

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

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>55</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	62
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	62
8.7 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.....	63

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	63
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	63
8.12 投资组合报告附注 .....	63
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	65
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4 基金投资策略的改变 .....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	68
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>74</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>75</b>
13.1 备查文件目录 .....	75
13.2 存放地点 .....	75
13.3 查阅方式 .....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	长盛同益成长回报混合（LOF）
场内简称	长盛同益 LOF
基金主代码	160812
交易代码	160812
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 4 月 4 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	67,717,532.42 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 6 月 4 日

### 2.2 基金产品说明

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

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	郭明
	联系电话	010-86497608	010-66105799
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666 010-86497888	95588
传真		010-86497999	010-66105798
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼10D	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心3-5层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100029	100140
法定代表人		高民和	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	78,215,976.25	53,848,805.69	13,144,187.67
本期利润	-5,375,123.20	129,449,060.49	48,274,035.85
加权平均基金份额本期利润	-0.0589	1.0857	0.4131
本期加权平均净值利润率	-2.22%	52.45%	29.29%
本期基金份额净值增长率	-1.59%	67.83%	32.70%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	112,034,179.42	137,797,316.09	83,217,328.29
期末可供分配基金份额利润	1.6544	1.2830	0.6079
期末基金资产净值	179,706,594.03	289,707,029.30	220,012,907.10
期末基金份额净值	2.654	2.697	1.607
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	163.25%	167.51%	59.40%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

4、本基金由同益证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 4 月 4 日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.47%	0.86%	1.44%	0.39%	2.03%	0.47%
过去六个月	-3.98%	1.07%	-1.16%	0.51%	-2.82%	0.56%
过去一年	-1.59%	1.25%	0.30%	0.59%	-1.89%	0.66%
过去三年	119.16%	1.32%	38.57%	0.64%	80.59%	0.68%
过去五年	87.69%	1.14%	38.56%	0.59%	49.13%	0.55%
自基金转型日起至今	163.25%	1.38%	91.51%	0.73%	71.74%	0.65%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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

基准指数的构建考虑了三个原则：

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

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

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

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

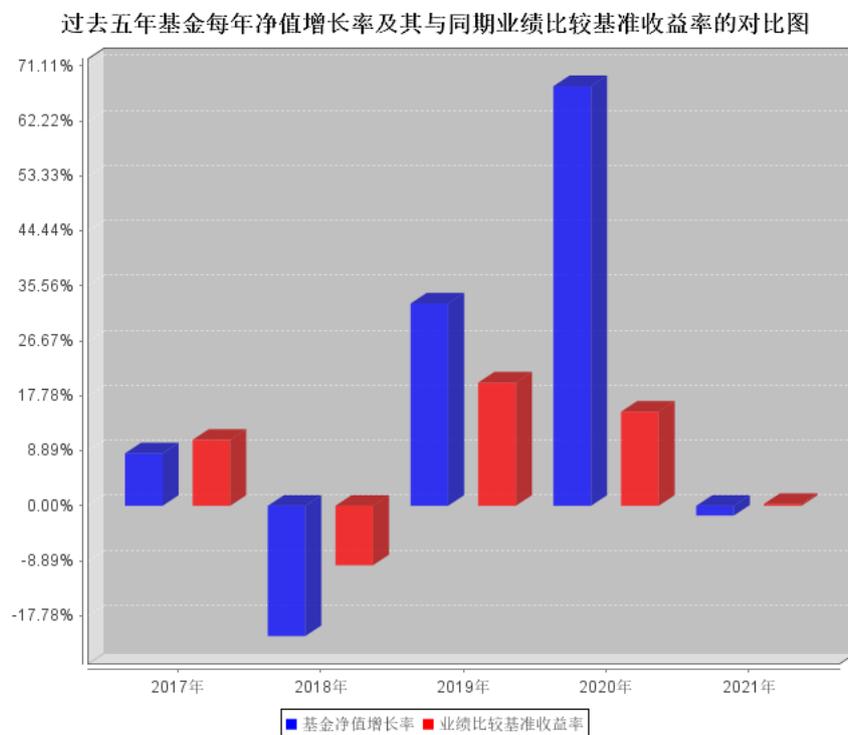
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

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

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内首批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%，安徽省信用融资担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基金的投资顾问。截至 2021 年 12 月 31 日，基金管理人共管理六十八只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

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

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

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

注：本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

## 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公司公平交易细则》，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。具体如下：

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

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

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

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司对管理的不同投资组合过去 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原则及利益输送的行为。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年，分子端企业盈利大幅改善，分母端货币宽松但信用收缩，整体估值难以扩张，市场呈现宽幅区间震荡的结构性行情，行业轮动较快。年初，在基本面向好与新发基金热情较高等因素共同作用下，市场延续了去年四季度的上行趋势，机构重仓蓝筹股表现较好，同时，市场整体估值也升至较高水平。春节之后，海外、国内通胀预期升温导致国债收益率快速上行，引发市场对机构重仓股高估值可持续的担忧，部分资金调仓布局低估值板块，机构重仓股出现较大调整。二季度后，随着一季报企业盈利高增长的确立，叠加宏观流动性改善，市场打开阶段上行窗口，周期、消费、新能源、TMT 轮动上涨。从全年的角度，新能源产业链的爆发与能耗双控下传统周期品价格大幅上涨构成两条投资主线，阶段性半导体、元宇宙带动的 TMT 板块活跃以及年底稳增长预期大幅提升带动地产基建产业链修复。

