

长盛同智优势成长混合型证券投资基金
(LOF)
2016年第3季度报告

2016年9月30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

报告送出日期：2016年10月24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2016年10月21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2016年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 长盛同智优势混合（LOF） |
| 场内简称 | 长盛同智 |
| 基金主代码 | 160805 |
| 交易代码 | 160805 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007年1月5日 |
| 报告期末基金份额总额 | 913,318,299.01份 |
| 投资目标 | 主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司，所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。 |
| 投资策略 | 本基金为主动管理的混合型基金，对各类资产采取适度灵活的资产配置。主要选股思路是采用自上而下的路径，投资策略上偏重选股能力的发挥。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金是较高预期收益-较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。 |
| 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 |

§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（2016年7月1日—2016年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -15,781,256.99 |
| 2. 本期利润 | -19,955,787.09 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0217 |
| 4. 期末基金资产净值 | 760,304,412.89 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.8325 |

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、所列数据截止到2016年9月30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。

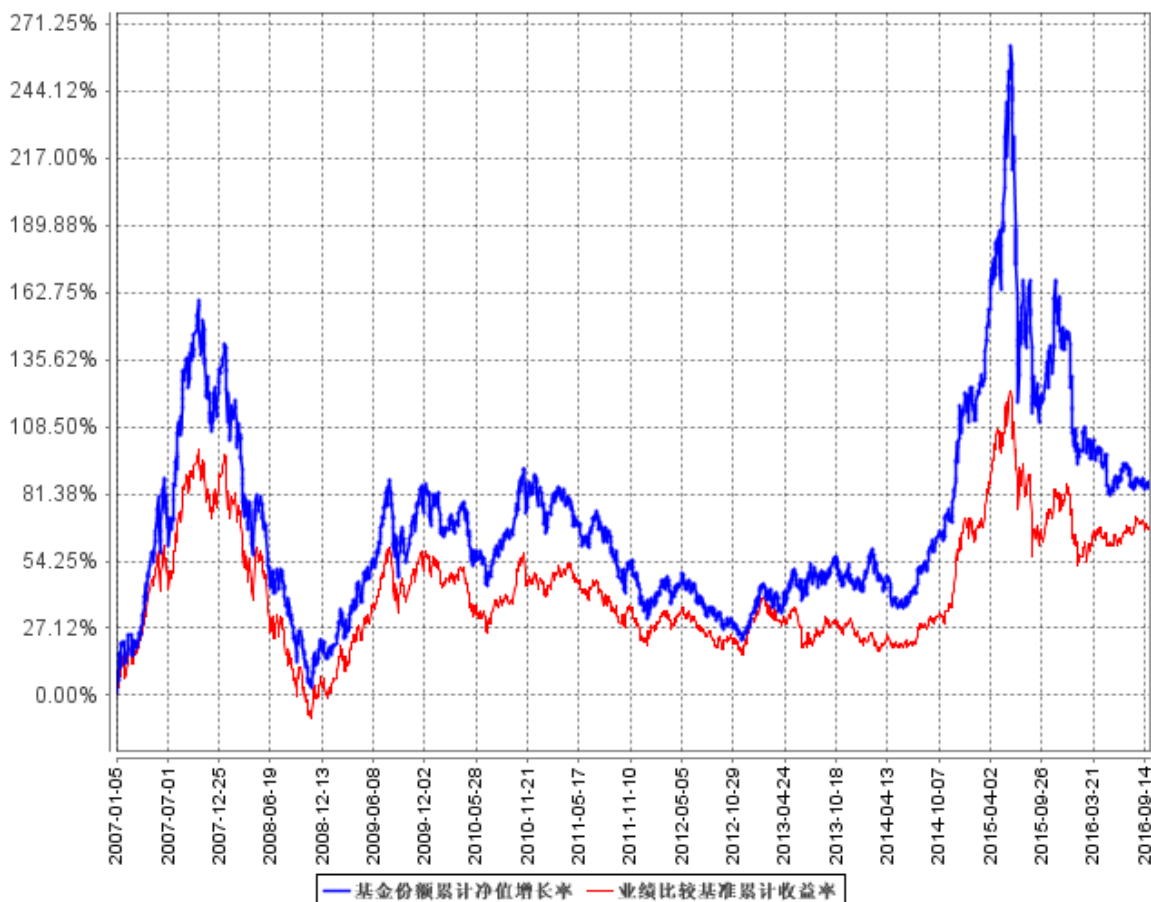
3.2 基金净值表现

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 | -2.53% | 0.70% | 2.50% | 0.52% | -5.03% | 0.18% |

