

长盛同智优势成长混合型证券投资基金
(LOF)
2017 年半年度报告

2017 年 6 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

送出日期：2017 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

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。本半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 2017 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 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.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.8 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.....	48
7.9 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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
10.2 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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	55
§11 备查文件目录.....	57

11.1 备查文件目录.....	57
11.2 存放地点.....	57
11.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）
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
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
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	848,272,100.97 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	2007 年 2 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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	本基金为混合型基金，根据对宏观经济、行业状况、公司成长性及资本市场的判断，综合评价各类资产的风险收益水平，对各类资产采取适度灵活的资产配置。
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。

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
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100088	100818

法定代表人	周兵	田国立
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-30,045,370.20
本期利润	-3,249,632.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0037
本期加权平均净值利润率	-0.45%
本期基金份额净值增长率	-0.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-149,953,491.56
期末可供分配基金份额利润	-0.1768
期末基金资产净值	698,318,609.41
期末基金份额净值	0.8232
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	83.95%

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（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

4、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。

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
过去一个月	2.64%	0.65%	3.28%	0.44%	-0.64%	0.21%
过去三个月	-3.04%	0.64%	4.01%	0.40%	-7.05%	0.24%
过去六个月	-0.53%	0.56%	7.09%	0.37%	-7.62%	0.19%
过去一年	-3.62%	0.60%	11.08%	0.44%	-14.70%	0.16%
过去三年	31.20%	1.58%	50.37%	1.14%	-19.17%	0.44%
自基金转型起至今	83.95%	1.51%	82.10%	1.22%	1.85%	0.29%

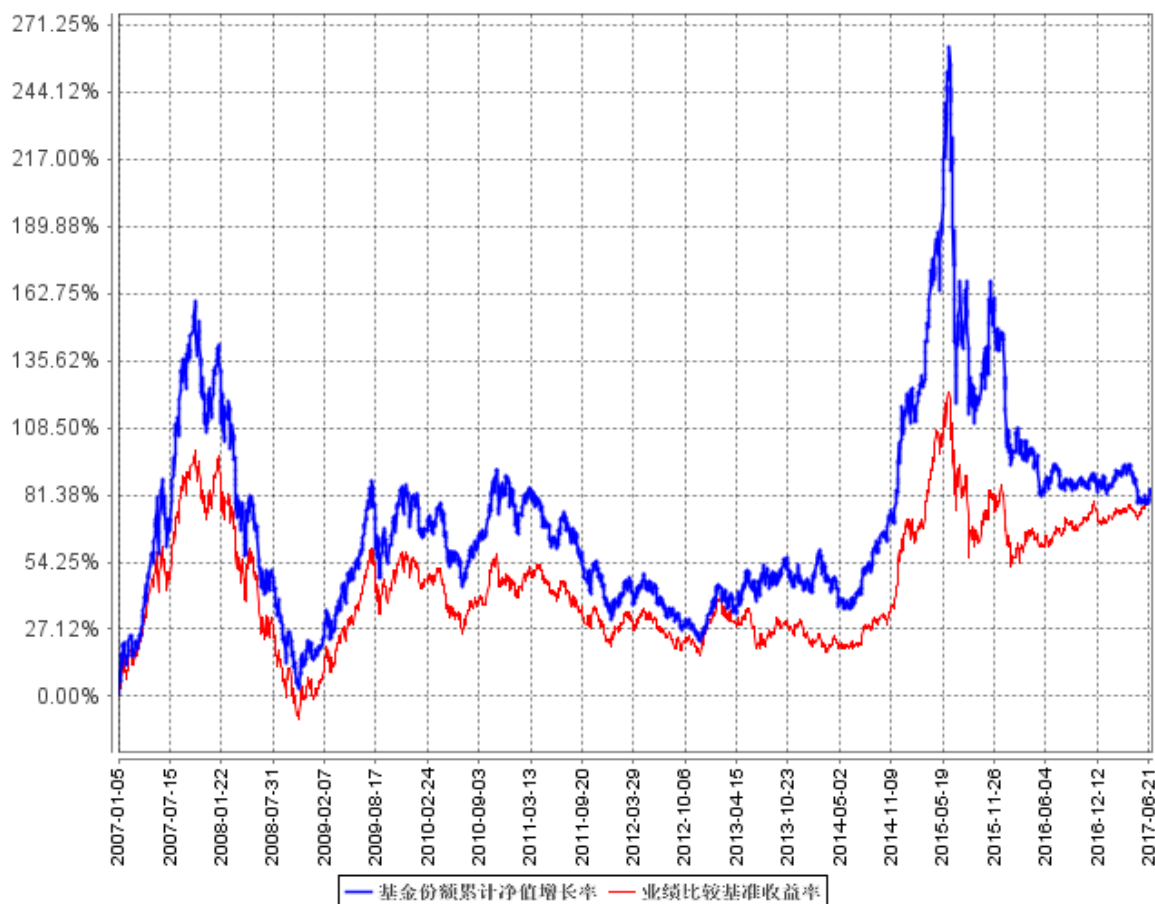
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

