

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金  
(LOF)  
2022 年年度报告

2022 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 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，普华永道中天会计师事务所（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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 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	5
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>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	10
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	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>50</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	51
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 .....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
8.12 投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>71</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	71
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
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情况 .....	72
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>72</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>72</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
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 .....	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
11.4 基金投资策略的改变 .....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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 .....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
11.8 其他重大事件 .....	76
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>77</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 .....	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	78
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>78</b>
13.1 备查文件目录 .....	78
13.2 存放地点 .....	78
13.3 查阅方式 .....	78

## § 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	75,143,415.79 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	王小飞
	联系电话	010-86497608	021-60637103
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	021-60637228
传真		010-86497999	021-60635778
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院

	楼中建财富国际中心 3-5 层	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
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	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	3,145,994.03	68,864,246.10	90,967,993.66
本期利润	-27,546,738.79	25,101,408.67	117,376,717.69
加权平均基金份额本期利润	-0.3424	0.2591	0.4530
本期加权平均净值利润率	-21.67%	14.80%	29.53%
本期基金份额净值增长率	-18.32%	8.46%	39.01%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	32,288,517.75	65,227,060.20	107,479,115.14
期末可供分配基金份额利润	0.4297	0.7654	0.6230
期末基金资产净值	112,562,151.80	156,257,260.74	291,724,651.74
期末基金份额净值	1.498	1.834	1.691
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	9.17%	33.66%	23.24%

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 12 月 31 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
过去三个月	2.11%	1.14%	1.90%	1.13%	0.21%	0.01%
过去六个月	-11.15%	1.01%	-11.95%	1.01%	0.80%	0.00%
过去一年	-18.32%	1.20%	-20.23%	1.20%	1.91%	0.00%
过去三年	23.15%	1.20%	-1.18%	1.21%	24.33%	-0.01%
过去五年	35.44%	1.21%	-3.58%	1.22%	39.02%	-0.01%
自基金转型起至今	9.17%	1.43%	-23.66%	1.38%	32.83%	0.05%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

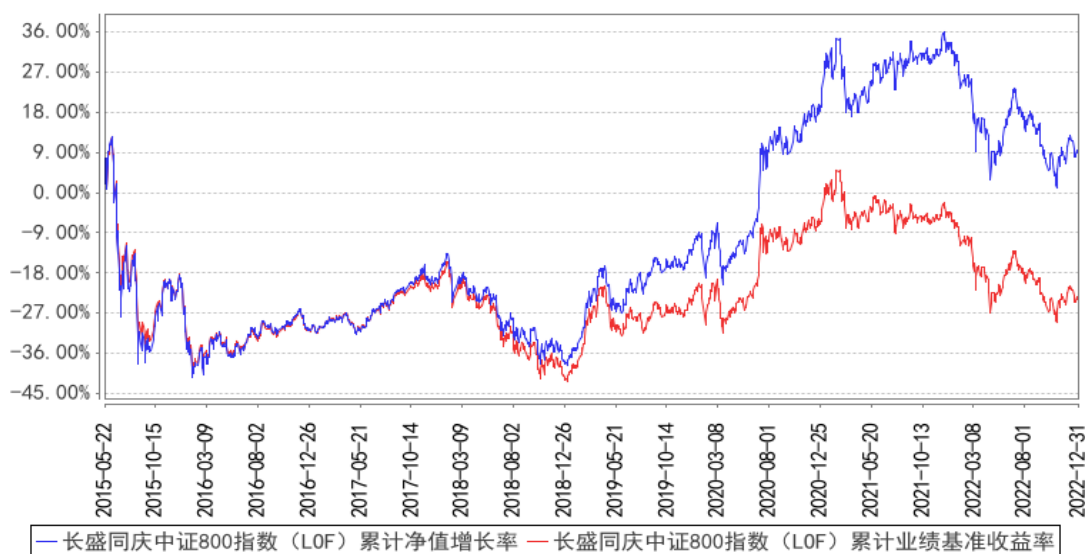
本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率 (税后)}$

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



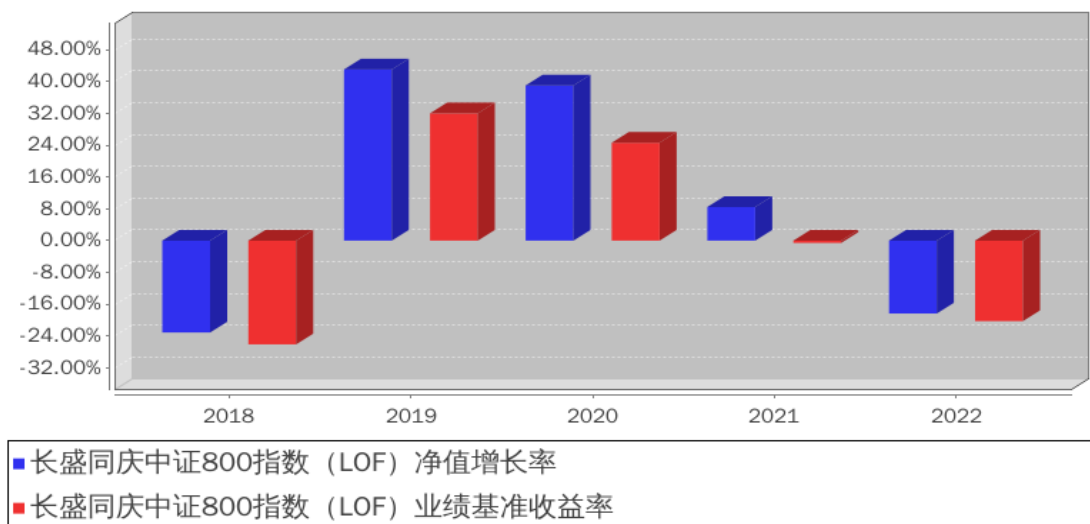
注：1、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2015 年 5 月 22

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。

### 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

**长盛同庆中证800指数 (LOF) 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图**



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位: 人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	2.634	49,523,424.08	6,960,918.46	56,484,342.54	-
合计	2.634	49,523,424.08	6,960,918.46	56,484,342.54	-

## § 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 12 月 31 日, 基金管理人共管理六十九只开放式基金, 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。	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。

#### 4.1.4 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

2022 年 A 股市场总体呈现先持续下跌再区间震荡且逐渐收敛的走势，波动较为剧烈。上半年主要受到国内经济增速偏弱、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影响，A 股市场在一季度经历了较大幅度的下行；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，市场的风险偏好显著下降，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，重新激发了投资者对于成长板块的偏好，使得反弹持续到二季度末。三季度受制于经济运行尤其是房地产行业下行预期的掣肘，社会信用依然难以有效扩张，叠加美元持续走强抑制了海外资金对 A 股的配置需求，大盘在反弹后继续下探。四季度随着疫情管控的转变和房地产相关政策的连续出台，市场对经济增长的预期修复和对金融风险发酵的担忧得到了有效缓解。从当时市场整体的风险溢价水平看，A 股已处于历史偏底部位置，下行空间十分有限。随着美国加息预期的放缓和美元走弱，北向资金急速引领了一波以大盘价值为主导的修复行情，并有望延续至次年初，带动市场情绪的重新启动。

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 1.498 元；本报告期基金份额净值增长率为-18.32%，业绩比较基准收益率为-20.23%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0097%，年度化跟踪误差为 1.1016%。

## 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 2023 年全年，预计财政政策将持续发力，并且在疫情影响消退后能够更加有效的落地，带动经济增长率和居民收入水平的修复。居民消费水平和基建开工相关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。地产产业链经历过多重冲击后，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。但是总体上我们认为 2023 年是一段休养生息的窗口期，经济上行的趋势确定性极高，但大幅上行空间有多大仍有待观察，因为居民和企业部门的资产负债表的修复大概率受到海外经济衰退引发的出口疲软的牵制。此外，经济扩张的速度和幅度亦和国内通胀水平有一定程度的相互制约关系，进而使得

在 2023 下半年内国内利率水平的下行空间可能受到约束。在行业上，我们重点关注偏向于内生动力的三大安全相关主题，尤其是产业链上关键位置的国产替代和自主创新这一受外部国际经济环境影响较小的方向，其成长空间仍然大有可为。

#### 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、员工行为、信息技术等。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。

#### 4.8 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，本基金于本报告期内未进行利润分配。

本基金截至 2022 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 32,288,517.75 元，其中，未分配利润已实现部分为 134,760,732.85 元，未分配利润未实现部分为-102,472,215.10 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

