

# 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF） 2018 年年度报告

2018 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 29 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 28 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，普华永道中天会计师事务所（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 2018 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                         | 5         |
| 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                       | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 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       | 14        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 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 | 15        |
| 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       | 15        |
| <b>§6 审计报告</b>                          | <b>16</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 16        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 16        |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | <b>18</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 18        |
| 7.2 利润表                                 | 19        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 20        |
| 7.4 报表附注                                | 21        |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 45        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 45        |
| 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       | 46        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 62        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 63        |
| 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      | 64        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细    | 64        |
| 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   | 64        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 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.....  | 64        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....           | 64        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....           | 64        |
| 8.12 投资组合报告附注.....                       | 65        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                | <b>68</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....               | 68        |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人.....                    | 68        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....            | 68        |
| 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.....   | 68        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>69</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                  | <b>70</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                    | 70        |
| 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.....    | 70        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....         | 70        |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                      | 70        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....               | 70        |
| 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.....       | 70        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....              | 70        |
| 11.8 其他重大事件 .....                        | 73        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>           | <b>75</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 ..... | 75        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 75        |
| <b>§13 备查文件目录 .....</b>                  | <b>76</b> |
| 13.1 备查文件目录.....                         | 76        |
| 13.2 存放地点.....                           | 76        |
| 13.3 查阅方式.....                           | 76        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                           |
|--------------|---------------------------|
| 基金名称         | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF） |
| 基金简称         | 长盛同庆中证 800 指数（LOF）        |
| 场内简称         | 长盛同庆                      |
| 基金主代码        | 160806                    |
| 基金运作方式       | 契约型开放式                    |
| 基金合同生效日      | 2015 年 5 月 22 日           |
| 基金管理人        | 长盛基金管理有限公司                |
| 基金托管人        | 中国建设银行股份有限公司              |
| 报告期末基金份额总额   | 97,526,920.54 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         | 2015 年 8 月 6 日            |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                             |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内，以实现中证 800 指数的有效跟踪。                                            |
| 投资策略   | 本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率（税后）}$                                                                                       |
| 风险收益特征 | 本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。                                                                                             |

### 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                   | 中国建设银行股份有限公司         |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 张利宁                          | 田青                   |
|         | 联系电话 | 010-86497608                 | 010-67595096         |
|         | 电子邮箱 | zhangln@csfunds.com.cn       | tianqing1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话  |      | 400-888-2666<br>010-86497888 | 010-67595096         |
| 传真      |      | 010-86497999                 | 010-66275853         |

|       |                                   |                       |
|-------|-----------------------------------|-----------------------|
| 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         | 北京市西城区金融大街 25 号       |
| 办公地址  | 北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码  | 100029                            | 100033                |
| 法定代表人 | 周兵                                | 田国立                   |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                   |
|---------------------|-------------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》                                                           |
| 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          | 基金管理人和基金托管人的办公地址                                                  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                    |
|--------|----------------------|-------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 |
| 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 | 2018 年         | 2017 年         | 2016 年         |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期已实现收益       | -1,732,712.98  | 4,367,883.47   | -2,180,083.28  |
| 本期利润          | -33,002,879.96 | 23,577,895.28  | -32,796,159.37 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.3312        | 0.2012         | -0.2086        |
| 本期加权平均净值利润率   | -25.31%        | 15.06%         | -17.25%        |
| 本期基金份额净值增长率   | -23.10%        | 16.43%         | -12.29%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年末        | 2017 年末        | 2016 年末        |
| 期末可供分配利润      | 4,252,861.92   | 39,339,222.22  | 22,809,386.78  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0436         | 0.3781         | 0.1742         |
| 期末基金资产净值      | 108,422,396.63 | 150,482,345.90 | 162,664,226.07 |
| 期末基金份额净值      | 1.112          | 1.446          | 1.242          |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2018 年末        | 2017 年末        | 2016 年末        |
| 基金份额累计净值增长率   | -38.02%        | -19.40%        | -30.77%        |

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 2018 年 12 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。

4、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为 2015 年 5 月 22 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    | -11.39%  | 1.54%       | -11.98%    | 1.58%         | 0.59% | -0.04% |
| 过去六个月    | -12.85%  | 1.40%       | -14.90%    | 1.42%         | 2.05% | -0.02% |
| 过去一年     | -23.10%  | 1.27%       | -26.08%    | 1.27%         | 2.98% | 0.00%  |
| 过去三年     | -21.47%  | 1.20%       | -25.93%    | 1.17%         | 4.46% | 0.03%  |
| 自基金转型起至今 | -38.02%  | 1.65%       | -41.47%    | 1.55%         | 3.45% | 0.10%  |

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

第 7 页 共 76 页

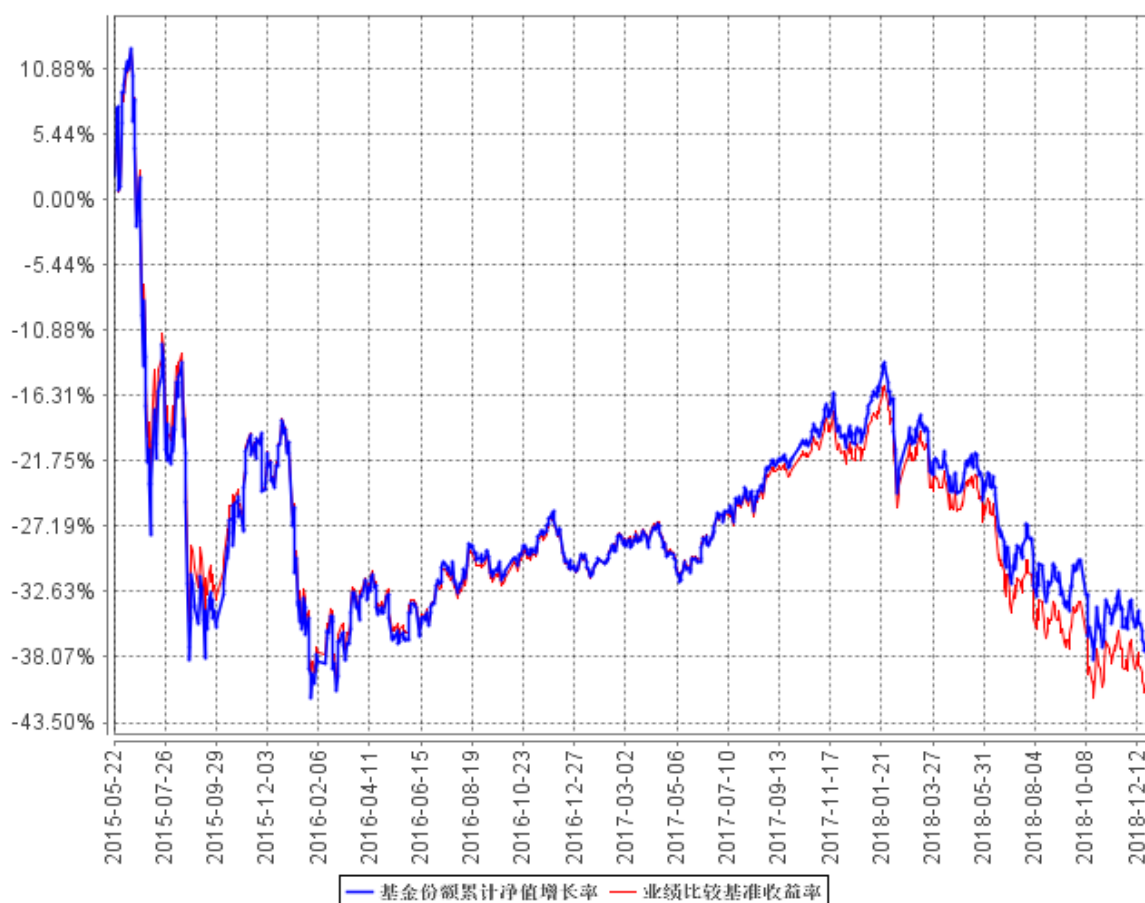
本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率（税后）}$

本基金为指数型基金，股票资产跟踪的标的指数为中证 800 指数。中证 800 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数。其成份股由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。

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 95%、5% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



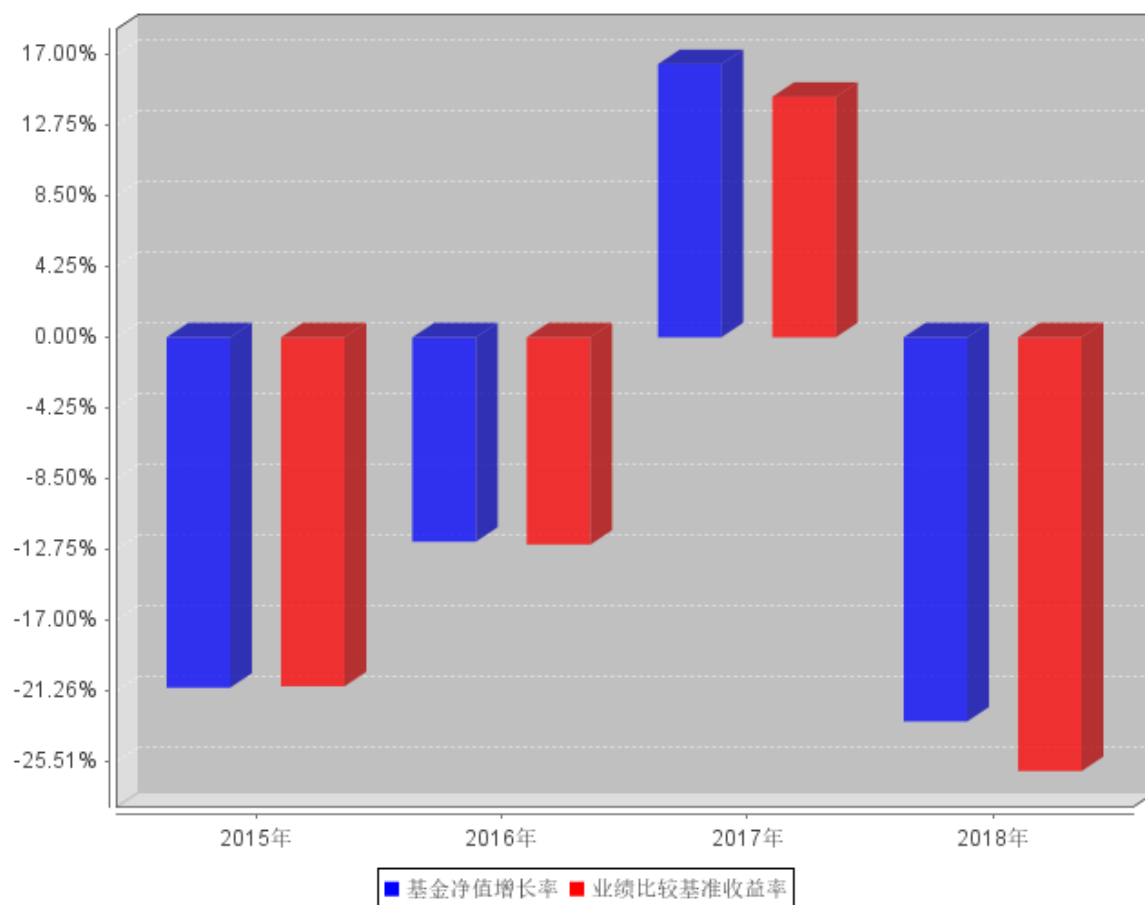
注：1、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为 2015 年 5 月 22 日。

2、按照本基金合同规定，本基金将在基金合同生效 3 个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金的各项资产配置比例符合本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：本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，转型日（即基金合同生效日）为 2015 年 5 月 22 日。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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，在深圳设有营销中心，并拥有长盛基金（香港）有限公司、长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。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%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格。截至 2018 年 12 月 31 日，基金管理人共管理五十八只开放式基金，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<br>经理（助理）期限   |          | 证券从<br>业年限 | 说明                                                                                                  |
|----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|----------|------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                                                                                                                                                                                                                           | 任职日<br>期              | 离任日<br>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，长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金经理，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理，长盛多因子策略优选股票型证券投资基金基金经理。 | 2015<br>年 5 月<br>22 日 | -        | 11 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。 |

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合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。具体如下：

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

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

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

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易

成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略，尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响，将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

##### 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 1.112 元；本报告期基金份额净值增长率为-23.10%，业绩比较基准收益率为-26.08%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为 0.06%，控制在 0.35% 之内；年化跟踪误差为 1.12%，控制在 4% 之内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全年股票市场呈现震荡下跌走势，个股和行业分化严重。行业上，休闲服务、银行表现相对较好，跌幅较小，电子、有色金属和传媒等行业表现较差。风格上，低市净率、低市盈率、大盘股等风格表现相对较好，跌幅较小，微利股、亏损股和高市盈率股等风格表现较差。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

#### 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，由独立于业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产的运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时督促相关部门改进，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、合规考试等多种形式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，深化员工合规理念，提高员工合规意识，改善员工合规工作技能，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规章建设，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，及时督促业务部门调整相关业务制度与流程，保证公司制度规章的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司新订或修订了《公司基金从业人员从业资格管理规定》

《公司非居民金融账户涉税信息收集及信息报送制度》《长盛基金管理有限公司投资管理制度》《长盛基金管理有限公司关联交易管理制度》《长盛基金管理有限公司员工合规手册》《公司投研体系重大突发事件快速响应流程》《公司场内期权投资管理办法》《公司投资产品风险评级管理制度》《公司及员工廉洁从业管理规定》等多部制度或流程。

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》的规定，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，严肃制度规章执行力，合理保障公司运营及受托资产投资运作合规。报告期内，公司监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核四十余项，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、产品开发、员工行为等。此外，根据业务发展需要、监管机构通报的业内问题，以及公司在日常监督中发现的问题，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，合理保障公司及受托资产合规、稳健运作。