基准指数的构建考虑了三个原则：

- 1、公允性。选择市场认同度比较高的沪深 300 指数和上证国债指数作为计算的基础指数。
- 2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金持有的股票投资占基金资产的比例范围为 30%—95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数，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 65%、30%、5%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、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。截至报告日，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、郑州、杭州、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2017年6月30日，基金管理人共管理七十二只开放式基金，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		
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。	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，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。
代毅	本基金基金经理助理，行业研究员。	2015年1月8日	-	5年	男，1984年1月出生，中国国籍。北京大学硕士。2010年7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、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）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 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

今年一季度，国内宏观经济延续了上一年四季度较好的发展趋势；其次在流动性层面，虽然货币政策呈现中性，但相比固定收益等其他大类资产，股票投资的相对吸引力在提升。整体市场呈现蓝筹大盘股上升的态势。

4 月 1 日雄安新区横空出世，“千年大计”刺激着投资者的神经。然而这个概念的快速到来和快速消退成为了市场情绪转弱的契机。2017 年 4 月至 5 月，整个市场情绪较弱，大多数指数均呈现下跌态势。其中军工，农林牧渔等板块下跌较多。

5 月 27 日最新公布的关于大股东和董监高的减持新规，主要从增加了限制减持范围（将定向增发、股权质押、配股和可交债等方式取得的股份也纳入到限制减持范围）、降低不同期限减持比例（如大股东集合竞价方式连续 90 个交易日减持不能超过 1%+大宗交易连续 90 个交易日减持不能超过 2%，定增解禁后一年内减持份额不能超过持有总份额的 50%等）、对董监高通过离职方式减持进行规范、信息披露等方面完善。这表示证监会在将投资者的关注点向价值蓝筹方向进一步引导。

沿着政策指引的方向，在 6 月份的市场反弹中，白马蓝筹再一次引领市场上涨。在这过程中，板块分化进一步达到极致，在格力电器、美的集团、老板电器等上半年屡创新高的白马股的带领下，家用电器板块成为最牛板块。以上证 50 为代表的白马蓝筹股不断创出新高。以贵州茅台、格力电器等为代表的白马蓝筹一路高歌猛进，纷纷创出历史或阶段新高。Wind 白马股指数上半年累计上涨 35%，位居所有概念板块首位。

1-3 月份我们按照绝对收益思路逐渐兑现 2016 年底我们布局的工程机械，LED，石油机械等板块的收益，一季度整体表现较好。在 3 月底我们充分预计到了市场调整的可能性，延续一季度的绝对收益投资思路，在 4 月上旬对组合进行换仓。然而我们还是对于整体投资环境的惯性估计较差，认为白马行情要休息较长的时间，选择很长时间没有引起投资者关注的国企改革相关领域板块进行布局，重点投资了包括军工，一带一路，环保等行业。这几个错误的方向选择给二季度组合的净值带来了较大的损失。经过 6 月份的调整，我们重新对组合的方向进行了梳理，对组合的投资方向进行了分散，重点布局了周期性板块，成长性行业里的龙头公司。

4.4.2 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 0.8232 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.53%，业绩比较基准收益率为 7.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

按库存周期平均时间跨度推算，本轮库存周期已进入后期。以每轮库存周期的波峰为起点，自 1998 年以来中国经济经历了五轮完整的库存周期，平均库存周期为 40 个月（见图 1，表 1）。目前正处于第六轮库存周期，按库存周期四阶段划分，2014 年 9 月-2016 年 2 月为主动去库存阶段，2016 年 3 月-2016 年 5 月处于被动去库存阶段，2016 年 6 月开始进入主动补库存阶段，至 2017 年 6 月，本轮周期已有 34 个月，目前正进入被动补库存阶段。

房地产销售增速持续趋缓，一、二线城市房价涨幅回落。2009 年以来中国房地产经历了两轮时间跨度为 3 年的短周期，分别是 2009 年 1 月-2012 年 2 月、2012 年 3 月-2015 年 2 月。本轮房地产小周期起始于 2015 年 3 月，房地产销售面积累计增速见底后于当年 6 月份由负转正，2016 年 4 月份回升至 36.5%后开始趋缓，2017 年 5 月份累计增速已回调至 14.3%。2016 年 10 月份实施房地产调控后，一、二线城市房价涨幅开始出现回落（见图 5）。到今年 6 月份本轮房地产小周期已运行 28 个月，目前正处在周期顶部区域，房价涨幅和销售增速开始出现同步回调。按周期长度 36 个月推算，本轮周期将持续到 2018 年 2 月。

长期来看，我们正处在牛熊转换的第三阶段，震荡市，结构市，典型特征为分化与抱团取暖，这一阶段目前还没结束。我们看目前盈利虽缓慢回落，但经济远没有跌出政策底线。同时制造业投资中设备周期逐步开启，本轮设备更替需求占据很大一部分，尤其在工程机械板块表现明显。金融强监管延续的态势下，阶段性会有监管放松的窗口打开。市场的共识集中在经济增长一定是逐级下降的过程，对于经济悲观的预期已经反映在大家对超大市值白马蓝筹的一致追逐中，这些有限的公司是最具备长期确定性的公司。然而市场无论是对于周期板块继续缓慢复苏或者是成长性行业龙头公司业绩持续增长都不认同，对于稳定类板块由于国企改革带来的制度红利更是基本上没有预期了。我们在这个时点，认为短期来看，未来半年，市场上有超预期可能的板块集中周期类板块，成长性行业龙头公司，部分国企改革受益的稳定行业公司等。我们对于价值类白马蓝筹公司保持密切的关注，但我们认为短期内这些白马蓝筹公司需要调整来消化过于一致的市场预期。