报告期内，组合仓位根据市场情况动态调整，整体维持中高仓位。行业风格方面，出于稳健的考虑，整体行业风格保持均衡，以部分优质的低估值蓝筹个股作为底仓，同时在新能源、TMT、医药等成长行业积极挖掘投资机会。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.654 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.59%，业绩比较基准收益率为 0.30%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，中国经济大概率将进入去库存周期，经济内生下行压力较大，但政策稳增长对冲力度也将加大，预计全年 GDP 增速大致在 5.5% 左右。结构上，出口优势仍有望维持，但增速或将从近两年的高增长回归至低个位数的常态；投资方面房地产投资上半年压力仍在，下半年或有所缓解；制造业投资更多是结构性的改善；基建投资将适度发力，增速或较前两年有所提升；消费受收入与疫情防控制约，短期内完全恢复至疫情前的水平仍有难度。政策方面，货币政策整体保持偏宽松基调，一季度存在政策调整的窗口期，后期受海外流动性收紧与通胀上行的掣肘，货币进一步宽松的可能性降低。信用端，上半年信用温和扩张相对确定，下半年取决稳增长力度的持续性。

市场方面，2022 年，分子端企业盈利将处在下行周期的后半场，预计全 A 非金融企业盈利至少将回落至二季度，分母端稳增长预期下，以社融为代表的信用端会有所扩张，但相对温和，同时当前 A 股整体估值水平处在历史均值附近，难言高性价比。风险偏好方面，海外美联储收紧仍有可能阶段性对风险偏好形成扰动。整体上，估值下行风险大于上行风险，市场仍将呈现宽幅震荡的结构性行情。板块与行业层面，新能源预计仍将保持较快的增速，但高预期与高交易拥挤度并存，个股选择需要综合基本面与估值水平；数字经济浪潮下，部分估值合理的 TMT 细分领域或存在结构性机会；医药板块 2021 年受到政策扰动、原材料涨价等不利影响波动较大，但老龄化中长期趋势无法改变，医药行业整体盈利仍有保障，特别是基于全球比较优势下中国高端医药制造业与医改政策下国产替代产业链以及创新药产业链。消费板块盈利相对稳定，但仍有可能受到居民收入放缓与疫情防控的扰动。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人遵循合规运作、保护基金投资者利益的原则，结合监管要求、市场形势及自身业务发展需要，由独立于业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产的运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时督促相关部门改进，并定期制作检查报告报送公司管理层。具体工作情况如下：

1、加强合规宣导与培训，持续推动公司合规文化建设。报告期内，监察稽核部通过外请专业机构、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种形式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，及时组织学习法律法规与监管文件，深化员工合规理念，提升员工合规工作技能。

2、持续完善公司制度规章体系建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时督促、提示业务部门进行相关制度、流程的新订、修订与完善，保证公司制度规章的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司除完成有关制度的新订、修订工作外，还要求业务部门就制度、流程变化内容与其他相关执行部门进行沟通，确保各相关部门对新订、修订内容的理解保持一致，保证制度、流程被严格执行。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》的规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待，防范非公平交易和利益输送。

4、加强专项稽核与检查力度，完善发现问题与改进情况的跟踪、落实机制，保障公司运营及

受托资产投资运作合规。报告期内，公司监察稽核部开展定期、临时专项稽核，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、产品开发、员工行为等。此外，根据业务发展需要、监管机构通报的业内问题，以及公司在日常监督中发现的问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，合理保障公司及受托资产合规、稳健运作。

5、参与新产品设计、新业务、新流程的合规论证工作，提供合规意见或建议，确保依法合规开展相关业务。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保护基金投资者的利益为宗旨，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至 2021 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 112,034,179.42 元，其中：未分配利润已实现部分为 140,030,598.26 元，未分配利润未实现部分为-27,996,418.84 元。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 60468688_A06 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关

	<p>的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）不能持续经营。</p>

	<p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	王海彦
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2022 年 3 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	25,510,896.71	35,414,140.61
结算备付金		1,961,376.34	179,959.91
存出保证金		57,859.62	15,198.85
交易性金融资产	7.4.7.2	155,211,373.88	255,838,396.68
其中：股票投资		154,410,873.88	255,689,468.90
基金投资		-	-
债券投资		800,500.00	148,927.78
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	507,610.47
应收利息	7.4.7.5	2,993.70	3,580.32
应收股利		-	-
应收申购款		2,916.65	1,013.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		182,747,416.90	291,959,900.66
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		897,354.03	-
应付赎回款		98,743.05	67,321.57
应付管理人报酬		231,781.96	347,480.97
应付托管费		38,630.34	57,913.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	240,145.75	126,106.41
应交税费		815,700.59	815,700.03
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	718,467.15	838,348.89
负债合计		3,040,822.87	2,252,871.36
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	67,672,414.61	107,329,403.82
未分配利润	7.4.7.10	112,034,179.42	182,377,625.48
所有者权益合计		179,706,594.03	289,707,029.30
负债和所有者权益总计		182,747,416.90	291,959,900.66

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.654 元，基金份额总额 67,717,532.42 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		1,035,869.66	134,668,513.28
1. 利息收入		132,565.04	169,055.90
其中：存款利息收入	7.4.7.11	132,253.69	168,933.95
债券利息收入		311.35	121.95
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）		84,347,563.64	58,821,066.54
其中：股票投资收益	7.4.7.12	81,838,948.92	56,523,029.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	356,262.06	103,064.52
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,152,352.66	2,194,972.84
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-83,591,099.45	75,600,254.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	146,840.43	78,136.04
<b>减：二、费用</b>		6,410,992.86	5,219,452.79
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,651,828.08	3,692,121.40
2. 托管费	7.4.10.2.2	608,638.02	615,353.55
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	1,872,545.41	634,057.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.35	0.42
7. 其他费用	7.4.7.20	277,981.00	277,920.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,375,123.20	129,449,060.49
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-5,375,123.20	129,449,060.49

