

长盛同智优势成长混合型证券投资基金  
(LOF)  
2017 年年度报告摘要

2017 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

送出日期：2018 年 3 月 31 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 30 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 2017 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	787,863,508.28 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

### 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	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

## § 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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	73,199.33	-255,755,774.94	915,076,930.80
本期利润	25,077,298.07	-252,290,740.13	450,175,324.89
加权平均基金份额本期利润	0.0297	-0.2744	0.3399
本期基金份额净值增长率	3.73%	-23.65%	12.74%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1415	-0.1724	0.2288
期末基金资产净值	676,404,168.03	736,823,829.95	1,086,480,504.06
期末基金份额净值	0.8585	0.8276	1.2288

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。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 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
过去三个月	4.93%	0.97%	3.36%	0.52%	1.57%	0.45%
过去六个月	4.29%	0.84%	6.55%	0.45%	-2.26%	0.39%
过去一年	3.73%	0.72%	14.10%	0.41%	-10.37%	0.31%
过去三年	-10.71%	1.55%	15.25%	1.09%	-25.96%	0.46%
过去五年	44.36%	1.40%	48.36%	1.00%	-4.00%	0.40%
自基金转型日起至今	91.84%	1.48%	94.03%	1.19%	-2.19%	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

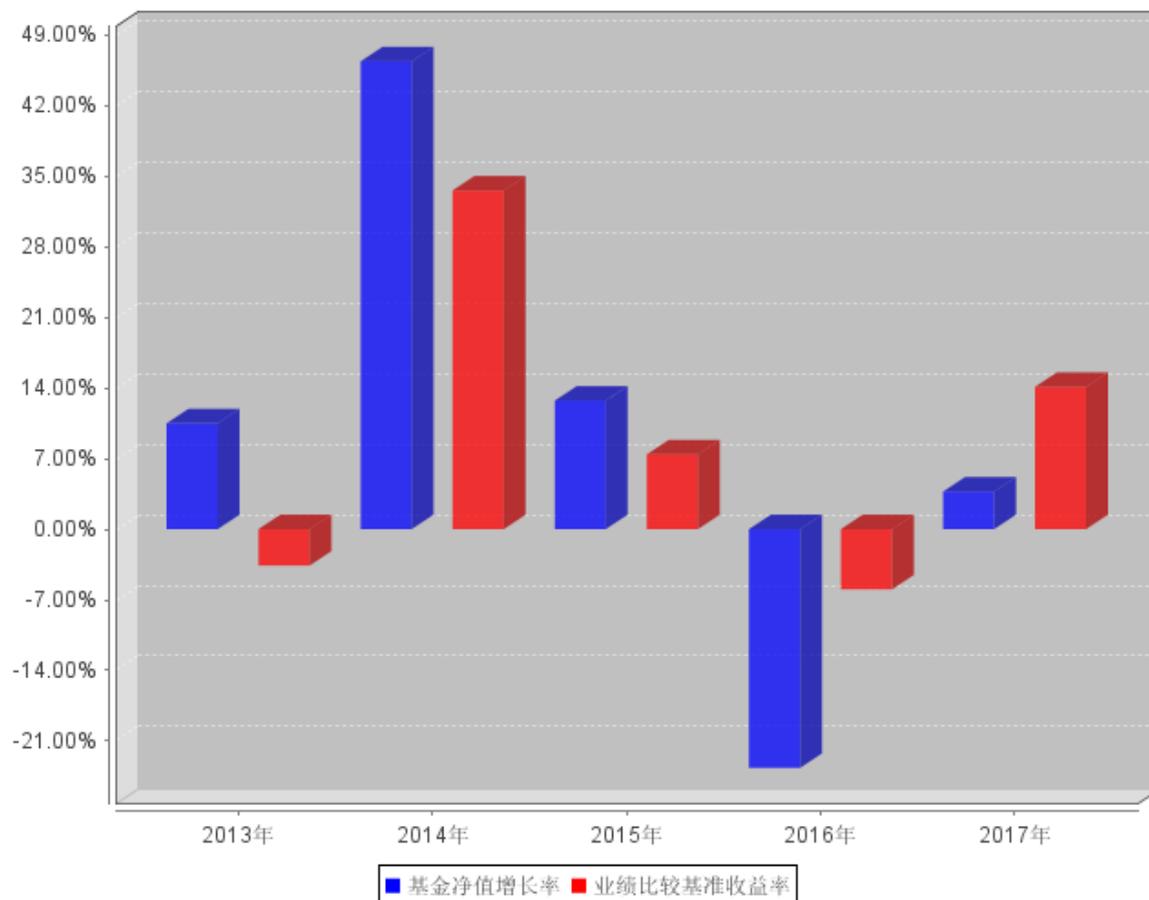


注：1、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 日。

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的有关约定。截止报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年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

过去五年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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10份基金份 额分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放 总额	年度利润分配合 计	备注
2016	1.2000	58,902,810.17	47,098,624.63	106,001,434.80	
2015	0.9100	139,739,098.79	67,041,043.52	206,780,142.31	
