

长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
2016 年年度报告 摘要

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 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 2016 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	长盛同益成长回报混合（LOF）
场内简称	长盛同益
基金主代码	160812
交易代码	160812
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 4 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	153,554,099.79 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 6 月 4 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过自上而下筛选增长预期良好或景气复苏的行业，结合挖掘目标行业的上市公司基本面，自下而上精选个股，为投资者实现资产长期增值，力争获得绝对回报。
投资策略	<p>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、股指期货、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。</p> <p>股票投资策略上，本基金将充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，采用定性和定量相结合的方式，以深入的基本面研究为基础，结合数据挖掘技术，密切跟踪市场景气变化，挖掘具有快速成长预期、且估值相对较低的个股进行投资，并通过对股票投资机会的精细操作，审慎选择投资时机，力争获取正回报。本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>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。利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，在市场向下带动净值走低时，通过股指期货快速降低投资组合的仓位，从而调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特性；并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时，通过股指期货快速提高投资组合的仓位，从而提高基金</p>

	资产收益。本基金的权证投资是以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。
业绩比较基准	50%*沪深300指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

## 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	郭明
	联系电话	010-82019988	010-66105799
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95588
传真		010-82255988	010-66105798

## 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	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## §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	2016年	2015年	2014年4月4日 (基金合同生效日)– 2014年12月31日
本期已实现收益	-25,168,387.12	387,121,654.74	426,534,569.37
本期利润	-48,366,796.53	237,930,602.51	574,231,458.35
加权平均基金份额本期利润	-0.2919	0.6528	0.3577
本期基金份额净值增长率	-16.23%	17.55%	43.60%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.4143	0.6890	0.3420
期末基金资产净值	217,055,249.67	297,883,643.88	1,256,202,000.90
期末基金份额净值	1.414	1.688	1.436

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。

## 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

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	-2.82%	0.62%	0.19%	0.38%	-3.01%	0.24%
过去六个月	2.91%	0.75%	2.80%	0.39%	0.11%	0.36%
过去一年	-16.23%	1.30%	-4.24%	0.70%	-11.99%	0.60%
自基金转型起至今	40.25%	1.72%	38.21%	0.92%	2.04%	0.80%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

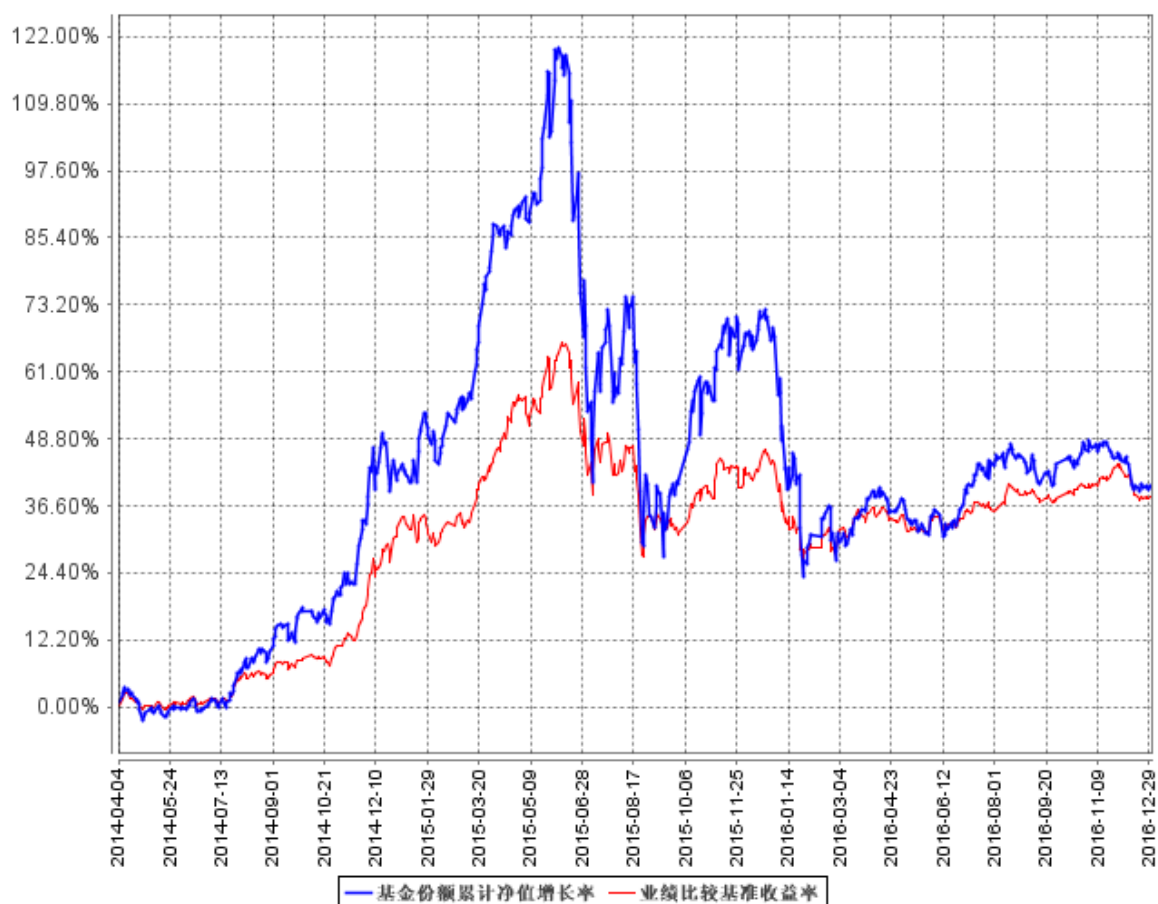
本基金业绩比较基准：50%\*沪深 300 指数收益率+50%\*中证综合债指数收益率

