

长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金
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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44

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	44
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	44
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.3 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	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	长盛电子信息主题混合
基金主代码	000063
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 5 月 10 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	180,943,750.67 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标在于把握中国电子信息产业发展带来的投资机会，分享中国电子信息产业相关上市公司的持续投资收益，在严格控制投资风险的基础上，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金充分发挥基金管理人的投资研究优势，运用科学严谨、规范化的资产配置方法，灵活配置电子信息主题的上市公司股票和债券，谋求基金资产的长期稳定增长。1、资产配置策略：本基金主要考虑宏观经济指标、微观经济指标、市场指标以及政策因素，分析市场风险，提高基金收益率。</p> <p>2、电子信息主题相关行业和公司的界定：本基金管理人界定的电子信息主题相关行业和公司主要包括三类：1) 电子信息相关行业和公司；2) 通信设备和软件相关行业和公司；3) 传媒相关行业和公司。</p> <p>3、股票投资策略：本基金的股票投资策略，分为股票池的初步构建、细分领域培植和个股精选三个方面。</p>
业绩比较基准	50%×中证 TMT 产业主题指数收益率+50%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁
	联系电话	010-86497608
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666、010-86497888	95566
传真	010-86497999	010-66594942
注册地址	深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	楼中建财富国际中心 3-5 层	
邮政编码	100029	100818
法定代表人	胡甲	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	基金管理人的办公地址及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层

§ 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	-16,755,864.94
本期利润	-17,483,471.09
加权平均基金份额本期利润	-0.0947
本期加权平均净值利润率	-5.79%
本期基金份额净值增长率	-6.52%
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	29,129,166.31
期末可供分配基金份额利润	0.1610
期末基金资产净值	269,579,800.73
期末基金份额净值	1.490
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	49.00%

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。

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	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	-8.59%	2.41%	0.28%	0.88%	-8.87%	1.53%
过去三个月	-13.27%	1.82%	-1.32%	0.97%	-11.95%	0.85%
过去六个月	-6.52%	1.67%	12.96%	0.88%	-19.48%	0.79%
过去一年	-16.48%	1.49%	7.99%	0.80%	-24.47%	0.69%
过去三年	-21.12%	1.58%	0.20%	0.78%	-21.32%	0.80%
自基金合同生效起至今	49.00%	1.62%	36.48%	0.98%	12.52%	0.64%

注：根据《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，业绩比较基准自 2014 年 7 月 3 日起，由“上证市值百强指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%”变更为“50%×中证 TMT 产业主题指数收益率+50%×中证综合债指数收益率”；基金业绩比较基准收益率在变更前后期间分别根据相应的指标计算。

本基金业绩比较基准：50%×中证 TMT 产业主题指数收益率+50%×中证综合债指数收益率。

基准指数的构建考虑了三个原则：

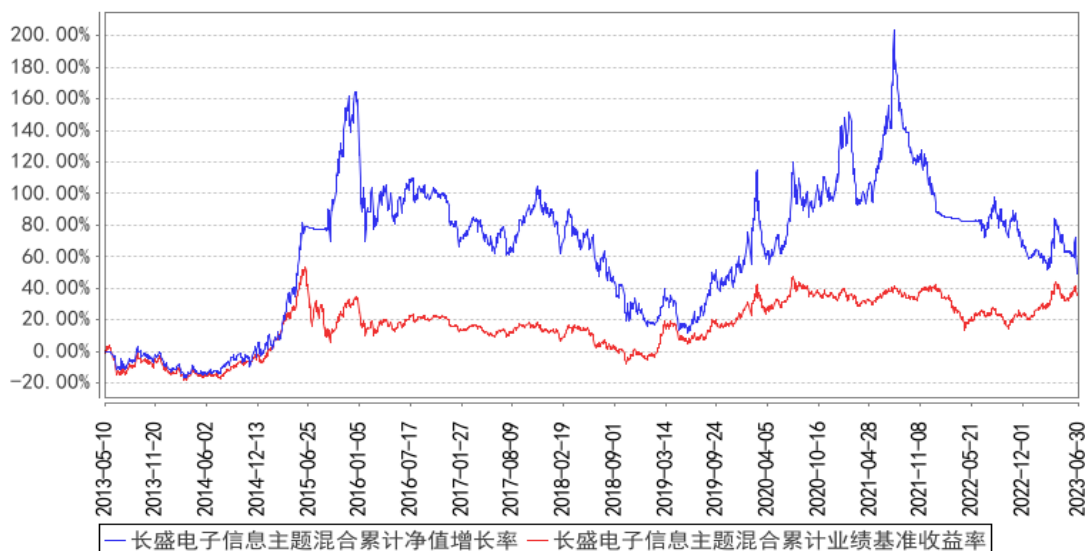
1、公允性。本基金为行业主题混合型基金，在综合比较目前市场上各主要行业指数的编制特点后，本基金选择以中证 TMT 产业主题指数作为股票投资的业绩比较基准。中证 TMT 产业主题指数由 TMT 产业中规模和流动性较好的 100 只公司股票组成，以反映 A 股上市公司中数字新媒体相关产业公司股票的走势。本基金主要投资于电子信息主题相关产业上市公司股票，从而中证 TMT 产业主题指数适合作为本基金的业绩比较基准。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响。本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具，其中投资于电子信息主题的股票和债券不低于非现金基金资产的 80%。基准指数采用 50%、50%的权数，是根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定的，这样使业绩比较更具有合理性。