5、积极参与新产品设计、新业务拓展工作，提供合规意见或建议。

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债金融估值中心有限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。

#### **4.7.1 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定,本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至截至 2018 年 12 月 31 日,期末可供分配利润为 4,252,861.92 元,其中,未分配利润已实现部分为 84,335,391.56 元,未分配利润未实现部分为-80,082,529.64 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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     | 普华永道中天审字(2019)第 22259 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         | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 审计意见            | 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。                                                                                                                                                |
| 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。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。<br>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。                                                                                                                                                                   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)的基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。<br>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长盛同庆中证 800 指数基金(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，除非基金管理人管理层计划清算长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。<br>基金管理人治理层负责监督长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)的财务报告过程。 |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | 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                                                                                                                                                                                                                                     |



|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |     |
|-----------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|           | <p>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>(一) 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>(二) 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>(三) 评价基金管理人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>(四) 对基金管理人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庆中证 800 指数基金(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庆中证 800 指数基金(LOF)不能持续经营。</p> <p>(五) 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>我们与基金管理人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 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |     |
| 注册会计师的姓名  | 薛竞                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 叶尔甸 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 · 上海市                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |     |
| 审计报告日期    | 2019 年 3 月 27 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |     |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 11,659,812.87                   | 9,737,947.25                     |
| 结算备付金           |            | -                               | -                                |
| 存出保证金           |            | 3,241.89                        | 4,482.17                         |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 98,320,603.44                   | 142,405,953.34                   |
| 其中：股票投资         |            | 98,302,594.54                   | 142,223,995.80                   |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 18,008.90                       | 181,957.54                       |
| 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         |            | -                               | -                                |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 2,306.85                        | 2,060.66                         |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 634.85                          | 640.08                           |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 109,986,599.90                  | 152,151,083.50                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 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         |            | -                               | -                                |
| 应付赎回款           |            | 6,168.14                        | 66,317.11                        |
| 应付管理人报酬         |            | 94,979.88                       | 128,111.79                       |
| 应付托管费           |            | 20,895.56                       | 28,184.60                        |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 4,601.84                        | 8,337.38                         |
| 应交税费            |            | -                               | -                                |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | -              | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 1,437,557.85   | 1,437,786.72   |
| 负债合计          |          | 1,564,203.27   | 1,668,737.60   |
| <b>所有者权益:</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 104,169,534.71 | 111,143,123.68 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 4,252,861.92   | 39,339,222.22  |
| 所有者权益合计       |          | 108,422,396.63 | 150,482,345.90 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 109,986,599.90 | 152,151,083.50 |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.112 元，基金份额总额 97,526,920.54 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | -30,967,421.08                            | 25,957,981.03                                  |
| 1.利息收入                |            | 85,082.85                                 | 93,207.28                                      |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11   | 84,978.21                                 | 93,129.58                                      |
| 债券利息收入                |            | 104.64                                    | 77.70                                          |
| 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）      |            | 208,109.16                                | 6,617,018.23                                   |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12   | -2,224,616.30                             | 4,177,515.37                                   |
| 基金投资收益                |            | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13   | 28,151.40                                 | 5,125.99                                       |
| 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   | 2,404,574.06                              | 2,434,376.87                                   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | -31,270,166.98                            | 19,210,011.81                                  |
| 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   | 9,553.89                                  | 37,743.71                                      |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 2,035,458.88                              | 2,380,085.75                                   |
| 1. 管理人报酬              | 7.4.10.2.1 | 1,304,878.76                              | 1,566,252.49                                   |

|                      |            |                |               |
|----------------------|------------|----------------|---------------|
| 2. 托管费               | 7.4.10.2.2 | 287,073.35     | 344,575.53    |
| 3. 销售服务费             |            | -              | -             |
| 4. 交易费用              | 7.4.7.19   | 51,011.28      | 75,497.24     |
| 5. 利息支出              |            | -              | -             |
| 其中: 卖出回购金融资产支出       |            | -              | -             |
| 6. 税金及附加             |            | -              | -             |
| 7. 其他费用              | 7.4.7.20   | 392,495.49     | 393,760.49    |
| 三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列) |            | -33,002,879.96 | 23,577,895.28 |
| 减: 所得税费用             |            | -              | -             |
| 四、净利润 (净亏损以“-”号填列)   |            | -33,002,879.96 | 23,577,895.28 |

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

| 项目                                      | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 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)                        | 111,143,123.68                              | 39,339,222.22  | 150,482,345.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)               | -                                           | -33,002,879.96 | -33,002,879.96 |
| 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)      | -6,973,588.97                               | -2,083,480.34  | -9,057,069.31  |
| 其中: 1. 基金申购款                            | 1,237,102.58                                | 158,077.23     | 1,395,179.81   |
| 2. 基金赎回款                                | -8,210,691.55                               | -2,241,557.57  | -10,452,249.12 |
| 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)                        | 104,169,534.71                              | 4,252,861.92   | 108,422,396.63 |
| 项目                                      | 上年度可比期间<br>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                            | 139,854,839.29                              | 22,809,386.78  | 162,664,226.07 |

|                                         |                |               |                |
|-----------------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| 金净值)                                    |                |               |                |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)               | -              | 23,577,895.28 | 23,577,895.28  |
| 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)      | -28,711,715.61 | -7,048,059.84 | -35,759,775.45 |
| 其中: 1. 基金申购款                            | 290,987.34     | 72,073.07     | 363,060.41     |
| 2. 基金赎回款                                | -29,002,702.95 | -7,120,132.91 | -36,122,835.86 |
| 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)                        | 111,143,123.68 | 39,339,222.22 | 150,482,345.90 |

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:

|            |            |           |
|------------|------------|-----------|
| <u>林培富</u> | <u>刁俊东</u> | <u>龚珉</u> |
| 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

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)是由原长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。根据原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》，原基金分级运作期为三年，分级运作期届满后转为上市开放式基金(LOF)。根据深圳证券交易所深证上[2015]205 号《终止上市同意书》，原基金于 2015 年 5 月 20 日进行基金份额权益登记，于 2015 年 5 月 21 日终止上市。自 2015 年 5 月 22 日起，原基金分级运作期届满自动转为上市开放式基金(LOF)，并更名为长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)。经向中国证监会备案，《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)》于 2015 年 5 月 22 日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期间不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金在分级运作期内的基金份额包括长盛同庆中证 800 分级份额(以下简称“同庆分级份额”)、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“同庆 800A”)以及长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之积极

收益类份额(以下简称“同庆 800B”)。原基金在分级运作期届满后,根据同庆 800A 和同庆 800B 基金份额转换比例对基金份额持有人基金份额转换基准日登记在册的基金份额实施转换,按照本基金基金合同参考净值计算规则分别对同庆 800A 份额和同庆 800B 份额计算分级运作期期末基金份额参考净值,并按照各自的份额参考净值转换为本基金基金份额。于 2015 年 5 月 21 日(基金份额转换日)日终,同庆 800A 转换前份额数为 157,659,406.00 份,转换比例为 0.593624387,转换后对应本基金份额数为 93,590,468.00 份;同庆 800B 转换前份额数为 236,489,110.00 份,转换比例为 1.270917071,转换后对应本基金份额数为 300,558,047.00 份;同庆分级份额转换前份额数为 148,119,975.78 份,转换后对应本基金份额数为 148,119,975.78 份。截至 2015 年 5 月 21 日转换完成当日,本基金基金份额总额为 542,268,490.78 份。本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司根据原基金基金合同约定,对同庆 800A、同庆 800B 的份额持有人的基金份额进行了计算,并向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

经深圳证券交易所深证上[2015]378 号审核同意,本基金 292,227,017.00 份基金份额于 2015 年 8 月 6 日在深圳证券交易所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,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)、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的相关规定)。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%,其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%;其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种,其中权证资产占基金资产净值的比例为 0—3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为: 中证 800 指数收益率 $\times$ 95%+一年期银行定期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2019 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同庆中证 800 指数型证券

投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认



金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配, 其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资, 场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数, 包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等, 则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分; 若期末未分配利润的未实现部分为负数, 则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润, 即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部, 以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分: (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用; (2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果, 以决定向其配置资源、评价其业绩; (3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征, 并且满足一定条件的, 则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作, 不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作, 本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况, 本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》, 根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 9 月 4 日前, 对于在锁定期内的非公开发行股票, 根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》, 若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本, 按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值; 若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的

初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 9 月 4 日起,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产

品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 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。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, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。对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, 对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货, 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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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, 股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得, 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, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款            | 11,659,812.87           | 9,737,947.25             |
| 定期存款            | -                       | -                        |
| 其中: 存款期限 1 个月以内 | -                       | -                        |

|             |               |              |
|-------------|---------------|--------------|
| 存款期限 1-3 个月 |               |              |
| 存款期限 3 个月以上 |               |              |
| 其他存款        |               |              |
| 合计:         | 11,659,812.87 | 9,737,947.25 |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日  |                |               |
|---------------|-------|--------------------------|----------------|---------------|
|               |       | 成本                       | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 106,367,324.71           | 98,302,594.54  | -8,064,730.17 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 18,000.00                | 18,008.90      | 8.90          |
|               | 银行间市场 | -                        | -              | -             |
|               | 合计    | 18,000.00                | 18,008.90      | 8.90          |
| 资产支持证券        |       | -                        | -              | -             |
| 基金            |       | -                        | -              | -             |
| 其他            |       | -                        | -              | -             |
| 合计            |       | 106,385,324.71           | 98,320,603.44  | -8,064,721.27 |
| 项目            |       | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |                |               |
|               |       | 成本                       | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 119,023,407.63           | 142,223,995.80 | 23,200,588.17 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场 | 177,100.00               | 181,957.54     | 4,857.54      |
|               | 银行间市场 | -                        | -              | -             |
|               | 合计    | 177,100.00               | 181,957.54     | 4,857.54      |
| 资产支持证券        |       | -                        | -              | -             |
| 基金            |       | -                        | -              | -             |
| 其他            |       | -                        | -              | -             |
| 合计            |       | 119,200,507.63           | 142,405,953.34 | 23,205,445.71 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注: 无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注: 无余额。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：无余额。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 2,304.12                | 1,999.17                 |
| 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  | -                       | -                        |
| 应收债券利息     | 1.23                    | 59.49                    |
| 应收资产支持证券利息 | -                       | -                        |
| 应收买入返售证券利息 | -                       | -                        |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孖息 | -                       | -                        |
| 其他         | 1.50                    | 2.00                     |
| 合计         | 2,306.85                | 2,060.66                 |

**7.4.7.6 其他资产**

注：无余额。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 4,601.84                | 8,337.38                 |
| 银行间市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 合计          | 4,601.84                | 8,337.38                 |

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 500,000.00              | 500,000.00               |
| 应付赎回费       | 21.06                   | 249.93                   |
| 预提费用        | 330,000.00              | 330,000.00               |
| 其他          | 607,536.79              | 607,536.79               |
| 合计          | 1,437,557.85            | 1,437,786.72             |

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 |                |
|---------------|----------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额 (份)                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 104,056,548.64                         | 111,143,123.68 |
| 本期申购          | 1,158,146.71                           | 1,237,102.58   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -7,687,774.81                          | -8,210,691.55  |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                                      | -              |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                                      | -              |
| 本期申购          | -                                      | -              |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                                      | -              |
| 本期末           | 97,526,920.54                          | 104,169,534.71 |

注：1：申购含转换入；赎回含转换出。

2：截至 2018 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 81,652,696.00 份(2017 年 12 月 31 日：86,974,327.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 15,874,224.54 份(2017 年 12 月 31 日：17,082,221.64 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

## 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           | 91,886,721.70 | -52,547,499.48 | 39,339,222.22  |
| 本期利润           | -1,732,712.98 | -31,270,166.98 | -33,002,879.96 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,818,617.16 | 3,735,136.82   | -2,083,480.34  |
| 其中：基金申购款       | 1,033,606.04  | -875,528.81    | 158,077.23     |
| 基金赎回款          | -6,852,223.20 | 4,610,665.63   | -2,241,557.57  |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -              |
| 本期末            | 84,335,391.56 | -80,082,529.64 | 4,252,861.92   |

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|----------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
|          |                                        |                                             |
| 活期存款利息收入 | 84,850.95                              | 92,980.25                                   |
| 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 | 80.60     | 67.71     |
| 其他        | 46.66     | 81.62     |
| 合计        | 84,978.21 | 93,129.58 |

#### 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<br>2018年1月1日至2018<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年<br>12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 20,887,414.32                   | 37,779,255.42                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 23,112,030.62                   | 33,601,740.05                        |
| 买卖股票差价收入   | -2,224,616.30                   | 4,177,515.37                         |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2018年1月1日至2018年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月<br>31日 |
|-------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 28,151.40                       | 5,125.99                             |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                               | -                                    |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                               | -                                    |
| 合计                            | 28,151.40                       | 5,125.99                             |

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2018年1月1日至2018年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月<br>31日 |
|-------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 291,614.30                      | 143,144.20                           |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 263,300.00                      | 138,000.00                           |
| 减：应收利息总额                | 162.90                          | 18.21                                |
| 买卖债券差价收入                | 28,151.40                       | 5,125.99                             |

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。



**7.4.7.15 衍生工具收益**

注：无。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 2,404,574.06                           | 2,434,376.87                                |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                      | -                                           |
| 合计          | 2,404,574.06                           | 2,434,376.87                                |

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|------------------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -31,270,166.98                         | 19,210,011.81                               |
| ——股票投资                 | -31,265,318.34                         | 19,205,154.27                               |
| ——债券投资                 | -4,848.64                              | 4,857.54                                    |
| ——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                  | -                                      | -                                           |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                                      | -                                           |
| 合计                     | -31,270,166.98                         | 19,210,011.81                               |

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 9,545.64                               | 37,731.16                                   |
| 基金转换费收入 | 8.25                                   | 12.55                                       |
| 合计      | 9,553.89                               | 37,743.71                                   |

