

# 长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)

## 2017 年年度报告

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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§4 管理人报告</b>	<b>11</b>
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
<b>§6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>21</b>
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
<b>§8 投资组合报告</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
8.7 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	66

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 .....	66
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 .....	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12 投资组合报告附注 .....	67
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>69</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
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 .....	69
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>70</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>71</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	71
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 .....	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	71
11.4 基金投资策略的改变 .....	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	72
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 .....	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	72
11.8 其他重大事件 .....	75
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>80</b>
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 .....	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	80
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>81</b>
13.1 备查文件目录 .....	81
13.2 存放地点 .....	81
13.3 查阅方式 .....	81

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)
基金简称	长盛同盛成长优选混合
场内简称	长盛同盛
基金主代码	160813
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 11 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	239,658,726.46 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 12 月 26 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	聚焦经济转型、产业升级、模式创新、政策热点等板块，通过“自上而下优选行业”和“自下而上精选个股”相结合，重点布局未来增长预期高、成长确定性大的上市公司，为投资者实现资产长期增值。
投资策略	<p>本基金将首先参考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围，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>股票投资上，本基金将充分发挥基金管理人研究和投资的团队能力，以深入扎实的研究为基础，聚焦经济转型、产业升级、模式创新、政策热点等板块，将“自上而下优选行业”与“自下而上精选个股”相结合，将定性分析与定量分析相结合，寻找和布局未来增长预期良好、估值合理的上市公司，并审慎选择投资时机和介入时点，为投资者实现资产长期增值。</p> <p>债券投资上，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>股指期货投资上，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。</p>
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	陈四清

## 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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
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、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	5,849,643.66	-59,188,432.48	576,685,167.12
本期利润	14,960,385.86	-106,751,708.17	108,412,772.88
加权平均基金份额本期利润	0.0570	-0.3209	0.1259
本期加权平均净值利润率	7.08%	-40.29%	11.34%
本期基金份额净值增长率	7.32%	-27.60%	0.94%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	8,221,951.08	-6,279,175.22	99,529,198.16
期末可供分配基金份额利润	0.0343	-0.0221	0.2743
期末基金资产净值	200,250,167.48	221,355,411.65	390,225,916.39
期末基金份额净值	0.836	0.779	1.076
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-9.72%	-15.88%	16.19%

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 12 月 31 日。

4、长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同盛证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 11 月 5 日（即基金合同生效日）。

### 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	3.34%	0.79%	2.31%	0.41%	1.03%	0.38%
过去六个月	4.89%	0.76%	5.01%	0.35%	-0.12%	0.41%
过去一年	7.32%	0.68%	10.65%	0.32%	-3.33%	0.36%
过去三年	-21.58%	1.98%	15.31%	0.84%	-36.89%	1.14%
自基金转型	-9.72%	1.97%	37.51%	0.85%	-47.23%	1.12%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

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： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

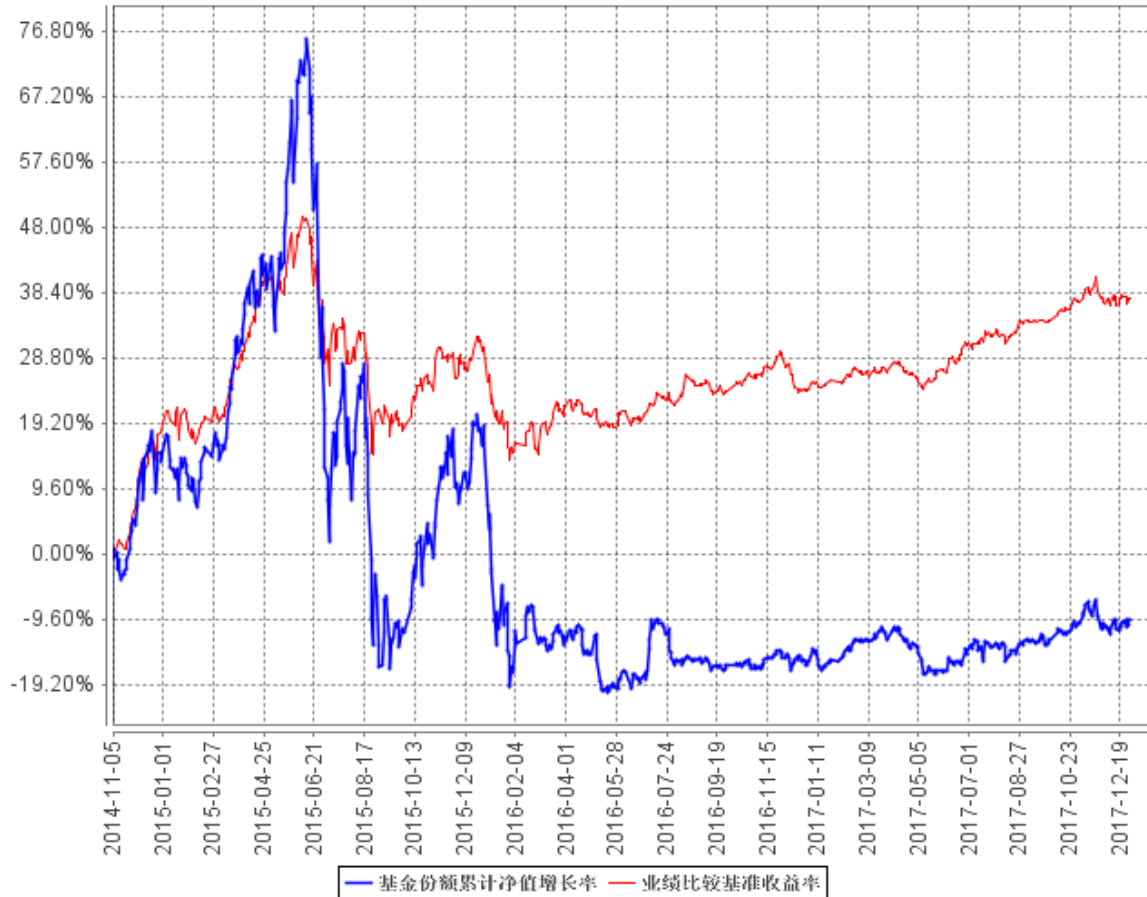
基准指数的构建考虑了三个原则：

- 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

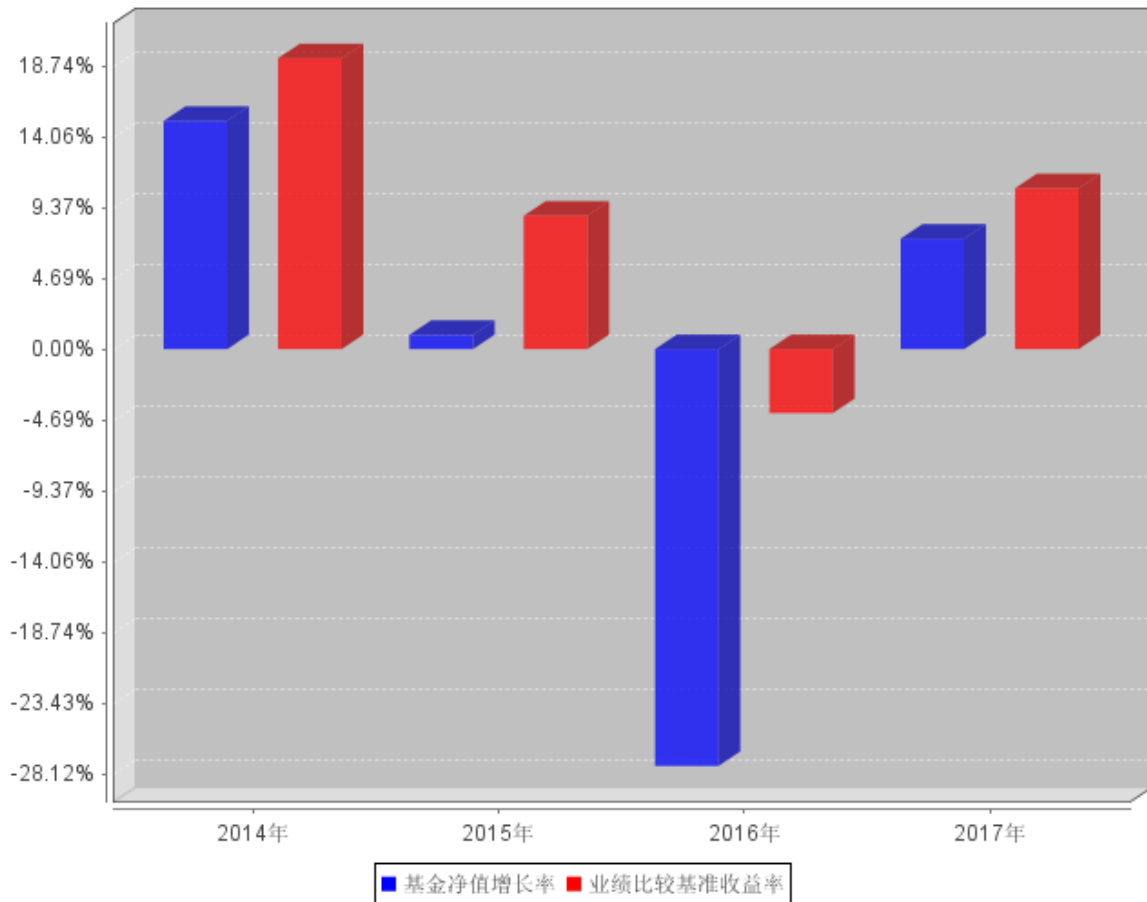


注：1、长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同盛证券投资基金转型而来，转型日期为2014年11月5日（即基金合同生效日）。