合计	2.1100	198,641,908.96	114,139,668.15	312,781,577.11	

注：本基金于 2017 年度未进行利润分配。

## §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 12 月 31 日，基金管理人共管理七十四只开放式基金，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		
王超	本基金基金经理，长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛盛鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同盛	2017-10-09	-	10 年	王超先生，1981 年 9 月出生。中央财经大学硕士，CFA（特许金融分析师），FRM（金融风险管理师）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。

	成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理。				
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。	2016-01-06	2017-10-09	10 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。	2015-01-08	-	7 年	代毅先生，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、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**

回顾 2017 年的市场行情，白马股和“中小创”之间的分化还是大大超出我们的预料，一方面，基金持仓集中的白马股成为抱团取暖的对象，股价屡创新高；另一方面，相对估值较高的“中小创”呈现出估值持续回落的态势，而不是大家之前普遍预期的重新回归成长的节奏。在此期间，上证综指上涨 6.56%，沪深 300 上涨 21.78%，中小板指上涨 16.73%，创业板指下跌 10.67%。反思期间的操作，造成落后主要原因在于，投资组合配置偏向成长股风格，与市场主流趋势背道而驰。在第四季度调整为业绩超预期策略进行管理，较好的把握盈利出现上涨动量的股票，获取市场上涨中的收益。

#### 4.4.2 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 0.8585 元，本报告期份额净值增长率为 3.73%，同期业绩比较基准增长率为 14.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来的行情，外部因素对国内市场的影响有待观察，美国税改的影响尚未充分体现，但是我们预计将不会对国内构成实质性冲击。国内的经济基本面，将会呈现经济稳中趋缓、通胀温和上行、货币政策稳定、宏观审慎加强以及财政政策保持积极的状态，对于股票资产而言，经济、企业盈利中枢稳定从分子端有利于股票资产定价，机构投资者的发展以及监管层防范金融风险的要求，推动股票资产波动率中枢下行，提高其风险调整后的回报率。另外从居民资产配置需求的角度，当房地产在“房住不炒”的政策定位下，以及资管新规对银行理财净值化的约束下，相关资产对居民的吸引力或有下降，有利于资金向权益市场倾斜。基于上述判断，我们将坚持业绩超预期策略，未来市场投资风格可能会偏向盈利成长性优质的股票，有可能带来该策略的持续超额收益。

#### 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**

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期末实施利润分配。

本基金截至 2017 年 12 月 31 日期末可供分配利润为-111,459,340.25 元，其中：未分配利润已实现部分为 219,985,014.63 元，未分配利润未实现部分为-331,444,354.88 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”）在对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

