

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF） 2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 27 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 2022 年 08 月 26 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 2022 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产 (基金净值) 变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	58

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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末上市基金前十名持有人	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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情况	61
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 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
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	75,803,614.44 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 8 月 6 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%以内,以实现中证 800 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性,通过抽样方式构建基金股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%,且年化跟踪误差小于 4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×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	高民和	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,279,493.12
本期利润	-13,295,716.82
加权平均基金份额本期利润	-0.1555
本期加权平均净值利润率	-9.60%
本期基金份额净值增长率	-8.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	46,845,205.45
期末可供分配基金份额利润	0.6180
期末基金资产净值	127,823,959.73
期末基金份额净值	1.686
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	22.87%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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，转型日期为 2015 年 5 月 22 日（即基金合同生效日）。

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	9.34%	0.99%	8.55%	1.00%	0.79%	-0.01%
过去三个月	6.51%	1.38%	4.98%	1.40%	1.53%	-0.02%
过去六个月	-8.07%	1.38%	-9.41%	1.39%	1.34%	-0.01%
过去一年	-5.12%	1.15%	-11.45%	1.16%	6.33%	-0.01%
过去三年	56.89%	1.18%	19.67%	1.19%	37.22%	-0.01%
自基金转型起至今	22.87%	1.46%	-13.30%	1.40%	36.17%	0.06%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

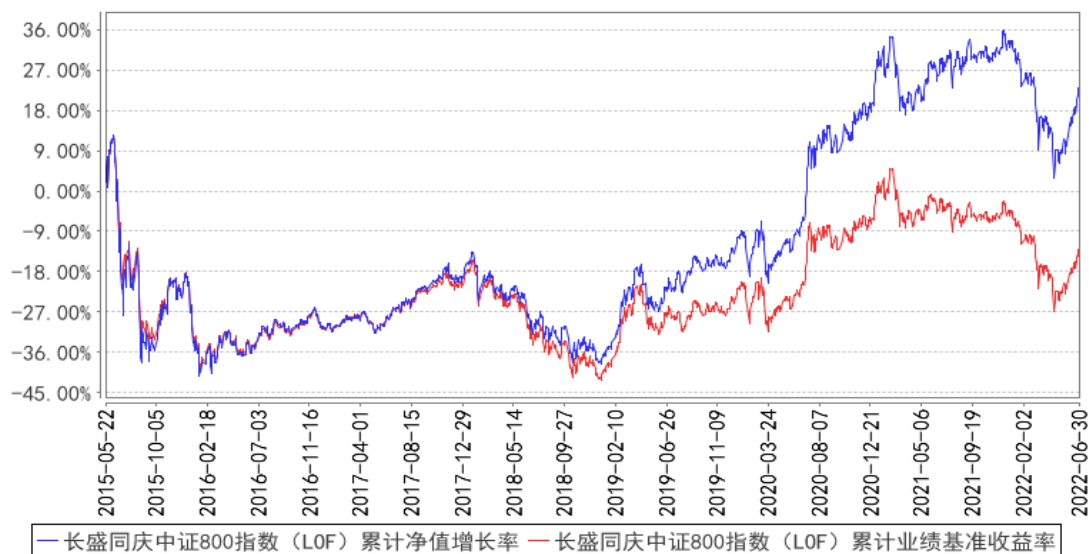
本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率（税后）}$

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

长盛同庆中证800指数 (LOF) 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，转型日期为 2015 年 5 月 22 日（即基金合同生效日）。

2、按基金合同规定，本基金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 2022 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十只开放式基金，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		
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，长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛信息安全量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2019 年 5 月 30 日	-	13 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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金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

2022 年上半年,股市和经济增长总体呈现先下再上的 V 型走势,波动较为剧烈。首先受到国内经济下行压力增大、有效信用扩张不及预期以及美国高通胀带来的美元持续升息的预期影响,A 股市场在一季度经历了较大幅度的下行,投资者明显转向红利价值类的风格股票避险。二季度初又受到国内疫情的反复和国际地缘冲突的突发影响,A 股整体进一步急剧下挫。随着市场潜在杠杆的出清和国内迅捷有力的货币政策支持下,社会融资见底反弹,流动性得到充分补充,低利率叠加下跌后的较低估值,使得 A 股市场的风险溢价率显现较好的吸引力,出现一轮快速反弹。进入二季度中期,疫情得到显著有效的控制,经济增长预期得到修复,进一步激发了投资者对于成长板块的偏好,使得反弹有力的持续到季度末。而随着上游大宗商品的高位回调,国内中游制造

业的成本压力缓解,重拾产业链竞争力,并促进了出口大幅回升,使得 A 股市场和国内经济的运行在一定程度下重回常态。

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 1.686 元,本报告期基金份额净值增长率为-8.07%,同期业绩比较基准收益率为-9.41%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0124%,年度化跟踪误差为 1.2392%。

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 年下半年,预计国内货币政策将继续保持对企业的积极的支持力度,财政政策将进一步敦促上半年各个项目的落地和实施,以期给实体经济带来新的增长点和长效的增长预期。此外随着疫情对经济的影响逐步消退,居民消费水平和基建开工活动有望从低点逐步恢复至常态水平,同时给 A 股的消费行业和基建相关行业带来一定机会。地产产业链经历多重冲击后,行业存在进一步出清并提高集中度的可能性,有望重拾供给侧改革的投资逻辑。此外,我们需要看到国内的社会融资结构中,企业部门的中长期贷款增长仍然较为疲软,经济自发扩张动能尚且不足。国际地缘政治冲突虽然暂未进一步发酵,大宗原材料价格有一定回调,但 CPI 向 PPI 靠拢在全球普遍发生,亦在国内有抬头之势,对国内的进一步大幅宽松政策实施形成掣肘,成长股的反弹也步入下半场。下半年呈现以业绩修复为主逻辑的结构性行情的概率更高,同时对股市的预期收益率也需要更加理性一些。

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、公司业务运营部分管领导、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对基金利润分配原则的约定，本基金于本报告期内未进行利润分配。

本基金截至 2022 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 46,845,205.45 元，其中，未分配利润已实现部分为 135,078,166.68 元，未分配利润未实现部分为-88,232,961.23 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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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: 2022 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	6,208,176.31	9,746,598.73
结算备付金		-	-
存出保证金		2,586.71	7,315.96
交易性金融资产	6.4.7.2	123,185,993.95	147,883,040.05
其中: 股票投资		120,954,786.22	147,655,774.45
基金投资		-	-
债券投资		2,231,207.73	227,265.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		284,873.89	6,376.46
应收股利		-	-
应收申购款		22,214.52	11,081.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	967.46
资产总计		129,703,845.38	157,655,380.56
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		512,108.45	64,969.10

应付管理人报酬		110,651.24	132,503.91
应付托管费		24,343.27	29,150.84
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,232,782.69	1,171,495.97
负债合计		1,879,885.65	1,398,119.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	80,978,754.28	91,030,200.54
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	46,845,205.45	65,227,060.20
净资产合计		127,823,959.73	156,257,260.74
负债和净资产总计		129,703,845.38	157,655,380.56

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.686 元，基金份额总额 75,803,614.44 份。

2、以下比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-12,366,360.52	22,437,038.49
1. 利息收入		16,285.78	22,299.30
其中：存款利息收入	6.4.7.9	16,285.78	22,255.21
债券利息收入		-	44.09
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)		3,187,826.94	58,649,291.87
其中: 股票投资收益	6.4.7.10	1,817,931.85	57,408,695.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	64,687.19	35,227.65
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,305,207.90	1,205,369.04
以摊余成本计量的金		-	-
融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.15	-15,575,209.94	-36,420,653.54
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.16	4,736.70	186,100.86
减: 二、营业总支出		929,356.30	1,654,313.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	688,122.66	908,003.10
2. 托管费	6.4.10.2.2	151,386.97	199,760.66
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支		-	-
出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		0.05	0.10
8. 其他费用	6.4.7.17	89,846.62	546,549.35
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-13,295,716.82	20,782,725.28
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-13,295,716.82	20,782,725.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-13,295,716.82	20,782,725.28