2、按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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：长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）合同于 2014 年 11 月 5 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 2017 年度、2016 年度、2015 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	2017 年 10 月 23 日	—	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。

	股票型证券投资基金基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同智优势成长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。	2016 年 2 月 17 日	-	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。

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。

在第四季度调整为低波动策略进行管理，持仓中绩优白马股权权重较高，较好的获取市场上涨中的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.836 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.32%，业绩比较基准收益率为 10.65%。

#### 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，我们将坚持低波动量化策略和强势行业轮动策略的“核心-卫星”组合，在低波动量化策略长期相对市场稳定超额收益的基础上，利用强势行业轮动策略提供短期的收益跃升。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合规运作，保障资产委托人利益出发，结合监管要求、市场形势及自身业务发展需要，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时督促有关部门改进、完善，并定期制作检查报告报送公司管理层。具体工作情况如下：

1、强调合规宣导与培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种方式，有重点、有针对性地展开合规培训工作，强化员工合规理念，深化员工合规意识，提高员工合规工作技能，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、持续推动公司完善制度/流程建设，扎实公司内控制度基础。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，保证公司制度/流程的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司新订、修订了包括《长盛基金管理有限公司公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理制度》《长盛基金管理有限公司合规管

理制度》《公司证券投资基金销售适用性管理制度》《公司反洗钱内部控制管理办法》《公司债券投资管理办法》《公司开放式证券投资基金大额申购赎回管理办法》《公司客户回访工作细则》《公司专职、兼联合规管理人员管理实施办法》等多部制度和流程。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，严肃制度/流程执行力，合理保障公司运营及委托资产投资运作合规。报告期内，监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核 30 余项，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、登记注册、产品开发、员工行为等；此外，根据业务发展需要，以及日常监督中发现问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，合理保障公司及委托资产合规、稳健运作。

5、积极参与新产品设计、新业务拓展工作，对相关的合规问题提供意见和建议。本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

#### 4.7 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。

#### **4.8 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，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2017 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 8,221,951.08 元，其中：未分配利润已实现部分为 90,393,124.91 元，未分配利润未实现部分为-82,171,173.83 元。

#### **4.9 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”）在长盛同盛成长优选灵活配置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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2018）审字第 60468688_A11 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。  在编制财务报表时，管理层负责评估长盛同盛成长优选灵活配置混

	<p>合型证券投资基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金</p>

	<p>(LOF) 不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容 (包括披露), 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	徐 艳	马剑英
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2018 年 3 月 27 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：长盛同盛成长优选灵活配置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	附注号	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	7.4.7.1	36,593,238.76	59,548,019.57
结算备付金		36,886.50	531,027.96
存出保证金		159,572.87	223,990.13
交易性金融资产	7.4.7.2	170,608,528.53	168,813,346.02
其中：股票投资		158,650,767.53	168,813,346.02
基金投资		-	-
债券投资		11,957,761.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		219,231.79	-
应收利息	7.4.7.5	256,552.94	12,634.73
应收股利		-	-
应收申购款		15.98	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		207,874,027.37	229,129,018.41
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,707,617.63	4,191,895.47
应付赎回款		18,654.91	109,641.40
应付管理人报酬		254,246.21	288,373.66
应付托管费		42,374.35	48,062.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	414,037.07	788,650.43
应交税费		1,823,891.66	1,823,891.66

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	363,038.06	523,091.86
负债合计		7,623,859.89	7,773,606.76
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	192,028,216.40	227,634,586.87
未分配利润	7.4.7.10	8,221,951.08	-6,279,175.22
所有者权益合计		200,250,167.48	221,355,411.65
负债和所有者权益总计		207,874,027.37	229,129,018.41

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 0.836 元，基金份额总额为 239,658,726.46 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛同盛成长优选灵活配置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	附注号	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>		23,382,409.72	-96,717,810.93
1. 利息收入		564,158.64	860,625.40
其中：存款利息收入	7.4.7.11	469,793.93	860,625.40
债券利息收入		94,364.71	-
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）		13,664,560.71	-50,101,234.23
其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,484,414.21	-50,912,562.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,180,146.50	811,327.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	9,110,742.20	-47,563,275.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	42,948.17	86,073.59
<b>减：二、费用</b>		8,422,023.86	10,033,897.24
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,172,411.24	3,985,758.75

2. 托管费	7.4.10.2.2	528,735.13	664,293.06
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	4,319,169.70	4,976,581.41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	401,707.79	407,264.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,960,385.86	-106,751,708.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,960,385.86	-106,751,708.17

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同盛成长优选灵活配置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）	227,634,586.87	-6,279,175.22	221,355,411.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,960,385.86	14,960,385.86
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）	-35,606,370.47	-459,259.56	-36,065,630.03
其中：1. 基金申购款	2,790,587.30	27,412.47	2,817,999.77
2. 基金赎回款	-38,396,957.77	-486,672.03	-38,883,629.80
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）	192,028,216.40	8,221,951.08	200,250,167.48
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）	290,696,718.23	99,529,198.16	390,225,916.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-106,751,708.17	-106,751,708.17
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）	-63,062,131.36	943,334.79	-62,118,796.57
其中：1. 基金申购款	7,340,282.34	105,973.08	7,446,255.42
2. 基金赎回款	-70,402,413.70	837,361.71	-69,565,051.99
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）	227,634,586.87	-6,279,175.22	221,355,411.65

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：

林培富	刁俊东	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

长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同盛证券投资基金（以下简称“基金同盛”）转型而成。根据基金同盛的基金份额持有人大会审议通过的《关于同盛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”）《关于准予同盛证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2014]998号）及深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2014]406号）的同意，基金同盛于2014年11月4日进行终止上市权益登记，2014年11月5日终止上市。自基金同盛终止上市之日起，基金同盛转型为长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），由《同盛证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同盛成长优选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，基金托管人为中国银行股份有限公司。



根据《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》、《关于同盛证券投资基金转换所得长盛同盛成长优选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 12 月 3 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 1.247992463 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: 1.247992463 的折算比例对基金同盛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。折算前基金同盛份额总额为 30 亿份，折算后基金份额总额为 3,743,977,389.00 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 12 月 4 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 11 月 17 日至 2014 年 11 月 28 日期间开放集中申购，集中申购款扣除申购费用后的净申购金额为人民币 609,423,974.44 元，折合 609,423,974.44 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 88,606.90 元，折合 88,606.90 份基金份额；集中申购期间收到的实收基金共计人民币 609,512,581.34 元，折合 609,512,581.34 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：本基金股票投资占基金资产的比例为 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《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 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效

套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息

支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，若事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；场内基金份额的收益分配方式为现金分红，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及注册登记机构的相关规定；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 投资者的现金红利保留到小数点后第 2 位，由此产生的收益或损失由基金资产承担；

(6) 当日申购的基金份额自申购确认日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自赎回确认日起，不享有基金的分配权益；

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 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、国家税务总局财税[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、国家税务总局财税字[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、国家税务总局财税字[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 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	36,593,238.76	59,548,019.57
定期存款	—	—
其中：存款期限 1-3 个月	—	—
其他存款	—	—