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）、投资组合报告中的数据真实、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）注册会计师徐艳、马剑英 2018 年 3 月 27 日对本基金 2017 年 12 月 31 日的资产负债表和 2017 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注出具了安永华明（2018）审字第 60468688\_A05 号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：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	113,604,977.73	205,598,594.02
结算备付金	182,892.11	1,725,734.44
存出保证金	520,365.92	485,935.75
交易性金融资产	603,326,024.03	548,399,329.52
其中：股票投资	568,592,978.53	548,399,329.52
基金投资	-	-
债券投资	34,733,045.50	-
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	787,752.52	42,448.40
应收股利	-	-
应收申购款	5,077.18	103,679.39
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	718,427,089.49	756,355,721.52
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 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	37,329,562.77	14,701,380.81
应付赎回款	945,702.73	350,824.15
应付管理人报酬	853,624.21	945,731.74
应付托管费	142,270.70	157,621.96
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,021,576.62	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	995,454.15	905,432.35
负债合计	42,022,921.46	19,531,891.57
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	787,863,508.28	890,349,173.49
未分配利润	-111,459,340.25	-153,525,343.54
所有者权益合计	676,404,168.03	736,823,829.95
负债和所有者权益总计	718,427,089.49	756,355,721.52

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）份额净值为人民币 0.8585 元，基金份额总额为 787,863,508.28 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	52,844,911.80	-218,602,191.48
1. 利息收入	1,872,385.96	2,503,271.16
其中：存款利息收入	1,576,688.99	2,503,271.16
债券利息收入	295,696.97	-
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）	25,953,518.07	-224,590,079.27
其中：股票投资收益	19,000,794.48	-227,839,734.98
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
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	6,952,723.59	3,249,655.71
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	25,004,098.74	3,465,034.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	14,909.03	19,581.82
<b>减：二、费用</b>	27,767,613.73	33,688,548.65
1. 管理人报酬	10,527,086.50	11,935,605.45
2. 托管费	1,754,514.44	1,989,267.64
3. 销售服务费	-	-

4. 交易费用	15,038,630.01	19,314,938.32
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	447,382.78	448,737.24
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>25,077,298.07</b>	<b>-252,290,740.13</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>25,077,298.07</b>	<b>-252,290,740.13</b>

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	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）	-	25,077,298.07	25,077,298.07
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）	-102,485,665.21	16,988,705.22	-85,496,959.99
其中：1. 基金申购款	7,110,480.57	-1,214,577.94	5,895,902.63
2. 基金赎回款	-109,596,145.78	18,203,283.16	-91,392,862.62
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）	787,863,508.28	-111,459,340.25	676,404,168.03
项目	上年度可比期间 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）	884,183,871.53	202,296,632.53	1,086,480,504.06



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%。

## 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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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

无。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 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 增值税

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]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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）

、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。。

#### 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（“长盛基金”）	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
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	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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

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。

#### 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,527,086.50	11,935,605.45
其中：支付销售机构的客户维护费	3,519,600.82	3,952,614.12

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

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付	1,754,514.44	1,989,267.64

的托管费		
------	--	--

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

### 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：本基金于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

注：本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

#### 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

### 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
中国银行	113,604,977.73	1,499,221.85	205,598,594.02	2,387,043.62

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。

### 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。

### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

## 7.4.9 期末（2017 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
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
002466	天齐锂业	2017年12月26日	2018年1月3日	配股流通受限	11.06	53.21	3,360	37,161.60	178,785.60	-

## 7.4.9.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128024	宁行转债	2017年12月5日	2018年1月12日	新债未上市	100.00	100.00	1,235.00	123,500.00	123,500.00	-
128029	太阳转债	2017年12月22日	2018年1月16日	新债未上市	100.00	100.00	1,582.00	158,200.00	158,200.00	-

## 7.4.9.2 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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	-------	--------	--------	----