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《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第二十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 2017 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-149,953,491.56 元，其中：未分配利润已实现部分为 205,524,190.77 元，未分配利润未实现部分为 -355,477,682.33 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）（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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	132,554,532.70	205,598,594.02
结算备付金		6,086,523.66	1,725,734.44
存出保证金		350,542.07	485,935.75
交易性金融资产	6.4.7.2	578,849,753.23	548,399,329.52
其中：股票投资		578,849,753.23	548,399,329.52
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	15,813.95	42,448.40
应收股利		-	-
应收申购款		50,819.78	103,679.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		717,907,985.39	756,355,721.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,743,626.50	14,701,380.81
应付赎回款		447,838.14	350,824.15
应付管理人报酬		845,019.58	945,731.74
应付托管费		140,836.58	157,621.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,823,326.39	1,736,170.28
应交税费		305,932.19	305,932.19

应付利息		-	-
应付利润		428,798.09	428,798.09
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	853,998.51	905,432.35
负债合计		19,589,375.98	19,531,891.57
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	848,272,100.97	890,349,173.49
未分配利润	6.4.7.10	-149,953,491.56	-153,525,343.54
所有者权益合计		698,318,609.41	736,823,829.95
负债和所有者权益总计		717,907,985.39	756,355,721.52

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.8232 元，基金份额总额 848,272,100.97 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
一、收入		11,658,416.55	-207,778,723.27
1.利息收入		1,076,034.78	1,458,058.01
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,076,034.78	1,458,058.01
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-16,220,749.22	-219,218,599.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-20,333,818.08	-221,958,470.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	4,113,068.86	2,739,870.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	26,795,737.54	9,972,162.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,393.45	9,655.95
减：二、费用		14,908,049.21	20,268,361.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,387,186.23	6,189,832.63

2. 托管费	6.4.10.2.2	897,864.37	1,031,638.84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	8,400,043.52	12,816,084.15
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	222,955.09	230,806.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,249,632.66	-228,047,085.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,249,632.66	-228,047,085.13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30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）	890,349,173.49	-153,525,343.54	736,823,829.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,249,632.66	-3,249,632.66
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）	-42,077,072.52	6,821,484.64	-35,255,587.88
其中：1.基金申购款	3,548,378.32	-605,855.21	2,942,523.11
2.基金赎回款	-45,625,450.84	7,427,339.85	-38,198,110.99
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）	848,272,100.97	-149,953,491.56	698,318,609.41
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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)	884,183,871.53	202,296,632.53	1,086,480,504.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-228,047,085.13	-228,047,085.13
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)	42,760,062.78	-3,467,022.36	39,293,040.42
其中：1.基金申购款	68,639,849.46	-6,009,052.43	62,630,797.03
2.基金赎回款	-25,879,786.68	2,542,030.07	-23,337,756.61
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)	-	-106,001,434.80	-106,001,434.80
五、期末所有者权益(基金净值)	926,943,934.31	-135,218,909.76	791,725,024.55

注：报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>林培富</u>	<u>刁俊东</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2006]260号文《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》的核准，由封闭式基金同智证券投资基金转型而成，自2007年1月5日起，《长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金于2007年1月22日（“转换基准日”）的基金净值为人民币955,116,003.53元，于2007年1月23日（“转换日”）折合基金份额955,116,000.00份。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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、

可转换债券，权证以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资占基金资产的比例范围为 30%-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。本基金将不低于 80%的股票资产投资于具有较大成长潜力的上市公司的股票。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。本基金的业绩比较基准是：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%。

6.4.2 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。

6.4.3 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 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

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，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2017 年 6 月 30 日
活期存款	132,554,532.70
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	132,554,532.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	545,014,667.78	578,849,753.23	33,835,085.45
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	545,014,667.78	578,849,753.23	33,835,085.45

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	13,221.56
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,450.25
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.21
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	141.93
合计	15,813.95

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,823,326.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,823,326.39

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	504.67
其他	150,176.54

预提费用	203,317.30
合计	853,998.51

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	890,349,173.49	890,349,173.49
本期申购	3,548,378.32	3,548,378.32
本期赎回(以“-”号填列)	-45,625,450.84	-45,625,450.84
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	848,272,100.97	848,272,100.97

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	247,492,612.50	-401,017,956.04	-153,525,343.54
本期利润	-30,045,370.20	26,795,737.54	-3,249,632.66
本期基金份额交易产生的变动数	-11,923,051.53	18,744,536.17	6,821,484.64
其中：基金申购款	974,875.61	-1,580,730.82	-605,855.21
基金赎回款	-12,897,927.14	20,325,266.99	7,427,339.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	205,524,190.77	-355,477,682.33	-149,953,491.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	25,799.72
其他	2,908.89
合计	1,076,034.78

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	2,756,596,248.84
减：卖出股票成本总额	2,776,930,066.92
买卖股票差价收入	-20,333,818.08

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期未取得债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期未取得衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,113,068.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,113,068.86

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	26,795,737.54
——股票投资	26,795,737.54
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	26,795,737.54

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	6,996.88
基金转换费收入	396.57
合计	7,393.45

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	8,400,043.52
银行间市场交易费用	-
合计	8,400,043.52

