

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金  
(LOF)  
2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 30 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 2023 年 08 月 29 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现</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
<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	10
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)</b>	<b>13</b>
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	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55

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 .....	56
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 .....	56
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 .....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
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 .....	58
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
10.8 其他重大事件 .....	62
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</b>
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 .....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	64
12.3 查阅方式 .....	64

## § 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	56,585,711.20 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	胡甲	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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	438,419.61
本期利润	2,730,581.26
加权平均基金份额本期利润	0.0391
本期加权平均净值利润率	2.50%
本期基金份额净值增长率	1.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	25,618,664.71
期末可供分配基金份额利润	0.4527
期末基金资产净值	86,062,335.79
期末基金份额净值	1.521
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.85%

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	1.40%	0.81%	0.61%	0.82%	0.79%	-0.01%
过去三个月	-3.80%	0.76%	-4.93%	0.76%	1.13%	0.00%
过去六个月	1.54%	0.76%	0.07%	0.76%	1.47%	0.00%
过去一年	-9.79%	0.90%	-11.88%	0.90%	2.09%	0.00%
过去三年	16.56%	1.10%	-4.78%	1.10%	21.34%	0.00%
自基金转型起至今	10.85%	1.40%	-23.60%	1.35%	34.45%	0.05%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

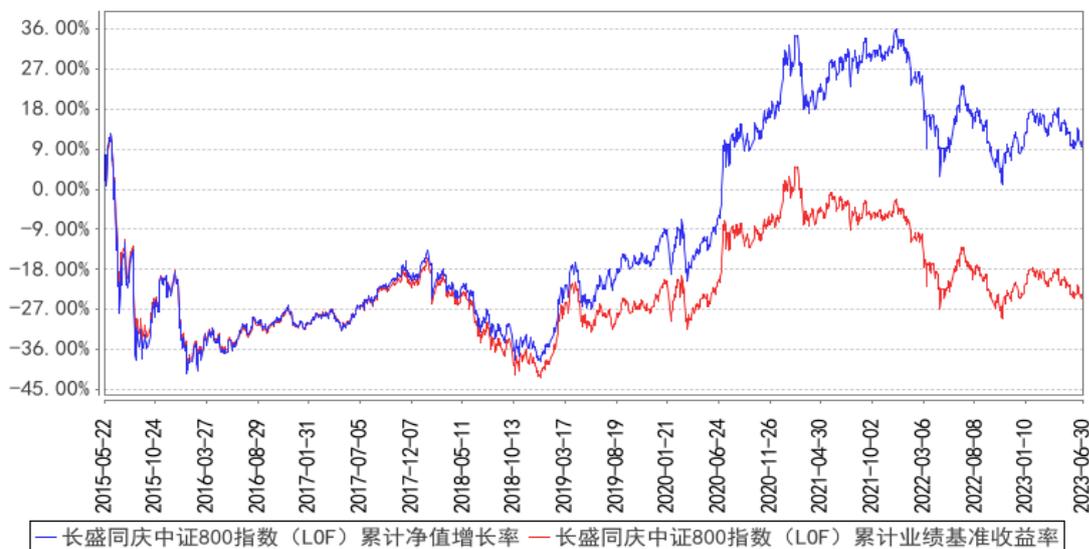
本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率 (税后)}$

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。

## § 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 (DBS) 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 2023 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	2019 年 5 月 30 日	-	14 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。

	<p>50 指数 证券投资 基金 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 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 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</p>				
--	---	--	--	--	--

	混合型证券投资基金基金经理。				
--	----------------	--	--	--	--

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

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券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

2023 年上半年，A 股市场整体呈现震荡格局，板块分化剧烈并且行业轮动迅猛。去年底受到经济修复至常态的预期引导而快速反弹的消费相关板块走势乏力，缺乏宏观经济数据和政策力度的支持，居民超额储蓄的内部不平衡的结构和蕴含的低风险偏好依然未见起色。三架马车中的出口增速的中期展望亦显疲软，市场对政府投资及采购的发力和落地的预期较高，叠加一带一路大外交的破局，带动了大基建、信创、数据资产板块的行情持续发酵。随着三月份 chatgpt 新版本的推出，投资者对于技术革命的热情在多年沉寂后重被点燃，TMT 板块的未来预期被全面打开。二季度 A 股延续了一季度启动的重点板块行情，即红利低估性质的央国企价值重估走势和强成长预期的人工智能相关板块的突围。市场既追求远期的成长性，又不忘当下的分红安全性，这两者并存所带来杠铃型行情在一定程度上反应了对经济增长的不确定性的担忧。

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 1.521 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.54%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0122%，年度化跟踪误差为 0.9759%。

## 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 年下半年，目前能观察到大国外交关系有解冻趋缓的态势并且市场对经济政策的预期开始增强，譬如促进新能源汽车、储能和电网建设的政策频频发力，管理层对于人工智能相关产业链高度重视并鼓励前瞻布局等。虽然下半年的国内经济可能还会处于夯实底部阶段，但库存去化开始进入后半程。我们预计美联储即便停止加息，但美国经济自然回落可能仍将美元的实际利率维持在显著的 1%-2% 的水平到四季度，这对中美息差收窄和外资流入仍有一定压制作用，并且国内的风险偏好重新上升仍需等待政策的进一步发力。真正的重大机会或许来自供给侧的一定程度的调整出清配合需求侧的有力支持从而两者达到较为平衡的状态之时。柳暗花明总在峰回路

转处，若干年后回头看这也许是国内经济迈向高质量发展、打开更广阔天地的转型途中一次短暂的波折。我们更需要耐心等待，在投资上转变追求短平快的心态，戒急用忍方能行稳致远。

#### 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中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期内未实施利润分配。

截至 2023 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 25,618,664.71 元，其中，未分配利润已实现部分为 101,903,306.52 元，未分配利润未实现部分为 -76,284,641.81 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合规守信情况声明

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合规守信、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 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,562,926.55	6,006,344.44
结算备付金		-	-
存出保证金		6,105.89	5,784.06
交易性金融资产	6.4.7.2	80,575,665.51	107,725,569.99
其中：股票投资		80,533,444.59	105,415,579.49
基金投资		-	-
债券投资		42,220.92	2,309,990.50
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	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,054.81	77,708.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		87,153,752.76	113,815,407.12
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		29,467.96	94,577.87
应付管理人报酬		70,816.53	96,978.13
应付托管费		15,579.64	21,335.17
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	6.4.7.9	975,552.84	1,040,364.15
负债合计		1,091,416.97	1,253,255.32
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	60,443,671.08	80,273,634.05
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	25,618,664.71	32,288,517.75
净资产合计		86,062,335.79	112,562,151.80
负债和净资产总计		87,153,752.76	113,815,407.12

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.521 元，基金份额总额 56,585,711.20 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022
-----	-----	----------------------------	---------------------------------

		年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		3,483,967.54	-12,366,360.52
1. 利息收入		11,673.07	16,285.78
其中：存款利息收入	6.4.7.13	11,673.07	16,285.78
债券利息收入		-	-
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）		1,175,801.74	3,187,826.94
其中：股票投资收益	6.4.7.14	186,389.34	1,817,931.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	25,379.49	64,687.19
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	964,032.91	1,305,207.90
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）	6.4.7.20	2,292,161.65	-15,575,209.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	4,331.08	4,736.70
<b>减：二、营业总支出</b>		753,386.28	929,356.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	543,976.37	688,122.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	119,674.74	151,386.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.02	0.05
8. 其他费用	6.4.7.23	89,735.15	89,846.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,730,581.26	-13,295,716.82

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,730,581.26	-13,295,716.82
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		2,730,581.26	-13,295,716.82