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	107,329,403.82	182,377,625.48	289,707,029.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,375,123.20	-5,375,123.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-39,656,989.21	-64,968,322.86	-104,625,312.07
其中：1. 基金申购款	4,298,921.58	7,059,309.16	11,358,230.74
2. 基金赎回款	-43,955,910.79	-72,027,632.02	-115,983,542.81
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）	67,672,414.61	112,034,179.42	179,706,594.03
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	136,795,578.81	83,217,328.29	220,012,907.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	129,449,060.49	129,449,060.49
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）	-29,466,174.99	-30,288,763.30	-59,754,938.29
其中：1. 基金申购款	975,604.07	1,034,174.72	2,009,778.79
2. 基金赎回款	-30,441,779.06	-31,322,938.02	-61,764,717.08
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）	107,329,403.82	182,377,625.48	289,707,029.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

根据《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》、《关于同益证

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

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

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额

入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，若事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；场内基金份额的收益分配方式为现金分红，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及注册登记机构的相关规定；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 投资者的现金红利保留到小数点后第 2 位，由此产生的收益或损失由基金资产承担；

(6) 当日申购的基金份额自申购确认日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自赎回确认日起，不享有基金的分配权益；

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

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

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

##### 7.4.6.2 增值税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服

务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

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

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

#### 7.4.6.3 企业所得税

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

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

#### 7.4.6.4 个人所得税

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

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	25,510,896.71	35,414,140.61
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：	25,510,896.71	35,414,140.61

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	144,190,227.13	154,410,873.88	10,220,646.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	800,500.00	800,500.00
	银行间市场	-	-
	合计	800,500.00	800,500.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	144,990,727.13	155,211,373.88	10,220,646.75
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	161,909,550.48	255,689,468.90	93,779,918.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	117,100.00	148,927.78
	银行间市场	-	-
	合计	117,100.00	148,927.78
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	162,026,650.48	255,838,396.68	93,811,746.20

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	2,276.10	3,477.38
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	653.26	81.00
应收债券利息	38.34	15.14
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	26.00	6.80
合计	2,993.70	3,580.32

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021年12月31日	2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	240,145.75	126,106.41
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	240,145.75	126,106.41

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021年12月31日	2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	555,208.31	555,208.31
应付赎回费	371.98	253.72
应付证券出借违约金	-	-
其他	93,886.86	93,886.86
预提费用	69,000.00	189,000.00
合计	718,467.15	838,348.89

## 7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	107,403,943.99	107,329,403.82
本期申购	4,301,833.03	4,298,921.58
本期赎回（以“-”号填列）	-43,988,244.60	-43,955,910.79
- 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	67,717,532.42	67,672,414.61

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	137,797,316.09	44,580,309.39	182,377,625.48
本期利润	78,215,976.25	-83,591,099.45	-5,375,123.20

本期基金份额交易产生的变动数	-75,982,694.08	11,014,371.22	-64,968,322.86
其中：基金申购款	8,305,490.10	-1,246,180.94	7,059,309.16
基金赎回款	-84,288,184.18	12,260,552.16	-72,027,632.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	140,030,598.26	-27,996,418.84	112,034,179.42

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	123,429.60	166,347.93
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	58.19
结算备付金利息收入	8,029.07	1,975.73
其他	795.02	552.10
合计	132,253.69	168,933.95

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	642,953,784.20	210,123,132.34
减：卖出股票成本总额	561,114,835.28	153,600,103.16
买卖股票差价收入	81,838,948.92	56,523,029.18

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021	2020年1月1日至2020年

	年12月31日	12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	356,262.06	103,064.52
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	356,262.06	103,064.52

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,832,253.16	346,074.73
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,475,700.00	242,900.00
减：应收利息总额	291.10	110.21
买卖债券差价收入	356,262.06	103,064.52

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,152,352.66	2,194,972.84
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	2,152,352.66	2,194,972.84

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-83,591,099.45	75,600,254.80
——股票投资	-83,559,271.67	75,568,427.02
——债券投资	-31,827.78	31,827.78
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-83,591,099.45	75,600,254.80

#### 7.4.7.18 其他收入

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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	146,610.56	77,933.99
基金转换费收入	229.87	202.05
合计	146,840.43	78,136.04

#### 7.4.7.19 交易费用

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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,872,545.41	634,057.42
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	1,872,545.41	634,057.42

#### 7.4.7.20 其他费用

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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行费用	781.00	720.00
账户维护费用	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	277,981.00	277,920.00

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用融资担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司
长盛基金（香港）有限公司	基金管理人子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	116,438,259.81	9.94%	133,785,467.84	38.67%

#### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	-	-	173,900.00	24.63%

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31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	108,438.20	9.94%	108,438.20	45.16%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	124,594.37	38.67%	1,963.37	1.56%

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

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

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,651,828.08	3,692,121.40
其中：支付销售机构的客户维护费	192,302.08	137,588.94

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值（扣除超过规定比例现金后的资产净值）

### 7.4.10.2.2 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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	608,638.02	615,353.55

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

### 7.4.10.4 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

#### 7.4.10.4.1 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。

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

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

份额单位：份

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

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	25,510,896.71	123,429.60	35,414,140.61	166,347.93