600715	文投控股	2017年7月5日	重大事项停牌	22.47	2018年1月8日	23.40	308,500	6,873,186.00	6,931,995.00	-
600309	万华化学	2017年12月5日	重大事项停牌	37.94	-	-	80,467	2,971,546.74	3,052,917.98	-
600525	长园集团	2017年12月25日	重大事项停牌	15.79	2018年1月10日	17.30	176,300	3,380,928.00	2,783,777.00	-
600150	中国船舶	2017年9月27日	重大事项停牌	24.12	2018年3月21日	22.20	27,400	671,400.00	660,888.00	-
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项停牌	7.76	-	-	52,000	403,631.00	403,520.00	-
601600	中国铝业	2017年9月12日	重大事项停牌	6.65	2018年2月26日	7.28	40,000	310,877.33	266,000.00	-
600685	中船防务	2017年9月27日	重大事项停牌	26.66	2018年3月21日	24.05	4,400	116,592.00	117,304.00	-
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项停牌	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项停牌	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
600903	贵州燃气	2017年12月28日	重大事项停牌	16.86	2018年1月2日	16.01	715	1,580.15	12,054.90	-

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 7.4.10.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，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 554,216,013.45 元，属于第二层次的余额为人民币 49,110,010.58 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）。

#### (2) 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可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。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。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（2016 年：无）。

### 7.4.10.2 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。

### 7.4.10.3 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。

### 7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 27 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	568,592,978.53	79.14
	其中：股票	568,592,978.53	79.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,733,045.50	4.83
	其中：债券	34,733,045.50	4.83
	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	113,787,869.84	15.84
8	其他各项资产	1,313,195.62	0.18
9	合计	718,427,089.49	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	3,365,410.56	0.50
B	采矿业	28,167,097.22	4.16
C	制造业	343,819,558.75	50.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,848,014.97	1.01
E	建筑业	14,854,921.60	2.20
F	批发和零售业	25,988,848.28	3.84
G	交通运输、仓储和邮政业	14,137,689.26	2.09
H	住宿和餐饮业	2,421.75	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,494,535.54	2.29
J	金融业	48,271,257.53	7.14
K	房地产业	29,142,284.34	4.31

L	租赁和商务服务业	10,807,289.35	1.60
M	科学研究和技术服务业	4,283.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	3,941,560.20	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,583,770.55	0.53
R	文化、体育和娱乐业	20,164,035.15	2.98
S	综合	-	-
	合计	568,592,978.53	84.06

### 8.2.2 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港股通投资股票。

### 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	601336	新华保险	320,000	22,464,000.00	3.32
2	000968	蓝焰控股	800,000	13,432,000.00	1.99
3	600584	长电科技	384,900	8,209,917.00	1.21
4	600519	贵州茅台	11,300	7,881,637.00	1.17
5	600715	文投控股	308,500	6,931,995.00	1.02
6	601155	新城控股	188,940	5,535,942.00	0.82
7	000725	京东方 A	941,300	5,450,127.00	0.81
8	001979	招商蛇口	268,460	5,251,077.60	0.78
9	002294	信立泰	110,600	4,998,014.00	0.74
10	000418	小天鹅 A	72,400	4,912,340.00	0.73

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	600085	同仁堂	62,656,769.66	8.50
2	601328	交通银行	48,291,683.00	6.55
3	600019	宝钢股份	48,237,611.89	6.55
4	600021	上海电力	48,077,184.83	6.52
5	600498	烽火通信	44,215,310.66	6.00