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 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	普华永道中天审字(2023)第 23172 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	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) (以下简称“长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF)”) 的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“中国基金业协会”) 发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF) 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>

形成审计意见的基础	<p>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。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF) 的基金管理人长盛基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF) 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF) 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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>(一) 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>(二) 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>(三) 评价基金管理人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>(四) 对基金管理人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，就可能对长盛同庆中证 800 指数基金 (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</p>

	日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF) 不能持续经营。 (五) 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。 我们与基金管理人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。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张勇	叶尔甸
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2023 年 3 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	6,006,344.44	9,746,598.73
结算备付金		-	-
存出保证金		5,784.06	7,315.96
交易性金融资产	7.4.7.2	107,725,569.99	147,883,040.05
其中：股票投资		105,415,579.49	147,655,774.45
基金投资		-	-
债券投资		2,309,990.50	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	6,376.46
应收股利		-	-
应收申购款		77,708.63	11,081.90
递延所得税资产		-	-



其他资产	7.4.7.8	-	967.46
资产总计		113,815,407.12	157,655,380.56
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		94,577.87	64,969.10
应付管理人报酬		96,978.13	132,503.91
应付托管费		21,335.17	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	7.4.7.9	1,040,364.15	1,171,495.97
负债合计		1,253,255.32	1,398,119.82
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.10	80,273,634.05	91,030,200.54
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	32,288,517.75	65,227,060.20
净资产合计		112,562,151.80	156,257,260.74
负债和净资产总计		113,815,407.12	157,655,380.56

注：(1) 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.498 元，基金份额总额 75,143,415.79 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 年年度报告资产负债表中“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 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-25,810,818.33	27,927,932.57
1. 利息收入		26,574.45	40,936.60
其中：存款利息收入	7.4.7.13	26,574.45	40,860.43
债券利息收入		-	76.17
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）		4,845,771.94	71,440,490.77
其中：股票投资收益	7.4.7.14	2,117,420.52	68,850,985.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	86,240.44	63,391.95
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,642,110.98	2,526,113.15
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）	7.4.7.20	-30,692,732.82	-43,762,837.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	9,568.10	209,342.63
<b>减：二、营业总支出</b>		1,735,920.46	2,826,523.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,274,769.70	1,697,831.47
2. 托管费	7.4.10.2.2	280,449.24	373,522.92
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.05	0.10

8. 其他费用	7.4.7.23	180,701.47	755,169.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-27,546,738.79	25,101,408.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-27,546,738.79	25,101,408.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-27,546,738.79	25,101,408.67

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 年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	-10,756,566.49	-	-32,938,542.45	-43,695,108.94
（一）、综合收益总额	-	-	-27,546,738.79	-27,546,738.79
（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）	-10,756,566.49	-	-5,391,803.66	-16,148,370.15
其中：1. 基金申购款	4,901,782.55	-	2,432,689.06	7,334,471.61
2. 基金赎回款	-15,658,349.04	-	-7,824,492.72	-23,482,841.76
（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)	80,273,634.05	-	32,288,517.75	112,562,151.80
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	-93,215,336.06	-	-42,252,054.94	-135,467,391.00
(一)、综合收益总额	-	-	25,101,408.67	25,101,408.67
(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)	-93,215,336.06	-	-67,353,463.61	-160,568,799.67
其中: 1. 基金申购款	25,795,777.11	-	13,872,561.20	39,668,338.31
2. 基金赎回款	-119,011,113.17	-	-81,226,024.81	-200,237,137.98
(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)	91,030,200.54	-	65,227,060.20	156,257,260.74

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:

胡甲

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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  $\times$  95% + 一年期银行定期存款利率 (税后)  $\times$  5%。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2023 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定 (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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 新金融工具准则

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。

## 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

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。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。



## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他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。

### 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

#### 新金融工具准则

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。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

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。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占净资产比例计算的金额。未实现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损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

##### 新金融工具准则

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及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税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。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

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。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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或者发行价计算的利

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利息收入。

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在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税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。

#### 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在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中债金融估值中心有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

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

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，财政部于 2022 年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号)，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。

(i) 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) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府



债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	6,006,344.44	9,746,598.73
等于：本金	6,005,772.66	9,746,598.73
加：应计利息	571.78	-
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	6,006,344.44	9,746,598.73

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	110,601,066.18	-	105,415,579.49	-5,185,486.69	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,264,142.00	29,395.85	2,309,990.50	16,452.65
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,264,142.00	29,395.85	2,309,990.50	16,452.65
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	112,865,208.18	29,395.85	107,725,569.99	-5,169,034.04	
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	122,140,741.27	-	147,655,774.45	25,515,033.18	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	218,600.00	-	227,265.60	8,665.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	218,600.00	-	227,265.60	8,665.60
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	122,359,341.27	-	147,883,040.05	25,523,698.78	

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

## 7.4.7.5 债权投资

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

无。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	967.46
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	967.46

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	500,000.00
应付赎回费	354.50	234.38
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,472.86	3,724.80
其中：交易所市场	2,472.86	3,724.80
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	60,000.00
其他	607,536.79	607,536.79
合计	1,040,364.15	1,171,495.97

## 7.4.7.10 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 12 月 31 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	4,588,487.18	4,901,782.55
本期赎回 (以“-”号填列)	-14,659,612.47	-15,658,349.04
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	75,143,415.79	80,273,634.05
-----	---------------	---------------

注：1、申购含转换入；赎回含转换出。

2、截至 2022 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 42,928,440.00 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 32,214,975.79 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。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 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	3,145,994.03	-30,692,732.82	-27,546,738.79
本期基金份额交易产生的变动数	-17,863,302.27	12,471,498.61	-5,391,803.66
其中：基金申购款	8,146,847.87	-5,714,158.81	2,432,689.06
基金赎回款	-26,010,150.14	18,185,657.42	-7,824,492.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	134,760,732.85	-102,472,215.10	32,288,517.75

#### 7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	26,340.56	39,542.42
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	152.41	608.43
其他	81.48	709.58
合计	26,574.45	40,860.43

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖	2,117,420.52	68,850,985.67

股票差价收入		
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	2,117,420.52	68,850,985.67

#### 7.4.7.14.2 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
卖出股票成交总 额	31,533,867.21	213,319,003.54
减：卖出股票成本 总额	29,326,710.94	144,468,017.87
减：交易费用	89,735.75	-
买卖股票差价收 入	2,117,420.52	68,850,985.67

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息 收入	23,440.54	-
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	63,391.95
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	86,240.44	63,391.95

##### 7.4.7.15.2 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	386,466.18	499,277.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	323,600.00	435,800.00
减：应计利息总额	62.44	86.00
减：交易费用	3.84	-
买卖债券差价收入	62,799.90	63,391.95

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,642,110.98	2,526,113.15
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	2,642,110.98	2,526,113.15

#### 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-30,692,732.82	-43,762,837.43
股票投资	-30,700,519.87	-43,768,864.23
债券投资	7,787.05	6,026.80
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	-30,692,732.82	-43,762,837.43

#### 7.4.7.21 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	9,533.75	105,761.57
基金转换费收入	34.35	103,581.06
合计	9,568.10	209,342.63

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。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	-	-
银行费用	701.47	5,248.97
交易费用	-	509,920.44
深交所上市年费	-	60,000.00
合计	180,701.47	755,169.41

#### 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

无。

#### 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 (“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
国元证券股份有限公司 (“国元证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司 (“星展银行”)	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用融资担保集团有限公司	基金管理人的股东
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛基金 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

#### 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

无。

##### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,274,769.70	1,697,831.47
其中：支付销售机构的客户维护费	121,404.72	125,492.99

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。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	280,449.24	373,522.92

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。

##### 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

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

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

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

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

无。

## 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国建设银行	6,006,344.44	26,340.56	9,746,598.73	39,542.42
合计	6,006,344.44	26,340.56	9,746,598.73	39,542.42

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。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

无。

## 7.4.12 期末（2022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	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

688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	6 个月	限售期 锁定	21.93	25.26	2,441	53,531.13	61,659.66	-
688409	富创精 密	2022 年 9 月 26 日	6 个月	限售期 锁定	69.99	100.48	548	38,354.52	55,063.04	-
688480	赛恩斯	2022 年 11 月 18 日	6 个月	限售期 锁定	19.18	20.82	1,611	30,898.98	33,541.02	-
688496	清越科 技	2022 年 12 月 21 日	6 个月	限售期 锁定	9.16	8.69	4,400	40,304.00	38,236.00	-

