

长盛同禧债券型证券投资基金 2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 月 31 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：2018 年 3 月 31 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 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 2017 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	长盛同禧债券	
基金主代码	080009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 12 月 6 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	135,279,543.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C
下属分级基金的交易代码:	080009	080010
报告期末下属分级基金的份额总额	49,655,646.54 份	85,623,896.67 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	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。在债券组合管理策略方面,本基金将综合应用利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略、可转换债券投资策略、资产支持证券等品种投资策略、中小企业私募债投资策略。
业绩比较基准	中证企业债指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均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	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

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	基金管理人的办公地址和基金托管人住所

§ 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	2017 年		2016 年		2015 年	
	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C
本期已 实现收 益	3,942,518.52	-95,776.36	-3,586,602.68	-78,512.93	3,083,364.69	3,037,651.65
本期利 润	6,569,976.80	116,762.50	-6,253,713.47	-161,733.86	895,645.91	851,503.06
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0239	0.0017	-0.0210	-0.0409	0.0735	0.1011
本期基 金份额 净值增 长率	0.03%	-0.80%	-2.51%	-3.01%	5.36%	4.81%
3.1.2 期末数 据和指 标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C
期末可 供分配 基金份 额利润	0.0137	0.0088	0.3229	0.2884	0.3570	0.3279
期末基 金资产 净值	50,334,559.54	86,381,543.62	302,099,354.69	3,868,466.12	53,140,754.71	6,263,850.11
期末基 金份额 净值	1.014	1.009	1.323	1.288	1.357	1.328

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。

表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 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

长盛同禧债券 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
过去三个月	-0.78%	0.11%	-0.40%	0.05%	-0.38%	0.06%
过去六个月	-0.12%	0.08%	0.20%	0.04%	-0.32%	0.04%
过去一年	0.03%	0.08%	0.02%	0.05%	0.01%	0.03%
过去三年	2.75%	0.39%	12.10%	0.07%	-9.35%	0.32%
过去五年	40.34%	0.44%	23.63%	0.08%	16.71%	0.36%
自基金合同生效起至今	32.34%	0.42%	30.20%	0.08%	2.14%	0.34%

长盛同禧债券 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
过去三个月	-0.88%	0.11%	-0.40%	0.05%	-0.48%	0.06%
过去六个月	-0.42%	0.09%	0.20%	0.04%	-0.62%	0.05%
过去一年	-0.80%	0.09%	0.02%	0.05%	-0.82%	0.04%
过去三年	0.84%	0.39%	12.10%	0.07%	-11.26%	0.32%
过去五年	36.50%	0.44%	23.63%	0.08%	12.87%	0.36%
自基金合同生效起至今	27.77%	0.42%	30.20%	0.08%	-2.43%	0.34%

注：本基金业绩比较基准： $40\% \times$ 中证国债指数收益率 $+60\% \times$ 中证企业债指数收益率。

中证国债指数是中证指数公司编制的，反映我国国债市场整体价格和投资回报情况的指数，样本券包括在银行间债券市场、上海证券交易所和深圳证券交易所流通的剩余期限在 1 年以上的国债。

中证企业债指数是中证指数公司编制的，反映我国企业债市场整体价格和投资回报情况的指数，样本券包括在银行间债券市场、上海证券交易所和深圳证券交易所流通的剩余期限在 1 年以上的企业债。