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

3.2.2 自基金合同生效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

长盛电子信息主题混合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：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六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		
朱律	本基金基金经理。	2019年5月22日	-	15年	朱律先生，硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员。2014年5月加入长盛基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理等职务。

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

上半年主要指数呈现震荡走势，AI 代表的新技术产业出现结构化行情。整体市场走势可能跟部分海外市场有所不同，这是反映目前中国经济状态的表现。

随着移动互联网和人工智能的交替，传统能源设备和新能源设备的交替，整体配置以代表未来中国产业升级趋势以及代表下一代技术的人工智能方向为主。

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 1.490 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.52%，同期业绩比较基准收益率为 12.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前甚至未来几年，中国都处于产业升级的关键阶段。中国已经经历几次产业升级，从农业国升级成为“世界工厂”，产业几乎覆盖联合国产业分类的 666 个所有细分名录，我们已经是大规模的制造业国家。但是从产业链环节在全球所处阶段来看，中国还不是真正处于世界产业链的上层。虽然大大甩开了东南亚、拉美等过去的同类竞争对手的差距，将目前的产业所在水平做到了极致，但是与产业链上一层的日韩德法英等国的产业制造水平来看，还有是一些不同和差距的。

但中国有优秀的管理机制、庞大的市场和历史屡次证明的举国同心的强大的韧性。突破到上一层已经只是时间问题。跨时代的新兴技术、高端机械制造、高端半导体制造、高端科技材料、先进软件技术、先进医药技术的突破既是迈入上一层的门票，也是目前和未来突破攻坚的方向。

目前的攻坚和转型期可能是痛苦的，万丈高楼平地起，产业链升级，其他相关产业才能享受红利。我们将重点研究、投资这些领域，选取中国的新经济龙头，享受中国下一波产业升级的红利，为基民做出贡献。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2023 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 29,129,166.31 元，其中：未分配利润已实现部分为 29,129,166.31 元，未分配利润未实现部分为 59,506,883.75 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	129,820,845.95	280,026,323.60
结算备付金		215,360.08	148,696.90
存出保证金		319,500.07	213,297.04
交易性金融资产	6.4.7.2	140,841,541.40	90,141,951.64
其中：股票投资		139,830,444.96	90,141,951.64
基金投资		-	-
债券投资		1,011,096.44	-
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		48,488.56	-
应收股利		-	-
应收申购款		268,248.29	118,665.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		271,513,984.35	370,648,934.71
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	68,351,037.25
应付赎回款		274,688.12	1,520,438.23
应付管理人报酬		357,551.13	393,146.05
应付托管费		59,591.84	65,524.33
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.47
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,242,352.53	539,492.57
负债合计		1,934,183.62	70,869,638.90
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	180,943,750.67	188,045,249.38
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	88,636,050.06	111,734,046.43
净资产合计		269,579,800.73	299,779,295.81
负债和净资产总计		271,513,984.35	370,648,934.71

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.490 元，基金份额总额 180,943,750.67 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金

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 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
一、营业总收入		-14,739,074.12	-44,047,512.65
1. 利息收入		143,405.60	650,319.19
其中：存款利息收入	6.4.7.13	143,405.60	650,319.19
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）		-14,190,622.00	-35,124,813.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-15,309,057.08	-35,289,954.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4,846.03	75,935.16
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	1,113,589.05	89,205.58
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	-727,606.15	-9,697,191.00
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	35,748.43	124,172.74
减：二、营业总支出		2,744,396.97	3,603,049.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,255,014.09	2,999,111.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	375,835.65	499,851.85
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	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	0. 13
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	113, 547. 23	104, 086. 64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-17, 483, 471. 09	-47, 650, 562. 34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-17, 483, 471. 09	-47, 650, 562. 34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-17, 483, 471. 09	-47, 650, 562. 34

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金

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）	188, 045, 249. 38	-	111, 734, 046. 43	299, 779, 295. 81
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）	188, 045, 249. 38	-	111, 734, 046. 43	299, 779, 295. 81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7, 101, 498. 71	-	-23, 097, 996. 37	-30, 199, 495. 08
（一）、综合收益总额	-	-	-17, 483, 471. 09	-17, 483, 471. 09
（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）	-7, 101, 498. 71	-	-5, 614, 525. 28	-12, 716, 023. 99
其中：1. 基金申购款	16, 062, 437. 40	-	10, 011, 895. 27	26, 074, 332. 67
2. 基金赎回款	-23, 163, 936. 11	-	-15, 626, 420. 55	-38, 790, 356. 66
（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）	180,943,750.67	-	88,636,050.06	269,579,800.73
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）	219,219,379.64	-	219,648,597.69	438,867,977.33
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）	219,219,379.64	-	219,648,597.69	438,867,977.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-23,695,022.72	-	-66,356,149.01	-90,051,171.73
（一）、综合收益总额	-	-	-47,650,562.34	-47,650,562.34
（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）	-23,695,022.72	-	-18,705,586.67	-42,400,609.39
其中：1. 基金申购款	36,001,045.86	-	31,637,084.60	67,638,130.46
2. 基金赎回款	-59,696,068.58	-	-50,342,671.27	-110,038,739.85
（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)	195,524,356.92	-	153,292,448.68	348,816,805.60