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	133,892.94
账户维护费	9,000.00
上市年费	29,752.78
汇划手续费	10,037.79
其他	600.00
合计	222,955.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,387,186.23	6,189,832.63
其中：支付销售机构的客户维护费	1,802,789.65	2,062,923.59

注：基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。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 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	897,864.37	1,031,638.84

注：基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。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 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 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未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人于本报告期及上年度可比期间内均未运用自有资金投资本基金份额。

6.4.10.4.2 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：除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	132,554,532.70	1,047,326.17	158,470,792.18	1,382,912.74

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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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

002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

注：基金可使用以基金名义开设股票账户，选择网下或者网上一种方式进行新股申购。从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300298	三诺生物	2017年5月17日	重大事项停牌	16.27	2017年7月17日	16.09	83,160	1,372,265.00	1,353,013.20	-
603238	诺邦股份	2017年5月15日	重大事项停牌	29.38	2017年8月23日	31.99	1,750	23,292.50	51,415.00	-
002856	美芝股份	2017年6月19日	重大事项停牌	31.86	-	-	1,230	14,280.30	39,187.80	-
300582	英飞特	2017年6月5日	重大事项停牌	18.92	2017年8月2日	17.50	2,038	20,181.15	38,558.96	-
603501	韦尔股份	2017年6月5日	重大事项停牌	20.15	-	-	1,657	11,632.14	33,388.55	-

注：本基金截至2017年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会风险控制管理委员会、督察长、公司风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司监察稽核部和风险管理部构成，监察稽核部负责对公司业务的法律合规风险和运作风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险控制委员会构成，公司管理层通过风险控制委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，在公司督察长的指导下，监察稽核部和风险管理部对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门总监、风险控制委员会、公司总经理、风险控制管理委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会及其下设风险控制管理委员会构成，风险控制管理委员会通过督察长、监察稽核部和风险管理部的工作，掌握整体风险状况并进行决策。风险控制管理委员会负责审查公司风险控制体系及其有效性、公司内控制度的实施情况。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	132,554,532.70	-	-	-	-	-	132,554,532.70
结算备付金	6,086,523.66	-	-	-	-	-	6,086,523.66
存出保证金	350,542.07	-	-	-	-	-	350,542.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	578,849,753.23	578,849,753.23
应收利息	-	-	-	-	-	15,813.95	15,813.95
应收申购款	-	-	-	-	-	50,819.78	50,819.78
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	138,991,598.43	-	-	-	-	578,916,386.96	717,907,985.39
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	12,743,626.50	12,743,626.50
应付赎回款	-	-	-	-	-	447,838.14	447,838.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	845,019.58	845,019.58
应付托管费	-	-	-	-	-	140,836.58	140,836.58
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,823,326.39	3,823,326.39
应付利润	-	-	-	-	-	428,798.09	428,798.09
应交税费	-	-	-	-	-	305,932.19	305,932.19
其他负债	-	-	-	-	-	853,998.51	853,998.51
负债总计	-	-	-	-	-	19,589,375.98	19,589,375.98
利率敏感度缺口	138,991,598.43	-	-	-	-	-559,327,010.98	698,318,609.41
上年度末 2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	205,598,594.02	-	-	-	-	-	205,598,594.02
结算备付金	1,725,734.44	-	-	-	-	-	1,725,734.44
存出保证金	485,935.75	-	-	-	-	-	485,935.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	548,399,329.52	548,399,329.52
应收利息	-	-	-	-	-	42,448.40	42,448.40
应收申购款	-	-	-	-	-	103,679.39	103,679.39
资产总计	207,810,264.21	-	-	-	-	548,545,457.31	756,355,721.52
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	14,701,380.81	14,701,380.81
应付赎回款	-	-	-	-	-	350,824.15	350,824.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	945,731.74	945,731.74
应付托管费	-	-	-	-	-	157,621.96	157,621.96
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,736,170.28	1,736,170.28
应付利润	-	-	-	-	-	428,798.09	428,798.09

应交税费	-	-	-	-	305,932.19	305,932.19
其他负债	-	-	-	-	905,432.35	905,432.35
负债总计	-	-	-	-	19,531,891.57	19,531,891.57
利率敏感度缺口	207,810,264.21	-	-	-	-529,013,565.74	736,823,829.95

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有交易性金融资产债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中，股票投资占基金资产的比例范围为 30%-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0%-3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0%-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。于 2017 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	578,849,753.23	82.89	548,399,329.52	74.43
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	578,849,753.23	82.89	548,399,329.52	74.43

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合在过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	38,784,091.83	39,498,582.76
	业绩比较基准下降 5%	-38,784,091.83	-39,498,582.76

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 577,221,165.98 元，属于第二层次的余额为人民币 1,628,587.25 元，无属于第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次人民币 547,275,354.53 元，第二层次人民币 1,123,974.99 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 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债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	578,849,753.23	80.63
	其中：股票	578,849,753.23	80.63
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	138,641,056.36	19.31
7	其他各项资产	417,175.80	0.06
8	合计	717,907,985.39	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	36,945,804.00	5.29
C	制造业	408,459,851.90	58.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	286,357.13	0.04
F	批发和零售业	6,845,302.40	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	6,899,985.00	0.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	49,125,262.07	7.03
J	金融业	42,600,835.29	6.10
K	房地产业	13,259,684.00	1.90
L	租赁和商务服务业	41,847.12	0.01
M	科学研究和技术服务业	86,652.88	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	7,247,910.73	1.04
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	7,050,260.71	1.01
S	综合	-	-
	合计	578,849,753.23	82.89

