

长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 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。本中期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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 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.....	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	50
7.8 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.....	51
7.9 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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.4 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.....	53
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
10.2 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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	59
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>61</b>

11.1 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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	长盛同益成长回报混合（LOF）
场内简称	长盛同益 LOF
基金主代码	160812
交易代码	160812
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 4 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	102,291,990.31 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 6 月 4 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过自上而下筛选增长预期良好或景气复苏的行业，结合挖掘目标行业的上市公司基本面，自下而上精选个股，为投资者实现资产长期增值，力争获得绝对回报。
投资策略	<p>本基金将通过深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标和政策因素，动态调整基金资产在股票、股指期货、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>股票投资策略上，本基金将充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，采用定性和定量相结合的方式，以深入的基本面研究为基础，结合数据挖掘技术，密切跟踪市场景气变化，挖掘具有快速成长预期、且估值相对较低的个股进行投资，并通过对股票投资机会的精细操作，审慎选择投资时机，力争获取正回报。本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，在市场向下带动净值走低时，通过股指期货快速降低投资组合的仓位，从而调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特</p>

	性；并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时，通过股指期货快速提高投资组合的仓位，从而提高基金资产收益。本基金的权证投资是以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。
业绩比较基准	50%*沪深300指数收益率+50%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	郭明
	联系电话	010-86497608	010-66105799
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666、 010-86497888	95588
传真		010-86497999	010-66105798
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼10D	北京市西城区复兴门内大街55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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100029	100140
法定代表人		周兵	陈四清

注：长盛基金管理有限公司法定代表人已于2021年7月21日变更为高民和。

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	62,850,177.11
本期利润	6,813,971.20
加权平均基金份额本期利润	0.0653
本期加权平均净值利润率	2.44%
本期基金份额净值增长率	2.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	180,511,928.66
期末可供分配基金份额利润	1.7647
期末基金资产净值	282,733,011.20
期末基金份额净值	2.764
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	174.16%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

4、本基金由同益证券投资基金转型而来，转型日为2014年4月4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
过去一个月	2.26%	0.82%	-0.91%	0.41%	3.17%	0.41%
过去三个月	9.51%	1.00%	2.42%	0.49%	7.09%	0.51%
过去六个月	2.48%	1.42%	1.47%	0.66%	1.01%	0.76%
过去一年	34.96%	1.38%	14.21%	0.66%	20.75%	0.72%
过去三年	96.45%	1.29%	32.81%	0.68%	63.64%	0.61%
自基金转型日起至今	174.16%	1.39%	93.75%	0.74%	80.41%	0.65%



注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

基准指数的构建考虑了三个原则：

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

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

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

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同益证券投资基金转型而来，转型日期为2014年4月4日（即基金合同生效日）。

2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

## § 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 2.06 亿元。长盛基金总部办公地位于北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，并拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。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、私募资产管理、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 2021 年 6 月 30 日，基金管理人共管理六十七只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张谊然	本基金基金经理，长盛同享灵活配置混合型证券投资基金基金经理，研究部副总监。	2019 年 5 月 22 日	-	13 年	张谊然女士，硕士。曾任中国国际金融股份有限公司基础分析组分析员。2012 年 9 月加入长盛基金管理有限公司。

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

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

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 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 公平交易制度的执行情况

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

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

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

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投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。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 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

2021 年上半年，市场呈现宽幅区间震荡。年初，在基本面向好与新发基金热情较高等因素共同作用下，市场延续了去年四季度的上行趋势，特别是化工、新能源、医药、食品饮料等机构重仓行业表现较好，同时，相关行业估值升至历史较高水平。春节之后，海外、国内通胀预期升温导致国债收益率快速上行，引发市场对机构重仓股高估值可持续的担忧，部分资金调仓布局低估值板块，机构重仓股出现较大调整。4-5 月，随着宏观流动性改善，市场打开阶段上行窗口，多

数热门板块轮动修复。二季度以来市场上行主要源于此前主导大势下行的信用快速收缩、通胀快速上行两大不利条件在 5 月边际缓解，体现为 M1-PPI 筑底。同时，基本面的惯性复苏仍在继续，但边际趋缓，利率呈现稳中有松；微观结构上，前期热门板块一定程度上出清，叠加外资恢复布局，基金仓位调整到位等，市场交易结构优化。从基本面、流动性条件到微观结构，都有利于权益资产打开向上窗口。