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“原基金”)基金份额持有人大会的决议由长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]第 125 号《关于核准上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 308,394,736.32 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 214 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2013 年 5 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 308,496,450.30 份基金份额,其中认购资金利息折合 101,713.98 元份基金份额。

原基金基金份额持有人大会自 2014 年 5 月 7 日起至 2014 年 6 月 6 日止以通讯方式召开,会议审议通过了《关于修改长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同有关事项的议案》,经中国证监会备案后决议生效。根据原基金基金份额持有人大会决议,《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自 2014 年 7 月 3 日生效,基金投资目标、范围和策略调整,同时“长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金”更名为“长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金”。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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)、债券、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货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。本基金业绩比较基准为中证 TMT 产业主题指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

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》、《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号

《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	129,820,845.95
等于：本金	129,816,714.70
加：应计利息	4,131.25
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	129,820,845.95

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	142,615,922.31	-	139,830,444.96	-2,785,477.35	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	998,610.00	9,196.44	1,011,096.44	3,290.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	998,610.00	9,196.44	1,011,096.44	3,290.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	143,614,532.31	9,196.44	140,841,541.40	-2,782,187.35	

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

无余额。

6.4.7.5 债权投资

无余额。

6.4.7.6 其他债权投资

无余额。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无余额。

6.4.7.8 其他资产

无余额。

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	519.88
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,148,072.50
其中：交易所市场	1,148,072.50
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	93,760.15
合计	1,242,352.53

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	188,045,249.38	188,045,249.38
本期申购	16,062,437.40	16,062,437.40
本期赎回（以“-”号填列）	-23,163,936.11	-23,163,936.11
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	180,943,750.67	180,943,750.67

注：申购含转换入；赎回含转换出。

6.4.7.11 其他综合收益

无余额。

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	47,545,611.56	64,188,434.87	111,734,046.43
本期利润	-16,755,864.94	-727,606.15	-17,483,471.09
本期基金份额交易产生的变动数	-1,660,580.31	-3,953,944.97	-5,614,525.28
其中：基金申购款	3,828,173.39	6,183,721.88	10,011,895.27
基金赎回款	-5,488,753.70	-10,137,666.85	-15,626,420.55

本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,129,166.31	59,506,883.75	88,636,050.06

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		126,136.10
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		15,658.18
其他		1,611.32
合计		143,405.60

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		-15,309,057.08
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		-15,309,057.08

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		1,629,622,109.31
减：卖出股票成本总额		1,640,325,910.80
减：交易费用		4,605,255.59
买卖股票差价收入		-15,309,057.08

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		4,846.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		-
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	4,846.03

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	1,113,589.05
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,113,589.05

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	-727,606.15
股票投资	-730,896.15
债券投资	3,290.00
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	-727,606.15

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	34,547.89

基金转换费收入	1,200.54
合计	35,748.43

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	15,287.08
账户维护费	9,000.00
合计	113,547.23

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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元期货有限公司（“国元期货”）	基金管理人股东的控股子公司

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。

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	2,255,014.09	2,999,111.07
其中：支付销售机构的客户维护费	985,175.72	1,322,259.86

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 1.50%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×1.50%/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	375,835.65	499,851.85

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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×0.25%/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
中国银行	129,820,845.95	126,136.10	126,283,425.09	642,380.27
合计	129,820,845.95	126,136.10	126,283,425.09	642,380.27

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金用于期货交易结算的资金分别存放于国元期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，存出保证金不计息。于2023年6月30日，本基金存放于国元期货的结算备付金和存出保证金余额均为0.00元(2022年6月30日：无结算备付金和存出保证金余额)。于2023年上半年度，本基金当期结算备付金利息收入0.00元(2022年上半年度：2,302.51元)。

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
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	限售期锁定	9.60	9.93	3,767	36,163.20	37,406.31	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	限售期锁定	11.88	25.32	408	4,847.04	10,330.56	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	限售期锁定	18.88	20.03	114	2,152.32	2,283.42	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	限售期锁定	20.68	29.79	123	2,543.64	3,664.17	-
001360	南矿集	2023年	6个月	限售期	15.38	16.45	177	2,722.26	2,911.65	-