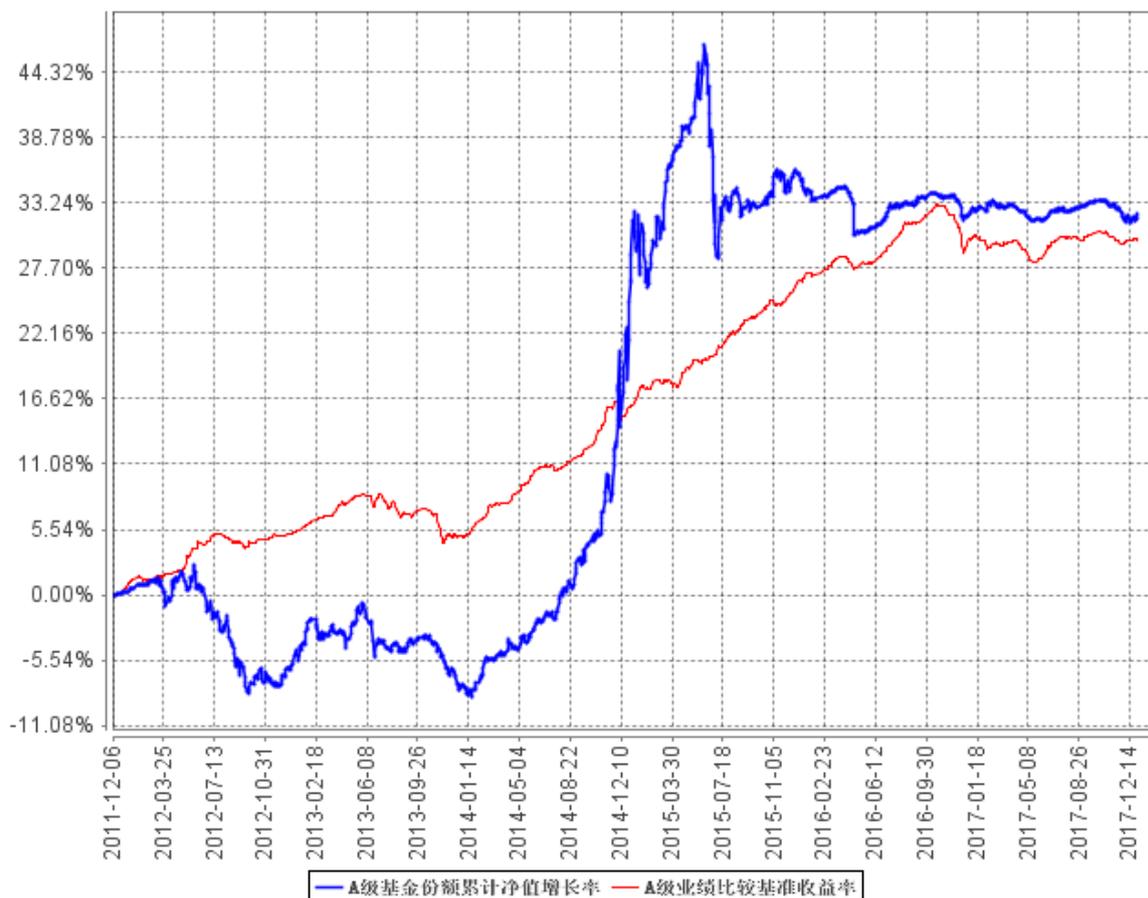
这两个指数具有广泛的市场代表性，能够分别反映我国国债、企业债市场的总体走势。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 40%、60% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时