### 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	80,273,634.05	-	32,288,517.75	112,562,151.80
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）	80,273,634.05	-	32,288,517.75	112,562,151.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,829,962.97	-	-6,669,853.04	-26,499,816.01
（一）、综合收益总额	-	-	2,730,581.26	2,730,581.26
（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）	-19,829,962.97	-	-9,400,434.30	-29,230,397.27
其中：1. 基金申购款	2,706,027.39	-	1,259,715.14	3,965,742.53
2. 基金赎回款	-22,535,990.36	-	-10,660,149.44	-33,196,139.80
（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)	60,443,671.08	-	25,618,664.71	86,062,335.79
项目	上年度可比期间 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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>胡甲</u>	<u>刁俊东</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

根据原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金在分级运作期内的基金份额包括长盛同庆中证 800 分级份额(以下简称“同庆分级份额”)、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“同庆 800A”)以及长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“同庆 800B”)。原基金在分级运作期届满后，根据同庆 800A 和同庆 800B 基金份额转换比例对基金份额持有人基金份额转换基准日登记在册的基金份额实施转换，按照本基金基金合同参考净值计算规则分别对同庆 800A 份额和同庆 800B 份额计算分级运作期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、《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》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,

其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	6,562,926.55
等于：本金	6,562,353.74
加：应计利息	572.81
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	6,562,926.55

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	83,422,805.36	-	80,533,444.59	-2,889,360.77

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	29,700.00	32.54	42,220.92	12,488.38
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	29,700.00	32.54	42,220.92	12,488.38
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	83,452,505.36	32.54	80,575,665.51	-2,876,872.39	

#### 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 债权投资

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

无。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	102.63
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	28,653.27
其中：交易所市场	28,653.27
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15

其他	857,536.79
合计	975,552.84

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	75,143,415.79	80,273,634.05
本期申购	2,533,112.75	2,706,027.39
本期赎回 (以“-”号填列)	-21,090,817.34	-22,535,990.36
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	56,585,711.20	60,443,671.08

注：1、申购含转换入；赎回含转换出。

2、截至 2023 年 6 月 30 日，本基金于深交所上市的基金份额为 42,225,275.00 份 (2022 年 12 月 31 日：42,928,440.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 14,360,436.20 份 (2022 年 12 月 31 日：32,214,975.79 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。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 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
上年度末	134,760,732.85	-102,472,215.10	32,288,517.75
本期利润	438,419.61	2,292,161.65	2,730,581.26
本期基金份额交易产生的变动数	-33,295,845.94	23,895,411.64	-9,400,434.30
其中：基金申购款	4,545,668.35	-3,285,953.21	1,259,715.14
基金赎回款	-37,841,514.29	27,181,364.85	-10,660,149.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	101,903,306.52	-76,284,641.81	25,618,664.71

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	11,658.06

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	-
其他	15.01
合计	11,673.07

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	186,389.34
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	186,389.34

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	30,158,654.05
减：卖出股票成本总额	29,908,966.95
减：交易费用	63,297.76
买卖股票差价收入	186,389.34

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	13,384.48
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	11,995.01
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	25,379.49

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,294,948.34
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,240,242.00
减：应计利息总额	42,709.22
减：交易费用	2.11
买卖债券差价收入	11,995.01

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	964,032.91
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	964,032.91

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	2,292,161.65
股票投资	2,296,125.92
债券投资	-3,964.27
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	2,292,161.65

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,321.54
基金转换费收入	9.54
合计	4,331.08

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。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	475.00
合计	89,735.15

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	543,976.37	688,122.66
其中：支付销售机构的客户维护费	60,236.77	60,601.61

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	119,674.74	151,386.97

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固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固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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	6,562,926.55	11,658.06	6,208,176.31	16,213.75
合计	6,562,926.55	11,658.06	6,208,176.31	16,213.75

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（2023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
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	限售期锁定	6.58	8.18	354	2,329.32	2,895.72	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	限售期锁定	10.36	12.59	127	1,315.72	1,598.93	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	限售期锁定	11.66	13.72	115	1,340.90	1,577.80	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	限售期锁定	25.98	26.51	41	1,065.18	1,086.91	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	限售期锁定	15.90	18.25	96	1,526.40	1,752.00	-

603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	限售期 锁定	14.58	16.68	90	1,312.20	1,501.20	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	限售期 锁定	19.86	18.07	704	13,981.44	12,721.28	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	限售期 锁定	12.10	12.63	343	4,150.30	4,332.09	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	限售期 锁定	23.60	78.84	90	2,124.00	7,095.60	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	限售期 锁定	75.00	90.95	47	3,525.00	4,274.65	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	限售期 锁定	5.69	5.45	1,270	7,226.30	6,921.50	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	限售期 锁定	33.99	29.83	86	2,923.14	2,565.38	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	限售期 锁定	39.99	38.64	124	4,958.76	4,791.36	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	限售期 锁定	35.00	54.75	78	2,730.00	4,270.50	-
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	限售期 锁定	21.17	24.18	171	3,620.07	4,134.78	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	限售期 锁定	12.68	25.35	241	3,055.88	6,109.35	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	限售期 锁定	11.18	16.26	219	2,448.42	3,560.94	-

注：1、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。

2、本基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、本基金可作为特定投资者，参与上市公司公开或非公开发行股份认购。本基金可作为特定投资

者所认购的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

4、本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。本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。

5、本基金可以通过网下发行获配的创业板股票。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，安排获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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 2023 年 6 月 30 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.05% (2022 年 12 月 31 日：0.07%)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 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股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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 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 2023 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 2023 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	6,562,353.74	-	-	572.81	6,562,926.55
存出保证金	6,103.37	-	-	2.52	6,105.89
交易性金融资产	35,321.76	-	6,866.62	80,533,477.13	80,575,665.51
应收申购款	-	-	-	9,054.81	9,054.81
资产总计	6,603,778.87	-	6,866.62	80,543,107.27	87,153,752.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,467.96	29,467.96
应付管理人报酬	-	-	-	70,816.53	70,816.53
应付托管费	-	-	-	15,579.64	15,579.64
其他负债	-	-	-	975,552.84	975,552.84
负债总计	-	-	-	1,091,416.97	1,091,416.97
利率敏感度缺口	6,603,778.87	-	6,866.62	79,451,690.30	86,062,335.79
上年度末 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

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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为

0.05%(2022 年 12 月 31 日: 2.05%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	80,533,444.59	93.58	105,415,579.49	93.65
合计	80,533,444.59	93.58	105,415,579.49	93.65

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的	

	动	影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准 (附注 6.4.1) 上升 5%	4,283,224.34	5,596,496.20
	2. 业绩比较基准 (附注 6.4.1) 下降 5%	-4,283,224.34	-5,596,496.20

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	80,504,475.52	105,245,006.71
第二层次	-	2,292,063.56
第三层次	71,189.99	188,499.72
合计	80,575,665.51	107,725,569.99

###### 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，确定相关股票和债券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 2023 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 (2022 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	80,533,444.59	92.40
	其中：股票	80,533,444.59	92.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	42,220.92	0.05
	其中：债券	42,220.92	0.05
	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	6,562,926.55	7.53
8	其他各项资产	15,160.70	0.02
9	合计	87,153,752.76	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	890,849.25	1.04
B	采矿业	2,661,713.82	3.09
C	制造业	44,440,028.51	51.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	2,274,386.88	2.64

	业		
E	建筑业	1,842,167.04	2.14
F	批发和零售业	890,090.12	1.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,865,790.71	2.17
H	住宿和餐饮业	21,170.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,513,522.72	5.24
J	金融业	14,264,371.90	16.57
K	房地产业	1,249,853.54	1.45
L	租赁和商务服务业	817,002.22	0.95
M	科学研究和技术服务业	791,758.88	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	58,676.52	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	520,084.15	0.60
R	文化、体育和娱乐业	349,852.26	0.41
S	综合	153,730.86	0.18
	合计	77,605,049.38	90.17

