

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 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。

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	52

8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	66
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	67
§ 9 基金份额持有人信息.....	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末上市基金前十名持有人	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	68
§ 10 开放式基金份额变动.....	68
§ 11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	71
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	长盛沪深 300 指数 (LOF)
场内简称	长盛沪深 300LOF
基金主代码	160807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 8 月 4 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	160,069,927.09 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	2010 年 9 月 6 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资，跟踪沪深 300 指数，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%，以实现有效跟踪。
投资策略	本基金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均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4% 的投资目标。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+一年期银行定期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金是股票指数型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	招商银行股份有限公司
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	400-61-95555
传真	010-86497999	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号	深圳市深南大道 7088 号招商银

	楼中建财富国际中心 3-5 层	行大厦
邮政编码	100029	518040
法定代表人	胡甲	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	6,706,460.79	-14,337,797.54	72,395,713.61
本期利润	-14,372,061.94	-48,624,710.02	13,349,404.96
加权平均基金份额本期利润	-0.0940	-0.3201	0.0689
本期加权平均净值利润率	-6.55%	-21.51%	4.06%
本期基金份额净值增长率	-6.76%	-17.58%	3.48%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	52,019,961.89	65,901,080.36	134,714,677.24
期末可供分配基金份额利润	0.3250	0.4212	0.7245
期末基金	212,089,888.98	222,355,771.11	320,663,399.62

资产净值			
期末基金份额净值	1.325	1.421	1.724
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	69.77%	82.07%	120.90%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.49%	0.74%	-6.64%	0.75%	1.15%	-0.01%
过去六个月	-7.86%	0.79%	-10.14%	0.81%	2.28%	-0.02%
过去一年	-6.76%	0.78%	-10.74%	0.80%	3.98%	-0.02%
过去三年	-20.47%	1.04%	-32.47%	1.06%	12.00%	-0.02%
过去五年	58.48%	1.13%	14.14%	1.15%	44.34%	-0.02%
自基金合同生效起至今	69.77%	1.32%	22.10%	1.31%	47.67%	0.01%

注：本基金业绩比较基准 = 95% × 沪深 300 指数收益率 + 5% × 一年期银行定期存款利率（税后）。

沪深 300 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，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

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

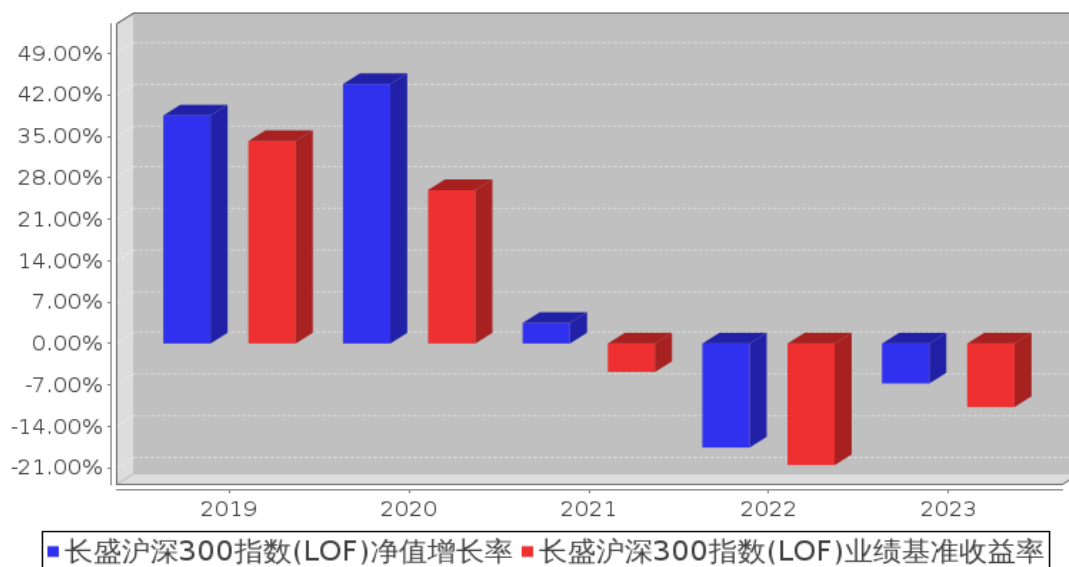
长盛沪深300指数(LOF)累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛沪深300指数(LOF)基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内较早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。长盛基金总部设在北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，下设长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司（DBS Bank Ltd.）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、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 12 月 31 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，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛上证 50 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证全指证券公司指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2019 年 10 月 9 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。

