

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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：招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。

基金托管人招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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
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.....	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
§5 托管人报告	15
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
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
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	58
§8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66

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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)
基金简称	长盛沪深 300 指数(LOF)
场内简称	长盛沪深 300LOF
基金主代码	160807
交易代码	160807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 8 月 4 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	201,844,495.31 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	2010 年 9 月 6 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资，跟踪沪深 300 指数，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%，以实现对标指数的有效跟踪。
投资策略	本基金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均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是股票指数型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	张燕
	联系电话	010-86497608	0755-83199084

	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-86497888	95555
传真		010-86497999	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100029	518040
法定代表人		周兵	缪建民

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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
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	38,405,764.26
本期利润	14,320,296.63
加权平均基金份额本期利润	0.0728
本期加权平均净值利润率	4.29%
本期基金份额净值增长率	3.90%
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	147,490,523.75
期末可供分配基金份额利润	0.7307
期末基金资产净值	349,335,019.06
期末基金份额净值	1.731
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	121.79%

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。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30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	-0.23%	0.77%	-1.91%	0.76%	1.68%	0.01%
过去三个月	6.52%	0.91%	3.34%	0.93%	3.18%	-0.02%
过去六个月	3.90%	1.24%	0.32%	1.25%	3.58%	-0.01%
过去一年	39.20%	1.24%	24.26%	1.27%	14.94%	-0.03%
过去三年	82.21%	1.26%	46.67%	1.30%	35.54%	-0.04%
自基金合同生效起至今	121.79%	1.38%	81.39%	1.37%	40.40%	0.01%

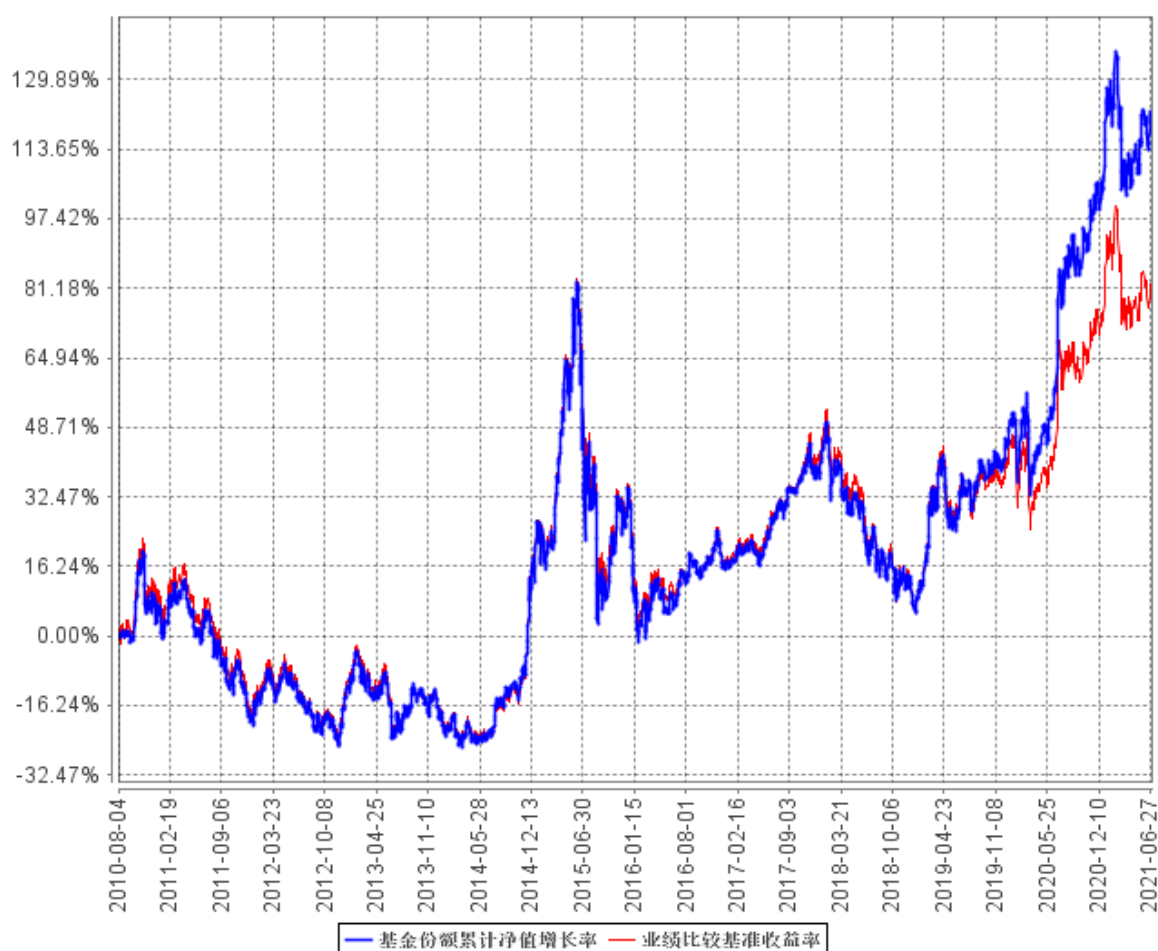
注：本基金业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。

沪深 300 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，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

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 自基金合同生效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：按照本基金合同规定，本基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。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。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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		
陈亘斯	本基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛上证	2019 年 10 月 9 日	-	12 年	陈亘斯先生，硕士。曾任 PineRiver 资产管理公司量化分析师，国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理，北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理。

	50 指数 证券投资基金 (LOF) 基 金经理， 长盛中证 100 指数 证券投资 基金基金 经理，长 盛中证申 万一带一 路主题指 数证券投资 基金 (LOF) 基 金经理， 长盛中证 全指证券 公司指数 证券投资 基金 (LOF) 基 金经理， 长盛同鑫 行业配置 混合型证 券投资基 金基金经 理。				
--	---	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 A 股市场经历了大幅波动后，整体呈现区间震荡，但依然包含显著的结构性行情。一季度到二季度，社会融资及 M2 前高后低，在国内外经济显著复苏以及疫苗的快速推广的背景下，央行提出“不急转弯”，但对流动性管理态度趋向中性，持续全面宽松的预期被扭转。春节前由于大市值的龙头公司的估值提升，核心资产的市值加权后的整体风险溢价率处于历史低位水平，叠加美国长期利率水平跳升和美元汇率暂时走强，使得海外的具有套利性质的资金出现从