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

## 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	10.52	10.52	5,209	54,798.68	54,798.68	-
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	限售期锁定	4.53	4.27	181,851	823,785.03	776,503.77	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 4 日	限售期锁定	38.85	289.29	2,149	83,488.65	621,684.21	-
688778	厦钨新能	2021 年 7 月 29 日	2022 年 2 月 7 日	限售期锁定	24.50	100.48	2,831	69,359.50	284,458.88	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 10 日	限售期锁定	21.96	93.26	2,469	54,219.24	230,258.94	-
688711	宏微科技	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	限售期锁定	27.51	116.48	1,865	51,306.15	217,235.20	-
688112	鼎阳科技	2021 年 11 月 24 日	2022 年 6 月 1 日	限售期锁定	46.60	92.65	2,328	108,484.80	215,689.20	-
688798	艾为电子	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 16 日	限售期锁定	76.58	210.74	816	62,489.28	171,963.84	-
688786	悦安新材	2021 年 8 月 18 日	2022 年 2 月 28 日	限售期锁定	11.76	53.97	1,513	17,792.88	81,656.61	-
688091	上海谊众	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	限售期锁定	38.10	42.80	1,548	58,978.80	66,254.40	-
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月	限售期锁	14.14	89.74	462	6,532.68	41,459.88	-

		日	24日	定							
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	限售期锁定	60.64	234.57	114	6,912.96	26,740.98	-	
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	限售期锁定	5.17	44.15	539	2,786.63	23,796.85	-	
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	限售期锁定	8.29	26.02	782	6,482.78	20,347.64	-	
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	限售期锁定	22.04	56.23	352	7,758.08	19,792.96	-	
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	限售期锁定	11.90	45.42	420	4,998.00	19,076.40	-	
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	限售期锁定	4.17	30.91	587	2,447.79	18,144.17	-	
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	限售期锁定	10.48	43.93	379	3,971.92	16,649.47	-	
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	限售期锁定	12.20	28.34	585	7,137.00	16,578.90	-	
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	限售期锁定	10.07	19.07	842	8,478.94	16,056.94	-	
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	限售期锁定	11.88	25.59	578	6,866.64	14,791.02	-	
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	限售期锁定	6.96	12.44	1,184	8,240.64	14,728.96	-	
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	限售期锁定	8.34	48.96	290	2,418.60	14,198.40	-	
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	限售期锁定	8.86	23.76	555	4,917.30	13,186.80	-	
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	限售期锁定	13.00	23.25	557	7,241.00	12,950.25	-	
301020	密封	2021年	2022	限售	10.64	30.38	421	4,479.44	12,789.98	-	

	科技	6月28日	2021年1月6日	限售期锁定							
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	限售期锁定	19.11	69.92	182	3,478.02	12,725.44		-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	限售期锁定	18.03	62.64	203	3,660.09	12,715.92		-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	限售期锁定	12.03	19.21	636	7,651.08	12,217.56		-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	限售期锁定	116.88	122.05	99	11,571.12	12,082.95		-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	限售期锁定	9.46	41.39	290	2,743.40	12,003.10		-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	限售期锁定	26.91	50.43	234	6,296.94	11,800.62		-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	限售期锁定	5.77	15.34	756	4,362.12	11,597.04		-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	限售期锁定	4.13	12.95	843	3,481.59	10,916.85		-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	限售期锁定	12.37	21.35	510	6,308.70	10,888.50		-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	限售期锁定	26.17	53.55	200	5,234.00	10,710.00		-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	限售期锁定	25.80	35.13	300	7,740.00	10,539.00		-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	限售期锁定	5.31	13.49	733	3,892.23	9,888.17		-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	限售期锁定	14.33	34.23	286	4,098.38	9,789.78		-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	限售期锁定	4.57	20.90	444	2,029.08	9,279.60		-

301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	限售期锁定	13.57	38.41	241	3,270.37	9,256.81	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	限售期锁定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	限售期锁定	1.55	20.84	403	624.65	8,398.52	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	限售期锁定	69.89	90.93	92	6,429.88	8,365.56	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	限售期锁定	21.76	34.24	239	5,200.64	8,183.36	-
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	限售期锁定	12.36	26.38	307	3,794.52	8,098.66	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	限售期锁定	39.08	54.86	145	5,666.60	7,954.70	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	限售期锁定	10.45	12.19	651	6,802.95	7,935.69	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	限售期锁定	8.40	23.80	328	2,755.20	7,806.40	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	限售期锁定	6.90	21.69	355	2,449.50	7,699.95	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	限售期锁定	27.81	34.57	214	5,951.34	7,397.98	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	限售期锁定	12.95	18.33	400	5,180.00	7,332.00	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	限售期锁定	93.09	75.43	92	8,564.28	6,939.56	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	限售期锁定	27.12	33.34	201	5,451.12	6,701.34	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月	限售期锁	29.28	33.50	197	5,768.16	6,599.50	-

		日	7日	定						
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	限售期锁定	36.50	31.42	206	7,519.00	6,472.52	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	限售期锁定	15.14	59.93	108	1,635.12	6,472.44	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	限售期锁定	19.34	32.88	196	3,790.64	6,444.48	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	限售期锁定	4.97	12.49	513	2,549.61	6,407.37	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	限售期锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	限售期锁定	66.18	57.13	111	7,345.98	6,341.43	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	限售期锁定	9.08	15.23	416	3,777.28	6,335.68	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	限售期锁定	23.38	29.80	205	4,792.90	6,109.00	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	限售期锁定	7.31	28.18	215	1,571.65	6,058.70	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	限售期锁定	7.46	33.38	181	1,350.26	6,041.78	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	限售期锁定	30.73	30.08	189	5,807.97	5,685.12	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	限售期锁定	27.85	28.36	200	5,570.00	5,672.00	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	限售期锁定	43.99	52.42	107	4,706.93	5,608.94	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	限售期锁定	9.96	27.28	203	2,021.88	5,537.84	-
301063	海锅	2021年	2022	限售	17.40	36.13	153	2,662.20	5,527.89	-