合计：	36,593,238.76	59,548,019.57
-----	---------------	---------------

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		145,972,701.58	158,650,767.53	12,678,065.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	11,968,887.00	11,957,761.00	-11,126.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	11,968,887.00	11,957,761.00	-11,126.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		157,941,588.58	170,608,528.53	12,666,939.95
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		165,257,148.27	168,813,346.02	3,556,197.75
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		165,257,148.27	168,813,346.02	3,556,197.75

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

应收活期存款利息	9,268.67	12,294.93
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	16.60	239.00
应收债券利息	247,195.87	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	71.80	100.80
合计	256,552.94	12,634.73

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	414,037.07	788,650.43
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	414,037.07	788,650.43

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	250,000.00
应付赎回费	70.32	124.12
其他	32,967.74	32,967.74
预提费用	330,000.00	240,000.00
合计	363,038.06	523,091.86

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	284,096,789.13	227,634,586.87
本期申购	3,483,452.14	2,790,587.30
本期赎回（以“-”号填列）	-47,921,514.81	-38,396,957.77
本期末	239,658,726.46	192,028,216.40

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

**7.4.7.10 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	100,706,954.32	-106,986,129.54	-6,279,175.22
本期利润	5,849,643.66	9,110,742.20	14,960,385.86
本期基金份额交易产生的变动数	-16,163,473.07	15,704,213.51	-459,259.56
其中：基金申购款	1,284,644.92	-1,257,232.45	27,412.47
基金赎回款	-17,448,117.99	16,961,445.96	-486,672.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	90,393,124.91	-82,171,173.83	8,221,951.08

**7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	448,116.75	828,714.05
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	19,273.66	24,558.77
其他	2,403.52	7,352.58
合计	469,793.93	860,625.40

**7.4.7.12 股票投资收益****7.4.7.12.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,439,977,441.19	1,669,574,270.51
减：卖出股票成本总额	1,428,493,026.98	1,720,486,832.64
买卖股票差价收入	11,484,414.21	-50,912,562.13

**7.4.7.13 债券投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,180,146.50	811,327.90
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,180,146.50	811,327.90

**7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	9,110,742.20	-47,563,275.69
——股票投资	9,121,868.20	-47,563,275.69
——债券投资	-11,126.00	-
——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	9,110,742.20	-47,563,275.69

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	42,941.13	85,818.81
基金转换费收入	7.04	254.78
合计	42,948.17	86,073.59

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	4,319,169.70	4,976,581.41
银行间市场交易费用	-	-
合计	4,319,169.70	4,976,581.41

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	270,000.00	270,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行费用	11,707.79	8,264.02
账户维护费用	-	9,000.00
合计	401,707.79	407,264.02

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

**7.4.9 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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	3,172,411.24	3,985,758.75
其中：支付销售机构的客户维护费	113,248.26	116,881.38

注：基金管理费每日计提，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 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	528,735.13	664,293.06

注：基金托管费每日计提，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 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

**7.4.10.3 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。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本报告期及上年度可比期间均无各关联方投资本基金的情况。

**7.4.10.4.2 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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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	3,743,978.00	1.5622%	3,743,978.00	1.3179%

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。

**7.4.10.5 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 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	36,593,238.76	448,116.75	59,548,019.57	828,714.05

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。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金本期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**7.4.10.7 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。

**7.4.11 利润分配情况**

注：本基金本报告期未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 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



## 7.4.12.1.1 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
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股未上市	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	新股未上市	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	新股未上市	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	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

## 7.4.12.1.2 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
123005	万信转债	2017 年 12 月 19 日	2018 年 1 月 30 日	新债未上市	100.00	100.00	18	1,800.00	1,800.00	-
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	7,468	746,800.00	746,800.00	-

## 7.4.12.2 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
600332	白云山	2017 年 10 月 31 日	重大事项停牌	32.14	2018 年 1 月 8 日	30.15	39,800	1,096,900.00	1,279,172.00	-
000926	福星股份	2017 年 12 月 26 日	重大事项停牌	10.89	2018 年 1 月 10 日	11.98	61,800	747,490.00	673,002.00	-

600309	万华化学	2017 年 12 月 5 日	重大事项停牌	37.94	-	-	17,000	559,870.00	644,980.00	-
000156	华数传媒	2017 年 12 月 26 日	重大事项停牌	11.40	-	-	27,019	333,631.23	308,016.60	-
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	18,000	135,238.00	119,700.00	-
601619	嘉泽新能	2017 年 10 月 31 日	重大事项停牌	7.90	-	-	6,617	8,337.42	52,274.30	-
600157	永泰能源	2017 年 11 月 21 日	重大事项停牌	3.36	-	-	14,300	52,490.00	48,048.00	-
601216	君正集团	2017 年 12 月 15 日	重大事项停牌	4.71	-	-	9,900	54,093.00	46,629.00	-
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	1,900	48,163.00	45,828.00	-
002470	金正大	2017 年 10 月 25 日	重大事项停牌	9.15	2018 年 2 月 9 日	8.24	4,600	37,738.00	42,090.00	-
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	-
300659	中孚信息	2017 年 11 月 14 日	重大事项停牌	40.21	-	-	776	9,971.60	31,202.96	-
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	-

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	900	24,748.00	23,994.00	-
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	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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财务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。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

##### 7.4.13.2 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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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。

##### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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 7.4.12 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。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，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，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	36,593,238.76	-	-	-	36,593,238.76
结算备付金	36,886.50	-	-	-	36,886.50
存出保证金	159,572.87	-	-	-	159,572.87
交易性金融资产	11,209,161.00	-	748,600.00	158,650,767.53	170,608,528.53
应收证券清算款	-	-	-	219,231.79	219,231.79
应收利息	-	-	-	256,552.94	256,552.94
应收申购款	-	-	-	15.98	15.98
资产总计	47,998,859.13	-	748,600.00	159,126,568.24	207,874,027.37
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,707,617.63	4,707,617.63
应付赎回款	-	-	-	18,654.91	18,654.91
应付管理人报酬	-	-	-	254,246.21	254,246.21
应付托管费	-	-	-	42,374.35	42,374.35
应付交易费用	-	-	-	414,037.07	414,037.07
应交税费	-	-	-	1,823,891.66	1,823,891.66
其他负债	-	-	-	363,038.06	363,038.06
负债总计	-	-	-	7,623,859.89	7,623,859.89
利率敏感度缺口	47,998,859.13	-	748,600.00	151,502,708.35	200,250,167.48
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	59,548,019.57	-	-	-	59,548,019.57
结算备付金	531,027.96	-	-	-	531,027.96
存出保证金	223,990.13	-	-	-	223,990.13
交易性金融资产	-	-	-	168,813,346.02	168,813,346.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	12,634.73	12,634.73
应收申购款	-	-	-	-	-
资产总计	60,303,037.66	-	-	168,825,980.75	229,129,018.41
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,191,895.47	4,191,895.47
应付赎回款	-	-	-	109,641.40	109,641.40
应付管理人报酬	-	-	-	288,373.66	288,373.66
应付托管费	-	-	-	48,062.28	48,062.28
应付交易费用	-	-	-	788,650.43	788,650.43
应交税费	-	-	-	1,823,891.66	1,823,891.66
其他负债	-	-	-	523,091.86	523,091.86

负债总计	-	-	-	7,773,606.76	7,773,606.76
利率敏感度缺口	60,303,037.66	-	-	161,052,373.99	221,355,411.65

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 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	158,650,767.53	79.23	168,813,346.02	76.26
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	158,650,767.53	79.23	168,813,346.02	76.26

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	16,120,138.48	20,509,208.92
	-5%	-16,120,138.48	-20,509,208.92

#### 7.4.14 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

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 155,175,267.57 元，属于第二层次的余额为人民币 15,433,260.96 元，无属于第三层次的余额（2016 年 12 月 31 日：第一层次人民币 168,239,379.85 元，第二层次人民币 573,966.17 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）。

##### 7.4.14.2 承诺事项

注：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

注：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

注：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	158,650,767.53	76.32
	其中：股票	158,650,767.53	76.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,957,761.00	5.75
	其中：债券	11,957,761.00	5.75
	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	36,630,125.26	17.62
8	其他各项资产	635,373.58	0.31
9	合计	207,874,027.37	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	67,263.00	0.03
B	采矿业	9,279,891.30	4.63
C	制造业	79,729,486.82	39.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,030,214.76	5.01
E	建筑业	3,673,549.97	1.83
F	批发和零售业	1,981,411.20	0.99
G	交通运输、仓储和邮政业	6,644,601.95	3.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,705,554.06	3.35
J	金融业	32,906,864.68	16.43
K	房地产业	4,315,398.60	2.16
L	租赁和商务服务业	252,273.20	0.13
M	科学研究和技术服务业	279,055.76	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	352,054.44	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-