报告期内，本组合对于优质的蓝筹股以及处在长期成长赛道的成长股积极操作，组合风格保持均衡，组合仓位根据市场情况动态调整，整体维持中高仓位。

#### 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 2.764 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.48%，业绩比较基准收益率为 1.47%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年下半年，中国经济放缓的趋势大概率延续，主要源于一方面海外经济随着全民免疫的实现，对国内出口的拉动将有所减弱，另一方面前期快速上涨的原材料成本也对中下游的生产形成一定的制约。但考虑地产后周期产业链相对稳定以及财政支出后移，预计经济失速风险也不大。货币政策保持稳健中性，流动性环境整体比较友好。综合基本面与流动性环境，短期大势显著下行风险可控，但在紧信用条件没有改变之前估值难扩张，上行幅度同样有限。从股票定价角度看，将出现“分子端不能向上，分母端来不及支撑”的情景。风格上延续结构轮动，盈利高增长的板块与个股能够通过业绩的高增长缓解分母端压力，但也需警惕其短期估值过高的回调风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风

险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。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 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中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期末未实施利润分配。

本基金截至 2021 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 180,511,928.66 元，其中：未分配利润已实现部分为 192,694,160.12 元，未分配利润未实现部分为-12,182,231.46 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**

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的管理人——长盛基金管理有限公司在长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2021年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	40,523,405.13	35,414,140.61
结算备付金		464,882.01	179,959.91
存出保证金		55,244.42	15,198.85
交易性金融资产	6.4.7.2	243,833,177.43	255,838,396.68
其中：股票投资		242,495,577.43	255,689,468.90
基金投资		-	-
债券投资		1,337,600.00	148,927.78
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		296,959.80	507,610.47
应收利息	6.4.7.5	3,821.09	3,580.32
应收股利		-	-
应收申购款		279.60	1,013.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		285,177,769.48	291,959,900.66
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		209,666.30	67,321.57
应付管理人报酬		340,330.44	347,480.97
应付托管费		56,721.75	57,913.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	239,527.55	126,106.41
应交税费		815,699.85	815,700.03



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	782,812.39	838,348.89
负债合计		2,444,758.28	2,252,871.36
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	102,221,082.54	107,329,403.82
未分配利润	6.4.7.10	180,511,928.66	182,377,625.48
所有者权益合计		282,733,011.20	289,707,029.30
负债和所有者权益总计		285,177,769.48	291,959,900.66

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.764 元，基金份额总额 102,291,990.31 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		10,252,681.45	57,943,858.87
1.利息收入		72,895.42	93,384.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	72,808.70	93,297.93
债券利息收入		86.72	86.11
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		66,198,151.48	22,964,462.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	64,630,192.99	21,897,523.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	39,640.33	68,515.70
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,528,318.16	998,423.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-56,036,205.91	34,846,473.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	17,840.46	39,538.52
<b>减：二、费用</b>		3,438,710.25	2,401,655.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,085,203.33	1,664,800.40
2. 托管费	6.4.10.2.2	347,533.90	277,466.75

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	867,984.06	321,087.47
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.03	0.27
7. 其他费用	6.4.7.20	137,988.93	138,300.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		6,813,971.20	55,542,203.12
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		6,813,971.20	55,542,203.12

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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）	107,329,403.82	182,377,625.48	289,707,029.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,813,971.20	6,813,971.20
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）	-5,108,321.28	-8,679,668.02	-13,787,989.30
其中：1.基金申购款	372,029.18	623,805.51	995,834.69
2.基金赎回款	-5,480,350.46	-9,303,473.53	-14,783,823.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	102,221,082.54	180,511,928.66	282,733,011.20
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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)	136,795,578.81	83,217,328.29	220,012,907.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	55,542,203.12	55,542,203.12
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)	-17,458,786.64	-13,554,801.09	-31,013,587.73
其中：1.基金申购款	392,749.33	282,712.86	675,462.19
2.基金赎回款	-17,851,535.97	-13,837,513.95	-31,689,049.92
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)	119,336,792.17	125,204,730.32	244,541,522.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
周兵

\_\_\_\_\_  
刁俊东

\_\_\_\_\_  
龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同益证券投资基金（以下简称“基金同益”）转型而成。根据基金同益的基金份额持有人大会审议通过的《关于同益证券投资基金转型有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）基金监管部《关于同益证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]150号）及深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2014]118号）的同意，基金同益于2014年4月3日进行终止上市权益登记，2014年4月4日终止上市。自基金同益终止上市之日起，基金同益转型为长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），由《同益证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，

