

长盛同智优势成长混合型证券投资基金
(LOF)
2017 年第 3 季度报告

2017 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：2017 年 10 月 27 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10月26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2017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	822,095,735.73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（2017年7月1日—2017年9月30日）
1. 本期已实现收益	6,687,435.56
2. 本期利润	-4,336,050.95
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0052
4. 期末基金资产净值	672,616,761.44
5. 期末基金份额净值	0.8182

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2017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。

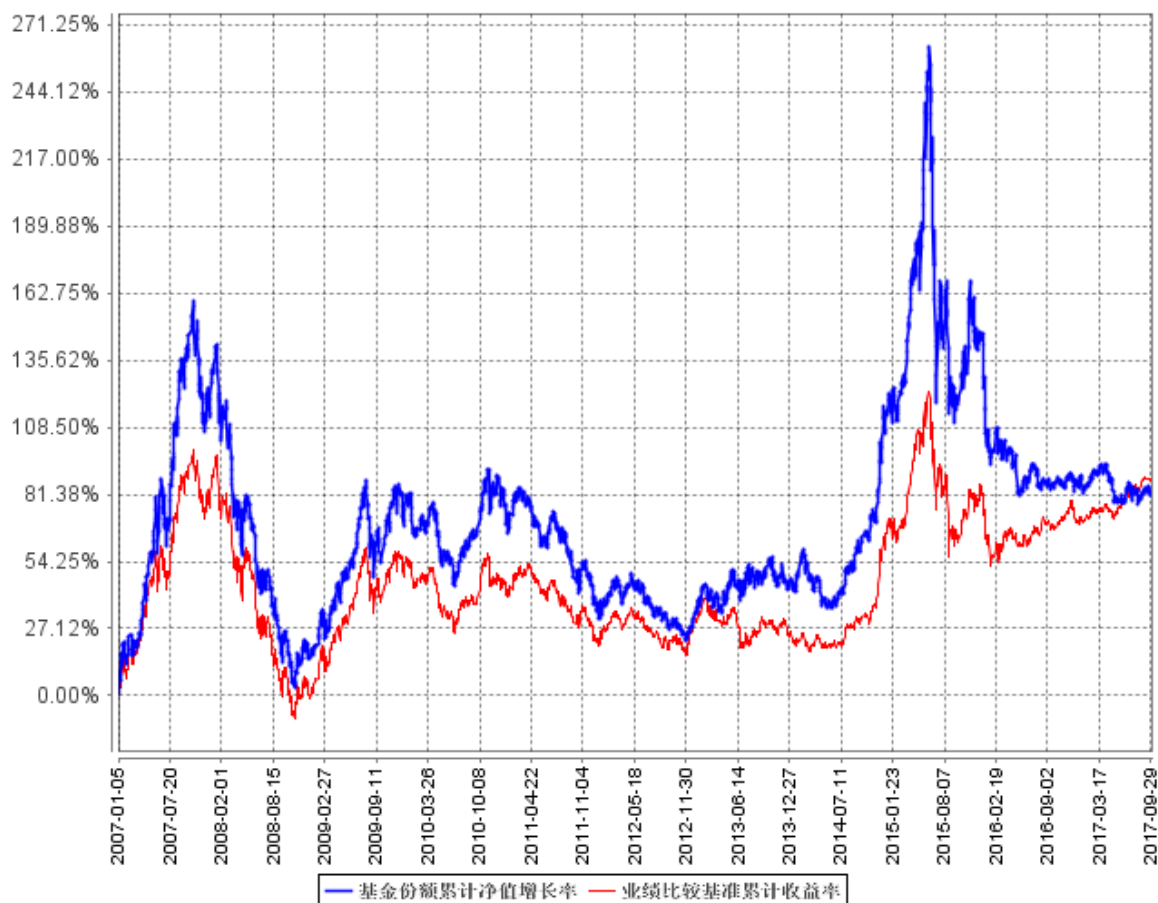
3.2 基金净值表现

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	-0.61%	0.71%	3.09%	0.39%	-3.70%	0.32%

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	说明
		任职日期	离任日期		

			日期	限	
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。

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

三季度市场整体波动加大，风格切换剧烈。7月初市场的热点延续了6月底以来的周期股行情，以钢铁煤炭为代表的板块加速上涨。7月底开始以计算机板块为代表的计算机板块开始反弹，市场做多热情开始升温，大量小市值公司开始有较大的波动性，市场呈现出热点散乱的特征。在众多题材股交替演出行情的时候，以食品饮料银行保险为代表的蓝筹股进入了平台调整期。在快速的风格轮动中，各个板块一齐拉动指数缓慢上攻，整体市场呈现出慢牛特征。

本基金整体在三季度操作谨慎，维持中性仓位。6月底时我们阶段性重仓周期板块，在7月初的时候录得较好的超额收益，但出于对组合整体波动性控制的考虑我们降低了周期板块的超额配置，客观上错过了后续周期板块的部分超额收益。我们目前的持仓不局限于大小市值公司的区分，而是集中在行业内龙头公司上。在行业的配置上，我们部分超配银行，半导体，食品饮料等板块，看好未来半年内这些行业景气度持续向好。三季度本基金涨幅-0.28%，跑输本基金基准。

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0.8182元；本报告期基金份额净值增长率为-0.61%，业绩比较基准收益率为3.09%。

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	569,689,286.10	83.90

	其中：股票	569,689,286.10	83.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	33,486,248.50	4.93
	其中：债券	33,486,248.50	4.93
	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	74,739,549.05	11.01
8	其他资产	1,125,770.78	0.17
9	合计	679,040,854.43	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	318,831.00	0.05
B	采矿业	8,360,829.80	1.24
C	制造业	323,363,155.27	48.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,571,659.38	3.50
E	建筑业	3,397,013.24	0.51
F	批发和零售业	12,074,813.65	1.80
G	交通运输、仓储和邮政业	17,019,923.08	2.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,294,332.35	1.68
J	金融业	97,434,334.47	14.49
K	房地产业	43,124,571.73	6.41
L	租赁和商务服务业	9,587,892.92	1.43
M	科学研究和技术服务业	385,936.75	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	8,280,712.09	1.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	939,774.69	0.14
R	文化、体育和娱乐业	10,025,697.68	1.49
S	综合	509,808.00	0.08
	合计	569,689,286.10	84.70

5.2.2 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。

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	600036	招商银行	1,432,914	36,610,952.70	5.44
2	603989	艾华集团	578,736	21,175,950.24	3.15
3	002142	宁波银行	1,230,234	19,413,092.52	2.89
4	300373	扬杰科技	847,183	19,247,997.76	2.86
5	000902	新洋丰	1,846,300	18,666,093.00	2.78
6	600856	中天能源	1,650,300	18,450,354.00	2.74
7	002156	通富微电	1,321,960	16,656,696.00	2.48
8	600329	中新药业	874,150	14,912,999.00	2.22
9	600266	北京城建	913,249	14,219,286.93	2.11
10	600584	长电科技	794,700	13,748,310.00	2.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	33,486,248.50	4.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	33,486,248.50	4.98

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019563	17国债09	335,030	33,486,248.50	4.98

注：本基金本期末仅持有1只债券。

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	642,748.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	478,312.03
5	应收申购款	4,710.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,125,770.78

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600584	长电科技	13,748,310.00	2.04	重大事项停牌

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	848,272,100.97
报告期期间基金总申购份额	1,937,491.28
减：报告期期间基金总赎回份额	28,113,856.52
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	822,095,735.73

§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 10 月 27 日