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
第 9 页 共 73 页

人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公

司相关制度等规定，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

公司对管理的不同投资组合过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易原则及利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年全年看来，具有顺周期、稳定盈利叠加红利特性的股票整体表现良好，虽然年中遭遇拥挤交易而产生回撤，但其后依然走出了稳健上涨的趋势。此外受到 chatgpt 的发布和升级的影响，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，尤其在上半年被充分交易至过度乐观的水平。此后科技成长类行业的市场走势逐步且快速的回归于其实际经营表现以及其合理的预期展望。A 股市场的其他板块总体持续下行，行业轮动迅速，尤其是下半年更难以寻觅能显著且持续走强的行业。以上种种现象暗示着市场对经济逐步修复、重回增长轨道开始展露信心，但对于快速恢复到全面高增长的期望有限，成长性更多的聚集在非常局部的行业和更远期的窗口内；这也正映射到当年哑铃型投资策略的有效性。

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 1.325 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.76%，业绩比较基准收益率为-10.74%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0173%，年度化跟踪误差为 0.9416%。

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 2024 年，美联储的降息预期在 2023 年底存在被过度交易的情形，预示美债可能会在超买后有所调整。美联储和财政部受到其国内大选的党派竞争、其国际治理能力的衰退以及其金融系统的脆弱性等底层因素的左右拉扯，可能使得两者在政策上难以强力调整，市场对其预期却往往反应过度，然后又发生均值回归。而我们国内财政政策也似乎倾向采取多看少动的态度，虽然货币政策可能会更积极一些，但信用自发扩张的动力依然不强，除非国内外有大级别的风险爆发。

因此 A 股可能先沿着 2023 年的风格及行业特征继续运行,直到被某些重大事件冲击后才更可能去寻找新结构和方向。我们后续需要重点关注中美库存周期大概率共振见底后的上行斜率和节奏,这对未来的行业和风格趋势有重要影响。美国经济对于准财政手段的依赖能持续多久以及中国经济对于强力财政政策的推行能有多快很有可能是未来的关键变量。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

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

开展相关业务。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人设有估值工作小组，负责制定、评估、复核和修订基金估值程序和技术，适时更新估值相关制度，指导并监督各类投资品种的估值程序，评估会计政策变更的影响，对证券投资基金估值方法进行最终决策等。估值工作小组由总经理担任组长，督察长担任副组长，小组成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可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，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 23859 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“长盛沪深 300 指数基金 (LOF)”) 的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“中国基金业协会”) 发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了长盛沪深 300 指数基金 (LOF) 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛沪深 300 指数基金 (LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
	长盛沪深 300 指数基金 (LOF) 的基金管理人长盛基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层对其他信息负责。

其他信息	<p>其他信息包括长盛沪深 300 指数基金 (LOF) 2023 年度年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作, 如果我们确定其他信息存在重大错报, 我们应当报告该事实。在这方面, 我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>长盛沪深 300 指数基金 (LOF) 的基金管理人长盛基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估长盛沪深 300 指数基金 (LOF) 的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项 (如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算长盛沪深 300 指数基金 (LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长盛沪深 300 指数基金 (LOF) 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险; 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能导致对长盛沪深 300 指数基金 (LOF) 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是</p>

	<p>否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛沪深 300 指数基金 (LOF) 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张勇	段黄霖
会计师事务所的地址	中国. 上海市	
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	14,352,728.05	14,153,187.50
结算备付金		-	144,340.16
存出保证金		3,938.72	59,140.03
交易性金融资产	7.4.7.2	197,400,647.91	208,657,140.73
其中：股票投资		197,339,220.24	208,581,906.27
基金投资		-	-
债券投资		61,427.67	75,234.46
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-