注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》、《关于同益证券投资基金转换所得长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额折算的公告》等相关规定，基金管理人确定 2014 年 5 月 14 日作为基金份额折算基准日。经本基金管理人计算并经基金托管人复核的折算基准日基金份额净值为人民币 1.000821371 元，折算基准日本基金份额净值采用四舍五入的方法保留到小数点后第 9 位。本基金管理人按照 1: 1.000821371 的折算比例对基金同益进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值为人民币 1.000 元，折算后本基金的基金份额数采用截尾的方式保留到整数，所产生的误差归入基金资产。折算前基金同益份额总额为 20 亿份，折算后基金份额总额为 2,001,642,742.00 份。本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2014 年 5 月 16 日对折算后的份额进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2014 年 4 月 14 日至 2014 年 5 月 9 日期间内开放集中申购，集中申购款扣除申购费后的净申购金额为人民币 686,467,684.84 元，折合 686,467,684.84 份基金份额；申购资金在集中申购期间产生的利息为人民币 182,782.70 元，折合 182,782.70 份基金份额；集中申购期间收到的实收基金共计人民币 686,650,467.54 元，折合 686,650,467.54 份基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的 0%–95%；其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；权证投资占基金资产净值的 0%–3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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：50%\*沪深 300 指数收益率+50%\*中证综合债指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的

编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	40,523,405.13
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：	40,523,405.13

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	204,720,037.14	242,495,577.43	37,775,540.29
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	1,337,600.00	1,337,600.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,337,600.00	1,337,600.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		206,057,637.14	243,833,177.43	37,775,540.29

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	3,528.79
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	188.19
应收债券利息	81.70
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	22.41
合计	3,821.09

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----



	2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	239,527.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	239,527.55

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	555,208.31
应付赎回费	790.19
应付证券出借违约金	-
其他	98,800.96
预提费用	128,012.93
合计	782,812.39

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	107,403,943.99	107,329,403.82
本期申购	372,287.92	372,029.18
本期赎回(以“-”号填列)	-5,484,241.60	-5,480,350.46
- 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	102,291,990.31	102,221,082.54

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.10 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	137,797,316.09	44,580,309.39	182,377,625.48
本期利润	62,850,177.11	-56,036,205.91	6,813,971.20
本期基金份额交易产生的变动数	-7,953,333.08	-726,334.94	-8,679,668.02

其中：基金申购款	584,658.11	39,147.40	623,805.51
基金赎回款	-8,537,991.19	-765,482.34	-9,303,473.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	192,694,160.12	-12,182,231.46	180,511,928.66

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	69,389.07
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	3,114.54
其他	305.09
合计	72,808.70

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	288,586,578.77
减：卖出股票成本总额	223,956,385.78
买卖股票差价收入	64,630,192.99

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30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	39,640.33
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	39,640.33

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	156,760.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	117,100.00
减：应收利息总额	20.53
买卖债券差价收入	39,640.33

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

注：无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,528,318.16
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,528,318.16

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-56,036,205.91
——股票投资	-56,004,378.13
——债券投资	-31,827.78
——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	-56,036,205.91

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	17,642.36
基金转换费收入	198.10
合计	17,840.46

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	867,984.06
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	867,984.06

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费用	18,000.00
其他手续费	600.00
上市年费	29,752.78
银行费用	376.00
合计	137,988.93

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

无。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人股东、基金代销机构

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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国元证券	-	-	129,206,960.09	71.40%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	120,330.30	71.40%	20,112.91	40.41%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,085,203.33
其中：支付销售机构的客户维护费	88,228.10	75,919.79

注：基金管理费每日计算，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	347,533.90	277,466.75

注：基金托管费每日计算，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
国元证券	4,003,286.00	3.9136%	4,003,286.00	3.7273%

**6.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	40,523,405.13	69,389.07	40,664,649.77	91,469.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

注：无。

**6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688499	利元亨	2021年6月23日	2022年1月3日	限售期锁定	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2022年1月10日	限售期锁定	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中	2021年	2021	新股未	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-