6	002465	海格通信	43,670,544.73	5.93
7	000018	神州长城	42,370,218.87	5.75
8	601390	中国中铁	40,301,612.07	5.47
9	600507	方大特钢	39,559,947.00	5.37
10	600036	招商银行	37,417,592.23	5.08
11	002739	万达电影	36,056,291.93	4.89
12	600584	长电科技	35,538,135.26	4.82
13	600016	民生银行	34,714,050.00	4.71
14	000060	中金岭南	33,643,153.76	4.57
15	002185	华天科技	30,780,292.13	4.18
16	601166	兴业银行	29,408,655.11	3.99
17	002366	台海核电	29,088,567.91	3.95
18	603168	莎普爱思	28,403,015.65	3.85
19	600999	招商证券	28,202,253.55	3.83
20	600267	海正药业	27,626,216.89	3.75
21	603989	艾华集团	27,293,181.12	3.70
22	601318	中国平安	26,912,353.12	3.65
23	601899	紫金矿业	26,822,533.00	3.64
24	000563	陕国投A	26,449,502.33	3.59
25	601336	新华保险	25,976,932.61	3.53
26	600066	宇通客车	25,956,669.77	3.52
27	300015	爱尔眼科	25,954,116.37	3.52
28	600856	中天能源	25,887,074.96	3.51
29	601601	中国太保	25,134,238.84	3.41
30	300070	碧水源	24,612,947.61	3.34
31	000157	中联重科	24,215,412.00	3.29
32	002048	宁波华翔	24,078,496.05	3.27
33	002142	宁波银行	24,014,912.94	3.26
34	601857	中国石油	23,838,820.72	3.24
35	600428	中远海特	23,715,670.75	3.22
36	600893	航发动力	23,588,224.07	3.20
37	000603	盛达矿业	23,344,259.08	3.17
38	600028	中国石化	23,238,950.10	3.15
39	000063	中兴通讯	23,060,704.10	3.13
40	001979	招商蛇口	22,966,783.53	3.12
41	600138	中青旅	22,719,475.37	3.08

42	600188	兖州煤业	22,448,017.86	3.05
43	600572	康恩贝	21,815,024.57	2.96
44	600887	伊利股份	21,609,064.96	2.93
45	300199	翰宇药业	21,506,422.79	2.92
46	300113	顺网科技	21,268,388.85	2.89
47	002436	兴森科技	21,185,429.90	2.88
48	000338	潍柴动力	21,058,264.03	2.86
49	600010	包钢股份	20,880,606.00	2.83
50	600048	保利地产	20,865,313.68	2.83
51	002223	鱼跃医疗	20,794,906.78	2.82
52	600208	新湖中宝	20,695,660.00	2.81
53	600026	中远海能	20,665,744.23	2.80
54	300244	迪安诊断	20,522,914.46	2.79
55	601098	中南传媒	20,487,155.12	2.78
56	002001	新 和 成	20,418,952.12	2.77
57	600266	北京城建	20,413,214.77	2.77
58	600993	马应龙	20,374,407.67	2.77
59	600029	南方航空	20,237,931.55	2.75
60	600803	新奥股份	20,227,852.36	2.75
61	600362	江西铜业	20,069,326.35	2.72
62	002221	东华能源	19,857,482.60	2.70
63	603328	依顿电子	19,775,351.72	2.68
64	603188	亚邦股份	19,515,814.97	2.65
65	300498	温氏股份	19,402,631.80	2.63
66	600270	外运发展	19,320,508.39	2.62
67	601766	中国中车	19,228,621.90	2.61
68	600323	瀚蓝环境	19,023,219.21	2.58
69	002773	康弘药业	18,949,056.49	2.57
70	000050	深天马A	18,710,505.23	2.54
71	300284	苏文科	18,673,227.41	2.53
72	002439	启明星辰	18,454,052.62	2.50
73	000908	景峰医药	18,312,477.01	2.49
74	600578	京能电力	18,258,433.15	2.48
75	601088	中国神华	18,227,040.00	2.47
76	600547	山东黄金	18,064,276.89	2.45
77	603160	汇顶科技	17,961,146.10	2.44

