

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人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.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
§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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	63
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.....	64
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.....	64
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.....	64
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注.....	64
§8 基金份额持有人信息.....	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
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.....	66
§9 开放式基金份额变动.....	67
§10 重大事件揭示.....	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变.....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
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.....	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8 其他重大事件.....	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	73

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	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§12 备查文件目录.....	74
12.1 备查文件目录.....	74
12.2 存放地点.....	74
12.3 查阅方式.....	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)
基金简称	长盛同庆中证 800 指数 (LOF)
场内简称	长盛中证 800LOF
基金主代码	160806
交易代码	160806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 22 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	101,822,802.47 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 8 月 6 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	李申
	联系电话	010-86497608	021-60637102
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-86497888	021-60637111

传真	010-86497999	021-60635778
注册地址	深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100029	100033
法定代表人	周兵	田国立

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	57,203,378.82
本期利润	20,782,725.28
加权平均基金份额本期利润	0.1949
本期加权平均净值利润率	11.35%
本期基金份额净值增长率	5.09%
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	72,140,432.91
期末可供分配基金份额利润	0.7085
期末基金资产净值	180,911,837.72
期末基金份额净值	1.777
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	29.50%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.62%	0.75%	-1.23%	0.73%	1.85%	0.02%
过去三个月	8.29%	0.87%	4.47%	0.84%	3.82%	0.03%
过去六个月	5.09%	1.19%	1.72%	1.15%	3.37%	0.04%
过去一年	36.18%	1.23%	22.04%	1.22%	14.14%	0.01%
过去三年	82.08%	1.27%	42.37%	1.29%	39.71%	-0.02%
自基金转型起至今	29.50%	1.50%	-2.09%	1.44%	31.59%	0.06%

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： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率（税后）}$

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

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 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，长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛上证 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，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）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。	2019 年 5 月 30 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。

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 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深幅的回撤。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 1.777 元; 本报告期基金份额净值增长率为 5.09%, 业绩比较基准收益率为 1.72%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0281%, 年度化跟踪误差为 1.9208%。

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，本基金本报告期内未实施利润分配。

截至 2021 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 72,140,432.91 元，其中，未分配利润已实现部分为 165,344,473.32 元，未分配利润未实现部分为-93,204,040.41 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

本报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,728,619.56	16,946,147.35
结算备付金		15,115.39	-
存出保证金		71,991.27	63,821.98
交易性金融资产	6.4.7.2	170,192,275.54	276,069,701.87
其中：股票投资		170,072,832.95	275,812,063.07
基金投资		-	-
债券投资		119,442.59	257,638.80
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		449,756.70	668,811.91
应收利息	6.4.7.5	1,040.52	5,950.79
应收股利		-	-
应收申购款		11,557.85	15,730.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		182,470,356.83	293,770,164.62
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		115,397.32	203,586.57
应付管理人报酬		146,472.90	340,119.29
应付托管费		32,224.03	74,826.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	32,528.51	139,173.58
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	1,231,896.35	1,287,806.01
负债合计		1,558,519.11	2,045,512.88
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	108,771,404.81	184,245,536.60
未分配利润	6.4.7.10	72,140,432.91	107,479,115.14
所有者权益合计		180,911,837.72	291,724,651.74
负债和所有者权益总计		182,470,356.83	293,770,164.62

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.777 元，基金份额总额 101,822,802.47 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：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		22,437,038.49	22,552,060.90
1.利息收入		22,299.30	91,848.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	22,255.21	91,843.76
债券利息收入		44.09	4.38
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）		58,649,291.87	24,818,086.83
其中：股票投资收益	6.4.7.12	57,408,695.18	21,685,183.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	35,227.65	-
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	1,205,369.04	3,132,903.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-36,420,653.54	-2,459,584.52
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	186,100.86	101,710.45
减：二、费用		1,654,313.21	2,989,631.66

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	908,003.10	1,854,335.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	199,760.66	407,953.73
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	423,659.59	604,076.54
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.10	0.02
7. 其他费用	6.4.7.20	122,889.76	123,266.03
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		20,782,725.28	19,562,429.24
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		20,782,725.28	19,562,429.24

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 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)	184,245,536.60	107,479,115.14	291,724,651.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	20,782,725.28	20,782,725.28
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-75,474,131.79	-56,121,407.51	-131,595,539.30
其中: 1. 基金申购款	24,423,296.71	12,965,071.48	37,388,368.19
2. 基金赎回款	-99,897,428.50	-69,086,478.99	-168,983,907.49
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)	108,771,404.81	72,140,432.91	180,911,837.72
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)	272,510,815.04	97,386,589.13	369,897,404.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	19,562,429.24	19,562,429.24
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)	-9,779,697.47	1,149,840.99	-8,629,856.48
其中: 1.基金申购款	74,007,586.58	25,434,612.83	99,442,199.41
2.基金赎回款	-83,787,284.05	-24,284,771.84	-108,072,055.89
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)	-	-33,497,184.16	-33,497,184.16
五、期末所有者权益 (基金净值)	262,731,117.57	84,601,675.20	347,332,792.77

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

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

根据原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金在分级运作期内的基金份额包括长盛同庆中

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%,其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%;其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种,其中权证资产占基金资产净值的比例为 0—3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:95%×中证 800 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)。

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》、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (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 的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 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需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	11,728,619.56
定期存款	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计:	11,728,619.56

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	137,215,292.87	170,072,832.95	32,857,540.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	111,100.00	119,442.59
	银行间市场	-	-
	合计	111,100.00	119,442.59
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	137,326,392.87	170,192,275.54	32,865,882.67

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	989.69
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	6.12
应收债券利息	15.55
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	29.16
合计	1,040.52

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	32,528.51
银行间市场应付交易费用	-
合计	32,528.51

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	500,000.00
应付赎回费	432.53
应付证券出借违约金	-
其他	612,450.89
预提费用	119,012.93
合计	1,231,896.35

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	172,510,529.46	184,245,536.60
本期申购	22,862,949.35	24,423,296.71
本期赎回(以“-”号填列)	-93,550,676.34	-99,897,428.50
- 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	101,822,802.47	108,771,404.81

注：1、申购含转换入；赎回含转换出。

2、截至 2021 年 6 月 30 日，本基金于深交所上市的基金份额为 46,033,896.00 份(2020 年 12 月

31 日: 49,731,481.00 份), 托管在场外未上市交易的基金份额为 55,788,906.47 份(2020 年 12 月 31 日: 122,779,048.46 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	174,066,307.75	-66,587,192.61	107,479,115.14
本期利润	57,203,378.82	-36,420,653.54	20,782,725.28
本期基金份额交易产生的变动数	-65,925,213.25	9,803,805.74	-56,121,407.51
其中: 基金申购款	34,948,563.71	-21,983,492.23	12,965,071.48
基金赎回款	-100,873,776.96	31,787,297.97	-69,086,478.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	165,344,473.32	-93,204,040.41	72,140,432.91

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	21,262.29
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	423.84
其他	569.08
合计	22,255.21

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	178,348,460.90
减: 卖出股票成本总额	120,939,765.72
买卖股票差价收入	57,408,695.18

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	35,227.65
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	35,227.65

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	359,977.26
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	324,700.00
减：应收利息总额	49.61
买卖债券差价收入	35,227.65

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	1,205,369.04
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	1,205,369.04

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	-36,420,653.54
——股票投资	-36,426,357.33
——债券投资	5,703.79
——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	-36,420,653.54

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	82,574.23
基金转换费收入	103,526.63
合计	186,100.86