注: 以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示: 2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	91,030,200.54	-	65,227,060.20	156,257,260.74
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	91,030,200.54	-	65,227,060.20	156,257,260.74
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,051,446.26	-	-18,381,854.75	-28,433,301.01
（一）、综合收益总额	-	-	-13,295,716.82	-13,295,716.82
（二）、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）	-10,051,446.26	-	-5,086,137.93	-15,137,584.19
其中：1. 基金申购款	2,852,492.23	-	1,510,780.49	4,363,272.72
2. 基金赎回款	-12,903,938.49	-	-6,596,918.42	-19,500,856.91
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	80,978,754.28	-	46,845,205.45	127,823,959.73
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	184,245,536.60	-	107,479,115.14	291,724,651.74
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	184,245,536.60	-	107,479,115.14	291,724,651.74
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-75,474,131.79	-	-35,338,682.23	-110,812,814.02
(一)、综合收益总额	-	-	20,782,725.28	20,782,725.28
(二)、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
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	108,771,404.81	-	72,140,432.91	180,911,837.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

周兵

刁俊东

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是由原长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。根据原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》,原基金分级运作期为三年,分级运作期届满后转为上市开放式基金(LOF)。根据深圳证券交易所深证上[2015]205 号《终止上市同意书》,原基金于 2015 年 5 月 20 日进行基金份额权益登记,于 2015 年 5 月 21 日终止上市。自 2015 年 5 月 22 日起,原基金分级运作期届满自动转为上市开放式基金(LOF),并更名为长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)。经向中国证监会备案,《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)》于 2015 年 5 月 22 日正式生效,

本基金为契约型开放式，存续期间不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

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

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》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。除下述会计政策外,本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产

主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期

信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

按直线法计算。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募基金证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定, 本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额, 2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日, 本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日, 本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款, 金额分别为 9,746,598.73 元、7,315.96 元、967.46 元、6,376.46 元和 11,081.90 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款, 金额分别为 9,747,551.65 元、7,319.26 元、0.00 元、6,376.46 元和 11,081.90 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 147,883,040.05 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产, 金额为 147,883,051.29 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 64,969.10 元、132,503.91 元、29,150.84 元、3,724.80 元和 1,107,771.17 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款, 金额分别为 64,969.10 元、132,503.91 元、29,150.84 元、3,724.80 元和 1,107,771.17 元。

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性

金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日,本基金根据新金融工具准则下的计量类别,将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示,无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	6,208,176.31
等于：本金	6,207,066.27
加：应计利息	1,110.04
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,208,176.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	111,012,720.51	-	120,954,786.22	9,942,065.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	7,842.60	2,231,207.73	6,423.13
	银行间市场	-	-	-
	合计	7,842.60	2,231,207.73	6,423.13
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	113,229,662.51	7,842.60	123,185,993.95	9,948,488.84

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	1,886.62
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	31,669.13
其中：交易所市场	31,669.13
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
其他	609,966.79
合计	1,232,782.69

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日

	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	85,214,541.08	91,030,200.54
本期申购	2,670,170.59	2,852,492.23
本期赎回 (以“-”号填列)	-12,081,097.23	-12,903,938.49
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	75,803,614.44	80,978,754.28

注：1、申购含转换入；赎回含转换出。

2、截至 2022 年 6 月 30 日，本基金于深交所上市的基金份额为 43,420,140.00 份 (2021 年 12 月 31 日：43,850,559.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 32,383,474.44 份 (2021 年 12 月 31 日：41,363,982.08 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。

6.4.7.8 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
本期期初	149,478,041.09	-84,250,980.89	65,227,060.20
本期利润	2,279,493.12	-15,575,209.94	-13,295,716.82
本期基金份额交易产生的变动数	-16,679,367.53	11,593,229.60	-5,086,137.93
其中：基金申购款	4,706,398.37	-3,195,617.88	1,510,780.49
基金赎回款	-21,385,765.90	14,788,847.48	-6,596,918.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	135,078,166.68	-88,232,961.23	46,845,205.45

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	16,213.75
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	44.12
其他	27.91
合计	16,285.78

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,817,931.85
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,817,931.85

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	27,213,643.48
减：卖出股票成本总额	25,324,139.84
减：交易费用	71,571.79
买卖股票差价收入	1,817,931.85

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,887.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	62,799.90
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	64,687.19

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	386,466.18
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	323,600.00
减：应计利息总额	62.44
减：交易费用	3.84
买卖债券差价收入	62,799.90

6.4.7.12 贵金属投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,305,207.90
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	1,305,207.90

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-15,575,209.94
股票投资	-15,572,967.47
债券投资	-2,242.47
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-15,575,209.94

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,723.23
基金转换费收入	13.47
合计	4,736.70

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。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-
银行费用	586.47
合计	89,846.62

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

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	688,122.66	908,003.10
其中：支付销售机构的客户维护费	60,601.61	60,060.84

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
当期发生的基金应支付的托管费		151,386.97		199,760.66

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

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

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

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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

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

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	6,208,176.31	16,213.75	11,728,619.56	21,262.29
合计	6,208,176.31	16,213.75	11,728,619.56	21,262.29

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

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

无。

6.4.12 期末(2022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	受限期	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
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	限售期锁定	10.80	16.16	42,002	453,621.60	678,752.32	-
688306	均普智能	2022年3月15日	6个月	限售期锁定	5.08	5.20	10,675	54,229.00	55,510.00	-
688400	凌云光	2022年6月27日	6个月	限售期锁定	21.93	21.93	2,441	53,531.13	53,531.13	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	限售期锁定	11.40	20.44	433	4,936.20	8,850.52	-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	限售期锁定	17.27	14.82	463	7,996.01	6,861.66	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	限售期锁定	72.69	71.48	91	6,614.79	6,504.68	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	限售期锁定	15.64	20.34	268	4,191.52	5,451.12	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	限售期锁定	64.08	37.50	57	3,652.56	2,137.50	-
688237	超卓航科	2022年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	1,334	55,054.18	55,054.18	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上

市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002670	国盛金控	2022 年 6 月 1 日	重大事项停牌	9.60	2022 年 7 月 14 日	9.99	8,000	78,319.78	76,800.00	-

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

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 2022 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净资产的比例为 0.02% (2021 年 12 月 31 日：0.15%)。

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 2022 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(净资产)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 2022 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 2022 年 6 月 30 日, 本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	6,207,066.27	-	-	1,110.04	6,208,176.31
存出保证金	2,585.63	-	-	1.08	2,586.71
交易性金融资产	2,200,660.00	-	22,705.13	120,962,628.82	123,185,993.95
应收申购款	-	-	-	22,214.52	22,214.52
应收清算款	-	-	-	284,873.89	284,873.89
资产总计	8,410,311.90	-	22,705.13	121,270,828.35	129,703,845.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	512,108.45	512,108.45
应付管理人报酬	-	-	-	110,651.24	110,651.24
应付托管费	-	-	-	24,343.27	24,343.27
其他负债	-	-	-	1,232,782.69	1,232,782.69
负债总计	-	-	-	1,879,885.65	1,879,885.65
利率敏感度缺口	8,410,311.90	-	22,705.13	119,390,942.70	127,823,959.73
上年度末 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	9,746,598.73	-	-	-	9,746,598.73
存出保证金	7,315.96	-	-	-	7,315.96
交易性金融资产	-	-	227,265.60	147,655,774.45	147,883,040.05
应收证券清算款	-	-	-	6,376.46	6,376.46
应收申购款	-	-	-	11,081.90	11,081.90

其他资产	-	-	-	967.46	967.46
资产总计	9,753,914.69	-	227,265.60	147,674,200.27	157,655,380.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	64,969.10	64,969.10
应付管理人报酬	-	-	-	132,503.91	132,503.91
应付托管费	-	-	-	29,150.84	29,150.84
其他负债	-	-	-	1,171,495.97	1,171,495.97
负债总计	-	-	-	1,398,119.82	1,398,119.82
利率敏感度缺口	9,753,914.69	-	227,265.60	146,276,080.45	156,257,260.74