陆股通撤出的迹象，进而缺失了对核心资产交易的足够的流动性支持。核心资产整体发生快速大幅的回撤。但同时我们看到以红利股为代表的低估值价值股重新受到关注，同时中小市值的高质量成长股开始活跃。估值和市值两个层面的风格开始发生转换。二季度在美联储的预期管理下，美债利率水平总体走弱，刺激海外资金通过陆股通回流。而国内利率曲线整体下行且平缓化，为股票市场的稳定提供了流动性呵护。核心资产的整体风险溢价率经过一季度的调整后处于长期均衡位置附近，受到机构配置需求驱动和利润增速释放，有一定反弹，但相对于业绩增速仍处于历史较高位置。而各板块中表现最为突出的是高利润增速的科技成长板块，包括创新药、新能源和半导体等。同时我们看到以红利股为代表的低估值价值股在碳中和的政策指引下其供给侧效应带来的业绩提升重新受到关注，估值水平得到一定的修复。

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。

4.4.2 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 1.731 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.90%，业绩比较基准收益率为 0.32%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0297%，年度化跟踪误差为 1.2794%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年下半年，随着美国以及国内的实体经济持续恢复，PPI 大概率继续修复向上或维持高位，交易疫情后的经济复苏成为重要的主题。随着美联储逐步引导落实 Taper，可能通过息差水平的传导制约人民币的利率曲线的下行空间。A 股的估值水平可能会受到流动性边际变紧的压制，业绩增长率及其持续性将扮演更重要的角色。此外随着美国国内生产逐步恢复，我国对外出口对经济的拉动存在弱化的趋势，而美国的服务业的复苏以及财政开支对于大宗资源品的价格又形成潜在支撑。投资人需要关注过高估值水平的成长股与其成长性的不匹配带来下行风险，同时需要关注低估值的价值股尤其是上游行业的公司在海外的资本开支扩张的背景下存在获得较长时间的景气向上的可能性，从而显现出超预期的成长性而带来机会。个股选择方面，企业成长性因子、估值与预期成长率的匹配度、财务质量、市场占有率等在行业内选股始终表现出较稳定的超额收益，是我们持之以恒的重要判断标准。

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 147,490,523.75 元，其中，未分配利润已实现部分为 198,537,974.57 元，未分配利润未实现部分为-51,047,450.82 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	20,478,807.70	21,384,229.50
结算备付金		38,895.71	-
存出保证金		46,527.18	42,665.10
交易性金融资产	6.4.7.2	329,466,696.88	348,126,629.99
其中：股票投资		329,185,428.09	347,863,629.99
基金投资		-	-
债券投资		281,268.79	263,000.00
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		555,751.94	247,695.92
应收利息	6.4.7.5	1,961.55	2,326.34
应收股利		-	-
应收申购款		545,085.97	2,382,824.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		351,133,726.93	372,186,371.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
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		1,317,133.73	4,186,594.19
应付管理人报酬		203,928.09	227,666.86
应付托管费		40,785.62	45,533.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	109,017.87	64,928.76
应交税费		-	1.21

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	127,842.56	195,149.78
负债合计		1,798,707.87	4,719,874.15
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	201,844,495.31	220,620,424.75
未分配利润	6.4.7.10	147,490,523.75	146,846,072.53
所有者权益合计		349,335,019.06	367,466,497.28
负债和所有者权益总计		351,133,726.93	372,186,371.43

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.731 元，基金份额总额 201,844,495.31 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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
一、收入		16,374,153.96	19,550,078.48
1.利息收入		38,619.64	45,512.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	38,545.93	45,510.21
债券利息收入		73.71	2.73
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）		40,212,438.31	16,203,588.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	37,688,399.41	13,761,918.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	66,325.72	-
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	2,457,713.18	2,441,670.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-24,085,467.63	3,144,053.81
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	208,563.64	156,922.83
减：二、费用		2,053,857.33	1,486,520.91

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,251,685.46	821,105.08
2. 托管费	6.4.10.2.2	250,337.08	164,221.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	427,295.22	377,972.65
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.13	-
7. 其他费用	6.4.7.20	124,539.44	123,222.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,320,296.63	18,063,557.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,320,296.63	18,063,557.57

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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）	220,620,424.75	146,846,072.53	367,466,497.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,320,296.63	14,320,296.63
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）	-18,775,929.44	-13,675,845.41	-32,451,774.85
其中：1.基金申购款	91,281,298.15	65,433,448.54	156,714,746.69
2.基金赎回款	-110,057,227.59	-79,109,293.95	-189,166,521.54
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）	201,844,495.31	147,490,523.75	349,335,019.06

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）	155,672,961.69	64,336,088.86	220,009,050.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,063,557.57	18,063,557.57
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）	45,227,869.64	16,129,090.86	61,356,960.50
其中：1.基金申购款	120,130,970.19	39,730,385.03	159,861,355.22
2.基金赎回款	-74,903,100.55	-23,601,294.17	-98,504,394.72
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）	-	-27,126,280.73	-27,126,280.73
五、期末所有者权益（基金净值）	200,900,831.33	71,402,456.56	272,303,287.89

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：

<u>周兵</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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2010]第 646 号《关于核准长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 898,648,405.80 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 193 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2010 年 8 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 898,915,869.33 份,其中认购资金利息折合 267,463.53 份基金份额。本基

金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第 276 号文审核同意，本基金 112,932,582 份基金份额于 2010 年 9 月 6 日在深交所挂牌交易。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交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《长盛沪深 300 指数证券投资基金(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、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票资产投资比例不低于基金资产净值的 90%，其中，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5%的现金以及到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+ 5\% \times$ 一年期银行定期存款利率(税后)。本基金标的指数使用费由基金管理人长盛基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

6.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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》、《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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。

(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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	20,478,807.70
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：	20,478,807.70

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	272,097,839.04	329,185,428.09	57,087,589.05
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	281,268.79	15,068.79
	银行间市场	-	-
	合计	281,268.79	15,068.79
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	272,364,039.04	329,466,696.88	57,102,657.84

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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	1,891.40
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	17.50
应收债券利息	31.75
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	20.90
合计	1,961.55

6.4.7.6 其他资产

注：无余额。

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	109,017.87
银行间市场应付交易费用	-

合计	109,017.87
----	------------

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	-
应付赎回费	3,915.53
应付证券出借违约金	-
其他	4,914.10
预提费用	119,012.93
合计	127,842.56

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	220,620,424.75	220,620,424.75
本期申购	91,281,298.15	91,281,298.15
本期赎回(以“-”号填列)	-110,057,227.59	-110,057,227.59
- 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	201,844,495.31	201,844,495.31