### 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	646,676.04	0.75
C	制造业	1,363,719.05	1.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,329.80	0.00
F	批发和零售业	33,485.72	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	158,263.89	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	328,448.05	0.38
J	金融业	163,716.00	0.19
K	房地产业	52,803.10	0.06
L	租赁和商务服务业	23,960.00	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	49,876.56	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	104,117.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	2,928,395.21	3.40

### 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	2,303	3,894,373.00	4.53
2	300750	宁德时代	8,540	1,953,866.60	2.27
3	601318	中国平安	34,518	1,601,635.20	1.86
4	600036	招商银行	40,616	1,330,580.16	1.55
5	000858	五粮液	6,498	1,062,877.86	1.24
6	000333	美的集团	16,138	950,850.96	1.10
7	002594	比亚迪	3,184	822,331.68	0.96
8	600900	长江电力	36,120	796,807.20	0.93
9	601166	兴业银行	47,671	746,051.15	0.87
10	600276	恒瑞医药	15,002	718,595.80	0.83
11	600030	中信证券	31,824	629,478.72	0.73
12	300059	东方财富	43,394	616,194.80	0.72
13	601012	隆基绿能	21,348	612,047.16	0.71
14	601398	工商银行	123,312	594,363.84	0.69
15	000651	格力电器	15,523	566,744.73	0.66
16	601899	紫金矿业	49,827	566,532.99	0.66
17	601328	交通银行	96,470	559,526.00	0.65
18	002415	海康威视	16,791	555,950.01	0.65
19	002475	立讯精密	17,052	553,337.40	0.64
20	000568	泸州老窖	2,634	552,007.38	0.64
21	300760	迈瑞医疗	1,800	539,640.00	0.63
22	600887	伊利股份	18,334	519,218.88	0.60
23	000725	京东方 A	126,007	515,368.63	0.60
24	000063	中兴通讯	10,762	490,101.48	0.57
25	600309	万华化学	5,379	472,491.36	0.55

26	603259	药明康德	7,268	452,869.08	0.53
27	300274	阳光电源	3,860	450,191.80	0.52
28	002230	科大讯飞	6,450	438,342.00	0.51
29	601668	中国建筑	75,099	431,068.26	0.50
30	300124	汇川技术	6,602	423,914.42	0.49
31	002714	牧原股份	9,895	417,074.25	0.48
32	601288	农业银行	110,167	388,889.51	0.45
33	601888	中国中免	3,412	377,128.36	0.44
34	601816	京沪高铁	70,100	368,726.00	0.43
35	000792	盐湖股份	19,200	368,064.00	0.43
36	000001	平安银行	32,679	366,985.17	0.43
37	601088	中国神华	11,896	365,802.00	0.43
38	601138	工业富联	14,200	357,840.00	0.42
39	600436	片仔癀	1,245	356,518.20	0.41
40	002142	宁波银行	13,766	348,279.80	0.40
41	002129	TCL 中环	10,470	347,604.00	0.40
42	600048	保利发展	26,424	344,304.72	0.40
43	600031	三一重工	20,429	339,734.27	0.39
44	600809	山西汾酒	1,834	339,418.38	0.39
45	002371	北方华创	1,059	336,391.35	0.39
46	300498	温氏股份	18,100	332,135.00	0.39
47	000002	万 科 A	23,654	331,629.08	0.39
48	600406	国电南瑞	14,236	328,851.60	0.38
49	600438	通威股份	9,500	325,945.00	0.38
50	600690	海尔智家	13,672	321,018.56	0.37
51	688981	中芯国际	6,350	320,802.00	0.37
52	600050	中国联通	66,272	318,105.60	0.37
53	601601	中国太保	12,040	312,799.20	0.36
54	600028	中国石化	49,096	312,250.56	0.36
55	600016	民生银行	83,195	311,981.25	0.36
56	300015	爱尔眼科	16,785	311,361.75	0.36
57	600837	海通证券	33,449	308,399.78	0.36
58	600089	特变电工	13,688	305,105.52	0.35
59	002304	洋河股份	2,295	301,448.25	0.35
60	601988	中国银行	77,038	301,218.58	0.35
61	600919	江苏银行	40,820	300,027.00	0.35
62	600000	浦发银行	40,525	293,401.00	0.34
63	002352	顺丰控股	6,500	293,085.00	0.34
64	688111	金山办公	618	291,831.96	0.34
65	601766	中国中车	44,187	287,215.50	0.33
66	601390	中国中铁	37,199	281,968.42	0.33
67	601688	华泰证券	20,291	279,407.07	0.32
68	603288	海天味业	5,840	273,604.00	0.32

69	601857	中国石油	36,231	270,645.57	0.31
70	002466	天齐锂业	3,861	269,922.51	0.31
71	601225	陕西煤业	14,492	263,609.48	0.31
72	002460	赣锋锂业	4,240	258,470.40	0.30
73	002027	分众传媒	37,700	256,737.00	0.30
74	603501	韦尔股份	2,610	255,884.40	0.30
75	603986	兆易创新	2,400	255,000.00	0.30
76	601169	北京银行	54,794	253,696.22	0.29
77	600570	恒生电子	5,646	250,061.34	0.29
78	000938	紫光股份	7,602	242,123.70	0.28
79	300014	亿纬锂能	4,000	242,000.00	0.28
80	600104	上汽集团	17,066	241,825.22	0.28
81	600150	中国船舶	7,200	236,952.00	0.28
82	000338	潍柴动力	19,006	236,814.76	0.28
83	601211	国泰君安	16,800	235,032.00	0.27
84	000625	长安汽车	17,498	226,249.14	0.26
85	000100	TCL 科技	57,227	225,474.38	0.26
86	603019	中科曙光	4,400	223,960.00	0.26
87	300308	中际旭创	1,500	221,175.00	0.26
88	601229	上海银行	37,969	218,321.75	0.25
89	688012	中微公司	1,391	217,621.95	0.25
90	600660	福耀玻璃	5,953	213,415.05	0.25
91	002709	天赐材料	5,180	213,364.20	0.25
92	601919	中远海控	22,190	208,586.00	0.24
93	600585	海螺水泥	8,551	203,000.74	0.24
94	600905	三峡能源	37,800	202,986.00	0.24
95	600111	北方稀土	8,383	201,024.34	0.23
96	601628	中国人寿	5,747	200,915.12	0.23
97	603799	华友钴业	4,307	197,734.37	0.23
98	600941	中国移动	2,100	195,930.00	0.23
99	002049	紫光国微	2,100	195,825.00	0.23
100	002459	晶澳科技	4,676	194,989.20	0.23
101	002271	东方雨虹	7,150	194,909.00	0.23
102	600019	宝钢股份	34,459	193,659.58	0.23
103	002050	三花智控	6,378	192,998.28	0.22
104	002812	恩捷股份	2,000	192,700.00	0.22
105	601818	光大银行	61,196	187,871.72	0.22
106	600999	招商证券	13,800	187,266.00	0.22
107	600958	东方证券	19,140	185,658.00	0.22
108	300122	智飞生物	4,200	185,640.00	0.22
109	601985	中国核电	26,288	185,330.40	0.22
110	600760	中航沈飞	4,116	185,220.00	0.22
111	601989	中国重工	38,426	185,213.32	0.22