3.2.2 自基金转型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

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：1、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 日。

2、按基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 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十五条（二）投资范围、（六）投资限制的有关约定。本报告期内，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 | | |
| 吴博文 | 本基金基金经理，长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金 | 2016 年 1 月 6 日 | - | 8 年 | 男，1983 年 6 月出生，中国国籍。毕业于北京大学，金融学硕士。历任雷曼兄弟证券股份有限公司分析师助理，野村 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | (LOF) 基金经理, 长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理, 长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 | | | | 证券股份有限公司分析师助理, 诺安基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。2015年8月加入长盛基金管理有限公司, 现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF, 本基金)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, 长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理, 长盛国企改革主题灵活配置混合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。

公司对过去4个季度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

三季度整体市场处于震荡格局，传统板块相对强势，围绕着房地产行业的建材、家电、建筑、以及地产自身板块涨幅领跑各个行业。6月份英国脱欧公投等一系列风险事件落地后，7月份市场展开了一小波反弹，仍然是上半年受捧的食品饮料、家电、医药等板块领涨市场。7月份重要的事件是监管层出台更加严格的政策，包括更严的借壳标准，加上银行理财分类监管等新政，市场的风险偏好被抑制。8月份是整个三季度行情最好的一个月份，市场的关注点转移到了PPP政府项目上。背后的主线逻辑是国家继续深化推进的供给侧改革去产能和保基建投资之间的平衡，地产，建材，建筑，环保等板块涨幅超额收益明显。9月份市场交投清淡，投资者情绪谨慎保守，家电，建材等板块有少许超额收益。

本基金整体在三季度操作谨慎，仓位始终保持相对较低位置。在标的的选择上我们把注意力集中到电子类公司和少数稳健行业的龙头公司上。在预期市场清淡的前提下，逐渐把仓位集中到少数有长期成长的龙头公司上。目前市场整体处在板块估值的均衡状态，各个板块之间的性价比较为一致，没有明显的差异，在等待市场给出定价偏离的机会之前，我们把仓位集中到少数公司。三季度本基金涨幅-2.53%，跑输基准。

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0.8325元，本报告期份额净值增长率为-2.53%，同期本基金业绩比较基准收益率为2.50%。

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 | 379,604,106.72 | 49.58 |
| | 其中：股票 | 379,604,106.72 | 49.58 |
| 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 | - | - |
| | 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 | 385,275,409.01 | 50.32 |
| 8 | 其他资产 | 803,043.82 | 0.10 |
| 9 | 合计 | 765,682,559.55 | 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 | 336,575,203.55 | 44.27 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 136,910.48 | 0.02 |
| E | 建筑业 | 4,497,889.74 | 0.59 |
| F | 批发和零售业 | 1,648,947.63 | 0.22 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,381,000.00 | 0.18 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 12,491,512.12 | 1.64 |
| J | 金融业 | 347,298.76 | 0.05 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 13,578,810.59 | 1.79 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 8,946,533.85 | 1.18 |
| 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 | 379,604,106.72 | 49.93 |

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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

| 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 | 600703 | 三安光电 | 2,513,980 | 30,192,899.80 | 3.97 |
| 2 | 000049 | 德赛电池 | 698,260 | 28,977,790.00 | 3.81 |
| 3 | 300408 | 三环集团 | 1,144,020 | 21,198,690.60 | 2.79 |
| 4 | 002179 | 中航光电 | 511,733 | 20,653,543.88 | 2.72 |
| 5 | 300207 | 欣旺达 | 1,299,282 | 20,073,906.90 | 2.64 |
| 6 | 300136 | 信维通信 | 750,106 | 19,150,206.18 | 2.52 |
| 7 | 002367 | 康力电梯 | 1,149,581 | 16,990,807.18 | 2.23 |
| 8 | 000887 | 中鼎股份 | 657,000 | 15,866,550.00 | 2.09 |
| 9 | 603168 | 莎普爱思 | 363,563 | 14,858,819.81 | 1.95 |
| 10 | 603766 | 隆鑫通用 | 731,638 | 14,596,178.10 | 1.92 |

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

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 | 711,609.70 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 70,620.13 |
| 5 | 应收申购款 | 20,813.99 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 803,043.82 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金报告期末未持有可转换债券。

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：本基金本报告期末前十名股票中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 | 926,943,934.31 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,783,331.24 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 18,408,966.54 |
| 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 | 913,318,299.01 |

§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 备查文件目录**8.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会关于核准同智证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复；
- 3、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 4、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 6、法律意见书；
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照；

8、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金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
2016 年 10 月 24 日