注：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。

#### 7.4.12.2 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
600038	中直 股份	2022 年 12 月 26 日	重大事 项停牌	46.41	2023 年 1 月 10 日	51.05	1,375	59,790.42	63,813.75	-

#### 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

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。

#### 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 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占基金资产净值的比例为 0.07% (2021 年 12 月 31 日：0.15%)。

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 日, 本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%, 本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持证券均在证券交易所上市, 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 7.4.12。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 12 月 31 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 12 月 31 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。

#### 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

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2022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	6,005,772.66	-	-	571.78	6,006,344.44
存出保证金	5,781.46	-	-	2.60	5,784.06
交易性金融资产	2,198,900.00	14,844.96	66,849.69	105,444,975.34	107,725,569.99
应收申购款	-	-	-	77,708.63	77,708.63
资产总计	8,210,454.12	14,844.96	66,849.69	105,523,258.35	113,815,407.12

负债					
应付赎回款	-	-	-	94,577.87	94,577.87
应付管理人报酬	-	-	-	96,978.13	96,978.13
应付托管费	-	-	-	21,335.17	21,335.17
其他负债	-	-	-	1,040,364.15	1,040,364.15
负债总计	-	-	-	1,253,255.32	1,253,255.32
利率敏感度缺口	8,210,454.12	14,844.96	66,849.69	104,270,003.03	112,562,151.80
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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.05% (2021 年 12 月 31 日：0.15%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 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。

#### 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 2022 年 12 月 31 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	105,415,579.49	93.65	147,655,774.45	94.50
合计	105,415,579.49	93.65	147,655,774.45	94.50

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 12 月 31 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)	
分析	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	5,596,496.20	7,957,596.32
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-5,596,496.20	-7,957,596.32

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	105,245,006.71	146,377,448.54
第二层次	2,292,063.56	245,749.81
第三层次	188,499.72	1,259,841.70
合计	107,725,569.99	147,883,040.05

##### 7.4.14.2.2 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,确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,259,841.70	1,259,841.70
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	698,330.31	698,330.31
转出第三层次	-	1,881,377.51	1,881,377.51



当期利得或损失总额	-	111,705.22	111,705.22
其中:计入损益的利得或损失	-	111,705.22	111,705.22
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	188,499.72	188,499.72
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	25,411.09	25,411.09
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	378,884.61	378,884.61
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	880,957.09	880,957.09
其中:计入损益的利得或损失	-	880,957.09	880,957.09
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,259,841.70	1,259,841.70
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	880,957.09	880,957.09

注:于2022年12月31日,本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度,本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位:人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

限售股票	188,499.72	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动 率	0.264920-0.589881	负相关
项目	上年度末公允 价值	采用的估 值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值 之间的关系
限售股票	1,259,841.70	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动 率	0.285798-1.122072	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 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	105,415,579.49	92.62
	其中: 股票	105,415,579.49	92.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,309,990.50	2.03
	其中: 债券	2,309,990.50	2.03
	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	6,006,344.44	5.28
8	其他各项资产	83,492.69	0.07
9	合计	113,815,407.12	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	1,387,611.65	1.23
B	采矿业	3,119,274.62	2.77
C	制造业	57,680,925.51	51.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,728,082.82	2.42
E	建筑业	2,218,503.64	1.97
F	批发和零售业	1,213,052.95	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	2,846,945.23	2.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,657,649.68	4.14
J	金融业	19,483,039.03	17.31
K	房地产业	2,070,138.15	1.84
L	租赁和商务服务业	1,539,337.43	1.37
M	科学研究和技术服务业	1,422,414.80	1.26
N	水利、环境和公共设施管理业	70,081.11	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	869,453.17	0.77
R	文化、体育和娱乐业	442,906.24	0.39
S	综合	214,096.08	0.19
	合计	101,963,512.11	90.58

### 8.2.2 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	736,893.28	0.65
C	制造业	1,781,879.17	1.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	41,500.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	221,011.58	0.20

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	210,235.34	0.19
J	金融业	222,935.00	0.20
K	房地产业	58,651.99	0.05
L	租赁和商务服务业	29,640.00	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	33,541.02	0.03
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	115,780.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	3,452,067.38	3.07

### 8.2.3 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。

### 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

#### 8.3.1 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	5,186,181.00	4.61
2	300750	宁德时代	6,800	2,675,256.00	2.38
3	601318	中国平安	49,218	2,313,246.00	2.06
4	600036	招商银行	58,616	2,184,032.16	1.94
5	000858	五粮液	9,098	1,643,917.62	1.46
6	601012	隆基绿能	30,548	1,290,958.48	1.15
7	601166	兴业银行	65,971	1,160,429.89	1.03
8	000333	美的集团	22,238	1,151,928.40	1.02
9	002594	比亚迪	4,284	1,100,859.48	0.98
10	600900	长江电力	51,620	1,084,020.00	0.96
11	601888	中国中免	4,612	996,330.36	0.89
12	300059	东方财富	51,162	992,542.80	0.88
13	600030	中信证券	43,924	874,526.84	0.78
14	002415	海康威视	23,991	832,007.88	0.74
15	603259	药明康德	9,868	799,308.00	0.71
16	600276	恒瑞医药	20,702	797,648.06	0.71
17	000568	泸州老窖	3,434	770,177.52	0.68

18	601398	工商银行	174,512	757,382.08	0.67
19	600887	伊利股份	24,234	751,254.00	0.67
20	300760	迈瑞医疗	2,300	726,731.00	0.65
21	002475	立讯精密	22,652	719,201.00	0.64
22	600809	山西汾酒	2,434	693,665.66	0.62
23	000651	格力电器	21,323	689,159.36	0.61
24	601899	紫金矿业	68,427	684,270.00	0.61
25	002714	牧原股份	13,495	657,881.25	0.58
26	600309	万华化学	7,079	655,869.35	0.58
27	601328	交通银行	136,370	646,393.80	0.57
28	300124	汇川技术	8,602	597,839.00	0.53
29	002142	宁波银行	18,266	592,731.70	0.53
30	000002	万 科 A	32,554	592,482.80	0.53
31	000725	京东方 A	174,407	589,495.66	0.52
32	300274	阳光电源	5,260	588,068.00	0.52
33	000001	平安银行	43,379	570,867.64	0.51
34	601668	中国建筑	103,599	562,542.57	0.50
35	600048	保利发展	36,324	549,582.12	0.49
36	300015	爱尔眼科	17,611	547,173.77	0.49
37	603288	海天味业	6,467	514,773.20	0.46
38	600438	通威股份	13,000	501,540.00	0.45
39	002352	顺丰控股	8,500	490,960.00	0.44
40	300498	温氏股份	24,900	488,787.00	0.43
41	002304	洋河股份	2,995	480,697.50	0.43
42	300014	亿纬锂能	5,300	465,870.00	0.41
43	601816	京沪高铁	93,000	457,560.00	0.41
44	601088	中国神华	16,196	447,333.52	0.40
45	600436	片仔癀	1,545	445,670.70	0.40
46	601288	农业银行	152,067	442,514.97	0.39
47	600690	海尔智家	18,072	442,041.12	0.39
48	600031	三一重工	27,029	427,058.20	0.38
49	002129	TCL 中环	11,076	417,122.16	0.37
50	002466	天齐锂业	5,261	415,566.39	0.37
51	600050	中国联通	91,672	410,690.56	0.36
52	601601	中国太保	16,340	400,656.80	0.36
53	002460	赣锋锂业	5,740	398,987.40	0.35
54	600919	江苏银行	54,220	395,263.80	0.35
55	600406	国电南瑞	16,163	394,377.20	0.35
56	600000	浦发银行	53,725	391,118.00	0.35
57	000792	盐湖股份	17,100	387,999.00	0.34
58	600837	海通证券	44,249	384,523.81	0.34
59	600016	民生银行	110,395	380,862.75	0.34
60	600089	特变电工	18,688	375,255.04	0.33