112	600893	航发动力	4,326	182,816.76	0.21
113	000977	浪潮信息	3,574	173,339.00	0.20
114	000661	长春高新	1,268	172,828.40	0.20
115	002410	广联达	5,097	165,601.53	0.19
116	601669	中国电建	28,488	163,521.12	0.19
117	601728	中国电信	28,900	162,707.00	0.19
118	002555	三七互娱	4,600	160,448.00	0.19
119	601009	南京银行	20,001	160,008.00	0.19
120	600009	上海机场	3,504	159,151.68	0.18
121	002179	中航光电	3,489	158,226.15	0.18
122	600426	华鲁恒升	5,139	157,407.57	0.18
123	688599	天合光能	3,673	156,506.53	0.18
124	300142	沃森生物	5,900	156,055.00	0.18
125	300316	晶盛机电	2,200	155,980.00	0.18
126	002920	德赛西威	1,000	155,810.00	0.18
127	601658	邮储银行	31,826	155,629.14	0.18
128	000166	申万宏源	33,351	154,081.62	0.18
129	002241	歌尔股份	8,654	153,608.50	0.18
130	601186	中国铁建	15,551	153,177.35	0.18
131	601600	中国铝业	27,672	151,919.28	0.18
132	601006	大秦铁路	20,228	150,294.04	0.17
133	600547	山东黄金	6,334	148,722.32	0.17
134	600795	国电电力	38,753	148,423.99	0.17
135	000776	广发证券	10,086	148,365.06	0.17
136	601377	兴业证券	23,663	144,817.56	0.17
137	002463	沪电股份	6,761	141,575.34	0.16
138	300450	先导智能	3,900	141,063.00	0.16
139	300418	昆仑万维	3,500	140,980.00	0.16
140	300033	同花顺	800	140,224.00	0.16
141	600085	同仁堂	2,434	140,101.04	0.16
142	001979	招商蛇口	10,736	139,890.08	0.16
143	600845	宝信软件	2,748	139,625.88	0.16
144	600011	华能国际	15,000	138,900.00	0.16
145	603993	洛阳钼业	25,856	137,812.48	0.16
146	600886	国投电力	10,878	137,606.70	0.16
147	603806	福斯特	3,696	137,454.24	0.16
148	600010	包钢股份	76,416	136,784.64	0.16
149	000988	华工科技	3,591	136,493.91	0.16
150	600926	杭州银行	11,500	135,125.00	0.16
151	000963	华东医药	3,079	133,536.23	0.16
152	300896	爱美客	300	133,485.00	0.16
153	600588	用友网络	6,479	132,819.50	0.15
154	601100	恒立液压	2,056	132,262.48	0.15

155	601800	中国交建	12,067	131,650.97	0.15
156	002311	海大集团	2,800	131,152.00	0.15
157	688036	传音控股	891	130,977.00	0.15
158	002493	荣盛石化	11,250	130,950.00	0.15
159	000768	中航西飞	4,791	128,159.25	0.15
160	300347	泰格医药	1,970	127,143.80	0.15
161	000425	徐工机械	18,754	126,964.58	0.15
162	002384	东山精密	4,900	126,910.00	0.15
163	300408	三环集团	4,300	126,205.00	0.15
164	600196	复星医药	4,074	125,886.60	0.15
165	000596	古井贡酒	508	125,669.04	0.15
166	002236	大华股份	6,349	125,392.75	0.15
167	300496	中科创达	1,300	125,255.00	0.15
168	603369	今世缘	2,300	121,440.00	0.14
169	000538	云南白药	2,295	120,441.60	0.14
170	600176	中国巨石	8,404	119,000.64	0.14
171	603659	璞泰来	3,102	118,558.44	0.14
172	000895	双汇发展	4,837	118,458.13	0.14
173	600745	闻泰科技	2,400	117,360.00	0.14
174	000157	中联重科	17,135	115,661.25	0.13
175	000009	中国宝安	9,539	115,135.73	0.13
176	300012	华测检测	5,900	115,050.00	0.13
177	601868	中国能建	48,733	114,035.22	0.13
178	600015	华夏银行	20,863	112,868.83	0.13
179	600674	川投能源	7,418	111,640.90	0.13
180	601618	中国中冶	27,806	110,389.82	0.13
181	002422	科伦药业	3,700	109,816.00	0.13
182	601633	长城汽车	4,325	108,860.25	0.13
183	600600	青岛啤酒	1,050	108,811.50	0.13
184	601336	新华保险	2,959	108,802.43	0.13
185	601788	光大证券	6,800	108,052.00	0.13
186	600584	长电科技	3,355	104,575.35	0.12
187	601877	正泰电器	3,782	104,572.30	0.12
188	600487	亨通光电	7,060	103,499.60	0.12
189	600079	人福医药	3,830	103,180.20	0.12
190	600346	恒力石化	7,200	103,176.00	0.12
191	600029	南方航空	17,082	103,004.46	0.12
192	688396	华润微	1,953	102,356.73	0.12
193	600741	华域汽车	5,533	102,139.18	0.12
194	601117	中国化学	12,300	101,844.00	0.12
195	002202	金风科技	9,561	101,537.82	0.12
196	002001	新和成	6,460	99,484.00	0.12
197	300003	乐普医疗	4,400	99,484.00	0.12

198	300413	芒果超媒	2,900	99,209.00	0.12
199	601360	三六零	7,900	99,066.00	0.12
200	002028	思源电气	2,117	98,906.24	0.11
201	000876	新希望	8,412	98,252.16	0.11
202	603444	吉比特	200	98,222.00	0.11
203	600489	中金黄金	9,413	97,236.29	0.11
204	601066	中信建投	4,000	96,800.00	0.11
205	002074	国轩高科	3,500	96,670.00	0.11
206	600039	四川路桥	9,787	96,010.47	0.11
207	600460	士兰微	3,161	95,683.47	0.11
208	600885	宏发股份	2,980	94,913.00	0.11
209	601555	东吴证券	13,628	94,578.32	0.11
210	601838	成都银行	7,733	94,419.93	0.11
211	000786	北新建材	3,824	93,726.24	0.11
212	688008	澜起科技	1,629	93,537.18	0.11
213	601058	赛轮轮胎	8,200	93,398.00	0.11
214	600536	中国软件	1,992	93,384.96	0.11
215	601901	方正证券	14,204	92,894.16	0.11
216	601607	上海医药	4,137	92,710.17	0.11
217	600132	重庆啤酒	1,000	92,160.00	0.11
218	002821	凯莱英	780	91,930.80	0.11
219	002736	国信证券	10,500	91,665.00	0.11
220	600115	中国东航	19,037	90,616.12	0.11
221	600161	天坛生物	3,239	87,938.85	0.10
222	600989	宝丰能源	6,900	87,009.00	0.10
223	002007	华兰生物	3,830	85,830.30	0.10
224	002624	完美世界	5,050	85,294.50	0.10
225	601111	中国国航	10,224	84,245.76	0.10
226	600352	浙江龙盛	8,962	83,794.70	0.10
227	300058	蓝色光标	8,651	83,655.17	0.10
228	600219	南山铝业	27,500	83,050.00	0.10
229	603882	金城医学	1,100	83,050.00	0.10
230	002385	大北农	12,510	82,566.00	0.10
231	002601	龙佰集团	5,000	82,500.00	0.10
232	300037	新宙邦	1,580	81,986.20	0.10
233	601108	财通证券	11,310	81,884.40	0.10
234	002008	大族激光	3,121	81,770.20	0.10
235	002156	通富微电	3,600	81,360.00	0.09
236	601021	春秋航空	1,400	80,458.00	0.09
237	002841	视源股份	1,200	80,208.00	0.09
238	002195	二三四五	27,743	80,177.27	0.09
239	002185	华天科技	8,700	80,040.00	0.09
240	600415	小商品城	9,373	79,951.69	0.09