基准指数的构建考虑了三个原则：

- 1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证全债指数。目前沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准较为合适。
- 2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金股票投资占基金资产的比例为 0%–95%；根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可使业绩比较更具有合理性。
- 3、再平衡。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 50%、50%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 自基金转型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

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

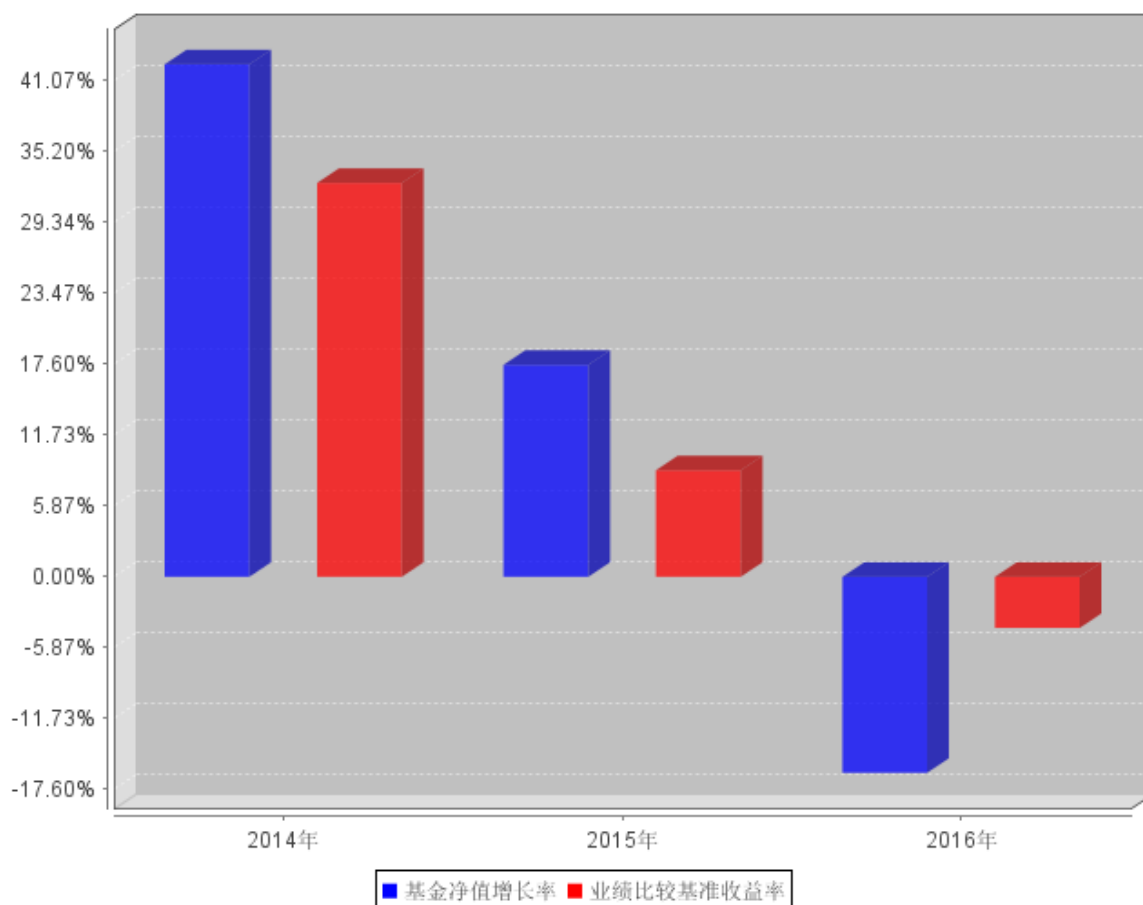


注：1、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同益证券投资基金转型而来，转型日期为2014年4月4日（即基金合同生效日）。

2、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基金合同第十二部分“二、投资范围”和“四、投资限制”的有关约定。

### 3.2.3 自基金转型以来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

自基金合同生效以来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



注：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）合同于2014年4月4日生效，合同生效当年按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于2016年度、2015年度、2014年度会计期间未进行利润分配。

## §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（以下简称“国元证券”）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 2016 年 12 月 31 日，基金管理人共管理五十七只开放式基金，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		
刘旭明	本基金基金经理，长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛养老健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛转型升级主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，研究部总监。	