78	000930	中粮生化	17,882,253.99	2.43
79	600804	鹏博士	17,791,785.38	2.41
80	300373	扬杰科技	17,771,444.55	2.41
81	000902	新洋丰	17,682,748.15	2.40
82	600688	上海石化	17,519,403.35	2.38
83	002468	申通快递	17,517,154.76	2.38
84	000997	新大陆	17,496,002.52	2.37
85	601689	拓普集团	17,480,925.86	2.37
86	601618	中国中冶	17,414,305.00	2.36
87	000596	古井贡酒	17,349,231.66	2.35
88	603816	顾家家居	17,290,755.00	2.35
89	603626	科森科技	17,183,597.79	2.33
90	002228	合兴包装	17,005,852.00	2.31
91	601186	中国铁建	16,784,841.00	2.28
92	600340	华夏幸福	16,717,573.28	2.27
93	000012	南玻A	16,537,285.20	2.24
94	600079	人福医药	16,416,750.54	2.23
95	300098	高新兴	16,403,634.71	2.23
96	002385	大北农	16,333,326.28	2.22
97	300347	泰格医药	16,299,655.51	2.21
98	600115	东方航空	16,272,035.00	2.21
99	300133	华策影视	15,956,451.76	2.17
100	002648	卫星石化	15,924,926.20	2.16
101	603444	吉比特	15,878,202.00	2.15
102	300274	阳光电源	15,861,445.76	2.15
103	600987	航民股份	15,655,326.66	2.12
104	600329	中新药业	15,638,973.10	2.12
105	002573	清新环境	15,462,025.33	2.10
106	600750	江中药业	15,185,807.24	2.06
107	600519	贵州茅台	15,169,170.01	2.06
108	000166	申万宏源	15,080,901.70	2.05
109	603588	高能环境	15,069,520.78	2.05
110	600527	江南高纤	15,069,142.00	2.05
111	000825	太钢不锈	15,066,512.00	2.04
112	300055	万邦达	15,007,556.48	2.04
113	000783	长江证券	14,962,866.78	2.03

114	600521	华海药业	14,954,176.36	2.03
115	000568	泸州老窖	14,948,597.80	2.03
116	300059	东方财富	14,873,016.40	2.02
117	601997	贵阳银行	14,871,157.21	2.02
118	002594	比亚迪	14,757,987.40	2.00

#### 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	600085	同仁堂	62,803,003.56	8.52
2	600703	三安光电	59,599,041.01	8.09
3	601390	中国中铁	51,484,039.35	6.99
4	600019	宝钢股份	50,102,624.78	6.80
5	601328	交通银行	48,779,540.00	6.62
6	600031	三一重工	47,908,093.39	6.50
7	600021	上海电力	46,855,082.47	6.36
8	000425	徐工机械	41,598,135.00	5.65
9	600498	烽火通信	40,800,659.56	5.54
10	002465	海格通信	40,196,445.51	5.46
11	600507	方大特钢	39,027,859.23	5.30
12	000998	隆平高科	36,261,651.88	4.92
13	000060	中金岭南	36,035,320.97	4.89
14	000930	中粮生化	35,138,173.50	4.77
15	600016	民生银行	35,127,683.99	4.77
16	600036	招商银行	34,258,316.80	4.65
17	002739	万达电影	34,094,906.51	4.63
18	000018	神州长城	34,064,187.84	4.62
19	300070	碧水源	30,259,958.59	4.11
20	601166	兴业银行	29,779,141.90	4.04
21	002185	华天科技	29,738,383.68	4.04
22	600584	长电科技	29,131,531.54	3.95
23	000902	新洋丰	28,997,278.92	3.94
24	600856	中天能源	28,520,012.75	3.87
25	601899	紫金矿业	27,428,741.00	3.72
26	600999	招商证券	27,376,951.92	3.72
27	600873	梅花生物	27,368,720.45	3.71
28	601766	中国中车	27,049,103.80	3.67

