长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金（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。

长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金（LOF）以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会通过了《关于终止长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金（LOF）基金合同有关事项的议案》，大会决议自2018年1月16日起生效，目该决议生效后，基金管理人将按照深圳证券交易所的业务规则申请长盛同辉（LOF）终止上市等业务。本基金将于2018年1月24日成立基金财产清算组，进入基金财产清算程序。详情请见登载于基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）的《长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》全文。

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	长盛同辉深证100（LOF）
场内简称	长盛同辉
基金主代码	160809
交易代码	160809
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月13日
报告期末基金份额总额	19,903,016.95份
投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内，以实现对深证100等权重指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用完全复制法，按照成份股在深证100等权重指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以期令，跟踪深证100等权重指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购赎回时本基金跟踪深证100等权重指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×深证100等权重指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	从基金资产整体运作来看，本基金为股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
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

注：根据《长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金分级运作五年后，满足合同约定的条件，自动转换为契约型上市开放式基金（LOF），基金名称相应变更为“长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金（LOF）”，转换基准日为2017年9月12日。

§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	-1,153,948.96
2.本期利润	110,767.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.0055
4.期末基金资产净值	22,042,165.72
5.期末基金份额净值	1.107

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。

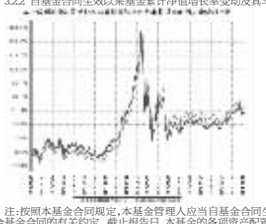
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.36%	0.98%	-0.96%	0.93%	1.32%	0.05%

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，本基金管理人应当自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定，截止报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四条“（二）投资范围”、“（八）投资限制”的有关约定。

§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		
王超	本基金基金经理，长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金基金经理，长盛同辰中证500指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛盛灵匹配混合型证券投资基金基金经理，长盛盛平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，长盛上证50指数分级证券投资基金基金经理。	2013年1月5日	-	10年	王超先生，1981年9月出生，中央财经大学硕士，CFA（特许金融分析师），FRM（金融风险管理师）。2007年7月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。

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。

公司对报告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 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略，尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响，将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为1.107元，本报告期份额净值增长率为0.36%，同期业绩比较基准收益率为-0.96%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为0.14%，控制在0.35%之内；年化跟踪误差为2.75%，控制在4%之内。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自2016年3月25日至2017年12月31日期间出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。

§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	20,752,678.25	93.47
	其中：股票	20,752,678.25	93.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,800.00	0.21
	其中：债券	45,800.00	0.21
	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	1,402,496.83	6.32
8	其他资产	2,385.70	0.01
9	合计	22,203,360.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	128,390.80	0.58
B	采矿业	239,304.00	1.09
C	制造业	11,462,971.44	52.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	674,158.00	3.06
F	批发和零售业	400,627.00	1.82
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,464,954.16	6.65
J	金融业	1,665,973.97	7.56
K	房地产业	1,159,436.80	5.26
L	租赁和商务服务业	274,726.40	1.25
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	603,961.98	2.74
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	147,067.86	0.67
S	综合	107,206.44	0.49
	合计	18,328,778.85	83.15

5.2.2 报告期末积极投资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	采掘业	202,240.00	0.92
C	制造业	1,622,050.00	7.36
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	193,833.40	0.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	405,776.00	1.84
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	2,423,899.40	11.00

5.2.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	000651	格力电器	13,200	576,840.00	2.62
2	002415	海康威视	12,226	476,814.00	2.16
3	000858	五粮液	5,600	447,328.00	2.03
4	000063	中兴通讯	11,839	430,466.04	1.95
5	000568	泸州老窖	6,265	413,490.00	1.88
6	000333	美的集团	7,450	412,953.50	1.87
7	000725	京东方A	70,079	405,757.41	1.84
8	002129	中环股份	34,000	390,660.00	1.77
9	000538	云南白药	3,732	379,890.28	1.72
10	002008	大族激光	7,100	350,740.00	1.59