2015 年 4 月 27 日	-	15 年	刘旭明先生，1977 年 5 月出生。清华大学管理学硕士。曾任中信证券研究部首席分析师、国信证券经济研究所首席分析师。2013 年 7 月加入长盛基金管理有限公司。
张谊然	本基金基金经理助理，研究部总监助理。	2015 年 6 月 16 日	-	7 年	女，1985 年 5 月出生，中国国籍。英国约克大学硕士。2012 年 9 月加入长盛基金管理有限公司。

注：1、上表基金经理及基金经理助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

2016 年市场总体下跌，上证指数下跌 12.31%，创业板指数下跌 27.71%，节奏上，一月份市场受到减持、熔断和汇率的影响大幅下跌，多次出现千股跌停，后面市场开始了震荡攀升的慢牛行情，年底有所回落。二月份市场开始筑底反弹，期间震荡反复，各种投资逻辑均有所表现，先是在货币放水和周期品涨价带动下周期行业率先反弹，带动市场筑底企稳，两会期间政策暖风频吹，市场风险偏好有所增加，先是房地产行业大幅上涨，随后创业板接力，大幅反弹，带动市场活跃度提高。进入二季度，市场前期憧憬的货币放水逐步得到证伪，通胀的担忧逐步缓解，周期股的表现略显疲弱，市场开始寻找新的主题，锂电池、OLED、芯片国产化、物联网、次新股等主题表现较为活跃，带动市场情绪。进入三季度，在政府为稳增长大力推动 PPP，同时房地产市场高涨，周期股表现强劲，建筑建材、家电、房地产、钢铁、等表现较好。同时市场的风险偏好有一定的恢复，PPP、装饰园林、参股金融、次新股、石墨烯等概念表现较好。四季度市场迎来了基本面和改革因素的共振，市场一度攀升至 3300 点，由 PMI、PPI 代表的经济数据显示企业补库存带来价格上升和盈利的增加，受到保险举牌的影响，建筑板块大象起舞带动了市场行情。整体来看，贯穿 2016 年的线索未股权转让、PPP、国企混改等主题，食品饮料、家用电器、建筑装饰等低估值蓝筹股涨幅靠前。

2016 年年初基于对市场熊市调整的判断，整体仓位水平控制在中低水平，有效避免了 1 月及 4 月份的市场系统性风险。在市场大跌后，2 月初及 5 月底及时提高仓位，获取一定收益，但仓位仍低影响业绩实现。3 季度个股选择及风格配置方面大幅减仓成长股，业绩明显回升。4 季度保险资金操作导致资本市场异常震荡，基于对市场各方因素的谨慎判断，基金操作相对较为谨慎，因此业绩表现差于沪深 300 指数。基金全年业绩弱于市场及基准。

在灵活、有效调整仓位的同时，注重对持仓结构的优化。在经济环境不稳，熊市震荡期间，注重自下而上挖掘个股价值，及时跟踪公司动态。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，长盛同益成长回报混合（LOF）份额净值为 1.414 元，本报告期份