61	002049	紫光国微	2,800	369,096.00	0.33
62	000063	中兴通讯	14,262	368,815.32	0.33
63	601225	陕西煤业	19,792	367,735.36	0.33
64	601688	华泰证券	27,791	354,057.34	0.31
65	688981	中芯国际	8,444	347,386.16	0.31
66	002027	分众传媒	51,800	346,024.00	0.31
67	002812	恩捷股份	2,600	341,354.00	0.30
68	601988	中国银行	106,238	335,712.08	0.30
69	600104	上汽集团	22,566	325,176.06	0.29
70	601169	北京银行	75,394	324,948.14	0.29
71	603986	兆易创新	3,100	317,657.00	0.28
72	603799	华友钴业	5,707	317,480.41	0.28
73	002271	东方雨虹	9,450	317,236.50	0.28
74	300122	智飞生物	3,600	316,188.00	0.28
75	300142	沃森生物	7,800	313,482.00	0.28
76	601211	国泰君安	23,000	312,570.00	0.28
77	601766	中国中车	60,987	311,643.57	0.28
78	600585	海螺水泥	11,351	310,790.38	0.28
79	688599	天合光能	4,867	310,319.92	0.28
80	601919	中远海控	29,390	302,423.10	0.27
81	002709	天赐材料	6,880	301,756.80	0.27
82	600570	恒生电子	7,446	301,265.16	0.27
83	601229	上海银行	50,369	297,680.79	0.26
84	600028	中国石化	67,696	295,154.56	0.26
85	002230	科大讯飞	8,750	287,262.50	0.26
86	601390	中国中铁	51,299	285,222.44	0.25
87	000625	长安汽车	23,098	284,336.38	0.25
88	002410	广联达	4,741	284,222.95	0.25
89	002371	北方华创	1,259	283,652.70	0.25
90	601628	中国人寿	7,547	280,144.64	0.25
91	600111	北方稀土	11,083	277,629.15	0.25
92	601669	中国电建	38,988	276,035.04	0.25
93	600660	福耀玻璃	7,853	275,404.71	0.24
94	601009	南京银行	26,401	275,098.42	0.24
95	603501	韦尔股份	3,510	270,585.90	0.24
96	300347	泰格医药	2,570	269,336.00	0.24
97	000661	长春高新	1,568	260,993.60	0.23
98	002459	晶澳科技	4,340	260,790.60	0.23
99	600009	上海机场	4,504	259,925.84	0.23
100	000100	TCL 科技	69,115	257,107.80	0.23
101	600019	宝钢股份	45,759	255,792.81	0.23
102	000338	潍柴动力	25,106	255,579.08	0.23
103	601818	光大银行	81,196	249,271.72	0.22

104	601857	中国石油	49,831	247,660.07	0.22
105	600999	招商证券	18,300	243,390.00	0.22
106	600893	航发动力	5,726	242,095.28	0.22
107	600760	中航沈飞	3,940	231,002.20	0.21
108	603806	福斯特	3,440	228,553.60	0.20
109	002311	海大集团	3,700	228,401.00	0.20
110	600958	东方证券	25,340	226,539.60	0.20
111	600426	华鲁恒升	6,739	223,397.85	0.20
112	600795	国电电力	51,453	219,704.31	0.20
113	688111	金山办公	821	217,146.29	0.19
114	601985	中国核电	34,788	208,728.00	0.19
115	600588	用友网络	8,579	207,354.43	0.18
116	002179	中航光电	3,584	207,011.84	0.18
117	000776	广发证券	13,286	205,800.14	0.18
118	300450	先导智能	5,100	205,275.00	0.18
119	600926	杭州银行	15,200	198,816.00	0.18
120	600010	包钢股份	101,716	195,294.72	0.17
121	601658	邮储银行	42,226	195,084.12	0.17
122	002241	歌尔股份	11,354	191,087.82	0.17
123	600196	复星医药	5,374	189,379.76	0.17
124	000963	华东医药	3,979	186,217.20	0.17
125	300316	晶盛机电	2,900	184,324.00	0.16
126	002493	荣盛石化	14,850	182,655.00	0.16
127	688012	中微公司	1,847	181,024.47	0.16
128	601377	兴业证券	31,463	180,597.62	0.16
129	001979	招商蛇口	14,236	179,800.68	0.16
130	601006	大秦铁路	26,728	178,543.04	0.16
131	601989	中国重工	50,926	177,731.74	0.16
132	000166	申万宏源	44,151	175,720.98	0.16
133	002050	三花智控	8,278	175,659.16	0.16
134	300012	华测检测	7,800	173,940.00	0.15
135	600029	南方航空	22,682	172,383.20	0.15
136	300408	三环集团	5,600	171,976.00	0.15
137	300896	爱美客	300	169,905.00	0.15
138	601633	长城汽车	5,725	169,574.50	0.15
139	000538	云南白药	3,095	168,244.20	0.15
140	601100	恒立液压	2,656	167,726.40	0.15
141	000895	双汇发展	6,437	166,911.41	0.15
142	601600	中国铝业	36,572	163,476.84	0.15
143	600745	闻泰科技	3,100	162,998.00	0.14
144	600905	三峡能源	28,800	162,720.00	0.14
145	000596	古井贡酒	608	162,275.20	0.14
146	002384	东山精密	6,500	160,745.00	0.14

147	300496	中科创达	1,600	160,480.00	0.14
148	000768	中航西飞	6,291	160,105.95	0.14
149	600547	山东黄金	8,334	159,679.44	0.14
150	601186	中国铁建	20,651	159,632.23	0.14
151	002001	新和成	8,460	158,625.00	0.14
152	600886	国投电力	14,378	155,713.74	0.14
153	603993	洛阳钼业	34,156	155,409.80	0.14
154	300661	圣邦股份	900	155,340.00	0.14
155	601838	成都银行	10,133	155,034.90	0.14
156	601615	明阳智能	6,100	154,086.00	0.14
157	600763	通策医疗	1,000	152,990.00	0.14
158	600132	重庆啤酒	1,200	152,856.00	0.14
159	000009	中国宝安	12,639	152,805.51	0.14
160	603369	今世缘	3,000	152,700.00	0.14
161	600176	中国巨石	11,104	152,235.84	0.14
162	600011	华能国际	19,800	150,678.00	0.13
163	601868	中国能建	64,733	148,238.57	0.13
164	600346	恒力石化	9,500	147,535.00	0.13
165	002385	大北农	16,510	146,939.00	0.13
166	600600	青岛啤酒	1,350	145,125.00	0.13
167	002821	凯莱英	980	145,040.00	0.13
168	600015	华夏银行	27,663	143,570.97	0.13
169	000876	新希望	11,112	143,455.92	0.13
170	601111	中国国航	13,524	143,354.40	0.13
171	603659	璞泰来	2,760	143,216.40	0.13
172	300759	康龙化成	2,100	142,800.00	0.13
173	600233	圆通速递	7,000	140,630.00	0.12
174	600115	中国东航	25,337	140,113.61	0.12
175	600085	同仁堂	3,134	140,027.12	0.12
176	600487	亨通光电	9,260	139,455.60	0.12
177	002202	金风科技	12,661	139,271.00	0.12
178	600150	中国船舶	6,200	138,136.00	0.12
179	601877	正泰电器	4,982	138,001.40	0.12
180	002920	德赛西威	1,300	136,942.00	0.12
181	688396	华润微	2,594	136,574.10	0.12
182	600845	宝信软件	2,990	133,952.00	0.12
183	601788	光大证券	9,000	133,830.00	0.12
184	300003	乐普医疗	5,800	133,226.00	0.12
185	600460	士兰微	4,061	133,160.19	0.12
186	603613	国联股份	1,500	132,660.00	0.12
187	002074	国轩高科	4,600	132,618.00	0.12
188	600383	金地集团	12,962	132,601.26	0.12
189	601117	中国化学	16,300	129,422.00	0.11