注：1. 本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.50%，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成, 其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

| 项目        | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 51,011.28                              | 75,497.24                                   |
| 银行间市场交易费用 | -                                      | -                                           |
| 合计        | 51,011.28                              | 75,497.24                                   |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

| 项目      | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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                                  |
| 深交所上市年费 | 60,000.00                              | 60,000.00                                   |
| 银行划款费用  | 2,495.49                               | 3,760.49                                    |
| 合计      | 392,495.49                             | 393,760.49                                  |

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 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

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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(“长盛基金公司”)   | 基金管理人、基金销售机构    |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金托管人、基金销售机构    |
| 国元证券股份有限公司(“国元证券”)     | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 新加坡星展银行有限公司            | 基金管理人的股东        |

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

注：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：无。

##### 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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,304,878.76                           | 1,566,252.49                                |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 87,129.75                              | 111,267.35                                  |

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 287,073.35                             | 344,575.53                                  |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 当年天数。

##### 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：无。

**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：无。

**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**

注：无。

**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<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 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    |
| 中国建设银行 | 11,659,812.87                          | 84,850.95 | 9,737,947.25                                | 92,980.25 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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：无。

**7.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

注：无

**7.4.12 期末（2018 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<br>(单位：股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 601860               | 紫金银行 | 2018 年 12 月 20 日 | 2019 年 1 月 3 日 | 新股未上市  | 3.14 | 3.14   | 15,970       | 50,145.80 | 50,145.80 | -  |

| 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<br>(单位：张) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 110049               | 海尔转债 | 2018 年 12 月 18 日 | 2019 年 1 月 18 日 | 配债未上市  | 100.00 | 100.00 | 170          | 17,000.00 | 17,000.00 | -  |

## 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<br>估值<br>单价 | 复牌日<br>期        | 复牌<br>开盘单<br>价 | 数量<br>(股) | 期末<br>成本总额   | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|--------|------------------|--------|----------------|-----------------|----------------|-----------|--------------|--------------|----|
| 600030 | 中信证券   | 2018 年 12 月 25 日 | 重大事项停牌 | 16.01          | 2019 年 1 月 10 日 | 17.15          | 69,934    | 1,324,618.21 | 1,119,643.34 | -  |
| 000540 | 中天金融   | 2017 年 8 月 21 日  | 重大事项停牌 | 2.59           | 2019 年 1 月 2 日  | 4.38           | 41,740    | 179,382.41   | 108,106.60   | -  |
| 600485 | 信威集团   | 2016 年 12 月 26 日 | 重大事项停牌 | 6.21           | -               | -              | 16,168    | 296,006.55   | 100,403.28   | -  |
| 600270 | 外运发展   | 2018 年 12 月 13 日 | 吸收合并   | 20.99          | -               | -              | 3,769     | 75,844.85    | 79,111.31    | -  |
| 002183 | 怡亚通    | 2018 年 12 月 25 日 | 重大事项停牌 | 5.01           | 2019 年 1 月 2 日  | 4.96           | 11,600    | 167,620.00   | 58,116.00    | -  |
| 000693 | *ST 华泽 | 2018 年 5 月 2 日   | 重大事项停牌 | 2.68           | -               | -              | 3,507     | 75,126.69    | 9,398.76     | -  |

注：1、根据中外运空运发展股份有限公司（以下简称“外运发展”）于 2018 年 11 月 3 日公布的《中国外运股份有限公司换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司暨关联交易报告书》和中国外运股份有限公司（以下简称“中国外运”）于 2019 年 1 月 15 日公布的《中国外运发行 A 股股份换股吸收合并中外运空运发展股份有限公司上市公告书暨 2018 年第三季度财务报表》，中国外运向外运发展除中国外运以外的股东发行 A 股股票，以换股比例 1:3.8225 取得外运发展股东持有的外运发展全部股票，吸收合并外运发展；外运发展自 2018 年 12 月 13 日起连续停牌。换股合并后新增的中国外运股票于 2019 年 1 月 18 日上市流通，当日开盘单价为 5.30 元。外运发展自 2018 年 12 月 28 日起终止上市并摘牌。

2、本基金截至 2018 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

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 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

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险

可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.02% (2017 年 12 月 31 日：0.12%)。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 7.4.13.3.2 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在基金运作过程中严格按照《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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公

司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持证券均在证券交易所上市,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日,本基金持有流动性受限的资产的估值占基金资产净值的比例符合上述要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 12 月 31 日,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出



保证金和债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2018 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                     | 11,659,812.87 | -        | -          | -              | 11,659,812.87  |
| 存出保证金                    | 3,241.89      | -        | -          | -              | 3,241.89       |
| 交易性金融资产                  | -             | -        | 18,008.90  | 98,302,594.54  | 98,320,603.44  |
| 应收利息                     | -             | -        | -          | 2,306.85       | 2,306.85       |
| 应收申购款                    | -             | -        | -          | 634.85         | 634.85         |
| 资产总计                     | 11,663,054.76 | -        | 18,008.90  | 98,305,536.24  | 109,986,599.90 |
| 负债                       |               |          |            |                |                |
| 应付赎回款                    | -             | -        | -          | 6,168.14       | 6,168.14       |
| 应付管理人报酬                  | -             | -        | -          | 94,979.88      | 94,979.88      |
| 应付托管费                    | -             | -        | -          | 20,895.56      | 20,895.56      |
| 应付交易费用                   | -             | -        | -          | 4,601.84       | 4,601.84       |
| 其他负债                     | -             | -        | -          | 1,437,557.85   | 1,437,557.85   |
| 负债总计                     | -             | -        | -          | 1,564,203.27   | 1,564,203.27   |
| 利率敏感度缺口                  | 11,663,054.76 | -        | 18,008.90  | 96,741,332.97  | 108,422,396.63 |
| 上年度末<br>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                     | 9,737,947.25  | -        | -          | -              | 9,737,947.25   |
| 存出保证金                    | 4,482.17      | -        | -          | -              | 4,482.17       |
| 交易性金融资产                  | -             | 5,700.00 | 176,257.54 | 142,223,995.80 | 142,405,953.34 |
| 应收利息                     | -             | -        | -          | 2,060.66       | 2,060.66       |
| 应收申购款                    | -             | -        | -          | 640.08         | 640.08         |
| 资产总计                     | 9,742,429.42  | 5,700.00 | 176,257.54 | 142,226,696.54 | 152,151,083.50 |
| 负债                       |               |          |            |                |                |
| 应付赎回款                    | -             | -        | -          | 66,317.11      | 66,317.11      |
| 应付管理人报酬                  | -             | -        | -          | 128,111.79     | 128,111.79     |
| 应付托管费                    | -             | -        | -          | 28,184.60      | 28,184.60      |
| 应付交易费用                   | -             | -        | -          | 8,337.38       | 8,337.38       |
| 其他负债                     | -             | -        | -          | 1,437,786.72   | 1,437,786.72   |
| 负债总计                     | -             | -        | -          | 1,668,737.60   | 1,668,737.60   |
| 利率敏感度缺口                  | 9,742,429.42  | 5,700.00 | 176,257.54 | 140,557,958.94 | 150,482,345.90 |

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

于 2018 年 12 月 31 日, 本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02%(2017 年 12 月 31 日: 0.12%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日: 同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价, 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券, 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中, 以复制、跟踪中证 800 指数为原则, 进行指数化长期投资, 综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性, 通过抽样方式构建基金股票投资组合, 并优化确定投资组合中的个股权重。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%, 其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%; 其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种, 其中权证资产占基金资产净值的比例为 0—3%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外, 本基金的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。

##### 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<br>2018 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |                       |
|--------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|              | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 98,302,594.54           | 90.67                    | 142,223,995.80           | 94.51                 |

|    |               |       |                |       |
|----|---------------|-------|----------------|-------|
| 合计 | 98,302,594.54 | 90.67 | 142,223,995.80 | 94.51 |
|----|---------------|-------|----------------|-------|

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|----|--------------------------------|-----------------------------|-------------------|
| 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(2018年12月31日)            | 上年度末(2017年12月31日) |
|    | 1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%       | 5,404,491.09                | 7,373,634.95      |
|    | 2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%       | -5,404,491.09               | -7,373,634.95     |

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由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决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: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:相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日,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中属于第一层次的余额为 96,778,678.35 元,属于第二层次的余额为 1,333,415.21 元,属于第三层次的余额为 208,509.88 元(2017 年 12 月 31 日:第一层次 137,439,903.23 元,第二层次 4,882,376.11 元,第三层次 83,674.00 元)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下:

|                  | 交易性金融资产 |            | 合计         |
|------------------|---------|------------|------------|
|                  | 债券投资    | 权益工具投资     |            |
| 2018 年 1 月 1 日   |         | 83,674.00  | 83,674.00  |
| 购买               | -       | -          | -          |
| 出售               | -       | -97,571.50 | -97,571.50 |
| 转入第三层次           | -       | 208,509.88 | 208,509.88 |
| 转出第三层次           | -       | -          | -          |
| 当期利得或损失总额        | -       | 13,897.50  | 13,897.50  |
| 计入损益的利得或损失       | -       | 13,897.50  | 13,897.50  |
| 2018 年 12 月 31 日 | -       | 208,509.88 | 208,509.88 |

2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2018 年年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益

-230,581.27 -230,581.27

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

|               | 2018 年 12 月 31 日公允价值 | 估值技术 | 名称    | 不可观察输入值  |            |
|---------------|----------------------|------|-------|----------|------------|
|               |                      |      |       | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 交易性金融资产——股票投资 | 208,509.88           | 市场法  | 市净率   | 1.2-2.6  | 正向         |
|               |                      |      | 流动性折扣 | 26%-30%  | 反向         |

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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              | 98,302,594.54  | 89.38         |
|    | 其中：股票             | 98,302,594.54  | 89.38         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 18,008.90      | 0.02          |
|    | 其中：债券             | 18,008.90      | 0.02          |
|    | 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      | 11,659,812.87  | 10.60         |
| 8  | 其他各项资产            | 6,183.59       | 0.01          |
| 9  | 合计                | 109,986,599.90 | 100.00        |

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资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         | 317,689.97    | 0.29          |
| B  | 采矿业              | 3,364,823.94  | 3.10          |
| C  | 制造业              | 41,083,113.84 | 37.89         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,909,978.26  | 2.68          |
| E  | 建筑业              | 3,317,734.53  | 3.06          |
| F  | 批发和零售业           | 2,516,982.69  | 2.32          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,900,024.57  | 2.67          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 41,279.40     | 0.04          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 4,003,863.60  | 3.69          |
| J  | 金融业              | 28,398,707.10 | 26.19         |
| K  | 房地产业             | 6,171,113.04  | 5.69          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,307,842.58  | 1.21          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 57,619.52     | 0.05          |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 306,124.00    | 0.28  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 483,992.60    | 0.45  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 571,543.47    | 0.53  |
| S | 综合            | 229,275.39    | 0.21  |
|   | 合计            | 97,981,708.50 | 90.37 |

### 8.2.2 期末积极投资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         | -          | -             |
| B  | 采矿业              | 9,398.76   | 0.01          |
| C  | 制造业              | 153,234.88 | 0.14          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -             |
| E  | 建筑业              | -          | -             |
| F  | 批发和零售业           | -          | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -          | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -          | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -          | -             |
| J  | 金融业              | 50,145.80  | 0.05          |
| K  | 房地产业             | 108,106.60 | 0.10          |
| L  | 租赁和商务服务业         | -          | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -          | -             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -          | -             |
| 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               | 320,886.04 | 0.30          |