额净值增长率为-16.23%，同期业绩比较基准增长率为-4.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球经济喜忧参半，美欧日经济政策和货币政策不同步，导致金融市场动荡，黑天鹅事件仍需关注。2017年国内经济仍将在合理区间运行，下半年经济压力略大，财政政策、PPP等“稳增长”措施将托底。“去杠杆”是2017年的重点工作，货币政策将保持稳健，最终实现“脱虚向实”。各项改革措施将逐步落地，经济转型将带来相应板块的投资机遇。2015年A股高点回落后已充分调整，2017年将震荡上行。

#### 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（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，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《证券投资基金运作管理办法》的规定以及《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资

资基金（LOF）基金合同》第十六条中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期未实施利润分配。本基金截至 2016 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 63,615,791.25 元，其中：未分配利润已实现部分为 125,043,342.18 元，未分配利润未实现部分为-61,427,550.93 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**

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

## **§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，本基金托管人在对长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### **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，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的管理人——长盛基金管理有限公司在长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

### **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**

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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）注册会计师汤骏、马剑英 2017 年 3 月 22 日对本基金 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注出具了安永华明（2017）审字第 60468688\_A12 号标准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：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	62,063,074.49	72,290,266.89
结算备付金	202,121.01	588,516.58
存出保证金	53,820.23	278,650.17
交易性金融资产	158,521,071.10	232,957,389.96
其中：股票投资	158,521,071.10	232,957,389.96
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	-
应收利息	10,726.05	15,352.97
应收股利	-	-
应收申购款	99.85	1,198.20
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	220,850,912.73	306,131,374.77
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负债：</b>		
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	-	-
应付证券清算款	1,593,283.34	5,719,498.44
应付赎回款	38,108.03	77,378.53
应付管理人报酬	279,737.60	394,833.31
应付托管费	46,622.94	65,805.57
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	132,972.69	290,128.59
应交税费	815,699.68	815,699.68

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	889,238.78	884,386.77
负债合计	3,795,663.06	8,247,730.89
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	153,439,458.42	176,312,636.05
未分配利润	63,615,791.25	121,571,007.83
所有者权益合计	217,055,249.67	297,883,643.88
负债和所有者权益总计	220,850,912.73	306,131,374.77

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.414 元，基金份额总额为 153,554,099.79 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	-42,816,890.76	256,024,706.19
1. 利息收入	680,202.81	1,659,636.05
其中：存款利息收入	623,640.28	1,100,346.62
债券利息收入	-	559,289.43
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	56,562.53	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-20,338,710.94	402,073,711.11
其中：股票投资收益	-21,510,904.99	397,576,450.72
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	152,250.00
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	1,172,194.05	4,345,010.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-23,198,409.41	-149,191,052.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	40,026.78	1,482,411.26
<b>减：二、费用</b>	5,549,905.77	18,094,103.68
1. 管理人报酬	3,506,927.57	9,228,368.12

2. 托管费	584,487.94	1,538,061.29
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,049,163.26	6,923,638.35
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	409,327.00	404,035.92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-48,366,796.53</b>	<b>237,930,602.51</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-48,366,796.53</b>	<b>237,930,602.51</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	176,312,636.05	121,571,007.83	297,883,643.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-48,366,796.53	-48,366,796.53
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）	-22,873,177.63	-9,588,420.05	-32,461,597.68
其中：1. 基金申购款	4,859,255.09	2,100,745.33	6,960,000.42
2. 基金赎回款	-27,732,432.72	-11,689,165.38	-39,421,598.10
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	153,439,458.42	63,615,791.25	217,055,249.67
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	873,924,822.90	382,277,178.00	1,256,202,000.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	237,930,602.51	237,930,602.51
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）	-697,612,186.85	-498,636,772.68	-1,196,248,959.53
其中：1. 基金申购款	30,560,459.71	20,322,278.99	50,882,738.70
2. 基金赎回款	-728,172,646.56	-518,959,051.67	-1,247,131,698.23
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	176,312,636.05	121,571,007.83	297,883,643.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
周兵

\_\_\_\_\_  
杨思乐

\_\_\_\_\_  
龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同益证券投资基金（以下简称“基金同益”）转型而成。根据基金同益的基金份额持有人大会审议通过的《关于同益证券投资基金转型有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）基金监管部《关于同益证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]150号）及深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2014]118号）的同意，基金同益于2014年4月3日进行终止上市权益登记，2014年4月4日终止上市。自基金同益终止上市之日起，基金同益转型为长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），由《同益证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》、《关于同益证券投资基金转换所得长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额折算的