	股份	9月9日	年3月24日	期锁定						
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	限售期锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	限售期锁定	8.09	19.29	259	2,095.31	4,996.11	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	限售期锁定	79.60	80.15	61	4,855.60	4,889.15	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	限售期锁定	11.45	16.61	286	3,274.70	4,750.46	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	限售期锁定	58.08	50.21	94	5,459.52	4,719.74	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	限售期锁定	57.27	56.01	84	4,810.68	4,704.84	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	限售期锁定	14.82	24.17	193	2,860.26	4,664.81	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	限售期锁定	12.24	32.06	144	1,762.56	4,616.64	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	限售期锁定	36.31	35.50	130	4,720.30	4,615.00	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	限售期锁定	33.16	24.99	180	5,968.80	4,498.20	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	限售期锁定	8.03	19.01	218	1,750.54	4,144.18	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	限售期锁定	13.98	28.36	144	2,013.12	4,083.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	限售期锁定	11.92	29.17	140	1,668.80	4,083.80	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021年12月28日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	3,530	353,000.00	353,000.00	-
113052	兴业转债	2021年12月29日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	1,580	158,000.00	158,000.00	-
113634	珀莱转债	2021年12月9日	2022年1月4日	新债未上市	100.00	100.00	250	25,000.00	25,000.00	-
123133	佩蒂转债	2021年12月22日	2022年1月21日	新债未上市	100.00	100.00	2,645	264,500.00	264,500.00	-

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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，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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.45%（2020 年 12 月 31 日：0.05%）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式

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

本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易。因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	25,510,896.71	-	-	-	25,510,896.71

结算备付金	1,961,376.34	-	-	-	1,961,376.34
存出保证金	57,859.62	-	-	-	57,859.62
交易性金融资产	-	-	800,500.00	154,410,873.88	155,211,373.88
应收利息	-	-	-	2,993.70	2,993.70
应收申购款	-	-	-	2,916.65	2,916.65
资产总计	27,530,132.67	-	800,500.00	154,416,784.23	182,747,416.90
负债					
应付证券清算款	-	-	-	897,354.03	897,354.03
应付赎回款	-	-	-	98,743.05	98,743.05
应付管理人报酬	-	-	-	231,781.96	231,781.96
应付托管费	-	-	-	38,630.34	38,630.34
应付交易费用	-	-	-	240,145.75	240,145.75
应交税费	-	-	-	815,700.59	815,700.59
其他负债	-	-	-	718,467.15	718,467.15
负债总计	-	-	-	3,040,822.87	3,040,822.87
利率敏感度缺口	27,530,132.67	-	800,500.00	151,375,961.36	179,706,594.03
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	35,414,140.61	-	-	-	35,414,140.61
结算备付金	179,959.91	-	-	-	179,959.91
存出保证金	15,198.85	-	-	-	15,198.85
交易性金融资产	-	-	148,927.78	255,689,468.90	255,838,396.68
应收证券清算款	-	-	-	507,610.47	507,610.47
应收利息	-	-	-	3,580.32	3,580.32
应收申购款	-	-	-	1,013.82	1,013.82
资产总计	35,609,299.37	-	148,927.78	256,201,673.51	291,959,900.66
负债					

应付赎回款	-	-	-	67,321.57	67,321.57
应付管理人报酬	-	-	-	347,480.97	347,480.97
应付托管费	-	-	-	57,913.49	57,913.49
应付交易费用	-	-	-	126,106.41	126,106.41
应交税费	-	-	-	815,700.03	815,700.03
其他负债	-	-	-	838,348.89	838,348.89
负债总计	-	-	-	2,252,871.36	2,252,871.36
利率敏感度缺口	35,609,299.37	-	148,927.78	253,948,802.15	289,707,029.30

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	154,410,873.88	85.92	255,689,468.90	88.26
合计	154,410,873.88	85.92	255,689,468.90	88.26

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合在过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	+5%	17,398,248.08	29,147,486.50
	-5%	-17,398,248.08	-29,147,486.50

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

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

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 150,957,648.65 元，属于第二层次的余额为人民币 860,803.17 元，属于第三层次的余额为人民币 3,392,922.06 元（2020 年 12 月 31 日：第一层次的余额为人民币 252,966,482.76 元，第二层次的余额为人民币 2,871,913.92 元，无属于第三层次的余额）。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### (3) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三

层次公允价值为人民币 3,392,922.06 元，期初余额为人民币 0 元，本期增加人民币 3,392,922.06 元（2020 年：无）。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	154,410,873.88	84.49
	其中：股票	154,410,873.88	84.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	800,500.00	0.44
	其中：债券	800,500.00	0.44
	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	27,472,273.05	15.03
8	其他各项资产	63,769.97	0.03
9	合计	182,747,416.90	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,917,860.00	1.62
B	采矿业	-	-
C	制造业	113,259,754.71	63.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,303,798.00	2.39
E	建筑业	1,749,343.06	0.97
F	批发和零售业	66,252.09	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	1,980,297.00	1.10
H	住宿和餐饮业	4,616.64	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,708,649.29	4.85
J	金融业	11,730,695.68	6.53
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	4,393,955.24	2.45
N	水利、环境和公共设施管理业	33,479.48	0.02

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,144.17	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,244,028.52	2.92
S	综合	-	-
	合计	154,410,873.88	85.92