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002146	荣盛发展	22,000	209,660.00	0.95
2	000629	*ST钒钛	63,200	202,240.00	0.92
3	002074	国轩高科	9,000	200,340.00	0.91
4	002271	东方雨虹	5,000	199,800.00	0.91
5	000050	深天马A	10,000	197,100.00	0.89

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	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）	45,800.00	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,800.00	0.21

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	128024	宁行转债	293	29,300.00	0.13
2	123006	东时转债	104	10,400.00	0.05
3	123005	万信转债	61	6,100.00	0.03

注：本基金本报告期末仅持有上述三只债券。

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	1,296.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	378.16
5	应收申购款	709.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,385.70

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000629	*ST钒钛	202,240.00	0.92	重大事项停牌

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	20,770,426.03
报告期期间基金总申购份额	49,031.40
减：报告期期间基金总赎回份额	916,434.48
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	19,903,016.95

§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	20171001-20171231	6,191,322.00	0.00	105,000.00	6,086,322.00	30.58%
	2	20171001-20171231	5,769,380.00	0.00	0.00	5,769,380.00	28.99%
产品持有风险							
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

（一）中国证监会核准基金募集的文件；

（二）《长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金合同》；

（三）《长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金托管协议》；

（四）《长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金招募说明书》；

（五）《长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金（LOF）基金合同》；

（六）《长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金（LOF）托管协议》；

（七）《长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；

（八）法律意见书；

（九）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（十）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及/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

长盛同享保本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	长盛同享保本
基金主代码	002789
交易代码	002789
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年6月28日
报告期末基金份额总额	3,099,007,013.89份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的基础上，运用投资组合保险技术，为投资者提供保本周期到期时保本金额安全的保证，并力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	（一）大类资产配置策略 （1）CPPI策略 根据恒定比例组合保险原理，本基金将根据市场的波动，组合安全垫（即基金净资产超过基金价值底线的数额）的大小动态调整安全资产与风险资产投资的比例，通过对安全资产的投资实现保本期到期时保本金额的安全，通过对风险资产的投资寻求保本期间资产的稳定增值。本基金对安全资产和风险资产的资产配置具体可分为以下四步： 第一步：确定安全资产的最低配置比例。 第二步：计算投资组合的安全垫（Cushion），即投资组合净值超过安全底线的数额。 第三步：确定风险资产的最高配置比例。 （2）TIPP策略 本基金采用时间不变性投资组合保险策略（TimeInvariantPortfolioProtection）策略，该策略是指基金设置的价值底线随着投资组合收益的变动而调整的投资策略。 （二）债券投资策略 本基金采用自上而下的策略，以久期管理为核心，从整体资产配置、类属资产配置等方面进行系统主动的债券投资管理，实现基金份额净值的稳步提升。 （三）股票投资策略 本基金的股票投资策略包括新股申购策略和二级市场投资策略。 （1）新股申购 本基金将根据市场情况，适度参与新股申购（含增发新股），以增加收益。 （2）二级市场股票投资 本基金股票投资采用行业配置与个股精选相结合的投资策略，在定性和定量分析的基础上，通过优选具有良好成长性、成长质量优良、定价相对合理的股票进行投资，以期求超额收益。 （四）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。 （五）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。 （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、个券选择和相关市场交易机会等影响因素，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	两年期银行定期存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其长期平均预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。
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	长盛同享保本A / 长盛同享保本C
下属分级基金的交易代码	002789 / 002790
报告期末下属分级基金的份额总额	3,099,006,713.89份 / 300.00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）	
	长盛同享保本A	长盛同享保本C
1. 本期已实现收益	107,542,703.75	4.00
2. 本期利润	43,938,136.01	2.42
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0125	0.0081
4. 期末基金资产净值	3,260,800,735.69	300.00
5. 期末基金份额净值	1.052	1.000