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 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净资产的比例为 1.75% (2021 年 12 月 31 日：0.15%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响 (2021 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 2022年6月30日		上年度末 2021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	120,954,786.22	94.63	147,655,774.45	94.50
合计	120,954,786.22	94.63	147,655,774.45	94.50

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		
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 (2022年6月30日)	上年度末 (2021年12月31日)	
分析	1. 业绩比较基准 (附注 6.4.1) 上升 5%	6,354,685.07	7,957,596.32
	2. 业绩比较基准 (附注 6.4.1) 下降 5%	-6,354,685.07	-7,957,596.32

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日

第一层次	120,028,046.43	146,377,448.54
第二层次	2,393,879.72	245,749.81
第三层次	764,067.80	1,259,841.70
合计	123,185,993.95	147,883,040.05

6.4.14.2.2 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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	120,954,786.22	93.25
	其中：股票	120,954,786.22	93.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,231,207.73	1.72
	其中：债券	2,231,207.73	1.72
	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	6,208,176.31	4.79
8	其他各项资产	309,675.12	0.24
9	合计	129,703,845.38	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,525,766.45	1.19
B	采矿业	3,380,314.75	2.64
C	制造业	69,180,228.33	54.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,766,436.83	2.16
E	建筑业	2,382,236.04	1.86
F	批发和零售业	1,218,431.85	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	2,991,359.10	2.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,633,841.56	3.63
J	金融业	21,262,557.25	16.63
K	房地产业	2,391,696.09	1.87
L	租赁和商务服务业	1,645,602.80	1.29
M	科学研究和技术服务业	1,752,749.82	1.37
N	水利、环境和公共设施管理业	54,741.47	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	50,373.00	0.04
Q	卫生和社会工作	970,930.12	0.76
R	文化、体育和娱乐业	473,634.58	0.37
S	综合	233,906.58	0.18
	合计	116,914,806.62	91.47

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	746,181.52	0.58

C	制造业	2,195,855.26	1.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	117,030.56	0.09
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	45,500.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	229,665.90	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	232,425.19	0.18
J	金融业	254,022.00	0.20
K	房地产业	71,378.80	0.06
L	租赁和商务服务业	32,240.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,110.37	0.00
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	109,570.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	4,039,979.60	3.16

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	3,003	6,141,135.00	4.80
2	300750	宁德时代	6,800	3,631,200.00	2.84
3	600036	招商银行	58,616	2,473,595.20	1.94
4	601318	中国平安	49,218	2,297,988.42	1.80
5	601012	隆基绿能	30,548	2,035,413.24	1.59
6	000858	五粮液	9,098	1,837,159.14	1.44
7	002594	比亚迪	4,284	1,428,671.16	1.12
8	000333	美的集团	22,238	1,342,952.82	1.05
9	601166	兴业银行	65,971	1,312,822.90	1.03
10	300059	东方财富	51,162	1,299,514.80	1.02

11	600900	长江电力	51,620	1,193,454.40	0.93
12	601888	中国中免	4,612	1,074,273.16	0.84
13	603259	药明康德	9,868	1,026,173.32	0.80
14	600030	中信证券	43,924	951,393.84	0.74
15	600887	伊利股份	24,234	943,914.30	0.74
16	002415	海康威视	23,991	868,474.20	0.68
17	000568	泸州老窖	3,434	846,618.36	0.66
18	601398	工商银行	174,512	832,422.24	0.65
19	600809	山西汾酒	2,434	790,563.20	0.62
20	600438	通威股份	13,000	778,180.00	0.61
21	600276	恒瑞医药	20,702	767,837.18	0.60
22	002475	立讯精密	22,652	765,411.08	0.60
23	002714	牧原股份	13,495	745,868.65	0.58
24	000651	格力电器	21,323	719,011.56	0.56
25	000725	京东方 A	174,407	687,163.58	0.54
26	600309	万华化学	7,079	686,592.21	0.54
27	601328	交通银行	136,370	679,122.60	0.53
28	000002	万 科 A	32,554	667,357.00	0.52
29	002466	天齐锂业	5,261	656,572.80	0.51
30	002142	宁波银行	18,266	654,105.46	0.51
31	002129	TCL 中环	11,076	652,265.64	0.51
32	002812	恩捷股份	2,600	651,170.00	0.51
33	000001	平安银行	43,379	649,817.42	0.51
34	601899	紫金矿业	68,427	638,423.91	0.50
35	600048	保利发展	36,324	634,217.04	0.50
36	002460	赣锋锂业	4,100	609,670.00	0.48
37	300015	爱尔眼科	13,556	606,902.12	0.47
38	300760	迈瑞医疗	1,900	595,080.00	0.47
39	603288	海天味业	6,467	584,358.12	0.46
40	300124	汇川技术	8,602	566,613.74	0.44
41	600436	片仔癀	1,545	551,147.85	0.43
42	601668	中国建筑	103,599	551,146.68	0.43
43	002304	洋河股份	2,995	548,534.25	0.43
44	603799	华友钴业	5,707	545,703.34	0.43
45	601088	中国神华	16,196	539,326.80	0.42
46	300498	温氏股份	24,900	530,121.00	0.41
47	300274	阳光电源	5,260	516,795.00	0.40
48	300014	亿纬锂能	5,300	516,750.00	0.40
49	600031	三一重工	27,029	515,172.74	0.40
50	000792	盐湖股份	17,100	512,316.00	0.40
51	600089	特变电工	18,688	511,864.32	0.40
52	600690	海尔智家	18,072	496,257.12	0.39

53	002271	东方雨虹	9,450	486,391.50	0.38
54	002352	顺丰控股	8,500	474,385.00	0.37
55	601816	京沪高铁	93,000	466,860.00	0.37
56	601288	农业银行	152,067	459,242.34	0.36
57	603501	韦尔股份	2,600	449,878.00	0.35
58	603986	兆易创新	3,100	440,851.00	0.34
59	600406	国电南瑞	16,163	436,401.00	0.34
60	600837	海通证券	44,249	434,082.69	0.34
61	600000	浦发银行	53,725	430,337.25	0.34
62	002709	天赐材料	6,880	426,972.80	0.33
63	601225	陕西煤业	19,792	419,194.56	0.33
64	600016	民生银行	110,395	410,669.40	0.32
65	601919	中远海控	29,390	408,521.00	0.32
66	600104	上汽集团	22,566	401,900.46	0.31
67	600585	海螺水泥	11,351	400,463.28	0.31
68	000625	长安汽车	23,098	400,057.36	0.31
69	300122	智飞生物	3,600	399,636.00	0.31
70	601688	华泰证券	27,791	394,632.20	0.31
71	600111	北方稀土	11,083	389,678.28	0.30
72	600919	江苏银行	54,220	386,046.40	0.30
73	601601	中国太保	16,340	384,480.20	0.30
74	002241	歌尔股份	11,354	381,494.40	0.30
75	688981	中芯国际	8,444	381,415.48	0.30
76	002049	紫光国微	2,000	379,440.00	0.30
77	300142	沃森生物	7,800	377,442.00	0.30
78	000661	长春高新	1,568	366,002.56	0.29
79	000063	中兴通讯	14,262	364,108.86	0.28
80	002230	科大讯飞	8,750	360,675.00	0.28
81	601211	国泰君安	23,000	349,600.00	0.27
82	002371	北方华创	1,259	348,894.08	0.27
83	002027	分众传媒	51,800	348,614.00	0.27
84	601988	中国银行	106,238	346,335.88	0.27
85	002459	晶澳科技	4,340	342,426.00	0.27
86	601169	北京银行	75,394	342,288.76	0.27
87	000100	TCL 科技	69,115	331,060.85	0.26
88	601229	上海银行	50,369	329,916.95	0.26
89	600660	福耀玻璃	7,853	328,333.93	0.26
90	300450	先导智能	5,100	322,218.00	0.25
91	688599	天合光能	4,867	317,571.75	0.25
92	600050	中国联通	91,672	317,185.12	0.25
93	601766	中国中车	60,987	317,132.40	0.25
94	601390	中国中铁	51,299	314,975.86	0.25