	团	3月31日		锁定							
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	限售期锁定	44.48	42.55	55	2,446.40	2,340.25		-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	限售期锁定	56.50	52.92	147	8,305.50	7,779.24		-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	限售期锁定	50.00	30.71	335	16,750.00	10,287.85		-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	限售期锁定	44.18	25.36	322	10,161.40	8,165.92		-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	限售期锁定	29.60	76.13	333	9,856.80	25,351.29		-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	限售期锁定	25.25	19.83	468	11,817.00	9,280.44		-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	限售期锁定	13.06	23.16	642	8,384.52	14,868.72		-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	限售期锁定	131.11	53.20	135	11,799.90	7,182.00		-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	限售期锁定	14.81	13.74	699	10,352.19	9,604.26		-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	限售期锁定	32.60	32.24	232	7,563.20	7,479.68		-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	限售期锁定	73.45	46.64	123	9,034.35	5,736.72		-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	限售期锁定	17.55	17.23	511	8,968.05	8,804.53		-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	限售期锁定	23.77	42.86	363	8,628.51	15,558.18		-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	限售期锁定	71.88	92.81	131	9,416.28	12,158.11		-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	限售期锁定	23.80	35.90	395	9,401.00	14,180.50		-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	限售期锁定	16.24	16.95	655	10,637.20	11,102.25		-

301419	阿莱德	2023年 2月2日	6个月	限售期 锁定	24.80	43.78	330	8,184.00	14,447.40	-
301428	世纪恒 通	2023年 5月10 日	6个月	限售期 锁定	26.35	33.25	229	6,034.15	7,614.25	-
301439	泓淋电 力	2023年 3月10 日	6个月	限售期 锁定	19.99	16.91	380	7,596.20	6,425.80	-
601061	中信金 属	2023年 3月30 日	6个月	限售期 锁定	6.58	8.18	898	5,908.84	7,345.64	-
601065	江盐集 团	2023年 3月31 日	6个月	限售期 锁定	10.36	12.59	333	3,449.88	4,192.47	-
601133	柏诚股 份	2023年 3月31 日	6个月	限售期 锁定	11.66	13.72	301	3,509.66	4,129.72	-
603125	常青科 技	2023年 3月30 日	6个月	限售期 锁定	25.98	26.51	105	2,727.90	2,783.55	-
603135	XD中 重科	2023年 3月29 日	6个月	限售期 锁定	17.80	19.09	299	5,322.20	5,707.91	-
603137	恒尚节 能	2023年 4月10 日	6个月	限售期 锁定	15.90	18.25	139	2,210.10	2,536.75	-
603172	万丰股 份	2023年 4月28 日	6个月	限售期 锁定	14.58	16.68	122	1,778.76	2,034.96	-
688249	晶合集 成	2023年 4月24 日	6个月	限售期 锁定	19.86	18.07	1,913	37,992.18	34,567.91	-
688334	西高院	2023年 6月9日	6个月	限售期 锁定	14.16	17.20	584	8,269.44	10,044.80	-
688352	颀中科 技	2023年 4月11 日	6个月	限售期 锁定	12.10	12.63	894	10,817.40	11,291.22	-
688361	中科飞 测	2023年 5月12 日	6个月	限售期 锁定	23.60	78.84	299	7,056.40	23,573.16	-
688458	美芯晟	2023年 5月15 日	6个月	限售期 锁定	75.00	90.95	124	9,300.00	11,277.80	-
688469	中芯集	2023年	6个月	限售期	5.69	5.45	3,388	19,277.72	18,464.60	-

	成	4月28日		锁定							
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	限售期锁定	11.10	17.24	1,225	13,597.50	21,119.00		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	限售期锁定	33.99	29.83	230	7,817.70	6,860.90		-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	限售期锁定	39.99	38.64	312	12,476.88	12,055.68		-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	限售期锁定	21.86	25.43	448	9,793.28	11,392.64		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	限售期锁定	35.00	54.75	161	5,635.00	8,814.75		-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	限售期锁定	21.17	24.18	451	9,547.67	10,905.18		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	限售期锁定	12.68	25.35	636	8,064.48	16,122.60		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	限售期锁定	125.80	118.08	82	10,315.60	9,682.56		-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	限售期锁定	11.18	16.26	750	8,385.00	12,195.00		-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	限售期锁定	125.88	89.31	87	10,951.56	7,769.97		-

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

本基金是以一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于高风险品种。本基金重点投资于电子信息主题相关的股票和债券，该类型股票和债券的波动会受到宏观经济环境、行业周期和公司自身经营状况等因素的影响。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、管理风险以及本基金的特定风险。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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国银行，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，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券(2022 年 12 月 31 日：同)。

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家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)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流动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	129,816,714.70	-	-	4,131.25	129,820,845.95
结算备付金	215,272.87	-	-	87.21	215,360.08
存出保证金	319,370.65	-	-	129.42	319,500.07
交易性金融资产	1,001,900.00	-	-	139,839,641.40	140,841,541.40
应收申购款	-	-	-	268,248.29	268,248.29
应收清算款	-	-	-	48,488.56	48,488.56
资产总计	131,353,258.22	-	-	140,160,726.13	271,513,984.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	274,688.12	274,688.12
应付管理人报酬	-	-	-	357,551.13	357,551.13
应付托管费	-	-	-	59,591.84	59,591.84
其他负债	-	-	-	1,242,352.53	1,242,352.53
负债总计	-	-	-	1,934,183.62	1,934,183.62
利率敏感度缺口	131,353,258.22	-	-	-138,226,542.51	269,579,800.73
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	280,002,467.67	-	-	23,855.93	280,026,323.60
结算备付金	148,630.00	-	-	66.90	148,696.90
存出保证金	213,201.14	-	-	95.90	213,297.04
交易性金融资产	-	-	-	90,141,951.64	90,141,951.64
应收申购款	-	-	-	118,665.53	118,665.53
资产总计	280,364,298.81	-	-	90,284,635.90	370,648,934.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,520,438.23	1,520,438.23
应付管理人报酬	-	-	-	393,146.05	393,146.05
应付托管费	-	-	-	65,524.33	65,524.33
应付清算款	-	-	-	68,351,037.25	68,351,037.25
应交税费	-	-	-	0.47	0.47
其他负债	-	-	-	539,492.57	539,492.57
负债总计	-	-	-	70,869,638.90	70,869,638.90
利率敏感度缺口	280,364,298.81	-	-	-19,414,997.00	299,779,295.81