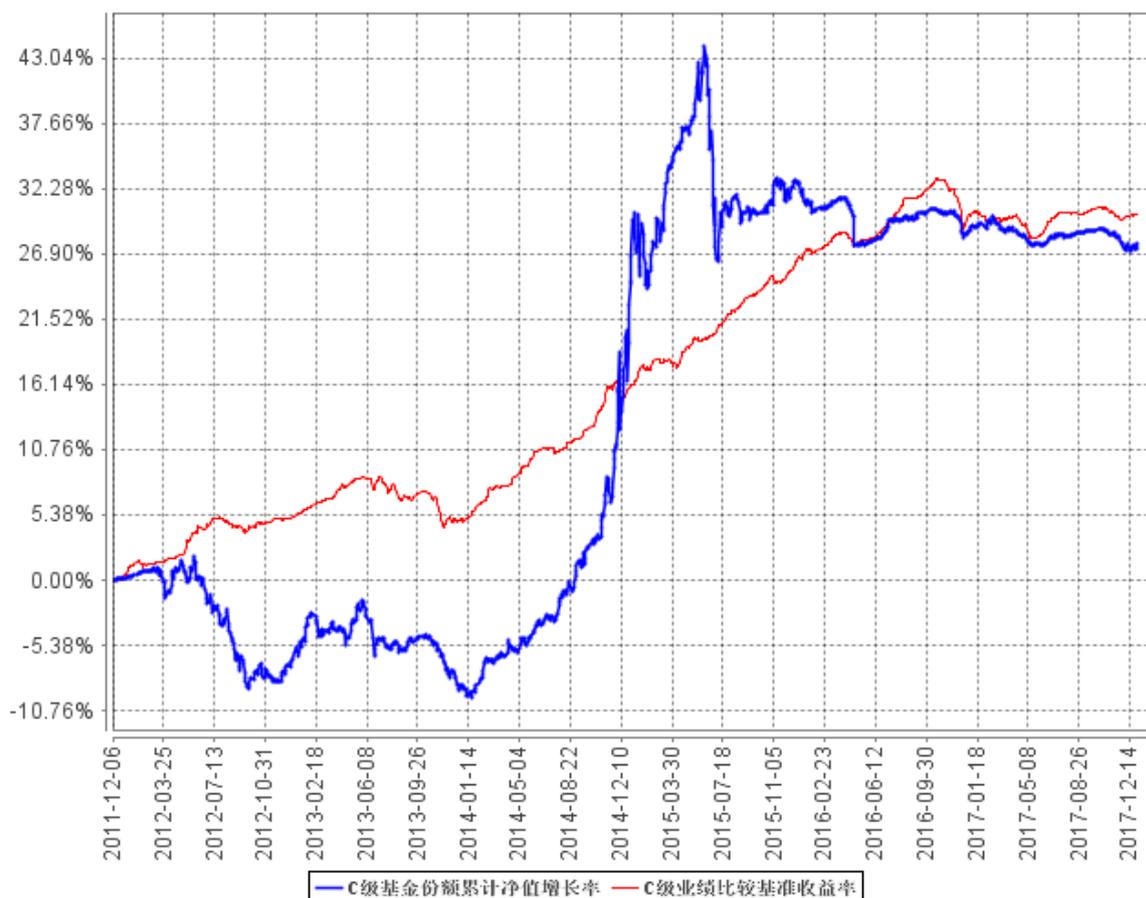
间序列。

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



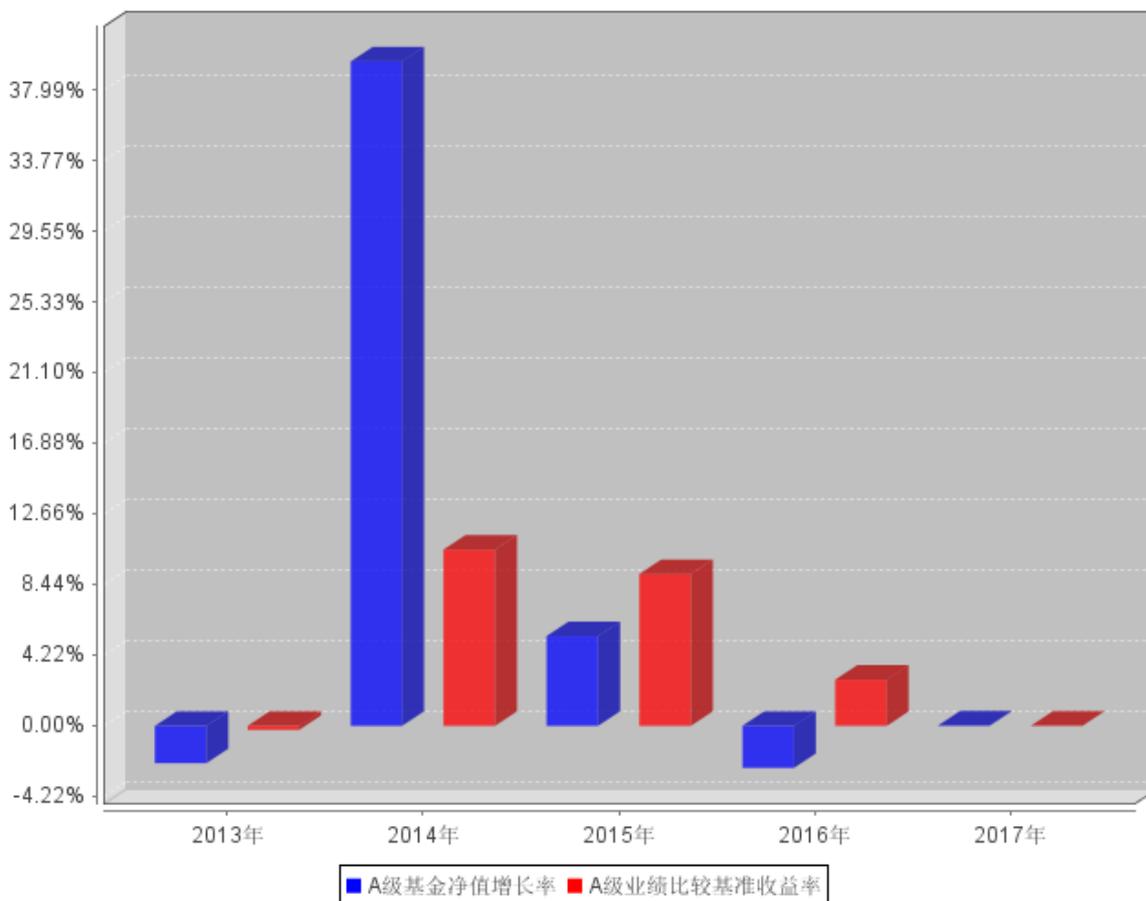
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