### 8.2.3 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

### 8.3.1 期末指数投资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  | 601318 | 中国平安  | 97,087  | 5,446,580.70 | 5.02    |
| 2  | 600519 | 贵州茅台  | 5,003   | 2,951,820.03 | 2.72    |
| 3  | 000002 | 万 科 A | 99,554  | 2,371,376.28 | 2.19    |
| 4  | 600036 | 招商银行  | 90,416  | 2,278,483.20 | 2.10    |
| 5  | 000651 | 格力电器  | 54,623  | 1,949,494.87 | 1.80    |
| 6  | 601166 | 兴业银行  | 117,471 | 1,755,016.74 | 1.62    |
| 7  | 601398 | 工商银行  | 290,612 | 1,537,337.48 | 1.42    |
| 8  | 000333 | 美的集团  | 39,568  | 1,458,476.48 | 1.35    |
| 9  | 601328 | 交通银行  | 240,570 | 1,392,900.30 | 1.28    |
| 10 | 600016 | 民生银行  | 242,395 | 1,388,923.35 | 1.28    |
| 11 | 600887 | 伊利股份  | 53,334  | 1,220,281.92 | 1.13    |
| 12 | 601288 | 农业银行  | 335,467 | 1,207,681.20 | 1.11    |
| 13 | 600030 | 中信证券  | 69,934  | 1,119,643.34 | 1.03    |
| 14 | 600276 | 恒瑞医药  | 20,267  | 1,069,084.25 | 0.99    |
| 15 | 601668 | 中国建筑  | 181,699 | 1,035,684.30 | 0.96    |
| 16 | 600000 | 浦发银行  | 98,225  | 962,605.00   | 0.89    |
| 17 | 600900 | 长江电力  | 58,520  | 929,297.60   | 0.86    |
| 18 | 000858 | 五 粮 液 | 17,198  | 875,034.24   | 0.81    |
| 19 | 002415 | 海康威视  | 33,391  | 860,152.16   | 0.79    |
| 20 | 601601 | 中国太保  | 28,040  | 797,177.20   | 0.74    |
| 21 | 600104 | 上汽集团  | 29,566  | 788,525.22   | 0.73    |
| 22 | 601211 | 国泰君安  | 51,300  | 785,916.00   | 0.72    |
| 23 | 601169 | 北京银行  | 136,294 | 764,609.34   | 0.71    |
| 24 | 600048 | 保利地产  | 63,124  | 744,231.96   | 0.69    |
| 25 | 000001 | 平安银行  | 76,379  | 716,435.02   | 0.66    |
| 26 | 601766 | 中国中车  | 79,387  | 716,070.74   | 0.66    |
| 27 | 601988 | 中国银行  | 184,638 | 666,543.18   | 0.61    |
| 28 | 600837 | 海通证券  | 71,449  | 628,751.20   | 0.58    |
| 29 | 002304 | 洋河股份  | 5,895   | 558,374.40   | 0.51    |
| 30 | 601888 | 中国国旅  | 9,244   | 556,488.80   | 0.51    |
| 31 | 000725 | 京东方 A | 209,207 | 550,214.41   | 0.51    |
| 32 | 600585 | 海螺水泥  | 17,915  | 524,551.20   | 0.48    |
| 33 | 600019 | 宝钢股份  | 79,759  | 518,433.50   | 0.48    |
| 34 | 601818 | 光大银行  | 139,696 | 516,875.20   | 0.48    |
| 35 | 601229 | 上海银行  | 44,100  | 493,479.00   | 0.46    |
| 36 | 600690 | 青岛海尔  | 34,772  | 481,592.20   | 0.44    |
| 37 | 601688 | 华泰证券  | 29,591  | 479,374.20   | 0.44    |
| 38 | 600009 | 上海机场  | 9,204   | 467,195.04   | 0.43    |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 39 | 600028 | 中国石化 | 92,096  | 465,084.80 | 0.43 |
| 40 | 601390 | 中国中铁 | 65,499  | 457,838.01 | 0.42 |
| 41 | 603288 | 海天味业 | 6,600   | 454,080.00 | 0.42 |
| 42 | 600050 | 中国联通 | 86,072  | 444,992.24 | 0.41 |
| 43 | 601006 | 大秦铁路 | 52,228  | 429,836.44 | 0.40 |
| 44 | 000538 | 云南白药 | 5,811   | 429,781.56 | 0.40 |
| 45 | 000063 | 中兴通讯 | 21,562  | 422,399.58 | 0.39 |
| 46 | 600015 | 华夏银行 | 56,663  | 418,739.57 | 0.39 |
| 47 | 601989 | 中国重工 | 89,826  | 381,760.50 | 0.35 |
| 48 | 001979 | 招商蛇口 | 21,536  | 373,649.60 | 0.34 |
| 49 | 002142 | 宁波银行 | 22,424  | 363,717.28 | 0.34 |
| 50 | 600309 | 万华化学 | 12,778  | 357,656.22 | 0.33 |
| 51 | 600999 | 招商证券 | 26,069  | 349,324.60 | 0.32 |
| 52 | 601088 | 中国神华 | 19,396  | 348,352.16 | 0.32 |
| 53 | 300059 | 东方财富 | 28,087  | 339,852.70 | 0.31 |
| 54 | 000776 | 广发证券 | 26,777  | 339,532.36 | 0.31 |
| 55 | 000338 | 潍柴动力 | 43,706  | 336,536.20 | 0.31 |
| 56 | 600919 | 江苏银行 | 56,200  | 335,514.00 | 0.31 |
| 57 | 002024 | 苏宁易购 | 33,282  | 327,827.70 | 0.30 |
| 58 | 002027 | 分众传媒 | 61,600  | 322,784.00 | 0.30 |
| 59 | 601336 | 新华保险 | 7,534   | 318,236.16 | 0.29 |
| 60 | 002230 | 科大讯飞 | 12,750  | 314,160.00 | 0.29 |
| 61 | 601186 | 中国铁建 | 28,851  | 313,610.37 | 0.29 |
| 62 | 601857 | 中国石油 | 43,231  | 311,695.51 | 0.29 |
| 63 | 601628 | 中国人寿 | 15,047  | 306,808.33 | 0.28 |
| 64 | 002594 | 比亚迪  | 5,984   | 305,184.00 | 0.28 |
| 65 | 000661 | 长春高新 | 1,684   | 294,700.00 | 0.27 |
| 66 | 600660 | 福耀玻璃 | 12,898  | 293,816.44 | 0.27 |
| 67 | 600436 | 片仔癀  | 3,345   | 289,844.25 | 0.27 |
| 68 | 601009 | 南京银行 | 44,801  | 289,414.46 | 0.27 |
| 69 | 600795 | 国电电力 | 112,453 | 287,879.68 | 0.27 |
| 70 | 601933 | 永辉超市 | 36,425  | 286,664.75 | 0.26 |
| 71 | 601899 | 紫金矿业 | 84,027  | 280,650.18 | 0.26 |
| 72 | 600031 | 三一重工 | 33,529  | 279,631.86 | 0.26 |
| 73 | 600406 | 国电南瑞 | 14,891  | 275,930.23 | 0.25 |
| 74 | 601225 | 陕西煤业 | 36,956  | 274,952.64 | 0.25 |
| 75 | 000568 | 泸州老窖 | 6,754   | 274,617.64 | 0.25 |
| 76 | 600570 | 恒生电子 | 4,876   | 253,454.48 | 0.23 |
| 77 | 600518 | 康美药业 | 27,444  | 252,759.24 | 0.23 |



|     |        |        |        |            |      |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 78  | 600011 | 华能国际   | 33,800 | 249,444.00 | 0.23 |
| 79  | 002475 | 立讯精密   | 17,540 | 246,612.40 | 0.23 |
| 80  | 600196 | 复星医药   | 10,374 | 241,402.98 | 0.22 |
| 81  | 600886 | 国投电力   | 29,878 | 240,517.90 | 0.22 |
| 82  | 601012 | 隆基股份   | 13,693 | 238,805.92 | 0.22 |
| 83  | 002008 | 大族激光   | 7,821  | 237,445.56 | 0.22 |
| 84  | 600271 | 航天信息   | 10,276 | 235,217.64 | 0.22 |
| 85  | 002044 | 美年健康   | 15,500 | 231,725.00 | 0.21 |
| 86  | 000166 | 申万宏源   | 56,051 | 228,127.57 | 0.21 |
| 87  | 300296 | 利亚德    | 29,400 | 226,086.00 | 0.21 |
| 88  | 000895 | 双汇发展   | 9,537  | 224,977.83 | 0.21 |
| 89  | 002714 | 牧原股份   | 7,740  | 222,525.00 | 0.21 |
| 90  | 600340 | 华夏幸福   | 8,722  | 221,974.90 | 0.20 |
| 91  | 601985 | 中国核电   | 41,088 | 216,533.76 | 0.20 |
| 92  | 600703 | 三安光电   | 18,858 | 213,283.98 | 0.20 |
| 93  | 600741 | 华域汽车   | 11,533 | 212,207.20 | 0.20 |
| 94  | 600547 | 山东黄金   | 6,960  | 210,540.00 | 0.19 |
| 95  | 600029 | 南方航空   | 31,182 | 207,048.48 | 0.19 |
| 96  | 000423 | 东阿阿胶   | 5,217  | 206,332.35 | 0.19 |
| 97  | 300015 | 爱尔眼科   | 7,700  | 202,510.00 | 0.19 |
| 98  | 601155 | 新城控股   | 8,500  | 201,365.00 | 0.19 |
| 99  | 000963 | 华东医药   | 7,566  | 200,196.36 | 0.18 |
| 100 | 000100 | TCL 集团 | 81,215 | 198,976.75 | 0.18 |
| 101 | 601901 | 方正证券   | 37,204 | 197,553.24 | 0.18 |
| 102 | 600352 | 浙江龙盛   | 20,362 | 196,493.30 | 0.18 |
| 103 | 600487 | 亨通光电   | 11,480 | 195,734.00 | 0.18 |
| 104 | 601377 | 兴业证券   | 42,102 | 195,353.28 | 0.18 |
| 105 | 600588 | 用友网络   | 9,151  | 194,916.30 | 0.18 |
| 106 | 600383 | 金地集团   | 20,062 | 192,996.44 | 0.18 |
| 107 | 601600 | 中国铝业   | 53,672 | 190,535.60 | 0.18 |
| 108 | 600958 | 东方证券   | 23,900 | 190,483.00 | 0.18 |
| 109 | 600332 | 白云山    | 5,300  | 189,528.00 | 0.17 |
| 110 | 002202 | 金风科技   | 18,771 | 187,522.29 | 0.17 |
| 111 | 002736 | 国信证券   | 22,300 | 186,651.00 | 0.17 |
| 112 | 002466 | 天齐锂业   | 6,355  | 186,328.60 | 0.17 |
| 113 | 000069 | 华侨城 A  | 29,341 | 186,315.35 | 0.17 |
| 114 | 300142 | 沃森生物   | 9,700  | 185,270.00 | 0.17 |
| 115 | 000656 | 金科股份   | 29,671 | 183,663.49 | 0.17 |
| 116 | 300003 | 乐普医疗   | 8,800  | 183,128.00 | 0.17 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 117 | 601607 | 上海医药 | 10,737  | 182,529.00 | 0.17 |
| 118 | 600089 | 特变电工 | 26,788  | 181,890.52 | 0.17 |
| 119 | 002450 | 康得新  | 23,502  | 179,555.28 | 0.17 |
| 120 | 300124 | 汇川技术 | 8,835   | 177,936.90 | 0.16 |
| 121 | 601611 | 中国核建 | 27,200  | 177,616.00 | 0.16 |
| 122 | 601877 | 正泰电器 | 7,282   | 176,515.68 | 0.16 |
| 123 | 600010 | 包钢股份 | 118,716 | 175,699.68 | 0.16 |
| 124 | 601111 | 中国国航 | 22,924  | 175,139.36 | 0.16 |
| 125 | 601669 | 中国电建 | 35,788  | 173,929.68 | 0.16 |
| 126 | 600201 | 生物股份 | 10,469  | 173,785.40 | 0.16 |
| 127 | 600637 | 东方明珠 | 16,757  | 171,591.68 | 0.16 |
| 128 | 600674 | 川投能源 | 19,718  | 170,955.06 | 0.16 |
| 129 | 000938 | 紫光股份 | 5,460   | 170,679.60 | 0.16 |
| 130 | 600023 | 浙能电力 | 35,961  | 170,095.53 | 0.16 |
| 131 | 600111 | 北方稀土 | 19,183  | 168,234.91 | 0.16 |
| 132 | 600100 | 同方股份 | 17,225  | 167,599.25 | 0.15 |
| 133 | 600535 | 天士力  | 8,662   | 166,310.40 | 0.15 |
| 134 | 600705 | 中航资本 | 39,060  | 165,614.40 | 0.15 |
| 135 | 600893 | 航发动力 | 7,526   | 163,464.72 | 0.15 |
| 136 | 600872 | 中炬高新 | 5,456   | 160,733.76 | 0.15 |
| 137 | 600867 | 通化东宝 | 11,500  | 159,850.00 | 0.15 |
| 138 | 601727 | 上海电气 | 32,068  | 158,415.92 | 0.15 |
| 139 | 600516 | 方大炭素 | 9,446   | 157,842.66 | 0.15 |
| 140 | 000783 | 长江证券 | 30,294  | 156,014.10 | 0.14 |
| 141 | 002456 | 欧菲科技 | 16,955  | 155,816.45 | 0.14 |
| 142 | 600085 | 同仁堂  | 5,634   | 154,935.00 | 0.14 |
| 143 | 601800 | 中国交建 | 13,667  | 153,890.42 | 0.14 |
| 144 | 600068 | 葛洲坝  | 24,154  | 152,653.28 | 0.14 |
| 145 | 002236 | 大华股份 | 13,265  | 152,016.90 | 0.14 |
| 146 | 600018 | 上港集团 | 28,761  | 148,981.98 | 0.14 |
| 147 | 002422 | 科伦药业 | 7,200   | 148,680.00 | 0.14 |
| 148 | 002007 | 华兰生物 | 4,518   | 148,190.40 | 0.14 |
| 149 | 601919 | 中远海控 | 36,600  | 147,864.00 | 0.14 |
| 150 | 601998 | 中信银行 | 26,984  | 147,062.80 | 0.14 |
| 151 | 600066 | 宇通客车 | 12,134  | 143,787.90 | 0.13 |
| 152 | 002311 | 海大集团 | 6,200   | 143,654.00 | 0.13 |
| 153 | 600498 | 烽火通信 | 5,045   | 143,631.15 | 0.13 |
| 154 | 600115 | 东方航空 | 30,237  | 143,625.75 | 0.13 |
| 155 | 600673 | 东阳光科 | 19,653  | 143,073.84 | 0.13 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 156 | 002460 | 赣锋锂业 | 6,400  | 141,312.00 | 0.13 |
| 157 | 300408 | 三环集团 | 8,300  | 140,436.00 | 0.13 |
| 158 | 002493 | 荣盛石化 | 13,900 | 140,251.00 | 0.13 |
| 159 | 300122 | 智飞生物 | 3,600  | 139,536.00 | 0.13 |
| 160 | 000413 | 东旭光电 | 30,900 | 139,050.00 | 0.13 |
| 161 | 000157 | 中联重科 | 38,935 | 138,608.60 | 0.13 |
| 162 | 000876 | 新希望  | 18,912 | 137,679.36 | 0.13 |
| 163 | 600177 | 雅戈尔  | 19,117 | 137,451.23 | 0.13 |
| 164 | 600256 | 广汇能源 | 36,348 | 136,668.48 | 0.13 |
| 165 | 300136 | 信维通信 | 6,300  | 136,143.00 | 0.13 |
| 166 | 002179 | 中航光电 | 4,025  | 135,562.00 | 0.13 |
| 167 | 000768 | 中航飞机 | 10,191 | 134,928.84 | 0.12 |
| 168 | 300024 | 机器人  | 10,196 | 134,791.12 | 0.12 |
| 169 | 000625 | 长安汽车 | 20,306 | 133,816.54 | 0.12 |
| 170 | 600489 | 中金黄金 | 15,513 | 133,101.54 | 0.12 |
| 171 | 600606 | 绿地控股 | 21,600 | 131,976.00 | 0.12 |
| 172 | 601618 | 中国中冶 | 42,206 | 131,260.66 | 0.12 |
| 173 | 002352 | 顺丰控股 | 4,000  | 131,000.00 | 0.12 |
| 174 | 002410 | 广联达  | 6,241  | 129,875.21 | 0.12 |
| 175 | 603799 | 华友钴业 | 4,300  | 129,473.00 | 0.12 |
| 176 | 000623 | 吉林敖东 | 8,955  | 129,220.65 | 0.12 |
| 177 | 603993 | 洛阳钼业 | 34,356 | 129,178.56 | 0.12 |
| 178 | 002465 | 海格通信 | 16,434 | 128,185.20 | 0.12 |
| 179 | 601555 | 东吴证券 | 19,060 | 127,702.00 | 0.12 |
| 180 | 600426 | 华鲁恒升 | 10,438 | 125,986.66 | 0.12 |
| 181 | 600739 | 辽宁成大 | 12,012 | 125,645.52 | 0.12 |
| 182 | 600176 | 中国巨石 | 12,964 | 125,361.88 | 0.12 |
| 183 | 000860 | 顺鑫农业 | 3,924  | 125,136.36 | 0.12 |
| 184 | 600338 | 西藏珠峰 | 6,400  | 124,352.00 | 0.11 |
| 185 | 300144 | 宋城演艺 | 5,811  | 124,064.85 | 0.11 |
| 186 | 000503 | 国新健康 | 7,776  | 123,482.88 | 0.11 |
| 187 | 601168 | 西部矿业 | 20,963 | 122,004.66 | 0.11 |
| 188 | 000425 | 徐工机械 | 37,654 | 121,622.42 | 0.11 |
| 189 | 002049 | 紫光国微 | 4,200  | 121,380.00 | 0.11 |
| 190 | 600522 | 中天科技 | 14,698 | 119,788.70 | 0.11 |
| 191 | 600109 | 国金证券 | 16,692 | 119,514.72 | 0.11 |
| 192 | 002081 | 金螳螂  | 14,542 | 117,790.20 | 0.11 |
| 193 | 300253 | 卫宁健康 | 9,445  | 117,684.70 | 0.11 |
| 194 | 600208 | 新湖中宝 | 40,387 | 117,122.30 | 0.11 |