241	600332	白云山	2,500	79,700.00	0.09
242	600157	永泰能源	56,000	79,520.00	0.09
243	600482	中国动力	3,390	79,461.60	0.09
244	688256	寒武纪	422	79,336.00	0.09
245	600418	江淮汽车	6,300	79,317.00	0.09
246	300454	深信服	700	79,275.00	0.09
247	000301	东方盛虹	6,700	79,194.00	0.09
248	002223	鱼跃医疗	2,191	78,854.09	0.09
249	300724	捷佳伟创	700	78,645.00	0.09
250	003816	中国广核	25,200	78,372.00	0.09
251	600188	兖矿能源	2,600	77,792.00	0.09
252	601615	明阳智能	4,600	77,648.00	0.09
253	600763	通策医疗	800	77,488.00	0.09
254	600233	圆通速递	5,300	77,168.00	0.09
255	300285	国瓷材料	2,800	76,720.00	0.09
256	300433	蓝思科技	6,500	76,440.00	0.09
257	000783	长江证券	13,094	75,945.20	0.09
258	300024	机器人	4,496	74,948.32	0.09
259	300661	圣邦股份	910	74,738.30	0.09
260	601799	星宇股份	600	74,160.00	0.09
261	600027	华电国际	11,000	73,590.00	0.09
262	600060	海信视像	2,973	73,581.75	0.09
263	300782	卓胜微	760	73,438.80	0.09
264	600862	中航高科	2,900	73,399.00	0.09
265	000021	深科技	3,663	73,223.37	0.09
266	002648	卫星化学	4,846	72,496.16	0.08
267	000630	铜陵有色	24,923	72,027.47	0.08
268	600109	国金证券	8,292	71,891.64	0.08
269	300207	欣旺达	4,400	71,808.00	0.08
270	601995	中金公司	2,000	71,040.00	0.08
271	603833	欧派家居	740	70,892.00	0.08
272	600362	江西铜业	3,735	70,890.30	0.08
273	002252	上海莱士	9,400	70,594.00	0.08
274	600383	金地集团	9,762	70,384.02	0.08
275	600705	中航产融	18,360	70,318.80	0.08
276	600486	扬农化工	800	69,936.00	0.08
277	000975	银泰黄金	5,945	69,556.50	0.08
278	688777	中控技术	1,101	69,120.78	0.08
279	601168	西部矿业	6,563	68,977.13	0.08
280	601233	桐昆股份	5,200	68,900.00	0.08
281	002439	启明星辰	2,300	68,448.00	0.08
282	600066	宇通客车	4,634	68,305.16	0.08
283	300136	信维通信	3,400	68,272.00	0.08

284	300144	宋城演艺	5,500	68,200.00	0.08
285	603939	益丰药房	1,834	67,858.00	0.08
286	300601	康泰生物	2,667	67,715.13	0.08
287	600298	安琪酵母	1,868	67,640.28	0.08
288	688126	沪硅产业	3,214	67,172.60	0.08
289	000069	华侨城 A	15,141	66,620.40	0.08
290	002078	太阳纸业	6,225	66,545.25	0.08
291	002797	第一创业	11,620	66,466.40	0.08
292	600497	驰宏锌锗	13,100	65,762.00	0.08
293	603927	中科软	1,700	65,552.00	0.08
294	600392	盛和资源	5,091	65,521.17	0.08
295	002465	海格通信	6,334	65,493.56	0.08
296	300253	卫宁健康	6,048	65,439.36	0.08
297	601878	浙商证券	6,600	65,208.00	0.08
298	600061	国投资本	9,052	64,450.24	0.07
299	600160	巨化股份	4,669	64,338.82	0.07
300	603589	口子窖	1,300	64,155.00	0.07
301	600879	航天电子	7,548	64,082.52	0.07
302	600153	建发股份	5,864	63,976.24	0.07
303	600839	四川长虹	12,600	63,630.00	0.07
304	002368	太极股份	1,545	63,607.65	0.07
305	601128	常熟银行	9,300	63,426.00	0.07
306	601998	中信银行	10,584	63,292.32	0.07
307	600096	云天化	3,700	63,159.00	0.07
308	600018	上港集团	11,961	62,795.25	0.07
309	603899	晨光股份	1,400	62,496.00	0.07
310	300763	锦浪科技	600	62,460.00	0.07
311	002294	信立泰	2,000	62,380.00	0.07
312	603486	科沃斯	800	62,216.00	0.07
313	600118	中国卫星	2,196	61,949.16	0.07
314	000998	隆平高科	4,000	61,400.00	0.07
315	601319	中国人保	10,500	61,320.00	0.07
316	002268	电科网安	2,200	61,314.00	0.07
317	300759	康龙化成	1,600	61,248.00	0.07
318	600521	华海药业	3,300	60,753.00	0.07
319	600177	雅戈尔	9,584	60,475.04	0.07
320	002497	雅化集团	3,400	60,452.00	0.07
321	300017	网宿科技	8,495	60,399.45	0.07
322	002916	深南电路	800	60,296.00	0.07
323	600699	均胜电子	3,400	59,976.00	0.07
324	000400	许继电气	2,600	59,930.00	0.07
325	000729	燕京啤酒	4,800	59,856.00	0.07
326	603000	人民网	2,030	59,276.00	0.07

327	600549	厦门钨业	3,110	59,183.30	0.07
328	002407	多氟多	2,980	59,182.80	0.07
329	000997	新大陆	3,128	59,119.20	0.07
330	600642	申能股份	8,435	58,960.65	0.07
331	002281	光迅科技	1,582	58,676.38	0.07
332	600325	华发股份	5,936	58,469.60	0.07
333	600183	生益科技	4,109	58,347.80	0.07
334	600511	国药股份	1,485	57,692.25	0.07
335	300088	长信科技	9,520	57,405.60	0.07
336	002138	顺络电子	2,400	57,384.00	0.07
337	600380	健康元	4,500	57,195.00	0.07
338	000629	钒钛股份	14,600	57,086.00	0.07
339	601997	贵阳银行	10,900	56,244.00	0.07
340	300595	欧普康视	1,860	56,153.40	0.07
341	600637	东方明珠	7,065	55,248.30	0.06
342	002673	西部证券	8,700	55,245.00	0.06
343	600143	金发科技	6,321	55,182.33	0.06
344	300146	汤臣倍健	2,286	54,818.28	0.06
345	002180	纳思达	1,600	54,800.00	0.06
346	002507	涪陵榨菜	2,990	54,746.90	0.06
347	688390	固德威	328	54,730.08	0.06
348	000960	锡业股份	3,510	54,580.50	0.06
349	600271	航天信息	3,976	54,431.44	0.06
350	300751	迈为股份	320	54,201.60	0.06
351	688099	晶晨股份	641	54,049.12	0.06
352	600498	烽火通信	2,645	53,878.65	0.06
353	605117	德业股份	360	53,838.00	0.06
354	000623	吉林敖东	3,355	53,814.20	0.06
355	002670	国盛金控	6,100	53,558.00	0.06
356	002056	横店东磁	2,936	53,464.56	0.06
357	601881	中国银河	4,600	53,406.00	0.06
358	000513	丽珠集团	1,372	53,384.52	0.06
359	600166	福田汽车	15,656	53,230.40	0.06
360	601238	广汽集团	5,100	53,142.00	0.06
361	600704	物产中大	10,715	52,932.10	0.06
362	300769	德方纳米	480	52,910.40	0.06
363	002131	利欧股份	22,703	52,216.90	0.06
364	603185	弘元绿能	700	52,185.00	0.06
365	603517	绝味食品	1,400	52,010.00	0.06
366	600580	卧龙电驱	3,548	51,836.28	0.06
367	002373	千方科技	3,800	51,832.00	0.06
368	002203	海亮股份	4,300	51,643.00	0.06
369	600372	中航电子	3,400	51,612.00	0.06