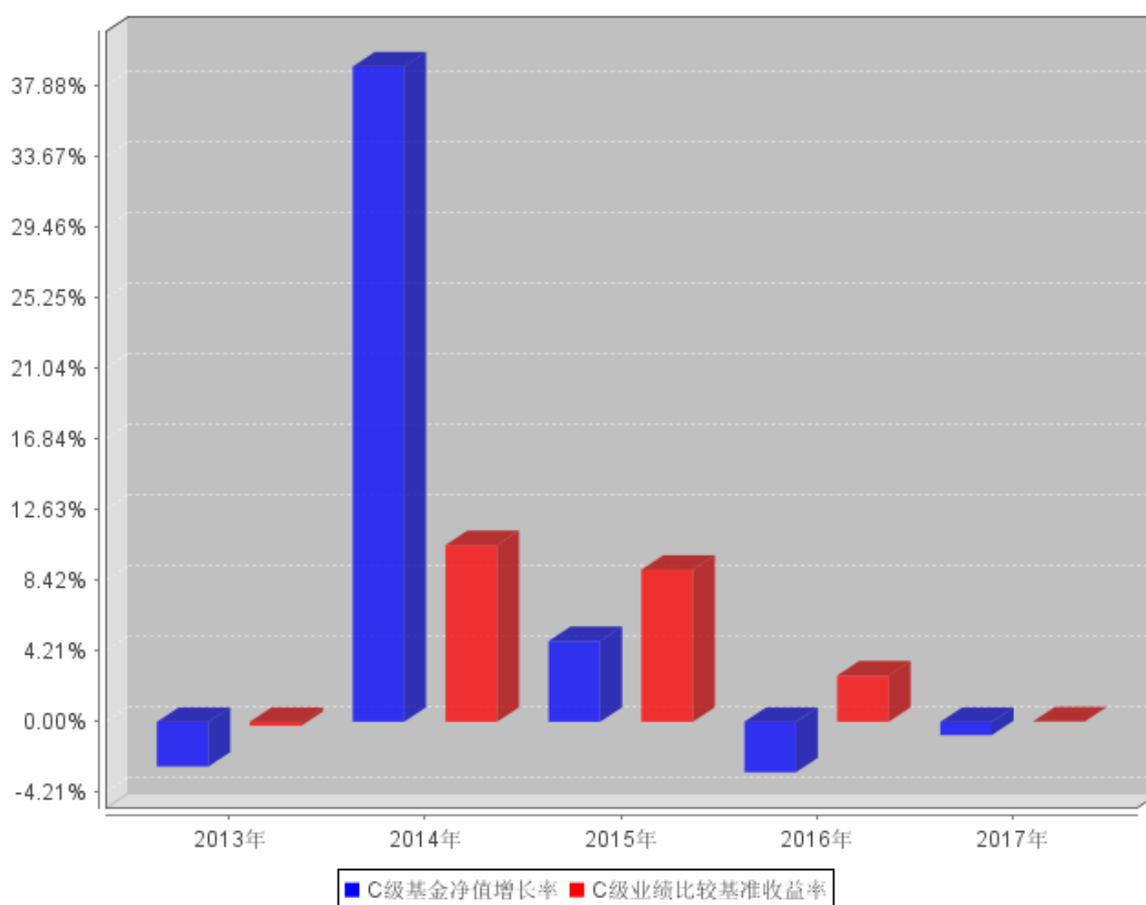
注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 过去五年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

A级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长盛同禧债券 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
2017	3.1000	2,296,161,647.86	179,493.26	2,296,341,141.12	
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
合计	3.1000	2,296,161,647.86	179,493.26	2,296,341,141.12	

单位：人民币元

长盛同禧债券 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
2017	2.7000	177,707,834.09	96,588.97	177,804,423.06	
2016	-	-	-	-	
2015	-	-	-	-	
合计	2.7000	177,707,834.09	96,588.97	177,804,423.06	

§ 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，在香港、北京分别设有子公司。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%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2017 年 12 月 31 日，基金管理人共管理七十四只开放式基金，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		
张帆	本基金基金经理，长盛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，长盛同丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理，养老金业务部负责人。	2016 年 1 月 20 日	-	10 年	张帆先生，1983 年 1 月出生。华中科技大学硕士。曾在长江证券股份有限公司从事债券研究、债券投资工作。2012 年 4 月加入长盛基金管理有限公司，曾任非信用研究员，长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理等职务。
乔林建	本基金基金经理。	2016 年 1 月 20 日	2017 年 5 月 18 日	14 年	乔林建先生，1976 年 1 月出生。经济学硕士。历任新华人寿保险公司研究员、投资经理，新华资产管理公司高级投资经理，建信基金管理公司资

					深投资经理、基金经理助理、基金经理。2015年6月加入长盛基金管理有限公司，曾任权益投资部执行总监。
--	--	--	--	--	--

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

回顾 2017 年全年，GDP 实际同比增速达到 6.9%，为近年来经济增速的首次反弹；强于年初政府工作报告目标，也强于市场预期，17 年国内经济显示出超预期的较强韧性。全年海外经济复苏拉动进出口，国内供给侧改革及环保限产改善企业利润，房地产去库存拉动上下游产业链，消费保持较强水平，经济整体显示出较为强劲的内生动力。2017 年海外发达经济体整体向好，全球经济温和复苏，全球范围内宽松货币政策力度逐渐减弱。