	港	6月29日	2021年7月7日	上市							
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41		-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70		-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96		-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14		-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	限售期锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78		-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	限售期锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30		-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	限售期锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44		-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	限售期锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40		-
688383	新益昌	2021年4月21日	2021年10月28日	限售期锁定	19.58	128.50	2,701	52,885.58	347,078.50		-
688621	阳光诺和	2021年6月11日	2021年12月21日	限售期锁定	26.89	83.09	1,485	39,931.65	123,388.65		-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	限售期锁定	47.33	252.43	194	9,182.02	48,971.42		-
688395	正弦电气	2021年4月21日	2021年10月29日	限售期锁定	15.95	25.72	1,627	25,950.65	41,846.44		-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月	限售期锁定	33.22	105.33	338	11,228.36	35,601.54		-

		日	月 26 日								
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	限售期 锁定	28.28	145.09	237	6,702.36	34,386.33	-	
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	限售期 锁定	7.64	54.81	462	3,529.68	25,322.22	-	
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	限售期 锁定	28.77	99.89	240	6,904.80	23,973.60	-	
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	限售期 锁定	12.54	31.22	741	9,292.14	23,134.02	-	
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	限售期 锁定	48.59	106.28	198	9,620.82	21,043.44	-	
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	限售期 锁定	6.87	14.98	1,133	7,783.71	16,972.34	-	
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	限售期 锁定	8.72	35.33	471	4,107.12	16,640.43	-	
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	限售期 锁定	9.19	49.61	329	3,023.51	16,321.69	-	
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	限售期 锁定	15.83	50.96	317	5,018.11	16,154.32	-	
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	限售期 锁定	24.69	31.70	492	12,147.48	15,596.40	-	
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	限售期 锁定	18.71	76.32	201	3,760.71	15,340.32	-	

300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	限售期锁定	12.76	43.35	307	3,917.32	13,308.45	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	限售期锁定	12.25	53.66	244	2,989.00	13,093.04	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	限售期锁定	3.40	22.12	576	1,958.40	12,741.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	限售期锁定	20.81	50.60	241	5,015.21	12,194.60	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	限售期锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	限售期锁定	13.75	41.07	275	3,781.25	11,294.25	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	限售期锁定	16.53	46.05	232	3,834.96	10,683.60	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	限售期锁定	6.79	34.76	301	2,043.79	10,462.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	限售期锁定	8.42	16.77	593	4,993.06	9,944.61	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	限售期锁定	14.79	37.23	264	3,904.56	9,828.72	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	限售期锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	限售期锁定	12.10	23.23	410	4,961.00	9,524.30	-
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月	限售期锁定	11.72	27.07	340	3,984.80	9,203.80	-

			13 日							
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	限售期锁定	7.81	28.93	312	2,436.72	9,026.16	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	限售期锁定	4.56	18.87	474	2,161.44	8,944.38	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	限售期锁定	13.00	27.39	324	2,808.00	8,874.36	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	限售期锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	限售期锁定	13.06	34.14	254	3,317.24	8,671.56	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	限售期锁定	8.41	39.12	219	1,841.79	8,567.28	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	限售期锁定	5.48	17.07	492	2,696.16	8,398.44	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	限售期锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 12 日	限售期锁定	10.76	22.16	359	3,862.84	7,955.44	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	限售期锁定	13.11	24.47	322	4,221.42	7,879.34	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	限售期锁定	12.13	27.73	283	3,432.79	7,847.59	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	限售期锁定	4.54	15.34	507	2,301.78	7,777.38	-
300985	致远	2021 年	2021	限售期	24.90	27.29	283	7,046.70	7,723.07	-

	新能	4月21日	年10月29日	锁定							
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	限售期锁定	14.20	44.02	175	2,485.00	7,703.50	-	
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	限售期锁定	7.19	16.20	430	3,091.70	6,966.00	-	
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	限售期锁定	13.39	30.08	217	2,905.63	6,527.36	-	
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	限售期锁定	9.79	23.00	255	2,496.45	5,865.00	-	
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	限售期锁定	14.72	28.81	191	2,811.52	5,502.71	-	
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	限售期锁定	8.05	32.12	170	1,368.50	5,460.40	-	
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	限售期锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-	
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	限售期锁定	9.36	26.89	200	1,872.00	5,378.00	-	
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	限售期锁定	7.83	22.61	218	1,706.94	4,928.98	-	
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	限售期锁定	24.60	163.00	278	6,838.80	45,314.00	-	

## 6.4.12.1.2 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	认购价格	期末估值单价	数量（单位：）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	-------	------	------	------	--------	---------	--------	--------	----

