长盛添利宝货币市场基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛添利宝货币	
基金主代码	000424	
交易代码	000424	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年12月9日	
报告期末基金份额总额	8,921,291,323.37份	
投资目标	以有效控制投资风险和保持较高流动性为优先目标,力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	本基金在短期市场利率预期策略的基础上,综合运用期限结构的滚动配置策略、投资组合优化策略和无风险套利操作策略,通过比较各类短期因记收益工具如央行票据、债券、短期融资券、银行存款、债券回购等投资品种在流动性、收益率水平和风险参数等指标的差异,确定这些投资品种的合理配置比例,以保证投资组合在低风险的前提下尽可能提高组合收益率。	
业绩比较基准	七天通知存款税后利率	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长盛添利宝货币A	长盛添利宝货币B
下属分级基金的交易代码	000424	000425
报告期末下属分级基金的份额总额	404,403,095.07份	8,516,988,228.30份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)	
	长盛添利宝货币A	长盛添利宝货币B
1. 本期已实现收益	1,964,504.18	97,990,460.55
2. 本期利润	1,964,504.18	97,990,460.55
3. 期末基金资产净值	404,403,095.07	8,516,988,228.30

注:1、所列数据截止到2017年3月31日。

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛添利宝货币A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7639%	0.0012%	0.3329%	0.0000%	0.4310%	0.0012%

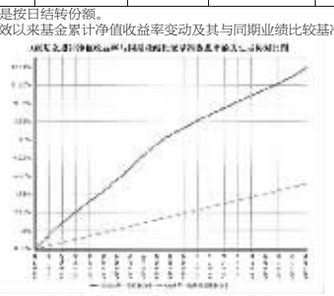
注:本基金收益分配是按日结转份额。

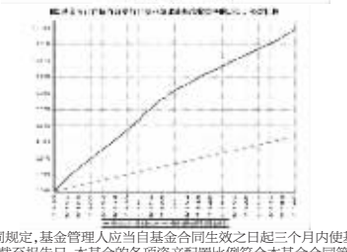
长盛添利宝货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8246%	0.0012%	0.3329%	0.0000%	0.4917%	0.0012%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:按照本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起三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本基金合同第十二部分、第二条投资范围、第五条投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张帆	本基金基金经理,长盛同禧债券型证券投资基金基金经理,长盛同丰债券型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛同禧债券型证券投资基金基金经理,长盛同裕纯债债券型证券投资基金基金经理,长盛同裕债券型证券投资基金基金经理,养老金业务部负责人。	2013年12月9日	-	10年	张帆先生,1983年1月出生。华中科技大学硕士,曾在长江证券股份有限公司从事债券研究,债券投资工作。2012年4月加入长盛基金管理有限公司,曾任非银用研究员,长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理等职务。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内行情回顾

回顾一季度,国内经济相对平稳,工业企业利润同比有所改善。通胀方面,食品价格稳中有落,中上游涨价推动PPI同比继续上行,但工业品供给改善导致价格逐步趋弱。受汇率、资产价格以及金融监管去杠杆等因素制约,货币政策更趋于稳健,一季度央行两次上调公开市场操作利率,资金面总体呈现中性偏紧局面。

在海内外经济和政策等多重因素影响下,债券市场延续了去年四季度以来的调整走势,收益率曲线整体上行,10年期国开债一度上行至4.21%的近期高点;3月中下旬以来,受美国加息落地、短期市场情绪回暖、地产调控加码、通胀预期回落等因素影响,现券利率有所下行,债市出现一波交易行情。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金始终控制资产配置节奏,优化持仓结构,保持组合流动性,合理调整协存和债券配置比例,努力提高组合整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017年1季度,本基金A级净值收益率为0.7639%,B级净值收益率为0.8246%,同期业绩比较基准收益率0.3329%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	3,745,920,327.55	40.88
	其中:债券	3,745,920,327.55	40.88
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	962,628,228.80	10.40
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	3,396,798,489.78	37.06
4	其他资产	1,067,857,263.25	11.66
5	合计	9,162,094,309.38	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.36	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	236,769,244.86	2.65
	其中:买断式回购融资	-	