190	000938	紫光股份	6,602	128,805.02	0.11
191	601800	中国交建	15,967	128,534.35	0.11
192	002422	科伦药业	4,800	127,728.00	0.11
193	000786	北新建材	4,924	127,433.12	0.11
194	600885	宏发股份	3,780	126,289.80	0.11
195	603019	中科曙光	5,700	126,198.00	0.11
196	300763	锦浪科技	700	126,035.00	0.11
197	000425	徐工机械	24,854	126,009.78	0.11
198	601066	中信建投	5,300	125,875.00	0.11
199	600741	华域汽车	7,233	125,347.89	0.11
200	002601	龙佰集团	6,600	124,872.00	0.11
201	002736	国信证券	13,900	123,432.00	0.11
202	000157	中联重科	22,635	123,134.40	0.11
203	300207	欣旺达	5,800	122,670.00	0.11
204	600079	人福医药	5,030	120,166.70	0.11
205	600674	川投能源	9,818	120,074.14	0.11
206	601901	方正证券	18,804	119,969.52	0.11
207	600219	南山铝业	36,500	119,355.00	0.11
208	601336	新华保险	3,959	119,086.72	0.11
209	601555	东吴证券	18,028	117,722.84	0.10
210	002603	以岭药业	3,920	117,443.20	0.10
211	601618	中国中冶	36,806	117,043.08	0.10
212	600352	浙江龙盛	11,762	116,443.80	0.10
213	601021	春秋航空	1,800	115,650.00	0.10
214	000301	东方盛虹	8,800	114,752.00	0.10
215	600188	兖矿能源	3,400	114,172.00	0.10
216	300413	芒果超媒	3,800	114,076.00	0.10
217	600157	永泰能源	74,500	113,985.00	0.10
218	002007	华兰生物	5,030	113,828.90	0.10
219	600536	中国软件	1,932	112,693.56	0.10
220	601138	工业富联	12,200	111,996.00	0.10
221	002555	三七互娱	6,100	110,410.00	0.10
222	603517	绝味食品	1,800	109,962.00	0.10
223	600989	宝丰能源	9,100	109,837.00	0.10
224	300782	卓胜微	960	109,728.00	0.10
225	603882	金城医学	1,400	109,480.00	0.10
226	300601	康泰生物	3,467	109,314.51	0.10
227	603939	益丰药房	1,710	109,166.40	0.10
228	600418	江淮汽车	8,300	108,979.00	0.10
229	601058	赛轮轮胎	10,800	108,216.00	0.10
230	000069	华侨城 A	20,141	107,351.53	0.10
231	603605	珀莱雅	640	107,187.20	0.10
232	600298	安琪酵母	2,368	107,080.96	0.10

233	601108	财通证券	15,010	106,871.20	0.09
234	600153	建发股份	7,764	105,978.60	0.09
235	300144	宋城演艺	7,200	105,120.00	0.09
236	002028	思源电气	2,717	103,843.74	0.09
237	002180	纳思达	2,000	103,780.00	0.09
238	002008	大族激光	4,021	103,138.65	0.09
239	000630	铜陵有色	33,023	103,031.76	0.09
240	300724	捷佳伟创	900	102,618.00	0.09
241	002497	雅化集团	4,400	102,300.00	0.09
242	600039	四川路桥	9,191	102,203.92	0.09
243	603833	欧派家居	840	102,085.20	0.09
244	600489	中金黄金	12,413	101,662.47	0.09
245	300454	深信服	900	101,295.00	0.09
246	600096	云天化	4,800	100,992.00	0.09
247	600161	天坛生物	4,239	100,591.47	0.09
248	000977	浪潮信息	4,674	100,584.48	0.09
249	600584	长电科技	4,355	100,382.75	0.09
250	601233	桐昆股份	6,900	99,705.00	0.09
251	300285	国瓷材料	3,600	99,252.00	0.09
252	002120	韵达股份	6,900	99,222.00	0.09
253	603899	晨光股份	1,800	98,964.00	0.09
254	300033	同花顺	1,000	98,610.00	0.09
255	002648	卫星化学	6,346	98,363.00	0.09
256	600332	白云山	3,300	98,307.00	0.09
257	603589	口子窖	1,700	98,039.00	0.09
258	601607	上海医药	5,437	96,941.71	0.09
259	002185	华天科技	11,600	96,164.00	0.09
260	600160	巨化股份	6,169	95,681.19	0.09
261	600109	国金证券	10,892	94,760.40	0.08
262	002078	太阳纸业	8,225	94,752.00	0.08
263	600941	中国移动	1,400	94,738.00	0.08
264	002236	大华股份	8,349	94,427.19	0.08
265	688036	传音控股	1,179	93,754.08	0.08
266	600392	盛和资源	6,691	93,674.00	0.08
267	600486	扬农化工	900	93,510.00	0.08
268	000783	长江证券	17,394	92,710.02	0.08
269	601128	常熟银行	12,200	92,110.00	0.08
270	002223	鱼跃医疗	2,891	92,107.26	0.08
271	600521	华海药业	4,200	91,812.00	0.08
272	600859	王府井	3,254	91,567.56	0.08
273	000629	钒钛股份	19,300	91,289.00	0.08
274	002407	多氟多	2,700	89,964.00	0.08
275	003816	中国广核	33,400	89,846.00	0.08

276	300433	蓝思科技	8,500	89,505.00	0.08
277	601799	星宇股份	700	89,159.00	0.08
278	002841	视源股份	1,500	88,560.00	0.08
279	002268	电科网安	2,900	88,537.00	0.08
280	601168	西部矿业	8,663	88,362.60	0.08
281	601155	新城控股	4,300	88,150.00	0.08
282	300595	欧普康视	2,460	87,822.00	0.08
283	600497	驰宏锌锗	17,300	87,538.00	0.08
284	002797	第一创业	15,420	86,814.60	0.08
285	300699	光威复材	1,200	86,700.00	0.08
286	600988	赤峰黄金	4,800	86,640.00	0.08
287	300037	新宙邦	1,980	86,070.60	0.08
288	600027	华电国际	14,600	85,848.00	0.08
289	000975	银泰黄金	7,745	85,504.80	0.08
290	002294	信立泰	2,600	85,410.00	0.08
291	601878	浙商证券	8,600	85,398.00	0.08
292	000999	华润三九	1,824	85,381.44	0.08
293	000998	隆平高科	5,300	85,171.00	0.08
294	600862	中航高科	3,800	84,702.00	0.08
295	603185	上机数控	800	84,680.00	0.08
296	002624	完美世界	6,650	84,588.00	0.08
297	600362	江西铜业	4,835	84,274.05	0.07
298	600018	上港集团	15,761	84,163.74	0.07
299	002138	顺络电子	3,200	83,776.00	0.07
300	300357	我武生物	1,500	82,650.00	0.07
301	300751	迈为股份	200	82,368.00	0.07
302	300253	卫宁健康	7,948	81,705.44	0.07
303	600143	金发科技	8,321	80,630.49	0.07
304	600705	中航产融	24,360	79,900.80	0.07
305	600177	雅戈尔	12,584	79,656.72	0.07
306	601997	贵阳银行	14,400	79,056.00	0.07
307	600026	中远海能	6,538	78,782.90	0.07
308	002252	上海莱士	12,400	78,616.00	0.07
309	600549	厦门钨业	4,010	78,395.50	0.07
310	002439	启明星辰	3,000	78,240.00	0.07
311	002156	通富微电	4,700	77,456.00	0.07
312	002507	涪陵榨菜	3,000	77,310.00	0.07
313	000988	华工科技	4,691	76,979.31	0.07
314	600183	生益科技	5,309	76,502.69	0.07
315	002353	杰瑞股份	2,738	76,417.58	0.07
316	600061	国投资本	11,852	75,734.28	0.07
317	688390	固德威	234	75,603.06	0.07
318	300088	长信科技	12,620	75,341.40	0.07

319	688126	沪硅产业	4,276	75,300.36	0.07
320	601238	广汽集团	6,800	75,004.00	0.07
321	300136	信维通信	4,500	74,295.00	0.07
322	002195	二三四五	36,843	74,054.43	0.07
323	688005	容百科技	1,069	73,493.75	0.07
324	300073	当升科技	1,300	73,320.00	0.07
325	603486	科沃斯	1,000	72,940.00	0.06
326	300628	亿联网络	1,200	72,708.00	0.06
327	300390	天华超净	1,300	72,644.00	0.06
328	002602	世纪华通	19,050	72,580.50	0.06
329	601319	中国人保	13,900	72,558.00	0.06
330	688122	西部超导	765	72,437.85	0.06
331	002916	深南电路	1,000	72,150.00	0.06
332	002056	横店东磁	3,836	71,886.64	0.06
333	002030	达安基因	4,601	71,591.56	0.06
334	600765	中航重机	2,300	71,507.00	0.06
335	000703	恒逸石化	10,107	71,052.21	0.06
336	600325	华发股份	7,736	70,088.16	0.06
337	002673	西部证券	11,500	70,035.00	0.06
338	002557	洽洽食品	1,400	70,000.00	0.06
339	002739	万达电影	5,000	70,000.00	0.06
340	601998	中信银行	13,984	69,640.32	0.06
341	000878	云南铜业	5,900	69,325.00	0.06
342	688777	中控技术	759	68,939.97	0.06
343	300769	德方纳米	300	68,877.00	0.06
344	601360	三六零	10,500	68,670.00	0.06
345	600704	物产中大	14,215	68,374.15	0.06
346	300146	汤臣倍健	2,986	68,140.52	0.06
347	002465	海格通信	8,334	67,672.08	0.06
348	600879	航天电子	9,948	67,646.40	0.06
349	600482	中国动力	4,390	67,123.10	0.06
350	000729	燕京啤酒	6,300	66,906.00	0.06
351	000623	吉林敖东	4,455	66,780.45	0.06
352	600380	健康元	5,900	66,611.00	0.06
353	688008	澜起科技	1,064	66,606.40	0.06
354	300418	昆仑万维	4,600	66,286.00	0.06
355	605117	德业股份	200	66,240.00	0.06
356	000400	许继电气	3,300	65,901.00	0.06
357	603290	斯达半导	200	65,860.00	0.06
358	601077	渝农商行	18,600	65,658.00	0.06
359	600170	上海建工	25,096	65,249.60	0.06
360	603927	中科软	2,200	65,142.00	0.06
361	000960	锡业股份	4,610	65,001.00	0.06