其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		157,143.15	-
应收股利		-	-
应收申购款		600,839.70	155,028.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		212,515,297.53	223,168,836.59
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		77,257.62	210,175.00
应付管理人报酬		131,988.74	142,143.93
应付托管费		26,397.74	28,428.78
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.35	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	189,764.10	432,317.77
负债合计		425,408.55	813,065.48
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	160,069,927.09	156,454,690.75
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	52,019,961.89	65,901,080.36
净资产合计		212,089,888.98	222,355,771.11
负债和净资产总计		212,515,297.53	223,168,836.59

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.325 元，基金份额总额 160,069,927.09 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
一、营业总收入		-12,211,535.79	-46,399,969.56

1. 利息收入		50,319.09	55,462.66
其中：存款利息收入	7.4.7.13	50,319.09	55,462.66
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,755,749.04	-12,577,948.02
其中：股票投资收益	7.4.7.14	3,799,800.15	-16,736,551.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	21,418.60	143,859.71
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	4,934,530.29	4,014,743.63
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-21,078,522.73	-34,286,912.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	60,918.81	409,428.28
减：二、营业总支出		2,160,526.15	2,224,740.46
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,646,655.35	1,696,268.90
2. 托管费	7.4.10.2.2	329,331.00	339,253.66
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.21	0.26
8. 其他费用	7.4.7.23	184,539.59	189,217.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,372,061.94	-48,624,710.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,372,061.94	-48,624,710.02
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-14,372,061.94	-48,624,710.02

7.3 净资产变动表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	156,454,690.75	65,901,080.36	222,355,771.11
二、本期期初净资产	156,454,690.75	65,901,080.36	222,355,771.11
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	3,615,236.34	-13,881,118.47	-10,265,882.13
(一)、综合收益总额	-	-14,372,061.94	-14,372,061.94
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	3,615,236.34	490,943.47	4,106,179.81
其中：1. 基金申购款	38,202,603.54	16,447,668.84	54,650,272.38
2. 基金赎回款	-34,587,367.20	-15,956,725.37	-50,544,092.57
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	160,069,927.09	52,019,961.89	212,089,888.98
项目	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	185,948,722.38	134,714,677.24	320,663,399.62
二、本期期初净资产	185,948,722.38	134,714,677.24	320,663,399.62
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-29,494,031.63	-68,813,596.88	-98,307,628.51
(一)、综合收益总额	-	-48,624,710.02	-48,624,710.02
(二)、本期基金份额交易产生的净资产	-29,494,031.63	-20,188,886.86	-49,682,918.49

产变动数 (净资产减少以“-” 号填列)			
其中: 1. 基金申购款	199,055,432.92	89,770,594.21	288,826,027.13
2. 基金赎回 款	-228,549,464.55	-109,959,481.07	-338,508,945.62
(三)、本期向基金 份额持有人分配利 润产生的净资产变 动(净资产减少以 “-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	156,454,690.75	65,901,080.36	222,355,771.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

胡甲

刁俊东

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2010]第 646 号《关于核准长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 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《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 898,648,405.80 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(2010)第 193 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2010 年 8 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 898,915,869.33 份,其中认购资金利息折合 267,463.53 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第 276 号文审核同意,本基金 112,932,582 份基金份额于 2010 年 9 月 6 日在深交所挂牌交易。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交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《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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、

债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票资产投资比例不低于基金资产净值的 90%，其中，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5% 的现金以及到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 95% + 一年期银行定期存款利率 (税后) \times 5%。本基金标的指数使用费由基金管理人长盛基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定 (以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会 (以下简称“中国基金业协会”) 颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类

取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最

近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征:(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利,这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产;这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位,并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量;(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别,即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具,且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权;(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别),所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征,并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同);(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外,该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征;(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额,应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市

场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以

2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	14,352,728.05	14,153,187.50
等于：本金	14,351,218.24	14,151,751.36
加：应计利息	1,509.81	1,436.14
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	14,352,728.05	14,153,187.50
----	---------------	---------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	230,565,317.60	-	197,339,220.24	-33,226,097.36	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	58,900.00	48.70	61,427.67	2,478.97
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	58,900.00	48.70	61,427.67	2,478.97
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	230,624,217.60	48.70	197,400,647.91	-33,223,618.39	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	220,741,002.29	-	208,581,906.27	-12,159,096.02	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	61,200.00	34.10	75,234.46	14,000.36
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	61,200.00	34.10	75,234.46	14,000.36
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	220,802,202.29	34.10	208,657,140.73	-12,145,095.66	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