95	000338	潍柴动力	25,106	313,071.82	0.24
96	601669	中国电建	38,988	306,835.56	0.24
97	600522	中天科技	12,998	300,253.80	0.23
98	300347	泰格医药	2,570	294,136.50	0.23
99	600028	中国石化	67,696	276,199.68	0.22
100	600019	宝钢股份	45,759	275,469.18	0.22
101	601009	南京银行	26,401	275,098.42	0.22
102	601857	中国石油	49,831	264,104.30	0.21
103	600745	闻泰科技	3,100	263,841.00	0.21
104	600999	招商证券	18,300	263,703.00	0.21
105	600893	航发动力	5,726	260,590.26	0.20
106	600958	东方证券	25,340	258,721.40	0.20
107	002410	广联达	4,741	258,100.04	0.20
108	600009	上海机场	4,504	255,376.80	0.20
109	600570	恒生电子	5,728	249,397.12	0.20
110	000776	广发证券	13,286	248,448.20	0.19
111	601818	光大银行	81,196	244,399.96	0.19
112	600010	包钢股份	101,716	239,032.60	0.19
113	601985	中国核电	34,788	238,645.68	0.19
114	600760	中航沈飞	3,940	238,173.00	0.19
115	600196	复星医药	5,374	236,939.66	0.19
116	601628	中国人寿	7,547	234,560.76	0.18
117	603659	璞泰来	2,760	232,944.00	0.18
118	002493	荣盛石化	14,850	228,541.50	0.18
119	600926	杭州银行	15,200	227,696.00	0.18
120	601658	邮储银行	42,226	227,598.14	0.18
121	002050	三花智控	8,278	227,479.44	0.18
122	002179	中航光电	3,584	226,938.88	0.18
123	603806	福斯特	3,440	225,388.80	0.18
124	600256	广汇能源	21,248	223,953.92	0.18
125	002311	海大集团	3,700	222,037.00	0.17
126	601633	长城汽车	5,725	212,054.00	0.17
127	600346	恒力石化	9,500	211,280.00	0.17
128	600460	士兰微	4,061	211,172.00	0.17
129	002074	国轩高科	4,600	209,760.00	0.16
130	300496	中科创达	1,600	208,768.00	0.16
131	601615	明阳智能	6,100	206,180.00	0.16
132	002821	凯莱英	700	202,300.00	0.16
133	600795	国电电力	51,453	201,181.23	0.16
134	300759	康龙化成	2,100	199,962.00	0.16
135	600426	华鲁恒升	6,739	196,778.80	0.15
136	300316	晶盛机电	2,900	196,011.00	0.15

137	603993	洛阳钼业	34,156	195,713.88	0.15
138	600176	中国巨石	11,104	193,320.64	0.15
139	002001	新和成	8,460	192,972.60	0.15
140	002920	德赛西威	1,300	192,400.00	0.15
141	001979	招商蛇口	14,236	191,189.48	0.15
142	000768	中航西飞	6,291	190,554.39	0.15
143	000166	申万宏源	44,151	189,407.79	0.15
144	601989	中国重工	50,926	188,935.46	0.15
145	000895	双汇发展	6,437	188,604.10	0.15
146	002202	金风科技	12,661	187,382.80	0.15
147	000538	云南白药	3,095	186,907.05	0.15
148	600588	用友网络	8,579	186,250.09	0.15
149	300207	欣旺达	5,800	183,280.00	0.14
150	600905	三峡能源	28,800	181,152.00	0.14
151	300012	华测检测	7,800	181,038.00	0.14
152	300896	爱美客	300	180,003.00	0.14
153	000963	华东医药	3,979	179,691.64	0.14
154	601877	正泰电器	4,982	178,255.96	0.14
155	601006	大秦铁路	26,728	176,137.52	0.14
156	600132	重庆啤酒	1,200	175,920.00	0.14
157	600763	通策医疗	1,000	174,440.00	0.14
158	600383	金地集团	12,962	174,209.28	0.14
159	601600	中国铝业	36,572	173,717.00	0.14
160	601377	兴业证券	24,202	170,624.10	0.13
161	000009	中国宝安	12,639	170,500.11	0.13
162	000786	北新建材	4,924	170,468.88	0.13
163	000876	新希望	11,112	170,013.60	0.13
164	300408	三环集团	5,600	168,560.00	0.13
165	601838	成都银行	10,133	168,005.14	0.13
166	600741	华域汽车	7,233	166,359.00	0.13
167	600029	南方航空	22,682	165,805.42	0.13
168	600085	同仁堂	3,134	165,725.92	0.13
169	603019	中科曙光	5,700	165,414.00	0.13
170	601100	恒立液压	2,656	163,928.32	0.13
171	300661	圣邦股份	900	163,818.00	0.13
172	601186	中国铁建	20,651	163,142.90	0.13
173	688111	金山办公	821	161,835.52	0.13
174	600885	宏发股份	3,780	158,193.00	0.12
175	601111	中国国航	13,524	157,013.64	0.12
176	300601	康泰生物	3,467	156,639.06	0.12
177	600547	山东黄金	8,334	154,679.04	0.12
178	601868	中国能建	64,733	153,417.21	0.12

179	601117	中国化学	16,300	153,383.00	0.12
180	688396	华润微	2,594	153,227.58	0.12
181	601066	中信建投	5,300	153,223.00	0.12
182	603369	今世缘	3,000	153,000.00	0.12
183	000596	古井贡酒	608	151,793.28	0.12
184	600392	盛和资源	6,691	151,216.60	0.12
185	600096	云天化	4,800	151,104.00	0.12
186	600886	国投电力	14,378	150,969.00	0.12
187	601800	中国交建	15,967	148,173.76	0.12
188	600015	华夏银行	27,663	144,124.23	0.11
189	002497	雅化集团	4,400	143,660.00	0.11
190	600233	圆通速递	7,000	142,730.00	0.11
191	600418	江淮汽车	8,300	142,428.00	0.11
192	601788	光大证券	9,000	141,840.00	0.11
193	300595	欧普康视	2,460	140,687.40	0.11
194	600600	青岛啤酒	1,350	140,292.00	0.11
195	000157	中联重科	22,635	139,431.60	0.11
196	600011	华能国际	19,800	139,392.00	0.11
197	600115	中国东航	25,337	139,100.13	0.11
198	688005	容百科技	1,069	138,371.36	0.11
199	002236	大华股份	8,349	137,090.58	0.11
200	600219	南山铝业	36,500	134,685.00	0.11
201	600487	亨通光电	9,260	134,640.40	0.11
202	600188	兖矿能源	3,400	134,232.00	0.11
203	000425	徐工机械	24,854	133,963.06	0.10
204	600989	宝丰能源	9,100	133,315.00	0.10
205	002008	大族激光	4,021	133,215.73	0.10
206	002736	国信证券	13,900	133,023.00	0.10
207	601916	浙商银行	40,000	132,800.00	0.10
208	002240	盛新锂能	2,200	132,792.00	0.10
209	002601	龙佰集团	6,600	132,330.00	0.10
210	002407	多氟多	2,700	132,057.00	0.10
211	000069	华侨城 A	20,141	130,715.09	0.10
212	300782	卓胜微	960	129,600.00	0.10
213	002555	三七互娱	6,100	129,503.00	0.10
214	300285	国瓷材料	3,600	129,312.00	0.10
215	002385	大北农	16,510	128,943.10	0.10
216	601618	中国中冶	36,806	128,821.00	0.10
217	000938	紫光股份	6,602	128,078.80	0.10
218	601336	新华保险	3,959	127,440.21	0.10
219	300413	芒果超媒	3,800	126,768.00	0.10
220	603833	欧派家居	840	126,571.20	0.10