7.2.2 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沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000060	中金岭南	2,399,448	26,873,817.60	3.85
2	603626	科森科技	302,492	19,716,428.56	2.82
3	603816	顾家家居	329,442	19,364,600.76	2.77
4	603160	汇顶科技	192,626	19,320,387.80	2.77
5	002223	鱼跃医疗	780,697	18,486,904.96	2.65
6	600019	宝钢股份	2,719,864	18,250,287.44	2.61
7	002773	康弘药业	300,390	15,710,397.00	2.25
8	000938	紫光股份	250,764	15,326,695.68	2.19
9	000997	新大陆	667,799	15,152,359.31	2.17
10	002174	游族网络	474,100	15,057,416.00	2.16
11	002424	贵州百灵	782,813	14,763,853.18	2.11
12	600016	民生银行	1,768,600	14,537,892.00	2.08
13	601689	拓普集团	429,400	14,380,606.00	2.06
14	002831	裕同科技	190,757	14,306,775.00	2.05
15	600742	一汽富维	746,800	14,271,348.00	2.04
16	000338	潍柴动力	1,065,606	14,065,999.20	2.01
17	601998	中信银行	2,221,520	13,973,360.80	2.00
18	600085	同仁堂	389,892	13,630,624.32	1.95
19	600188	兖州煤业	1,021,086	12,498,092.64	1.79
20	002195	二三四五	1,644,960	11,761,464.00	1.68
21	601899	紫金矿业	2,908,000	9,974,440.00	1.43
22	600031	三一重工	1,133,600	9,216,168.00	1.32
23	000559	万向钱潮	761,680	8,089,041.60	1.16
24	002460	赣锋锂业	161,400	7,464,750.00	1.07
25	000786	北新建材	461,100	7,303,824.00	1.05
26	600498	烽火通信	288,000	7,300,800.00	1.05
27	600362	江西铜业	427,068	7,200,366.48	1.03
28	000898	鞍钢股份	1,262,800	7,147,448.00	1.02

29	600201	生物股份	200,875	7,145,123.75	1.02
30	601877	正泰电器	351,300	7,057,617.00	1.01
31	603989	艾华集团	179,700	7,051,428.00	1.01
32	601818	光大银行	1,738,300	7,040,115.00	1.01
33	600507	方大特钢	821,201	7,004,844.53	1.00
34	000826	启迪桑德	199,412	7,003,349.44	1.00
35	600715	文投控股	308,500	6,959,760.00	1.00
36	601339	百隆东方	1,166,919	6,943,168.05	0.99
37	002065	东华软件	318,374	6,937,369.46	0.99
38	002366	台海核电	147,500	6,919,225.00	0.99
39	002437	誉衡药业	949,700	6,913,816.00	0.99
40	600270	外运发展	364,500	6,899,985.00	0.99
41	600522	中天科技	571,600	6,887,780.00	0.99
42	002185	华天科技	949,000	6,870,760.00	0.98
43	600015	华夏银行	744,200	6,861,524.00	0.98
44	600153	建发股份	526,400	6,806,352.00	0.97
45	000070	特发信息	573,275	6,735,981.25	0.96
46	600048	保利地产	675,300	6,732,741.00	0.96
47	601225	陕西煤业	919,400	6,500,158.00	0.93
48	000967	盈峰环境	599,523	6,498,829.32	0.93
49	000402	金融街	535,600	6,277,232.00	0.90
50	600808	马钢股份	1,759,921	6,230,120.34	0.89
51	603188	亚邦股份	332,532	5,799,358.08	0.83
52	600409	三友化工	564,800	5,687,536.00	0.81
53	603993	洛阳钼业	1,033,800	5,231,028.00	0.75
54	601678	滨化股份	712,800	4,953,960.00	0.71
55	300415	伊之密	238,330	3,441,485.20	0.49
56	000951	中国重汽	216,028	3,303,068.12	0.47
57	603799	华友钴业	40,000	2,431,200.00	0.35
58	300401	花园生物	49,987	1,852,018.35	0.27
59	000983	西山煤电	177,400	1,555,798.00	0.22
60	300298	三诺生物	83,160	1,353,013.20	0.19
61	000603	盛达矿业	77,300	1,049,734.00	0.15
62	600183	生益科技	31,083	383,564.22	0.05
63	002146	荣盛发展	25,300	249,711.00	0.04
64	603766	隆鑫通用	31,813	231,598.64	0.03
65	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.03
66	300558	贝达药业	2,172	129,538.08	0.02
67	603603	博天环境	2,421	101,633.58	0.01