				类型			张)			
113050	南银转债	2021年6月16日	2021年7月1日	配债未上市	100.00	100.00	10,990	1,099,000.00	1,099,000.00	-
113626	伯特转债	2021年6月30日	2021年7月21日	配债未上市	100.00	100.00	2,010	201,000.00	201,000.00	-
123117	健帆转债	2021年6月23日	2021年7月12日	配债未上市	100.00	100.00	376	37,600.00	37,600.00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2021 年 6 月 30 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 0.47%（2020 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 0.05%）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计



2021年6月30日					
资产					
银行存款	40,523,405.13	-	-	-	40,523,405.13
结算备付金	464,882.01	-	-	-	464,882.01
存出保证金	55,244.42	-	-	-	55,244.42
交易性金融资产	-	-	1,337,600.00	242,495,577.43	243,833,177.43
应收证券清算款	-	-	-	296,959.80	296,959.80
应收利息	-	-	-	3,821.09	3,821.09
应收申购款	-	-	-	279.60	279.60
资产总计	41,043,531.56	-	1,337,600.00	242,796,637.92	285,177,769.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	209,666.30	209,666.30
应付管理人报酬	-	-	-	340,330.44	340,330.44
应付托管费	-	-	-	56,721.75	56,721.75
应付交易费用	-	-	-	239,527.55	239,527.55
应交税费	-	-	-	815,699.85	815,699.85
其他负债	-	-	-	782,812.39	782,812.39
负债总计	-	-	-	2,444,758.28	2,444,758.28
利率敏感度缺口	41,043,531.56	-	1,337,600.00	240,351,879.64	282,733,011.20
上年度末 2020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	35,414,140.61	-	-	-	35,414,140.61
结算备付金	179,959.91	-	-	-	179,959.91
存出保证金	15,198.85	-	-	-	15,198.85
交易性金融资产	-	-	148,927.78	255,689,468.90	255,838,396.68
应收证券清算款	-	-	-	507,610.47	507,610.47
应收利息	-	-	-	3,580.32	3,580.32
应收申购款	-	-	-	1,013.82	1,013.82
资产总计	35,609,299.37	-	148,927.78	256,201,673.51	291,959,900.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	67,321.57	67,321.57
应付管理人报酬	-	-	-	347,480.97	347,480.97
应付托管费	-	-	-	57,913.49	57,913.49
应付交易费用	-	-	-	126,106.41	126,106.41
应交税费	-	-	-	815,700.03	815,700.03
其他负债	-	-	-	838,348.89	838,348.89
负债总计	-	-	-	2,252,871.36	2,252,871.36
利率敏感度缺口	35,609,299.37	-	148,927.78	253,948,802.15	289,707,029.30

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	242,495,577.43	85.77	255,689,468.90	88.26
合计	242,495,577.43	85.77	255,689,468.90	88.26

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是根据组合在过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
+5%		27,576,624.36	29,147,486.50
-5%		-27,576,624.36	-29,147,486.50

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 240,905,711.48 元，属于第二层次的余额为人民币 2,927,465.95 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：第一层次的余额为人民币 252,966,482.76 元，第二层次的余额为人民币 2,871,913.92 元，无属于第三层次的余额）。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（2020 年上半年度：无）。

##### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	242,495,577.43	85.03
	其中：股票	242,495,577.43	85.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,337,600.00	0.47
	其中：债券	1,337,600.00	0.47
	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	40,988,287.14	14.37
8	其他各项资产	356,304.91	0.12
9	合计	285,177,769.48	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	14,743.38	0.01
B	采矿业	3,561,075.00	1.26
C	制造业	161,680,949.16	57.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,497,052.39	1.24
E	建筑业	2,723,703.76	0.96
F	批发和零售业	104,931.08	0.04
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	10,941,166.44	3.87
J	金融业	41,847,862.80	14.80
K	房地产业	2,320,522.90	0.82
L	租赁和商务服务业	4,801,600.00	1.70
M	科学研究和技术服务业	3,223,870.65	1.14
N	水利、环境和公共设施管理业	120,639.37	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,641,460.50	2.00
R	文化、体育和娱乐业	2,016,000.00	0.71
S	综合	-	-
	合计	242,495,577.43	85.77