221	601901	方正证券	18,804	126,174.84	0.10
222	600845	宝信软件	2,300	125,580.00	0.10
223	688012	中微公司	1,074	125,389.50	0.10
224	601555	东吴证券	18,028	124,934.04	0.10
225	002268	卫士通	2,900	124,439.00	0.10
226	000977	浪潮信息	4,674	123,767.52	0.10
227	300769	德方纳米	300	122,604.00	0.10
228	603486	科沃斯	1,000	121,890.00	0.10
229	601138	工业富联	12,200	120,048.00	0.09
230	600486	扬农化工	900	119,952.00	0.09
231	600352	浙江龙盛	11,762	119,737.16	0.09
232	601799	星宇股份	700	119,700.00	0.09
233	600157	永泰能源	74,500	118,455.00	0.09
234	601108	财通证券	15,010	118,128.70	0.09
235	002120	韵达股份	6,900	117,714.00	0.09
236	600150	中国船舶	6,200	117,676.00	0.09
237	600584	长电科技	4,355	117,585.00	0.09
238	300073	当升科技	1,300	117,442.00	0.09
239	002648	卫星化学	4,533	117,178.05	0.09
240	603882	金域医学	1,400	115,570.00	0.09
241	600298	安琪酵母	2,368	115,440.00	0.09
242	002007	华兰生物	5,030	114,684.00	0.09
243	300390	天华超净	1,300	113,620.00	0.09
244	002841	视源股份	1,500	112,980.00	0.09
245	300144	宋城演艺	7,200	110,520.00	0.09
246	002353	杰瑞股份	2,738	110,341.40	0.09
247	601155	新城控股	4,300	109,349.00	0.09
248	002185	华天科技	11,600	108,808.00	0.09
249	000988	华工科技	4,691	108,690.47	0.09
250	300003	乐普医疗	5,800	107,706.00	0.08
251	000630	铜陵有色	33,023	107,654.98	0.08
252	600862	中航高科	3,800	106,780.00	0.08
253	002756	永兴材料	700	106,547.00	0.08
254	000703	恒逸石化	10,107	106,224.57	0.08
255	603605	珀莱雅	640	105,715.20	0.08
256	688036	传音控股	1,179	105,202.17	0.08
257	601021	春秋航空	1,800	105,030.00	0.08
258	600332	白云山	3,300	104,247.00	0.08
259	603517	绝味食品	1,800	104,076.00	0.08
260	300037	新宙邦	1,980	104,068.80	0.08
261	601238	广汽集团	6,800	103,632.00	0.08
262	002507	涪陵榨菜	3,000	103,560.00	0.08

263	000783	长江证券	17,394	103,146.42	0.08
264	000066	中国长城	9,485	102,627.70	0.08
265	601168	西部矿业	8,663	102,483.29	0.08
266	002056	横店东磁	3,836	102,114.32	0.08
267	600153	建发股份	7,764	101,475.48	0.08
268	002078	太阳纸业	8,225	101,249.75	0.08
269	002180	纳思达	2,000	101,240.00	0.08
270	603899	晨光股份	1,800	100,944.00	0.08
271	603589	口子窖	1,700	99,637.00	0.08
272	002797	第一创业	15,420	98,842.20	0.08
273	601607	上海医药	5,437	98,300.96	0.08
274	300751	迈为股份	200	98,180.00	0.08
275	600109	国金证券	10,892	98,028.00	0.08
276	601878	浙商证券	8,600	97,868.00	0.08
277	002028	思源电气	2,717	96,888.22	0.08
278	600039	四川路桥	9,191	96,781.23	0.08
279	300529	健帆生物	1,900	96,691.00	0.08
280	300033	同花顺	1,000	96,150.00	0.08
281	002624	完美世界	6,650	95,560.50	0.07
282	600521	华海药业	4,200	95,340.00	0.07
283	002603	以岭药业	3,920	95,256.00	0.07
284	300433	蓝思科技	8,500	94,095.00	0.07
285	002916	深南电路	1,000	93,710.00	0.07
286	300088	长信科技	12,620	93,640.40	0.07
287	003816	中国广核	33,400	93,520.00	0.07
288	601128	常熟银行	12,200	93,208.00	0.07
289	600018	上港集团	15,761	91,886.63	0.07
290	002602	世纪华通	19,050	91,821.00	0.07
291	600489	中金黄金	12,413	91,732.07	0.07
292	300628	亿联网络	1,200	91,380.00	0.07
293	603939	益丰药房	1,710	90,339.30	0.07
294	600183	生益科技	5,309	90,199.91	0.07
295	600497	驰宏锌锗	17,300	89,787.00	0.07
296	002422	科伦药业	4,800	89,760.00	0.07
297	601360	三六零	10,500	89,460.00	0.07
298	000998	隆平高科	5,300	88,298.00	0.07
299	600141	兴发集团	2,000	87,980.00	0.07
300	002138	顺络电子	3,200	87,200.00	0.07
301	600549	厦门钨业	4,010	86,696.20	0.07
302	000970	中科三环	4,597	86,331.66	0.07
303	600362	江西铜业	4,835	86,208.05	0.07
304	600161	天坛生物	3,532	85,756.96	0.07

305	600875	东方电气	5,200	85,540.00	0.07
306	300763	锦浪科技	400	85,200.00	0.07
307	002384	东山精密	3,700	84,841.00	0.07
308	000301	东方盛虹	5,000	84,550.00	0.07
309	600859	王府井	3,254	84,538.92	0.07
310	600705	中航产融	24,360	84,285.60	0.07
311	002508	老板电器	2,339	84,274.17	0.07
312	601997	贵阳银行	14,400	83,664.00	0.07
313	600177	雅戈尔	12,584	83,431.92	0.07
314	002195	二三四五	36,843	82,896.75	0.06
315	603260	合盛硅业	700	82,572.00	0.06
316	002572	索菲亚	3,002	82,555.00	0.06
317	000999	华润三九	1,824	82,080.00	0.06
318	600160	巨化股份	6,169	81,122.35	0.06
319	600079	人福医药	5,030	80,480.00	0.06
320	002557	洽洽食品	1,400	79,702.00	0.06
321	600516	方大炭素	10,471	79,579.60	0.06
322	600143	金发科技	8,321	79,215.92	0.06
323	002030	达安基因	4,601	79,091.19	0.06
324	600536	中国软件	1,932	78,419.88	0.06
325	603392	万泰生物	503	78,115.90	0.06
326	300357	我武生物	1,500	78,045.00	0.06
327	603444	吉比特	200	77,600.00	0.06
328	000960	锡业股份	4,610	77,309.70	0.06
329	603290	斯达半导	200	77,180.00	0.06
330	600399	抚顺特钢	4,300	76,970.00	0.06
331	002670	国盛金控	8,000	76,800.00	0.06
332	600170	上海建工	25,096	76,040.88	0.06
333	300136	信维通信	4,500	75,825.00	0.06
334	002465	海格通信	8,334	75,756.06	0.06
335	300999	金龙鱼	1,400	75,628.00	0.06
336	000975	银泰黄金	7,745	75,436.30	0.06
337	600061	国投资本	11,852	75,378.72	0.06
338	002673	西部证券	11,500	75,210.00	0.06
339	002414	高德红外	5,837	75,122.19	0.06
340	300058	蓝色光标	11,451	74,775.03	0.06
341	601216	君正集团	15,308	74,703.04	0.06
342	600499	科达制造	3,600	74,304.00	0.06
343	002223	鱼跃医疗	2,891	74,183.06	0.06
344	300244	迪安诊断	2,380	74,018.00	0.06
345	600765	中航重机	2,300	74,014.00	0.06
346	000636	风华高科	3,936	73,957.44	0.06