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	423,659.59
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	423,659.59

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	-
深交所上市年费	29,752.78
银行划款费用	3,876.83
合计	122,889.76

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
中国建设银行股份有限公司 (“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构

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

注：无。

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	908,003.10	1,854,335.34

的管理费		
其中: 支付销售机构的客户维护费	60,060.84	41,787.81

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

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	199,760.66	407,953.73

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 当年天数。

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 (2015 年 5 月 22 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	-	7,142,857.14
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	-	7,142,857.14
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.9037%

注: 基金管理人持有本基金份额的交易费用按照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
中国建设银行	11,728,619.56	21,262.29	21,588,321.51	91,048.84

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管, 按银行同业利率计息。

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
301018	申菱	2021年	2021	新股未	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-

	环境	6月28日	2021年7月7日	上市							
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		-
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	1,389	53,962.65	53,962.65		-
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		-
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	1,753	38,495.88	38,495.88		-
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		-
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		-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2022年1月7日	限售期锁定	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06		-
688630	芯碁微装	2021年3月25日	2021年10月8日	限售期锁定	15.23	66.49	3,397	51,736.31	225,866.53		-
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	3,084	48,017.88	198,239.52		-
688059	华锐精密	2021年2月1日	2021年8月9日	限售期锁定	37.09	159.98	1,023	37,943.07	163,659.54		-
688689	银河微电	2021年1月15日	2021年7月27日	限售期锁定	14.01	35.58	3,258	45,644.58	115,919.64		-
688575	亚辉	2021年	2021	限售期	14.80	41.66	2,359	34,913.20	98,275.94		-

	龙	5月10日	年11月17日	锁定							
688628	优利德	2021年1月22日	2021年8月2日	限售期锁定	19.11	32.61	2,789	53,297.79	90,949.29		-
688662	富信科技	2021年3月25日	2021年10月8日	限售期锁定	15.61	33.28	2,556	39,899.16	85,063.68		-
688639	华恒生物	2021年4月14日	2021年10月22日	限售期锁定	23.16	44.35	1,847	42,776.52	81,914.45		-
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		-
688633	星球石墨	2021年3月17日	2021年9月24日	限售期锁定	33.62	53.12	908	30,526.96	48,232.96		-
688109	品茗股份	2021年3月22日	2021年9月30日	限售期锁定	50.05	72.11	664	33,233.20	47,881.04		-
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		-
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	213	7,075.86	22,435.29		-
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	2021年	2021	限售期	18.71	76.32	201	3,760.71	15,340.32		-

	股份	5月27日	年12月7日	锁定							
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	477	5,981.58	14,891.94	-	
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	-	
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	-	
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	-	
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	-	
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	245	3,623.55	9,121.35	-	
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	-	
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月	限售期锁定	13.00	27.39	324	2,808.00	8,874.36	-	

		日	25 日								
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	-	
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	298	3,492.56	8,066.86	-	
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	-	
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	-	
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	-	
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	-	
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	-	

			日							
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	177	4,407.30	4,830.33	-
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	-
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	445	10,947.00	72,535.00	-

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
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	50	5,000.00	5,000.00	-
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	870	87,000.00	87,000.00	-

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
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	5,361	85,479.37	302,092.35	-
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	27,282	268,211.22	152,506.38	-
600811	东方集团	2021年6月30日	重大事项停牌	3.05	2021年7月14日	3.36	21,708	95,809.80	66,209.40	-

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

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

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

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

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中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发

行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 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 0.07% (2020 年 12 月 31 日：0.09%)。

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该比例限制)。

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、结算备付金、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	11,728,619.56	-	-	-	11,728,619.56
结算备付金	15,115.39	-	-	-	15,115.39
存出保证金	71,991.27	-	-	-	71,991.27
交易性金融资产	-	-	119,442.59	170,072,832.95	170,192,275.54
应收证券清算款	-	-	-	449,756.70	449,756.70
应收利息	-	-	-	1,040.52	1,040.52
应收申购款	-	-	-	11,557.85	11,557.85
资产总计	11,815,726.22	-	119,442.59	170,535,188.02	182,470,356.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	115,397.32	115,397.32
应付管理人报酬	-	-	-	146,472.90	146,472.90
应付托管费	-	-	-	32,224.03	32,224.03
应付交易费用	-	-	-	32,528.51	32,528.51
其他负债	-	-	-	1,231,896.35	1,231,896.35
负债总计	-	-	-	1,558,519.11	1,558,519.11
利率敏感度缺口	11,815,726.22	-	119,442.59	168,976,668.91	180,911,837.72
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	16,946,147.35	-	-	-	16,946,147.35
存出保证金	63,821.98	-	-	-	63,821.98
交易性金融资产	-	-	257,638.80	275,812,063.07	276,069,701.87
应收证券清算款	-	-	-	668,811.91	668,811.91
应收利息	-	-	-	5,950.79	5,950.79
应收申购款	-	-	-	15,730.72	15,730.72
资产总计	17,009,969.33	-	257,638.80	276,502,556.49	293,770,164.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	203,586.57	203,586.57
应付管理人报酬	-	-	-	340,119.29	340,119.29
应付托管费	-	-	-	74,826.22	74,826.22
应付交易费用	-	-	-	139,173.58	139,173.58
应交税费	-	-	-	1.21	1.21
其他负债	-	-	-	1,287,806.01	1,287,806.01
负债总计	-	-	-	2,045,512.88	2,045,512.88
利率敏感度缺口	17,009,969.33	-	257,638.80	274,457,043.61	291,724,651.74

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

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为

0.07%(2020 年 12 月 31 日: 0.09%), 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。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%, 其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%; 其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种, 其中权证资产占基金资产净值的比例为 0—3%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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	170,072,832.95	94.01	275,812,063.07	94.55
合计	170,072,832.95	94.01	275,812,063.07	94.55

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%	9,035,080.00	14,089,788.70
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-9,035,080.00	-14,089,788.70	

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 167,584,740.24 元,属于第二层次的余额为 2,607,535.30 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 270,536,829.02 元,第二层次的余额为 5,532,872.85 元,无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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	170,072,832.95	93.21
	其中：股票	170,072,832.95	93.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	119,442.59	0.07
	其中：债券	119,442.59	0.07
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,743,734.95	6.44
8	其他各项资产	534,346.34	0.29
9	合计	182,470,356.83	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	1,732,045.90	0.96
B	采矿业	3,467,914.18	1.92
C	制造业	93,656,431.77	51.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,914,790.43	1.61
E	建筑业	2,506,341.98	1.39
F	批发和零售业	2,535,655.53	1.40
G	交通运输、仓储和邮政业	4,734,699.77	2.62
H	住宿和餐饮业	138,844.10	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,072,624.02	4.46
J	金融业	32,236,050.06	17.82
K	房地产业	3,867,457.84	2.14
L	租赁和商务服务业	2,954,994.70	1.63
M	科学研究和技术服务业	1,620,189.12	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	101,660.17	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	325,884.00	0.18
Q	卫生和社会工作	2,781,325.88	1.54
R	文化、体育和娱乐业	1,041,349.14	0.58
S	综合	372,790.50	0.21
	合计	165,061,049.09	91.24

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	-	-
B	采矿业	73,116.00	0.04
C	制造业	3,470,320.09	1.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	134,076.33	0.07
E	建筑业	11,014.44	0.01
F	批发和零售业	181,234.70	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	202,417.45	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	412,662.80	0.23
J	金融业	116,648.00	0.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	312,424.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	25,196.05	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	72,674.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	5,011,783.86	2.77