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	205,898	9,471,308.00	3.35
2	300750	宁德时代	16,000	8,556,800.00	3.03
3	000001	平安银行	317,840	7,189,540.80	2.54
4	000858	五粮液	24,000	7,149,360.00	2.53
5	688396	华润微	76,000	6,917,520.00	2.45
6	002460	赣锋锂业	56,100	6,793,149.00	2.40
7	600036	招商银行	120,000	6,502,800.00	2.30
8	300122	智飞生物	34,300	6,404,839.00	2.27
9	000661	长春高新	15,900	6,153,300.00	2.18
10	603345	安井食品	23,700	6,020,274.00	2.13
11	000651	格力电器	115,000	5,991,500.00	2.12
12	601009	南京银行	550,000	5,786,000.00	2.05
13	300760	迈瑞医疗	12,000	5,760,600.00	2.04
14	300347	泰格医药	29,185	5,641,460.50	2.00
15	002508	老板电器	115,500	5,370,750.00	1.90
16	601012	隆基股份	60,340	5,360,605.60	1.90
17	603187	海容冷链	121,100	5,192,768.00	1.84
18	300124	汇川技术	68,700	5,101,662.00	1.80
19	601888	中国中免	16,000	4,801,600.00	1.70
20	300496	中科创达	29,400	4,617,564.00	1.63
21	603678	火炬电子	66,800	4,509,000.00	1.59
22	002791	坚朗五金	22,100	4,288,505.00	1.52
23	002138	顺络电子	110,000	4,264,700.00	1.51
24	300973	立高食品	26,537	4,110,886.33	1.45
25	601166	兴业银行	200,000	4,110,000.00	1.45

26	603986	兆易创新	21,000	3,945,900.00	1.40
27	002078	太阳纸业	290,900	3,883,515.00	1.37
28	601658	邮储银行	762,800	3,829,256.00	1.35
29	600176	中国巨石	240,030	3,722,865.30	1.32
30	600660	福耀玻璃	65,000	3,630,250.00	1.28
31	601899	紫金矿业	367,500	3,561,075.00	1.26
32	601318	中国平安	55,000	3,535,400.00	1.25
33	600900	长江电力	168,800	3,484,032.00	1.23
34	002311	海大集团	42,000	3,427,200.00	1.21
35	603517	绝味食品	40,420	3,407,001.80	1.21
36	601939	建设银行	500,000	3,325,000.00	1.18
37	603596	伯特利	91,000	3,253,250.00	1.15
38	688111	金山办公	8,137	3,212,487.60	1.14
39	601799	星宇股份	14,071	3,176,106.12	1.12
40	603259	药明康德	19,800	3,100,482.00	1.10
41	600519	贵州茅台	1,500	3,085,050.00	1.09
42	603833	欧派家居	21,100	2,995,356.00	1.06
43	600926	杭州银行	200,000	2,950,000.00	1.04
44	002709	天赐材料	26,800	2,856,344.00	1.01
45	601668	中国建筑	579,900	2,696,535.00	0.95
46	300529	健帆生物	30,300	2,616,708.00	0.93
47	600845	宝信软件	49,960	2,542,964.00	0.90
48	003012	东鹏控股	149,900	2,494,336.00	0.88
49	601336	新华保险	52,600	2,414,866.00	0.85
50	000333	美的集团	33,500	2,390,895.00	0.85
51	600048	保利地产	192,700	2,320,108.00	0.82
52	600016	民生银行	500,000	2,205,000.00	0.78
53	002677	浙江美大	118,000	2,157,040.00	0.76
54	300144	宋城演艺	120,000	2,016,000.00	0.71
55	601233	桐昆股份	78,200	1,883,838.00	0.67
56	002271	东方雨虹	23,350	1,291,722.00	0.46
57	605499	东鹏饮料	5,000	1,254,000.00	0.44
58	600019	宝钢股份	150,000	1,146,000.00	0.41
59	688699	明微电子	1,869	533,263.08	0.19
60	688063	派能科技	1,804	355,027.20	0.13
61	688383	新益昌	2,701	347,078.50	0.12
62	688621	阳光诺和	1,485	123,388.65	0.04
63	300958	建工修复	2,993	86,747.74	0.03
64	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.03

