

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 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
	联系电话	010-82019988
	电子邮箱	yejs@csfunds. com. cn
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	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

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管理转型而来，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%
自基金转型起至今	-9.72%	1.97%	37.51%	0.85%	-47.23%	1.12%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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

基准指数的构建考虑了三个原则：

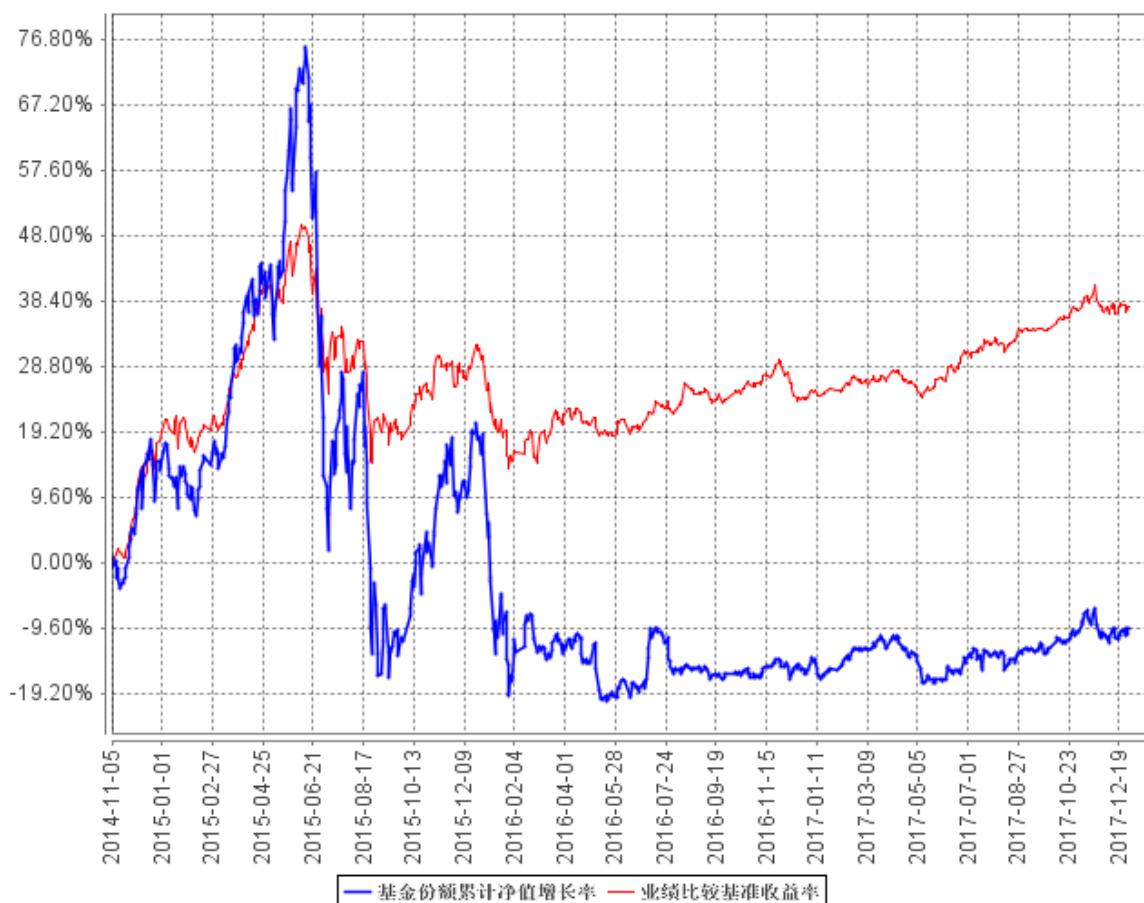
1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证全债指数。目前沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准较为合适。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可使业绩比较更具有合理性。

3、再平衡。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 50%、50% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