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	3,703	7,615,960.10	4.21

2	600036	招商银行	72,116	3,907,966.04	2.16
3	601318	中国平安	60,318	3,877,241.04	2.14
4	000858	五粮液	11,098	3,305,983.22	1.83
5	601012	隆基股份	26,377	2,343,332.68	1.30
6	000333	美的集团	30,938	2,208,045.06	1.22
7	600276	恒瑞医药	27,102	1,842,122.94	1.02
8	601166	兴业银行	88,771	1,824,244.05	1.01
9	601888	中国中免	6,012	1,804,201.20	1.00
10	002415	海康威视	27,591	1,779,619.50	0.98
11	603259	药明康德	9,968	1,560,889.12	0.86
12	300059	东方财富	46,168	1,513,848.72	0.84
13	000651	格力电器	28,623	1,491,258.30	0.82
14	000001	平安银行	65,179	1,474,348.98	0.81
15	002594	比亚迪	5,684	1,426,684.00	0.79
16	002475	立讯精密	29,252	1,345,592.00	0.74
17	600887	伊利股份	35,634	1,312,400.22	0.73
18	600900	长江电力	62,820	1,296,604.80	0.72
19	600030	中信证券	50,734	1,265,305.96	0.70
20	000725	京东方 A	197,007	1,229,323.68	0.68
21	603501	韦尔股份	3,600	1,159,200.00	0.64
22	300015	爱尔眼科	15,556	1,104,164.88	0.61
23	000568	泸州老窖	4,634	1,093,345.96	0.60
24	000002	万科 A	45,254	1,077,497.74	0.60
25	600031	三一重工	36,029	1,047,363.03	0.58
26	601398	工商银行	200,012	1,034,062.04	0.57
27	600309	万华化学	9,379	1,020,622.78	0.56
28	603288	海天味业	7,852	1,012,515.40	0.56
29	601816	京沪高铁	190,500	1,007,745.00	0.56
30	002714	牧原股份	15,895	966,733.90	0.53
31	600436	片仔癀	2,145	961,603.50	0.53
32	601919	中远海控	29,900	913,146.00	0.50
33	300122	智飞生物	4,800	896,304.00	0.50
34	600809	山西汾酒	1,953	874,944.00	0.48
35	002142	宁波银行	22,224	866,069.28	0.48
36	002304	洋河股份	3,995	827,764.00	0.46
37	300274	阳光电源	7,160	823,829.60	0.46
38	600438	通威股份	19,000	822,130.00	0.45
39	601328	交通银行	166,670	816,683.00	0.45
40	601899	紫金矿业	80,127	776,430.63	0.43

41	002230	科大讯飞	11,450	773,791.00	0.43
42	000661	长春高新	1,968	761,616.00	0.42
43	300014	亿纬锂能	7,100	737,903.00	0.41
44	300124	汇川技术	9,702	720,470.52	0.40
45	600000	浦发银行	71,425	714,250.00	0.39
46	002241	歌尔股份	16,654	711,791.96	0.39
47	000100	TCL 科技	91,115	697,029.75	0.39
48	002027	分众传媒	73,800	694,458.00	0.38
49	600690	海尔智家	26,772	693,662.52	0.38
50	601601	中国太保	23,440	679,056.80	0.38
51	300142	沃森生物	11,000	678,700.00	0.38
52	600837	海通证券	58,949	677,913.50	0.37
53	002271	东方雨虹	12,250	677,670.00	0.37
54	300347	泰格医药	3,470	670,751.00	0.37
55	002352	顺丰控股	9,900	670,230.00	0.37
56	603986	兆易创新	3,500	657,650.00	0.36
57	600196	复星医药	8,874	640,081.62	0.35
58	000063	中兴通讯	18,862	626,784.26	0.35
59	601288	农业银行	206,667	626,201.01	0.35
60	600048	保利地产	51,924	625,164.96	0.35
61	688111	金山办公	1,578	622,994.40	0.34
62	603806	福斯特	5,900	620,267.00	0.34
63	600585	海螺水泥	14,951	613,738.55	0.34
64	601229	上海银行	71,669	587,685.80	0.32
65	002129	中环股份	15,176	585,793.60	0.32
66	000338	潍柴动力	32,706	584,456.22	0.32
67	601668	中国建筑	124,999	581,245.35	0.32
68	002460	赣锋锂业	4,800	581,232.00	0.32
69	601688	华泰证券	36,191	571,817.80	0.32
70	603799	华友钴业	4,990	569,858.00	0.31
71	600660	福耀玻璃	10,153	567,045.05	0.31
72	600703	三安光电	17,558	562,733.90	0.31
73	601211	国泰君安	32,700	560,478.00	0.31
74	600016	民生银行	126,895	559,606.95	0.31
75	600104	上汽集团	25,166	552,897.02	0.31
76	002049	紫光国微	3,500	539,665.00	0.30
77	601766	中国中车	86,787	527,664.96	0.29
78	601169	北京银行	107,194	522,034.78	0.29
79	600050	中国联通	120,772	521,735.04	0.29

80	300450	先导智能	8,600	517,204.00	0.29
81	600919	江苏银行	72,120	512,052.00	0.28
82	600570	恒生电子	5,334	497,395.50	0.27
83	600019	宝钢股份	64,959	496,286.76	0.27
84	002311	海大集团	6,000	489,600.00	0.27
85	000799	酒鬼酒	1,900	485,640.00	0.27
86	300498	温氏股份	32,800	471,336.00	0.26
87	600406	国电南瑞	20,202	469,494.48	0.26
88	601988	中国银行	151,438	466,429.04	0.26
89	601088	中国神华	23,796	464,497.92	0.26
90	000538	云南白药	4,011	464,152.92	0.26
91	002371	北方华创	1,659	460,173.42	0.25
92	600999	招商证券	24,100	458,382.00	0.25
93	688396	华润微	5,036	458,376.72	0.25
94	002410	广联达	6,641	452,916.20	0.25
95	601818	光大银行	114,296	432,038.88	0.24
96	600028	中国石化	96,396	420,286.56	0.23
97	601628	中国人寿	12,247	415,050.83	0.23
98	600763	通策医疗	1,000	411,000.00	0.23
99	002821	凯莱英	1,100	409,860.00	0.23
100	002709	天赐材料	3,840	409,267.20	0.23
101	601633	长城汽车	9,225	402,117.75	0.22
102	600346	恒力石化	15,300	401,472.00	0.22
103	600588	用友网络	11,879	395,095.54	0.22
104	601009	南京银行	37,501	394,510.52	0.22
105	000625	长安汽车	14,406	378,589.68	0.21
106	601857	中国石油	70,731	374,166.99	0.21
107	300601	康泰生物	2,467	367,583.00	0.20
108	300413	芒果超媒	5,300	363,580.00	0.20
109	002493	荣盛石化	20,850	360,079.50	0.20
110	600132	重庆啤酒	1,800	356,310.00	0.20
111	600089	特变电工	27,488	353,220.80	0.20
112	300595	欧普康视	3,360	347,928.00	0.19
113	600893	航发动力	6,526	347,117.94	0.19
114	600009	上海机场	7,204	346,728.52	0.19
115	601225	陕西煤业	29,092	344,740.20	0.19
116	600111	北方稀土	16,483	341,198.10	0.19
117	600745	闻泰科技	3,500	339,150.00	0.19
118	600426	华鲁恒升	10,839	335,467.05	0.19