Q	卫生和社会工作	161,751.69	0.08
R	文化、体育和娱乐业	2,241,366.10	1.12
S	综合	30,030.00	0.01
	合计	158,650,767.53	79.23

### 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	600036	招商银行	440,700	12,789,114.00	6.39
2	600584	长电科技	445,000	9,491,850.00	4.74
3	603989	艾华集团	236,449	9,084,370.58	4.54
4	300373	扬杰科技	298,600	8,949,042.00	4.47
5	600856	中天能源	600,100	7,015,169.00	3.50
6	002142	宁波银行	378,630	6,743,400.30	3.37
7	601006	大秦铁路	604,700	5,484,629.00	2.74
8	002156	通富微电	409,350	5,411,607.00	2.70
9	000568	泸州老窖	71,900	4,745,400.00	2.37
10	600352	浙江龙盛	400,000	4,684,000.00	2.34
11	002410	广联达	220,177	4,315,469.20	2.16
12	002690	美亚光电	200,000	3,854,000.00	1.92
13	601328	交通银行	444,400	2,759,724.00	1.38
14	000729	燕京啤酒	340,200	2,292,948.00	1.15
15	601699	潞安环能	200,000	2,276,000.00	1.14
16	601666	平煤股份	350,000	2,205,000.00	1.10
17	601398	工商银行	349,500	2,166,900.00	1.08
18	601555	东吴证券	207,900	2,020,788.00	1.01
19	600208	新湖中宝	358,100	1,869,282.00	0.93
20	601601	中国太保	43,500	1,801,770.00	0.90
21	601390	中国中铁	210,900	1,769,451.00	0.88
22	600690	青岛海尔	81,600	1,537,344.00	0.77
23	600059	古越龙山	151,800	1,425,402.00	0.71
24	000001	平安银行	101,400	1,348,620.00	0.67
25	600073	上海梅林	165,300	1,342,236.00	0.67
26	600332	白云山	39,800	1,279,172.00	0.64
27	600900	长江电力	79,100	1,233,169.00	0.62

28	603517	绝味食品	31,100	1,225,962.00	0.61
29	600522	中天科技	83,700	1,166,778.00	0.58
30	600028	中国石化	173,300	1,062,329.00	0.53
31	000425	徐工机械	212,300	982,949.00	0.49
32	000338	潍柴动力	111,600	930,744.00	0.46
33	000541	佛山照明	100,400	923,680.00	0.46
34	600221	海航控股	274,600	875,974.00	0.44
35	601857	中国石油	107,400	868,866.00	0.43
36	000400	许继电气	65,000	857,350.00	0.43
37	600271	航天信息	38,300	824,982.00	0.41
38	600325	华发股份	111,900	823,584.00	0.41
39	600019	宝钢股份	94,900	819,936.00	0.41
40	600170	上海建工	210,500	783,060.00	0.39
41	002463	沪电股份	146,400	780,312.00	0.39
42	600489	中金黄金	78,400	775,376.00	0.39
43	600639	浦东金桥	41,400	701,730.00	0.35
44	000623	吉林敖东	31,100	699,750.00	0.35
45	002465	海格通信	72,800	698,152.00	0.35
46	601939	建设银行	89,900	690,432.00	0.34
47	600820	隧道股份	80,700	674,652.00	0.34
48	000926	福星股份	61,800	673,002.00	0.34
49	000581	威孚高科	27,300	655,200.00	0.33
50	600309	万华化学	17,000	644,980.00	0.32
51	000513	丽珠集团	9,600	637,920.00	0.32
52	600651	飞乐音响	68,700	628,605.00	0.31
53	000651	格力电器	14,000	611,800.00	0.31
54	600674	川投能源	59,300	603,674.00	0.30
55	000727	华东科技	249,000	592,620.00	0.30
56	600252	中恒集团	127,000	557,530.00	0.28
57	600079	人福医药	30,800	549,472.00	0.27
58	601933	永辉超市	53,700	542,370.00	0.27
59	600380	健康元	46,400	519,216.00	0.26
60	601098	中南传媒	36,500	506,985.00	0.25
61	600739	辽宁成大	27,900	491,040.00	0.25
62	000426	兴业矿业	49,300	484,619.00	0.24
63	600637	东方明珠	28,600	476,476.00	0.24
64	000938	紫光股份	6,500	468,195.00	0.23
65	000975	银泰资源	34,800	464,928.00	0.23
66	000528	柳 工	54,500	464,885.00	0.23

67	600688	上海石化	71,400	451,962.00	0.23
68	002155	湖南黄金	45,800	444,260.00	0.22
69	000883	湖北能源	92,101	426,427.63	0.21
70	601928	凤凰传媒	52,000	421,720.00	0.21
71	600037	歌华有线	30,700	398,793.00	0.20
72	600633	浙数文化	25,600	389,120.00	0.19
73	600585	海螺水泥	13,100	384,223.00	0.19
74	000783	长江证券	48,600	382,482.00	0.19
75	600256	广汇能源	73,900	373,934.00	0.19
76	600705	中航资本	63,900	352,728.00	0.18
77	300324	旋极信息	23,900	349,657.00	0.17
78	600958	东方证券	25,000	346,500.00	0.17
79	300182	捷成股份	40,090	345,174.90	0.17
80	002266	浙富控股	78,700	340,771.00	0.17
81	300144	宋城演艺	17,700	330,282.00	0.16
82	601099	太平洋	91,100	329,782.00	0.16
83	600109	国金证券	34,200	326,268.00	0.16
84	600750	江中药业	12,500	318,500.00	0.16
85	002673	西部证券	25,200	310,464.00	0.16
86	000156	华数传媒	27,019	308,016.60	0.15
87	000709	河钢股份	78,500	306,150.00	0.15
88	002408	齐翔腾达	23,800	301,784.00	0.15
89	000685	中山公用	28,200	289,050.00	0.14
90	600811	东方集团	62,600	286,708.00	0.14
91	000876	新希望	37,100	276,395.00	0.14
92	600201	生物股份	8,000	253,920.00	0.13
93	600628	新世界	24,400	248,148.00	0.12
94	600704	物产中大	31,700	216,194.00	0.11
95	600025	华能水电	36,104	191,351.20	0.10
96	601878	浙商证券	11,049	183,634.38	0.09
97	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.09
98	002503	搜于特	31,100	172,294.00	0.09
99	000959	首钢股份	20,700	123,786.00	0.06
100	601600	中国铝业	18,000	119,700.00	0.06
101	300679	电连技术	1,184	109,070.08	0.05
102	000012	南玻A	12,900	109,005.00	0.05
103	603458	勘设股份	1,320	99,778.80	0.05
104	300601	康泰生物	2,109	99,650.25	0.05
105	600098	广州发展	13,700	96,859.00	0.05

106	603882	金域医学	2,763	87,393.69	0.04
107	603096	新经典	1,270	85,432.90	0.04
108	603603	博天环境	2,421	84,517.11	0.04
109	603896	寿仙谷	1,392	79,483.20	0.04
110	603133	碳元科技	2,445	79,438.05	0.04
111	601155	新城控股	2,700	79,110.00	0.04
112	601919	中远海控	11,200	75,824.00	0.04
113	600893	航发动力	2,800	75,348.00	0.04
114	002044	美年健康	3,400	74,358.00	0.04
115	601225	陕西煤业	8,900	72,624.00	0.04
116	603387	基蛋生物	1,190	71,376.20	0.04
117	603595	东尼电子	909	69,811.20	0.03
118	603717	天域生态	2,490	69,246.90	0.03
119	603501	韦尔股份	1,657	69,212.89	0.03
120	002027	分众传媒	4,900	68,992.00	0.03
121	603106	恒银金融	2,786	68,953.50	0.03
122	002081	金螳螂	4,500	68,940.00	0.03
123	603648	畅联股份	3,196	68,010.88	0.03
124	603081	大丰实业	2,582	67,648.40	0.03
125	002841	视源股份	924	66,990.00	0.03
126	300691	联合光电	808	66,918.56	0.03
127	000413	东旭光电	7,100	66,598.00	0.03
128	603233	大参林	1,287	66,486.42	0.03
129	300602	飞荣达	1,254	65,333.40	0.03
130	603728	鸣志电器	2,719	64,630.63	0.03
131	603359	东珠景观	1,865	63,913.55	0.03
132	603776	永安行	1,058	63,342.46	0.03
133	603690	至纯科技	3,106	63,020.74	0.03
134	603730	岱美股份	1,738	62,237.78	0.03
135	603707	健友股份	2,185	61,682.55	0.03
136	603920	世运电路	3,125	61,437.50	0.03
137	603197	保隆科技	1,086	61,174.38	0.03
138	600362	江西铜业	3,000	60,510.00	0.03
139	600570	恒生电子	1,300	60,320.00	0.03
140	002845	同兴达	2,096	59,547.36	0.03
141	300678	中科信息	1,033	59,469.81	0.03
142	000157	中联重科	13,200	59,004.00	0.03
143	603303	得邦照明	4,067	58,808.82	0.03
144	002310	东方园林	2,900	58,493.00	0.03