债券市场全年持续调整，债券收益率整体上行幅度较大。2017 年债市继 2016 年末之后继续大幅调整，在经济基本面较强、资金面中性偏紧和监管调控政策不断强化等因素综合影响下，债市收益率分别在 4-5 月、9-10 月出现大幅上行，四季度也基本维持在高位震荡态势。在“去杠杆”政策下，央行持续抬升政策利率，增大波动水平，并控制流动性投放量，期限错配放大杠杆的行为不再能够获得稳定正收益。

A 股市场整体回暖，结构性行情显著。2017 年全年上证综指上涨 6.56%，沪深 300 指数上涨 21.78%，创业板指下跌 10.67%。养老金入市、境外投资者入场等新形势下，A 股投资逻辑出现一定变化。股市分化明显，结构性行情全年持续发展，业绩优异的白马股、消费股、绩优蓝筹股显著跑赢市场，保险、家电、食品饮料等板块有不错的表现。优质白马股受到市场追捧，而一部分市值较小、基本面较差的股票在大幅下跌的同时，成交量也出现大幅萎缩。

转债市场方面，信用申购新规施行后，10 月以来转债发行大幅提速，目前存量规模已经超过 1500 亿。供给节奏的变化和权益市场波动的共同影响下，转债市场的整体溢价率在 5-6 月和 11-12 月为年内低点；随着市场的逐步扩容，存量券及待发个券中不乏行业龙头及优质标的，预计后续

转债市场也有一定的结构性机会。

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，重点配置中短期利率债及高等级信用债，保持组合流动性。权益资产方面，根据市场风格变化，灵活调整权益资产比重，以避免净值大幅波动，择机参与较长久期利率品种的投资机会，提升组合收益；精选具备估值优势和业绩成长潜力的股票和可转债，择机进行波段操作，提升组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，长盛同禧债券 A 的基金份额净值为 1.014 元，本报告期份额净值增长率为 0.03%，同期业绩比较基准增长率为 0.02%。

截止报告期末，长盛同禧债券 C 的基金份额净值为 1.009 元，本报告期份额净值增长率为 -0.80%，同期业绩比较基准增长率为 0.02%。

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 2018 年，国内宏观经济韧性较强，供给侧改革进一步深入，消费对 GDP 增长贡献率逐步提升，环保限产下大中企业盈利持续改善，虽然年初监管机构密集出台监管政策，但在旧城棚户区改造及基建投资托底下预计经济增速不会出现断崖式下跌，转型升级是否能够顺利进行对中国经济至关重要。通胀方面，猪肉价格出现回升，CPI 非食品项持续走高，通胀预期有所抬头。受汇率、资产价格以及政策防风险等因素制约，货币政策更趋于稳健中性。全球主要海外经济体经济温和复苏，通胀有所分化。

债券市场方面，在海内外经济和政策等多重因素影响下，预计债券收益率将维持高位震荡，“严监管、去杠杆”的监管大环境叠加稳健中性货币政策仍将制约市场收益率趋势下行，通胀预期抬头、海外市场减税加息也会对债市形成一定利空；但当前债市的绝对收益水平已具备一定的配置价值，同时可以关注经济基本面再次转弱等因素也会带来交易性机会。信用债配置方面，企业盈利分化下预计部分民企及中小企业信用风险将上升，将继续严控信用风险，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；金融去杠杆对中低评级信用债更为不利，因此以中高评级中短久期信用债作为主要配置方向。

股市方面，养老金入市、境外投资者入场等新形势带来权益市场投资逻辑的变化，预计业绩为王的结构性机会仍将持续，重点关注基本面持续改善、低估值高分红的大金融板块，环保限产带来盈利改善的周期性行业、满足人民美好生活需求的消费升级行业以及 5G 通信、半导体、创新药等科技主题机会。积极抓住权益市场机会，提升组合收益。但也需警惕国内经济增长低于预期、美国加息及税改对全球经济带来的不确定性等多重因素对资本市场的扰动。

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央国债登记结算有限责任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，本基金于 2017 年 8 月 8 日对 2017 年度收益进行了利润分配，分配总金额 2,474,145,564.18 元（其中：长盛同禧债券 A 分配金额为 2,296,341,141.12 元，长盛同禧债券 C 分配金额为 177,804,423.06 元）。

本基金截至 2017 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 1,436,559.95 元，其中：长盛同禧债券 A 期末可供分配利润为 678,913.00 元（长盛同禧债券 A 的未分配利润已实现部分为 1,022,242.41 元，未分配利润未实现部分为-343,329.41 元），长盛同禧债券 C 期末可供分配利润为 757,646.95 元（长盛同禧债券 C 的未分配利润已实现部分为 1,577,848.04 元，未分配利润未实现部分为-820,201.09 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