119	300408	三环集团	7,800	330,876.00	0.18
120	000776	广发证券	21,786	329,840.04	0.18
121	000157	中联重科	35,435	327,419.40	0.18
122	002001	新和成	11,400	326,952.00	0.18
123	002607	中公教育	15,600	325,884.00	0.18
124	002179	中航光电	4,103	324,219.06	0.18
125	000009	中国宝安	17,639	322,264.53	0.18
126	002050	三花智控	13,278	318,406.44	0.18
127	601377	兴业证券	32,202	311,071.32	0.17
128	601390	中国中铁	59,099	309,678.76	0.17
129	600741	华域汽车	11,733	308,225.91	0.17
130	600460	士兰微	5,361	302,092.35	0.17
131	300003	乐普医疗	9,300	298,716.00	0.17
132	002007	华兰生物	8,130	298,208.40	0.16
133	000963	华东医药	6,479	298,098.79	0.16
134	300529	健帆生物	3,400	293,624.00	0.16
135	601336	新华保险	6,359	291,941.69	0.16
136	000166	申万宏源	62,051	290,398.68	0.16
137	603882	金城医学	1,800	287,586.00	0.16
138	601155	新城控股	6,900	287,040.00	0.16
139	601006	大秦铁路	43,328	285,098.24	0.16
140	002236	大华股份	13,449	283,773.90	0.16
141	601901	方正证券	30,304	283,645.44	0.16
142	300285	国瓷材料	5,800	282,750.00	0.16
143	300433	蓝思科技	9,600	282,336.00	0.16
144	600143	金发科技	13,421	279,962.06	0.15
145	600015	华夏银行	44,963	278,320.97	0.15
146	600176	中国巨石	17,904	277,691.04	0.15
147	601989	中国重工	66,126	272,439.12	0.15
148	601799	星宇股份	1,200	270,864.00	0.15
149	601877	正泰电器	7,982	266,439.16	0.15
150	603369	今世缘	4,900	265,384.00	0.15
151	000768	中航西飞	10,091	265,191.48	0.15
152	603893	瑞芯微	1,900	264,974.00	0.15
153	002601	龙佰集团	7,600	262,808.00	0.15
154	601100	恒立液压	3,056	262,571.52	0.15
155	600352	浙江龙盛	19,062	261,911.88	0.14
156	600760	中航沈飞	4,340	261,702.00	0.14
157	002074	国轩高科	6,000	261,360.00	0.14

158	600958	东方证券	26,100	260,739.00	0.14
159	300207	欣旺达	8,000	260,480.00	0.14
160	002340	格林美	27,800	259,930.00	0.14
161	600547	山东黄金	13,434	258,201.48	0.14
162	600926	杭州银行	17,500	258,125.00	0.14
163	600010	宝钢股份	165,016	255,774.80	0.14
164	601916	浙商银行	64,400	255,668.00	0.14
165	002008	大族激光	6,321	255,305.19	0.14
166	601658	邮储银行	50,626	254,142.52	0.14
167	001979	招商蛇口	23,036	252,244.20	0.14
168	000786	北新建材	6,424	252,142.00	0.14
169	601600	中国铝业	47,472	251,601.60	0.14
170	002202	金风科技	20,561	250,021.76	0.14
171	002185	华天科技	16,200	249,318.00	0.14
172	002841	视源股份	2,000	248,580.00	0.14
173	601186	中国铁建	33,451	248,540.93	0.14
174	603993	洛阳钼业	48,056	247,968.96	0.14
175	688036	传音控股	1,179	247,000.50	0.14
176	002555	三七互娱	9,900	237,798.00	0.13
177	300316	晶盛机电	4,700	237,350.00	0.13
178	603899	晨光文具	2,800	236,768.00	0.13
179	000895	双汇发展	7,437	236,496.60	0.13
180	603833	欧派家居	1,640	232,814.40	0.13
181	000938	紫光股份	10,602	231,971.76	0.13
182	601985	中国核电	45,488	230,169.28	0.13
183	603659	璞泰来	1,680	229,488.00	0.13
184	600739	辽宁成大	11,012	229,159.72	0.13
185	000876	新希望	15,612	229,028.04	0.13
186	603486	科沃斯	1,000	228,080.00	0.13
187	002648	卫星石化	5,740	224,950.60	0.12
188	600109	国金证券	17,692	224,511.48	0.12
189	600885	宏发股份	3,500	219,450.00	0.12
190	000596	古井贡酒	908	217,466.00	0.12
191	603019	中科曙光	7,800	215,358.00	0.12
192	601669	中国电建	55,488	214,738.56	0.12
193	601788	光大证券	12,000	214,680.00	0.12
194	000977	浪潮信息	7,574	213,056.62	0.12
195	603444	吉比特	400	212,000.00	0.12
196	688012	中微公司	1,275	211,548.00	0.12

197	000069	华侨城 A	28,341	210,857.04	0.12
198	300253	卫宁健康	12,848	209,036.96	0.12
199	000425	徐工机械	32,454	206,731.98	0.11
200	000783	长江证券	28,194	206,380.08	0.11
201	600795	国电电力	84,753	205,949.79	0.11
202	601838	成都银行	16,233	205,185.12	0.11
203	603517	绝味食品	2,400	202,296.00	0.11
204	000012	南玻 A	19,500	199,680.00	0.11
205	600884	杉杉股份	8,491	198,010.12	0.11
206	600584	长电科技	5,255	198,008.40	0.11
207	600183	生益科技	8,409	196,854.69	0.11
208	002736	国信证券	18,300	196,725.00	0.11
209	300144	宋城演艺	11,700	196,560.00	0.11
210	600079	人福医药	6,930	195,911.10	0.11
211	601233	桐昆股份	8,100	195,129.00	0.11
212	601108	财通证券	18,600	195,114.00	0.11
213	603160	汇顶科技	1,500	194,445.00	0.11
214	002353	杰瑞股份	4,338	193,908.60	0.11
215	600886	国投电力	20,078	192,949.58	0.11
216	300033	同花顺	1,700	191,726.00	0.11
217	002138	顺络电子	4,900	189,973.00	0.11
218	600779	水井坊	1,500	189,525.00	0.10
219	600029	南方航空	31,282	188,317.64	0.10
220	601555	东吴证券	22,498	187,633.32	0.10
221	000027	深圳能源	20,449	187,517.33	0.10
222	002414	高德红外	6,798	187,488.84	0.10
223	300628	亿联网络	2,200	184,360.00	0.10
224	600219	南山铝业	51,100	183,960.00	0.10
225	000547	航天发展	9,713	183,284.31	0.10
226	603589	口子窖	2,700	182,763.00	0.10
227	601607	上海医药	8,637	182,499.81	0.10
228	002044	美年健康	20,000	182,200.00	0.10
229	300136	信维通信	5,900	182,192.00	0.10
230	600522	中天科技	18,198	181,980.00	0.10
231	000066	中国长城	12,285	179,361.00	0.10
232	600600	青岛啤酒	1,550	179,257.50	0.10
233	002223	鱼跃医疗	4,691	178,867.83	0.10
234	601138	工业富联	14,400	178,704.00	0.10
235	002624	完美世界	7,450	178,129.50	0.10