347	300418	昆仑万维	4,600	73,600.00	0.06
348	601966	玲珑轮胎	2,900	73,573.00	0.06
349	002252	上海莱士	12,400	73,532.00	0.06
350	000629	攀钢钒钛	19,300	73,340.00	0.06
351	002294	信立泰	2,600	73,060.00	0.06
352	300296	利亚德	10,000	73,000.00	0.06
353	300558	贝达药业	1,200	72,960.00	0.06
354	600704	物产中大	14,215	72,922.95	0.06
355	600380	健康元	5,900	72,865.00	0.06
356	002156	通富微电	4,700	72,380.00	0.06
357	000547	航天发展	6,013	71,795.22	0.06
358	603077	和邦生物	16,800	71,568.00	0.06
359	601198	东兴证券	8,000	71,200.00	0.06
360	603613	国联股份	800	70,880.00	0.06
361	688122	西部超导	765	70,533.00	0.06
362	601319	中国人保	13,900	70,334.00	0.06
363	600739	辽宁成大	4,812	70,158.96	0.05
364	300253	卫宁健康	7,948	69,783.44	0.05
365	600699	均胜电子	4,400	69,124.00	0.05
366	600482	中国动力	4,390	68,966.90	0.05
367	600415	小商品城	12,373	68,917.61	0.05
368	002739	万达电影	5,000	68,250.00	0.05
369	603160	汇顶科技	1,100	68,123.00	0.05
370	600171	上海贝岭	2,720	68,081.60	0.05
371	000039	中集集团	4,900	67,865.00	0.05
372	600606	绿地控股	17,085	67,656.60	0.05
373	600026	中远海能	6,538	67,537.54	0.05
374	000878	云南铜业	5,900	67,201.00	0.05
375	603345	安井食品	400	67,148.00	0.05
376	000519	中兵红箭	2,300	67,045.00	0.05
377	600580	卧龙电驱	4,648	67,024.16	0.05
378	600848	上海临港	4,940	66,986.40	0.05
379	600637	东方明珠	9,365	66,959.75	0.05
380	601998	中信银行	13,984	66,424.00	0.05
381	600867	通化东宝	6,400	66,176.00	0.05
382	601162	天风证券	20,800	66,144.00	0.05
383	600820	隧道股份	10,800	66,096.00	0.05
384	600655	豫园股份	6,989	65,976.16	0.05
385	002203	海亮股份	5,700	65,835.00	0.05
386	000623	吉林敖东	4,455	65,755.80	0.05
387	000983	山西焦煤	4,900	65,611.00	0.05
388	600801	华新水泥	3,343	65,221.93	0.05

389	688099	晶晨股份	641	64,741.00	0.05
390	300146	汤臣倍健	2,986	64,646.90	0.05
391	600879	航天电子	9,948	64,562.52	0.05
392	688008	澜起科技	1,064	64,457.12	0.05
393	601058	赛轮轮胎	5,700	64,239.00	0.05
394	000513	丽珠集团	1,772	64,164.12	0.05
395	600315	上海家化	1,500	64,125.00	0.05
396	300026	红日药业	8,300	63,910.00	0.05
397	600673	东阳光	7,053	63,406.47	0.05
398	000400	许继电气	3,300	63,360.00	0.05
399	600642	申能股份	11,135	63,246.80	0.05
400	600732	爱旭股份	1,900	62,738.00	0.05
401	600369	西南证券	15,792	62,694.24	0.05
402	603185	上机数控	400	62,396.00	0.05
403	000750	国海证券	17,171	62,330.73	0.05
404	002625	光启技术	3,600	62,172.00	0.05
405	688180	君实生物	825	62,155.50	0.05
406	600038	中直股份	1,375	62,150.00	0.05
407	601005	重庆钢铁	32,400	61,884.00	0.05
408	600563	法拉电子	300	61,548.00	0.05
409	600529	山东药玻	2,200	61,490.00	0.05
410	002958	青农商行	18,500	61,420.00	0.05
411	000729	燕京啤酒	6,300	60,858.00	0.05
412	002500	山西证券	10,572	60,683.28	0.05
413	000027	深圳能源	9,449	60,568.09	0.05
414	300017	网宿科技	11,295	60,541.20	0.05
415	600941	中国移动	1,000	60,500.00	0.05
416	600909	华安证券	13,220	60,151.00	0.05
417	601696	中银证券	4,500	59,850.00	0.05
418	002439	启明星辰	3,000	59,790.00	0.05
419	601611	中国核建	7,100	59,569.00	0.05
420	002273	水晶光电	4,914	59,508.54	0.05
421	300024	机器人	5,896	59,431.68	0.05
422	601881	中国银河	6,100	58,987.00	0.05
423	600166	福田汽车	20,756	58,739.48	0.05
424	601992	金隅集团	21,200	58,724.00	0.05
425	600325	华发股份	7,736	58,561.52	0.05
426	002131	利欧股份	30,103	58,399.82	0.05
427	600118	中国卫星	2,896	58,151.68	0.05
428	002926	华西证券	7,400	58,016.00	0.05
429	300618	寒锐钴业	1,000	57,920.00	0.05
430	000050	深天马 A	5,800	57,826.00	0.05

431	000739	普洛药业	2,800	57,792.00	0.05
432	600008	首创环保	19,835	57,521.50	0.05
433	300482	万孚生物	1,410	57,401.10	0.04
434	600027	华电国际	14,600	57,378.00	0.04
435	601636	旗滨集团	4,500	57,375.00	0.04
436	603456	九洲药业	1,100	56,870.00	0.04
437	600271	航天信息	5,176	56,625.44	0.04
438	002250	联化科技	3,446	56,411.02	0.04
439	000060	中金岭南	12,604	56,213.84	0.04
440	002831	裕同科技	1,900	56,145.00	0.04
441	601728	中国电信	15,000	55,950.00	0.04
442	000401	冀东水泥	5,299	55,745.48	0.04
443	002373	千方科技	5,000	55,600.00	0.04
444	000021	深科技	4,763	55,441.32	0.04
445	688777	中控技术	759	55,224.84	0.04
446	300251	光线传媒	5,814	55,058.58	0.04
447	300070	碧水源	10,507	54,741.47	0.04
448	603156	养元饮品	2,400	54,528.00	0.04
449	603885	吉祥航空	3,000	53,970.00	0.04
450	300009	安科生物	5,320	53,785.20	0.04
451	600208	新湖中宝	19,387	53,508.12	0.04
452	601995	中金公司	1,200	53,388.00	0.04
453	002152	广电运通	5,750	53,302.50	0.04
454	603858	步长制药	2,700	53,217.00	0.04
455	000997	新大陆	4,028	53,209.88	0.04
456	002212	天融信	5,200	52,780.00	0.04
457	000778	新兴铸管	10,882	52,451.24	0.04
458	600667	太极实业	7,100	52,398.00	0.04
459	002127	南极电商	9,800	52,332.00	0.04
460	300182	捷成股份	9,500	52,250.00	0.04
461	600066	宇通客车	6,034	52,194.10	0.04
462	300168	万达信息	5,500	51,920.00	0.04
463	300454	深信服	500	51,890.00	0.04
464	600598	北大荒	3,500	51,660.00	0.04
465	603927	中科软	2,200	51,304.00	0.04
466	600998	九州通	4,300	51,213.00	0.04
467	002032	苏泊尔	900	50,706.00	0.04
468	600511	国药股份	1,885	50,480.30	0.04
469	002221	东华能源	5,414	50,404.34	0.04
470	002607	中公教育	8,700	50,373.00	0.04
471	603707	健友股份	1,778	50,139.60	0.04
472	600297	广汇汽车	19,200	50,112.00	0.04

473	002124	天邦食品	7,440	49,996.80	0.04
474	600498	烽火通信	3,445	49,883.60	0.04
475	600390	五矿资本	10,200	49,878.00	0.04
476	002396	星网锐捷	2,200	49,808.00	0.04
477	000012	南玻 A	6,700	49,714.00	0.04
478	300919	中伟股份	400	49,560.00	0.04
479	601865	福莱特	1,300	49,530.00	0.04
480	600155	华创阳安	5,800	49,184.00	0.04
481	600528	中铁工业	6,076	48,911.80	0.04
482	600827	百联股份	3,676	48,559.96	0.04
483	600060	海信视像	3,873	48,412.50	0.04
484	000807	云铝股份	4,900	48,412.00	0.04
485	600021	上海电力	4,714	48,318.50	0.04
486	600839	四川长虹	16,700	48,096.00	0.04
487	002019	亿帆医药	3,400	47,532.00	0.04
488	601077	渝农商行	12,800	47,360.00	0.04
489	600201	生物股份	5,169	47,348.04	0.04
490	000581	威孚高科	2,444	47,047.00	0.04
491	603658	安图生物	960	46,934.40	0.04
492	600755	厦门国贸	6,240	46,800.00	0.04
493	300363	博腾股份	600	46,794.00	0.04
494	300630	普利制药	1,331	46,784.65	0.04
495	300001	特锐德	2,700	46,737.00	0.04
496	600718	东软集团	4,059	46,719.09	0.04
497	600282	南钢股份	14,800	46,620.00	0.04
498	603233	大参林	1,488	46,574.40	0.04
499	600567	山鹰国际	16,600	45,982.00	0.04
500	688126	沪硅产业	1,993	45,799.14	0.04
501	002153	石基信息	2,859	45,372.33	0.04
502	000686	东北证券	6,482	45,309.18	0.04
503	002511	中顺洁柔	3,600	45,072.00	0.04
504	600535	天士力	4,262	44,793.62	0.04
505	601872	招商轮船	7,760	44,697.60	0.03
506	600895	张江高科	3,589	44,683.05	0.03
507	300724	捷佳伟创	500	44,675.00	0.03
508	600037	歌华有线	4,700	44,133.00	0.03
509	002468	申通快递	3,700	44,104.00	0.03
510	000690	宝新能源	10,061	44,067.18	0.03
511	600064	南京高科	3,994	43,934.00	0.03
512	600216	浙江医药	3,209	43,802.85	0.03
513	002939	长城证券	4,300	43,688.00	0.03
514	601179	中国西电	9,300	43,524.00	0.03