145	603177	德创环保	2,779	57,803.20	0.03
146	300558	贝达药业	908	57,467.32	0.03
147	603638	艾迪精密	1,674	55,627.02	0.03
148	300597	吉大通信	2,647	55,216.42	0.03
149	601998	中信银行	8,900	55,180.00	0.03
150	601333	广深铁路	9,900	55,143.00	0.03
151	603630	拉芳家化	1,985	54,508.10	0.03
152	603179	新泉股份	1,495	54,507.70	0.03
153	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.03
154	603955	大千生态	1,250	54,025.00	0.03
155	603505	金石资源	2,570	53,404.60	0.03
156	601992	金隅股份	9,800	53,214.00	0.03
157	000060	中金岭南	4,700	52,499.00	0.03
158	603208	江山欧派	1,221	52,295.43	0.03
159	601619	嘉泽新能	6,617	52,274.30	0.03
160	603305	旭升股份	1,351	51,405.55	0.03
161	603938	三孚股份	1,246	51,023.70	0.03
162	603826	坤彩科技	3,299	50,771.61	0.03
163	600436	片仔癀	800	50,560.00	0.03
164	603586	金麒麟	2,046	50,127.00	0.03
165	600297	广汇汽车	6,200	49,724.00	0.02
166	300657	弘信电子	1,021	48,681.28	0.02
167	600085	同仁堂	1,500	48,360.00	0.02
168	002916	深南电路	552	48,150.96	0.02
169	600157	永泰能源	14,300	48,048.00	0.02
170	603825	华扬联众	1,578	47,750.28	0.02
171	603277	银都股份	2,544	47,267.52	0.02
172	603181	皇马科技	1,946	46,704.00	0.02
173	601216	君正集团	9,900	46,629.00	0.02
174	300677	英科医疗	882	46,349.10	0.02
175	300692	中环环保	1,077	46,311.00	0.02
176	000826	启迪桑德	1,400	46,228.00	0.02
177	002500	山西证券	5,000	46,100.00	0.02
178	600150	中国船舶	1,900	45,828.00	0.02
179	603933	睿能科技	857	45,712.38	0.02
180	000983	西山煤电	4,500	45,630.00	0.02
181	300610	晨化股份	2,694	45,474.72	0.02
182	600682	南京新百	1,200	45,348.00	0.02
183	603797	联泰环保	2,137	45,240.29	0.02

184	601198	东兴证券	3,100	44,640.00	0.02
185	603055	台华新材	2,658	44,441.76	0.02
186	603360	百傲化学	2,071	44,360.82	0.02
187	000977	浪潮信息	2,200	43,736.00	0.02
188	300017	网宿科技	4,100	43,624.00	0.02
189	603637	镇海股份	1,802	43,590.38	0.02
190	603906	龙蟠科技	2,816	43,535.36	0.02
191	600061	国投资本	3,300	43,494.00	0.02
192	300675	建科院	1,536	43,330.56	0.02
193	002049	紫光国芯	900	43,191.00	0.02
194	002889	东方嘉盛	1,515	43,147.20	0.02
195	603063	禾望电气	2,361	42,568.83	0.02
196	603966	法兰泰克	2,590	42,450.10	0.02
197	002714	牧原股份	800	42,288.00	0.02
198	002470	金正大	4,600	42,090.00	0.02
199	000008	神州高铁	4,800	42,000.00	0.02
200	603803	瑞斯康达	2,245	41,734.55	0.02
201	300697	电工合金	1,630	41,320.50	0.02
202	300606	金太阳	1,228	41,273.08	0.02
203	300027	华谊兄弟	4,700	41,031.00	0.02
204	300662	科锐国际	1,656	41,019.12	0.02
205	603238	诺邦股份	1,750	40,932.50	0.02
206	002842	翔鹭钨业	932	40,849.56	0.02
207	002847	盐津铺子	1,553	40,797.31	0.02
208	603615	茶花股份	2,915	40,780.85	0.02
209	600118	中国卫星	1,600	40,400.00	0.02
210	600588	用友网络	1,900	40,185.00	0.02
211	002895	川恒股份	1,461	40,177.50	0.02
212	600663	陆家嘴	2,100	39,963.00	0.02
213	002899	英派斯	1,408	39,930.88	0.02
214	603676	卫信康	2,485	39,859.40	0.02
215	002869	金溢科技	1,255	39,808.60	0.02
216	603903	中持股份	1,031	39,631.64	0.02
217	601117	中国化学	5,800	39,150.00	0.02
218	600583	海油工程	6,300	38,745.00	0.02
219	002848	高斯贝尔	2,500	38,725.00	0.02
220	603665	康隆达	1,185	38,631.00	0.02
221	603178	圣龙股份	2,578	38,515.32	0.02
222	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02

223	300671	富满电子	942	38,056.80	0.02
224	000671	阳光城	4,800	37,776.00	0.02
225	603036	如通股份	2,114	37,544.64	0.02
226	300609	汇纳科技	1,037	37,435.70	0.02
227	300603	立昂技术	1,035	37,239.30	0.02
228	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
229	603578	三星新材	1,142	37,012.22	0.02
230	000402	金融街	3,300	36,663.00	0.02
231	600718	东软集团	2,500	36,650.00	0.02
232	300682	朗新科技	1,997	36,565.07	0.02
233	603383	顶点软件	811	36,486.89	0.02
234	002891	中宠股份	1,011	36,284.79	0.02
235	600060	海信电器	2,400	36,048.00	0.02
236	603042	华脉科技	1,232	36,011.36	0.02
237	300582	英飞特	2,038	35,868.80	0.02
238	603043	广州酒家	1,810	35,457.90	0.02
239	601229	上海银行	2,500	35,450.00	0.02
240	603711	香飘飘	1,318	35,019.26	0.02
241	600008	首创股份	6,800	34,952.00	0.02
242	603535	嘉诚国际	1,340	34,706.00	0.02
243	002877	智能自控	1,436	34,119.36	0.02
244	300730	科创信息	821	34,112.55	0.02
245	600649	城投控股	3,800	33,440.00	0.02
246	300658	延江股份	1,110	33,222.30	0.02
247	603855	华荣股份	2,728	32,899.68	0.02
248	603321	梅轮电梯	2,725	32,700.00	0.02
249	601866	中远海发	9,500	32,395.00	0.02
250	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.02
251	603488	展鹏科技	1,837	32,220.98	0.02
252	603388	元成股份	1,782	31,790.88	0.02
253	601877	正泰电器	1,200	31,380.00	0.02
254	300659	中孚信息	776	31,202.96	0.02
255	300315	掌趣科技	5,600	31,136.00	0.02
256	000415	渤海金控	5,400	31,104.00	0.02
257	002875	安奈儿	1,158	30,964.92	0.02
258	300731	科创新源	808	30,914.08	0.02
259	002893	华通热力	1,176	30,646.56	0.02
260	002849	威星智能	1,060	30,305.40	0.02
261	002843	泰嘉股份	1,377	30,294.00	0.02