236	000860	顺鑫农业	4,111	173,401.98	0.10
237	600362	江西铜业	7,735	173,109.30	0.10
238	600383	金地集团	16,762	171,642.88	0.09
239	002195	二三四五	84,343	171,216.29	0.09
240	600733	北汽蓝谷	12,680	170,926.40	0.09
241	601021	春秋航空	3,000	170,700.00	0.09
242	601111	中国国航	21,924	170,568.72	0.09
243	002508	老板电器	3,639	169,213.50	0.09
244	600859	王府井	5,854	169,063.52	0.09
245	600161	天坛生物	4,932	168,921.00	0.09
246	600085	同仁堂	4,134	168,873.90	0.09
247	600486	扬农化工	1,500	167,655.00	0.09
248	601800	中国交建	25,867	167,618.16	0.09
249	600115	中国东航	32,837	166,811.96	0.09
250	601168	西部矿业	13,963	166,578.59	0.09
251	601099	太平洋	49,000	166,110.00	0.09
252	000636	风华高科	5,436	164,275.92	0.09
253	600061	国投资本	19,152	162,600.48	0.09
254	300558	贝达药业	1,500	162,360.00	0.09
255	600392	盛和资源	9,291	161,291.76	0.09
256	000703	恒逸石化	13,307	159,018.65	0.09
257	601117	中国化学	18,100	158,556.00	0.09
258	002030	达安基因	7,401	157,197.24	0.09
259	002250	联化科技	5,546	154,733.40	0.09
260	002507	涪陵榨菜	4,100	154,406.00	0.09
261	300357	我武生物	2,400	153,888.00	0.09
262	002078	太阳纸业	11,525	153,858.75	0.09
263	601618	中国中冶	51,506	153,487.88	0.08
264	600705	中航产融	39,460	152,710.20	0.08
265	002024	苏宁易购	27,282	152,506.38	0.08
266	600068	葛洲坝	20,254	151,702.46	0.08
267	002028	思源电气	4,917	151,394.43	0.08
268	600315	上海家化	2,500	150,350.00	0.08
269	603927	中科软	3,500	150,325.00	0.08
270	002422	科伦药业	7,500	149,625.00	0.08
271	600704	物产中大	18,815	148,074.05	0.08
272	601360	三六零	12,100	147,741.00	0.08
273	002385	大北农	21,710	147,628.00	0.08
274	300001	特锐德	4,900	147,539.00	0.08

275	000630	铜陵有色	53,523	145,582.56	0.08
276	600332	白云山	4,300	145,555.00	0.08
277	600699	均胜电子	5,700	145,464.00	0.08
278	002075	沙钢股份	13,300	145,103.00	0.08
279	300088	长信科技	17,520	144,715.20	0.08
280	002916	深南电路	1,300	144,469.00	0.08
281	600606	绿地控股	26,500	144,425.00	0.08
282	600201	生物股份	8,269	144,294.05	0.08
283	000988	华工科技	6,091	143,260.32	0.08
284	300482	万孚生物	2,210	142,964.90	0.08
285	002439	启明星辰	4,900	142,149.00	0.08
286	002602	世纪华通	21,850	140,277.00	0.08
287	600754	锦江酒店	2,438	138,844.10	0.08
288	000513	丽珠集团	2,772	138,655.44	0.08
289	002463	沪电股份	8,955	138,533.85	0.08
290	002603	以岭药业	4,700	137,052.00	0.08
291	600549	厦门钨业	6,510	135,603.30	0.07
292	600011	华能国际	32,000	135,040.00	0.07
293	600118	中国卫星	4,596	134,478.96	0.07
294	600177	雅戈尔	20,384	134,330.56	0.07
295	002273	水晶光电	9,114	133,884.66	0.07
296	601933	永辉超市	28,025	132,558.25	0.07
297	600862	中航高科	4,300	132,354.00	0.07
298	600845	宝信软件	2,600	132,340.00	0.07
299	000739	普洛药业	4,500	132,300.00	0.07
300	600171	上海贝岭	4,320	131,457.60	0.07
301	002080	中材科技	5,000	130,850.00	0.07
302	600655	豫园股份	11,189	129,680.51	0.07
303	002511	中顺洁柔	4,700	129,485.00	0.07
304	002013	中航机电	12,819	129,087.33	0.07
305	601878	浙商证券	9,800	128,184.00	0.07
306	002465	海格通信	13,534	128,031.64	0.07
307	002797	第一创业	17,920	127,948.80	0.07
308	300009	安科生物	8,520	126,948.00	0.07
309	603885	吉祥航空	8,300	126,658.00	0.07
310	601216	君正集团	24,708	125,763.72	0.07
311	601066	中信建投	4,000	125,720.00	0.07
312	002456	欧菲光	14,155	125,696.40	0.07
313	300244	迪安诊断	3,280	125,624.00	0.07

314	600516	方大炭素	16,871	125,520.24	0.07
315	600038	中直股份	2,375	125,257.50	0.07
316	002127	南极电商	12,800	125,056.00	0.07
317	002156	通富微电	5,200	125,008.00	0.07
318	600867	通化东宝	10,400	124,176.00	0.07
319	603939	益丰药房	2,210	123,958.90	0.07
320	600637	东方明珠	15,065	123,382.35	0.07
321	601128	常熟银行	19,800	122,760.00	0.07
322	002690	美亚光电	2,200	122,672.00	0.07
323	600529	山东药玻	3,600	122,220.00	0.07
324	600066	宇通客车	9,734	121,577.66	0.07
325	600018	上港集团	25,461	121,448.97	0.07
326	600879	航天电子	16,048	120,680.96	0.07
327	002212	天融信	6,100	120,597.00	0.07
328	002152	广电运通	9,250	120,527.50	0.07
329	600827	百联股份	5,976	120,416.40	0.07
330	000960	锡业股份	7,510	120,385.30	0.07
331	601997	贵阳银行	16,700	119,572.00	0.07
332	600489	中金黄金	13,813	119,068.06	0.07
333	002120	韵达股份	8,800	119,064.00	0.07
334	000975	银泰黄金	12,445	118,351.95	0.07
335	603658	安图生物	1,560	118,201.20	0.07
336	000750	国海证券	27,871	118,173.04	0.07
337	603605	珀莱雅	600	118,026.00	0.07
338	300146	汤臣倍健	3,586	117,979.40	0.07
339	601162	天风证券	24,100	117,126.00	0.06
340	600487	亨通光电	10,260	116,964.00	0.06
341	002572	索菲亚	4,802	116,208.40	0.06
342	601689	拓普集团	3,100	116,033.00	0.06
343	600166	福田汽车	33,556	115,768.20	0.06
344	600418	江淮汽车	9,300	115,599.00	0.06
345	601998	中信银行	22,584	115,178.40	0.06
346	600521	华海药业	5,500	114,840.00	0.06
347	000402	金融街	17,000	114,750.00	0.06
348	002157	正邦科技	9,600	114,720.00	0.06
349	002131	利欧股份	49,003	114,667.02	0.06
350	601005	重庆钢铁	42,800	114,276.00	0.06
351	003816	中国广核	42,500	113,475.00	0.06
352	601198	东兴证券	10,300	112,579.00	0.06