515	002065	东华软件	6,872	43,431.04	0.03
516	300166	东方国信	4,700	43,334.00	0.03
517	600597	光明乳业	3,412	43,093.56	0.03
518	000709	河钢股份	19,047	43,046.22	0.03
519	002938	鹏鼎控股	1,400	42,294.00	0.03
520	600728	佳都科技	6,500	41,990.00	0.03
521	000598	兴蓉环境	8,195	41,876.45	0.03
522	300115	长盈精密	4,052	41,776.12	0.03
523	601990	南京证券	5,000	41,700.00	0.03
524	600808	马钢股份	11,000	41,690.00	0.03
525	000800	一汽解放	4,400	41,096.00	0.03
526	603883	老百姓	1,196	40,520.48	0.03
527	002004	华邦健康	7,247	40,438.26	0.03
528	002690	美亚光电	1,810	39,240.80	0.03
529	002429	兆驰股份	10,200	39,168.00	0.03
530	000089	深圳机场	5,000	38,600.00	0.03
531	600959	江苏有线	11,760	38,337.60	0.03
532	000656	金科股份	13,271	37,955.06	0.03
533	600572	康恩贝	8,567	37,951.81	0.03
534	002368	太极股份	1,945	37,363.45	0.03
535	601118	海南橡胶	7,700	36,806.00	0.03
536	000877	天山股份	2,992	36,801.60	0.03
537	000830	鲁西化工	2,100	36,309.00	0.03
538	600967	内蒙一机	3,968	36,188.16	0.03
539	001914	招商积余	2,000	35,940.00	0.03
540	000402	金融街	6,000	35,700.00	0.03
541	600446	金证股份	3,400	35,292.00	0.03
542	002281	光迅科技	1,982	34,843.56	0.03
543	002110	三钢闽光	5,700	34,713.00	0.03
544	002233	塔牌集团	3,913	34,630.05	0.03
545	600811	东方集团	12,108	34,265.64	0.03
546	002174	游族网络	3,500	34,195.00	0.03
547	600988	赤峰黄金	2,100	33,495.00	0.03
548	600918	中泰证券	4,300	32,895.00	0.03
549	000488	晨鸣纸业	5,800	32,712.00	0.03
550	002387	维信诺	4,800	32,256.00	0.03
551	600167	联美控股	4,300	32,207.00	0.03
552	601098	中南传媒	3,400	32,096.00	0.03
553	000158	常山北明	5,300	31,800.00	0.02
554	600126	杭钢股份	6,200	31,744.00	0.02
555	300212	易华录	1,820	31,668.00	0.02
556	002399	海普瑞	1,801	31,661.58	0.02

557	000932	华菱钢铁	6,200	31,558.00	0.02
558	002081	金螳螂	6,142	31,201.36	0.02
559	300308	中际旭创	1,000	31,050.00	0.02
560	000961	中南建设	9,775	29,813.75	0.02
561	002326	永太科技	900	29,637.00	0.02
562	603000	人民网	2,630	29,456.00	0.02
563	300699	光威复材	500	29,435.00	0.02
564	002146	荣盛发展	9,674	29,312.22	0.02
565	600546	山煤国际	1,500	29,190.00	0.02
566	603026	石大胜华	200	29,070.00	0.02
567	000156	华数传媒	3,600	28,692.00	0.02
568	300676	华大基因	400	28,680.00	0.02
569	002382	蓝帆医疗	3,000	28,650.00	0.02
570	688009	中国通号	6,296	28,520.88	0.02
571	000708	中信特钢	1,400	28,210.00	0.02
572	000738	航发控制	1,000	28,100.00	0.02
573	603228	景旺电子	1,200	27,996.00	0.02
574	605117	德业股份	100	27,989.00	0.02
575	600348	华阳股份	1,800	27,828.00	0.02
576	688002	睿创微纳	694	27,565.68	0.02
577	603267	鸿远电子	200	26,866.00	0.02
578	000415	渤海租赁	12,300	26,691.00	0.02
579	002600	领益智造	5,300	26,606.00	0.02
580	601699	潞安环能	1,800	26,316.00	0.02
581	002242	九阳股份	1,417	26,016.12	0.02
582	000031	大悦城	6,300	25,200.00	0.02
583	600717	天津港	6,182	24,789.82	0.02
584	688561	奇安信	428	23,882.40	0.02
585	002506	协鑫集成	6,400	23,808.00	0.02
586	000671	阳光城	10,532	23,065.08	0.02
587	000408	藏格矿业	700	23,058.00	0.02
588	002299	圣农发展	1,200	23,016.00	0.02
589	603127	昭衍新药	200	22,760.00	0.02
590	603868	飞科电器	300	22,725.00	0.02
591	002444	巨星科技	1,200	22,608.00	0.02
592	601016	节能风电	4,700	22,560.00	0.02
593	002409	雅克科技	400	22,204.00	0.02
594	600236	桂冠电力	3,600	21,924.00	0.02
595	000887	中鼎股份	1,200	21,888.00	0.02
596	601898	中煤能源	2,100	21,798.00	0.02
597	300957	贝泰妮	100	21,753.00	0.02
598	002372	伟星新材	900	21,636.00	0.02

599	600372	中航电子	1,100	21,329.00	0.02
600	300223	北京君正	200	21,250.00	0.02
601	002568	百润股份	700	21,028.00	0.02
602	000028	国药一致	700	20,853.00	0.02
603	300474	景嘉微	300	20,517.00	0.02
604	000062	深圳华强	1,600	20,320.00	0.02
605	688088	虹软科技	630	19,901.70	0.02
606	603198	迎驾贡酒	300	19,542.00	0.02
607	000831	五矿稀土	600	18,750.00	0.01
608	601717	郑煤机	1,300	18,733.00	0.01
609	002092	中泰化学	2,400	18,624.00	0.01
610	600316	洪都航空	600	18,144.00	0.01
611	000825	太钢不锈	3,200	17,440.00	0.01
612	601866	中远海发	5,700	17,100.00	0.01
613	688321	微芯生物	638	16,071.22	0.01
614	603195	公牛集团	100	15,291.00	0.01
615	600970	中材国际	1,300	12,597.00	0.01
616	601236	红塔证券	1,300	11,869.00	0.01
617	603983	丸美股份	400	10,720.00	0.01
618	600737	中粮糖业	1,400	10,528.00	0.01
619	601577	长沙银行	1,200	9,516.00	0.01
620	601456	国联证券	700	8,589.00	0.01
621	300677	英科医疗	180	4,564.80	0.00
622	603638	艾迪精密	220	4,510.00	0.00
623	600409	三友化工	500	4,095.00	0.00