362	002508	老板电器	2,339	64,930.64	0.06
363	600415	小商品城	12,373	64,834.52	0.06
364	603345	安井食品	400	64,752.00	0.06
365	002756	永兴材料	700	64,519.00	0.06
366	002203	海亮股份	5,700	64,410.00	0.06
367	002414	高德红外	5,837	64,207.00	0.06
368	600516	方大炭素	10,471	64,082.52	0.06
369	600038	中直股份	1,375	63,813.75	0.06
370	603392	万泰生物	503	63,730.10	0.06
371	300017	网宿科技	11,295	63,026.10	0.06
372	601728	中国电信	15,000	62,850.00	0.06
373	002831	裕同科技	1,900	62,833.00	0.06
374	000970	中科三环	4,597	62,703.08	0.06
375	603444	吉比特	200	62,568.00	0.06
376	600529	山东药玻	2,200	62,480.00	0.06
377	600118	中国卫星	2,896	62,408.80	0.06
378	600637	东方明珠	9,365	62,277.25	0.06
379	600699	均胜电子	4,400	61,820.00	0.05
380	601198	东兴证券	8,000	61,760.00	0.05
381	600399	抚顺特钢	4,300	61,533.00	0.05
382	600673	东阳光	7,053	61,290.57	0.05
383	600348	华阳股份	4,300	61,275.00	0.05
384	002625	光启技术	3,600	61,272.00	0.05
385	600642	申能股份	11,135	61,131.15	0.05
386	601216	君正集团	15,308	61,078.92	0.05
387	300999	金龙鱼	1,400	60,984.00	0.05
388	600909	华安证券	13,220	60,679.80	0.05
389	600739	辽宁成大	4,812	60,583.08	0.05
390	000739	普洛药业	2,800	60,312.00	0.05
391	000027	深圳能源	9,449	60,095.64	0.05
392	000708	中信特钢	3,500	60,060.00	0.05
393	300244	迪安诊断	2,380	59,809.40	0.05
394	601162	天风证券	20,800	59,696.00	0.05
395	601966	玲珑轮胎	2,900	59,392.00	0.05
396	603658	安图生物	960	59,376.00	0.05
397	002670	国盛金控	8,000	59,280.00	0.05
398	600369	西南证券	15,792	59,220.00	0.05
399	300558	贝达药业	1,200	59,124.00	0.05
400	603233	大参林	1,488	58,924.80	0.05
401	600848	上海临港	4,940	58,884.80	0.05
402	300529	健帆生物	1,900	58,843.00	0.05
403	600867	通化东宝	6,400	58,752.00	0.05
404	000636	风华高科	3,936	58,370.88	0.05

405	600166	福田汽车	20,756	58,324.36	0.05
406	603260	合盛硅业	700	58,058.00	0.05
407	600141	兴发集团	2,000	58,000.00	0.05
408	002273	水晶光电	4,914	57,936.06	0.05
409	600580	卧龙电驱	4,648	57,914.08	0.05
410	300058	蓝色光标	11,451	57,827.55	0.05
411	000513	丽珠集团	1,772	57,554.56	0.05
412	000750	国海证券	17,171	57,179.43	0.05
413	002152	广电运通	5,750	57,155.00	0.05
414	600820	隧道股份	10,800	56,916.00	0.05
415	603858	步长制药	2,700	56,727.00	0.05
416	601881	中国银河	6,100	56,669.00	0.05
417	300296	利亚德	10,000	56,600.00	0.05
418	000547	航天发展	6,013	56,462.07	0.05
419	600008	首创环保	19,835	56,133.05	0.05
420	600998	九州通	4,300	56,072.00	0.05
421	002500	山西证券	10,572	56,031.60	0.05
422	600606	绿地控股	18,793	56,003.14	0.05
423	002926	华西证券	7,400	55,722.00	0.05
424	603160	汇顶科技	1,100	55,220.00	0.05
425	002368	太极股份	1,945	54,712.85	0.05
426	002572	索菲亚	3,002	54,516.32	0.05
427	000807	云铝股份	4,900	54,488.00	0.05
428	601611	中国核建	7,100	53,960.00	0.05
429	600271	航天信息	5,176	53,882.16	0.05
430	601992	金隅集团	21,200	53,848.00	0.05
431	002958	青农商行	18,500	53,465.00	0.05
432	603156	养元饮品	2,400	53,448.00	0.05
433	002250	联化科技	3,446	53,413.00	0.05
434	002131	利欧股份	30,103	53,282.31	0.05
435	600655	豫园股份	6,989	53,186.29	0.05
436	300024	机器人	5,896	52,946.08	0.05
437	600511	国药股份	1,885	52,591.50	0.05
438	600060	海信视像	3,873	52,440.42	0.05
439	000997	新大陆	4,028	52,404.28	0.05
440	002212	天融信	5,200	51,948.00	0.05
441	600390	五矿资本	10,200	51,816.00	0.05
442	000039	中集集团	7,350	51,744.00	0.05
443	000060	中金岭南	12,604	51,676.40	0.05
444	601636	旗滨集团	4,500	51,255.00	0.05
445	601005	重庆钢铁	32,400	51,192.00	0.05
446	600499	科达制造	3,600	51,156.00	0.05
447	603077	和邦生物	16,800	51,072.00	0.05

448	000021	深科技	4,763	50,916.47	0.05
449	300251	光线传媒	5,814	50,349.24	0.04
450	000050	深天马 A	5,800	50,228.00	0.04
451	300009	安科生物	5,320	49,795.20	0.04
452	300070	碧水源	10,507	49,698.11	0.04
453	600801	华新水泥	3,343	49,543.26	0.04
454	002511	中顺洁柔	3,600	49,464.00	0.04
455	600208	新湖中宝	19,387	49,242.98	0.04
456	601699	潞安环能	2,900	48,865.00	0.04
457	603885	吉祥航空	3,000	48,540.00	0.04
458	603883	老百姓	1,196	48,402.12	0.04
459	600598	北大荒	3,500	48,160.00	0.04
460	600563	法拉电子	300	47,964.00	0.04
461	600315	上海家化	1,500	47,775.00	0.04
462	601696	中银证券	4,500	47,565.00	0.04
463	600171	上海贝岭	2,720	47,409.60	0.04
464	600021	上海电力	4,714	47,187.14	0.04
465	300026	红日药业	8,300	47,144.00	0.04
466	002127	南极电商	9,800	47,138.00	0.04
467	603456	九洲药业	1,100	46,673.00	0.04
468	600282	南钢股份	14,800	46,620.00	0.04
469	600201	生物股份	5,169	46,572.69	0.04
470	300168	万达信息	5,500	46,365.00	0.04
471	600528	中铁工业	6,076	46,359.88	0.04
472	600535	天士力	4,262	45,859.12	0.04
473	601995	中金公司	1,200	45,756.00	0.04
474	002124	天邦食品	7,440	45,458.40	0.04
475	600066	宇通客车	6,034	45,315.34	0.04
476	600498	烽火通信	3,445	45,267.30	0.04
477	688099	晶晨股份	641	45,196.91	0.04
478	000519	中兵红箭	2,300	45,172.00	0.04
479	000012	南玻 A	6,700	44,957.00	0.04
480	300482	万孚生物	1,410	44,936.70	0.04
481	002373	千方科技	5,000	44,600.00	0.04
482	600755	厦门国贸	6,240	44,553.60	0.04
483	600827	百联股份	3,676	44,553.12	0.04
484	002032	苏泊尔	900	44,514.00	0.04
485	603000	人民网	2,630	44,368.10	0.04
486	600918	中泰证券	6,900	44,229.00	0.04
487	600839	四川长虹	16,700	44,088.00	0.04
488	000401	冀东水泥	5,299	43,610.77	0.04
489	601872	招商轮船	7,760	43,378.40	0.04
490	000581	威孚高科	2,444	43,332.12	0.04