353	601727	上海电气	26,468	112,224.32	0.06
354	000089	深圳机场	14,400	111,888.00	0.06
355	002252	上海莱士	14,900	111,601.00	0.06
356	000623	吉林敖东	7,155	110,830.95	0.06
357	000998	隆平高科	6,900	110,676.00	0.06
358	600642	申能股份	17,935	110,120.90	0.06
359	000488	晨鸣纸业	13,500	109,890.00	0.06
360	603156	养元饮品	3,800	108,604.00	0.06
361	002294	信立泰	3,300	108,570.00	0.06
362	600271	航天信息	8,276	107,836.28	0.06
363	000050	深天马 A	7,600	107,768.00	0.06
364	000400	许继电气	8,500	107,610.00	0.06
365	600895	张江高科	5,889	107,592.03	0.06
366	300115	长盈精密	5,152	106,131.20	0.06
367	601881	中国银河	9,800	105,644.00	0.06
368	002673	西部证券	12,800	105,600.00	0.06
369	600989	宝丰能源	7,700	105,336.00	0.06
370	300418	昆仑万维	6,400	104,832.00	0.06
371	601611	中国核建	14,500	104,690.00	0.06
372	000021	深科技	5,463	104,561.82	0.06
373	603233	大参林	2,040	104,264.40	0.06
374	000039	中集集团	5,700	103,626.00	0.06
375	002557	洽洽食品	2,400	103,440.00	0.06
376	600039	四川路桥	16,491	103,398.57	0.06
377	600415	小商品城	20,073	103,375.95	0.06
378	600060	海信视像	6,073	102,633.70	0.06
379	600153	建发股份	12,664	102,578.40	0.06
380	300618	寒锐钴业	1,300	102,492.00	0.06
381	300296	利亚德	13,100	102,442.00	0.06
382	300070	碧水源	13,907	101,660.17	0.06
383	600535	天士力	6,862	101,626.22	0.06
384	600369	西南证券	20,792	101,257.04	0.06
385	002739	万达电影	6,400	101,056.00	0.06
386	600848	上海临港	5,640	100,956.00	0.06
387	300024	机器人	9,396	100,255.32	0.06
388	002670	国盛金控	8,800	100,232.00	0.06
389	600498	烽火通信	5,345	99,577.35	0.06
390	600155	华创阳安	9,300	99,510.00	0.06
391	600390	五矿资本	16,600	99,268.00	0.05

392	002500	山西证券	14,772	99,120.12	0.05
393	300251	光线传媒	9,114	98,522.34	0.05
394	000878	云南铜业	7,600	97,508.00	0.05
395	600909	华安证券	17,420	97,029.40	0.05
396	600008	首创环保	32,235	97,027.35	0.05
397	000581	威孚高科	4,644	96,734.52	0.05
398	603858	步长制药	4,300	96,707.00	0.05
399	600497	驰宏锌锗	22,400	96,544.00	0.05
400	600233	圆通速递	9,600	96,096.00	0.05
401	600536	中国软件	1,686	95,983.98	0.05
402	002221	东华能源	8,714	95,418.30	0.05
403	600208	新湖中宝	31,387	95,416.48	0.05
404	002373	千方科技	5,700	95,190.00	0.05
405	002019	亿帆医药	5,500	94,875.00	0.05
406	002926	华西证券	9,800	94,374.00	0.05
407	603707	健友股份	2,260	94,355.00	0.05
408	601319	中国人保	15,800	93,694.00	0.05
409	600808	马钢股份	21,800	93,522.00	0.05
410	300168	万达信息	6,400	93,440.00	0.05
411	600380	健康元	6,800	93,364.00	0.05
412	600801	华新水泥	5,243	92,119.51	0.05
413	000997	新大陆	5,528	91,709.52	0.05
414	600875	东方电气	8,300	91,051.00	0.05
415	000656	金科股份	15,671	90,735.09	0.05
416	300271	华宇软件	4,700	90,475.00	0.05
417	600170	上海建工	32,496	89,688.96	0.05
418	002268	卫士通	4,600	89,608.00	0.05
419	601238	广汽集团	6,900	89,355.00	0.05
420	002032	苏泊尔	1,400	89,306.00	0.05
421	300058	蓝色光标	14,751	89,243.55	0.05
422	002958	青农商行	20,600	88,168.00	0.05
423	600160	巨化股份	9,969	88,125.96	0.05
424	603338	浙江鼎力	1,500	88,035.00	0.05
425	688008	澜起科技	1,409	87,893.42	0.05
426	000686	东北证券	10,382	87,727.90	0.05
427	600998	九州通	5,700	87,609.00	0.05
428	300315	掌趣科技	20,500	87,125.00	0.05
429	000415	渤海租赁	35,400	85,668.00	0.05
430	300017	网宿科技	14,595	85,380.75	0.05

431	600482	中国动力	4,890	85,183.80	0.05
432	600325	华发股份	12,636	85,166.64	0.05
433	600667	太极实业	9,300	84,630.00	0.05
434	002174	游族网络	4,900	84,133.00	0.05
435	000401	冀东水泥	6,799	83,967.65	0.05
436	000999	华润三九	3,124	83,567.00	0.05
437	601636	旗滨集团	4,500	83,520.00	0.05
438	600150	中国船舶	5,000	82,550.00	0.05
439	601231	环旭电子	4,900	82,369.00	0.05
440	600216	浙江医药	5,109	81,795.09	0.05
441	600027	华电国际	23,700	81,528.00	0.05
442	600256	广汇能源	24,348	81,078.84	0.04
443	600755	厦门国贸	9,840	80,786.40	0.04
444	002281	光迅科技	3,282	80,737.20	0.04
445	000961	中南建设	13,575	80,364.00	0.04
446	300630	普利制药	1,531	80,224.40	0.04
447	300037	新宙邦	800	80,080.00	0.04
448	000060	中金岭南	17,704	80,022.08	0.04
449	600528	中铁工业	9,876	79,995.60	0.04
450	002056	横店东磁	6,136	79,768.00	0.04
451	600567	山鹰国际	23,100	79,695.00	0.04
452	002429	兆驰股份	13,100	79,517.00	0.04
453	002384	东山精密	3,800	79,192.00	0.04
454	600580	卧龙电驱	5,948	79,108.40	0.04
455	300166	东方国信	6,400	79,104.00	0.04
456	600511	国药股份	2,385	78,848.10	0.04
457	002081	金螳螂	9,942	78,740.64	0.04
458	300212	易华录	2,920	78,577.20	0.04
459	002153	石基信息	3,342	78,570.42	0.04
460	600839	四川长虹	27,000	78,570.00	0.04
461	002242	九阳股份	2,417	78,528.33	0.04
462	000158	常山北明	6,800	78,132.00	0.04
463	002939	长城证券	7,000	77,910.00	0.04
464	002203	海亮股份	7,300	77,672.00	0.04
465	002831	裕同科技	2,600	77,194.00	0.04
466	600728	佳都科技	10,400	77,064.00	0.04
467	000078	海王生物	23,600	76,936.00	0.04
468	000800	一汽解放	7,100	76,822.00	0.04
469	300182	捷成股份	15,300	76,347.00	0.04