262	002352	顺丰控股	600	30,216.00	0.02
263	300729	乐歌股份	941	30,187.28	0.02
264	002868	绿康生化	1,234	30,035.56	0.01
265	600895	张江高科	2,100	30,030.00	0.01
266	300693	盛弘股份	863	29,816.65	0.01
267	603050	科林电气	1,507	29,718.04	0.01
268	600827	百联股份	2,200	29,678.00	0.01
269	603538	美诺华	1,122	29,609.58	0.01
270	300589	江龙船艇	1,189	29,368.30	0.01
271	300686	智动力	1,288	29,237.60	0.01
272	603917	合力科技	1,022	29,014.58	0.01
273	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
274	300727	润禾材料	870	28,701.30	0.01
275	603129	春风动力	1,075	28,659.50	0.01
276	603963	大理药业	999	28,531.44	0.01
277	603811	诚意药业	953	28,361.28	0.01
278	300670	大烨智能	1,259	28,327.50	0.01
279	600549	厦门钨业	1,100	28,314.00	0.01
279	603326	我乐家居	1,452	28,314.00	0.01
280	300168	万达信息	2,100	28,308.00	0.01
281	002892	科力尔	765	28,236.15	0.01
282	000917	电广传媒	3,100	28,086.00	0.01
283	600919	江苏银行	3,800	27,930.00	0.01
284	603767	中马传动	1,785	27,756.75	0.01
285	603183	建研院	701	27,514.25	0.01
286	300663	科蓝软件	1,293	27,489.18	0.01
287	300592	华凯创意	1,583	27,385.90	0.01
288	002602	世纪华通	800	27,184.00	0.01
289	600373	中文传媒	1,600	27,088.00	0.01
290	603386	广东骏亚	1,644	27,076.68	0.01
291	300643	万通智控	2,027	26,938.83	0.01
292	603976	正川股份	964	26,625.68	0.01
293	000559	万向钱潮	2,600	26,390.00	0.01
294	300655	晶瑞股份	873	26,329.68	0.01
295	603316	诚邦股份	1,824	26,192.64	0.01
296	603089	正裕工业	1,087	26,055.39	0.01
297	603787	新日股份	1,849	26,052.41	0.01
298	603500	祥和实业	1,004	25,953.40	0.01
299	601718	际华集团	3,800	25,574.00	0.01



300	601997	贵阳银行	1,900	25,384.00	0.01
301	002152	广电运通	3,400	25,296.00	0.01
302	300251	光线传媒	2,400	25,080.00	0.01
303	601118	海南橡胶	4,500	24,975.00	0.01
304	603725	天安新材	1,203	24,384.81	0.01
305	603196	日播时尚	2,083	24,308.61	0.01
306	300647	超频三	1,244	24,307.76	0.01
307	603320	迪贝电气	958	24,256.56	0.01
308	002153	石基信息	900	23,994.00	0.01
308	600685	中船防务	900	23,994.00	0.01
309	002888	惠威科技	861	23,324.49	0.01
310	603041	美思德	1,034	23,285.68	0.01
311	600977	中国电影	1,500	23,100.00	0.01
312	603139	康惠制药	910	22,804.60	0.01
313	603768	常青股份	1,242	22,803.12	0.01
314	603229	奥翔药业	1,340	22,766.60	0.01
315	603813	原尚股份	741	22,682.01	0.01
316	002555	三七互娱	1,100	22,594.00	0.01
317	600909	华安证券	3,100	22,537.00	0.01
318	600482	中国动力	900	22,329.00	0.01
319	002174	游族网络	1,000	22,300.00	0.01
320	600737	中粮糖业	2,800	22,260.00	0.01
321	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
322	603721	中广天择	796	22,136.76	0.01
323	002558	巨人网络	600	22,080.00	0.01
324	600021	上海电力	2,400	21,936.00	0.01
325	300133	华策影视	2,000	21,680.00	0.01
326	601958	金钼股份	2,900	20,967.00	0.01
327	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
328	300669	沪宁股份	841	20,537.22	0.01
329	600372	中航电子	1,500	20,535.00	0.01
330	603880	南卫股份	802	20,475.06	0.01
331	002292	奥飞娱乐	1,400	20,006.00	0.01
332	603269	海鸥股份	795	19,827.30	0.01
333	603617	君禾股份	832	19,809.92	0.01
334	603331	百达精工	999	19,800.18	0.01
335	600446	金证股份	1,300	19,682.00	0.01
336	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.01
337	000961	中南建设	3,000	19,230.00	0.01

338	603727	博迈科	804	18,789.48	0.01
339	000718	苏宁环球	4,300	18,619.00	0.01
340	002424	贵州百灵	1,200	18,480.00	0.01
341	000738	航发控制	1,200	18,348.00	0.01
342	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.01
343	601881	中国银河	1,700	17,867.00	0.01
344	002923	润都股份	954	16,227.54	0.01
345	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01
346	600188	兖州煤业	1,100	15,972.00	0.01
347	601611	中国核建	1,500	15,405.00	0.01
348	600233	圆通速递	900	15,075.00	0.01
349	601375	中原证券	2,400	14,808.00	0.01
350	600926	杭州银行	1,200	13,836.00	0.01
351	603466	风语筑	227	12,307.94	0.01
352	601163	三角轮胎	600	12,228.00	0.01
353	600903	贵州燃气	715	12,054.90	0.01
354	300684	中石科技	827	11,528.38	0.01
355	603619	中曼石油	299	10,399.22	0.01
356	300723	一品红	281	10,082.28	0.01
357	600978	宜华生活	1,100	10,054.00	0.01
358	603605	珀莱雅	347	9,965.84	0.00
359	002913	奥士康	193	9,258.21	0.00
360	603367	辰欣药业	433	8,582.06	0.00
361	002918	蒙娜丽莎	152	8,466.40	0.00
362	601127	小康股份	400	8,044.00	0.00
363	603507	振江股份	199	7,999.80	0.00
364	000587	金洲慈航	1,100	7,700.00	0.00
365	300718	长盛轴承	185	7,449.95	0.00
366	002839	张家港行	600	7,032.00	0.00
367	603083	剑桥科技	144	6,809.76	0.00
368	002911	佛燃股份	239	6,507.97	0.00
369	603278	大业股份	264	6,095.76	0.00
370	603607	京华激光	134	5,453.80	0.00
371	603858	步长制药	100	5,086.00	0.00
372	603848	好太太	210	4,764.90	0.00
373	603916	苏博特	274	4,701.84	0.00
374	603661	恒林股份	67	4,589.50	0.00
375	603856	东宏股份	223	4,587.11	0.00
376	603937	丽岛新材	172	4,513.28	0.00

377	601086	国芳集团	547	4,474.46	0.00
378	603829	洛凯股份	234	4,230.72	0.00
379	603157	拉夏贝尔	235	4,180.65	0.00
380	603922	金鸿顺	136	3,812.08	0.00
381	002910	庄园牧场	179	3,687.40	0.00
382	603722	阿科力	76	3,005.04	0.00
383	603365	水星家纺	129	2,981.19	0.00
384	300726	宏达电子	98	2,832.20	0.00
385	603683	晶华新材	126	2,620.80	0.00
386	603110	东方材料	96	2,541.12	0.00
387	002917	金奥博	72	2,354.40	0.00
388	603809	豪能股份	64	2,306.56	0.00
389	600376	首开股份	240	2,229.60	0.00
390	603378	亚士创能	96	2,196.48	0.00
391	603363	傲农生物	129	2,131.08	0.00
392	603127	昭衍新药	27	1,499.31	0.00
393	603499	翔港科技	60	1,485.00	0.00
394	600933	爱柯迪	90	1,383.30	0.00
395	002864	盘龙药业	44	1,260.60	0.00
396	603970	中农立华	38	1,240.32	0.00
397	603890	春秋电子	29	1,221.77	0.00
398	603912	佳力图	40	1,129.20	0.00
399	300716	国立科技	36	933.12	0.00
400	603685	晨丰科技	19	668.04	0.00

## 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	600021	上海电力	16,250,139.72	7.34
2	600507	方大特钢	15,727,825.74	7.11
3	601328	交通银行	15,250,769.00	6.89
4	600085	同仁堂	14,514,361.76	6.56
5	600795	国电电力	14,375,129.00	6.49
6	600584	长电科技	14,073,476.32	6.36
7	002465	海格通信	13,592,570.02	6.14