491	601865	福莱特	1,300	43,303.00	0.04
492	002690	美亚光电	1,810	43,259.00	0.04
493	000709	河钢股份	19,047	43,046.22	0.04
494	601179	中国西电	9,300	42,873.00	0.04
495	002153	石基信息	2,859	42,856.41	0.04
496	300182	捷成股份	9,500	42,465.00	0.04
497	002396	星网锐捷	2,200	42,152.00	0.04
498	300115	长盈精密	4,052	41,857.16	0.04
499	603707	健友股份	2,311	41,690.44	0.04
500	002019	亿帆医药	3,400	41,650.00	0.04
501	002221	东华能源	5,414	41,308.82	0.04
502	600567	山鹰国际	16,600	41,168.00	0.04
503	300001	特锐德	2,700	41,067.00	0.04
504	600895	张江高科	3,589	40,699.26	0.04
505	600718	东软集团	4,059	40,387.05	0.04
506	600297	广汇汽车	19,200	40,320.00	0.04
507	000598	兴蓉环境	8,195	40,073.55	0.04
508	300618	寒锐钴业	1,000	40,050.00	0.04
509	000778	新兴铸管	10,882	39,719.30	0.04
510	601990	南京证券	5,000	39,650.00	0.04
511	000089	深圳机场	5,000	39,300.00	0.03
512	002065	东华软件	6,872	38,895.52	0.03
513	002938	鹏鼎控股	1,400	38,416.00	0.03
514	002468	申通快递	3,700	38,221.00	0.03
515	600155	华创阳安	5,800	37,700.00	0.03
516	600216	浙江医药	3,209	37,513.21	0.03
517	300212	易华录	1,820	37,146.20	0.03
518	600064	南京高科	5,592	36,963.12	0.03
519	600597	光明乳业	3,412	36,713.12	0.03
520	600667	太极实业	7,100	36,636.00	0.03
521	002939	长城证券	4,300	35,604.00	0.03
522	002429	兆驰股份	10,200	35,598.00	0.03
523	300223	北京君正	500	35,220.00	0.03
524	600959	江苏有线	11,760	34,927.20	0.03
525	600546	山煤国际	2,400	34,776.00	0.03
526	600728	佳都科技	6,500	34,320.00	0.03
527	000800	一汽解放	4,400	34,012.00	0.03
528	601098	中南传媒	3,400	33,932.00	0.03
529	601118	海南橡胶	7,700	33,726.00	0.03
530	603816	顾家家居	780	33,313.80	0.03
531	300630	普利制药	1,331	32,822.46	0.03
532	600967	内蒙一机	3,968	32,775.68	0.03
533	601898	中煤能源	3,800	32,756.00	0.03



534	688363	华熙生物	239	32,331.92	0.03
535	603737	三棵树	280	31,872.40	0.03
536	000402	金融街	6,000	31,500.00	0.03
537	002281	光迅科技	1,982	31,157.04	0.03
538	600808	马钢股份	11,000	30,910.00	0.03
539	001914	招商积余	2,000	30,760.00	0.03
540	688009	中国通号	6,296	30,157.84	0.03
541	002081	金螳螂	6,142	29,788.70	0.03
542	002683	广东宏大	1,100	29,656.00	0.03
543	000932	华菱钢铁	6,200	29,140.00	0.03
544	002299	圣农发展	1,200	28,428.00	0.03
545	688561	奇安信	428	28,149.56	0.03
546	002430	杭氧股份	700	27,552.00	0.02
547	000415	渤海租赁	12,300	27,183.00	0.02
548	600167	联美控股	4,300	27,176.00	0.02
549	300308	中际旭创	1,000	27,030.00	0.02
550	000156	华数传媒	3,600	26,964.00	0.02
551	002110	三钢闽光	5,700	26,790.00	0.02
552	300919	中伟股份	400	26,244.00	0.02
553	002568	百润股份	700	26,152.00	0.02
554	000830	鲁西化工	2,100	26,019.00	0.02
555	688002	睿创微纳	694	25,809.86	0.02
556	000738	航发控制	1,000	25,640.00	0.02
557	600126	杭钢股份	6,200	25,606.00	0.02
558	600985	淮北矿业	2,000	25,600.00	0.02
559	000877	天山股份	2,992	25,491.84	0.02
560	000656	金科股份	13,271	25,347.61	0.02
561	300363	博腾股份	600	24,510.00	0.02
562	603228	景旺电子	1,200	24,288.00	0.02
563	002600	领益智造	5,300	24,062.00	0.02
564	000031	大悦城	6,300	23,688.00	0.02
565	002242	九阳股份	1,417	23,352.16	0.02
566	601016	节能风电	6,110	23,279.10	0.02
567	002399	海普瑞	1,801	23,142.85	0.02
568	688256	寒武纪	422	23,024.32	0.02
569	688521	芯原股份	519	22,872.33	0.02
570	002444	巨星科技	1,200	22,776.00	0.02
571	688065	凯赛生物	369	22,616.01	0.02
572	000961	中南建设	9,775	21,407.25	0.02
573	002146	荣盛发展	9,674	20,992.58	0.02
574	300676	华大基因	400	20,676.00	0.02
575	603568	伟明环保	1,100	20,383.00	0.02
576	603267	鸿远电子	200	20,232.00	0.02

577	603868	飞科电器	300	20,199.00	0.02
578	002409	雅克科技	400	20,148.00	0.02
579	000831	中国稀土	600	19,728.00	0.02
580	002326	永太科技	900	19,647.00	0.02
581	000062	深圳华强	1,600	19,536.00	0.02
582	002372	伟星新材	900	19,206.00	0.02
583	002506	协鑫集成	6,400	18,624.00	0.02
584	603026	胜华新材	200	18,460.00	0.02
585	000408	藏格矿业	700	18,179.00	0.02
586	002092	中泰化学	2,400	17,904.00	0.02
587	600372	中航电子	1,100	17,567.00	0.02
588	000887	中鼎股份	1,200	17,364.00	0.02
589	300474	景嘉微	300	16,371.00	0.01
590	603127	昭衍新药	280	16,354.80	0.01
591	600316	洪都航空	600	15,114.00	0.01
592	300957	贝泰妮	100	14,924.00	0.01
593	601717	郑煤机	1,300	14,508.00	0.01
594	603195	公牛集团	100	14,326.00	0.01
595	688088	虹软科技	630	14,181.30	0.01
596	601866	中远海发	5,700	13,794.00	0.01
597	002966	苏州银行	1,700	13,226.00	0.01
598	002936	郑州银行	4,800	11,280.00	0.01
599	002408	齐翔腾达	1,600	11,264.00	0.01
600	600025	华能水电	1,700	11,220.00	0.01
601	600970	中材国际	1,300	11,076.00	0.01
602	002244	滨江集团	1,200	10,596.00	0.01
603	603712	七一二	300	10,476.00	0.01
604	600863	内蒙华电	3,000	10,470.00	0.01
605	300832	新产业	200	10,028.00	0.01
606	600737	中粮糖业	1,400	9,716.00	0.01
607	601236	红塔证券	1,300	9,620.00	0.01
608	601577	长沙银行	1,200	8,112.00	0.01
609	601456	国联证券	700	7,875.00	0.01
610	300677	英科医疗	180	3,785.40	0.00
611	600409	三友化工	500	3,305.00	0.00
612	603638	艾迪精密	220	3,282.40	0.00

### 8.3.2 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	638,430.40	0.57
2	600703	三安光电	15,558	266,975.28	0.24
3	300862	蓝盾光电	7,343	172,046.49	0.15
4	000799	酒鬼酒	1,200	165,528.00	0.15