370	000703	恒逸石化	7,607	51,575.46	0.06
371	002353	杰瑞股份	2,038	51,214.94	0.06
372	600170	上海建工	18,996	51,099.24	0.06
373	600998	九州通	4,917	51,038.46	0.06
374	002152	广电运通	4,350	50,982.00	0.06
375	002120	韵达股份	5,300	50,668.00	0.06
376	300073	当升科技	1,000	50,330.00	0.06
377	601077	渝农商行	14,000	50,260.00	0.06
378	600867	通化东宝	4,800	50,112.00	0.06
379	600988	赤峰黄金	3,700	49,802.00	0.06
380	300390	天华新能	1,390	49,762.00	0.06
381	000878	云南铜业	4,500	49,725.00	0.06
382	300296	利亚德	7,600	49,628.00	0.06
383	600820	隧道股份	8,200	49,282.00	0.06
384	601198	东兴证券	6,100	48,922.00	0.06
385	601966	玲珑轮胎	2,200	48,884.00	0.06
386	600739	辽宁成大	3,712	48,812.80	0.06
387	600516	方大炭素	7,871	48,800.20	0.06
388	600859	王府井	2,454	48,564.66	0.06
389	000807	云铝股份	3,800	48,374.00	0.06
390	300244	迪安诊断	1,880	48,184.40	0.06
391	600765	中航重机	1,800	47,718.00	0.06
392	002739	万达电影	3,800	47,652.00	0.06
393	601216	君正集团	11,608	47,592.80	0.06
394	601155	新城控股	3,300	47,553.00	0.06
395	600535	天士力	3,262	47,331.62	0.05
396	300212	易华录	1,420	47,186.60	0.05
397	000027	深圳能源	7,149	47,111.91	0.05
398	603392	万泰生物	704	47,006.08	0.05
399	600909	华安证券	10,020	46,793.40	0.05
400	601162	天风证券	15,700	46,786.00	0.05
401	000636	风华高科	3,036	46,572.24	0.05
402	002926	华西证券	5,600	46,536.00	0.05
403	002508	老板电器	1,839	46,508.31	0.05
404	601611	中国核建	5,500	46,475.00	0.05
405	600529	山东药玻	1,700	46,274.00	0.05
406	600528	中铁工业	4,676	46,198.88	0.05
407	600848	上海临港	3,840	45,888.00	0.05
408	002557	洽洽食品	1,100	45,705.00	0.05
409	000060	中金岭南	9,604	45,619.00	0.05
410	002273	水晶光电	3,814	45,539.16	0.05
411	300182	捷成股份	7,200	45,432.00	0.05
412	000547	航天发展	4,513	45,130.00	0.05

413	000970	中科三环	3,497	44,831.54	0.05
414	002414	高德红外	5,768	44,817.36	0.05
415	002500	山西证券	7,972	44,483.76	0.05
416	603156	养元饮品	1,800	44,460.00	0.05
417	002756	永兴材料	710	44,453.10	0.05
418	300699	光威复材	1,440	44,424.00	0.05
419	300628	亿联网络	1,260	44,188.20	0.05
420	300999	金龙鱼	1,100	43,989.00	0.05
421	600369	西南证券	11,992	43,770.80	0.05
422	300001	特锐德	2,100	43,638.00	0.05
423	688005	容百科技	806	43,540.12	0.05
424	000750	国海证券	12,971	43,452.85	0.05
425	600008	首创环保	15,035	43,300.80	0.05
426	603858	步长制药	2,100	43,239.00	0.05
427	300558	贝达药业	900	43,227.00	0.05
428	603290	斯达半导	200	43,040.00	0.05
429	300070	碧水源	8,007	42,917.52	0.05
430	600038	中直股份	1,075	42,806.50	0.05
431	002429	兆驰股份	7,700	42,350.00	0.05
432	603260	合盛硅业	600	42,012.00	0.05
433	600390	五矿资本	7,800	41,964.00	0.05
434	603160	汇顶科技	900	41,625.00	0.05
435	002625	光启技术	2,700	41,202.00	0.05
436	300009	安科生物	4,120	41,200.00	0.05
437	600563	法拉电子	300	41,190.00	0.05
438	000708	中信特钢	2,600	41,184.00	0.05
439	000050	深天马 A	4,400	40,392.00	0.05
440	300357	我武生物	1,200	40,356.00	0.05
441	601689	拓普集团	500	40,350.00	0.05
442	002572	索菲亚	2,302	40,100.84	0.05
443	002340	格林美	5,800	40,078.00	0.05
444	002032	苏泊尔	800	40,000.00	0.05
445	603233	大参林	1,425	39,914.25	0.05
446	603658	安图生物	760	39,314.80	0.05
447	002153	石基信息	2,807	39,298.00	0.05
448	600667	太极实业	5,400	39,204.00	0.05
449	600348	华阳股份	4,950	39,154.50	0.05
450	600021	上海电力	3,614	38,922.78	0.05
451	600606	绿地控股	14,093	38,755.75	0.05
452	600732	爱旭股份	1,260	38,745.00	0.05
453	600171	上海贝岭	2,120	38,690.00	0.04
454	600673	东阳光	5,353	38,595.13	0.04
455	601865	福莱特	1,000	38,510.00	0.04

456	000733	振华科技	400	38,340.00	0.04
457	000039	中集集团	5,550	38,239.50	0.04
458	002958	青农商行	14,000	38,080.00	0.04
459	002019	亿帆医药	2,600	37,960.00	0.04
460	601179	中国西电	7,000	37,870.00	0.04
461	600282	南钢股份	11,200	37,744.00	0.04
462	600895	张江高科	2,689	37,430.88	0.04
463	688521	芯原股份	519	37,326.48	0.04
464	601696	中银证券	3,500	37,310.00	0.04
465	000739	普洛药业	2,100	37,254.00	0.04
466	600827	百联股份	2,776	37,115.12	0.04
467	600755	厦门国贸	4,740	36,687.60	0.04
468	002831	裕同科技	1,500	36,585.00	0.04
469	002065	东华软件	5,172	36,514.32	0.04
470	600208	新湖中宝	14,687	36,423.76	0.04
471	300115	长盈精密	3,052	36,349.32	0.04
472	002690	美亚光电	1,410	36,307.50	0.04
473	600655	豫园股份	5,289	36,282.54	0.04
474	600918	中泰证券	5,200	35,932.00	0.04
475	601699	潞安环能	2,200	35,904.00	0.04
476	300251	光线传媒	4,414	35,709.26	0.04
477	002221	东华能源	4,114	35,586.10	0.04
478	603885	吉祥航空	2,300	35,489.00	0.04
479	002966	苏州银行	5,400	35,370.00	0.04
480	300223	北京君正	400	35,324.00	0.04
481	002030	达安基因	3,501	34,904.97	0.04
482	601992	金隅集团	16,000	34,880.00	0.04
483	600315	上海家化	1,200	34,812.00	0.04
484	300529	健帆生物	1,500	34,770.00	0.04
485	600598	北大荒	2,600	34,658.00	0.04
486	000598	兴蓉环境	6,295	34,181.85	0.04
487	601005	重庆钢铁	24,400	34,160.00	0.04
488	300026	红日药业	6,300	34,146.00	0.04
489	601872	招商轮船	5,860	33,929.40	0.04
490	600718	东软集团	3,159	33,674.94	0.04
491	600399	抚顺特钢	3,300	33,660.00	0.04
492	000778	新兴铸管	8,182	33,382.56	0.04
493	600141	兴发集团	1,500	33,330.00	0.04
494	000519	中兵红箭	1,800	32,562.00	0.04
495	000709	河钢股份	14,347	32,424.22	0.04
496	600499	科达制造	2,800	31,808.00	0.04
497	600801	华新水泥	2,543	31,406.05	0.04
498	002511	中顺洁柔	2,800	31,220.00	0.04