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注:本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	57
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本基金本报告期内投资组合平均剩余期限无超过120天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	42.01	2.65
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	26.48	-
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	14.10	-
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	8.14	-
	其中:剩余存续期超过30天的浮动利率债	-	-
合计		90.73	2.65

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:报告期内无投资组合平均剩余存续期超过240天情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	29,966,228.51	0.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	580,027,982.62	6.50
	其中:政策性金融债	580,027,982.62	6.50
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	299,987,509.11	3.36
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,835,938,610.31	31.79
8	其他	-	-
9	合计	3,745,920,327.55	41.99
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	160414	16农发14	2,000,000	199,981,626.16	2.24
2	111594668	17天津农村商业银行CD113	2,000,000	199,311,526.74	2.23
3	111619200	16恒丰银行CD200	2,000,000	198,955,611.20	2.23
4	140208	14国开08	1,800,000	180,076,503.00	2.02
5	011756003	17鲁高速SCP001	1,500,000	149,995,008.93	1.68
6	011758004	17津融商SCP001	1,500,000	149,992,500.18	1.68
7	160304	16进出04	1,400,000	139,962,324.83	1.57
8	111613116	16浙商CD116	1,000,000	100,000,000.00	1.12
9	111698916	16中原银行CD123	1,000,000	99,808,814.38	1.12
10	111715063	17民生银行CD063	1,000,000	99,751,507.56	1.12

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	-0.0277%
报告期内偏离度的最低值	-0.0707%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0541%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.9.2

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

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	38,998,060.90
4	应收申购款	1,028,859,212.35
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,067,857,263.25

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长盛添利宝货币A	长盛添利宝货币B
报告期初基金份额总额	1,246,549,936.84	24,307,701,881.17
报告期间基金总申购份额	385,586,306.18	14,171,766,391.38
报告期间基金总赎回份额	1,226,733,137.95	29,962,480,044.06
报告期末基金份额总额	404,403,095.07	8,516,988,228.30

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2017年1月12日	30,000,000.00	30,000,000.00	-
2	赎回	2017年1月13日	30,000,000.00	30,000,000.00	-
合计			60,000,000.00	60,000,000.00	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会关于核准长盛添利宝货币市场基金基金合同的批复;

2、《长盛添利宝货币市场基金基金合同》;

3、《长盛添利宝货币市场基金托管协议》;

4、《长盛添利宝货币市场基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666,010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2017年4月22日

长盛同德主题增长混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同德主题增长
基金主代码	519039
交易代码	519039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月25日
报告期末基金份额总额	1,146,473,060.50份
投资目标	本基金投资目标是在确定促进中国经济持续增长的主题背景下,挖掘中国经济持续增长的动力之所在,选取具有较高成长性和盈利能力等特征的上市公司,给予中国经济高速增长的成果产生产业所带来投资风险所需具备竞争力的稳定增值。
投资策略	本基金将将看全球化、城镇化、消费升级、制度变革四大主题进行大类资产配置;根据企业获利能力、增长能力、资产回报率、资产管理能力等定量指标,结合公司的规范程序状况等定性指标对行业内上市公司进行综合评价,动态的寻找行业与个股的最佳结合点。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	15,964,760.77
2.本期利润	72,837,823.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0623
4.期末基金资产净值	1,668,208,737.09
5.期末基金份额净值	1.4551

注:1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2017年3月31日。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.46%	0.54%	3.58%	0.41%	0.87%	0.13%

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

注:本基金由同德证券投资基金转型而来,转型日为2007年10月25日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
乔林建	本基金基金经理,长盛动态精选证券投资基金基金经理,长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金经理,权益投资部执行总监。	2016年1月6日	-	14年	乔林建先生,1976年1月出生。经济学硕士。历任泰信人寿保险公司财务员、投资经理,新华资产管理公司高级投资经理,建信基金管理公司资深投资经理、基金经理助理、基金经理。2015年6月加入长盛基金管理有限公司。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1 日、3 日、5 日的交易片段进行T 检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年一季度自开年下跌以来,从1月底到2月底走出了一波单边上涨。从2月底到3月底市场横向震荡,但多个板块此起彼伏,市场热点层出不穷。本基金严格遵守为投资人贡献长期稳定回报的绝对收益策略,结合自上而下行业选择和自下而上的选股,抓住了工程机械,油服装备,化工等细分子行业公司的投资机会,并在3月份的市场相对高点处大部分获利了解。由于我们对行情维持相对谨慎的看法,本基金的仓位一直保持中性偏低的位置,没有将选股和选时的进攻性发挥到最大,是本基金在一季度操作过程中值得总结和吸取教训的。