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 0.38% (2022 年 12 月 31 日：0.00%)，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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%—95%，其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具，其中投资于电子信息主题的股票和债券不低于非现金基金资产的 80%。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	139,830,444.96	51.87	90,141,951.64	30.07
合计	139,830,444.96	51.87	90,141,951.64	30.07

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）
	业绩比较基准（附注 6.4.1）上升 5%	14,799,617.00	6,518,849.18
	业绩比较基准（附注 6.4.1）下降 5%	-14,799,617.00	-6,518,849.18

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	139,320,612.69	89,914,143.10
第二层次	1,011,096.44	-
第三层次	509,832.27	227,808.54
合计	140,841,541.40	90,141,951.64

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	139,830,444.96	51.50
	其中：股票	139,830,444.96	51.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,011,096.44	0.37
	其中：债券	1,011,096.44	0.37
	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	130,036,206.03	47.89
8	其他各项资产	636,236.92	0.23
9	合计	271,513,984.35	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	61,877,845.80	22.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,406.31	0.01
E	建筑业	10,202,376.47	3.78
F	批发和零售业	28,778.45	0.01

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	67,616,513.75	25.08
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,892.45	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	9,280.44	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	25,351.29	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	139,830,444.96	51.87

7.2.2 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

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	688111	金山办公	29,322	13,846,434.84	5.14
2	002230	科大讯飞	194,700	13,231,812.00	4.91
3	002555	三七互娱	327,200	11,412,736.00	4.23
4	000063	中兴通讯	250,200	11,394,108.00	4.23
5	688095	福昕软件	88,014	11,123,209.32	4.13
6	000032	深桑达 A	309,900	10,195,710.00	3.78
7	002368	太极股份	224,900	9,259,133.00	3.43
8	600498	烽火通信	423,100	8,618,547.00	3.20
9	000938	紫光股份	257,440	8,199,464.00	3.04
10	688100	威胜信息	264,126	7,873,596.06	2.92
11	600150	中国船舶	231,185	7,608,298.35	2.82
12	000977	浪潮信息	126,400	6,130,400.00	2.27
13	688378	奥来德	122,763	6,064,492.20	2.25
14	600584	长电科技	179,800	5,604,366.00	2.08
15	600941	中国移动	57,700	5,383,410.00	2.00
16	300229	拓尔思	125,400	3,256,638.00	1.21
17	001286	陕西能源	3,767	37,406.31	0.01
18	688249	晶合集成	1,913	34,567.91	0.01
19	300418	昆仑万维	800	32,224.00	0.01
20	301293	三博脑科	333	25,351.29	0.01
21	688361	中科飞测	299	23,573.16	0.01

22	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
23	688472	阿特斯	1,225	21,119.00	0.01
24	688469	中芯集成	3,388	18,464.60	0.01
25	688562	航天软件	636	16,122.60	0.01
26	301358	湖南裕能	363	15,558.18	0.01
27	301320	豪江智能	642	14,868.72	0.01
28	301419	阿莱德	330	14,447.40	0.01
29	301382	蜂助手	395	14,180.50	0.01
30	688593	新相微	750	12,195.00	0.00
31	301360	荣旗科技	131	12,158.11	0.00
32	688484	南芯科技	312	12,055.68	0.00
33	688523	航天环宇	448	11,392.64	0.00
34	688352	颀中科技	894	11,291.22	0.00
35	688458	美芯晟	124	11,277.80	0.00
36	301408	华人健康	655	11,102.25	0.00
37	688552	航天南湖	451	10,905.18	0.00
38	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
39	001287	中电港	408	10,330.56	0.00
40	301246	宏源药业	335	10,287.85	0.00
41	688334	西高院	584	10,044.80	0.00
42	688581	安杰思	82	9,682.56	0.00
43	301332	德尔玛	699	9,604.26	0.00
44	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
45	301305	朗坤环境	468	9,280.44	0.00
46	301290	东星医疗	286	9,166.30	0.00
47	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
48	688535	华海诚科	161	8,814.75	0.00
49	301355	南王科技	511	8,804.53	0.00
50	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
51	301281	科源制药	322	8,165.92	0.00
52	301157	华塑科技	147	7,779.24	0.00
53	688623	双元科技	87	7,769.97	0.00
54	301428	世纪恒通	229	7,614.25	0.00
55	301337	亚华电子	232	7,479.68	0.00
56	601061	中信金属	898	7,345.64	0.00
57	301265	华新环保	622	7,227.64	0.00
58	301322	绿通科技	135	7,182.00	0.00
59	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
60	688479	友车科技	230	6,860.90	0.00
61	301439	泓淋电力	380	6,425.80	0.00
62	301345	涛涛车业	123	5,736.72	0.00
63	603135	中重科技	299	5,707.91	0.00
64	601065	江盐集团	333	4,192.47	0.00