499	688002	睿创微纳	694	31,091.20	0.04
500	601990	南京证券	3,800	31,084.00	0.04
501	603077	和邦生物	12,700	30,861.00	0.04
502	002738	中矿资源	600	30,564.00	0.04
503	000066	中国长城	2,200	30,426.00	0.04
504	000012	南玻 A	5,100	30,396.00	0.04
505	002468	申通快递	2,800	30,296.00	0.04
506	600959	江苏有线	8,960	30,284.80	0.04
507	601636	旗滨集团	3,500	30,170.00	0.04
508	600297	广汇汽车	14,500	30,160.00	0.04
509	601098	中南传媒	2,600	30,160.00	0.04
510	600967	内蒙一机	2,968	29,976.80	0.03
511	603883	老百姓	996	29,730.60	0.03
512	300482	万孚生物	1,110	29,559.30	0.03
513	000401	冀东水泥	3,999	29,472.63	0.03
514	002409	雅克科技	400	29,152.00	0.03
515	688223	晶科能源	2,070	29,104.20	0.03
516	000581	威孚高科	1,844	29,043.00	0.03
517	000800	一汽解放	3,400	28,458.00	0.03
518	002250	联化科技	2,646	27,677.16	0.03
519	002600	领益智造	4,000	27,640.00	0.03
520	688009	中国通号	4,741	27,497.80	0.03
521	600546	山煤国际	1,900	27,493.00	0.03
522	600155	华创云信	4,400	27,368.00	0.03
523	600597	光明乳业	2,612	27,164.80	0.03
524	300474	景嘉微	300	26,997.00	0.03
525	688303	大全能源	665	26,899.25	0.03
526	002939	长城证券	3,300	26,829.00	0.03
527	000423	东阿阿胶	500	26,725.00	0.03
528	002938	鹏鼎控股	1,100	26,719.00	0.03
529	002683	广东宏大	900	26,496.00	0.03
530	601118	海南橡胶	5,900	26,432.00	0.03
531	000089	深圳机场	3,800	26,410.00	0.03
532	603816	顾家家居	680	25,942.00	0.03
533	300618	寒锐钴业	800	25,928.00	0.03
534	603228	景旺电子	1,000	25,650.00	0.03
535	603737	三棵树	392	25,644.64	0.03
536	603456	九洲药业	900	24,642.00	0.03
537	601898	中煤能源	2,900	24,476.00	0.03
538	603707	健友股份	1,811	24,448.50	0.03
539	600875	东方电气	1,300	24,245.00	0.03
540	300919	中伟股份	400	24,100.00	0.03
541	001914	招商积余	1,600	24,080.00	0.03

542	300568	星源材质	1,400	24,066.00	0.03
543	300676	华大基因	400	23,996.00	0.03
544	000156	华数传媒	2,700	23,490.00	0.03
545	000933	神火股份	1,800	23,400.00	0.03
546	600167	联美控股	3,300	23,001.00	0.03
547	688065	凯赛生物	369	22,973.94	0.03
548	603688	石英股份	200	22,768.00	0.03
549	000983	山西焦煤	2,500	22,750.00	0.03
550	000723	美锦能源	3,000	22,620.00	0.03
551	000932	华菱钢铁	4,700	22,419.00	0.03
552	002240	盛新锂能	700	22,309.00	0.03
553	688561	奇安信	428	22,174.68	0.03
554	605358	立昂微	600	22,038.00	0.03
555	002444	巨星科技	1,000	21,880.00	0.03
556	002568	百润股份	600	21,810.00	0.03
557	000683	远兴能源	3,000	21,570.00	0.03
558	600808	马钢股份	8,300	21,331.00	0.02
559	688363	华熙生物	239	21,309.24	0.02
560	600754	锦江酒店	500	21,170.00	0.02
561	000591	太阳能	3,100	21,018.00	0.02
562	002081	金螳螂	4,642	20,935.42	0.02
563	000402	金融街	4,600	20,792.00	0.02
564	002430	杭氧股份	600	20,616.00	0.02
565	600873	梅花生物	2,300	20,539.00	0.02
566	600126	杭钢股份	4,700	20,398.00	0.02
567	000617	中油资本	2,800	20,244.00	0.02
568	300395	菲利华	400	19,680.00	0.02
569	000415	渤海租赁	9,300	19,530.00	0.02
570	000738	航发控制	800	19,520.00	0.02
571	002299	圣农发展	1,000	19,150.00	0.02
572	688567	孚能科技	883	19,063.97	0.02
573	300604	长川科技	400	18,996.00	0.02
574	600803	新奥股份	1,000	18,980.00	0.02
575	603868	飞科电器	300	18,927.00	0.02
576	000877	天山股份	2,292	18,656.88	0.02
577	002532	天山铝业	3,100	18,569.00	0.02
578	600985	淮北矿业	1,600	18,432.00	0.02
579	002110	三钢闽光	4,300	18,146.00	0.02
580	000031	大悦城	4,800	17,568.00	0.02
581	601016	节能风电	4,610	16,918.70	0.02
582	000830	鲁西化工	1,600	16,896.00	0.02
583	688220	翱捷科技	220	16,585.80	0.02
584	002372	伟星新材	800	16,432.00	0.02

585	300383	光环新网	1,500	16,125.00	0.02
586	002399	海普瑞	1,401	16,069.47	0.02
587	603568	伟明环保	900	15,759.00	0.02
588	000831	中国稀土	500	14,800.00	0.02
589	300363	博腾股份	500	14,795.00	0.02
590	603195	公牛集团	148	14,216.88	0.02
591	002506	协鑫集成	4,800	14,064.00	0.02
592	000408	藏格矿业	600	13,542.00	0.02
593	000887	中鼎股份	1,000	13,090.00	0.02
594	603267	鸿远电子	200	13,060.00	0.02
595	600970	中材国际	1,000	12,750.00	0.01
596	601717	郑煤机	1,000	12,450.00	0.01
597	002326	永太科技	800	12,232.00	0.01
598	603026	胜华新材	200	11,850.00	0.01
599	300832	新产业	200	11,800.00	0.01
600	600316	洪都航空	500	11,725.00	0.01
601	002092	中泰化学	1,800	11,610.00	0.01
602	603127	昭衍新药	280	11,452.00	0.01
603	601866	中远海发	4,400	10,868.00	0.01
604	600863	内蒙华电	2,300	9,545.00	0.01
605	600025	华能水电	1,300	9,269.00	0.01
606	603712	七一二	300	9,063.00	0.01
607	300957	贝泰妮	100	8,888.00	0.01
608	600737	中粮糖业	1,100	8,855.00	0.01
609	002244	滨江集团	1,000	8,820.00	0.01
610	002936	郑州银行	3,700	8,510.00	0.01
611	002408	齐翔腾达	1,300	8,281.00	0.01
612	601577	长沙银行	1,000	7,760.00	0.01
613	601236	红塔证券	1,000	7,450.00	0.01
614	601456	国联证券	600	5,460.00	0.01
615	603638	艾迪精密	220	4,514.40	0.01
616	300677	英科医疗	180	3,960.00	0.00
617	600409	三友化工	500	2,725.00	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	31,702	574,440.24	0.67
2	600703	三安光电	11,758	202,707.92	0.24
3	300862	蓝盾光电	5,543	170,724.40	0.20
4	300002	神州泰岳	9,935	139,090.00	0.16
5	000799	酒鬼酒	1,000	90,150.00	0.10
6	688496	清越科技	4,400	87,472.00	0.10
7	601099	太平洋	33,100	85,398.00	0.10