68	603727	博迈科	2,591	83,585.66	0.01
69	300623	捷捷微电	1,242	83,462.40	0.01
70	603133	碳元科技	2,445	82,054.20	0.01
71	603717	天域生态	2,490	81,198.90	0.01
72	603303	得邦照明	2,392	79,868.88	0.01
73	300641	正丹股份	4,020	77,586.00	0.01
74	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.01
75	002845	同兴达	1,048	75,246.40	0.01
76	002848	高斯贝尔	2,500	74,525.00	0.01
77	603630	拉芳家化	1,985	73,881.70	0.01
78	603768	常青股份	2,755	70,087.20	0.01
79	603920	世运电路	3,125	70,062.50	0.01
80	300627	华测导航	1,498	69,806.80	0.01
81	603586	金麒麟	2,046	69,666.30	0.01
82	603208	江山欧派	1,221	65,970.63	0.01
83	603179	新泉股份	1,495	65,645.45	0.01
84	603906	龙蟠科技	2,816	63,557.12	0.01
85	603728	鸣志电器	2,719	63,434.27	0.01
86	300610	晨化股份	2,694	63,228.18	0.01
87	603360	百傲化学	2,071	62,109.29	0.01
88	603638	艾迪精密	1,674	59,728.32	0.01
89	603826	坤彩科技	3,299	59,579.94	0.01
90	603966	法兰泰克	2,590	59,518.20	0.01
91	603036	如通股份	2,114	59,424.54	0.01
92	300602	飞荣达	1,254	59,301.66	0.01
93	300601	康泰生物	2,109	59,178.54	0.01
94	603615	茶花股份	2,915	57,687.85	0.01
95	603197	保隆科技	1,086	57,612.30	0.01
96	603637	镇海股份	1,802	56,474.68	0.01
97	002847	盐津铺子	1,553	56,218.60	0.01
98	603955	大千生态	1,250	55,850.00	0.01
99	002869	金溢科技	1,255	54,592.50	0.01
100	603896	寿仙谷	1,392	54,301.92	0.01
101	603096	新经典	1,270	53,822.60	0.01
102	300630	普利制药	1,488	53,716.80	0.01
103	603177	德创环保	2,779	52,967.74	0.01
104	603505	金石资源	2,570	52,967.70	0.01
105	603690	至纯科技	3,106	52,895.18	0.01
106	002855	捷荣技术	3,056	52,440.96	0.01

107	603578	三星新材	1,142	52,155.14	0.01
108	603803	瑞斯康达	2,245	52,016.65	0.01
109	603238	诺邦股份	1,750	51,415.00	0.01
110	002861	瀛通通讯	1,664	51,201.28	0.01
111	603903	中持股份	1,031	49,271.49	0.01
112	603081	大丰实业	2,582	49,006.36	0.01
113	603050	科林电气	1,256	48,933.76	0.01
114	002774	快意电梯	3,441	48,174.00	0.01
115	300657	弘信电子	1,021	48,089.10	0.01
116	603178	圣龙股份	2,578	47,847.68	0.01
117	603665	康隆达	1,185	47,577.75	0.01
118	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
119	300597	吉大通信	2,647	45,422.52	0.01
120	002849	威星智能	1,060	45,262.00	0.01
121	300639	凯普生物	1,046	44,894.32	0.01
122	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
123	300633	开立医疗	2,324	43,272.88	0.01
124	300658	延江股份	1,110	43,101.30	0.01
125	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.01
126	603855	华荣股份	2,728	41,792.96	0.01
127	002875	安奈儿	1,158	41,514.30	0.01
128	002843	泰嘉股份	1,377	40,979.52	0.01
129	603797	联泰环保	2,137	40,688.48	0.01
130	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.01
131	002866	传艺科技	1,488	40,071.84	0.01
132	603767	中马传动	1,785	39,751.95	0.01
133	002856	美芝股份	1,230	39,187.80	0.01
134	300622	博士眼镜	1,280	38,950.40	0.01
135	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.01
136	300582	英飞特	2,038	38,558.96	0.01
137	002842	翔鹭钨业	932	38,118.80	0.01
138	300606	金太阳	1,227	38,049.27	0.01
139	002860	星帅尔	777	37,995.30	0.01
140	300621	维业股份	1,758	37,867.32	0.01
141	002865	钧达股份	1,246	36,881.60	0.01
142	300592	华凯创意	1,583	36,678.11	0.01
143	002877	智能自控	1,436	36,302.08	0.01
144	603787	新日股份	1,849	36,184.93	0.01
145	603383	顶点软件	811	36,138.16	0.01

146	603811	诚意药业	953	35,918.57	0.01
147	002868	绿康生化	1,234	35,872.38	0.01
148	300609	汇纳科技	1,037	35,537.99	0.01
149	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
150	002870	香山股份	1,046	35,093.30	0.01
151	603042	华脉科技	1,232	35,013.44	0.01
152	300620	光库科技	986	34,095.88	0.00
153	603320	迪贝电气	958	34,066.48	0.00
154	300603	立昂技术	1,035	33,927.30	0.00
155	603538	美诺华	1,122	33,480.48	0.00
156	603388	元成股份	891	33,474.87	0.00
157	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.00
158	300643	万通智控	2,027	33,181.99	0.00
159	603196	日播时尚	2,083	32,682.27	0.00
160	603089	正裕工业	1,087	32,544.78	0.00
161	603488	展鹏科技	1,837	32,074.02	0.00
162	603496	恒为科技	912	31,354.56	0.00
163	603041	美思德	1,034	31,340.54	0.00
164	300652	雷迪克	966	30,863.70	0.00
165	300663	科蓝软件	1,293	30,812.19	0.00
166	300637	扬帆新材	1,313	30,619.16	0.00
167	300647	超频三	1,244	30,602.40	0.00
168	300635	达安股份	949	30,178.20	0.00
169	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.00
170	300632	光莆股份	1,237	29,811.70	0.00
171	300589	江龙船艇	1,189	29,201.84	0.00
172	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
173	300514	友讯达	1,024	27,535.36	0.00
174	603139	康惠制药	910	27,181.70	0.00
175	300659	中孚信息	776	27,175.52	0.00
176	603229	奥翔药业	1,340	26,558.80	0.00
177	300655	晶瑞股份	873	25,814.61	0.00
178	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
179	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.00
180	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
181	603269	海鸥股份	795	23,357.10	0.00
182	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
183	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
184	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00