7.4.7.5 债权投资

无。

7.4.7.6 其他债权投资

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	188.41	533.69
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	9,575.69	251,784.08
其中：交易所市场	9,575.69	251,784.08
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	189,764.10	432,317.77

7.4.7.10 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	156,454,690.75	156,454,690.75
本期申购	38,202,603.54	38,202,603.54
本期赎回（以“-”号填列）	-34,587,367.20	-34,587,367.20
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	160,069,927.09	160,069,927.09

注：1. 若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

2. 截至 2023 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 3,393,300.00 份（2022 年 12 月 31 日：2,906,780.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 156,676,627.09 份（2022 年 12 月 31 日：153,547,910.75 份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	169,234,150.63	-103,333,070.27	65,901,080.36
本期期初	169,234,150.63	-103,333,070.27	65,901,080.36
本期利润	6,706,460.79	-21,078,522.73	-14,372,061.94
本期基金份额交易产生的变动数	4,237,811.12	-3,746,867.65	490,943.47
其中：基金申购款	42,052,345.63	-25,604,676.79	16,447,668.84
金赎回款	-37,814,534.51	21,857,809.14	-15,956,725.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	180,178,422.54	-128,158,460.65	52,019,961.89

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	49,532.12	51,111.42
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	379.56	3,652.24
其他	407.41	699.00
合计	50,319.09	55,462.66

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,799,800.15	-16,736,551.36
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	3,799,800.15	-16,736,551.36

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	29,837,613.98	298,680,257.80
减：卖出股票成本总额	25,950,274.06	314,545,774.60
减：交易费用	87,539.77	871,034.56
买卖股票差价收入	3,799,800.15	-16,736,551.36

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	56.34	152.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	21,362.26	143,706.77
债券投资收益——赎回	-	-

回差价收入		
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	21,418.60	143,859.71

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	82,608.98	894,959.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	61,200.00	751,100.00
减：应计利息总额	43.41	148.58
减：交易费用	3.31	4.56
买卖债券差价收入	21,362.26	143,706.77

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,934,530.29	4,014,743.63
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	4,934,530.29	4,014,743.63

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-21,078,522.73	-34,286,912.48
股票投资	-21,067,001.34	-34,278,199.49
债券投资	-11,521.39	-8,712.99
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	-21,078,522.73	-34,286,912.48

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	60,893.91	182,334.75
基金转换费收入	24.90	227,093.53
合计	60,918.81	409,428.28

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对持续持有期少于 7 天的基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产；其余赎回费总额的 25% 计入基金资产。

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，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	4,539.59	9,217.64
合计	184,539.59	189,217.64

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
国元证券	32,101,697.56	56.01	317,934,340.11	58.59

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）
国元证券	57,616.76	69.75	805,161.53	89.97

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国元证券	30,017.84	56.00	5,027.98	52.51
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国元证券	296,094.42	58.59	147,016.52	58.39

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,646,655.35	1,696,268.90
其中：应支付销售机构的客户维护 费	398,446.63	406,371.72
应支付基金管理人的净管理费	1,248,208.72	1,289,897.18

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年管理费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
当期发生的基金应支付的托管费	329,331.00		339,253.66	

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年托管费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	14,352,728.05	49,532.12	14,153,187.50	51,111.42
合计	14,352,728.05	49,532.12	14,153,187.50	51,111.42

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	限售期锁定	12.05	21.94	189	2,277.45	4,146.66	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	限售期锁定	53.63	84.62	41	2,198.83	3,469.42	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	限售期锁定	41.18	51.74	84	3,459.12	4,346.16	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	限售期锁定	41.00	46.28	63	2,583.00	2,915.64	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	限售期锁定	31.68	36.39	141	4,466.88	5,130.99	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	限售期锁定	25.82	31.77	181	4,673.42	5,750.37	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	限售期锁定	28.88	34.64	222	6,411.36	7,690.08	-