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	603596	伯特利	80,200	5,581,920.00	3.11
2	002241	歌尔股份	100,400	5,431,640.00	3.02
3	300413	芒果超媒	91,500	5,235,630.00	2.91
4	000977	浪潮信息	143,100	5,127,273.00	2.85
5	002475	立讯精密	97,798	4,811,661.60	2.68
6	300115	长盈精密	239,680	4,755,251.20	2.65
7	300750	宁德时代	7,200	4,233,600.00	2.36
8	002036	联创电子	169,800	4,119,348.00	2.29
9	603259	药明康德	33,800	4,008,004.00	2.23
10	002557	洽洽食品	59,700	3,663,192.00	2.04
11	300122	智飞生物	29,000	3,613,400.00	2.01
12	603606	东方电缆	69,300	3,545,388.00	1.97
13	300274	阳光电源	23,300	3,397,140.00	1.89
14	300363	博腾股份	37,700	3,372,265.00	1.88
15	300850	新强联	18,830	3,361,343.30	1.87
16	002709	天赐材料	28,420	3,258,353.00	1.81
17	300760	迈瑞医疗	8,200	3,122,560.00	1.74
18	601728	中国电信	674,751	2,910,760.77	1.62
19	603345	安井食品	16,800	2,869,104.00	1.60
20	601166	兴业银行	146,500	2,789,360.00	1.55
21	600801	华新水泥	144,300	2,784,990.00	1.55
22	600276	恒瑞医药	53,100	2,692,701.00	1.50
23	600900	长江电力	118,200	2,683,140.00	1.49
24	300059	东方财富	70,300	2,608,833.00	1.45
25	600809	山西汾酒	8,100	2,557,818.00	1.42

26	600036	招商银行	51,300	2,498,823.00	1.39
27	688005	容百科技	21,416	2,475,261.28	1.38
28	603187	海容冷链	45,960	2,180,802.00	1.21
29	600570	恒生电子	33,400	2,075,810.00	1.16
30	300726	宏达电子	20,500	2,051,230.00	1.14
31	002271	东方雨虹	38,200	2,012,376.00	1.12
32	002824	和胜股份	43,700	1,982,669.00	1.10
33	601111	中国国航	216,900	1,980,297.00	1.10
34	603690	至纯科技	40,800	1,964,520.00	1.09
35	300633	开立医疗	61,100	1,950,923.00	1.09
36	300673	佩蒂股份	93,100	1,906,688.00	1.06
37	300383	光环新网	128,300	1,903,972.00	1.06
38	601939	建设银行	322,300	1,888,678.00	1.05
39	601318	中国平安	37,200	1,875,252.00	1.04
40	605499	东鹏饮料	10,300	1,872,952.00	1.04
41	300973	立高食品	13,748	1,815,835.84	1.01
42	600406	国电南瑞	44,700	1,789,341.00	1.00
43	300502	新易盛	44,900	1,759,182.00	0.98
44	002714	牧原股份	32,800	1,750,208.00	0.97
45	688299	长阳科技	53,210	1,739,967.00	0.97
46	601669	中国电建	214,700	1,734,776.00	0.97
47	000739	普洛药业	47,100	1,652,739.00	0.92
48	600132	重庆啤酒	10,900	1,649,388.00	0.92
49	600905	三峡能源	215,800	1,620,658.00	0.90
50	600703	三安光电	36,300	1,363,428.00	0.76
51	688082	盛美上海	9,919	1,267,648.20	0.71
52	600426	华鲁恒升	39,600	1,239,480.00	0.69
53	600438	通威股份	26,700	1,200,432.00	0.67
54	000998	隆平高科	50,200	1,167,652.00	0.65
55	002675	东诚药业	70,081	1,105,878.18	0.62
56	688012	中微公司	8,299	1,050,653.40	0.58
57	688050	爱博医疗	4,908	1,031,808.84	0.57
58	600660	福耀玻璃	21,200	999,368.00	0.56
59	000301	东方盛虹	39,600	765,864.00	0.43
60	688696	极米科技	1,371	756,792.00	0.42
61	688499	利元亨	2,149	621,684.21	0.35
62	688778	厦钨新能	2,831	284,458.88	0.16
63	301050	雷电微力	1,131	274,695.75	0.15
64	688087	英科再生	2,469	230,258.94	0.13

65	688711	宏微科技	1,865	217,235.20	0.12
66	688112	鼎阳科技	2,328	215,689.20	0.12
67	688621	阳光诺和	1,485	180,576.00	0.10
68	688798	艾为电子	816	171,963.84	0.10
69	002436	兴森科技	8,500	119,000.00	0.07
70	603127	昭衍新药	900	103,887.00	0.06
71	688151	华强科技	2,447	88,777.16	0.05
72	688786	悦安新材	1,513	81,656.61	0.05
73	301055	张小泉	3,541	80,149.59	0.04
74	600019	宝钢股份	9,900	70,884.00	0.04
75	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.04
76	688091	上海谊众	1,548	66,254.40	0.04
77	688553	汇宇制药	1,785	60,029.55	0.03
78	301136	招标股份	5,209	54,798.68	0.03
79	301029	怡合达	462	41,459.88	0.02
80	603517	绝味食品	420	28,698.60	0.02
81	002460	赣锋锂业	200	28,570.00	0.02
82	301069	凯盛新材	539	23,796.85	0.01
83	300994	久祺股份	495	22,647.90	0.01
84	301018	申菱环境	782	20,347.64	0.01
85	301035	润丰股份	352	19,792.96	0.01
86	301060	兰卫医学	587	18,144.17	0.01
87	301111	粤万年青	379	16,649.47	0.01
88	301180	万祥科技	585	16,578.90	0.01
89	301149	隆华新材	842	16,056.94	0.01
90	301185	鸥玛软件	578	14,791.02	0.01
91	301039	中集车辆	1,184	14,728.96	0.01
92	301046	能辉科技	290	14,198.40	0.01
93	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.01
94	301017	漱玉平民	555	13,186.80	0.01
95	301188	力诺特玻	557	12,950.25	0.01
96	301020	密封科技	421	12,789.98	0.01
97	301089	拓新药业	182	12,725.44	0.01
98	301026	浩通科技	203	12,715.92	0.01
99	301189	奥尼电子	210	12,283.41	0.01
100	301127	天源环保	636	12,217.56	0.01
101	301177	迪阿股份	99	12,082.95	0.01
102	301021	英诺激光	290	12,003.10	0.01
103	301101	明月镜片	234	11,800.62	0.01