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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600938	中国海油	42,002	678,752.32	0.53
2	600703	三安光电	15,558	382,415.64	0.30
3	000799	酒鬼酒	1,200	222,972.00	0.17
4	300862	蓝盾光电	7,343	198,848.44	0.16
5	601099	太平洋	43,800	130,962.00	0.10
6	002463	沪电股份	8,861	130,788.36	0.10
7	600779	水井坊	1,400	129,556.00	0.10
8	600674	川投能源	9,818	117,030.56	0.09
9	601018	宁波港	29,451	114,858.90	0.09
10	600004	白云机场	7,700	114,807.00	0.09
11	601233	桐昆股份	6,900	109,572.00	0.09
12	601727	上海电气	22,568	92,754.48	0.07
13	601127	小康股份	1,100	89,199.00	0.07

14	002456	欧菲光	12,555	84,244.05	0.07
15	600273	嘉化能源	7,500	81,450.00	0.06
16	688076	诺泰生物	3,084	79,813.92	0.06
17	002807	江阴银行	16,100	72,933.00	0.06
18	600583	海油工程	16,248	67,429.20	0.05
19	600977	中国电影	5,800	66,700.00	0.05
20	002317	众生药业	4,282	62,131.82	0.05
21	000860	顺鑫农业	2,311	61,981.02	0.05
22	600881	亚泰集团	21,231	56,049.84	0.04
23	688306	均普智能	10,675	55,510.00	0.04
24	688237	超卓航科	1,334	55,054.18	0.04
25	300002	神州泰岳	13,135	54,247.55	0.04
26	688400	凌云光	2,441	53,531.13	0.04
27	000627	天茂集团	14,700	50,127.00	0.04
28	000078	海王生物	12,500	45,500.00	0.04
29	603816	顾家家居	780	44,171.40	0.03
30	002217	合力泰	13,900	43,507.00	0.03
31	600410	华胜天成	7,396	43,192.64	0.03
32	000681	视觉中国	3,000	42,870.00	0.03
33	300113	顺网科技	2,800	40,516.00	0.03
34	600094	大名城	10,600	38,902.00	0.03
35	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.03
36	002558	巨人网络	4,000	36,600.00	0.03
37	603737	三棵树	280	36,240.40	0.03
38	603888	新华网	2,000	34,300.00	0.03
39	600340	华夏幸福	10,149	32,476.80	0.03
40	000061	农产品	5,200	32,240.00	0.03
41	002773	康弘药业	2,000	29,880.00	0.02
42	300010	豆神教育	4,900	23,569.00	0.02
43	000008	神州高铁	6,200	15,500.00	0.01
44	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
45	301116	益客食品	433	8,850.52	0.01
46	301217	铜冠铜箔	463	6,861.66	0.01
47	301201	诚达药业	91	6,504.68	0.01
48	301127	天源环保	549	6,110.37	0.00
49	301158	德石股份	268	5,451.12	0.00
50	605377	华旺科技	140	2,507.40	0.00
51	301196	唯科科技	57	2,137.50	0.00
52	600267	海正药业	17	217.77	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	300750	宁德时代	3,351,228.00	2.14
2	600938	中国海油	648,021.60	0.41
3	300760	迈瑞医疗	585,072.00	0.37
4	000792	盐湖股份	508,509.00	0.33
5	688981	中芯国际	363,408.74	0.23
6	002812	恩捷股份	361,674.00	0.23
7	002459	晶澳科技	296,772.00	0.19
8	688599	天合光能	285,055.18	0.18
9	300759	康龙化成	181,084.00	0.12
10	600519	贵州茅台	176,050.00	0.11
11	600905	三峡能源	170,468.00	0.11
12	300896	爱美客	162,208.00	0.10
13	300661	圣邦股份	150,324.00	0.10
14	600096	云天化	146,676.00	0.09
15	002497	雅化集团	139,443.00	0.09
16	600030	中信证券	136,401.70	0.09
17	600188	兖矿能源	132,093.00	0.08
18	002240	盛新锂能	130,353.00	0.08
19	688005	容百科技	124,646.87	0.08
20	600157	永泰能源	123,031.00	0.08

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	600519	贵州茅台	1,160,785.00	0.74
2	600036	招商银行	594,382.00	0.38
3	601318	中国平安	584,712.00	0.37
4	000858	五粮液	393,968.94	0.25
5	600887	伊利股份	317,371.00	0.20
6	601166	兴业银行	309,129.00	0.20
7	000333	美的集团	307,520.00	0.20
8	688789	宏华数科	305,443.49	0.20
9	600900	长江电力	287,903.00	0.18
10	002594	比亚迪	273,153.00	0.17
11	600938	中国海油	267,840.00	0.17
12	600030	中信证券	224,485.00	0.14
13	600438	通威股份	217,103.00	0.14
14	002340	格林美	197,926.00	0.13

15	601888	中国中免	193,794.00	0.12
16	000002	万科 A	189,320.00	0.12
17	600884	杉杉股份	186,270.40	0.12
18	600048	保利发展	184,591.00	0.12
19	002466	天齐锂业	174,625.00	0.11
20	601689	拓普集团	173,322.00	0.11

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	14,196,119.08
卖出股票收入（成交）总额	27,213,643.48

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	2,208,494.41	1.73
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）	22,713.32	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,231,207.73	1.75

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	019674	22 国债 09	22,000	2,208,494.41	1.73
2	127058	科伦转债	143	18,675.23	0.01
3	127061	美锦转债	34	4,038.09	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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 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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

兴业银行

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了成分股兴业银行。

2021 年 8 月 20 日，银罚字（2021）26 号显示，兴业银行股份有限公司存在违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定等违法违规事实，被处罚款 5 万元。2022 年 3 月 25 日，银保监罚决字（2022）22 号显示，兴业银行股份有限公司存在漏报贸易融资业务 EAST 数据等 14 项违法违规事实，被处罚款 350 万元。对以上事件，本基金判断，兴业银行股份有限公司经营较为稳健，上述处罚对公司影响可控。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	2,586.71
2	应收清算款	284,873.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,214.52
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	309,675.12

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600938	中国海油	678,752.32	0.53	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 (%)
6,554	11,566.01	22,592,560.19	29.80	53,211,054.25	70.20

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	8.59
2	王飞舟	1,677,417.00	3.86
3	靳宁卿	980,300.00	2.26
4	纪伟才	938,029.00	2.16
5	于成福	932,390.00	2.15
6	于君	711,529.00	1.64
7	李坚	500,000.00	1.15
8	于延年	499,916.00	1.15

9	符王莹月	466,006.00	1.07
10	陈雁金	466,006.00	1.07

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	19,048.59	0.0251

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	85,214,541.08
本报告期基金总申购份额	2,670,170.59
减：本报告期基金总赎回份额	12,081,097.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	75,803,614.44

§ 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

自 2022 年 4 月 1 日起实施的《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》明确将公司财务负责人纳入高级管理人员序列。本报告期内，公司按照法规规定完成了公司财务负责人刁俊东同志在监管机构的任职备案，以及在中国证券投资基金业协会的登记。

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 (%)	
长江证券	1	21,191,088.11	54.21	19,735.04	54.21	-
东北证券	1	10,710,355.88	27.40	9,974.92	27.40	-
光大证券	1	6,977,929.35	17.85	6,498.56	17.85	-
招商证券	2	213,046.00	0.54	194.03	0.53	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	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 (%)

长江证券	2,553,272.30	98.75	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	32,435.88	1.25	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

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

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

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

(3) 研究、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:

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	招商证券	北京	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况: 无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 1 日
2	长盛基金管理有限公司关于终止部分基金销售机构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	2022 年 1 月 1 日
3	长盛基金管理有限公司关于增加东方财富证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投、转换及费率优惠业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 14 日
4	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 22 日
5	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 22 日
6	长盛基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资上交所上市股票的风险提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 2 月 28 日
7	长盛基金管理有限公司关于增加申万宏源西部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	2022 年 3 月 4 日
8	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)	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 9 日
9	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 9 日
10	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加广发证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 25 日
11	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 31 日
12	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 31 日

13	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 4 月 22 日
14	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 4 月 22 日
15	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加宁波银行为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 5 月 27 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	2022 年 5 月 31 日
17	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加陆享基金等三家基金销售公司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	2022 年 6 月 13 日
18	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加华安证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 6 月 20 日
19	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 6 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	20220101~20220630	18,495,067.82	0.00	0.00	18,495,067.82	24.40
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

2022 年 8 月 27 日