		日									
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	限售期锁定	21.00	22.21	301	6,321.00	6,685.21	-	
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	限售期锁定	55.68	37.55	121	6,737.28	4,543.55	-	
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	限售期锁定	33.25	70.25	158	5,253.50	11,099.50	-	
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	限售期锁定	29.38	59.36	250	7,345.00	14,840.00	-	
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	限售期锁定	31.90	44.48	173	5,518.70	7,695.04	-	
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	限售期锁定	57.66	47.16	141	8,130.06	6,649.56	-	
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	限售期锁定	5.32	40.76	867	4,612.44	35,338.92	-	
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	限售期锁定	41.66	67.77	113	4,707.58	7,658.01	-	
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	限售期锁定	19.50	28.90	341	6,649.50	9,854.90	-	
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	限售期锁定	23.97	20.89	249	5,968.53	5,201.61	-	
301505	苏州规	2023年7月12日	6个月	限售期锁定	26.35	35.79	194	5,111.90	6,943.26	-	

	划	日									
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	限售期锁定	10.00	15.85	477	4,770.00	7,560.45	-	
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	限售期锁定	16.82	32.25	313	5,264.66	10,094.25	-	
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	限售期锁定	12.00	35.00	396	4,752.00	13,860.00	-	
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	限售期锁定	31.16	28.26	180	5,608.80	5,086.80	-	
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	限售期锁定	6.87	20.06	604	4,149.48	12,116.24	-	
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	限售期锁定	26.87	51.90	150	4,030.50	7,785.00	-	
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	限售期锁定	67.88	52.74	83	5,634.04	4,377.42	-	
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	限售期锁定	99.57	81.46	65	6,472.05	5,294.90	-	
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	限售期锁定	2.66	5.26	3,547	9,435.02	18,657.22	-	
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	限售期锁定	71.80	68.86	96	6,892.80	6,610.56	-	
301529	福赛科	2023年8月31日	6个月	限售期锁定	36.60	37.88	143	5,233.80	5,416.84	-	

	技	日								
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	限售期锁定	66.80	59.03	72	4,809.60	4,250.16	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	限售期锁定	37.56	43.58	139	5,220.84	6,057.62	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	限售期锁定	22.88	39.68	224	5,125.12	8,888.32	-
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	限售期锁定	7.33	13.67	771	5,651.43	10,539.57	-
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	限售期锁定	24.22	18.25	267	6,466.74	4,872.75	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	限售期锁定	8.90	27.95	562	5,001.80	15,707.90	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	限售期锁定	23.23	43.26	197	4,576.31	8,522.22	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	限售期锁定	48.94	74.43	103	5,040.82	7,666.29	-
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	限售期锁定	11.25	11.85	346	3,892.50	4,100.10	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	限售期锁定	1.70	5.23	1,592	2,706.40	8,326.16	-
603004	鼎龙科	2023年12月20日	6个月	限售期锁定	16.80	34.50	117	1,965.60	4,036.50	-

	技	日								
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	限售期锁定	23.10	23.32	94	2,171.40	2,192.08	-
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	限售期锁定	14.23	21.96	145	2,063.35	3,184.20	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	限售期锁定	15.32	23.86	116	1,777.12	2,767.76	-
603193	润本股份	2023年10月9日	6个月	限售期锁定	17.38	17.02	140	2,433.20	2,382.80	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	限售期锁定	21.29	22.26	97	2,065.13	2,159.22	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	限售期锁定	21.77	29.58	117	2,547.09	3,460.86	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	限售期锁定	9.50	20.45	178	1,691.00	3,640.10	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	限售期锁定	25.73	24.88	95	2,444.35	2,363.60	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	限售期锁定	19.10	40.47	88	1,680.80	3,561.36	-
688347	华虹公司	2023年7月27日	6个月	限售期锁定	52.00	42.04	6,279	326,508.00	263,969.16	-
688548	广钢气	2023年8月8日	6个月	限售期锁定	9.87	12.74	810	7,994.70	10,319.40	-

	体	日								
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	限售期锁定	5.18	8.09	1,215	6,293.70	9,829.35	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	限售期锁定	78.99	60.47	151	11,927.49	9,130.97	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	限售期锁定	24.98	28.02	314	7,843.72	8,798.28	-
688592	司南导航	2023年8月7日	6个月	限售期锁定	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	限售期锁定	8.66	11.05	557	4,823.62	6,154.85	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	限售期锁定	55.00	74.10	126	6,930.00	9,336.60	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	限售期锁定	47.29	37.94	119	5,627.51	4,514.86	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	限售期锁定	46.77	87.67	130	6,080.10	11,397.10	-
688638	誉辰智能	2023年7月4日	6个月	限售期锁定	83.90	59.65	98	8,222.20	5,845.70	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	限售期锁定	46.80	36.06	135	6,318.00	4,868.10	-
688648	中邮科	2023年11月6日	6个月	限售期锁定	15.18	24.91	303	4,599.54	7,547.73	-