我们在3月下旬将部分仓位从前期获利的品种调整到通讯设备,医疗,建筑,环保等前期滞涨或调整相对比较充分的品种,在防守中等待机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为0.8490元,本报告期份额净值增长率为2.59%,同期本基金业绩比较基准收益率为2.96%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,430,118,647.39	85.11
	其中:股票	1,430,118,647.39	85.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	248,687,278.51	14.80
8	其他资产	1,629,311.62	0.10
9	合计	1,680,435,237.52	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	35,994,049.75	2.16
B	采矿业	107,658,357.77	6.45
C	制造业	1,003,935,113.89	60.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,239,359.10	2.71
E	建筑业	212,404.44	0.01
F	批发和零售业	62,106,767.34	3.72
G	交通运输、仓储和邮政业	131,314.89	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,102,251.20	0.13
J	金融业	50,690,000.00	3.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	57,665,997.60	3.46
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	64,377,101.25	3.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,430,118,647.39	85.73

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	1,584,486	68,132,898.00	4.08
2	002304	洋河股份	699,723	61,141,756.74	3.67
3	601888	中国国旅	1,017,040	57,655,997.60	3.46
4	002241	歌尔股份	1,625,387	55,328,173.48	3.32
5	300408	三环集团	2,699,817	53,483,374.77	3.21
6	601225	陕西煤业	8,242,630	50,939,453.40	3.05
7	600109	国金证券	3,700,000	50,690,000.00	3.04
8	002573	清新环境	2,539,541	49,146,153.76	2.95
9	002450	康得新	2,566,400	49,069,168.00	2.94
10	600886	中天能源	4,106,306	45,239,384.10	2.71

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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

5.11.2

基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	387,638.15
2	应收证券清算款	7,415,041.13
3	应收股利	-
4	应收利息	47,798.69
5	应收申购款	398.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,850,857.39

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,184,331,313.08
报告期期间基金总申购份额	1,618,581.42
减:报告期期间基金总赎回份额	39,476,834.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,146,473,060.50

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证券监督管理委员会关于核准同德证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复;

2、《长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金合同》;

3、《长盛同德主题增长混合型证券投资基金托管协议》;

4、《长盛同德主题增长混合型证券投资基金招募说明书》;

5、法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所及/或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-888-2666,010-62350088。

网址:http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2017年4月22日

长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)

【2017】第一季度报告

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛同智优势成长(LOF)
场内简称	长盛同智
基金主代码	160805
交易代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1月5日
报告期末基金份额总额	869,437,496.97份
投资目标	主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司,所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下,谋求基金资产增值和取益的最大化。
投资策略	本基金为主动管理的混合型基金,对各类资产采取选度灵活的资产配置,主要选股思路是采用自上而下的路径,投资策略上偏重选股能力的发挥。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益-较高预期风险的产品,其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	22,357,919.43
2.本期利润	19,087,635.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0216
4.期末基金资产净值	738,187,664.12
5.期末基金份额净值	0.8490

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、所列数据截止到2017年3月31日。

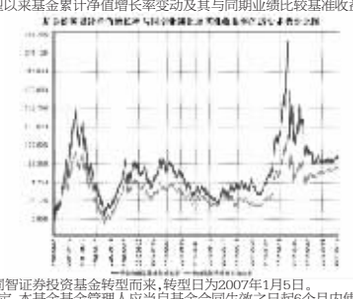
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.59%	0.47%	2.96%	0.34%	-0.37%	0.13%

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



注:1、本基金由同智证券投资基金转型而来,转型日为2007年1月5日。

2、按基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十五条(二)投资范围、(六)投资禁止行为与限制的有关约定。本报告期内,本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴博文	本基金基金经理,长盛同盛成长优选混合型证券投资基金(LOF)基金经理,长盛同合改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016年1月6日	-	9年	吴博文先生,1983年6月出生。北京大学金融学硕士。历任恒泰证券证券投资分有限公司分析师助理