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

长盛同享保本A

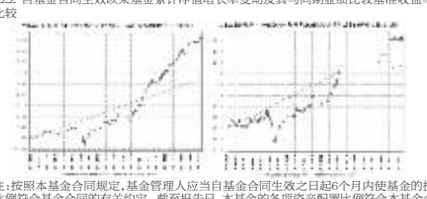
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.15%	0.08%	0.53%	0.01%	0.62%	0.07%

长盛同享保本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	0.78%	0.07%	0.21%	0.00%	0.57%	0.07%

注：长盛同享保本C级分别于2017年7月7日至2017年10月19日、2017年10月27日至2017年11月20日、2017年12月8日至2017年12月19日未持有份额。

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。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四部分（二）投资范围、（四）投资限制的有关约定。

§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		
蔡宾	本基金基金经理，长盛基金管理有限公司副总经理，固定收益部总监，社保组合组合经理。	2016年6月28日	-	12年	蔡宾先生，1978年11月出生。毕业于中央财经大学，获硕士学位，CFA（特许金融分析师）。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理，2006年2月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理、投资经理，长盛积极配置债券基金基金经理、长盛同庭信用增利债券型证券投资基金基金经理、长盛同鑫中高收益债券型证券投资基金基金经理、长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理、长盛同享保本混合型证券投资基金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。

公司对报告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 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

回顾四季度，国内经济稳中趋缓，经济韧性仍较强；资产投资、消费、工业生产等主要经济指标小幅回落，CPI小幅回升；供给侧改革及环保限产持续推进，在企业盈利修复持续的预期下，工业生产基本平稳。通胀方面，猪肉价格出现回升，中上游价格维持高位，通胀预期有所抬头；受资产价格、金融监管去杠杆等因素制约，货币政策保持稳健中性，资金面总体维持中性偏紧局面。

债券收益率震荡走高，收益率曲线较为平坦，整体上行幅度较大。10-11月在基本面、资金面和监管政策落地等因素综合影响下，债市收益率突破今年4-5月前期高点，持续大幅度调整。12月以来，在央行释放稳定流动性预期信号，实体经济稳中稍弱等因素作用下，债券市场下跌趋缓，收益率整体维持高位震荡。信用债整体亦跟随利率债大幅调整，信用利差较三季度末走阔。

四季度，A股市场呈现先涨后跌行情，上证综指小幅下跌1.25%，沪深300指数上涨5.07%，创业板指下跌6.12%。今年以来的结构性行情在4季度持续发展，白马股、消费股、绩优蓝筹股显著跑赢市场，家电、食品饮料、保险等板块有不错的表现。市场整体从11月下旬开始出现较大幅度的一波调整。

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，按照CPPI保本策略进行大类资产配置，安全资产以低风险的债券资产及银行存单为主要投资标的；同时，根据市场形势变化及安全资产的收益积累情况，继续精选估值水平合理、分红率较高的股票，适度布局权益市场，把握结构性市场机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛同享保本A基金份额净值为1.052元，本报告期基金份额净值增长率为1.15%，同期业绩比较基准收益率为0.53%；截至本报告期末长盛同享保本C基金份额净值为1.000元，本报告期基金份额净值增长率为0.78%，同期业绩比较基准收益率为0.21%。(注：长盛同享保本C级分别于2017年7月7日至2017年10月19日、2017年10月27日至2017年11月20日、2017年12月8日至2017年12月19日未持有份额。)

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	212,699,907.39	4.09
	其中：股票	212,699,907.39	4.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,865,051,182.30	93.66
	其中：债券	4,865,051,182.30	93.66
	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	114,217,647.92	2.20
8	其他资产	5,194,217.64	0.10
9	合计	5,196,162,955.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	24,409,843.15	0.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	161,798,175.00	4.96
K	房地产业	23,472,391.20	0.72
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	2,985,396.90	0.09
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	212,699,907.39	6.52

5.