	技	日									
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	限售期锁定	39.90	46.03	159	6,344.10	7,318.77	-	
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	限售期锁定	31.95	57.06	173	5,527.35	9,871.38	-	
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	限售期锁定	10.50	18.86	498	5,229.00	9,392.28	-	
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	限售期锁定	103.40	79.31	55	5,687.00	4,362.05	-	
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	限售期锁定	40.83	43.40	139	5,675.37	6,032.60	-	
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	限售期锁定	42.66	48.19	151	6,441.66	7,276.69	-	
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	限售期锁定	29.66	36.38	166	4,923.56	6,039.08	-	
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	限售期锁定	69.98	60.10	91	6,368.18	5,469.10	-	
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	限售期锁定	28.03	57.51	165	4,624.95	9,489.15	-	

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，锁定期限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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.03% (2022 年 12 月 31 日：0.03%)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2023 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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

上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持证券均在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合上述要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,351,218.24	-	-	1,509.81	14,352,728.05
存出保证金	3,936.74	-	-	1.98	3,938.72
交易性金融资产	-	-	61,378.97	197,339,268.94	197,400,647.91
应收申购款	-	-	-	600,839.70	600,839.70
应收清算款	-	-	-	157,143.15	157,143.15
资产总计	14,355,154.98	-	61,378.97	198,098,763.58	212,515,297.53
负债					
应付赎回款	-	-	-	77,257.62	77,257.62
应付管理人报酬	-	-	-	131,988.74	131,988.74
应付托管费	-	-	-	26,397.74	26,397.74
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	189,764.10	189,764.10
负债总计	-	-	-	425,408.55	425,408.55
利率敏感度缺口	14,355,154.98	-	61,378.97	197,673,355.03	212,089,888.98
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					
货币资金	14,151,751.36	-	-	1,436.14	14,153,187.50
结算备付金	144,268.77	-	-	71.39	144,340.16
存出保证金	59,110.77	-	-	29.26	59,140.03
交易性金融资产	-	23,362.56	51,837.80	208,581,940.37	208,657,140.73
应收申购款	-	-	-	155,028.17	155,028.17
资产总计	14,355,130.90	23,362.56	51,837.80	208,738,505.33	223,168,836.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	210,175.00	210,175.00
应付管理人报酬	-	-	-	142,143.93	142,143.93
应付托管费	-	-	-	28,428.78	28,428.78
其他负债	-	-	-	432,317.77	432,317.77
负债总计	-	-	-	813,065.48	813,065.48
利率敏感度缺口	14,355,130.90	23,362.56	51,837.80	207,925,439.85	222,355,771.11

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金净资产无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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。

本基金采用抽样复制指数的投资策略，股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例占基金资产净值的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	197,339,220.24	93.05	208,581,906.27	93.81
合计	197,339,220.24	93.05	208,581,906.27	93.81

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%		10,306,036.25
2. 业绩比较基准下降 5%		-10,306,036.25	-10,886,420.70

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	196,617,272.10	207,898,936.43
第二层次	-	135,702.84
第三层次	783,375.81	622,501.46
合计	197,400,647.91	208,657,140.73

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	622,501.46	622,501.46

当期购买	-	0.00	0.00
当期出售/结算	-	0.00	0.00
转入第三层次	-	1,041,428.97	1,041,428.97
转出第三层次	-	1,036,975.71	1,036,975.71
当期利得或损失总额	-	156,421.09	156,421.09
其中：计入损益的利得或损失	-	156,421.09	156,421.09
计入其他综合收益的利得或损失	-	0.00	0.00
期末余额	-	783,375.81	783,375.81
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	94,478.76	94,478.76
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2,315,690.79	2,315,690.79
当期购买	-	0.00	0.00
当期出售/结算	-	0.00	0.00
转入第三层次	-	1,416,175.36	1,416,175.36
转出第三层次	-	3,274,639.65	3,274,639.65
当期利得或损失总额	-	165,274.96	165,274.96
其中：计入损益的利得或损失	-	165,274.96	165,274.96
计入其他综合收益的利得或损失	-	0.00	0.00
期末余额	-	622,501.46	622,501.46
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	59,748.44	59,748.44