注：1. 申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

2. 截至 2021 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 2,710,004.00 份(2020 年 12 月 31 日：1,971,903.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 199,134,491.31 份(2020 年 12 月 31 日：218,648,521.75 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。

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	173,523,499.92	-26,677,427.39	146,846,072.53
本期利润	38,405,764.26	-24,085,467.63	14,320,296.63
本期基金份额交易产生的变动数	-13,391,289.61	-284,555.80	-13,675,845.41
其中：基金申购款	80,268,598.91	-14,835,150.37	65,433,448.54
基金赎回款	-93,659,888.52	14,550,594.57	-79,109,293.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	198,537,974.57	-51,047,450.82	147,490,523.75

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	37,355.77
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	841.94
其他	348.22
合计	38,545.93

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	146,614,047.47
减：卖出股票成本总额	108,925,648.06
买卖股票差价收入	37,688,399.41

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	66,325.72

券到期兑付) 差价收入	
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	66,325.72

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	493,888.59
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	427,500.00
减：应收利息总额	62.87
买卖债券差价收入	66,325.72

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	2,457,713.18
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	2,457,713.18

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	-24,085,467.63
——股票投资	-24,100,536.42

——债券投资	15,068.79
——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	-24,085,467.63

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	208,356.17
基金转换费收入	207.47
合计	208,563.64

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，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，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

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	427,295.22
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	427,295.22

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	-
上市费	29,752.78
银行汇划费	5,526.51
合计	124,539.44

6.4.7.21 分部报告

无。

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

无。

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（“长盛基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

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	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

	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	153,463,564.09	60.55%	155,292,885.36	64.84%

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
国元证券	255,261.20	51.68%	0.00	0.00%

6.4.10.1.3 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	142,920.92	60.55%	71,407.36	65.50%
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	144,621.94	64.84%	65,596.38	62.86%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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等。

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	1,251,685.46	821,105.08
其中：支付销售机构的客户维护费	191,782.79	110,325.27

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 0.75%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×0.75%÷当年天数。

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	250,337.08	164,221.04

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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×0.15%/当年天数。

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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2010年	-	-

8 月 4 日)持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	7,685,626.44
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	7,685,626.44
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	3.8256%

注: 1. 期间申购/买入总份额含转换入份额, 期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 上述申购本基金的交易委托长盛直销中心办理, 交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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

注: 无。

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	20,478,807.70	37,355.77	21,038,872.17	44,338.83

注: 本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管, 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	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
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	-
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	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
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	-
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	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
688686	奥普特	2020年12月24日	2021年7月1日	限售期锁定	78.49	447.41	1,515	118,912.35	677,826.15	-
688076	诺泰生物	2021年5月12日	2021年11月22日	限售期锁定	15.57	64.28	4,984	77,600.88	320,371.52	-
688425	铁建重工	2021年6月11日	2021年12月22日	限售期锁定	2.87	5.77	36,449	104,608.63	210,310.73	-
688575	亚辉龙	2021年5月10日	2021年11月17日	限售期锁定	14.80	41.66	3,435	50,838.00	143,102.10	-
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	354	8,708.40	57,702.00	-
688113	联测科技	2021年4月26日	2021年11月8日	限售期锁定	19.14	60.90	1,415	27,083.10	86,173.50	-
688468	科美诊断	2021年3月31日	2021年10月11日	限售期锁定	7.15	19.50	3,919	28,020.85	76,420.50	-
688191	智洋创新	2021年3月30日	2021年10月8日	限售期锁定	11.38	20.10	3,203	36,450.14	64,380.30	-
688655	迅捷兴	2021年4月28日	2021年11月11日	限售期锁定	7.59	19.30	3,083	23,399.97	59,501.90	-
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	217	10,270.61	54,777.31	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	限售期锁定	33.22	105.33	379	12,590.38	39,920.07	-
300973	立高	2021年4月	2021年10月	限售期	28.28	145.09	264	7,465.92	38,303.76	-

	食品	月 8 日	月 15 日	锁定							
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	-	
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	801	10,044.54	25,007.22	-	
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	-	
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	1,162	7,982.94	17,406.76	-	
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	-	
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 13 日	限售期锁定	11.72	27.07	340	3,984.80	9,203.80	-	

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	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	限售期锁定	24.90	27.29	295	7,345.50	8,050.55	-
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	-
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	-
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	-
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	2021年5月	2021年11月	限售期	9.36	26.89	200	1,872.00	5,378.00	-

	泵业	月 17 日	月 25 日	锁定						
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	-
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	-

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	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	2,010	201,000.00	201,000.00	-
127038	国微转债	2021 年 6 月 10 日	2021 年 7 月 14 日	配债未上市	100.00	100.00	171	17,100.00	17,100.00	-
113049	长汽转债	2021 年 6 月 11 日	2021 年 7 月 8 日	配债未上市	100.00	100.00	110	11,000.00	11,000.00	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

002024	苏宁易购	2021 年 6 月 16 日	重大事项 停牌	5.59	-	-	61,764	598,990.13	345,260.76	-
--------	------	-----------------------	------------	------	---	---	--------	------------	------------	---

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

本基金为抽样复制的指数型基金，采用抽样复制指数的投资策略，跟踪沪深 300 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。

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招商银行，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 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占基金资产净值的比例为 0.08%(2020 年 12 月 31 日：0.07%)。

6.4.13.3 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 2021 年 6 月 30 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。

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》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上市公司发行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上述比例限制)。

本基金所持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，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 6.4.12。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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限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 2021 年 6 月 30 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。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,478,807.70	-	-	-	20,478,807.70
结算备付金	38,895.71	-	-	-	38,895.71
存出保证金	46,527.18	-	-	-	46,527.18
交易性金融资产	-	-	281,268.79	329,185,428.09	329,466,696.88
应收证券清算款	-	-	-	555,751.94	555,751.94
应收利息	-	-	-	1,961.55	1,961.55
应收申购款	-	-	-	545,085.97	545,085.97
资产总计	20,564,230.59	-	281,268.79	330,288,227.55	351,133,726.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,317,133.73	1,317,133.73
应付管理人报酬	-	-	-	203,928.09	203,928.09
应付托管费	-	-	-	40,785.62	40,785.62
应付交易费用	-	-	-	109,017.87	109,017.87
其他负债	-	-	-	127,842.56	127,842.56
负债总计	-	-	-	1,798,707.87	1,798,707.87
利率敏感度缺口	20,564,230.59	-	281,268.79	328,489,519.68	349,335,019.06
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	21,384,229.50	-	-	-	21,384,229.50
存出保证金	42,665.10	-	-	-	42,665.10
交易性金融资产	-	-	263,000.00	347,863,629.99	348,126,629.99
应收证券清算款	-	-	-	247,695.92	247,695.92
应收利息	-	-	-	2,326.34	2,326.34
应收申购款	-	-	-	2,382,824.58	2,382,824.58
资产总计	21,426,894.60	-	263,000.00	350,496,476.83	372,186,371.43
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,186,594.19	4,186,594.19