|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 195 | 300146 | 汤臣倍健  | 6,886  | 116,993.14 | 0.11 |
| 196 | 002241 | 歌尔股份  | 16,954 | 116,643.52 | 0.11 |
| 197 | 000630 | 铜陵有色  | 58,623 | 115,487.31 | 0.11 |
| 198 | 002065 | 东华软件  | 16,472 | 114,480.40 | 0.11 |
| 199 | 601018 | 宁波港   | 34,151 | 114,064.34 | 0.11 |
| 200 | 000786 | 北新建材  | 8,224  | 113,162.24 | 0.10 |
| 201 | 300070 | 碧水源   | 14,507 | 113,154.60 | 0.10 |
| 202 | 000709 | 河钢股份  | 39,747 | 112,881.48 | 0.10 |
| 203 | 600895 | 张江高科  | 7,389  | 110,465.55 | 0.10 |
| 204 | 002439 | 启明星辰  | 5,300  | 108,968.00 | 0.10 |
| 205 | 600298 | 安琪酵母  | 4,268  | 107,681.64 | 0.10 |
| 206 | 300072 | 三聚环保  | 10,889 | 107,147.76 | 0.10 |
| 207 | 600718 | 东软集团  | 9,259  | 106,941.45 | 0.10 |
| 208 | 600161 | 天坛生物  | 5,008  | 106,420.00 | 0.10 |
| 209 | 600600 | 青岛啤酒  | 3,050  | 106,323.00 | 0.10 |
| 210 | 300017 | 网宿科技  | 13,559 | 106,166.97 | 0.10 |
| 211 | 000960 | 锡业股份  | 11,100 | 105,894.00 | 0.10 |
| 212 | 600549 | 厦门钨业  | 8,710  | 105,216.80 | 0.10 |
| 213 | 600809 | 山西汾酒  | 2,953  | 103,502.65 | 0.10 |
| 214 | 002129 | 中环股份  | 14,176 | 102,492.48 | 0.09 |
| 215 | 600221 | 海航控股  | 54,508 | 102,475.04 | 0.09 |
| 216 | 600362 | 江西铜业  | 7,735  | 101,792.60 | 0.09 |
| 217 | 000418 | 小天鹅 A | 2,353  | 101,767.25 | 0.09 |
| 218 | 002038 | 双鹭药业  | 4,096  | 101,621.76 | 0.09 |
| 219 | 600153 | 建发股份  | 14,364 | 101,266.20 | 0.09 |
| 220 | 600183 | 生益科技  | 10,009 | 100,690.54 | 0.09 |
| 221 | 000999 | 华润三九  | 4,024  | 100,036.64 | 0.09 |
| 222 | 002223 | 鱼跃医疗  | 5,091  | 99,834.51  | 0.09 |
| 223 | 002470 | 金正大   | 15,616 | 98,693.12  | 0.09 |
| 224 | 600118 | 中国卫星  | 5,696  | 98,654.72  | 0.09 |
| 225 | 600688 | 上海石化  | 19,551 | 97,559.49  | 0.09 |
| 226 | 002281 | 光迅科技  | 3,582  | 96,212.52  | 0.09 |
| 227 | 002013 | 中航机电  | 14,719 | 95,820.69  | 0.09 |
| 228 | 600583 | 海油工程  | 19,548 | 95,785.20  | 0.09 |
| 229 | 002146 | 荣盛发展  | 11,974 | 95,193.30  | 0.09 |
| 230 | 601333 | 广深铁路  | 30,096 | 95,103.36  | 0.09 |
| 231 | 600061 | 国投资本  | 10,400 | 93,496.00  | 0.09 |
| 232 | 601788 | 光大证券  | 10,600 | 92,962.00  | 0.09 |
| 233 | 000830 | 鲁西化工  | 9,484  | 92,943.20  | 0.09 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 234 | 600038 | 中直股份 | 2,475  | 92,466.00 | 0.09 |
| 235 | 002050 | 三花智控 | 7,266  | 92,205.54 | 0.09 |
| 236 | 002508 | 老板电器 | 4,539  | 91,642.41 | 0.08 |
| 237 | 000997 | 新大陆  | 6,228  | 91,177.92 | 0.08 |
| 238 | 002153 | 石基信息 | 3,487  | 90,522.52 | 0.08 |
| 239 | 600643 | 爱建集团 | 10,661 | 90,511.89 | 0.08 |
| 240 | 600808 | 马钢股份 | 26,100 | 90,306.00 | 0.08 |
| 241 | 600170 | 上海建工 | 29,796 | 90,281.88 | 0.08 |
| 242 | 000750 | 国海证券 | 20,475 | 89,271.00 | 0.08 |
| 243 | 600816 | 安信信托 | 20,336 | 88,868.32 | 0.08 |
| 244 | 002572 | 索菲亚  | 5,302  | 88,808.50 | 0.08 |
| 245 | 600369 | 西南证券 | 25,392 | 88,364.16 | 0.08 |
| 246 | 300027 | 华谊兄弟 | 18,795 | 88,148.55 | 0.08 |
| 247 | 601198 | 东兴证券 | 9,200  | 87,952.00 | 0.08 |
| 248 | 002399 | 海普瑞  | 3,801  | 87,613.05 | 0.08 |
| 249 | 002340 | 格林美  | 22,700 | 87,168.00 | 0.08 |
| 250 | 000596 | 古井贡酒 | 1,608  | 86,767.68 | 0.08 |
| 251 | 600388 | 龙净环保 | 8,500  | 86,275.00 | 0.08 |
| 252 | 600655 | 豫园股份 | 11,610 | 85,914.00 | 0.08 |
| 253 | 600820 | 隧道股份 | 13,700 | 85,762.00 | 0.08 |
| 254 | 000402 | 金融街  | 13,296 | 85,626.24 | 0.08 |
| 255 | 601838 | 成都银行 | 10,633 | 85,595.65 | 0.08 |
| 256 | 000778 | 新兴铸管 | 19,682 | 84,829.42 | 0.08 |
| 257 | 000839 | 中信国安 | 25,115 | 84,637.55 | 0.08 |
| 258 | 600079 | 人福医药 | 8,330  | 84,466.20 | 0.08 |
| 259 | 600482 | 中国动力 | 3,790  | 84,403.30 | 0.08 |
| 260 | 600415 | 小商品城 | 24,173 | 84,363.77 | 0.08 |
| 261 | 000401 | 冀东水泥 | 6,799  | 84,171.62 | 0.08 |
| 262 | 600143 | 金发科技 | 16,921 | 83,758.95 | 0.08 |
| 263 | 000066 | 中国长城 | 17,585 | 83,352.90 | 0.08 |
| 264 | 000690 | 宝新能源 | 12,361 | 83,189.53 | 0.08 |
| 265 | 000009 | 中国宝安 | 19,299 | 83,178.69 | 0.08 |
| 266 | 601021 | 春秋航空 | 2,600  | 82,706.00 | 0.08 |
| 267 | 000686 | 东北证券 | 13,182 | 82,519.32 | 0.08 |
| 268 | 600584 | 长电科技 | 9,955  | 82,029.20 | 0.08 |
| 269 | 000581 | 威孚高科 | 4,644  | 82,013.04 | 0.08 |
| 270 | 000060 | 中金岭南 | 20,704 | 81,987.84 | 0.08 |
| 271 | 000983 | 西山煤电 | 14,850 | 81,526.50 | 0.08 |
| 272 | 600879 | 航天电子 | 14,948 | 80,868.68 | 0.07 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 273 | 000975 | 银泰资源  | 7,832  | 79,808.08 | 0.07 |
| 274 | 002310 | 东方园林  | 11,450 | 79,692.00 | 0.07 |
| 275 | 600260 | 凯乐科技  | 4,690  | 79,589.30 | 0.07 |
| 276 | 600270 | 外运发展  | 3,769  | 79,111.31 | 0.07 |
| 277 | 002797 | 第一创业  | 14,520 | 78,698.40 | 0.07 |
| 278 | 600801 | 华新水泥  | 4,702  | 78,617.44 | 0.07 |
| 279 | 300088 | 长信科技  | 18,920 | 78,518.00 | 0.07 |
| 280 | 600008 | 首创股份  | 22,796 | 78,190.28 | 0.07 |
| 281 | 002268 | 卫 士 通 | 4,300  | 76,798.00 | 0.07 |
| 282 | 000671 | 阳 光 城 | 14,732 | 76,459.08 | 0.07 |
| 283 | 600511 | 国药股份  | 3,285  | 76,376.25 | 0.07 |
| 284 | 002299 | 圣农发展  | 4,601  | 76,100.54 | 0.07 |
| 285 | 601872 | 招商轮船  | 20,500 | 75,645.00 | 0.07 |
| 286 | 000039 | 中集集团  | 7,109  | 75,213.22 | 0.07 |
| 287 | 002371 | 北方华创  | 1,959  | 73,971.84 | 0.07 |
| 288 | 000930 | 中粮生化  | 9,938  | 73,739.96 | 0.07 |
| 289 | 600755 | 厦门国贸  | 10,540 | 73,569.20 | 0.07 |
| 290 | 000826 | 启迪桑德  | 7,080  | 73,561.20 | 0.07 |
| 291 | 600376 | 首开股份  | 10,209 | 73,402.71 | 0.07 |
| 292 | 600804 | 鹏博士   | 10,412 | 73,196.36 | 0.07 |
| 293 | 000792 | 盐湖股份  | 10,436 | 72,843.28 | 0.07 |
| 294 | 600160 | 巨化股份  | 10,969 | 72,724.47 | 0.07 |
| 295 | 002602 | 世纪华通  | 3,520  | 72,688.00 | 0.07 |
| 296 | 600138 | 中青旅   | 5,567  | 71,758.63 | 0.07 |
| 297 | 000988 | 华工科技  | 5,991  | 71,532.54 | 0.07 |
| 298 | 600704 | 物产中大  | 15,615 | 71,516.70 | 0.07 |
| 299 | 600729 | 重庆百货  | 2,525  | 71,457.50 | 0.07 |
| 300 | 300315 | 掌趣科技  | 20,200 | 71,306.00 | 0.07 |
| 301 | 002353 | 杰瑞股份  | 4,738  | 71,070.00 | 0.07 |
| 302 | 600737 | 中粮糖业  | 9,600  | 70,656.00 | 0.07 |
| 303 | 000028 | 国药一致  | 1,703  | 70,572.32 | 0.07 |
| 304 | 600500 | 中化国际  | 10,300 | 70,452.00 | 0.06 |
| 305 | 000547 | 航天发展  | 9,313  | 70,406.28 | 0.06 |
| 306 | 600325 | 华发股份  | 11,336 | 70,283.20 | 0.06 |
| 307 | 002092 | 中泰化学  | 9,875  | 69,618.75 | 0.06 |
| 308 | 600563 | 法拉电子  | 1,638  | 69,025.32 | 0.06 |
| 309 | 600021 | 上海电力  | 8,514  | 68,963.40 | 0.06 |
| 310 | 600884 | 杉杉股份  | 5,328  | 68,837.76 | 0.06 |
| 311 | 600649 | 城投控股  | 12,531 | 68,544.57 | 0.06 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 312 | 300001 | 特锐德  | 3,900  | 68,367.00 | 0.06 |
| 313 | 600373 | 中文传媒 | 5,227  | 68,003.27 | 0.06 |
| 314 | 000559 | 万向钱潮 | 13,256 | 67,870.72 | 0.06 |
| 315 | 002463 | 沪电股份 | 9,455  | 67,792.35 | 0.06 |
| 316 | 600064 | 南京高科 | 8,594  | 67,720.72 | 0.06 |
| 317 | 000513 | 丽珠集团 | 2,686  | 67,552.90 | 0.06 |
| 318 | 600572 | 康恩贝  | 11,367 | 67,406.31 | 0.06 |
| 319 | 600266 | 北京城建 | 8,500  | 67,320.00 | 0.06 |
| 320 | 002191 | 劲嘉股份 | 8,616  | 67,290.96 | 0.06 |
| 321 | 600967 | 内蒙一机 | 6,468  | 67,267.20 | 0.06 |
| 322 | 000636 | 风华高科 | 6,236  | 66,974.64 | 0.06 |
| 323 | 600528 | 中铁工业 | 6,376  | 66,948.00 | 0.06 |
| 324 | 000703 | 恒逸石化 | 5,767  | 66,435.84 | 0.06 |
| 325 | 002078 | 太阳纸业 | 11,625 | 66,262.50 | 0.06 |
| 326 | 600158 | 中体产业 | 7,417  | 65,937.13 | 0.06 |
| 327 | 000887 | 中鼎股份 | 6,477  | 65,547.24 | 0.06 |
| 328 | 002701 | 奥瑞金  | 12,844 | 64,990.64 | 0.06 |
| 329 | 600060 | 海信电器 | 7,485  | 64,969.80 | 0.06 |
| 330 | 002440 | 闰土股份 | 7,218  | 64,962.00 | 0.06 |
| 331 | 000598 | 兴蓉环境 | 16,095 | 64,862.85 | 0.06 |
| 332 | 600536 | 中国软件 | 3,086  | 64,589.98 | 0.06 |
| 333 | 601866 | 中远海发 | 28,253 | 64,416.84 | 0.06 |
| 334 | 600372 | 中航电子 | 4,950  | 64,251.00 | 0.06 |
| 335 | 300251 | 光线传媒 | 8,414  | 63,946.40 | 0.06 |
| 336 | 002152 | 广电运通 | 11,350 | 63,673.50 | 0.06 |
| 337 | 002358 | 森源电气 | 3,576  | 63,652.80 | 0.06 |
| 338 | 601216 | 君正集团 | 24,208 | 63,424.96 | 0.06 |
| 339 | 002500 | 山西证券 | 10,694 | 63,308.48 | 0.06 |
| 340 | 300274 | 阳光电源 | 7,060  | 62,975.20 | 0.06 |
| 341 | 002004 | 华邦健康 | 13,547 | 62,451.67 | 0.06 |
| 342 | 600863 | 内蒙华电 | 26,951 | 62,256.81 | 0.06 |
| 343 | 000878 | 云南铜业 | 7,800  | 61,854.00 | 0.06 |
| 344 | 601633 | 长城汽车 | 11,025 | 61,740.00 | 0.06 |
| 345 | 002266 | 浙富控股 | 15,165 | 61,721.55 | 0.06 |
| 346 | 600460 | 士兰微  | 7,561  | 61,395.32 | 0.06 |
| 347 | 002221 | 东华能源 | 7,614  | 61,368.84 | 0.06 |
| 348 | 600811 | 东方集团 | 16,708 | 61,151.28 | 0.06 |
| 349 | 600277 | 亿利洁能 | 10,800 | 61,128.00 | 0.06 |
| 350 | 600827 | 百联股份 | 7,176  | 60,637.20 | 0.06 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 351 | 600062 | 华润双鹤  | 4,965  | 60,026.85 | 0.06 |
| 352 | 600056 | 中国医药  | 4,762  | 59,858.34 | 0.06 |
| 353 | 600282 | 南钢股份  | 17,500 | 59,850.00 | 0.06 |
| 354 | 002051 | 中工国际  | 5,394  | 59,765.52 | 0.06 |
| 355 | 000415 | 渤海租赁  | 16,499 | 59,396.40 | 0.05 |
| 356 | 000528 | 柳 工   | 9,768  | 59,291.76 | 0.05 |
| 357 | 002385 | 大北农   | 18,410 | 58,912.00 | 0.05 |
| 358 | 600125 | 铁龙物流  | 8,346  | 58,422.00 | 0.05 |
| 359 | 600664 | 哈药股份  | 14,783 | 58,392.85 | 0.05 |
| 360 | 002195 | 二三四五  | 15,795 | 58,283.55 | 0.05 |
| 361 | 000961 | 中南建设  | 10,375 | 58,203.75 | 0.05 |
| 362 | 002183 | 怡 亚 通 | 11,600 | 58,116.00 | 0.05 |
| 363 | 300133 | 华策影视  | 6,465  | 57,926.40 | 0.05 |
| 364 | 600645 | 中源协和  | 3,548  | 57,619.52 | 0.05 |
| 365 | 600392 | 盛和资源  | 6,691  | 57,609.51 | 0.05 |
| 366 | 601928 | 凤凰传媒  | 7,190  | 57,088.60 | 0.05 |
| 367 | 000027 | 深圳能源  | 10,841 | 56,915.25 | 0.05 |
| 368 | 002273 | 水晶光电  | 5,942  | 56,805.52 | 0.05 |
| 369 | 002030 | 达安基因  | 5,578  | 56,672.48 | 0.05 |
| 370 | 000970 | 中科三环  | 7,710  | 56,514.30 | 0.05 |
| 371 | 600348 | 阳泉煤业  | 11,067 | 55,777.68 | 0.05 |
| 372 | 300058 | 蓝色光标  | 12,851 | 55,773.34 | 0.05 |
| 373 | 002384 | 东山精密  | 4,914  | 55,479.06 | 0.05 |
| 374 | 600026 | 中远海能  | 12,438 | 55,224.72 | 0.05 |
| 375 | 600717 | 天津港   | 7,800  | 55,146.00 | 0.05 |
| 376 | 600037 | 歌华有线  | 6,400  | 54,976.00 | 0.05 |
| 377 | 600859 | 王府井   | 4,054  | 54,972.24 | 0.05 |
| 378 | 000738 | 航发控制  | 4,500  | 54,270.00 | 0.05 |
| 379 | 600881 | 亚泰集团  | 16,331 | 54,055.61 | 0.05 |
| 380 | 300113 | 顺网科技  | 4,200  | 53,382.00 | 0.05 |
| 381 | 601717 | 郑煤机   | 9,646  | 53,342.38 | 0.05 |
| 382 | 002250 | 联化科技  | 5,646  | 53,241.78 | 0.05 |
| 383 | 600648 | 外高桥   | 3,861  | 53,050.14 | 0.05 |
| 384 | 600216 | 浙江医药  | 6,109  | 53,026.12 | 0.05 |
| 385 | 601958 | 金钼股份  | 8,952  | 52,995.84 | 0.05 |
| 386 | 600039 | 四川路桥  | 16,091 | 52,778.48 | 0.05 |
| 387 | 000031 | 中粮地产  | 10,793 | 52,669.84 | 0.05 |
| 388 | 002368 | 太极股份  | 2,261  | 52,455.20 | 0.05 |
| 389 | 600970 | 中材国际  | 9,543  | 52,200.21 | 0.05 |



