长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金

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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2018年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛沪港深混合
基金主代码	002732
交易代码	002732
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年7月5日
报告期末基金份额总额	50,015,206.38份
投资目标	通过把握国内宏观经济政策和市场发展趋势,深入发掘A股和港股两个市场上的高成长上市公司,全面把握中国经济的投资机会。
投资策略	(一)大类资产配置策略 在大类资产配置中,本基金将主要考虑:(1)宏观经济指标;(2)微观经济指标;(3)市场指标;(4)政策因素。 本基金将通过深入分析上述指标与因素,动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例,控制市场风险,提高配置效率。 (二)股票投资策略 本基金将通时调整国内A股和香港(港股通标的股票)两地股票配置比例及投资策略,主要依照但括但不限于宏观经济因素、政策因素、两地估值折溢价因素、资金利差、市场情绪以及流动性趋势等。 1、A股投资策略 在A股投资方面,本基金主要突出"自下而上"的个股精选策略,通过定性分析和定量分析相结合的办法,挑选具备较大投资价值的上市公司。 2、港股通标的股票投资策略 在对A11股溢价水平进行重点分析和趋势预测的前提下,本基金管理人将优选香港市场与国内A股在部分行业形成有效互补的行业和上市公司。 最后,本基金将利用两地市场在估值水平、投资者群体结构、交易规则等方面的差异,通过估值套利、事件套利等多重策略获取收益。 (三)债券投资策略 本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素,构造债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。 (四)权证投资策略 本基金投资权证的原则是有利于基金资产增值和投资风险控制。 (五)股指期货投资策略 本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适当参与股指期货的投资。 (六)资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等多模策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×30%+恒生综合指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期风险与预期收益水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中等风险收益特征的基金品种。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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-2017年12月31日)
1.本期已实现收益	241,948.93
2.本期利润	-255,725.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0050
4.期末基金资产净值	58,182,270.20
5.期末基金份额净值	1.163

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。

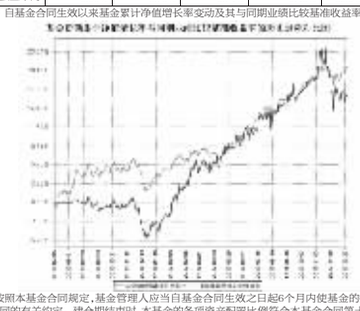
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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①	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	0.09%	0.79%	3.74%	0.45%	-3.65%	0.34%

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: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部分(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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴达	本基金基金经理、长盛环球资气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理、国际业务部总监、长盛基金(香港)有限公司副总经理、长盛创富资产管理有限公司董事。	2016年7月5日	-	15年	吴达先生,1979年8月出生。伦敦政治经济学院金融经济学硕士,CFA(特许金融分析师)。历任新加坡星展资产管理有限公司研究员、星展瑞顿全球收益基金经理助理、星展增顿基金经理、专户投资组合经理;新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员;华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理;2007年8月起加入长盛基金管理有限公司,曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。

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 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。

公司对投资期内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 投资组合报告附注

四季度中国经济如期有所放缓,但供给侧改革的效应继续发挥,从PMI指数显示的水平看大企业优于中、小型企业。海外主要经济体增长良好,体现为国内新出口订单指数创年内新高,短期内出口景气或仍维持高位。综合考虑先行指标的小幅回落,国内经济增长整体上存在支撑,短期风险不大。

年底召开的中央经济工作会议延续了十九大会议的精神,强调对经济增长质量的看重,对经济的整体信心增强。在稳中求进的基调下,预计整体经济保持平稳。财政政策维持积极,调整优化财政支出结构,有保有压,确保对重点领域和项目的支持力度,压缩一般性支出,切实加强地方政府债务管理。货币政策维持稳健中性不变。同时,防范金融风险依然是新时期的重要任务,主要指标是控制宏观杠杆率稳定,促进金融服务实体经济,在这个过程中,金融监管难以见到显著放松。