104	301078	孩子王	756	11,597.04	0.01
105	300814	中富电路	480	11,566.88	0.01
106	688265	南模生物	157	10,997.85	0.01
107	301048	金鹰重工	843	10,916.85	0.01
108	301126	达嘉维康	510	10,888.50	0.01
109	301138	华研精机	200	10,710.00	0.01
110	301211	亨迪药业	300	10,539.00	0.01
111	301028	东亚机械	733	9,888.17	0.01
112	301098	金埔园林	369	9,853.26	0.01
113	301133	金钟股份	286	9,789.78	0.01
114	300774	倍杰特	444	9,279.60	0.01
115	301040	中环海陆	241	9,256.81	0.01
116	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
117	301190	善水科技	293	8,480.60	0.00
118	301025	读客文化	403	8,398.52	0.00
119	301221	光庭信息	92	8,365.56	0.00
120	301198	喜悦智行	239	8,183.36	0.00
121	301168	通灵股份	145	7,954.70	0.00
122	301090	华润材料	651	7,935.69	0.00
123	301100	风光股份	214	7,397.98	0.00
124	301081	严牌股份	400	7,332.00	0.00
125	301087	可孚医疗	92	6,939.56	0.00
126	301182	凯旺科技	201	6,701.34	0.00
127	301199	迈赫股份	197	6,599.50	0.00
128	301091	深城交	206	6,472.52	0.00
129	301033	迈普医学	108	6,472.44	0.00
130	301049	超越科技	196	6,444.48	0.00
131	301032	新柴股份	513	6,407.37	0.00
132	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
133	301083	百胜智能	416	6,335.68	0.00
134	301036	双乐股份	205	6,109.00	0.00
135	301041	金百泽	215	6,058.70	0.00
136	301072	中捷精工	181	6,041.78	0.00
137	301193	家联科技	189	5,685.12	0.00
138	301179	泽宇智能	107	5,608.94	0.00
139	300854	中兰环保	203	5,537.84	0.00
140	301063	海锅股份	153	5,527.89	0.00
141	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
142	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00

143	301059	金三江	259	4,996.11	0.00
144	301096	百诚医药	61	4,889.15	0.00
145	301027	华蓝集团	286	4,750.46	0.00
146	301093	华兰股份	94	4,719.74	0.00
147	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
148	301108	洁雅股份	84	4,704.84	0.00
149	301037	保立佳	193	4,664.81	0.00
150	301073	君亭酒店	144	4,616.64	0.00
151	301092	争光股份	130	4,615.00	0.00
152	301088	戎美股份	180	4,498.20	0.00
153	301057	汇隆新材	218	4,144.18	0.00
154	301068	大地海洋	144	4,083.84	0.00
155	301079	邵阳液压	140	4,083.80	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603187	海容冷链	9,371,735.60	3.23
2	000661	长春高新	9,095,711.00	3.14
3	603259	药明康德	8,016,602.00	2.77
4	300973	立高食品	7,905,688.20	2.73
5	603345	安井食品	7,396,807.76	2.55
6	601939	建设银行	7,123,035.00	2.46
7	003012	东鹏控股	7,071,700.00	2.44
8	300347	泰格医药	6,979,109.00	2.41
9	002709	天赐材料	6,973,194.56	2.41
10	300450	先导智能	6,842,984.00	2.36
11	603596	伯特利	6,575,308.00	2.27
12	002791	坚朗五金	6,377,853.00	2.20
13	688299	长阳科技	6,376,568.39	2.20
14	002847	盐津铺子	6,319,819.00	2.18
15	300760	迈瑞医疗	6,260,127.50	2.16
16	688396	华润微	6,239,106.31	2.15
17	300363	博腾股份	6,191,803.00	2.14

18	601233	桐昆股份	6,169,198.16	2.13
19	600926	杭州银行	6,117,652.00	2.11
20	600176	中国巨石	5,937,346.00	2.05
21	002078	太阳纸业	5,929,258.00	2.05
22	300059	东方财富	5,893,149.64	2.03
23	600809	山西汾酒	5,837,703.00	2.02
24	000651	格力电器	5,798,886.00	2.00