65	601133	柏诚股份	301	4,129.72	0.00
66	001328	登康口腔	123	3,664.17	0.00
67	001360	南矿集团	177	2,911.65	0.00
68	603125	常青科技	105	2,783.55	0.00
69	000066	中国长城	200	2,766.00	0.00
70	603137	恒尚节能	139	2,536.75	0.00
71	001367	海森药业	55	2,340.25	0.00
72	001324	长青科技	114	2,283.42	0.00
73	603172	万丰股份	122	2,034.96	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	688266	泽璟制药	31,570,686.24	10.53
2	600276	恒瑞医药	31,373,675.31	10.47
3	002653	海思科	31,036,159.56	10.35
4	688617	惠泰医疗	30,985,987.99	10.34
5	300033	同花顺	30,389,311.00	10.14
6	002230	科大讯飞	29,314,411.00	9.78
7	601628	中国人寿	29,192,390.00	9.74
8	688111	金山办公	29,056,422.70	9.69
9	300229	拓尔思	28,512,063.11	9.51
10	688235	百济神州	27,547,356.72	9.19
11	300454	深信服	27,100,846.54	9.04
12	300525	博思软件	26,796,962.85	8.94
13	002555	三七互娱	26,544,345.80	8.85
14	300633	开立医疗	25,336,716.20	8.45
15	002368	太极股份	23,955,576.10	7.99
16	603019	中科曙光	23,736,217.14	7.92
17	000032	深桑达 A	22,718,882.69	7.58
18	001269	欧晶科技	22,317,560.82	7.44
19	002020	京新药业	21,875,779.73	7.30
20	300418	昆仑万维	20,639,161.31	6.88
21	300212	易华录	19,801,148.61	6.61
22	300634	彩讯股份	19,092,832.00	6.37
23	301153	中科江南	18,289,458.40	6.10
24	688192	迪哲医药	18,029,492.21	6.01
25	603444	吉比特	17,271,663.12	5.76
26	000938	紫光股份	17,155,168.56	5.72
27	688338	赛科希德	16,513,742.23	5.51
28	688169	石头科技	15,702,010.85	5.24
29	002294	信立泰	15,560,313.00	5.19

30	688578	艾力斯	15,407,977.69	5.14
31	688687	凯因科技	15,355,074.95	5.12
32	603915	国茂股份	15,237,375.00	5.08
33	688488	艾迪药业	15,207,728.10	5.07
34	000739	普洛药业	15,099,461.00	5.04
35	688327	云从科技	15,034,877.59	5.02
36	688302	海创药业	15,003,064.53	5.00
37	300607	拓斯达	14,997,910.20	5.00
38	601318	中国平安	14,983,529.54	5.00
39	688305	科德数控	14,935,661.79	4.98
40	600570	恒生电子	14,838,296.77	4.95
41	600536	中国软件	14,835,443.28	4.95
42	002791	坚朗五金	14,569,393.30	4.86
43	688256	寒武纪	14,518,676.02	4.84
44	688308	欧科亿	14,448,276.82	4.82
45	603232	格尔软件	14,428,280.00	4.81
46	001339	智微智能	14,401,230.10	4.80
47	300036	超图软件	14,388,853.00	4.80
48	301236	软通动力	14,385,135.40	4.80
49	300124	汇川技术	14,213,486.75	4.74
50	000063	中兴通讯	14,178,302.00	4.73
51	600588	用友网络	14,014,621.30	4.67
52	601360	三六零	13,990,715.00	4.67
53	688787	海天瑞声	13,931,606.42	4.65
54	300548	博创科技	13,762,240.50	4.59
55	000977	浪潮信息	13,639,206.91	4.55
56	688561	奇安信	13,581,549.52	4.53
57	603983	丸美股份	13,422,220.00	4.48
58	603590	康辰药业	13,404,046.00	4.47
59	002332	仙琚制药	13,351,968.99	4.45
60	002959	小熊电器	13,165,222.80	4.39
61	600845	宝信软件	12,871,161.60	4.29
62	600685	中船防务	12,708,254.00	4.24
63	688095	福昕软件	11,620,159.94	3.88
64	688365	光云科技	11,616,451.24	3.88
65	688207	格灵深瞳	11,546,089.93	3.85
66	688508	芯朋微	11,481,911.74	3.83
67	688168	安博通	11,342,015.41	3.78
68	603171	税友股份	11,103,649.00	3.70
69	688777	中控技术	10,949,768.64	3.65
70	000651	格力电器	10,569,662.00	3.53
71	688262	国芯科技	10,497,058.02	3.50
72	300996	普联软件	10,207,970.81	3.41