185	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
186	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
187	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
188	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
189	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
190	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
191	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
192	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
193	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600085	同仁堂	61,943,760.66	8.41
2	600021	上海电力	47,945,151.83	6.51
3	600019	宝钢股份	45,429,552.89	6.17
4	000018	神州长城	42,370,218.87	5.75
5	601328	交通银行	41,285,764.00	5.60
6	600507	方大特钢	37,922,840.14	5.15
7	600498	烽火通信	36,892,534.66	5.01
8	002739	万达电影	36,056,291.93	4.89
9	601390	中国中铁	32,066,122.07	4.35
10	002465	海格通信	29,782,091.73	4.04
11	002366	台海核电	29,088,567.91	3.95
12	603168	莎普爱思	28,403,015.65	3.85
13	600016	民生银行	28,137,319.00	3.82
14	600267	海正药业	27,626,216.89	3.75
15	601899	紫金矿业	26,033,987.00	3.53
16	000060	中金岭南	25,953,263.49	3.52
17	300070	碧水源	23,292,486.61	3.16
18	600893	航发动力	22,461,117.04	3.05
19	300015	爱尔眼科	22,422,801.17	3.04
20	600188	兖州煤业	22,380,299.86	3.04
21	300113	顺网科技	21,268,388.85	2.89
22	000063	中兴通讯	20,897,842.50	2.84

23	601601	中国太保	20,705,642.61	2.81
24	600028	中国石化	20,675,298.00	2.81
25	601166	兴业银行	20,605,288.00	2.80
26	300244	迪安诊断	20,522,914.46	2.79
27	600208	新湖中宝	20,508,849.00	2.78
28	603328	依顿电子	19,775,351.72	2.68
29	300498	温氏股份	19,402,631.80	2.63
30	002773	康弘药业	18,949,056.49	2.57
31	000050	深天马 A	18,710,505.23	2.54
32	300284	苏交科	18,673,227.41	2.53
33	000338	潍柴动力	18,551,174.03	2.52
34	000908	景峰医药	18,312,477.01	2.49
35	600578	京能电力	18,258,433.15	2.48
36	300199	翰宇药业	18,021,546.79	2.45
37	603160	汇顶科技	17,915,746.10	2.43
38	600048	保利地产	17,875,047.00	2.43
39	603816	顾家家居	17,290,755.00	2.35
40	603626	科森科技	17,183,597.79	2.33
41	002223	鱼跃医疗	17,172,490.28	2.33
42	600428	中远海特	16,770,123.75	2.28
43	600887	伊利股份	16,526,981.96	2.24
44	000563	陕国投 A	16,278,025.73	2.21
45	603444	吉比特	15,878,202.00	2.15
46	300133	华策影视	15,837,870.76	2.15
47	600270	外运发展	15,749,703.39	2.14
48	600115	东方航空	15,472,475.00	2.10
49	600750	江中药业	15,185,807.24	2.06
50	600527	江南高纤	15,069,142.00	2.05
51	600572	康恩贝	15,025,243.77	2.04
52	300055	万邦达	15,007,556.48	2.04
53	600993	马应龙	14,959,265.87	2.03
54	600521	华海药业	14,954,176.36	2.03
55	601088	中国神华	14,922,416.00	2.03

7.4.2 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	600703	三安光电	56,986,994.01	7.73
2	600085	同仁堂	48,812,161.85	6.62
3	600021	上海电力	46,724,936.47	6.34
4	601390	中国中铁	43,535,886.85	5.91
5	601328	交通银行	41,983,981.00	5.70
6	000425	徐工机械	41,441,544.00	5.62
7	600031	三一重工	38,025,917.39	5.16
8	000998	隆平高科	36,261,651.88	4.92
9	002739	万达电影	34,094,906.51	4.63
10	000018	神州长城	34,064,187.84	4.62
11	600507	方大特钢	30,229,414.37	4.10
12	300070	碧水源	28,856,873.59	3.92
13	600019	宝钢股份	27,739,347.98	3.76
14	000930	中粮生化	27,671,472.50	3.76
15	600873	梅花生物	27,368,720.45	3.71
16	603168	莎普爱思	27,018,310.75	3.67
17	002465	海格通信	26,667,636.81	3.62
18	600498	烽火通信	25,671,692.56	3.48
19	600267	海正药业	24,835,351.55	3.37
20	000063	中兴通讯	24,176,012.91	3.28
21	002573	清新环境	24,120,251.61	3.27
22	002353	杰瑞股份	23,445,549.12	3.18
23	300015	爱尔眼科	23,124,065.87	3.14
24	600737	中粮糖业	21,837,027.06	2.96
25	600028	中国石化	21,608,520.00	2.93
26	601601	中国太保	21,214,685.22	2.88
27	600340	华夏幸福	21,189,523.57	2.88
28	601166	兴业银行	21,166,009.90	2.87
29	300113	顺网科技	20,740,289.32	2.81
30	300244	迪安诊断	20,728,265.07	2.81
31	600208	新湖中宝	19,993,173.00	2.71
32	002366	台海核电	19,960,992.85	2.71
33	601766	中国中车	19,870,967.20	2.70