应付管理人报酬	-	-	227,666.86	227,666.86
应付托管费	-	-	45,533.35	45,533.35
应付交易费用	-	-	64,928.76	64,928.76
应交税费	-	-	1.21	1.21
其他负债	-	-	195,149.78	195,149.78
负债总计	-	-	4,719,874.15	4,719,874.15
利率敏感度缺口	21,426,894.60	-	263,000.00	345,776,602.68

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.08%（2020 年 12 月 31 日：0.07%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

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。

本基金采用抽样复制指数的投资策略，股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例占基金资产净值的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%。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。

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	329,185,428.09	94.23	347,863,629.99	94.67
合计	329,185,428.09	94.23	347,863,629.99	94.67

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	17,079,088.64	17,922,753.98
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-17,079,088.64	-17,922,753.98	

6.4.14 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 2021 年 6 月 30 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 326,184,829.87 元，属于第二层次的余额为 3,281,867.01 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为 343,302,325.07 元，属于第二层次的余额为 4,824,304.92 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层级间的重大变动

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

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 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。

§ 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	329,185,428.09	93.75
	其中：股票	329,185,428.09	93.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	281,268.79	0.08
	其中：债券	281,268.79	0.08
	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	20,517,703.41	5.84
8	其他各项资产	1,149,326.64	0.33
9	合计	351,133,726.93	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,384,202.69	0.97
B	采矿业	7,188,394.69	2.06
C	制造业	180,853,587.52	51.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,474,558.05	1.57
E	建筑业	4,315,457.39	1.24
F	批发和零售业	2,530,495.62	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	10,001,659.50	2.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,465,520.39	3.28
J	金融业	67,962,607.17	19.45
K	房地产业	6,967,631.80	1.99
L	租赁和商务服务业	5,766,130.60	1.65
M	科学研究和技术服务业	4,738,665.65	1.36
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	729,061.00	0.21
Q	卫生和社会工作	6,961,626.86	1.99
R	文化、体育和娱乐业	1,497,025.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	319,836,623.93	91.56

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	14,743.38	0.00
B	采矿业	649,236.84	0.19
C	制造业	6,773,068.76	1.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	270,298.17	0.08
E	建筑业	203,358.16	0.06
F	批发和零售业	104,931.08	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	374,608.55	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	124,298.06	0.04
J	金融业	347,848.40	0.10
K	房地产业	215,809.60	0.06
L	租赁和商务服务业	76,920.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	42,057.63	0.01
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	151,625.53	0.04
S	综合	-	-
	合计	9,348,804.16	2.68

7.2.3 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。

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

7.3.1 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	600519	贵州茅台	9,189	18,899,016.30	5.41
2	601318	中国平安	155,790	10,014,181.20	2.87
3	000858	五粮液	30,106	8,968,276.34	2.57
4	601012	隆基股份	61,270	5,443,226.80	1.56
5	000333	美的集团	75,188	5,366,167.56	1.54
6	601166	兴业银行	215,330	4,425,031.50	1.27
7	600276	恒瑞医药	64,486	4,383,113.42	1.25
8	603259	药明康德	27,535	4,311,705.65	1.23
9	601888	中国中免	13,928	4,179,792.80	1.20
10	300059	东方财富	121,635	3,988,411.65	1.14
11	002415	海康威视	61,496	3,966,492.00	1.14
12	000651	格力电器	71,317	3,715,615.70	1.06
13	000001	平安银行	146,679	3,317,878.98	0.95
14	002594	比亚迪	12,903	3,238,653.00	0.93
15	600887	伊利股份	87,210	3,211,944.30	0.92
16	002475	立讯精密	69,164	3,181,544.00	0.91
17	600900	长江电力	148,992	3,075,194.88	0.88
18	600030	中信证券	121,017	3,018,163.98	0.86
19	000725	京东方 A	475,188	2,965,173.12	0.85
20	300015	爱尔眼科	37,629	2,670,906.42	0.76
21	601398	工商银行	496,687	2,567,871.79	0.74
22	000568	泸州老窖	10,657	2,514,412.58	0.72
23	600309	万华化学	22,926	2,494,807.32	0.71
24	603501	韦尔股份	7,700	2,479,400.00	0.71
25	601919	中远海控	80,700	2,464,578.00	0.71
26	000002	万科 A	103,147	2,455,930.07	0.70
27	600031	三一重工	84,259	2,449,409.13	0.70
28	603288	海天味业	18,264	2,355,142.80	0.67
29	002714	牧原股份	38,161	2,320,952.02	0.66
30	600809	山西汾酒	5,000	2,240,000.00	0.64
31	600436	片仔癀	4,900	2,196,670.00	0.63
32	002352	顺丰控股	30,300	2,051,310.00	0.59
33	600438	通威股份	45,800	1,981,766.00	0.57