本基金自 2017 年 3 月 8 日至 2017 年 5 月 17 日、自 2017 年 5 月 22 日至 2017 年 7 月 27 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 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”）在长盛同禧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 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师徐艳、马剑英 2018 年 3 月 27 日对本基金 2017 年 12 月 31 日的资产负债表和 2017 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（2018）审字第 60468688_A06 号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：长盛同禧债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	944,262.93	37,914,361.37
结算备付金	1,568,926.21	2,395,639.35
存出保证金	10,724.96	31,776.46
交易性金融资产	134,813,756.45	267,504,927.90
其中：股票投资	8,636,652.65	23,145,968.00
基金投资	-	-
债券投资	126,177,103.80	244,358,959.90
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	29,855,235.07	-
应收利息	2,288,113.31	4,352,407.08
应收股利	-	-
应收申购款	410.00	397.46
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	169,481,428.93	312,199,509.62
负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 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	1,800,000.00	1,000,000.00
应付证券清算款	-	4,652,337.26
应付赎回款	30,269,700.00	629.89
应付管理人报酬	104,344.38	196,129.32
应付托管费	27,825.15	52,301.15
应付销售服务费	29,284.62	1,383.05
应付交易费用	41,962.47	39,395.84
应交税费	126,797.56	126,797.56

应付利息	-	27.78
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	365,411.59	162,686.96
负债合计	32,765,325.77	6,231,688.81
所有者权益：		
实收基金	135,279,543.21	231,369,249.95
未分配利润	1,436,559.95	74,598,570.86
所有者权益合计	136,716,103.16	305,967,820.81
负债和所有者权益总计	169,481,428.93	312,199,509.62

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，长盛同禧债券 A 类基金份额净值人民币 1.014 元，长盛同禧债券 C 类基金份额净值人民币 1.009 元；基金份额总额 135,279,543.21 份，其中长盛同禧债券 A 类基金份额 49,655,646.54 份，长盛同禧债券 C 类基金份额 85,623,896.67 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛同禧债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
一、收入	11,435,266.54	-62,703.25
1.利息收入	15,372,374.10	15,620,633.88
其中：存款利息收入	1,411,067.45	179,359.22
债券利息收入	12,765,742.93	15,351,526.52
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,195,563.72	89,748.14
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-8,929,030.32	-12,995,089.33
其中：股票投资收益	338,605.16	-614,001.92
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-9,267,635.48	-12,553,501.71
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	-	172,414.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,839,997.14	-2,750,331.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,151,925.62	62,083.92

减：二、费用	4,748,527.24	6,352,744.08
1. 管理人报酬	2,960,080.61	3,013,052.59
2. 托管费	789,354.73	803,480.63
3. 销售服务费	287,724.57	20,639.48
4. 交易费用	214,277.97	355,426.40
5. 利息支出	105,616.09	1,902,615.81
其中：卖出回购金融资产支出	105,616.09	1,902,615.81
6. 其他费用	391,473.27	257,529.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	6,686,739.30	-6,415,447.33
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	6,686,739.30	-6,415,447.33

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同禧债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	231,369,249.95	74,598,570.86	305,967,820.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,686,739.30	6,686,739.30
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）	-96,089,706.74	2,394,296,813.97	2,298,207,107.23
其中：1. 基金申购款	8,100,088,101.52	2,611,598,656.79	10,711,686,758.31
2. 基金赎回款	-8,196,177,808.26	-217,301,842.82	-8,413,479,651.08
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）	-	-2,474,145,564.18	-2,474,145,564.18
五、期末所有者权益（基金净值）	135,279,543.21	1,436,559.95	136,716,103.16
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		

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,对于持有期限不少于 30 日的该类别基金份额不收取赎回费。

本基金的基金管理人和注册登记机构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《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及基金合同的有关规定,并报中国证监会备案,自 2016 年 9 月 13 日起,本基金名称由“长盛同禧信用增利债券型证券投资基金”更名为“长盛同禧债券型证券投资基金”。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、国债期货、资产支持证券、权证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(但需符合中国证监会相关规定)。本基金主要投资国债、央行票据、金融债(含政策性金融债)、企业债、公司债、短期融资券、地方政府债、正回购、逆回购、可转换公司债券(含可分离交易的可转换债券)、中小企业私募债、银行存款、同业存单,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。本基金投资于债券的资产比例不低于基金资产的 80%。本基金还可参与一级市场新股申购或增发新股、持有可转债转股所得的股票、投资二级市场股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它权益类金融工具,但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%,其中权证的投资比例不高于基金资产净值的 3%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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%。如法律法规或中国证监会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。本基金的业绩比较基准为: $40\% \times$ 中证国债指数收益率 $+60\% \times$ 中证企业债指数收益率。

