00	2.34

注:1.权益投资中股票投资占权益类资产的比例为100%。

2.“买入返售金融资产”中“证券融资”的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000036	招商银行	440,700	12,799,114.00	6.39
2	000044	长江电力	445,000	9,491,880.00	4.74
3	600899	紫光股份	256,449	9,064,279.58	4.54
4	300733	炬光科技	296,000	8,900,020.00	4.47
5	600856	中信证券	400,100	7,015,530.00	3.50
6	002412	宁波银行	378,630	6,734,840.30	3.37
7	601006	大秦铁路	600,700	5,848,627.00	2.94
8	002156	通威股份	409,300	5,111,609.00	2.70
9	600583	江山股份	71,900	4,745,400.00	2.37
10	000048	华发股份	400,000	4,600,000.00	2.34

注:1.权益投资中股票投资占权益类资产的比例为100%。

2.“买入返售金融资产”中“证券融资”的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000036	招商银行	440,700	12,799,114.00	6.39
2	000044	长江电力	445,000	9,491,880.00	4.74
3	600899	紫光股份	256,449	9,064,279.58	4.54
4	300733	炬光科技	296,000	8,900,020.00	4.47
5	600856	中信证券	400,100	7,015,530.00	3.50
6	002412	宁波银行	378,630	6,734,840.30	3.37
7	601006	大秦铁路	600,700	5,848,627.00	2.94
8	002156	通威股份	409,300	5,111,609.00	2.70
9	600583	江山股份	71,900	4,745,400.00	2.37
10	000048	华发股份	400,000	4,600,000.00	2.34

注:1.权益投资中股票投资占权益类资产的比例为100%。

2.“买入返售金融资产”中“证券融资”的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证投资明细

序号	
----	--