34	601328	交通银行	404,281	1,980,976.90	0.57
35	300122	智飞生物	10,600	1,979,338.00	0.57
36	601899	紫金矿业	200,401	1,941,885.69	0.56
37	300124	汇川技术	25,936	1,926,007.36	0.55
38	002142	宁波银行	48,938	1,907,113.86	0.55
39	002304	洋河股份	9,197	1,905,618.40	0.55
40	300014	亿纬锂能	18,100	1,881,133.00	0.54
41	002230	科大讯飞	26,959	1,821,889.22	0.52
42	300347	泰格医药	9,000	1,739,700.00	0.50
43	600000	浦发银行	173,029	1,730,290.00	0.50
44	000100	TCL 科技	223,335	1,708,512.75	0.49
45	601601	中国太保	57,666	1,670,584.02	0.48
46	000661	长春高新	4,300	1,664,100.00	0.48
47	002812	恩捷股份	7,100	1,662,110.00	0.48
48	600585	海螺水泥	40,190	1,649,799.50	0.47
49	601816	京沪高铁	310,200	1,640,958.00	0.47
50	002241	歌尔股份	37,804	1,615,742.96	0.46
51	600690	海尔智家	62,315	1,614,581.65	0.46
52	601668	中国建筑	343,403	1,596,823.95	0.46
53	002460	赣锋锂业	13,150	1,592,333.50	0.46
54	002027	分众传媒	168,580	1,586,337.80	0.45
55	300142	沃森生物	25,400	1,567,180.00	0.45
56	600016	民生银行	352,939	1,556,460.99	0.45
57	600837	海通证券	131,794	1,515,631.00	0.43
58	002271	东方雨虹	27,100	1,499,172.00	0.43
59	603986	兆易创新	7,908	1,485,913.20	0.43
60	300274	阳光电源	12,900	1,484,274.00	0.42
61	600763	通策医疗	3,600	1,479,600.00	0.42
62	000063	中兴通讯	44,389	1,475,046.47	0.42
63	603799	华友钴业	12,762	1,457,420.40	0.42
64	601288	农业银行	478,265	1,449,142.95	0.41
65	600196	复星医药	19,890	1,434,665.70	0.41
66	600048	保利地产	118,634	1,428,353.36	0.41
67	600919	江苏银行	198,970	1,412,687.00	0.40
68	600050	中国联通	322,648	1,393,839.36	0.40
69	000338	潍柴动力	77,092	1,377,634.04	0.39
70	601688	华泰证券	86,562	1,367,679.60	0.39
71	601229	上海银行	164,351	1,347,678.20	0.39
72	600660	福耀玻璃	23,741	1,325,934.85	0.38

73	600570	恒生电子	14,158	1,320,233.50	0.38
74	601211	国泰君安	74,900	1,283,786.00	0.37
75	600104	上汽集团	58,343	1,281,795.71	0.37
76	600703	三安光电	39,206	1,256,552.30	0.36
77	688111	金山办公	3,143	1,240,856.40	0.36
78	601766	中国中车	200,443	1,218,693.44	0.35
79	002129	中环股份	31,300	1,208,180.00	0.35
80	601169	北京银行	244,852	1,192,429.24	0.34
81	002049	紫光国微	7,600	1,171,844.00	0.34
82	600999	招商证券	59,746	1,136,368.92	0.33
83	600019	宝钢股份	147,688	1,128,336.32	0.32
84	002371	北方华创	4,000	1,109,520.00	0.32
85	002311	海大集团	13,300	1,085,280.00	0.31
86	601988	中国银行	349,060	1,075,104.80	0.31
87	600406	国电南瑞	46,186	1,073,362.64	0.31
88	601088	中国神华	54,878	1,071,218.56	0.31
89	300498	温氏股份	73,991	1,063,250.67	0.30
90	002410	广联达	15,500	1,057,100.00	0.30
91	000895	双汇发展	32,347	1,028,634.60	0.29
92	601658	邮储银行	201,600	1,012,032.00	0.29
93	000625	长安汽车	37,538	986,498.64	0.28
94	000538	云南白药	8,448	977,602.56	0.28
95	600893	航发动力	18,241	970,238.79	0.28
96	002821	凯莱英	2,600	968,760.00	0.28
97	601916	浙商银行	243,100	965,107.00	0.28
98	601818	光大银行	255,267	964,909.26	0.28
99	600028	中国石化	221,062	963,830.32	0.28
100	601628	中国人寿	27,999	948,886.11	0.27
101	601009	南京银行	89,804	944,738.08	0.27
102	601390	中国中铁	180,229	944,399.96	0.27
103	601377	兴业证券	96,230	929,581.80	0.27
104	600346	恒力石化	35,040	919,449.60	0.26
105	688036	传音控股	4,357	912,791.50	0.26
106	600588	用友网络	27,053	899,782.78	0.26
107	601633	长城汽车	20,280	884,005.20	0.25
108	002493	荣盛石化	49,100	847,957.00	0.24
109	600745	闻泰科技	8,700	843,030.00	0.24
110	300413	芒果超媒	12,100	830,060.00	0.24
111	601857	中国石油	155,165	820,822.85	0.23

112	300601	康泰生物	5,500	819,500.00	0.23
113	601225	陕西煤业	66,517	788,226.45	0.23
114	300433	蓝思科技	26,800	788,188.00	0.23
115	600926	杭州银行	52,520	774,670.00	0.22
116	300450	先导智能	12,800	769,792.00	0.22
117	600584	长电科技	20,300	764,904.00	0.22
118	300408	三环集团	17,900	759,318.00	0.22
119	600111	北方稀土	36,370	752,859.00	0.22
120	002841	视源股份	6,000	745,740.00	0.21
121	002601	龙佰集团	21,500	743,470.00	0.21
122	000776	广发证券	49,065	742,844.10	0.21
123	601939	建设银行	111,609	742,199.85	0.21
124	600958	东方证券	73,708	736,342.92	0.21
125	002607	中公教育	34,900	729,061.00	0.21
126	002001	新和成	25,240	723,883.20	0.21
127	002179	中航光电	9,100	719,082.00	0.21
128	600600	青岛啤酒	6,200	717,030.00	0.21
129	002050	三花智控	29,650	711,007.00	0.20
130	600741	华域汽车	26,529	696,916.83	0.20
131	000157	中联重科	75,308	695,845.92	0.20
132	600009	上海机场	14,452	695,574.76	0.20
133	000166	申万宏源	144,530	676,400.40	0.19
134	002007	华兰生物	18,265	669,960.20	0.19
135	000963	华东医药	14,479	666,178.79	0.19
136	300003	乐普医疗	20,700	664,884.00	0.19
137	300595	欧普康视	6,400	662,720.00	0.19
138	603806	福斯特	6,300	662,319.00	0.19
139	000786	北新建材	16,700	655,475.00	0.19
140	603882	金域医学	4,100	655,057.00	0.19
141	601336	新华保险	14,174	650,728.34	0.19
142	601006	大秦铁路	98,316	646,919.28	0.19
143	601138	工业富联	52,100	646,561.00	0.19
144	688012	中微公司	3,858	640,119.36	0.18
145	600015	华夏银行	101,936	630,983.84	0.18
146	300529	健帆生物	7,300	630,428.00	0.18
147	002236	大华股份	29,722	627,134.20	0.18
148	601155	新城控股	15,000	624,000.00	0.18
149	601989	中国重工	150,934	621,848.08	0.18
150	601901	方正证券	66,204	619,669.44	0.18