|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 390 | 002414 | 高德红外  | 2,422  | 52,194.10 | 0.05 |
| 391 | 600435 | 北方导航  | 7,024  | 52,047.84 | 0.05 |
| 392 | 600312 | 平高电气  | 6,438  | 52,019.04 | 0.05 |
| 393 | 600166 | 福田汽车  | 28,556 | 51,971.92 | 0.05 |
| 394 | 002155 | 湖南黄金  | 6,600  | 51,810.00 | 0.05 |
| 395 | 601880 | 大连港   | 27,931 | 51,672.35 | 0.05 |
| 396 | 600171 | 上海贝岭  | 5,520  | 51,556.80 | 0.05 |
| 397 | 002242 | 九阳股份  | 3,217  | 51,504.17 | 0.05 |
| 398 | 600120 | 浙江东方  | 4,095  | 51,433.20 | 0.05 |
| 399 | 000400 | 许继电气  | 5,745  | 51,073.05 | 0.05 |
| 400 | 600582 | 天地科技  | 14,800 | 50,616.00 | 0.05 |
| 401 | 000006 | 深振业 A | 9,770  | 50,608.60 | 0.05 |
| 402 | 002028 | 思源电气  | 5,117  | 50,504.79 | 0.05 |
| 403 | 600787 | 中储股份  | 10,086 | 50,430.00 | 0.05 |
| 404 | 600410 | 华胜天成  | 8,596  | 50,372.56 | 0.05 |
| 405 | 002128 | 露天煤业  | 7,006  | 50,162.96 | 0.05 |
| 406 | 600409 | 三友化工  | 8,699  | 49,758.28 | 0.05 |
| 407 | 300244 | 迪安诊断  | 3,280  | 49,757.60 | 0.05 |
| 408 | 600545 | 卓郎智能  | 6,700  | 49,580.00 | 0.05 |
| 409 | 300266 | 兴源环境  | 13,968 | 49,307.04 | 0.05 |
| 410 | 600835 | 上海机电  | 3,368  | 49,004.40 | 0.05 |
| 411 | 000049 | 德赛电池  | 1,703  | 48,842.04 | 0.05 |
| 412 | 600267 | 海正药业  | 5,817  | 48,804.63 | 0.05 |
| 413 | 000685 | 中山公用  | 6,885  | 48,195.00 | 0.04 |
| 414 | 601000 | 唐山港   | 20,223 | 48,130.74 | 0.04 |
| 415 | 600597 | 光明乳业  | 5,712  | 47,752.32 | 0.04 |
| 416 | 002603 | 以岭药业  | 4,500  | 47,070.00 | 0.04 |
| 417 | 000543 | 皖能电力  | 9,788  | 46,884.52 | 0.04 |
| 418 | 600633 | 浙数文化  | 5,742  | 46,797.30 | 0.04 |
| 419 | 600157 | 永泰能源  | 34,791 | 46,619.94 | 0.04 |
| 420 | 000667 | 美好置业  | 18,530 | 46,325.00 | 0.04 |
| 421 | 002408 | 齐翔腾达  | 6,729  | 46,026.36 | 0.04 |
| 422 | 000848 | 承德露露  | 5,701  | 45,836.04 | 0.04 |
| 423 | 600557 | 康缘药业  | 4,447  | 45,715.16 | 0.04 |
| 424 | 601718 | 际华集团  | 13,643 | 45,704.05 | 0.04 |
| 425 | 600017 | 日照港   | 16,523 | 45,603.48 | 0.04 |
| 426 | 600073 | 上海梅林  | 6,100  | 45,445.00 | 0.04 |
| 427 | 600750 | 江中药业  | 2,684  | 45,440.12 | 0.04 |
| 428 | 002254 | 泰和新材  | 4,188  | 45,397.92 | 0.04 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 429 | 000012 | 南 玻 A | 11,377 | 45,394.23 | 0.04 |
| 430 | 600611 | 大众交通  | 11,296 | 45,071.04 | 0.04 |
| 431 | 002056 | 横店东磁  | 8,136  | 44,992.08 | 0.04 |
| 432 | 002573 | 清新环境  | 6,228  | 44,966.16 | 0.04 |
| 433 | 600503 | 华丽家族  | 14,700 | 44,835.00 | 0.04 |
| 434 | 002048 | 宁波华翔  | 4,298  | 44,828.14 | 0.04 |
| 435 | 600525 | 长园集团  | 10,159 | 44,496.42 | 0.04 |
| 436 | 300055 | 万邦达   | 5,800  | 44,486.00 | 0.04 |
| 437 | 000078 | 海王生物  | 14,785 | 44,059.30 | 0.04 |
| 438 | 002672 | 东江环保  | 3,845  | 43,986.80 | 0.04 |
| 439 | 002074 | 国轩高科  | 3,800  | 43,928.00 | 0.04 |
| 440 | 600978 | 宜华生活  | 10,697 | 43,857.70 | 0.04 |
| 441 | 002373 | 千方科技  | 3,900  | 43,368.00 | 0.04 |
| 442 | 600993 | 马应龙   | 3,228  | 43,319.76 | 0.04 |
| 443 | 600694 | 大商股份  | 1,790  | 43,300.10 | 0.04 |
| 444 | 601678 | 滨化股份  | 10,234 | 43,187.48 | 0.04 |
| 445 | 600499 | 科达洁能  | 10,666 | 43,090.64 | 0.04 |
| 446 | 002444 | 巨星科技  | 4,469  | 42,366.12 | 0.04 |
| 447 | 603766 | 隆鑫通用  | 10,288 | 42,077.92 | 0.04 |
| 448 | 600098 | 广州发展  | 7,400  | 41,884.00 | 0.04 |
| 449 | 000712 | 锦龙股份  | 4,607  | 41,831.56 | 0.04 |
| 450 | 000563 | 陕国投 A | 15,535 | 41,633.80 | 0.04 |
| 451 | 300026 | 红日药业  | 13,600 | 41,480.00 | 0.04 |
| 452 | 600754 | 锦江股份  | 1,938  | 41,279.40 | 0.04 |
| 453 | 600316 | 洪都航空  | 4,159  | 41,132.51 | 0.04 |
| 454 | 002640 | 跨境通   | 3,800  | 41,040.00 | 0.04 |
| 455 | 600759 | 洲际油气  | 17,179 | 40,542.44 | 0.04 |
| 456 | 000877 | 天山股份  | 5,692  | 40,470.12 | 0.04 |
| 457 | 000021 | 深科技   | 6,963  | 40,037.25 | 0.04 |
| 458 | 603000 | 人民网   | 5,430  | 39,639.00 | 0.04 |
| 459 | 600141 | 兴发集团  | 3,838  | 39,493.02 | 0.04 |
| 460 | 600259 | 广晟有色  | 1,766  | 39,487.76 | 0.04 |
| 461 | 300199 | 翰宇药业  | 4,200  | 39,228.00 | 0.04 |
| 462 | 600874 | 创业环保  | 4,753  | 39,212.25 | 0.04 |
| 463 | 002285 | 世联行   | 7,695  | 39,090.60 | 0.04 |
| 464 | 002064 | 华峰氨纶  | 9,322  | 39,059.18 | 0.04 |
| 465 | 000758 | 中色股份  | 10,676 | 38,967.40 | 0.04 |
| 466 | 600580 | 卧龙电气  | 6,048  | 38,102.40 | 0.04 |
| 467 | 000727 | 华东科技  | 25,900 | 38,073.00 | 0.04 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 468 | 000062 | 深圳华强  | 2,284  | 38,051.44 | 0.04 |
| 469 | 601311 | 骆驼股份  | 4,242  | 37,456.86 | 0.03 |
| 470 | 000061 | 农产品   | 7,680  | 37,248.00 | 0.03 |
| 471 | 600094 | 大名城   | 10,200 | 37,230.00 | 0.03 |
| 472 | 600151 | 航天机电  | 9,381  | 37,148.76 | 0.03 |
| 473 | 600757 | 长江传媒  | 5,692  | 37,111.84 | 0.03 |
| 474 | 002589 | 瑞康医药  | 5,282  | 36,815.54 | 0.03 |
| 475 | 002400 | 省广集团  | 12,364 | 36,597.44 | 0.03 |
| 476 | 000937 | 冀中能源  | 9,687  | 36,519.99 | 0.03 |
| 477 | 000718 | 苏宁环球  | 11,449 | 36,407.82 | 0.03 |
| 478 | 600188 | 兖州煤业  | 4,145  | 36,393.10 | 0.03 |
| 479 | 002426 | 胜利精密  | 15,600 | 36,192.00 | 0.03 |
| 480 | 000501 | 鄂武商 A | 3,817  | 36,185.16 | 0.03 |
| 481 | 002131 | 利欧股份  | 24,603 | 36,166.41 | 0.03 |
| 482 | 300115 | 长盈精密  | 4,393  | 35,978.67 | 0.03 |
| 483 | 300002 | 神州泰岳  | 10,835 | 35,755.50 | 0.03 |
| 484 | 002317 | 众生药业  | 4,282  | 35,754.70 | 0.03 |
| 485 | 600770 | 综艺股份  | 7,565  | 35,631.15 | 0.03 |
| 486 | 000156 | 华数传媒  | 4,492  | 35,621.56 | 0.03 |
| 487 | 600565 | 迪马股份  | 13,600 | 35,360.00 | 0.03 |
| 488 | 002233 | 塔牌集团  | 3,513  | 35,340.78 | 0.03 |
| 489 | 300010 | 立思辰   | 4,800  | 34,848.00 | 0.03 |
| 490 | 600478 | 科力远   | 8,878  | 34,624.20 | 0.03 |
| 491 | 000829 | 天音控股  | 6,164  | 34,580.04 | 0.03 |
| 492 | 600195 | 中牧股份  | 3,248  | 34,558.72 | 0.03 |
| 493 | 002482 | 广田集团  | 5,950  | 34,450.50 | 0.03 |
| 494 | 600765 | 中航重机  | 4,599  | 34,216.56 | 0.03 |
| 495 | 002244 | 滨江集团  | 8,564  | 34,084.72 | 0.03 |
| 496 | 300257 | 开山股份  | 3,400  | 33,966.00 | 0.03 |
| 497 | 000926 | 福星股份  | 5,550  | 33,966.00 | 0.03 |
| 498 | 601608 | 中信重工  | 12,911 | 33,568.60 | 0.03 |
| 499 | 601001 | 大同煤业  | 7,857  | 33,549.39 | 0.03 |
| 500 | 600169 | 太原重工  | 14,888 | 33,200.24 | 0.03 |
| 501 | 600594 | 益佰制药  | 6,000  | 33,120.00 | 0.03 |
| 502 | 600366 | 宁波韵升  | 6,604  | 33,086.04 | 0.03 |
| 503 | 000600 | 建投能源  | 6,586  | 33,061.72 | 0.03 |
| 504 | 002366 | 台海核电  | 3,500  | 32,830.00 | 0.03 |
| 505 | 600639 | 浦东金桥  | 2,896  | 32,608.96 | 0.03 |
| 506 | 000552 | 靖远煤电  | 12,664 | 32,419.84 | 0.03 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 507 | 000541 | 佛山照明 | 6,210  | 32,167.80 | 0.03 |
| 508 | 603328 | 依顿电子 | 3,234  | 32,016.60 | 0.03 |
| 509 | 600466 | 蓝光发展 | 5,880  | 31,634.40 | 0.03 |
| 510 | 002332 | 仙琚制药 | 5,148  | 31,557.24 | 0.03 |
| 511 | 000519 | 中兵红箭 | 5,005  | 31,481.45 | 0.03 |
| 512 | 600657 | 信达地产 | 7,967  | 31,310.31 | 0.03 |
| 513 | 002375 | 亚厦股份 | 6,193  | 31,212.72 | 0.03 |
| 514 | 000090 | 天健集团 | 6,762  | 31,105.20 | 0.03 |
| 515 | 002093 | 国脉科技 | 4,242  | 30,924.18 | 0.03 |
| 516 | 600022 | 山东钢铁 | 19,530 | 30,662.10 | 0.03 |
| 517 | 002635 | 安洁科技 | 2,697  | 30,557.01 | 0.03 |
| 518 | 600086 | 东方金钰 | 6,600  | 30,426.00 | 0.03 |
| 519 | 600122 | 宏图高科 | 8,357  | 30,335.91 | 0.03 |
| 520 | 300134 | 大富科技 | 3,216  | 30,230.40 | 0.03 |
| 521 | 000008 | 神州高铁 | 7,700  | 29,953.00 | 0.03 |
| 522 | 002665 | 首航节能 | 10,658 | 29,948.98 | 0.03 |
| 523 | 600959 | 江苏有线 | 7,260  | 29,911.20 | 0.03 |
| 524 | 600329 | 中新药业 | 2,358  | 29,333.52 | 0.03 |
| 525 | 000612 | 焦作万方 | 7,401  | 29,307.96 | 0.03 |
| 526 | 600748 | 上实发展 | 5,362  | 28,633.08 | 0.03 |
| 527 | 000426 | 兴业矿业 | 5,700  | 28,386.00 | 0.03 |
| 528 | 600058 | 五矿发展 | 4,354  | 28,344.54 | 0.03 |
| 529 | 600869 | 智慧能源 | 5,834  | 28,294.90 | 0.03 |
| 530 | 002505 | 大康农业 | 17,016 | 27,565.92 | 0.03 |
| 531 | 600971 | 恒源煤电 | 4,883  | 27,491.29 | 0.03 |
| 532 | 600687 | 刚泰控股 | 6,600  | 27,390.00 | 0.03 |
| 533 | 002489 | 浙江永强 | 10,280 | 27,139.20 | 0.03 |
| 534 | 600614 | 鹏起科技 | 7,552  | 27,111.68 | 0.03 |
| 535 | 002118 | 紫鑫药业 | 6,200  | 27,032.00 | 0.02 |
| 536 | 002276 | 万马股份 | 5,349  | 26,958.96 | 0.02 |
| 537 | 600640 | 号百控股 | 2,737  | 26,849.97 | 0.02 |
| 538 | 600006 | 东风汽车 | 7,418  | 26,704.80 | 0.02 |
| 539 | 002277 | 友阿股份 | 8,428  | 26,632.48 | 0.02 |
| 540 | 600458 | 时代新材 | 3,900  | 26,442.00 | 0.02 |
| 541 | 000158 | 常山北明 | 5,000  | 26,100.00 | 0.02 |
| 542 | 002002 | 鸿达兴业 | 9,059  | 26,089.92 | 0.02 |
| 543 | 002390 | 信邦制药 | 6,257  | 25,591.13 | 0.02 |
| 544 | 600416 | 湘电股份 | 4,957  | 25,578.12 | 0.02 |
| 545 | 002308 | 威创股份 | 5,700  | 25,365.00 | 0.02 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 546 | 600428 | 中远海特 | 7,800 | 25,350.00 | 0.02 |
| 547 | 002344 | 海宁皮城 | 5,564 | 25,316.20 | 0.02 |
| 548 | 603568 | 伟明环保 | 1,100 | 25,135.00 | 0.02 |
| 549 | 002251 | 步步高  | 3,259 | 24,181.78 | 0.02 |
| 550 | 600240 | 华业资本 | 9,300 | 24,087.00 | 0.02 |
| 551 | 002431 | 棕榈股份 | 6,430 | 22,955.10 | 0.02 |
| 552 | 002437 | 誉衡药业 | 8,176 | 22,892.80 | 0.02 |
| 553 | 601777 | 力帆股份 | 5,955 | 22,688.55 | 0.02 |
| 554 | 000969 | 安泰科技 | 4,982 | 22,668.10 | 0.02 |
| 555 | 002699 | 美盛文化 | 4,075 | 22,331.00 | 0.02 |
| 556 | 600743 | 华远地产 | 8,863 | 21,448.46 | 0.02 |
| 557 | 300287 | 飞利信  | 5,600 | 21,168.00 | 0.02 |
| 558 | 000587 | 金洲慈航 | 8,512 | 20,003.20 | 0.02 |
| 559 | 002681 | 奋达科技 | 5,395 | 19,745.70 | 0.02 |
| 560 | 002345 | 潮宏基  | 4,382 | 19,587.54 | 0.02 |
| 561 | 002041 | 登海种业 | 3,537 | 19,064.43 | 0.02 |
| 562 | 002642 | 荣之联  | 2,950 | 18,998.00 | 0.02 |
| 563 | 600335 | 国机汽车 | 3,018 | 18,832.32 | 0.02 |
| 564 | 002663 | 普邦股份 | 7,600 | 18,772.00 | 0.02 |
| 565 | 300202 | 聚龙股份 | 2,896 | 18,650.24 | 0.02 |
| 566 | 002249 | 大洋电机 | 5,600 | 18,480.00 | 0.02 |
| 567 | 002588 | 史丹利  | 4,668 | 18,158.52 | 0.02 |
| 568 | 002503 | 搜于特  | 7,692 | 18,076.20 | 0.02 |
| 569 | 600280 | 中央商场 | 5,404 | 17,563.00 | 0.02 |
| 570 | 600184 | 光电股份 | 1,756 | 17,156.12 | 0.02 |
| 571 | 300291 | 华录百纳 | 3,800 | 16,910.00 | 0.02 |
| 572 | 002354 | 天神娱乐 | 2,909 | 15,243.16 | 0.01 |
| 573 | 603169 | 兰石重装 | 3,400 | 14,518.00 | 0.01 |
| 574 | 603198 | 迎驾贡酒 | 1,000 | 14,110.00 | 0.01 |
| 575 | 600618 | 氯碱化工 | 2,154 | 13,979.46 | 0.01 |
| 576 | 600917 | 重庆燃气 | 1,801 | 12,823.12 | 0.01 |
| 577 | 600751 | 海航科技 | 3,700 | 10,027.00 | 0.01 |
| 578 | 601016 | 节能风电 | 3,800 | 8,816.00  | 0.01 |
| 579 | 603260 | 合盛硅业 | 65    | 2,847.00  | 0.00 |
| 580 | 601869 | 长飞光纤 | 39    | 1,551.03  | 0.00 |
| 581 | 603650 | 彤程新材 | 76    | 1,507.08  | 0.00 |
| 582 | 603806 | 福斯特  | 30    | 804.00    | 0.00 |
| 583 | 603056 | 德邦股份 | 46    | 761.30    | 0.00 |
| 584 | 601019 | 山东出版 | 50    | 391.00    | 0.00 |