5	600779	水井坊	1,400	118,188.00	0.10
6	600004	白云机场	7,700	115,577.00	0.10
7	002317	众生药业	4,282	115,571.18	0.10
8	601099	太平洋	43,800	112,566.00	0.10
9	002463	沪电股份	8,861	105,445.90	0.09
10	601018	宁波港	29,451	105,434.58	0.09
11	600583	海油工程	16,248	98,462.88	0.09
12	601727	上海电气	22,568	88,917.92	0.08
13	600977	中国电影	5,800	78,880.00	0.07
14	688076	诺泰生物	3,084	70,746.96	0.06
15	000860	顺鑫农业	2,311	68,914.02	0.06
16	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.06
17	002807	江阴银行	16,100	63,917.00	0.06
18	600273	嘉化能源	7,500	62,775.00	0.06
19	688400	凌云光	2,441	61,659.66	0.05
20	002456	欧菲光	12,555	59,134.05	0.05
21	300002	神州泰岳	13,135	57,005.90	0.05
22	688409	富创精密	548	55,063.04	0.05
23	600881	亚泰集团	21,231	50,954.40	0.05
24	688306	均普智能	10,675	50,706.25	0.05
25	000627	天茂集团	14,700	46,452.00	0.04
26	601127	赛力斯	1,100	43,989.00	0.04
27	000078	海王生物	12,500	41,500.00	0.04
28	688496	清越科技	4,400	38,236.00	0.03
29	000681	视觉中国	3,000	36,900.00	0.03
30	600410	华胜天成	7,396	36,166.44	0.03
31	002217	合力泰	13,900	35,445.00	0.03
32	603888	新华网	2,000	34,760.00	0.03
33	688525	佰维存储	2,092	33,597.52	0.03
34	688480	赛恩斯	1,611	33,541.02	0.03
35	600094	大名城	10,600	33,178.00	0.03
36	002558	巨人网络	4,000	31,840.00	0.03
37	002773	康弘药业	2,000	31,380.00	0.03
38	000061	农产品	5,200	29,640.00	0.03
39	300113	顺网科技	2,800	29,148.00	0.03
40	600340	华夏幸福	10,149	25,473.99	0.02
41	300010	豆神教育	4,900	21,315.00	0.02
42	000008	神州高铁	6,200	14,260.00	0.01
43	605377	华旺科技	140	3,435.60	0.00
44	600267	海正药业	17	187.34	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	300750	宁德时代	3,351,228.00	2.14
2	300760	迈瑞医疗	705,901.00	0.45
3	600938	中国海油	648,021.60	0.41
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	300763	锦浪科技	144,375.00	0.09
16	688428	诺诚健华	141,923.01	0.09
17	002497	雅化集团	139,443.00	0.09
18	603613	国联股份	137,215.55	0.09
19	600030	中信证券	136,401.70	0.09
20	600188	兖矿能源	132,093.00	0.08

#### 8.4.2 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	600522	中天科技	277,822.56	0.18
11	002594	比亚迪	273,153.00	0.17
12	600938	中国海油	267,840.00	0.17
13	600030	中信证券	224,485.00	0.14
14	600256	广汇能源	217,686.00	0.14
15	600438	通威股份	217,103.00	0.14
16	002340	格林美	197,926.00	0.13
17	601888	中国中免	193,794.00	0.12

18	000002	万 科 A	189,320.00	0.12
19	600884	杉杉股份	186,270.40	0.12
20	600048	保利发展	184,591.00	0.12

#### 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	17,787,035.85
卖出股票收入（成交）总额	31,533,867.21

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	2,228,249.81	1.98
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）	81,740.69	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,309,990.50	2.05

#### 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	019674	22 国债 09	22,000	2,228,249.81	1.98
2	113062	常银转债	270	30,457.98	0.03
3	127058	科伦转债	143	22,736.53	0.02
4	127073	天赐转债	122	14,852.98	0.01
5	113661	福 22 转债	80	10,072.60	0.01

#### 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

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 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。

## 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 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 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

#### 1、招商银行

2022 年 3 月 25 日，银保监罚决字〔2022〕21 号显示，招商银行股份有限公司存在不良贷款余额 EAST 数据存在偏差等 13 项违法违规事实，被处罚款 300 万元。2022 年 11 月 4 日，银保监罚决字〔2022〕48 号显示，招商银行股份有限公司存在个人经营贷款挪用至房地产市场等 3 项违法违规事实，被处罚款 460 万元。2022 年 12 月 30 日，银罚决字〔2022〕1 号显示，招商银行股份有限公司存在违反账户管理规定等 13 项违法违规事实，被处警告，没收违法所得 5.692641 万元，罚款 3,423.5 万元。对以上事件，本基金判断，招商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。

#### 2、兴业银行

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。2022 年 10 月 28 日，银保监罚决字〔2022〕50 号显示，兴业银行股份有限公司理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹等 5 项违法违规事实，被处罚款 450 万元。2022 年 11 月 4 日，银保监罚决字〔2022〕41 号显示，兴业银行股份有限公司存在债券承销业务严重违反审慎经营规则的违法违规事实，被处罚款 150 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。

### 8.12.2 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。

## 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	5,784.06
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	77,708.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	83,492.69

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127058	科伦转债	22,736.53	0.02
2	127061	美锦转债	3,620.60	0.00

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 8.12.5.1 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不存在流通受限情况。

## 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 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 (%)
6,260	12,003.74	22,587,202.19	30.06	52,556,213.60	69.94

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	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	8.6863
2	王飞舟	1,677,417.00	3.9075
3	靳宁卿	980,300.00	2.2836
4	纪伟才	938,029.00	2.1851
5	于成福	932,390.00	2.1720
6	于君	711,529.00	1.6575
7	于延年	499,916.00	1.1645
8	符王莹月	466,006.00	1.0855
9	陈雁金	466,006.00	1.0855
10	肖诚	437,235.00	1.0185

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	19,048.59	0.0253

### 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、基金投资和研发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 (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	4,588,487.18
减：本报告期基金总赎回份额	14,659,612.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	75,143,415.79

## § 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



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。

#### 11.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 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

本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动情况。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、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。本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元, 已连续提供审计服务 14 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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 7 月 19 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	对子公司管控不严格
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	不适用
其他	-

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 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 (%)	
长江证券	1	23,975,124.26	53.12	22,327.96	53.12	-
东北证券	1	11,533,513.71	25.55	10,741.54	25.56	-
光大证券	1	7,956,640.80	17.63	7,410.05	17.63	-
海通证券	1	1,422,602.70	3.15	1,324.87	3.15	-
招商证券	2	248,871.64	0.55	227.40	0.54	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	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	-	-	-	-	-

### 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 (%)
长江证券	2,553,272.30	98.75	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	32,435.88	1.25	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
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) 资质雄厚，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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	东方证券	深圳	1

## 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 01 月 01 日
2	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 01 月 14 日
3	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 01 月 22 日
4	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北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 02 月 28 日
5	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 03 月 04 日
6	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 03 月 09 日
7	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 03 月 25 日
8	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 03 月 31 日
9	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 04 月 22 日
10	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 05 月 27 日
11	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 05 月 31 日
12	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 06 月 13 日
13	长盛基金管理有限公司关于旗	中国证监会指定披	2022 年 06 月 20

	下基金参加华安证券费率优惠活动的公告	露媒介	日
14	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 06 月 22 日
15	长盛基金管理有限公司关于部分基金增加代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 08 日
16	长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 20 日
17	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年中期报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 08 月 27 日
18	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加中泰证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 09 月 28 日
19	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加攀赢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	2022 年 10 月 19 日
20	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加兴业银行银银平台为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 10 月 25 日
21	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2022 年第 3 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 10 月 26 日
22	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加国新证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 11 月 09 日
23	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加平安银行为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 12 月 09 日
24	长盛基金管理有限公司关于增加华宝证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投业务与转换业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 12 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

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		间区间					
机构	1	20220101~20221231	18,495,067.82	0.00	0.00	18,495,067.82	24.61

#### 产品特有风险

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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据公司第八届董事会相关会议决议，选举胡甲先生担任公司董事长，同时代行公司总经理职务，代行总经理职务期限不超 6 个月；高民和先生不再担任公司董事长，周兵先生不再担任公司总经理职务。公司已按规定向相关监管机构报备并进行公告。本次高管变更属于公司管理层正常变动，符合《中华人民共和国公司法》《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》《长盛基金管理有限公司章程》的有关规定，对公司经营管理及基金份额持有人的合法权益无实质性影响。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 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

2023 年 3 月 31 日