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	18,737,283.00	6.47
2	300347	泰格医药	14,384,800.80	4.97
3	000858	五粮液	12,549,423.00	4.33
4	002460	赣锋锂业	10,819,143.00	3.73
5	002475	立讯精密	10,750,269.00	3.71
6	000001	平安银行	10,498,417.00	3.62
7	603517	绝味食品	9,399,379.00	3.24
8	300122	智飞生物	9,154,840.75	3.16
9	000568	泸州老窖	8,900,708.84	3.07
10	601888	中国中免	8,836,576.00	3.05
11	603833	欧派家居	8,531,406.89	2.94
12	000333	美的集团	8,220,377.55	2.84
13	603345	安井食品	7,861,219.00	2.71
14	601166	兴业银行	7,701,146.00	2.66
15	000651	格力电器	7,563,084.00	2.61
16	601939	建设银行	7,490,420.00	2.59
17	688396	华润微	7,279,641.39	2.51
18	603187	海容冷链	7,195,571.40	2.48
19	300308	中际旭创	7,048,156.00	2.43
20	002847	盐津铺子	6,820,108.00	2.35
21	002508	老板电器	6,749,776.00	2.33
22	000661	长春高新	6,686,325.00	2.31
23	300450	先导智能	6,430,258.00	2.22
24	300059	东方财富	6,349,231.22	2.19
25	002179	中航光电	6,339,738.00	2.19

26	300124	汇川技术	6,204,299.00	2.14
27	603986	兆易创新	6,059,510.00	2.09
28	600887	伊利股份	5,941,208.00	2.05
29	002436	兴森科技	5,933,430.00	2.05
30	603678	火炬电子	5,921,081.00	2.04
31	002709	天赐材料	5,851,548.02	2.02
32	600115	中国东航	5,810,402.00	2.01
33	600570	恒生电子	5,809,435.62	2.01

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	543,395,511.93
卖出股票收入（成交）总额	642,953,784.20

注：本项中 8.4.1, 8.4.2, 8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	800,500.00	0.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	800,500.00	0.45

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	5,110	511,000.00	0.28
2	123133	佩蒂转债	2,645	264,500.00	0.15

3	113634	珀莱转债	250	25,000.00	0.01
---	--------	------	-----	-----------	------

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 只债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

#### 8.12.2 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

本基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	57,859.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	2,993.70
5	应收申购款	2,916.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,769.97

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券（可交换债券）。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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
8,051	8,411.07	66,031.00	0.10%	67,651,501.42	99.90%

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	何继军	2,250,000.00	3.50%
2	俞河会	1,651,355.00	2.57%
3	周嘉宁	1,260,000.00	1.96%
4	张启	1,000,000.00	1.56%
5	黄良珍	712,600.00	1.11%
6	竺爱琴	700,041.00	1.09%
7	张琳	600,493.00	0.93%
8	刘晓娟	600,000.00	0.93%
9	包力	560,989.00	0.87%
10	蔡景玲	518,863.00	0.81%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	143,169.39	0.2114%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2014年4月4日）基金份额总额	2,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	107,403,943.99
本报告期基金总申购份额	4,301,833.03
减:本报告期基金总赎回份额	43,988,244.60
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	67,717,532.42

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

2021 年 6 月 6 日，根据我公司第八届董事会第一次会议决议，会议选举高民和先生担任公司董事长，周兵先生不再担任公司董事长；根据第八届董事会第二次会议决议，同意聘任周兵先生为公司总经理，林培富先生不再担任公司总经理，聘任郭堃同志为公司副总经理，王宁先生不再担任公司副总经理职务。

2021 年 7 月 12 日，根据公司第八届董事会第三次会议决议，聘任吴达同志为公司副总经理。

#### 11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 11.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

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

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期内应支付该会计师事务所的报酬为 60,000.00 元。已连续为本基金服务 23 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
浙商证券	1	491,093,075.49	41.93%	457,352.74	41.93%	-
银河证券	1	266,314,967.23	22.74%	248,020.63	22.74%	-
中信建投	1	149,994,434.67	12.81%	139,689.92	12.81%	-
平安证券	1	119,296,312.53	10.18%	111,101.29	10.18%	-
国元证券	2	116,438,259.81	9.94%	108,438.20	9.94%	-
华安证券	1	28,193,900.08	2.41%	26,257.11	2.41%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
浙商证券	1,631,725.90	89.06%	-	-	-	-
银河证券	43,766.40	2.39%	-	-	-	-
中信建投	156,760.86	8.56%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

华安证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

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：无。

## 11.8 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瑞银证券有限责任公司终止办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 12 月 22 日
2	长盛基金管理有限公司关于工商银行快捷支付渠道升级上线的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 11 月 26 日
3	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 10 月 27 日
4	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2021 年 第 3 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 10 月 27 日
5	长盛基金管理有限公司关于暂停使用工行快捷服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 10 月 26 日
6	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加意才基金为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	中国证监会指定披露媒介	2021 年 10 月 12 日
7	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 28 日
8	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2021 年中期报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 28 日
9	长盛基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 21 日

10	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 10 日
11	长盛基金管理有限公司高级管理人员副总经理变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 27 日
12	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 26 日
13	长盛基金管理有限公司高级管理人员董事长变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 22 日
14	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2021 年第 2 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 21 日
15	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 21 日
16	长盛基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 17 日
17	长盛基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司销售旗下部分基金并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 13 日
18	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	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 29 日
19	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 18 日

20	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	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 10 日
21	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 3 日
22	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 3 日
23	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 3 日
24	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 3 日
25	关于旗下由中国工商银行股份有限公司托管的 7 只公募基金引入侧袋机制并修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 3 日
26	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	中国证监会指定披露媒介	2021 年 4 月 22 日
27	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 4 月 22 日
28	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	中国证监会指定披露媒介	2021 年 3 月 31 日
29	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2020 年	中国证监会指定披露媒介	2021 年 3 月 31 日

	年度报告		
30	长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 1 月 22 日
31	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 1 月 22 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 相关批准文件；
- 2、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/或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

2022 年 3 月 31 日