公告》等相关规定，基金管理人确定 2014 年 5 月 14 日作为基金份额折算基准日。经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算基准日基金份额净值为人民币 1.000821371 元，折算基准日本基金份额净值采用四舍五入的方法保留到小数点后第 9 位。本基金管理人按照 1:

1.000821371 的折算比例对基金同益进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值为人民币 1.000 元，折算后本基金的基金份额数采用截尾的方式保留到整数，所产生的误差归入基金资产。折算前基金同益份额总额为 20 亿份，折算后基金份额总额为 2,001,642,742.00 份。本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2014 年 5 月 16 日对折算后的份额进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2014 年 4 月 14 日至 2014 年 5 月 9 日期间内开放集中申购，集中申购款扣除申购费后的净申购金额为人民币 686,467,684.84 元，折合 686,467,684.84 份基金份额；申购资金在集中申购期间产生的利息为人民币 182,782.70 元，折合 182,782.70 份基金份额；集中申购期间收到的实收基金共计人民币 686,650,467.54 元，折合 686,650,467.54 份基金份额。

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）、股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券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（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构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。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的 0%-95%；其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：50%\*沪深 300 指数收益率+50%\*中证综合债指数收益率

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 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 营业税、增值税

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，继续免征营业税；

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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。

#### 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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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

###### 7.4.8.1.1 股票交易

注：本基金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。

###### 7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金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债券交易。

### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金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债券回购交易。

### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金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权证交易。

### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

## 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 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,506,927.57	9,228,368.12
其中：支付销售机构的客户维护费	121,762.92	104,456.15

注：基金管理费每日计算，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值（扣除超过规定比例现金后的资产净值）

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	584,487.94	1,538,061.29

注：基金托管费每日计算，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	-	21,206,930.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	21,206,930.00
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：1. 本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

2. 基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2016 年 12 月 31 日		2015 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国元证券	4,003,286.00	2.61%	4,003,286.00	2.27%

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

#### 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国工商银行	62,063,074.49	616,909.60	72,290,266.89	1,053,163.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计算。

#### 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

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

### 7.4.9 期末（2016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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,283	23,834.52	23,834.52	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联	2016年	2017	新股流	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-

	新材	12月 26日	2017年 1月 4日	通受限						
300591	万里 马	2016年 12月 30日	2017年 1月 10日	新股流 通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱 信息	2016年 12月 27日	2017年 1月 5日	新股流 通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止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

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

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、应收利息、卖出回购金融资产款、应付证券清算款等，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 158,192,874.45 元，属于第二层次的余额为人民币 328,196.65 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日：第一层次人民币 181,495,562.64 元，第二层次人民币 51,461,827.32 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

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。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，由第一层次转入第二层次的金额为人民币零元（2015 年度：无），由第二层次转入第一层次的金额为人民币 2,244,158.00 元（2015 年度：无）。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（2015 年度：无）。



## 7.4.14.2 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。

## 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 22 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	158,521,071.10	71.78
	其中：股票	158,521,071.10	71.78
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	62,265,195.50	28.19
7	其他各项资产	64,646.13	0.03
8	合计	220,850,912.73	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	32,788,725.02	15.11
B	采矿业	3,472,679.00	1.60
C	制造业	103,139,593.37	47.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,552,948.00	1.64
E	建筑业	15,592.23	0.01

F	批发和零售业	3,306,324.60	1.52
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	2,165,739.20	1.00
J	金融业	106,780.00	0.05
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	9,258,965.68	4.27
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	713,724.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	158,521,071.10	73.03

### 8.2.2 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。

### 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	002415	海康威视	854,939	20,356,097.59	9.38
2	002085	万丰奥威	975,064	19,267,264.64	8.88
3	603766	隆鑫通用	657,352	13,659,774.56	6.29
4	002299	圣农发展	563,907	11,966,106.54	5.51
5	002234	民和股份	547,036	11,805,036.88	5.44
6	300070	碧水源	523,209	9,166,621.68	4.22
7	002458	益生股份	262,139	9,017,581.60	4.15
8	600703	三安光电	645,099	8,637,875.61	3.98
9	600887	伊利股份	445,060	7,833,056.00	3.61
10	600688	上海石化	846,600	5,452,104.00	2.51