货币金融条件方面,美联储12月例会加息,符合市场预期,后续在等待新任美联储主席上任的过程中,整体上全球货币政策的态势预计将维持,但会比较温和。国内货币政策继续稳健,金融去杠杆的推进导致M2增速继续下滑。临近年末资金面偏紧,结构分化明显,偏长期利率震荡上行。权益市场震荡调整,融资资金回落,成交量有所萎缩。报告期初港币汇率跟随美联储加息预期有所回复,但加息落地后欧美资金显现回流趋势,导致香港市场货币条件被动收紧,港股市场出现获利回吐潮,以前期表现强势的科技与可选消费板块为甚。沪港深优势精选基金在期内净值波动较大,主要来自于配置的相关板块与港币汇率波动的影响。

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1.163元;本报告期基金份额净值增长率为0.09%,业绩比较基准收益率为3.74%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	43,583,228.87	70.32
	其中:股票	43,583,228.87	70.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	10,000,000.00	16.14
	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	8,233,312.38	13.28
8	其他资产	159,709.98	0.26
9	合计	61,976,251.23	100.00

注:本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为29,215,388.87元,占期末资产净值比例为50.21%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,010,200.00	17.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	322,900.00	0.55
I	信息传输、软件和信息技术服务业	744,000.00	1.28
J	金融业	2,659,240.00	4.57
K	房地产业	631,500.00	1.09
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,367,840.00	24.69

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
金融	12,273,582.94	21.10
原材料	-	0.00
公用事业	2,970,239.01	5.11
日常消费品	-	0.00
电信业务	-	0.00
房地产	1,968,568.06	3.38
信息科技	6,444,197.37	11.08
工业	662,876.63	1.14
医疗保健	1,666,804.54	2.86
非日常生活消费品	3,229,120.33	5.55
能源	-	0.00
合计	29,215,388.87	50.21

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	02601 HK	中国太保	100,000	3,138,842.05	5.39
2	01288 HK	农业银行	1,000,000	3,042,712.40	5.23
3	01336 HK	新华保险	66,000	2,946,081.20	5.06
4	00700 HK	腾讯控股	8,000	2,715,035.68	4.67
5	601318	中国平安	38,000	2,659,240.00	4.57
6	01398 HK	工商银行	450,000	2,366,043.26	4.07
7	600703	三安光电	90,000	2,285,100.00	3.93
8	00884 HK	旭辉控股集团	500,000	1,968,568.05	3.38
9	00371 HK	北控水务集团	330,000	1,668,894.32	2.87
10	02018 HK	瑞声科技	13,000	1,514,836.10	2.60

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

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五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本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。

5.11.2

基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	141,016.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-637.18
5	应收申购款	19,330.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	159,709.98

5.11.4 报告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)。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末投资前十名股票不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	46,669,317.17
报告期期间基金总申购份额	39,472,862.11
减:报告期期间基金总赎回份额	36,126,972.90
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	50,015,206.38

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20171018-20171025	9,232,686.98	-	-	9,232,686.98	18.46%
产品特有风险							
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016]36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]46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]70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[2016]140号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税[2017]90号)及《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律法规、部门规章和规范性文件的规定,自2018年1月1日(含)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适用简易计税方法,按照规定的税费率缴纳增值税及附加税费。

自2018年1月1日(含)起,本公司将对旗下存续及新增产品发生的增值税应税行为按照相关法律法规及税收政策计算和缴纳增值税及相应附加税费;前述税费金额是产品管理、运作和处分过程中发生的,将由产品资产承担,从产品资产中提取缴纳,可能会使相关产品净值或实际收益降低,敬请投资者知悉。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛沪港深优势精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛沪港深优势精选灵活配置混合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。

9.2 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。

9.3 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和/或管理人互联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
2018年1月20日

长盛可转债债券型证券投资基金

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

基金管理人的董事会及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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛可转债	
基金主代码	003510	
交易代码	003510	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月7日	
报告期末基金份额总额	49,036,093.76份	
投资目标	在合理控制信用风险,保持适当流动性的基础上,以可转债为主要投资标的,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金综合运用定性和定量的分析手段,在对宏观经济因素进行充分研究的基础上,判断宏观经济周期所处阶段。基金经依照经济周期理论,结合对证券市场的系统性风险以及未来一段时期内各大类资产风险和预期收益率的评估,制定本基金在股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例,调整原则。 本基金主要投资于可转换债券等固定收益类品种,在有效控制风险的基础上,以可转换债券为主要投资标的,力求取得超越基金业绩比较基准的收益。本基金可投资可转债、分离交易可转债或含赎回或回售权的债券等,这类债券赋予债权人或债务人某种期权,比普通的债券更为灵活。本基金将采用专业的分析和计算方法,综合考虑可转债的久期、票面利率、风险等债券因素以及期权价格,力求选择被市场低估的品种,获得超额收益。分离交易可转债与传统可转债的不同点主要体现在分离交易可转债在上市后分离为债券部分跟权证部分分别独自进行交易。本基金的债券投资将主要采取久期策略、类属配置策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略。 本基金股票投资以精选个股为主,发挥基金管理人专业研究团队的研究能力,从定量和定性两方面考察上市公司的增值潜力。	
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%	
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。本基金主要投资于可转换债券,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。	
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	
下属分级基金的基金简称	长盛可转债A	长盛可转债C
下属分级基金的交易代码	003510	003511
报告期末下属分级基金的份额总额	17,700,837.28份	31,335,256.48份