470	000709	河钢股份	30,847	75,883.62	0.04
471	000028	国药一致	2,000	75,680.00	0.04
472	002625	光启技术	3,600	74,916.00	0.04
473	603883	老百姓	1,420	74,805.60	0.04
474	603866	桃李面包	2,380	74,256.00	0.04
475	600820	隧道股份	13,900	73,531.00	0.04
476	601127	小康股份	1,100	73,337.00	0.04
477	600598	北大荒	4,900	73,304.00	0.04
478	000729	燕京啤酒	10,100	73,124.00	0.04
479	002004	华邦健康	11,747	72,948.87	0.04
480	603000	人民网	4,230	72,713.70	0.04
481	000062	深圳华强	4,300	72,713.00	0.04
482	002146	荣盛发展	12,874	72,609.36	0.04
483	600037	歌华有线	7,500	72,075.00	0.04
484	688099	晶晨股份	641	71,920.20	0.04
485	000629	攀钢钒钛	31,300	71,677.00	0.04
486	300002	神州泰岳	14,635	70,979.75	0.04
487	002382	蓝帆医疗	3,400	70,890.00	0.04
488	601077	渝农商行	17,500	69,825.00	0.04
489	600282	南钢股份	19,500	69,420.00	0.04
490	688002	睿创微纳	694	69,282.02	0.04
491	000598	兴蓉环境	13,195	68,745.95	0.04
492	002938	鹏鼎控股	1,900	68,172.00	0.04
493	600597	光明乳业	4,712	67,899.92	0.04
494	600446	金证股份	4,700	67,868.00	0.04
495	600021	上海电力	9,814	67,814.74	0.04
496	600881	亚泰集团	23,731	67,633.35	0.04
497	600959	江苏有线	21,960	66,978.00	0.04
498	000690	宝新能源	12,961	66,230.71	0.04
499	600811	东方集团	21,708	66,209.40	0.04
500	002396	星网锐捷	3,100	66,185.00	0.04
501	000031	大悦城	18,300	65,880.00	0.04
502	002387	维信诺	6,300	65,709.00	0.04
503	601992	金隅集团	24,400	65,636.00	0.04
504	002065	东华软件	8,272	65,596.96	0.04
505	002558	巨人网络	4,900	65,170.00	0.04
506	000778	新兴铸管	17,482	65,033.04	0.04
507	600967	内蒙一机	6,368	64,444.16	0.04
508	600026	中远海能	10,438	64,298.08	0.04

509	601118	海南橡胶	12,600	64,134.00	0.04
510	000877	天山股份	4,892	63,742.76	0.04
511	600410	华胜天成	8,196	63,600.96	0.04
512	600718	东软集团	6,459	63,169.02	0.03
513	000671	阳光城	12,032	62,566.40	0.03
514	000970	中科三环	6,510	62,170.50	0.03
515	002110	三钢闽光	9,200	62,008.00	0.03
516	601179	中国西电	15,000	61,800.00	0.03
517	600167	联美控股	6,900	61,617.00	0.03
518	600572	康恩贝	13,867	61,569.48	0.03
519	603888	新华网	2,900	61,393.00	0.03
520	600340	华夏幸福	11,649	61,040.76	0.03
521	600064	南京高科	6,494	60,329.26	0.03
522	000156	华数传媒	7,800	60,138.00	0.03
523	002124	天邦股份	8,540	59,865.40	0.03
524	300676	华大基因	500	59,300.00	0.03
525	001914	招商积余	3,300	56,694.00	0.03
526	300026	红日药业	13,300	56,525.00	0.03
527	002233	塔牌集团	5,413	55,645.64	0.03
528	002085	万丰奥威	9,800	54,880.00	0.03
529	300133	华策影视	9,265	54,848.80	0.03
530	601975	招商南油	25,200	53,928.00	0.03
531	000061	农产品	9,600	52,992.00	0.03
532	600260	凯乐科技	5,966	52,978.08	0.03
533	600126	杭钢股份	10,300	52,839.00	0.03
534	603228	景旺电子	2,000	52,400.00	0.03
535	600804	鹏博士	10,712	51,846.08	0.03
536	000090	天健集团	9,307	51,467.71	0.03
537	000046	泛海控股	22,200	51,060.00	0.03
538	002368	太极股份	2,545	51,052.70	0.03
539	002773	康弘药业	2,200	50,886.00	0.03
540	600673	东阳光	11,253	50,525.97	0.03
541	603737	三棵树	280	49,280.00	0.03
542	601098	中南传媒	5,400	47,628.00	0.03
543	688009	中国通号	8,294	47,192.86	0.03
544	600872	中炬高新	1,100	46,222.00	0.03
545	002399	海普瑞	2,901	46,212.93	0.03
546	002458	益生股份	4,600	45,862.00	0.03
547	600094	大名城	11,800	44,486.00	0.02

548	000708	中信特钢	2,100	43,764.00	0.02
549	000681	视觉中国	3,300	42,669.00	0.02
550	002317	众生药业	4,782	41,173.02	0.02
551	300113	顺网科技	3,100	40,114.00	0.02
552	002468	申通快递	4,900	37,338.00	0.02
553	603392	万泰生物	140	36,285.20	0.02
554	688088	虹软科技	630	35,122.50	0.02
555	601866	中远海发	8,600	32,250.00	0.02
556	600563	法拉电子	200	31,672.00	0.02
557	601990	南京证券	3,000	31,560.00	0.02
558	603983	丸美股份	600	31,266.00	0.02
559	300010	豆神教育	5,400	30,618.00	0.02
560	688321	微芯生物	638	29,469.22	0.02
561	600717	天津港	7,282	28,545.44	0.02
562	601717	郑煤机	2,100	24,423.00	0.01
563	601615	明阳智能	1,500	24,285.00	0.01
564	601872	招商轮船	5,160	23,839.20	0.01
565	600737	中粮糖业	2,200	22,022.00	0.01
566	603868	飞科电器	500	21,030.00	0.01
567	601236	红塔证券	1,500	20,340.00	0.01
568	603195	公牛集团	100	20,200.00	0.01
569	600970	中材国际	2,100	19,257.00	0.01
570	601577	长沙银行	2,100	18,774.00	0.01
571	603638	艾迪精密	420	18,005.40	0.01
572	601456	国联证券	1,100	16,940.00	0.01
573	600918	中泰证券	1,500	16,230.00	0.01

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	6,861	425,519.22	0.24
2	300496	中科创达	2,000	314,120.00	0.17
3	300012	华测检测	9,800	312,424.00	0.17
4	300862	蓝盾光电	7,343	266,257.18	0.15
5	688630	芯碁微装	3,397	225,866.53	0.12
6	688059	华锐精密	1,249	201,604.94	0.11
7	688076	诺泰生物	3,084	198,239.52	0.11
8	600298	安琪酵母	3,568	194,027.84	0.11

9	601966	玲珑轮胎	3,600	157,464.00	0.09
10	688689	银河微电	3,989	143,105.53	0.08
11	002920	德赛西威	1,300	143,104.00	0.08
12	600674	川投能源	9,818	121,055.94	0.07
13	601018	宁波港	29,451	116,331.45	0.06
14	688628	优利德	3,419	112,022.79	0.06
15	000301	东方盛虹	5,000	104,500.00	0.06
16	688575	亚辉龙	2,359	98,275.94	0.05
17	600004	白云机场	7,700	86,086.00	0.05
18	600297	广汇汽车	29,600	85,248.00	0.05
19	688662	富信科技	2,556	85,063.68	0.05
20	688639	华恒生物	1,847	81,914.45	0.05
21	600583	海油工程	16,248	73,116.00	0.04
22	600977	中国电影	5,800	72,674.00	0.04
23	300919	中伟股份	445	72,535.00	0.04
24	600273	嘉化能源	7,500	65,250.00	0.04
25	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.04
26	002807	江阴银行	16,100	63,434.00	0.04
27	688655	迅捷兴	3,083	59,501.90	0.03
28	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
29	688499	利元亨	1,389	53,962.65	0.03
30	000627	天茂集团	14,700	53,214.00	0.03
31	603345	安井食品	200	50,804.00	0.03
32	002217	合力泰	13,900	49,623.00	0.03
33	300894	火星人	728	49,504.00	0.03
34	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.03
35	688633	星球石墨	908	48,232.96	0.03
36	688109	品茗股份	664	47,881.04	0.03
37	603816	顾家家居	600	46,368.00	0.03
38	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
39	688087	英科再生	1,753	38,495.88	0.02
40	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.02
41	301015	百洋医药	462	25,322.22	0.01
42	300979	华利集团	213	22,435.29	0.01
43	300932	三友联众	592	18,811.40	0.01
44	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
45	301013	利和兴	471	16,640.43	0.01
46	300614	百川畅银	329	16,321.69	0.01
47	300925	法本信息	600	15,774.00	0.01