65	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
66	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
67	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
68	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
69	300957	贝泰妮	194	48,971.42	0.02
70	300919	中伟股份	278	45,314.00	0.02
71	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
72	300894	火星号	628	42,704.00	0.02
73	688395	正弦电气	1,627	41,846.44	0.01
74	300979	华利集团	338	35,601.54	0.01
75	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
76	301015	百洋医药	462	25,322.22	0.01
77	300953	震裕科技	240	23,973.60	0.01
78	301009	可靠股份	741	23,134.02	0.01
79	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
80	300981	中红医疗	198	21,043.44	0.01
81	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
82	300968	格林精密	1,133	16,972.34	0.01
83	301013	利和兴	471	16,640.43	0.01
84	300614	百川畅银	329	16,321.69	0.01
85	300982	苏文电能	317	16,154.32	0.01
86	300932	三友联众	492	15,596.40	0.01
87	301002	崧盛股份	201	15,340.32	0.01
88	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
89	300940	南极光	307	13,308.45	0.00
90	300937	药易购	244	13,093.04	0.00
91	300962	中金辐照	576	12,741.12	0.00
92	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
93	300996	普联软件	241	12,194.60	0.00
94	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
95	301016	雷尔伟	275	11,294.25	0.00
96	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
97	300955	嘉亨家化	232	10,683.60	0.00
98	300987	川网传媒	301	10,462.76	0.00
99	300978	东箭科技	593	9,944.61	0.00
100	300986	志特新材	264	9,828.72	0.00
101	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
102	300993	玉马遮阳	410	9,524.30	0.00
103	300952	恒辉安防	340	9,203.80	0.00

104	301004	嘉益股份	312	9,026.16	0.00
105	300945	曼卡龙	474	8,944.38	0.00
106	300948	冠中生态	324	8,874.36	0.00
107	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
108	300991	创益通	254	8,671.56	0.00
109	300950	德固特	219	8,567.28	0.00
110	300975	商络电子	492	8,398.44	0.00
111	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
112	300926	博俊科技	359	7,955.44	0.00
113	300930	屹通新材	322	7,879.34	0.00
114	300963	中洲特材	283	7,847.59	0.00
115	300967	晓鸣股份	507	7,777.38	0.00
116	300985	致远新能	283	7,723.07	0.00
117	301011	华立科技	175	7,703.50	0.00
118	300972	万辰生物	430	6,966.00	0.00
119	300927	江天化学	217	6,527.36	0.00
120	300943	春晖智控	255	5,865.00	0.00
121	300995	奇德新材	191	5,502.71	0.00
122	301012	扬电科技	170	5,460.40	0.00
123	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
124	300992	泰福泵业	200	5,378.00	0.00
125	301010	晶雪节能	218	4,928.98	0.00
126	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
127	300917	特发服务	15	414.90	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	603187	海容冷链	7,446,391.00	2.57
2	000661	长春高新	7,196,924.00	2.48
3	003012	东鹏控股	7,071,700.00	2.44
4	601233	桐昆股份	6,169,198.16	2.13
5	600176	中国巨石	5,937,346.00	2.05
6	002078	太阳纸业	5,929,258.00	2.05
7	000651	格力电器	5,798,886.00	2.00



8	600115	中国东航	5,669,693.00	1.96
9	603345	安井食品	5,574,599.76	1.92
10	601009	南京银行	5,305,536.00	1.83
11	688396	华润微	5,104,395.13	1.76
12	600660	福耀玻璃	4,933,315.00	1.70
13	002847	盐津铺子	4,613,921.00	1.59
14	300308	中际旭创	4,593,077.00	1.59
15	300450	先导智能	4,426,448.00	1.53
16	002601	龙佰集团	4,352,233.00	1.50
17	601939	建设银行	4,278,500.00	1.48
18	002311	海大集团	4,197,928.00	1.45
19	601658	邮储银行	4,188,259.00	1.45
20	603678	火炬电子	4,177,695.00	1.44

#### 7.4.2 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	300750	宁德时代	12,331,953.00	4.26
2	000568	泸州老窖	8,900,708.84	3.07
3	300122	智飞生物	8,209,002.75	2.83
4	300308	中际旭创	7,048,156.00	2.43
5	300347	泰格医药	5,984,930.00	2.07
6	000333	美的集团	5,849,664.55	2.02
7	600115	中国东航	5,810,402.00	2.01
8	600570	恒生电子	5,809,435.62	2.01
9	603833	欧派家居	5,534,518.89	1.91
10	600426	华鲁恒升	5,334,037.73	1.84
11	600031	三一重工	5,197,663.00	1.79
12	002475	立讯精密	4,995,668.00	1.72
13	000858	五粮液	4,974,802.00	1.72
14	603345	安井食品	4,880,572.00	1.68
15	002129	中环股份	4,847,398.00	1.67
16	601166	兴业银行	4,829,476.00	1.67
17	002847	盐津铺子	4,675,455.00	1.61
18	600887	伊利股份	4,453,431.00	1.54