|     |        |      |    |        |      |
|-----|--------|------|----|--------|------|
| 585 | 603025 | 大豪科技 | 21 | 234.15 | 0.00 |
| 586 | 603077 | 和邦生物 | 82 | 132.84 | 0.00 |

### 8.3.2 期末积极投资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  | 000540 | 中天金融   | 41,740 | 108,106.60 | 0.10         |
| 2  | 600485 | 信威集团   | 16,168 | 100,403.28 | 0.09         |
| 3  | 603185 | 上机数控   | 1,076  | 52,831.60  | 0.05         |
| 4  | 601860 | 紫金银行   | 15,970 | 50,145.80  | 0.05         |
| 5  | 000693 | *ST 华泽 | 3,507  | 9,398.76   | 0.01         |

### 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  | 601398 | 工商银行 | 2,953,500.00 | 1.96           |
| 2  | 002027 | 分众传媒 | 543,360.00   | 0.36           |
| 3  | 601229 | 上海银行 | 488,197.00   | 0.32           |
| 4  | 603288 | 海天味业 | 433,616.00   | 0.29           |
| 5  | 600919 | 江苏银行 | 357,466.00   | 0.24           |
| 6  | 002415 | 海康威视 | 295,754.00   | 0.20           |
| 7  | 002460 | 赣锋锂业 | 241,113.00   | 0.16           |
| 8  | 002044 | 美年健康 | 220,438.00   | 0.15           |
| 9  | 600011 | 华能国际 | 211,501.00   | 0.14           |
| 10 | 300015 | 爱尔眼科 | 202,821.00   | 0.13           |
| 11 | 300408 | 三环集团 | 187,167.00   | 0.12           |
| 12 | 000413 | 东旭光电 | 186,018.00   | 0.12           |
| 13 | 300142 | 沃森生物 | 179,104.00   | 0.12           |
| 14 | 300003 | 乐普医疗 | 177,910.00   | 0.12           |
| 15 | 603156 | 养元饮品 | 166,828.87   | 0.11           |
| 16 | 600867 | 通化东宝 | 157,434.00   | 0.10           |
| 17 | 601877 | 正泰电器 | 157,082.10   | 0.10           |
| 18 | 600901 | 江苏租赁 | 155,843.75   | 0.10           |
| 19 | 000001 | 平安银行 | 148,824.00   | 0.10           |
| 20 | 002422 | 科伦药业 | 147,246.00   | 0.10           |