151	600760	中航沈飞	10,080	607,824.00	0.17
152	603993	洛阳钼业	117,305	605,293.80	0.17
153	600176	中国巨石	38,790	601,632.90	0.17
154	600132	重庆啤酒	3,000	593,850.00	0.17
155	600352	浙江龙盛	43,112	592,358.88	0.17
156	600010	宝钢股份	379,441	588,133.55	0.17
157	601877	正泰电器	17,600	587,488.00	0.17
158	000768	中航西飞	22,241	584,493.48	0.17
159	601788	光大证券	32,647	584,054.83	0.17
160	600547	山东黄金	30,220	580,828.40	0.17
161	601100	恒立液压	6,756	580,475.52	0.17
162	600426	华鲁恒升	18,700	578,765.00	0.17
163	601600	中国铝业	108,797	576,624.10	0.17
164	001979	招商蛇口	52,469	574,535.55	0.16
165	003816	中国广核	213,500	570,045.00	0.16
166	002008	大族激光	14,100	569,499.00	0.16
167	603369	今世缘	10,500	568,680.00	0.16
168	600150	中国船舶	34,400	567,944.00	0.16
169	601186	中国铁建	76,195	566,128.85	0.16
170	600989	宝丰能源	41,300	564,984.00	0.16
171	601238	广汽集团	42,940	556,073.00	0.16
172	002202	金风科技	45,682	555,493.12	0.16
173	002736	国信证券	51,109	549,421.75	0.16
174	000876	新希望	37,314	547,396.38	0.16
175	603899	晨光文具	6,400	541,184.00	0.15
176	601066	中信建投	17,200	540,596.00	0.15
177	000938	紫光股份	23,621	516,827.48	0.15
178	600109	国金证券	40,439	513,170.91	0.15
179	002555	三七互娱	20,902	502,066.04	0.14
180	002414	高德红外	17,940	494,785.20	0.14
181	603659	璞泰来	3,600	491,760.00	0.14
182	000069	华侨城 A	65,899	490,288.56	0.14
183	601669	中国电建	126,673	490,224.51	0.14
184	601077	渝农商行	122,300	487,977.00	0.14
185	688169	石头科技	385	485,485.00	0.14
186	002624	完美世界	20,200	482,982.00	0.14
187	000425	徐工机械	75,526	481,100.62	0.14
188	601727	上海电气	112,405	476,597.20	0.14
189	000783	长江证券	65,094	476,488.08	0.14

190	600143	金发科技	22,800	475,608.00	0.14
191	600795	国电电力	195,328	474,647.04	0.14
192	002600	领益智造	51,400	472,366.00	0.14
193	603019	中科曙光	17,020	469,922.20	0.13
194	688008	澜起科技	7,435	463,795.30	0.13
195	000977	浪潮信息	16,300	458,519.00	0.13
196	601838	成都银行	36,100	456,304.00	0.13
197	603517	绝味食品	5,400	455,166.00	0.13
198	002384	东山精密	21,800	454,312.00	0.13
199	600183	生益科技	19,200	449,472.00	0.13
200	601360	三六零	36,500	445,665.00	0.13
201	600029	南方航空	73,458	442,217.16	0.13
202	300144	宋城演艺	26,260	441,168.00	0.13
203	601108	财通证券	41,900	439,531.00	0.13
204	601985	中国核电	86,595	438,170.70	0.13
205	600886	国投电力	45,463	436,899.43	0.13
206	000596	古井贡酒	1,800	431,100.00	0.12
207	601555	东吴证券	51,554	429,960.36	0.12
208	600161	天坛生物	12,500	428,125.00	0.12
209	603160	汇顶科技	3,300	427,779.00	0.12
210	002938	鹏鼎控股	11,900	426,972.00	0.12
211	300676	华大基因	3,600	426,960.00	0.12
212	000066	中国长城	29,000	423,400.00	0.12
213	002602	世纪华通	65,901	423,084.42	0.12
214	600872	中炬高新	10,000	420,200.00	0.12
215	002044	美年健康	45,704	416,363.44	0.12
216	603833	欧派家居	2,920	414,523.20	0.12
217	601607	上海医药	19,347	408,802.11	0.12
218	600522	中天科技	40,800	408,000.00	0.12
219	601878	浙商证券	31,100	406,788.00	0.12
220	300136	信维通信	13,141	405,794.08	0.12
221	300033	同花顺	3,500	394,730.00	0.11
222	002916	深南电路	3,520	391,177.60	0.11
223	000703	恒逸石化	32,420	387,419.00	0.11
224	600362	江西铜业	17,307	387,330.66	0.11
225	600383	金地集团	37,640	385,433.60	0.11
226	601111	中国国航	49,496	385,078.88	0.11
227	600085	同仁堂	9,375	382,968.75	0.11
228	600115	中国东航	74,509	378,505.72	0.11

229	002508	老板电器	8,000	372,000.00	0.11
230	300628	亿联网络	4,400	368,720.00	0.11
231	601800	中国交建	56,433	365,685.84	0.10
232	600061	国投资本	43,016	365,205.84	0.10
233	601021	春秋航空	6,400	364,160.00	0.10
234	601799	星宇股份	1,600	361,152.00	0.10
235	000860	顺鑫农业	8,500	358,530.00	0.10
236	002252	上海莱士	47,800	358,022.00	0.10
237	688396	华润微	3,887	353,794.74	0.10
238	000708	中信特钢	16,900	352,196.00	0.10
239	601618	中国中冶	118,186	352,194.28	0.10
240	002157	正邦科技	29,100	347,745.00	0.10
241	600079	人福医药	12,300	347,721.00	0.10
242	002024	苏宁易购	61,764	345,260.76	0.10
243	002456	欧菲光	38,837	344,872.56	0.10
244	600705	中航产融	89,044	344,600.28	0.10
245	300677	英科医疗	2,700	336,960.00	0.10
246	300558	贝达药业	3,100	335,544.00	0.10
247	600606	绿地控股	60,406	329,212.70	0.09
248	000656	金科股份	56,700	328,293.00	0.09
249	600332	白云山	9,463	320,322.55	0.09
250	601696	中银证券	15,400	317,086.00	0.09
251	002463	沪电股份	20,100	310,947.00	0.09
252	600011	华能国际	72,900	307,638.00	0.09
253	600655	豫园股份	26,200	303,658.00	0.09
254	601933	永辉超市	63,592	300,790.16	0.09
255	603939	益丰药房	5,300	297,277.00	0.09
256	600118	中国卫星	10,094	295,350.44	0.08
257	600845	宝信软件	5,800	295,220.00	0.08
258	688363	华熙生物	1,048	291,197.28	0.08
259	601216	君正集团	56,408	287,116.72	0.08
260	601990	南京证券	27,000	284,040.00	0.08
261	601162	天风证券	57,390	278,915.40	0.08
262	601995	中金公司	4,500	276,750.00	0.08
263	600018	上港集团	57,973	276,531.21	0.08
264	600489	中金黄金	31,801	274,124.62	0.08
265	601998	中信银行	50,988	260,038.80	0.07
266	002120	韵达股份	18,693	252,916.29	0.07
267	688126	沪硅产业	8,500	248,030.00	0.07