8	600498	烽火通信	13,086,727.46	5.91
9	002179	中航光电	12,785,726.02	5.78
10	600019	宝钢股份	12,590,934.34	5.69
11	600208	新湖中宝	12,257,123.00	5.54
12	000018	神州长城	12,233,698.53	5.53
13	601601	中国太保	11,855,525.00	5.36
14	600036	招商银行	11,450,553.37	5.17
15	002739	万达电影	10,806,226.47	4.88
16	002174	游族网络	10,306,719.00	4.66
17	000603	盛达矿业	10,075,763.43	4.55
18	600323	瀚蓝环境	9,904,745.00	4.47
19	002048	宁波华翔	9,446,417.00	4.27
20	002223	鱼跃医疗	9,250,752.78	4.18
21	601166	兴业银行	9,096,578.00	4.11
22	600362	江西铜业	9,069,277.50	4.10
23	000060	中金岭南	9,005,946.13	4.07
24	600856	中天能源	8,996,324.60	4.06
25	600138	中青旅	8,947,585.28	4.04
26	600999	招商证券	8,875,549.00	4.01
27	600572	康恩贝	8,677,211.24	3.92
28	601390	中国中铁	8,676,684.00	3.92
29	002517	恺英网络	8,536,216.00	3.86
30	002366	台海核电	8,525,191.29	3.85
31	603989	艾华集团	8,362,936.67	3.78
32	600266	北京城建	8,274,919.00	3.74
33	603160	汇顶科技	8,274,355.01	3.74
34	600267	海正药业	8,258,759.32	3.73
35	300496	中科创达	8,258,320.01	3.73
36	000012	南玻A	8,226,242.92	3.72
37	600028	中国石化	8,159,254.00	3.69
38	300288	朗玛信息	8,099,094.00	3.66
39	603168	莎普爱思	8,000,614.15	3.61
40	600048	保利地产	7,961,835.00	3.60
41	300498	温氏股份	7,947,807.68	3.59
42	000563	陕国投A	7,936,374.00	3.59
43	600993	马应龙	7,555,160.80	3.41

44	002142	宁波银行	7,496,898.72	3.39
45	300070	碧水源	7,496,826.10	3.39
46	600010	包钢股份	7,409,384.00	3.35
47	002439	启明星辰	7,341,584.09	3.32
48	002185	华天科技	7,337,477.00	3.31
49	600332	白云山	7,194,540.95	3.25
50	000888	峨眉山 A	7,169,233.22	3.24
51	601318	中国平安	7,067,750.08	3.19
52	600428	中远海特	7,057,534.96	3.19
53	000063	中兴通讯	6,858,083.75	3.10
54	001979	招商蛇口	6,807,852.20	3.08
55	600893	航发动力	6,778,383.92	3.06
56	300015	爱尔眼科	6,682,530.22	3.02
57	002436	兴森科技	6,392,720.00	2.89
58	000587	金洲慈航	6,381,750.00	2.88
59	600804	鹏博士	6,357,718.46	2.87
60	600803	新奥股份	6,327,333.00	2.86
61	002221	东华能源	6,326,899.00	2.86
62	600026	中远海能	6,294,652.00	2.84
63	601021	春秋航空	6,282,183.00	2.84
64	000157	中联重科	6,262,932.00	2.83
65	300373	扬杰科技	6,261,279.00	2.83
66	300327	中颖电子	6,261,106.52	2.83
67	601899	紫金矿业	6,238,791.00	2.82
68	601006	大秦铁路	6,197,606.00	2.80
69	603444	吉比特	6,179,094.00	2.79
70	002624	完美世界	6,165,732.53	2.79
71	002405	四维图新	6,158,490.00	2.78
72	603188	亚邦股份	5,984,046.00	2.70
73	601766	中国中车	5,954,943.00	2.69
74	603816	顾家家居	5,906,165.00	2.67
75	600585	海螺水泥	5,852,278.68	2.64
76	300133	华策影视	5,804,468.69	2.62
77	002001	新 和 成	5,763,519.00	2.60
78	000908	景峰医药	5,622,140.42	2.54
79	601098	中南传媒	5,593,161.77	2.53

80	000050	深天马 A	5,579,303.00	2.52
81	300284	苏交科	5,569,338.00	2.52
82	600079	人福医药	5,494,086.00	2.48
83	000902	新洋丰	5,461,535.00	2.47
84	300199	翰宇药业	5,385,206.79	2.43
85	000930	中粮生化	5,381,459.77	2.43
86	002228	合兴包装	5,236,759.00	2.37
87	300203	聚光科技	5,229,854.55	2.36
88	000338	潍柴动力	5,187,879.80	2.34
89	600352	浙江龙盛	5,043,848.00	2.28
90	601186	中国铁建	5,036,839.00	2.28
91	601857	中国石油	4,915,868.00	2.22
92	600325	华发股份	4,907,552.00	2.22
93	600987	航民股份	4,844,912.46	2.19
94	000783	长江证券	4,670,243.00	2.11
95	000166	申万宏源	4,666,416.00	2.11
96	002562	兄弟科技	4,658,807.60	2.10
97	000568	泸州老窖	4,641,991.30	2.10
98	300059	东方财富	4,634,962.00	2.09
99	000825	太钢不锈	4,621,631.00	2.09
100	002410	广联达	4,612,650.61	2.08
101	600256	广汇能源	4,580,743.00	2.07
102	000938	紫光股份	4,570,773.86	2.06
103	002594	比亚迪	4,558,378.00	2.06
104	600887	伊利股份	4,506,251.00	2.04
105	300274	阳光电源	4,502,685.56	2.03
106	600395	盘江股份	4,494,513.00	2.03
107	600527	江南高纤	4,492,809.00	2.03
108	600340	华夏幸福	4,481,597.47	2.02
109	300055	万邦达	4,477,971.63	2.02
110	600521	华海药业	4,456,635.40	2.01
111	601088	中国神华	4,451,332.00	2.01

#### 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	600703	三安光电	19,186,681.04	8.67
2	600507	方大特钢	16,015,531.10	7.24
3	600021	上海电力	15,764,015.00	7.12
4	002179	中航光电	15,307,215.66	6.92
5	600031	三一重工	15,044,612.64	6.80
6	600795	国电电力	14,768,488.00	6.67
7	600085	同仁堂	14,585,122.96	6.59
8	000425	徐工机械	12,932,249.98	5.84
9	601328	交通银行	12,481,211.29	5.64
10	600019	宝钢股份	12,244,715.94	5.53
11	600498	烽火通信	12,075,405.40	5.46
12	002465	海格通信	11,862,993.20	5.36
13	002174	游族网络	11,028,697.29	4.98
14	601601	中国太保	10,885,491.11	4.92
15	000998	隆平高科	10,600,519.25	4.79
16	600362	江西铜业	10,489,584.43	4.74
17	601390	中国中铁	10,387,359.00	4.69
18	002739	万达电影	10,232,396.39	4.62
19	600208	新湖中宝	10,007,350.13	4.52
20	000060	中金岭南	9,794,321.00	4.42
21	600323	瀚蓝环境	9,738,152.00	4.40
22	000018	神州长城	9,674,092.60	4.37
23	000012	南玻A	9,555,089.22	4.32
24	000603	盛达矿业	9,470,786.86	4.28
25	000930	中粮生化	9,369,088.00	4.23
26	300070	碧水源	9,184,930.90	4.15
27	601166	兴业银行	9,181,727.00	4.15
28	002048	宁波华翔	9,172,652.39	4.14
29	002517	恺英网络	9,034,105.00	4.08
30	600873	梅花生物	8,923,297.00	4.03
31	002223	鱼跃医疗	8,765,643.75	3.96
32	300288	朗玛信息	8,591,020.70	3.88
33	600999	招商证券	8,562,306.60	3.87
34	600572	康恩贝	8,540,441.05	3.86
35	600138	中青旅	8,530,936.51	3.85
36	601766	中国中车	8,310,744.00	3.75

37	000902	新洋丰	8,265,844.00	3.73
38	000063	中兴通讯	8,244,491.00	3.72
39	300496	中科创达	8,152,562.63	3.68
40	000563	陕国投 A	8,112,570.00	3.66
41	600048	保利地产	8,050,641.00	3.64
42	600266	北京城建	7,984,711.00	3.61
43	603160	汇顶科技	7,966,132.81	3.60
44	002353	杰瑞股份	7,801,473.32	3.52
45	002366	台海核电	7,789,539.96	3.52
46	600428	中远海特	7,783,736.15	3.52
47	600993	马应龙	7,625,705.00	3.45
48	603168	莎普爱思	7,576,709.50	3.42
49	600267	海正药业	7,437,284.48	3.36
50	600028	中国石化	7,393,309.00	3.34
51	601318	中国平安	7,357,770.00	3.32
52	600010	包钢股份	7,328,450.00	3.31
53	002439	启明星辰	7,273,148.40	3.29
54	002405	四维图新	7,267,018.06	3.28
55	300498	温氏股份	7,065,410.16	3.19
56	002185	华天科技	7,063,190.23	3.19
57	300015	爱尔眼科	6,909,623.23	3.12
58	600340	华夏幸福	6,850,969.77	3.10
59	002624	完美世界	6,770,200.25	3.06
60	600737	中粮糖业	6,744,754.99	3.05
61	000888	峨眉山 A	6,628,391.84	2.99
62	001979	招商蛇口	6,611,767.58	2.99
63	300327	中颖电子	6,593,983.78	2.98
64	000860	顺鑫农业	6,499,561.10	2.94
65	002436	兴森科技	6,335,670.30	2.86
66	000587	金洲慈航	6,229,516.00	2.81
67	600332	白云山	6,199,799.72	2.80
68	600026	中远海能	6,195,002.00	2.80
69	000157	中联重科	6,194,843.00	2.80
70	600804	鹏博士	6,175,181.57	2.79
71	601899	紫金矿业	6,135,807.85	2.77
72	002470	金正大	6,122,797.72	2.77
73	002221	东华能源	6,086,575.00	2.75
74	601021	春秋航空	6,081,769.00	2.75