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(以下合称“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。

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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 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，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、地方政府债券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。

7.4.6.3 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利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、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
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
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

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,960,080.61	3,013,052.59
其中：支付销售机构的客户维护费	57,253.09	59,713.67

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 0.75% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% / \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	789,354.73	803,480.63

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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		
	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		
	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C	合计
中国银行	-	5,890.50	5,890.50
长盛基金管理有限公司	-	244,916.27	244,916.27
国元证券	-	0.30	0.30

合计	-	250,807.07	250,807.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C	合计
中国银行	-	8,745.55	8,745.55
长盛基金管理有限公司	-	1,113.19	1,113.19
合计	-	9,858.74	9,858.74

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

7.4.8.3 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 2017年1月1日至2017年12月31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	547,101,915.62	-	-	-	-	-
合计	547,101,915.62	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31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	22,064,326.67	-	-	-	-	-
合计	22,064,326.67	-	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31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	944,262.93	1,008,347.90	37,914,361.37	129,835.95

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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本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 1,800,000.00 元，于 2018 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的质押式回购下转入质押库的债券，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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**7.4.10.1 公允价值**

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 10,617,223.85 元，属于第二层次的余额为人民币 124,196,532.60 元，无属于第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次人民币 31,049,057.90 元，第二层次人民币 236,455,870.00 元，无属于第三层次的余额）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（2016 年：无）。

7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.10.3 其他事项

注：于本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元的情况，出现该情况的时间范围为 2017 年 3 月 8 日至 2017 年 5 月 17 日以及 2017 年 5 月 22 日至 2017 年 7 月 27 日。

7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	8,636,652.65	5.10
	其中：股票	8,636,652.65	5.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	126,177,103.80	74.45
	其中：债券	126,177,103.80	74.45
	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	2,513,189.14	1.48
8	其他各项资产	32,154,483.34	18.97
9	合计	169,481,428.93	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	2,108,052.65	1.54
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	6,528,600.00	4.78
K	房地产业	-	-
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	8,636,652.65	6.32

8.2.2 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。

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601336	新华保险	93,000	6,528,600.00	4.78
2	600754	锦江股份	65,285	2,108,052.65	1.54

注：本基金本报告期末仅持有上述两只股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600297	广汇汽车	8,468,163.50	2.77
2	601336	新华保险	5,933,335.78	1.94
3	002236	大华股份	5,650,704.06	1.85
4	000998	隆平高科	4,980,668.54	1.63
5	002573	清新环境	4,590,859.86	1.50
6	600856	中天能源	4,309,732.47	1.41
7	002500	山西证券	2,615,244.00	0.85
8	600754	锦江股份	2,165,708.95	0.71
9	000725	京东方 A	1,614,500.00	0.53
10	000783	长江证券	1,356,800.00	0.44
11	603589	口子窖	807,154.00	0.26
12	600050	中国联通	771,000.00	0.25
13	002258	利尔化学	736,722.00	0.24
14	000597	东北制药	619,396.00	0.20
15	300496	中科创达	586,472.00	0.19

16	600029	南方航空	455,000.00	0.15
17	600406	国电南瑞	420,143.00	0.14
18	002365	永安药业	375,380.00	0.12
19	300145	中金环境	324,700.00	0.11
20	300418	昆仑万维	303,350.00	0.10

8.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600048	保利地产	14,199,805.18	4.64
2	000858	五粮液	11,020,935.00	3.60
3	600297	广汇汽车	8,456,799.19	2.76
4	002236	大华股份	5,086,292.80	1.66
5	000998	隆平高科	4,935,224.10	1.61
6	002573	清新环境	4,809,996.00	1.57
7	600856	中天能源	4,277,222.32	1.40
8	002500	山西证券	2,468,277.00	0.81
9	000725	京东方 A	1,353,450.00	0.44
10	000783	长江证券	1,330,594.00	0.43
11	603589	口子窖	789,398.00	0.26
12	600050	中国联通	781,000.00	0.26
13	002258	利尔化学	673,579.00	0.22
14	300496	中科创达	622,708.00	0.20
15	000597	东北制药	594,500.00	0.19
16	600029	南方航空	446,000.00	0.15
17	600406	国电南瑞	379,940.00	0.12
18	002365	永安药业	361,533.00	0.12
19	300418	昆仑万维	299,550.00	0.10
20	300145	中金环境	286,670.00	0.09

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	47,754,818.16
卖出股票收入（成交）总额	63,826,123.59