268	603338	浙江鼎力	4,200	246,498.00	0.07
269	688009	中国通号	43,013	244,743.97	0.07
270	603392	万泰生物	940	243,629.20	0.07
271	002673	西部证券	29,088	239,976.00	0.07
272	600521	华海药业	11,000	229,680.00	0.07
273	002739	万达电影	14,300	225,797.00	0.06
274	601881	中国银河	20,800	224,224.00	0.06
275	002558	巨人网络	16,840	223,972.00	0.06
276	603195	公牛集团	1,100	222,200.00	0.06
277	603658	安图生物	2,900	219,733.00	0.06
278	600848	上海临港	12,000	214,800.00	0.06
279	601236	红塔证券	15,700	212,892.00	0.06
280	603233	大参林	4,080	208,528.80	0.06
281	601319	中国人保	35,100	208,143.00	0.06
282	600233	圆通速递	20,700	207,207.00	0.06
283	601872	招商轮船	42,360	195,703.20	0.06
284	600482	中国动力	10,802	188,170.84	0.05
285	601231	环旭电子	10,800	181,548.00	0.05
286	002032	苏泊尔	2,800	178,612.00	0.05
287	002773	康弘药业	7,680	177,638.40	0.05
288	000800	一汽解放	15,900	172,038.00	0.05
289	600025	华能水电	29,700	171,963.00	0.05
290	002939	长城证券	15,340	170,734.20	0.05
291	002153	石基信息	7,253	170,518.03	0.05
292	600918	中泰证券	13,400	144,988.00	0.04
293	601808	中海油服	9,900	142,164.00	0.04
294	600340	华夏幸福	26,104	136,784.96	0.04
295	601698	中国卫通	7,100	114,949.00	0.03
296	603087	甘李药业	1,000	106,580.00	0.03
297	600299	安迪苏	5,300	63,388.00	0.02
298	002945	华林证券	4,300	59,426.00	0.02

7.3.2 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	002466	天齐锂业	15,411	955,790.22	0.27
2	600089	特变电工	57,627	740,506.95	0.21

3	688686	奥普特	1,515	677,826.15	0.19
4	600219	南山铝业	110,900	399,240.00	0.11
5	688076	诺泰生物	4,984	320,371.52	0.09
6	600177	雅戈尔	46,152	304,141.68	0.09
7	600066	宇通客车	22,098	276,004.02	0.08
8	600867	通化东宝	22,100	263,874.00	0.08
9	600516	方大炭素	35,456	263,792.64	0.08
10	600674	川投能源	20,866	257,277.78	0.07
11	601997	贵阳银行	35,240	252,318.40	0.07
12	601018	宁波港	60,709	239,800.55	0.07
13	600038	中直股份	4,424	233,321.76	0.07
14	600208	新湖中宝	70,990	215,809.60	0.06
15	600188	兖州煤业	13,944	214,179.84	0.06
16	688425	铁建重工	36,449	210,310.73	0.06
17	601898	中煤能源	28,300	202,345.00	0.06
18	600170	上海建工	69,022	190,500.72	0.05
19	603260	合盛硅业	2,280	175,354.80	0.05
20	000709	河钢股份	65,975	162,298.50	0.05
21	600583	海油工程	34,332	154,494.00	0.04
22	600977	中国电影	12,101	151,625.53	0.04
23	600398	海澜之家	20,800	150,592.00	0.04
24	600372	中航电子	8,862	146,666.10	0.04
25	688575	亚辉龙	3,435	143,102.10	0.04
26	601992	金隅集团	52,000	139,880.00	0.04
27	600928	西安银行	20,500	95,530.00	0.03
28	688113	联测科技	1,415	86,173.50	0.02
29	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
30	600968	海油发展	30,200	78,218.00	0.02
31	601828	美凯龙	6,410	76,920.00	0.02
32	688468	科美诊断	3,919	76,420.50	0.02
33	002468	申通快递	9,500	72,390.00	0.02
34	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.02
35	688191	智洋创新	3,203	64,380.30	0.02
36	601298	青岛港	10,100	62,418.00	0.02
37	688655	迅捷兴	3,083	59,501.90	0.02
38	300919	中伟股份	354	57,702.00	0.02
39	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
40	300957	贝泰妮	217	54,777.31	0.02
41	601212	白银有色	20,800	54,288.00	0.02

42	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
43	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
44	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
45	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
46	300979	华利集团	379	39,920.07	0.01
47	300973	立高食品	264	38,303.76	0.01
48	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
49	301015	百洋医药	462	25,322.22	0.01
50	301009	可靠股份	801	25,007.22	0.01
51	300953	震裕科技	240	23,973.60	0.01
52	300968	格林精密	1,162	17,406.76	0.00
53	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
54	301013	利和兴	471	16,640.43	0.00
55	300614	百川畅银	329	16,321.69	0.00
56	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
57	300932	三友联众	492	15,596.40	0.00
58	301002	崧盛股份	201	15,340.32	0.00
59	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
60	300940	南极光	307	13,308.45	0.00
61	300937	药易购	244	13,093.04	0.00
62	300962	中金辐照	576	12,741.12	0.00
63	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
64	300996	普联软件	241	12,194.60	0.00
65	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
66	301016	雷尔伟	275	11,294.25	0.00
67	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
68	300955	嘉亨家化	232	10,683.60	0.00
69	300987	川网传媒	301	10,462.76	0.00
70	300978	东箭科技	593	9,944.61	0.00
71	300986	志特新材	264	9,828.72	0.00
72	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
73	300993	玉马遮阳	410	9,524.30	0.00
74	688080	映翰通	200	9,524.00	0.00
75	688078	龙软科技	200	9,256.00	0.00
76	300952	恒辉安防	340	9,203.80	0.00
77	301004	嘉益股份	312	9,026.16	0.00
78	300945	曼卡龙	474	8,944.38	0.00
79	300948	冠中生态	324	8,874.36	0.00
80	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00