73	002262	恩华药业	9,494,655.00	3.17
74	600436	片仔癀	9,479,280.00	3.16
75	601601	中国太保	9,444,589.00	3.15
76	600584	长电科技	9,352,265.15	3.12
77	002568	百润股份	9,051,811.00	3.02
78	300662	科锐国际	9,025,493.00	3.01
79	603060	国检集团	8,914,748.25	2.97
80	688037	芯源微	8,809,880.74	2.94
81	688176	亚虹医药	8,809,018.16	2.94
82	688082	盛美上海	8,806,952.06	2.94
83	002415	海康威视	8,799,693.00	2.94
84	002935	天奥电子	8,795,950.80	2.93
85	000066	中国长城	8,784,397.00	2.93
86	002371	北方华创	8,764,516.00	2.92
87	688100	威胜信息	8,754,910.04	2.92
88	002690	美亚光电	8,719,849.10	2.91
89	002153	石基信息	8,715,181.19	2.91
90	600498	烽火通信	8,699,940.83	2.90
91	002439	启明星辰	8,493,784.00	2.83
92	002990	盛视科技	7,958,126.00	2.65
93	600690	海尔智家	7,852,823.16	2.62
94	002373	千方科技	7,752,506.00	2.59
95	300226	上海钢联	7,632,621.32	2.55
96	600029	南方航空	7,430,127.00	2.48
97	300369	绿盟科技	7,364,174.00	2.46
98	600150	中国船舶	7,339,140.90	2.45
99	688041	海光信息	7,199,911.42	2.40
100	002965	祥鑫科技	6,305,172.00	2.10
101	688506	百利天恒	6,209,576.62	2.07
102	300782	卓胜微	6,140,010.00	2.05
103	688366	昊海生科	6,051,161.00	2.02
104	601882	海天精工	6,001,345.00	2.00

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	300033	同花顺	35,419,636.50	11.82
2	688266	泽璟制药	31,777,845.85	10.60
3	688617	惠泰医疗	31,455,298.97	10.49
4	600276	恒瑞医药	30,064,663.10	10.03
5	002653	海思科	29,265,332.00	9.76
6	300229	拓尔思	27,833,148.00	9.28
7	601628	中国人寿	27,647,403.91	9.22

8	300454	深信服	27,169,059.60	9.06
9	688235	百济神州	26,658,109.56	8.89
10	300525	博思软件	25,533,377.00	8.52
11	002415	海康威视	22,966,368.00	7.66
12	300633	开立医疗	22,555,582.57	7.52
13	603019	中科曙光	22,090,602.44	7.37
14	688327	云从科技	22,032,252.89	7.35
15	300634	彩讯股份	21,819,748.00	7.28
16	300212	易华录	20,897,420.50	6.97
17	002020	京新药业	20,858,225.60	6.96
18	601360	三六零	20,587,799.00	6.87
19	001269	欧晶科技	20,399,738.34	6.80
20	300548	博创科技	19,118,230.12	6.38
21	300418	昆仑万维	19,034,393.00	6.35
22	301153	中科江南	18,223,712.27	6.08
23	688169	石头科技	17,082,919.26	5.70
24	688192	迪哲医药	16,956,822.59	5.66
25	600845	宝信软件	16,654,406.13	5.56
26	603444	吉比特	16,340,820.09	5.45
27	002555	三七互娱	16,260,744.12	5.42
28	601100	恒立液压	15,734,299.00	5.25
29	688111	金山办公	15,600,840.58	5.20
30	603596	伯特利	15,522,229.28	5.18
31	000651	格力电器	15,279,387.00	5.10
32	000739	普洛药业	15,232,371.38	5.08
33	603915	国茂股份	15,058,030.56	5.02
34	002230	科大讯飞	15,004,487.46	5.01
35	601318	中国平安	14,988,898.83	5.00
36	688338	赛科希德	14,930,497.79	4.98
37	600570	恒生电子	14,895,661.63	4.97
38	688787	海天瑞声	14,591,216.84	4.87
39	300012	华测检测	14,479,915.83	4.83
40	603232	格尔软件	14,470,128.22	4.83
41	002027	分众传媒	14,468,138.00	4.83
42	300036	超图软件	14,154,338.86	4.72
43	002294	信立泰	14,092,565.00	4.70
44	600685	中船防务	14,043,703.00	4.68
45	688578	艾力斯	14,039,603.41	4.68
46	300607	拓斯达	13,821,404.20	4.61
47	688302	海创药业	13,494,262.64	4.50
48	688308	欧科亿	13,478,651.49	4.50
49	002791	坚朗五金	13,468,633.50	4.49
50	688305	科德数控	13,418,990.96	4.48