注：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允	采用的估	不可观察输入值
----	-------	------	---------

	价值	值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	783,375.81	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动率	0.187297-1.531612	负相关
项目	上年度末公 允价值	采用的估 值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	622,501.46	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动率	0.190909-0.879166	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	197,339,220.24	92.86
	其中：股票	197,339,220.24	92.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	61,427.67	0.03
	其中：债券	61,427.67	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,352,728.05	6.75
8	其他各项资产	761,921.57	0.36

9	合计	212,515,297.53	100.00
---	----	----------------	--------

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	2,364,785.44	1.11
B	采矿业	9,726,932.01	4.59
C	制造业	105,309,141.86	49.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,540,364.52	3.08
E	建筑业	4,203,687.03	1.98
F	批发和零售业	610,416.34	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	6,073,489.26	2.86
H	住宿和餐饮业	155,480.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,071,222.02	4.28
J	金融业	37,920,134.39	17.88
K	房地产业	2,265,811.68	1.07
L	租赁和商务服务业	1,620,075.92	0.76
M	科学研究和技术服务业	2,249,391.60	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	809,208.82	0.38
R	文化、体育和娱乐业	214,200.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	189,134,340.89	89.18

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	179,413.08	0.08
C	制造业	6,519,283.21	3.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	100,487.48	0.05
F	批发和零售业	115,867.38	0.05

G	交通运输、仓储和邮政业	342,519.92	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,021.51	0.01
J	金融业	234,153.60	0.11
K	房地产业	245,839.70	0.12
L	租赁和商务服务业	19,467.06	0.01
M	科学研究和技术服务业	21,414.93	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	5,498.24	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	108,528.00	0.05
Q	卫生和社会工作	191,125.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	94,260.24	0.04
S	综合	-	-
	合计	8,204,879.35	3.87

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	6,889	11,890,414.00	5.61
2	300750	宁德时代	30,060	4,907,595.60	2.31
3	601318	中国平安	117,290	4,726,787.00	2.23
4	000333	美的集团	56,188	3,069,550.44	1.45
5	000858	五粮液	21,806	3,059,599.86	1.44
6	601166	兴业银行	166,630	2,701,072.30	1.27
7	600900	长江电力	110,192	2,571,881.28	1.21
8	601899	紫金矿业	188,801	2,352,460.46	1.11
9	600030	中信证券	111,740	2,276,143.80	1.07
10	600276	恒瑞医药	48,686	2,202,067.78	1.04
11	300760	迈瑞医疗	7,200	2,092,320.00	0.99
12	002594	比亚迪	9,903	1,960,794.00	0.92
13	300059	东方财富	137,798	1,934,683.92	0.91
14	601398	工商银行	401,887	1,921,019.86	0.91
15	002475	立讯精密	54,564	1,879,729.80	0.89