48	301002	崧盛股份	201	15,340.32	0.01
49	301009	可靠股份	477	14,891.94	0.01
50	000008	神州高铁	6,200	13,764.00	0.01
51	300933	中辰股份	1,312	13,725.28	0.01
52	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
53	300940	南极光	307	13,308.45	0.01
54	300937	药易购	244	13,093.04	0.01
55	688317	之江生物	200	12,990.00	0.01
56	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
57	300996	普联软件	241	12,194.60	0.01
58	301016	雷尔伟	275	11,294.25	0.01
59	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
60	300987	川网传媒	301	10,462.76	0.01
61	300978	东箭科技	593	9,944.61	0.01
62	300993	玉马遮阳	410	9,524.30	0.01
63	300986	志特新材	245	9,121.35	0.01
64	301004	嘉益股份	312	9,026.16	0.00
65	300948	冠中生态	324	8,874.36	0.00
66	300991	创益通	254	8,671.56	0.00
67	300950	德固特	219	8,567.28	0.00
68	300975	商络电子	492	8,398.44	0.00
69	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
70	300952	恒辉安防	298	8,066.86	0.00
71	300926	博俊科技	359	7,955.44	0.00
72	300930	屹通新材	322	7,879.34	0.00
73	301011	华立科技	175	7,703.50	0.00
74	300927	江天化学	217	6,527.36	0.00
75	300995	奇德新材	191	5,502.71	0.00
76	301012	扬电科技	170	5,460.40	0.00
77	300992	泰福泵业	200	5,378.00	0.00
78	301010	晶雪节能	218	4,928.98	0.00
79	300985	致远新能	177	4,830.33	0.00
80	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
81	605377	华旺科技	140	2,161.60	0.00
82	600267	海正药业	17	255.85	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	601318	中国平安	1,542,310.00	0.53
2	600519	贵州茅台	1,423,293.00	0.49
3	000333	美的集团	1,371,461.88	0.47
4	601816	京沪高铁	962,107.00	0.33
5	000858	五粮液	910,487.00	0.31
6	600036	招商银行	845,654.00	0.29
7	000001	平安银行	720,254.00	0.25
8	603501	韦尔股份	635,708.00	0.22
9	600276	恒瑞医药	627,589.00	0.22
10	688111	金山办公	604,344.63	0.21
11	300450	先导智能	530,892.00	0.18
12	000651	格力电器	513,034.00	0.18
13	002049	紫光国微	507,922.00	0.17
14	000799	酒鬼酒	500,949.00	0.17
15	601166	兴业银行	472,592.00	0.16
16	601888	中国中免	457,660.00	0.16
17	600887	伊利股份	438,328.00	0.15
18	002415	海康威视	421,570.00	0.14
19	603806	福斯特	417,411.00	0.14
20	600030	中信证券	387,468.00	0.13

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	6,855,480.70	2.35
2	600519	贵州茅台	6,446,165.52	2.21
3	000858	五粮液	4,539,782.00	1.56
4	600036	招商银行	3,627,735.00	1.24
5	600276	恒瑞医药	3,199,144.60	1.10
6	000333	美的集团	3,084,317.26	1.06
7	000651	格力电器	2,286,779.00	0.78
8	600887	伊利股份	2,275,694.00	0.78
9	601888	中国中免	2,199,187.00	0.75
10	600030	中信证券	2,011,665.00	0.69

11	300059	东方财富	2,009,420.00	0.69
12	601012	隆基股份	2,007,033.60	0.69
13	601166	兴业银行	1,937,725.00	0.66
14	002594	比亚迪	1,769,863.00	0.61
15	002415	海康威视	1,678,051.00	0.58
16	002475	立讯精密	1,537,413.00	0.53
17	603288	海天味业	1,471,414.00	0.50
18	000001	平安银行	1,468,192.00	0.50
19	000002	万科 A	1,438,255.00	0.49
20	000568	泸州老窖	1,430,406.00	0.49

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	51,626,892.93
卖出股票收入（成交）总额	178,348,460.90

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）	119,442.59	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	119,442.59	0.07

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	870	87,000.00	0.05
2	127036	三花转债	111	14,539.89	0.01

3	113616	韦尔转债	50	7,740.00	0.00
4	113611	福 20 转债	30	5,162.70	0.00
5	113049	长汽转债	50	5,000.00	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。

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

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

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	71,991.27

2	应收证券清算款	449,756.70
3	应收股利	-
4	应收利息	1,040.52
5	应收申购款	11,557.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	534,346.34

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113611	福 20 转债	5,162.70	0.00

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中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	688630	芯碁微装	225,866.53	0.12	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
6,242	16,312.53	47,164,968.14	46.32%	54,657,834.33	53.68%

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	中国工商银行股份有限公司企业年金计划— 中国建设银行股份有限公司	3,728,891.00	8.10%
2	王飞舟	1,677,417.00	3.64%
3	靳宁卿	980,000.00	2.13%
4	纪伟才	938,029.00	2.04%
5	于成福	932,390.00	2.03%
6	于君	711,529.00	1.55%
7	李坚	500,000.00	1.09%
8	于延年	499,916.00	1.09%
9	符王莹月	466,006.00	1.01%
10	陈雁金	466,006.00	1.01%

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	6.73	0.0000%

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 (2015 年 5 月 22 日) 基金份额总额	542,268,490.78
本报告期期初基金份额总额	172,510,529.46
本报告期基金总申购份额	22,862,949.35
减:本报告期基金总赎回份额	93,550,676.34
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	101,822,802.47

§ 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

本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动情况。

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

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
中金证券	1	108,405,882.95	48.31%	100,959.18	48.31%	-

兴业证券	1	87,593,400.40	39.04%	81,576.16	39.04%	-
东兴证券	1	13,976,171.26	6.23%	13,016.23	6.23%	-
海通证券	1	8,858,554.38	3.95%	8,249.23	3.95%	-
华泰证券	1	5,560,330.83	2.48%	5,178.30	2.48%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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
中金证券	8,149.80	2.26%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	248,534.00	69.04%	-	-	-	-
华泰证券	103,293.46	28.69%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时为本公司提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚,信誉良好。

(3) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范,最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要,并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向,并提供相关研究报告;

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定;

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后,按照研究服务评价规定,对研究机构进行综合评价;

(4) 试用期满后,评价结果符合条件,双方认为有必要继续合作,经公司领导审批后,我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》,并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用;

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价,若本公司认为签约机构的服务不能满足要求,或签约机构违规受到国家有关部门的处罚,本公司有权终止签署的协议,并撤销租用的交易单元;

(6) 交易单元租用协议期限为一年,到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况:无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况: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	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (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 30 日
2	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要 (更	本公司网站、中国证监会基金信息披露	2021 年 6 月 30 日

	新)	网站	
3	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
4	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
5	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
6	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
7	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (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
8	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
9	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
10	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (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
11	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (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 3 月 30 日
12	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (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 3 月 30 日
13	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (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 3 月 30 日
14	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (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 3 月 30 日
15	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
16	长盛基金管理有限公司关于旗下	上海证券报、本公司	2021 年 3 月 18 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	网站、中国证监会基金信息披露网站	
17	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（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

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	20210101~20210125	42,071,810.69	0.00	42,071,810.69	0.00	0.00%
	2	20210126~20210630	21,873,067.38	0.00	0.00	21,873,067.38	21.48%
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、长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 相关批准文件；
- 2、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 4、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

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