75	603816	顾家家居	6,007,212.60	2.71
76	603444	吉比特	6,001,808.29	2.71
77	603188	亚邦股份	5,885,910.16	2.66
78	600803	新奥股份	5,861,951.00	2.65
79	601186	中国铁建	5,857,650.47	2.65
80	300133	华策影视	5,730,801.68	2.59
81	000050	深天马 A	5,703,308.02	2.58
82	002001	新 和 成	5,623,376.20	2.54
83	600585	海螺水泥	5,507,137.98	2.49
84	600584	长电科技	5,429,927.46	2.45
85	600893	航发动力	5,426,138.45	2.45
86	600887	伊利股份	5,415,603.22	2.45
87	600057	象屿股份	5,322,204.57	2.40
88	002228	合兴包装	5,321,487.64	2.40
89	601678	滨化股份	5,284,424.00	2.39
90	300203	聚光科技	5,160,787.21	2.33
91	300284	苏交科	5,092,156.64	2.30
92	300274	阳光电源	5,071,451.00	2.29
93	601088	中国神华	5,068,016.00	2.29
94	000908	景峰医药	4,981,893.64	2.25
95	601098	中南传媒	4,879,989.37	2.20
96	002304	洋河股份	4,875,920.00	2.20
97	000338	潍柴动力	4,856,765.46	2.19
98	300199	翰宇药业	4,761,781.68	2.15
99	600079	人福医药	4,723,142.00	2.13
100	600987	航民股份	4,717,369.22	2.13
101	002273	水晶光电	4,710,044.00	2.13
102	002562	兄弟科技	4,672,297.70	2.11
103	600516	方大炭素	4,663,733.96	2.11
104	002594	比亚迪	4,656,950.89	2.10
105	300059	东方财富	4,624,149.52	2.09
106	600108	亚盛集团	4,550,564.00	2.06
107	300055	万邦达	4,496,728.60	2.03
108	000825	太钢不锈	4,494,269.00	2.03
109	000166	申万宏源	4,490,838.00	2.03
110	600395	盘江股份	4,453,741.00	2.01

**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	1,409,208,580.29
卖出股票收入（成交）总额	1,439,977,441.19

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	11,209,161.00	5.60
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）	748,600.00	0.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,957,761.00	5.97

**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	112,260	11,209,161.00	5.60
2	128024	宁行转债	7,468	746,800.00	0.37
3	123005	万信转债	18	1,800.00	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述三只债券。

**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。

**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

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	159,572.87
2	应收证券清算款	219,231.79
3	应收股利	—
4	应收利息	256,552.94
5	应收申购款	15.98
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	635,373.58

#### **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**

注：报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### **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
20,320	11,794.23	18,262,937.00	7.62%	221,395,789.46	92.38%

### 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	3,743,978.00	1.65%
2	天津珍熙美容实业有限公司	3,656,580.00	1.61%
3	杨京京	3,238,471.00	1.43%
4	联想投资有限公司	2,820,613.00	1.24%
5	黄爱萍	2,350,766.00	1.04%
6	北京朝熙物业管理有限公司	2,258,866.00	1.00%
7	北京首创能达投资开发有限公司	2,021,683.00	0.89%
8	陈润和	1,871,989.00	0.83%
9	浙江省工艺品进出口有限公司	1,682,169.00	0.74%
10	章禾	1,581,846.00	0.70%

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	0.00	0.0000%

### 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（ 2014 年 11 月 5 日 ）基金份额总额	3,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	284,096,789.13
本报告期基金总申购份额	3,483,452.14
减:本报告期基金总赎回份额	47,921,514.81
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	239,658,726.46

## § 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 23 日起，王超同志兼任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。

#### 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，报告期内共支付安永华明会计师事务所审计费用 60,000.00 元。该审计机构已提供审计服务的连续年限为 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

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	
银河证券	2	1,919,524,756.84	67.50%	1,787,661.78	68.05%	—
长江证券	2	306,578,859.90	10.78%	285,518.66	10.87%	—
国泰君安	2	304,492,338.25	10.71%	283,576.12	10.80%	—
中泰证券	1	205,620,444.74	7.23%	191,495.56	7.29%	—
天风证券	1	107,524,402.05	3.78%	78,632.65	2.99%	—
中原证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	1	—	—	—	—	—
联讯证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
国元证券	2	—	—	—	—	—
渤海证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
中信证券	2	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—



东北证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	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
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	11,220,287.00	100.00%	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

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要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

## 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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	天风证券	上海	1
2	财富证券	上海	1

(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	日信证券	上海	1

## 11.8 其他重大事件

除上述事项外，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项如下：

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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2017 年 12 月 30 日
2	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书更新（摘要）	同上	2017 年 12 月 20 日
3	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书更新	同上	2017 年 12 月 20 日
4	长盛基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司销售旗下部分基金并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2017 年 11 月 25 日
5	长盛基金管理有限公司关于撤销杭州分公司的公告	同上	2017 年 11 月 17 日
6	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2017 年第三季度报告	同上	2017 年 10 月 27 日
7	长盛基金管理有限公司关于调整长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理的公告	同上	2017 年 10 月 25 日
8	长盛基金管理有限公司关于增加挖财金融为旗下部分基金销售机	同上	2017 年 10 月 20 日

	构并推出定投业务和参加费率优惠活动的公告		
9	长盛基金管理有限公司关于增加北京格上富信基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定投、转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2017 年 9 月 28 日
10	长盛基金管理有限公司关于旗下基金在上海大智慧财富管理有限公司开通定投业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2017 年 9 月 12 日
11	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加和讯信息为销售机构并推出转换的公告	同上	2017 年 8 月 31 日
12	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中泰证券申购（含定投）费率优惠活动的公告	同上	2017 年 8 月 29 日
13	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2017 年半年度报告	同上	2017 年 8 月 24 日
14	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2017 年半年度报告 摘要	同上	2017 年 8 月 24 日
15	长盛基金管理有限公司关于降低旗下开放式基金申购、定期定额申购业务单笔最低金额要求的公告	同上	2017 年 7 月 27 日
16	长盛基金管理有限公司关于旗下	同上	2017 年 7 月 26 日

	基金增加和谐保险为销售机构并推出定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告		
17	长盛基金管理有限公司关于增加凤凰金信（银川）投资管理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 7 月 25 日
18	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2017 年第 2 季度报告	同上	2017 年 7 月 19 日
19	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行网上银行渠道基金申购投资手续费率优惠活动的公告	同上	2017 年 7 月 4 日
20	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 7 月 1 日
21	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	同上	2017 年 6 月 29 日
22	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金 (lof) 招募说明书更新	同上	2017 年 6 月 17 日
23	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金 (lof) 招募说明书更新摘要	同上	2017 年 6 月 17 日
24	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	同上	2017 年 4 月 27 日

	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		
25	长盛同盛成长优选灵活配置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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 2016 年度报告	同上	2017 年 3 月 27 日
31	长盛同盛成长优选灵活配置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
32	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
33	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 23 日
34	长盛基金管理有限公司关于增加	同上	2017 年 3 月 21 日

	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		
35	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
36	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
37	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
38	长盛同盛成长优选灵活配置混合 型证券投资基金 (LOF) 2016 年第 4 季度报告	同上	2017 年 1 月 21 日

## § 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

注：本基金本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。



## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《同盛证券投资基金基金合同》；
- 3、《同盛证券投资基金托管协议》；
- 4、《同盛证券投资基金招募说明书》；
- 5、《关于准予同盛证券投资基金变更注册的批复》
- 6、《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 7、《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 8、《长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 9、法律意见书；
- 10、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 11、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 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。

### 13.3 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

2018 年 3 月 31 日