19	601186	中国铁建	4,371,800.00	1.51
20	300059	东方财富	4,091,463.22	1.41

### 7.4.3 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	266,766,872.44
卖出股票收入（成交）总额	288,586,578.77

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 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。

### 7.5 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）	1,337,600.00	0.47
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,337,600.00	0.47

### 7.6 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	113050	南银转债	10,990	1,099,000.00	0.39
2	113626	伯特转债	2,010	201,000.00	0.07
3	123117	健帆转债	376	37,600.00	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 只债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 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。

**7.9 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。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 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。

**7.10.2 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。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 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。

**7.11.2 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。

**7.11.3 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。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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

**7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定的备选股票库之内的股票。

**7.12.3 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	55,244.42
2	应收证券清算款	296,959.80
3	应收股利	-
4	应收利息	3,821.09
5	应收申购款	279.60
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	356,304.91

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券（可交换债券）。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,241	16,390.32	34,323,100.00	33.55%	67,968,890.31	66.45%

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。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	北京诚盛投资管理有限公司 — 诚盛锐智私募证券投资基金	11,590,000.00	11.52%
2	北京诚盛投资管理有限公司 — 诚盛卓悦私募证券投资基金	9,044,258.00	8.99%
3	北京诚盛投资管理有限公司 — 诚盛嘉选私募证券投资基金	8,142,000.00	8.09%
4	国元证券股份有限公司	4,003,286.00	3.98%
5	何继军	2,250,000.00	2.24%
6	俞河会	1,651,355.00	1.64%
7	中国对外经济贸易信托有限 公司—外贸信托—诚盛精选 金融投资私募证券投资基金	1,477,525.00	1.47%
8	周嘉宁	1,260,000.00	1.25%
9	张启	1,000,000.00	0.99%
10	黄良珍	712,600.00	0.71%

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。

### 8.3 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	143,169.39	0.1400%

### 8.4 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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014年4月4日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	107,403,943.99
本报告期基金总申购份额	372,287.92
减：本报告期基金总赎回份额	5,484,241.60
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	102,291,990.31

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

#### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

我公司第七届董事会任期已满，根据《公司法》和《公司章程》的有关规定，2021年6月6日，我公司召开了2021年第一次临时股东大会会议。会议选举俞仕新、高民和、毕功兵、杜愚为新任董事，蔡咏、陈翔、李伟强、朱慈蕴不再担任董事。公司已按规定向相关监管机构报备。

根据公司第八届董事会第二次会议决议，聘任周兵同志担任公司总经理，林培富同志不再担任公司总经理。公司已按规定向相关监管机构报备。

原董事会秘书孙杰同志退休，根据公司第八届董事会第二次会议决议，聘任刁俊东同志担任财务负责人兼董事会秘书。

#### 10.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	



			例			
浙商证券	1	261,457,061.04	47.70%	243,493.70	47.69%	-
中信建投	1	124,076,881.15	22.63%	115,552.83	22.63%	-
平安证券	1	119,296,312.53	21.76%	111,101.29	21.76%	-
华安证券	1	28,193,900.08	5.14%	26,257.11	5.14%	-
银河证券	1	15,159,171.28	2.77%	14,117.84	2.77%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-

### 10.7.2 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
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	156,760.86	100.00%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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) 资历雄厚，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：无。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于增加华西证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投和转换业务的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 29 日
2	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 18 日
3	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 10 日
4	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 3 日
5	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 3 日
6	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 3 日
7	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 3 日
8	关于旗下由中国工商银行股份有限公司托管的 7 只公募基金引入侧袋机制并修改基金合同等法律文件的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 3 日
9	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 5 月 13 日
10	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 5 月 13 日
11	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 1 季度报告提示性公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 22 日
12	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2021 年第 1 季度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 22 日
13	长盛基金管理有限公司关于旗下	证券时报、本公司网	2021 年 4 月 6 日

	基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	站、中国证监会基金信息披露网站	
14	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 31 日
15	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2020 年年度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 31 日
16	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 18 日
17	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2020 年第 4 季度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 1 月 22 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）相关批准文件；
- 2、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（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。

### 12.2 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。

### 12.3 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/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日