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.csfunds.com.cn> 网站的年度报告正文。

## 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	002415	海康威视	18,323,359.80	6.15
2	002234	民和股份	17,205,919.21	5.78
3	002299	圣农发展	15,369,562.51	5.16
4	603766	隆鑫通用	13,042,552.72	4.38
5	002458	益生股份	12,424,773.77	4.17
6	300148	天舟文化	10,265,163.97	3.45
7	600703	三安光电	8,117,268.43	2.72
8	601607	上海医药	7,767,990.30	2.61
9	600887	伊利股份	7,451,443.00	2.50
10	600104	上汽集团	7,312,144.00	2.45
11	300267	尔康制药	6,965,777.33	2.34
12	600340	华夏幸福	6,839,086.00	2.30
13	600585	海螺水泥	5,821,274.00	1.95
14	600688	上海石化	5,435,625.00	1.82
15	601766	中国中车	5,260,286.00	1.77
16	002589	瑞康医药	5,182,810.38	1.74
17	600048	保利地产	5,178,874.63	1.74
18	002223	鱼跃医疗	4,995,488.00	1.68
19	002241	歌尔股份	4,794,471.00	1.61
20	002400	省广股份	4,606,437.52	1.55

### 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	002236	大华股份	29,216,078.23	9.81
2	600155	宝硕股份	27,153,388.01	9.12
3	600406	国电南瑞	16,547,028.90	5.55
4	300148	天舟文化	10,985,909.20	3.69
5	002085	万丰奥威	10,373,572.86	3.48
6	300070	碧水源	9,808,700.70	3.29
7	601126	四方股份	9,362,491.98	3.14

8	000049	德赛电池	8,826,463.61	2.96
9	601222	林洋能源	8,589,180.03	2.88
10	000400	许继电气	7,970,098.12	2.68
11	600104	上汽集团	7,581,848.01	2.55
12	600340	华夏幸福	7,096,210.41	2.38
13	300267	尔康制药	6,909,473.70	2.32
14	600969	郴电国际	5,595,948.64	1.88
15	002589	瑞康医药	5,305,021.18	1.78
16	600048	保利地产	5,295,535.17	1.78
17	600617	国新能源	4,830,915.00	1.62
18	002169	智光电气	4,687,682.37	1.57
19	601607	上海医药	4,665,072.00	1.57
20	002400	省广股份	4,662,184.74	1.57

### 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	326,554,869.55
卖出股票收入（成交）总额	356,281,874.01

注：本项中 8.4.1，8.4.2，8.4.3 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 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股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

本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。

### 8.12.3 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	53,820.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,726.05
5	应收申购款	99.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	64,646.13

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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未存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 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

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
9,096	16,881.50	31,120,410.00	20.27%	122,433,689.79	79.73%

#### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	国元证券股份有限公司	4,003,286.00	3.26%
2	俞河会	1,651,355.00	1.34%
3	何继军	1,467,515.00	1.19%
4	钱浩然	1,405,223.00	1.14%
5	周嘉宁	1,260,000.00	1.02%
6	张启	1,145,100.00	0.93%
7	刘晓娟	1,088,994.00	0.89%
8	黄良珍	710,000.00	0.58%
9	蔡景玲	675,996.00	0.55%
10	竺爱琴	650,000.00	0.53%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	183,606.47	0.1196%

**9.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2014年4月4日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	176,446,496.92
本报告期基金总申购份额	4,863,395.25
减：本报告期基金总赎回份额	27,755,792.38
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	153,554,099.79

**§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****10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况**

本报告期内本基金管理人的高级管理人员无重大人事变动。

**10.2.2 基金经理变动情况**

本报告期本基金基金经理未曾变动。

**10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况**

本报告期本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

**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**

本报告期内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，本报告期内应支付该会计师事务所的报酬为 60,000.00 元。已连续为本基金服务 18 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

本报告期内管理人、托管人及其高级人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
银河证券	1	392,151,241.10	57.73%	365,212.11	57.73%	-
招商证券	2	268,456,023.28	39.52%	250,014.79	39.52%	-
申银万国	2	10,168,943.10	1.50%	9,470.51	1.50%	-
华安证券	1	8,514,217.71	1.25%	7,929.31	1.25%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
南方证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-

### 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	成交金额	占当期权证成交总额的比例



				的比例		
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	129,200,000.00	100.00%	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
南方证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

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，并能为本公司基金提供全面的信息服。

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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	东方证券	上海	1
2	华福证券	上海	1
3	方正证券	深圳	1

长盛基金管理有限公司  
2017年3月27日