34	600428	中远海特	19,194,760.18	2.61
35	000050	深天马A	19,120,497.62	2.59
36	600893	航发动力	18,054,156.87	2.45
37	603328	依顿电子	17,968,370.27	2.44
38	600578	京能电力	17,884,461.60	2.43
39	300498	温氏股份	17,261,287.23	2.34
40	600057	象屿股份	17,256,355.59	2.34
41	300284	苏交科	17,077,234.90	2.32
42	601088	中国神华	16,988,017.00	2.31
43	600887	伊利股份	16,909,779.48	2.29
44	000848	承德露露	16,786,037.52	2.28
45	000563	陕国投A	16,567,511.09	2.25
46	603444	吉比特	16,060,057.37	2.18
47	300199	翰宇药业	15,930,699.35	2.16
48	601899	紫金矿业	15,750,005.00	2.14
49	300133	华策影视	15,742,034.31	2.14
50	600516	方大炭素	15,635,539.00	2.12
51	600115	东方航空	15,460,829.00	2.10
52	000908	景峰医药	15,402,775.58	2.09
53	600993	马应龙	15,331,364.69	2.08
54	300055	万邦达	15,069,276.44	2.05
55	600572	康恩贝	15,020,668.28	2.04
56	600750	江中药业	14,900,422.82	2.02
57	600521	华海药业	14,817,608.77	2.01
58	600527	江南高纤	14,813,311.19	2.01
59	600108	亚盛集团	14,812,175.76	2.01
60	000860	顺鑫农业	14,808,695.94	2.01

7.4.3 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	2,780,584,753.09
卖出股票收入（成交）总额	2,756,596,248.84

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	350,542.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,813.95
5	应收申购款	50,819.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	417,175.80

7.12.4 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。

7.12.5 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中不存在流通受限情况。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
43,339	19,572.95	8,966,305.97	1.06%	839,305,795.00	98.94%

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.2 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	天津开创投资有限责任公司	1,986,564.00	3.66%
2	黄晓峰	709,737.00	1.31%
3	高兆明	577,298.00	1.06%
4	黄带顺	513,292.00	0.95%
5	王明瑞	486,832.00	0.90%
6	刘占武	418,871.00	0.77%
7	陈克明	387,000.00	0.71%
8	荆南飞	248,712.00	0.46%
9	李萍	247,169.00	0.46%
10	乔宇	242,800.00	0.45%

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。

8.3 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	534,130.12	0.0630%

8.4 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、基金投资和研 究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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年1月5日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	890,349,173.49
本报告期基金总申购份额	3,548,378.32
减：本报告期基金总赎回份额	45,625,450.84
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	848,272,100.97

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

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。

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

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略不曾改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
长江证券	1	2,550,193,214.16	46.09%	2,374,999.49	46.09%	-
东兴证券	1	2,346,064,199.16	42.40%	2,184,894.95	42.40%	-

华安证券	1	300,080,256.35	5.42%	279,465.64	5.42%	-
中信建投	2	266,112,560.02	4.81%	247,832.65	4.81%	-
申银万国	2	70,271,741.81	1.27%	65,443.88	1.27%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

10.7.2 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
长江证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

西部证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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	五矿证券	深圳	1
2	日信证券	深圳	1

10.8 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事件如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司旗下部分基金增加基煜销售并开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2017年6月29日
2	长盛基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》和《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	同上	2017年4月27日
3	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）2017年第1季度报告	同上	2017年4月22日
4	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	同上	2017年4月22日

5	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加广发证券申购（含定投）费率优惠活动的公告	同上	2017 年 4 月 10 日
6	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购优惠活动的公告	同上	2017 年 4 月 1 日
7	长盛基金管理有限公司高级管理人员董事长变更的公告	同上	2017 年 3 月 28 日
8	长盛基金管理有限公司高级管理人员副总经理变更的公告	同上	2017 年 3 月 28 日
9	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	同上	2017 年 3 月 28 日
10	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）2016 年度报告	同上	2017 年 3 月 27 日
11	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）2016 年度报告摘要	同上	2017 年 3 月 27 日
12	长盛基金管理有限公司关于增加肯特瑞财富为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2017 年 3 月 24 日
13	长盛基金管理有限公司关于增加蛋卷基金为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2017 年 3 月 21 日
14	长盛基金管理有限公司关于增加济安财富为旗下部分基金销售机构及参加费率优惠活动的公告	同上	2017 年 3 月 21 日
15	长盛基金管理有限公司关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定投业务及转换业务的公告	同上	2017 年 3 月 21 日
16	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告.	同上	2017 年 2 月 23 日
17	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书(更新)摘要	同上	2017 年 2 月 11 日
18	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书(更新)	同上	2017 年 2 月 11 日
19	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	同上	2017 年 1 月 21 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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8月24日