8	600004	白云机场	5,800	83,172.00	0.10
9	688076	诺泰生物	2,318	82,474.44	0.10
10	601727	上海电气	16,968	77,543.76	0.09
11	601018	宁波港	22,151	75,091.89	0.09
12	600583	海油工程	12,348	72,235.80	0.08
13	600779	水井坊	1,100	64,889.00	0.08
14	600977	中国电影	4,400	61,820.00	0.07
15	000860	顺鑫农业	1,811	61,012.59	0.07
16	688409	富创精密	548	59,732.00	0.07
17	688400	凌云光	1,839	56,052.72	0.07
18	002317	众生药业	3,282	55,761.18	0.06
19	002558	巨人网络	3,000	53,790.00	0.06
20	600273	嘉化能源	5,700	53,694.00	0.06
21	002456	欧菲光	9,555	53,508.00	0.06
22	688480	赛恩斯	1,611	49,876.56	0.06
23	603888	新华网	1,500	49,230.00	0.06
24	002807	江阴银行	12,200	45,018.00	0.05
25	688306	均普智能	8,037	43,319.43	0.05
26	000681	视觉中国	2,300	42,297.00	0.05
27	600410	华胜天成	5,596	41,522.32	0.05
28	002217	合力泰	10,500	37,065.00	0.04
29	300113	顺网科技	2,100	36,141.00	0.04
30	600881	亚泰集团	16,031	33,825.41	0.04
31	000627	天茂集团	11,100	33,300.00	0.04
32	601127	赛力斯	900	33,093.00	0.04
33	002773	康弘药业	1,600	30,592.00	0.04
34	000078	海王生物	9,500	30,590.00	0.04
35	600094	大名城	8,000	24,720.00	0.03
36	000061	农产品	4,000	23,960.00	0.03
37	600340	华夏幸福	7,649	16,904.29	0.02
38	688249	晶合集成	704	12,721.28	0.01
39	000656	金科股份	10,071	11,178.81	0.01
40	000008	神州高铁	4,700	11,092.00	0.01
41	688361	中科飞测	90	7,095.60	0.01
42	688469	中芯集成	1,270	6,921.50	0.01
43	688562	航天软件	241	6,109.35	0.01
44	688484	南芯科技	124	4,791.36	0.01
45	688352	颀中科技	343	4,332.09	0.01
46	688458	美芯晟	47	4,274.65	0.00
47	688535	华海诚科	78	4,270.50	0.00
48	688552	航天南湖	171	4,134.78	0.00
49	688593	新相微	219	3,560.94	0.00
50	601061	中信金属	354	2,895.72	0.00

51	688479	友车科技	86	2,565.38	0.00
52	605377	华旺科技	140	2,527.00	0.00
53	603137	恒尚节能	96	1,752.00	0.00
54	601065	江盐集团	127	1,598.93	0.00
55	601133	柏诚股份	115	1,577.80	0.00
56	603172	万丰股份	90	1,501.20	0.00
57	603125	常青科技	41	1,086.91	0.00
58	600267	海正药业	17	193.46	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	688249	晶合集成	139,675.38	0.12
2	000792	盐湖股份	120,714.00	0.11
3	601728	中国电信	110,075.00	0.10
4	601138	工业富联	104,197.00	0.09
5	600941	中国移动	99,790.00	0.09
6	600905	三峡能源	86,940.00	0.08
7	000938	紫光股份	85,103.00	0.08
8	300308	中际旭创	84,460.00	0.08
9	688469	中芯集成	72,234.55	0.06
10	600150	中国船舶	69,759.00	0.06
11	688515	裕太微	60,536.00	0.05
12	600925	苏能股份	55,372.80	0.05
13	688484	南芯科技	49,427.64	0.04
14	688008	澜起科技	48,419.29	0.04
15	601059	信达证券	46,431.00	0.04
16	688352	颀中科技	41,418.30	0.04
17	688486	龙迅股份	40,734.04	0.04
18	002340	格林美	40,301.00	0.04
19	601995	中金公司	39,051.00	0.03
20	688307	中润光学	38,518.44	0.03

##### 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	1,209,827.00	1.07
2	300750	宁德时代	842,210.00	0.75
3	601318	中国平安	770,800.00	0.68
4	600036	招商银行	620,890.00	0.55
5	000858	五粮液	450,216.00	0.40

6	600900	长江电力	352,134.00	0.31
7	000333	美的集团	335,139.00	0.30
8	601166	兴业银行	318,732.00	0.28
9	601012	隆基绿能	305,672.00	0.27
10	300059	东方财富	291,975.00	0.26
11	002594	比亚迪	280,739.00	0.25
12	600030	中信证券	270,133.00	0.24
13	600276	恒瑞医药	264,464.00	0.23
14	002415	海康威视	260,569.00	0.23
15	601398	工商银行	259,365.00	0.23
16	601328	交通银行	238,717.00	0.21
17	601899	紫金矿业	228,393.00	0.20
18	000651	格力电器	199,214.00	0.18
19	600938	中国海油	198,449.00	0.18
20	601668	中国建筑	194,836.00	0.17

#### 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	2,730,706.13
卖出股票收入（成交）总额	30,158,654.05

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	42,220.92	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	42,220.92	0.05

#### 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	127058	科伦转债	103	19,464.12	0.02
2	127073	天赐转债	102	12,596.47	0.01

3	127085	韵达转债	58	6,868.68	0.01
4	127061	美锦转债	34	3,291.65	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述 4 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

###### 一、招商银行

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股招商银行。

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。2023 年 1 月 18 日，中国银行间市场交易商协会自律处分信息显示，招商银行股份有限公司存在多期债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销，个别债务融资工具挤占了其他投资人的正常投标，违背了公平公正原则，并影响了发行利率等 4 项违法违规事实，被处罚款 460 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。

###### 二、兴业银行

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股兴业银行。

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。2023 年 1 月 18 日，中国银行间市场交易商协会自律处分信息显示，兴业银行股份有限公司存在低价包销多期债务融资工具，影响了市场正常秩序等 2 项违法违规事实，被处警告，责令整改。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	6,105.89
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,054.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,160.70

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127058	科伦转债	19,464.12	0.02
2	127073	天赐转债	12,596.47	0.01
3	127061	美锦转债	3,291.65	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

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。

### 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 (%)
7,910	7,153.69	4,092,134.37	7.23	52,493,576.83	92.77

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	8.83
2	王飞舟	1,677,417.00	3.97
3	靳宁卿	980,300.00	2.32
4	纪伟才	938,029.00	2.22
5	于成福	932,390.00	2.21
6	于君	711,529.00	1.69
7	李坚	500,000.00	1.18
8	于延年	499,916.00	1.18
9	符王莹月	466,006.00	1.10
10	陈雁金	466,006.00	1.10

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	0.0337

### 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	75,143,415.79
本报告期基金总申购份额	2,533,112.75
减：本报告期基金总赎回份额	21,090,817.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	56,585,711.20

## § 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

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。

#### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动情况。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、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

### 10.6.1 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	2023 年 5 月 11 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	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况 (如提出整改意见)	公司已完成整改, 整改措施主要包括完善内部制度、优化管控流程等
其他	-

### 10.6.2 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。

## 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 (%)	
海通证券	1	19,371,698.47	60.94	18,041.14	60.94	-
招商证券	2	12,199,592.17	38.38	11,361.65	38.38	-
东北证券	1	215,314.14	0.68	200.54	0.68	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	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	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 (%)				的比例 (%)
海通证 券	42,200.55	80.74	-	-	-	-
招商证 券	10,067.79	19.26	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
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) 资历雄厚，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:无。

(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	兴业证券	深圳	1

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 20 日
2	长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 20 日
3	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	2023 年 2 月 18 日
4	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	2023 年 2 月 18 日
5	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加华瑞保险为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 8 日
6	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 15 日
7	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 15 日
8	长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
9	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2022 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
10	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销售业务	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日

	的公告		
11	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 17 日
12	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 22 日
13	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 22 日
14	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 5 月 5 日
15	长盛基金管理有限公司关于增加东方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	2023 年 6 月 7 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	20230101~20230509	18,495,067.82	0.00	18,495,067.82	0.00	0.00
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。							

### 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

2023年8月30日