29	603168	莎普爱思	27,018,310.75	3.67
30	000563	陕国投 A	26,931,558.55	3.66
31	000063	中兴通讯	26,891,891.15	3.65
32	002366	台海核电	26,580,945.93	3.61
33	600428	中远海特	26,184,001.18	3.55
34	600066	宇通客车	25,997,662.98	3.53
35	601601	中国太保	25,868,780.22	3.51
36	603989	艾华集团	25,243,898.40	3.43
37	600267	海正药业	24,835,351.55	3.37
38	600188	兖州煤业	24,387,634.27	3.31
39	002142	宁波银行	24,199,961.22	3.28
40	600028	中国石化	24,122,199.00	3.27
41	002573	清新环境	24,120,251.61	3.27
42	000157	中联重科	24,074,597.00	3.27
43	601318	中国平安	23,960,518.00	3.25
44	601857	中国石油	23,777,114.21	3.23
45	002353	杰瑞股份	23,445,549.12	3.18
46	300015	爱尔眼科	23,124,065.87	3.14
47	002048	宁波华翔	23,097,883.24	3.13
48	600362	江西铜业	22,799,449.40	3.09
49	000603	盛达矿业	22,519,498.43	3.06
50	600572	康恩贝	22,091,799.38	3.00
51	000012	南玻 A	22,040,848.93	2.99
52	600737	中粮糖业	21,968,362.06	2.98
53	000860	顺鑫农业	21,358,195.72	2.90
54	600340	华夏幸福	21,189,523.57	2.88
55	600266	北京城建	20,941,752.79	2.84
56	600048	保利地产	20,865,026.02	2.83
57	600010	包钢股份	20,840,065.82	2.83
58	300113	顺网科技	20,740,289.32	2.81
59	300244	迪安诊断	20,728,265.07	2.81
60	002436	兴森科技	20,661,129.00	2.80
61	600993	马应龙	20,654,711.44	2.80
62	600026	中远海能	20,325,202.75	2.76
63	601098	中南传媒	20,276,084.22	2.75
64	600208	新湖中宝	20,178,069.00	2.74
65	600887	伊利股份	20,177,619.48	2.74
66	002001	新和成	19,979,424.85	2.71

67	600029	南方航空	19,910,776.21	2.70
68	000338	潍柴动力	19,878,803.70	2.70
69	300373	扬杰科技	19,813,244.04	2.69
70	300199	翰宇药业	19,511,856.35	2.65
71	600893	航发动力	19,299,135.87	2.62
72	002773	康弘药业	19,283,173.36	2.62
73	601800	中国交建	19,190,574.68	2.60
74	603188	亚邦股份	19,164,956.79	2.60
75	000050	深天马A	19,120,497.62	2.59
76	002221	东华能源	18,973,088.50	2.57
77	600803	新奥股份	18,740,737.95	2.54
78	600323	瀚蓝环境	18,479,889.06	2.51
79	600138	中青旅	18,455,200.48	2.50
80	603816	顾家家居	18,361,182.30	2.49
81	002439	启明星辰	18,029,175.54	2.45
82	603328	依顿电子	17,968,370.27	2.44
83	600578	京能电力	17,884,461.60	2.43
84	600547	山东黄金	17,635,340.82	2.39
85	600688	上海石化	17,461,469.96	2.37
86	600804	鹏博士	17,314,557.70	2.35
87	300498	温氏股份	17,261,287.23	2.34
88	600057	象屿股份	17,256,355.59	2.34
89	603160	汇顶科技	17,166,921.56	2.33
90	001979	招商蛇口	17,083,463.21	2.32
91	300284	苏交科	17,077,234.90	2.32
92	601618	中国中冶	17,050,246.00	2.31
93	002228	合兴包装	16,996,887.11	2.31
94	601088	中国神华	16,988,017.00	2.31
95	000848	承德露露	16,786,037.52	2.28
96	603626	科森科技	16,325,392.95	2.22
97	600115	东方航空	16,251,251.00	2.21
98	603444	吉比特	16,060,057.37	2.18
99	300347	泰格医药	16,030,449.20	2.18
100	000568	泸州老窖	15,965,946.20	2.17
101	601186	中国铁建	15,918,332.05	2.16
102	002405	四维图新	15,876,705.00	2.15
103	300133	华策影视	15,851,451.31	2.15
104	600516	方大炭素	15,635,539.00	2.12