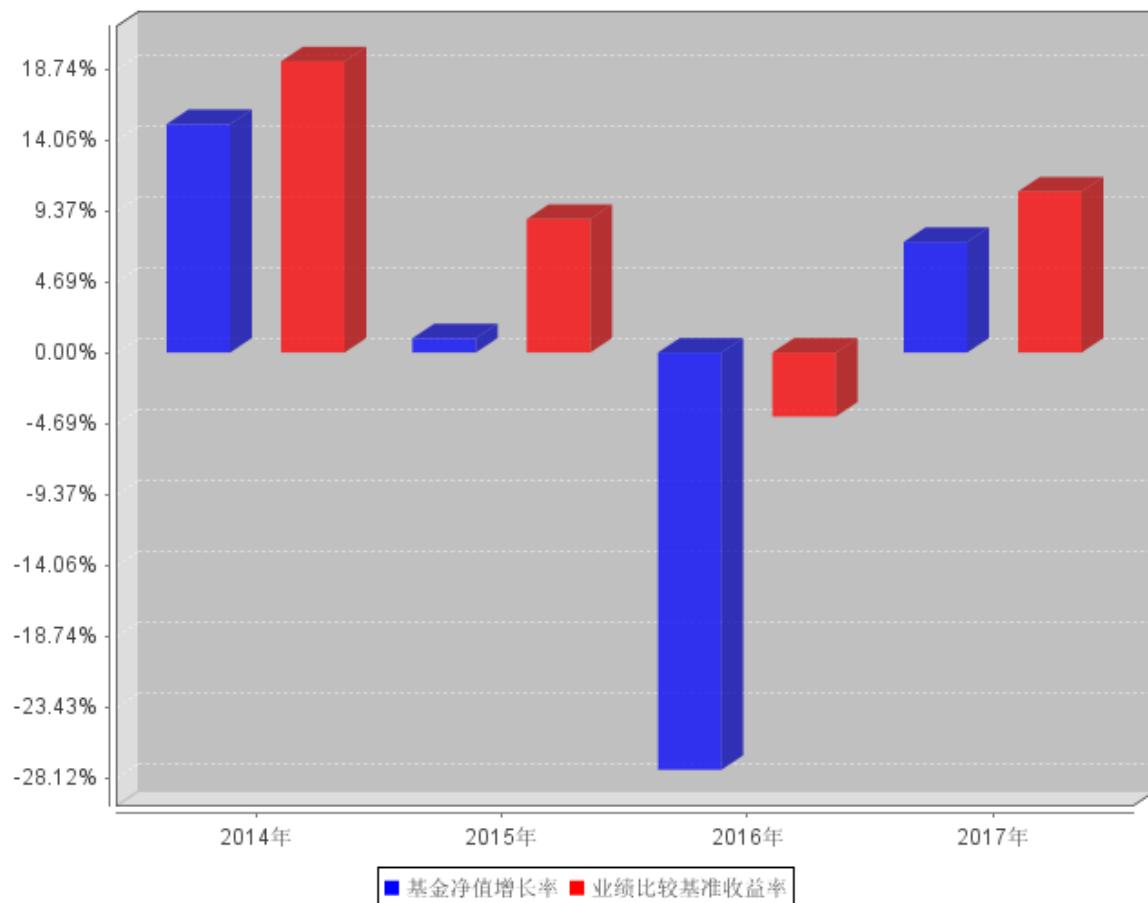
注：1、长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同盛证券投资基金管理转型而来，

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管理人，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管理人，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	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。

	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执行交易公平执行，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执行公平交易，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。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛同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的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 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、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\_A11 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	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	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	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	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	219,231.79	—
应收利息	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	—	—
资产总计	207,874,027.37	229,129,018.41
<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	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	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	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	192, 028, 216. 40	227, 634, 586. 87
未分配利润	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	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	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	11, 484, 414. 21	-50, 912, 562. 13
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	2, 180, 146. 50	811, 327. 90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	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）	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	3, 172, 411. 24	3, 985, 758. 75

2. 托管费	528,735.13	664,293.06
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	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	401,707.79	407,264.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>14,960,385.86</b>	<b>-106,751,708.17</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>14,960,385.86</b>	<b>-106,751,708.17</b>

### 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	290,696,718.23	99,529,198.16	390,225,916.39

金净值)			
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管理(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管理有关事项的议案》，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管理变更注册的批复》(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《同盛证券投资基金管理合同》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管理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 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 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。

#### 7.4.8 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 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

###### 7.4.8.2.2 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

##### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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。

#### 7.4.8.5 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	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。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本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。

#### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.9 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

7.4.12.1.1 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	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-

		日	5 日								
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	-

#### 7.4.9.2 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	重大事项停牌	11.40	-	-	27,019	333,631.23	308,016.60	-

		日								
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。

#### 7.4.9.3 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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

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	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

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	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	盈江股份	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前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## **8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

### **8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期内未投资股指期货。

## **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期内未投资国债期货。

### **8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### **8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期内未投资国债期货。

## **8.12 投资组合报告附注**

### **8.12.1**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### **8.12.2**

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) 研发发展部、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

## § 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。

长盛基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日