

长盛同智优势成长混合型证券投资基金 (LOF) 2016 年第 4 季度报告

2016 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

报告送出日期：2017 年 1 月 21 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 2017 年 1 月 20 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 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	890,349,173.49 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10月1日—2016年12月31日）
1. 本期已实现收益	-1,955,270.07
2. 本期利润	-4,287,867.91
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0048
4. 期末基金资产净值	736,823,829.95
5. 期末基金份额净值	0.8276

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。

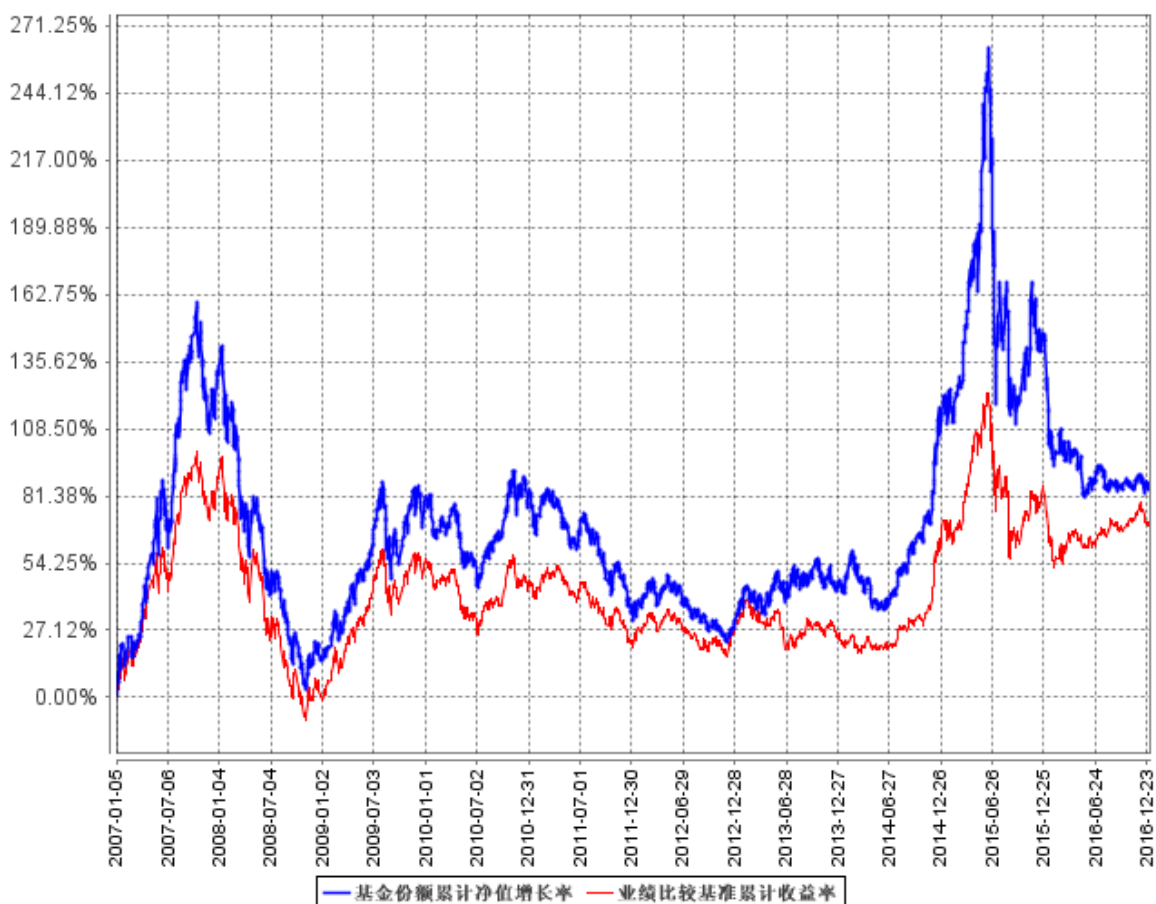
3.2 基金净值表现

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	-0.59%	0.58%	1.20%	0.47%	-1.79%	0.11%

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）投资禁止行为与限制的有关约定。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（LOF）基金经	2016 年 1 月 6 日	-	9 年	吴博文先生，1983 年 6 月出生。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，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。				理，野村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。
--	--	--	--	--	--

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

2016 年四季度整体行情是全年波动性较大的一个季度，10 月和 11 月市场在保险股举牌和油价复苏两条主线的带动下，接连创出新高，指数整体上涨了约 10%；但进入 12 月份以来受监管层的影响，市场进入快速下跌的阶段，到 12 月底的时候指数几乎回到 9 月底的位置。

本基金在 10 月初布局军工，油服等板块，但仓位较低，收效一般；低估值成长股继续受到整体环境压抑，因此 10 月 11 月跑输指数；11 月份我们关注到周期品种当中农产品处于长周期底部，具备反转的可能性，开始重点布局农业板块。在 12 月的时候，国家最高层面包括政治局会议，中央经济工作会议等都先后提到要把农业供给侧改革提到一个非常重要的高度上，我们提前布局的板块受到了效用，在 12 月份整体市场下跌的情形下，我们的农业板块对整体净值起到了稳定的作用。四季度净值增长-0.58%，跑输基准 1.73%。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 0.8276 元，本报告期份额净值增长率为-0.59%，同期业绩比较基准增长率为 1.20%。

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	548,399,329.52	72.51
	其中：股票	548,399,329.52	72.51
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	207,324,328.46	27.41
8	其他资产	632,063.54	0.08
9	合计	756,355,721.52	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	62,821,875.23	8.53
B	采矿业	3,980,114.43	0.54
C	制造业	383,975,584.93	52.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,356,497.00	1.68
E	建筑业	21,492,658.07	2.92
F	批发和零售业	25,123,001.16	3.41
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	583,970.35	0.08
J	金融业	1,719,691.62	0.23
K	房地产业	7,951,358.00	1.08
L	租赁和商务服务业	15,133,966.65	2.05
M	科学研究和技术服务业	137,744.40	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	13,113,409.00	1.78
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	548,399,329.52	74.43

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	3,765,780	50,423,794.20	6.84
2	000425	徐工机械	11,929,200	40,320,696.00	5.47
3	600031	三一重工	5,337,971	32,561,623.10	4.42
4	000998	隆平高科	1,492,061	31,974,867.23	4.34
5	600737	中粮屯河	1,844,300	22,979,978.00	3.12
6	600873	梅花生物	3,410,100	22,233,852.00	3.02
7	000930	中粮生化	1,367,000	18,372,480.00	2.49
8	002353	杰瑞股份	857,387	17,404,956.10	2.36
9	000860	顺鑫农业	705,000	15,510,000.00	2.10
10	600057	象屿股份	1,301,100	14,962,650.00	2.03

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	485,935.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	42,448.40
5	应收申购款	103,679.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	632,063.54

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	913,318,299.01
报告期期间基金总申购份额	1,895,385.17
减：报告期期间基金总赎回份额	24,864,510.69
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	890,349,173.49

§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
2017 年 1 月 21 日