105	600270	外运发展	15,587,472.20	2.12
106	600329	中新药业	15,426,360.00	2.09
107	000908	景峰医药	15,402,775.58	2.09
108	002273	水晶光电	15,356,972.68	2.08
109	002304	洋河股份	15,312,024.68	2.08
110	600987	航民股份	15,245,466.62	2.07
111	002594	比亚迪	15,088,796.49	2.05
112	300055	万邦达	15,069,276.44	2.05
113	601998	中信银行	14,963,892.68	2.03
114	600750	江中药业	14,900,422.82	2.02
115	600521	华海药业	14,817,608.77	2.01
116	002174	游族网络	14,814,481.15	2.01
117	600527	江南高纤	14,813,311.19	2.01
118	600108	亚盛集团	14,812,175.76	2.01
119	601997	贵阳银行	14,743,083.60	2.00
120	002223	鱼跃医疗	14,742,541.31	2.00
121	601333	广深铁路	14,742,258.12	2.00

#### 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	4,933,587,065.83
卖出股票收入（成交）总额	4,957,442,439.64

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	34,451,345.50	5.09
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）	281,700.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,733,045.50	5.13

**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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019563	17 国债 09	335,030	33,452,745.50	4.95
2	019557	17 国债 03	10,000	998,600.00	0.15
3	128029	太阳转债	1,582	158,200.00	0.02
4	128024	宁行转债	1,235	123,500.00	0.02

注：本基金本报告期末仅持有上述四只债券。

**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**

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记录，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	520,365.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	787,752.52
5	应收申购款	5,077.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,313,195.62

## 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处于转股期的可转换债券（可交换债券）。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600715	文投控股	6,931,995.00	1.02	重大事项停牌

## 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
40,900	19,263.17	8,906,275.97	1.13%	778,957,232.31	98.87%

### 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	中国结算深圳分公司上市公司待确认股份余股挂账账户	6,569,735.00	12.60%
2	天津开创投资有限责任公司	1,986,564.00	3.81%
3	黄晓峰	709,737.00	1.36%
4	高兆明	577,298.00	1.11%
5	黄带顺	513,292.00	0.98%
6	王明瑞	486,832.00	0.93%
7	刘占武	418,871.00	0.80%
8	陈克明	387,000.00	0.74%
9	刘惠忠	300,042.00	0.58%
10	张晓宇	255,698.00	0.49%

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	534,130.12	0.0678%

### 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

**§10 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	7,110,480.57
减:本报告期基金总赎回份额	109,596,145.78
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	787,863,508.28

## § 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

#### 11.2.1 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。

根据公司 2017 年第一次临时股东会议决议，同意张良庆先生不再担任公司第七届董事会独立董事职务，选举朱慈蕴女士担任公司第七届董事会独立董事。以上独立董事人员变更，已于 2018 年 1 月 9 日向中国证监会北京监管局报备。

#### 11.2.2 基金经理变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2017 年 10 月 9 日起，王超同志兼任长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，自 2017 年 10 月 9 日起，吴博文同志不再担任长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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。

### 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 80,000.00 元。已连续为本基金服务 17 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

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。

## 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	
长江证券	1	3,599,852,609.10	36.42%	3,352,547.10	36.42%	-
东兴证券	1	3,106,597,072.86	31.43%	2,893,181.38	31.43%	-
中信建投	2	1,402,450,226.78	14.19%	1,306,102.50	14.19%	-
招商证券	1	565,558,037.79	5.72%	526,705.31	5.72%	-
西南证券	1	510,371,107.15	5.16%	475,306.42	5.16%	-
申银万国	2	398,451,606.39	4.03%	371,076.37	4.03%	-
华安证券	1	300,080,256.35	3.04%	279,465.64	3.04%	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

### 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	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	34,495,475.10	100.00%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

国联证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

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	五矿证券	深圳	1
2	日信证券	深圳	1
3	民族证券	深圳	1

## **§12 影响投资者决策的其他重要信息**

### **12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况**

本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### **12.2 影响投资者决策的其他重要信息**

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

长盛基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日