注：本项中 8.4.1、8.4.2 和 8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	10,064,250.00	7.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	42,625,879.60	31.18
	其中：政策性金融债	42,625,879.60	31.18
4	企业债券	11,346,403.00	8.30
5	企业短期融资券	50,121,000.00	36.66
6	中期票据	10,039,000.00	7.34
7	可转债（可交换债）	1,980,571.20	1.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	126,177,103.80	92.29

8.6 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	108601	国开 1703	227,820	22,731,879.60	16.63
2	170410	17 农发 10	200,000	19,894,000.00	14.55
3	010303	03 国债(3)	105,000	10,064,250.00	7.36
4	011760048	17 鲁能源 SCP001	100,000	10,064,000.00	7.36
5	122366	14 武钢债	101,000	10,042,430.00	7.35

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.10.3 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1

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。

8.11.2

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。

8.11.3 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	10,724.96
2	应收证券清算款	29,855,235.07
3	应收股利	-
4	应收利息	2,288,113.31
5	应收申购款	410.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,154,483.34

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	521,850.00	0.38
2	120001	16 以岭 EB	208,880.00	0.15

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.11.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
长盛同禧债券 A	200	248,278.23	45,416,841.76	91.46%	4,238,804.78	8.54%
长盛同禧债券 C	191	448,292.65	83,800,623.06	97.87%	1,823,273.61	2.13%
合计	391	345,983.49	129,217,464.82	95.52%	6,062,078.39	4.48%

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。

9.2 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	长盛同禧债券 A	32,781.84	0.0660%
	长盛同禧债券 C	0.00	0.0000%
	合计	32,781.84	0.0242%

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。

9.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	长盛同禧债券 A	0
	长盛同禧债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛同禧债券 A	0
	长盛同禧债券 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛同禧债券 A	长盛同禧债券 C
基金合同生效日（2011 年 12 月 6 日）基金份额总额	1,919,811,572.88	1,781,049,932.44
本报告期期初基金份额总额	228,366,638.10	3,002,611.85
本报告期基金总申购份额	7,430,491,946.44	669,596,155.08
减:本报告期基金总赎回份额	7,609,202,938.00	586,974,870.26
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	49,655,646.54	85,623,896.67

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

由于任期届满，高新不再担任公司董事长，周放生不再担任公司独立董事。根据公司 2016 年度股东会议决议，选举林培富为公司董事，选举张良庆为公司独立董事；根据公司第七届董事会第一次会议决议，选举周兵担任公司董事长；根据公司第七届董事会第二次会议决议，聘任林培富担任公司总经理，周兵不再担任公司总经理，同时林培富不再担任公司副总经理。以上公司高级管理人员变更，已于 2017 年 3 月 30 日向中国证监会北京监管局报备。

根据公司 2017 年第一次临时股东会议决议，同意张良庆先生不再担任公司第七届董事会独立董事职务，选举朱慈蕴女士担任公司第七届董事会独立董事。以上独立董事人员变更，已于 2018 年 1 月 9 日向中国证监会北京监管局报备。

11.2.2 基金经理的变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2017 年 5 月 18 日起，乔林建同志不再担任长盛同禧债券型证券投资基金基金经理。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

11.5 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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元，已连续提供审计服务 6 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
华创证券		157,992,705.36	51.97%	54,008.44	51.97%	-
宏源证券		153,588,236.39	48.03%	49,906.65	48.03%	-

11.7.2 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
华创证券	26,797,429.45	12.95%	196,900,000.00	21.89%	-	-
宏源证券	180,208,365.71	87.05%	702,700,000.00	78.11%	-	-

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要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

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、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：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2017 年 7 月 28 日至 2017 年 8 月 2 日及 2017 年 8 月 14 日至 2017 年 8 月 14 日	0.00	678,730,769.23	678,730,769.23	0.00	0.00%
	2	2017 年 8 月 29 日至 2017 年 9 月 11 日	0.00	150,828,808.45	150,828,808.45	0.00	0.00%
	3	2017 年 7 月 28 日至 2017 年 7 月 30 日	0.00	155,763,239.88	155,763,239.88	0.00	0.00%
	4	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 3 月 7 日	223,714,397.74	0.00	223,714,397.74	0.00	0.00%
	5	2017 年 8 月 15 日至 2017 年 8 月 16 日	0.00	444,944,947.21	444,944,947.21	0.00	0.00%
	6	2017 年 8 月 31 日至 2017 年 12 月 31 日	0.00	83,800,623.06	0.00	83,800,623.06	61.95%
	7	2017 年 8 月 31 日至 2017 年 12 月 31 日	0.00	75,414,027.15	30,000,000.00	45,414,027.15	33.57%
	8	2017 年 8 月 2 日至 2017 年 8 月 2 日及 2017 年 8 月 11 日至 2017 年 8 月 13 日	0.00	754,146,304.68	754,146,304.68	0.00	0.00%
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>							

12.2 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

2018 年 3 月 31 日