## 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  | 601398 | 工商银行  | 3,213,508.00 | 2.14            |
| 2  | 603259 | 药明康德  | 568,920.00   | 0.38            |
| 3  | 601318 | 中国平安  | 357,505.00   | 0.24            |
| 4  | 601066 | 中信建投  | 212,897.00   | 0.14            |
| 5  | 600901 | 江苏租赁  | 185,210.40   | 0.12            |
| 6  | 000002 | 万 科 A | 183,008.00   | 0.12            |
| 7  | 603156 | 养元饮品  | 181,886.90   | 0.12            |
| 8  | 002001 | 新 和 成 | 179,806.50   | 0.12            |
| 9  | 002739 | 万达电影  | 171,589.50   | 0.11            |
| 10 | 002405 | 四维图新  | 165,478.48   | 0.11            |
| 11 | 601099 | 太平洋   | 156,816.44   | 0.10            |
| 12 | 000488 | 晨鸣纸业  | 152,857.18   | 0.10            |
| 13 | 300168 | 万达信息  | 147,313.00   | 0.10            |
| 14 | 002271 | 东方雨虹  | 146,994.20   | 0.10            |
| 15 | 600036 | 招商银行  | 144,033.00   | 0.10            |
| 16 | 000651 | 格力电器  | 136,557.00   | 0.09            |
| 17 | 600025 | 华能水电  | 134,001.50   | 0.09            |
| 18 | 000977 | 浪潮信息  | 130,817.10   | 0.09            |
| 19 | 603019 | 中科曙光  | 130,105.00   | 0.09            |
| 20 | 002673 | 西部证券  | 128,291.92   | 0.09            |

## 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 | 10,455,947.70 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 20,887,414.32 |

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      | -    | -             |
| 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) | 18,008.90 | 0.02 |
| 8  | 同业存单       | -         | -    |
| 9  | 其他         | -         | -    |
| 10 | 合计         | 18,008.90 | 0.02 |

### 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  | 110049 | 海尔转债 | 170    | 17,000.00 | 0.02          |
| 2  | 113523 | 伟明转债 | 10     | 1,008.90  | 0.00          |

注：本基金本报告期末仅持有上述 2 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

#### (1) 兴业银行

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股兴业银行。

根据银保监会 2018 年 5 月 4 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表-银保监银罚决字〔2018〕1 号-兴业银行股份有限公司》的公告，兴业银行因同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保、债券卖出回购业务违规出表、个人理财资金违规投资、向四证不全的房地产项目提供融资等 12 项违规被罚 5870 万元，这 12 项案由中，多涉及违反宏观调控政策、影子银行和交叉金融产品风险以及违法违规展业。与兴业银行一同被罚的还有该银行旗下的兴业金融租赁有限责任公司。兴业金融租赁因未制定明确的服务收费标准并公示以及办理融资租赁业务时搭售理财产品被罚 110 万元。除此之外，兴业银行苏州分行还存在买入返售业务项下基础资产不合规的情况，该银行两名直接责任人受到银保监会处罚。其中，原兴业银行苏州分行行长黄立峰受到警告处分，并被罚款 5 万元；胡刚被警告并罚款 10 万元。根据 4 月 16 日《上海银监局行政处罚信息公开表（沪银监罚决字〔2018〕12 号）》，2015 年 9 月，兴业银行股份有限公司上海分行在某理财业务中，对底层资产为非标准化债权资产的投资投前尽职调查严重不审慎。责令改正，罚款人民币 50 万元。根据 4 月 2 日中国人民银行福州中心支行公布了福银罚字〔2018〕10 号行政处罚公示表，兴业银行股份有限公司因违反国库管理规定，被警告并处罚款 5 万元人民币。对以上事件，本基金做出如下说明：兴业银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，公司高度重视内部控制建设，并围绕内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督等方面不断加强和完善内部控制机制。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

#### (2) 民生银行

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股民生银行。

根据银保监会 2018 年 12 月 7 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表-银保监银罚决字〔2018〕5 号-中国民生银行股份有限公司》的公告，民生银行因贷款业务严重违反审慎经营规则，被罚款 200 万元。根据银保监会 2018 年 12 月 7 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表-银保监银罚决字〔2018〕8 号-中国民生银行股份有限公司》的公告，民生银行因：内控管理严重违反审慎经营规则；同业投资违规接受担保；同业投资、理财

资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；本行理财产品之间风险隔离不到位；个人理财资金违规投资；票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；为非保本理财产品提供保本承诺等原因，被罚款 3160 万元。

对以上事件，本基金判断，民生银行是全国性股份制商业银行之一，上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

### （3）招商银行

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股招商银行。

根据银监罚决字〔2018〕1 号，招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）因电话销售欺骗投保人，被深圳保监局罚款 30 万元；根据银监罚决字〔2018〕1 号，招商银行因违反内控管理严重违反审慎经营规则、违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款以及同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保等行为，被中国银监会罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。对以上事件，本基金判断招商银行作为全国性的股份制银行，具有一定的系统重要性，具有较强的市场口碑和较强的市场竞争力，整体来看，上述处罚对公司影响极小。后续将关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

### （4）伟明转债

根据温鹿公（绣）行罚决字[2018]15476 号，浙江伟明环保股份有限公司（以下简称“伟明环保”）因不履行国际联网备案职责案被行政处罚，针对上述事件，本基金做出如下说明：伟明环保是一家固体废弃物处理为主业的上市公司，是固废处理领域的领军企业，同时具有垃圾处理及发电行业全产业链优势，拥有行业领先的研发能力和技术水平，基本面较好，上述处罚对公司影响小。后续将关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

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

## 8.12.2

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   | 3,241.89 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | 2,306.85 |

|   |       |          |
|---|-------|----------|
| 5 | 应收申购款 | 634.85   |
| 6 | 其他应收款 | -        |
| 7 | 待摊费用  | -        |
| 8 | 其他    | -        |
| 9 | 合计    | 6,183.59 |

#### 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

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|--------|-------------|---------------|----------|
| 1  | 000540 | 中天金融   | 108,106.60  | 0.10          | 重大事项停牌   |
| 2  | 600485 | 信威集团   | 100,403.28  | 0.09          | 重大事项停牌   |
| 3  | 601860 | 紫金银行   | 50,145.80   | 0.05          | 新股未上市    |
| 4  | 000693 | *ST 华泽 | 9,398.76    | 0.01          | 重大事项停牌   |

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 7,222        | 13,504.14     | 16,613,430.41 | 17.03%     | 80,913,490.13 | 82.97%     |

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 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<br>比例 |
|----|---------------------------------|--------------|--------------|
| 1  | 工银瑞信基金公司－农行－中国农业银行离退休人员福利负债     | 4,805,376.00 | 5.89%        |
| 2  | 中国工商银行股份有限公司企业年金计划－中国建设银行股份有限公司 | 4,603,371.00 | 5.64%        |
| 3  | 中国工商银行股份有限公司企业年金计划－中国建设银行股份有限公司 | 3,728,891.00 | 4.57%        |
| 4  | 余栋腾                             | 2,392,881.00 | 2.93%        |
| 5  | 王飞舟                             | 1,677,417.00 | 2.05%        |
| 6  | 恒生电子股份有限公司                      | 1,164,532.00 | 1.43%        |
| 7  | 靳宁卿                             | 990,000.00   | 1.21%        |
| 8  | 中国银行股份有限公司企业年金计划－中国农业银行         | 949,200.00   | 1.16%        |
| 9  | 纪伟才                             | 938,029.00   | 1.15%        |
| 10 | 于成福                             | 932,390.00   | 1.14%        |

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 | 0.80      | 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（2015 年 5 月 22 日）基金份额总额 | 542,268,490.78 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 104,056,548.64 |
| 本报告期期间基金总申购份额                  | 1,158,146.71   |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额                | 7,687,774.81   |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）     | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 97,526,920.54  |

## § 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

原督察长叶金松先生因退休离任，由张利宁女士担任本公司督察长。

上述变更事项已经公司第七届董事会第七次会议审议通过，并按规定向相关监管机构备案。

2018 年 4 月 27 日，中国证券监督管理委员会北京监管局作出《关于对长盛基金管理有限公司拟任合规负责人任职资格的意见》（京证监发〔2018〕136 号），对张利宁女士担任本公司督察长无异议。

#### 11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。

### 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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元，已连续提供审计服务 10 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 | 1      | 15,211,582.61 | 51.47%       | 14,166.41 | 51.52%     | -  |
| 光大证券 | 1      | 7,278,262.41  | 24.63%       | 6,778.40  | 24.65%     | -  |
| 长江证券 | 1      | 4,807,715.80  | 16.27%       | 4,457.84  | 16.21%     | -  |
| 兴业证券 | 1      | 2,246,387.50  | 7.60%        | 2,092.00  | 7.61%      | -  |
| 联合证券 | 1      | 9,321.00      | 0.03%        | -         | -          | -  |
| 招商证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国元证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 东兴证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 东方证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 申银万国 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 海通证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中金证券 | 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 | 52,286.00  | 13.21%       | -      | -              | -    | -            |
| 光大证券 | 135,667.10 | 34.28%       | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券 | 86,385.90  | 21.82%       | -      | -              | -    | -            |
| 兴业证券 | 52,275.30  | 13.21%       | -      | -              | -    | -            |
| 联合证券 | 69,200.00  | 17.48%       | -      | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国元证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东兴证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东方证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 申银万国 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东北证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 中金证券 | - | - | - | - | - | - |

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：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：

| 序号 | 证券公司名称 | 交易单元所属市场 | 数量 |
|----|--------|----------|----|
| 1  | 中信证券   | 上海       | 1  |



|   |      |    |   |
|---|------|----|---|
| 2 | 国信证券 | 深圳 | 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  | 关于中国邮政储蓄银行股份有限公司暂停我司部分基金的申购、定期定额投资、转托管转入、基金转换转入等业务的公告 | 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》及本公司网站 | 2018 年 12 月 28 日 |
| 2  | 长盛基金管理有限公司关于广发证券开通旗下部分开放式基金转换业务并推出申购（含定投）费率优惠活动的公告    | 同上                         | 2018 年 12 月 18 日 |
| 3  | 长盛基金管理有限公司关于办公地址变更的公告                                 | 同上                         | 2018 年 12 月 3 日  |
| 4  | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2018 年第 3 季度报告             | 同上                         | 2018 年 10 月 24 日 |
| 5  | 长盛基金管理有限公司关于开通国元证券销售代理旗下部分开放式基金基金定投业务的公告              | 同上                         | 2018 年 10 月 8 日  |
| 6  | 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                         | 2018 年 9 月 29 日  |
| 7  | 长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东海证券申购（含定投）费率优惠活动的公告           | 同上                         | 2018 年 9 月 10 日  |
| 8  | 长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中金公司申购（含定投）费率优惠活动的公告           | 同上                         | 2018 年 8 月 31 日  |
| 9  | 长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰诚财富为代销机构并开通定投和转换业务并参加费率优惠的公告     | 同上                         | 2018 年 8 月 31 日  |
| 10 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2018 年半年度报告                | 同上                         | 2018 年 8 月 29 日  |
| 11 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2018 年半年度报告摘要              | 同上                         | 2018 年 8 月 29 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东北证券申购（含定投）费率优惠活动的公告           | 同上                         | 2018 年 8 月 13 日  |
| 13 | 长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加第一创业证券申购（含定投）费率优惠活动的公告         | 同上                         | 2018 年 8 月 13 日  |
| 14 | 长盛基金管理有限公司关于增加唐鼎耀华为旗下基金代销机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告     | 同上                         | 2018 年 8 月 7 日   |
| 15 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金                                  | 同上                         | 2018 年 7 月 20 日  |

|    |                                                    |    |                 |
|----|----------------------------------------------------|----|-----------------|
|    | (LOF) 2018 年第 2 季度报告                               |    |                 |
| 16 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)              | 同上 | 2018 年 7 月 3 日  |
| 17 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (更新) 摘要         | 同上 | 2018 年 7 月 3 日  |
| 18 | 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 | 2018 年 6 月 30 日 |
| 19 | 长盛基金管理有限公司关于上海基煜基金销售有限公司参加费率优惠活动的公告                | 同上 | 2018 年 6 月 12 日 |
| 20 | 长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加银河证券申购 (含定投) 费率优惠活动的公告      | 同上 | 2018 年 5 月 21 日 |
| 21 | 长盛基金管理有限公司高级管理人员督察长变更的公告                           | 同上 | 2018 年 5 月 3 日  |
| 22 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2018 年第 1 季度报告          | 同上 | 2018 年 4 月 20 日 |
| 23 | 长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加东海证券申购费率优惠活动的公告             | 同上 | 2018 年 4 月 2 日  |
| 24 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2017 年度报告               | 同上 | 2018 年 3 月 31 日 |
| 25 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2017 年度报告 摘要            | 同上 | 2018 年 3 月 31 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 | 2018 年 3 月 30 日 |
| 27 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加展恒基金费率优惠活动的公告                    | 同上 | 2018 年 3 月 26 日 |
| 28 | 关于修改长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同等法律文件的公告        | 同上 | 2018 年 3 月 23 日 |
| 29 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)              | 同上 | 2018 年 3 月 23 日 |
| 30 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同                    | 同上 | 2018 年 3 月 22 日 |
| 31 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议                    | 同上 | 2018 年 3 月 22 日 |
| 32 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2017 年第 4 季度报告          | 同上 | 2018 年 1 月 20 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、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）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。

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/或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、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2019 年 3 月 29 日