81	300991	创益通	254	8,671.56	0.00
82	300950	德固特	219	8,567.28	0.00
83	300975	商络电子	492	8,398.44	0.00
84	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
85	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
86	300985	致远新能	295	8,050.55	0.00
87	300926	博俊科技	359	7,955.44	0.00
88	300930	屹通新材	322	7,879.34	0.00
89	300963	中洲特材	283	7,847.59	0.00
90	300967	晓鸣股份	507	7,777.38	0.00
91	301011	华立科技	175	7,703.50	0.00
92	300972	万辰生物	430	6,966.00	0.00
93	300927	江天化学	217	6,527.36	0.00
94	300943	春晖智控	255	5,865.00	0.00
95	300995	奇德新材	191	5,502.71	0.00
96	301012	扬电科技	170	5,460.40	0.00
97	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
98	300992	泰福泵业	200	5,378.00	0.00
99	301010	晶雪节能	218	4,928.98	0.00
100	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
101	605133	嵘泰股份	100	2,168.00	0.00
102	605303	园林股份	100	1,843.00	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	600519	贵州茅台	4,565,551.00	1.24
2	688111	金山办公	2,670,738.00	0.73
3	000858	五粮液	2,632,695.00	0.72
4	000333	美的集团	2,607,773.00	0.71
5	601318	中国平安	2,408,366.00	0.66
6	601166	兴业银行	1,685,111.00	0.46
7	600763	通策医疗	1,684,908.75	0.46
8	000895	双汇发展	1,607,579.00	0.44
9	601816	京沪高铁	1,530,138.00	0.42

10	002812	恩捷股份	1,482,974.00	0.40
11	603259	药明康德	1,475,098.20	0.40
12	601916	浙商银行	1,405,981.00	0.38
13	603501	韦尔股份	1,394,104.00	0.38
14	603882	金域医学	1,263,417.00	0.34
15	688169	石头科技	1,222,466.00	0.33
16	002049	紫光国微	1,213,264.00	0.33
17	300274	阳光电源	1,207,819.00	0.33
18	603806	福斯特	1,184,932.00	0.32
19	600050	中国联通	1,149,482.00	0.31
20	688036	传音控股	1,134,417.23	0.31

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	601318	中国平安	6,220,492.00	1.69
2	600519	贵州茅台	5,177,703.27	1.41
3	000858	五粮液	4,283,065.84	1.17
4	000333	美的集团	4,162,125.16	1.13
5	600276	恒瑞医药	2,593,233.00	0.71
6	601166	兴业银行	2,295,123.00	0.62
7	601888	中国中免	2,237,192.00	0.61
8	000651	格力电器	2,215,311.00	0.60
9	600887	伊利股份	1,834,519.00	0.50
10	000001	平安银行	1,619,190.59	0.44
11	300015	爱尔眼科	1,602,935.00	0.44
12	000002	万科 A	1,508,193.00	0.41
13	600031	三一重工	1,483,780.00	0.40
14	300059	东方财富	1,480,264.00	0.40
15	600030	中信证券	1,447,647.00	0.39
16	601012	隆基股份	1,393,201.85	0.38
17	601995	中金公司	1,312,011.80	0.36
18	002714	牧原股份	1,278,073.40	0.35
19	002594	比亚迪	1,256,027.00	0.34
20	601398	工商银行	1,251,698.00	0.34

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	114,347,982.58
卖出股票收入（成交）总额	146,614,047.47

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）	281,268.79	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	281,268.79	0.08

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	2,010	201,000.00	0.06
2	127036	三花转债	221	28,948.79	0.01
3	113616	韦尔转债	150	23,220.00	0.01
4	127038	国微转债	171	17,100.00	0.00
5	113049	长汽转债	110	11,000.00	0.00

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投资。

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

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

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	46,527.18
2	应收证券清算款	555,751.94
3	应收股利	-
4	应收利息	1,961.55
5	应收申购款	545,085.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,149,326.64

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**7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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	688686	奥普特	677,826.15	0.19	限售期锁定
2	688076	诺泰生物	320,371.52	0.09	限售期锁定

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
8,975	22,489.64	113,613,501.57	56.29%	88,230,993.74	43.71%

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	周茂研	382,900.00	14.13%
2	倪俊	135,628.00	5.00%
3	杨凯	112,682.00	4.16%
4	张维平	100,000.00	3.69%
5	张睿珈	74,700.00	2.76%
6	林树瀚	74,633.00	2.75%
7	缪晏	60,000.00	2.21%
8	吴卫菊	59,825.00	2.21%
9	梁恒升	57,165.00	2.11%
10	杜晓雯	55,800.00	2.06%

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	645,124.21	0.3196%

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（2010年8月4日）基金份额总额	898,915,869.33
本报告期期初基金份额总额	220,620,424.75
本报告期基金总申购份额	91,281,298.15
减:本报告期基金总赎回份额	110,057,227.59
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	201,844,495.31

§ 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

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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。

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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国元证券	1	153,463,564.09	60.55%	142,920.92	60.55%	-

招商证券	1	99,975,540.33	39.45%	93,107.39	39.45%	-
------	---	---------------	--------	-----------	--------	---

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
国元证券	255,261.20	51.68%	-	-	-	-
招商证券	238,627.39	48.32%	-	-	-	-

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：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	上海证券报、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	上海证券报、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	上海证券报、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	长盛基金管理有限公司关于增加中金财富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	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年5月31日
5	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	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年4月22日
6	长盛沪深 300 指数证券投资基金(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
7	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	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年4月6日
8	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	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年3月31日
9	长盛沪深 300 指数证券投资基金(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
10	长盛沪深 300 指数证券投资基金(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3月30日

11	长盛沪深 300 指数证券投资基金(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 3 月 30 日
12	长盛沪深 300 指数证券投资基金(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 3 月 30 日
13	长盛沪深 300 指数证券投资基金(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 3 月 30 日
14	关于旗下指数基金根据《侧袋机制指引》及《指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 30 日
15	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	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 18 日
16	长盛沪深 300 指数证券投资基金(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 3 月 15 日
17	长盛沪深 300 指数证券投资基金(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 3 月 15 日
18	关于长盛基金管理有限公司直销中心开展旗下部分基金赎回费率优惠活动的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 2 月 8 日
19	长盛沪深 300 指数证券投资基金(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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210303~20210630	43,781,437.11	0.00	0.00	43,781,437.11	21.69%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。</p>							

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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（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