§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-2017年12月31日)	
	长盛可转债A	长盛可转债C
1. 本期已实现收益	747.89	-103,364.71
2. 本期利润	-962,821.71	-1,649,701.59
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0457	-0.0586
4. 期末基金资产净值	18,026,319.47	31,960,247.62
5. 期末基金份额净值	1.0184	1.0199

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 基金净值表现

3.2.1 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

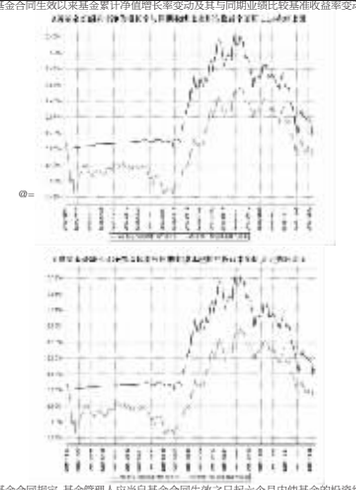
长盛可转债A

阶段	净值增长率①	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	-4.47%	0.37%	-3.68%	0.36%	-0.79%	0.01%

长盛可转债C

阶段	净值增长率①	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	-4.54%	0.37%	-3.68%	0.36%	-0.86%	0.01%

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:按照基金合同规定,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。截止报告期末,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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马文祥	本基金基金经理、长盛可转债券型证券投资基金基金经理、长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理、长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理、长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金经理、长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金(LOF)基金经理、长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理、长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理。	2016年12月7日	-	14年	马文祥先生,1977年7月出生。清华大学经济管理学院经济学硕士。历任中国农业银行主任科员、工银瑞信企业年金基金经理、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2013年8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 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。

公司对投资期内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 投资组合报告附注

四季度中国经济如期有所放缓,但供给侧改革的效应继续发挥,从PMI指数显示的水平看大企业优于中、小型企业。海外主要经济体增长良好,体现为国内新出口订单指数创年内新高,短期内出口景气或仍维持高位。综合考虑先行指标的小幅回落,国内经济增长整体上存在支撑,短期风险不大。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,374,244.00	3.91
C	制造业	16,321,862.00	18.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	574,770.00	0.67
E	建筑业	4,736,689.00	5.49
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,591,674.00	1.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	979,884.00	1.13
J	金融业	51,201,904.40	59.30
K	房地产业	2,760,223.00	3.20
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	81,541,250.40	94.44

5.2.2 报告期末按权益投资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。

5.2.2 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。

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

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,596,280.00	5.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	40,345,000.77	80.71
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	42,941,280.77	85.91

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五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	73,710	7,693,112.70	15.39
2	110034	九州转债	52,980	5,791,243.80	11.59
3	132012	17巨化EB	38,410	3,660,857.10	7.32
4	128016	雨虹转债	27,859	3,178,154.72	6.36
5	113012	骆驼转债	32,140	3,063,584.80	6.13

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本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。

5.11.2

基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,355.58
2	应收证券清算款	106,246.58
3	应收股利	-
4	应收利息	127,421.83
5	应收申购款	3,020,116.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,256,140.42

5.11.4 报告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)。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末投资前十名股票不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	24,933,945.11
报告期期间基金总申购份额	4,140,577.63
减:报告期期间基金总赎回份额	11,373,685.46
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	17,700,837.28

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20171001-20171129、20171207-20171231	50,023,195.00	316,506.00	35,204,800.00	15,134,901.00	20.49%
	2	20171