51	002959	小熊电器	13,411,407.30	4.47
52	002368	太极股份	13,317,594.20	4.44
53	002332	仙琚制药	13,283,674.00	4.43
54	300124	汇川技术	13,252,588.00	4.42
55	000032	深桑达 A	13,176,294.95	4.40
56	600536	中国软件	13,053,699.60	4.35
57	001339	智微智能	13,020,169.00	4.34
58	301236	软通动力	12,984,449.00	4.33
59	600588	用友网络	12,820,367.40	4.28
60	688488	艾迪药业	12,729,802.75	4.25
61	688256	寒武纪	12,584,843.41	4.20
62	688687	凯因科技	12,542,458.38	4.18
63	603983	丸美股份	12,452,380.00	4.15
64	603171	税友股份	12,400,830.00	4.14
65	603590	康辰药业	12,386,105.00	4.13
66	688561	奇安信	11,935,714.83	3.98
67	688207	格灵深瞳	11,833,212.01	3.95
68	688777	中控技术	11,819,912.78	3.94
69	688508	芯朋微	11,211,043.12	3.74
70	300226	上海钢联	11,044,639.66	3.68
71	688168	安博通	10,651,351.88	3.55
72	688262	国芯科技	10,297,333.50	3.43
73	002262	恩华药业	10,061,872.17	3.36
74	300996	普联软件	9,657,195.26	3.22
75	688365	光云科技	9,655,600.07	3.22
76	688041	海光信息	9,518,228.06	3.18
77	000977	浪潮信息	9,467,912.00	3.16
78	600436	片仔癀	9,108,873.00	3.04
79	601601	中国太保	9,105,392.00	3.04
80	000938	紫光股份	8,734,449.55	2.91
81	002439	启明星辰	8,707,194.00	2.90
82	002371	北方华创	8,605,704.00	2.87
83	300662	科锐国际	8,597,208.00	2.87
84	603060	国检集团	8,565,539.96	2.86
85	002373	千方科技	8,547,165.44	2.85
86	688082	盛美上海	8,513,324.91	2.84
87	002568	百润股份	8,375,498.40	2.79
88	688037	芯源微	8,151,584.97	2.72
89	002690	美亚光电	8,137,903.96	2.71
90	000066	中国长城	8,108,305.00	2.70
91	002935	天奥电子	7,807,981.00	2.60
92	688047	龙芯中科	7,728,437.27	2.58
93	002153	石基信息	7,697,506.40	2.57

94	002990	盛视科技	7,667,638.00	2.56
95	600690	海尔智家	7,628,059.00	2.54
96	300369	绿盟科技	7,444,357.56	2.48
97	688176	亚虹医药	7,287,417.11	2.43
98	600029	南方航空	7,274,713.00	2.43
99	002965	祥鑫科技	6,625,591.00	2.21
100	300170	汉得信息	6,575,144.83	2.19
101	688205	德科立	6,471,996.23	2.16
102	300782	卓胜微	6,166,839.00	2.06

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	1,690,745,300.27
卖出股票收入（成交）总额	1,629,622,109.31

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	1,011,096.44	0.38
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,011,096.44	0.38

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	019694	23 国债 01	10,000	1,011,096.44	0.38

注：本基金本报告期末仅持有上述 1 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

三七互娱

根据 2023 年 6 月 27 日中国证券监督管理委员会发布对该公司、董事长李卫伟和副董事长曾开天的《中国证券监督管理委员会立案告知书》，因涉嫌信息披露违法违规，证监会决定对公司、李卫伟和曾开天立案。本基金做出如下说明：三七互娱是国内规模领先的综合型游戏公司，其产品在国内外都具有竞争力，渠道运营能力国内领先，公司基本面良好。基于相关研究，本基金判断，对公司和高管的处罚对公司近期经营的影响不大。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注立案事项的进展，以及该事项对公司经营的影响，并持续跟踪企业的经营状况。

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

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	319,500.07
2	应收清算款	48,488.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	268,248.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	636,236.92
---	----	------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十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 (%)
24,755	7,309.38	386,617.09	0.21	180,557,133.58	99.79

8.2 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	1,735.33	0.0010

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2013 年 5 月 10 日) 基金份额总额	308,496,450.30
本报告期期初基金份额总额	188,045,249.38
本报告期基金总申购份额	16,062,437.40
减：本报告期基金总赎回份额	23,163,936.11
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	180,943,750.67

§ 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

本报告期内本基金基金经理未发生变动。

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

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
华创证券	1	1,297,414,544.09	39.14	948,817.36	34.98	-
中信建投	1	874,847,786.34	26.39	814,753.96	30.04	-
安信证券	2	414,894,559.21	12.51	303,412.63	11.19	-
东兴证券	1	305,180,402.56	9.21	284,216.53	10.48	-
招商证券	1	259,189,556.92	7.82	241,385.99	8.90	-
中银国际证券	1	163,626,929.01	4.94	119,662.50	4.41	-
光大证券	1	48,540.94	0.00	35.50	0.00	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
星展证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	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	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				证

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
华创证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	998,610.00	100.00	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
星展证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

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、本基金租用证券公司深圳交易单元和北京交易单元为共用交易单元。

4、本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	国海证券	深圳	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	兴业证券	上海	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	长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金 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的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 2 日
4	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	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 8 日

	优惠活动的公告		
5	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
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关于增加开源证券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 3 月 23 日
8	长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
9	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的公告	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
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	长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金 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

§ 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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、长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛电子信息主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

- 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的办公地址和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/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