16	600887	伊利股份	69,810	1,867,417.50	0.88
17	601328	交通银行	314,181	1,803,398.94	0.85
18	002415	海康威视	51,496	1,787,941.12	0.84
19	603259	药明康德	22,435	1,632,370.60	0.77
20	600028	中国石化	287,762	1,605,711.96	0.76
21	000725	京东方 A	407,788	1,590,373.20	0.75
22	000651	格力电器	49,417	1,589,744.89	0.75
23	600309	万华化学	20,526	1,576,807.32	0.74
24	601012	隆基绿能	66,118	1,514,102.20	0.71
25	000568	泸州老窖	8,057	1,445,586.94	0.68
26	600919	江苏银行	206,370	1,380,615.30	0.65
27	601816	京沪高铁	266,900	1,313,148.00	0.62
28	300124	汇川技术	20,436	1,290,329.04	0.61
29	600941	中国移动	12,900	1,283,292.00	0.61
30	601288	农业银行	347,765	1,265,864.60	0.60
31	002714	牧原股份	29,761	1,225,557.98	0.58
32	600809	山西汾酒	5,300	1,222,869.00	0.58
33	688981	中芯国际	22,009	1,166,917.18	0.55
34	300498	温氏股份	56,791	1,139,227.46	0.54
35	601088	中国神华	36,178	1,134,180.30	0.53
36	601668	中国建筑	230,203	1,107,276.43	0.52
37	002352	顺丰控股	26,900	1,086,760.00	0.51
38	600016	民生银行	279,839	1,046,597.86	0.49
39	603501	韦尔股份	9,410	1,004,141.10	0.47
40	300274	阳光电源	11,400	998,526.00	0.47
41	000001	平安银行	105,379	989,508.81	0.47
42	600837	海通证券	105,594	989,415.78	0.47
43	600406	国电南瑞	43,820	978,062.40	0.46
44	000100	TCL 科技	225,589	970,032.70	0.46
45	601728	中国电信	176,000	952,160.00	0.45
46	000792	盐湖股份	59,200	944,240.00	0.45
47	002230	科大讯飞	20,159	934,974.42	0.44
48	601988	中国银行	231,760	924,722.40	0.44
49	688111	金山办公	2,913	921,090.60	0.43
50	000063	中兴通讯	34,689	918,564.72	0.43
51	600050	中国联通	209,248	916,506.24	0.43
52	000625	长安汽车	54,219	912,505.77	0.43
53	601857	中国石油	128,365	906,256.90	0.43
54	601888	中国中免	10,728	897,826.32	0.42
55	600031	三一重工	64,933	894,127.41	0.42
56	601601	中国太保	37,566	893,319.48	0.42
57	601225	陕西煤业	42,617	890,269.13	0.42
58	600905	三峡能源	202,400	884,488.00	0.42

59	600690	海尔智家	41,615	873,915.00	0.41
60	002142	宁波银行	43,391	872,593.01	0.41
61	600000	浦发银行	128,229	848,875.98	0.40
62	300782	卓胜微	5,820	820,620.00	0.39
63	601688	华泰证券	58,662	818,334.90	0.39
64	000338	潍柴动力	59,392	810,700.80	0.38
65	300015	爱尔眼科	51,151	809,208.82	0.38
66	300122	智飞生物	13,100	800,541.00	0.38
67	600089	特变电工	57,955	799,779.00	0.38
68	600436	片仔癀	3,300	798,567.00	0.38
69	600048	保利发展	79,034	782,436.60	0.37
70	000002	万科 A	74,647	780,807.62	0.37
71	601985	中国核电	102,795	770,962.50	0.36
72	600438	通威股份	30,800	770,924.00	0.36
73	600111	北方稀土	39,570	765,283.80	0.36
74	002304	洋河股份	6,897	757,980.30	0.36
75	688012	中微公司	4,878	749,260.80	0.35
76	600150	中国船舶	25,200	741,888.00	0.35
77	601211	国泰君安	49,400	735,072.00	0.35
78	601169	北京银行	161,852	733,189.56	0.35
79	002027	分众传媒	114,280	722,249.60	0.34
80	002050	三花智控	24,450	718,830.00	0.34
81	002371	北方华创	2,900	712,559.00	0.34
82	601766	中国中车	132,943	699,280.18	0.33
83	000938	紫光股份	35,821	693,136.35	0.33
84	603288	海天味业	18,232	691,904.40	0.33
85	601818	光大银行	238,267	690,974.30	0.33
86	688008	澜起科技	11,597	681,439.72	0.32
87	600104	上汽集团	50,243	679,787.79	0.32
88	603986	兆易创新	7,308	675,186.12	0.32
89	601919	中远海控	69,100	661,978.00	0.31
90	601138	工业富联	43,500	657,720.00	0.31
91	600660	福耀玻璃	17,541	655,857.99	0.31
92	601229	上海银行	109,551	654,019.47	0.31
93	002466	天齐锂业	11,711	653,356.69	0.31
94	601390	中国中铁	111,929	635,756.72	0.30
95	600585	海螺水泥	26,390	595,358.40	0.28
96	002129	TCL 中环	37,025	579,071.00	0.27
97	600019	宝钢股份	97,188	576,324.84	0.27
98	600745	闻泰科技	13,600	575,416.00	0.27
99	300014	亿纬锂能	13,400	565,480.00	0.27
100	600999	招商证券	40,746	555,775.44	0.26
101	601658	邮储银行	126,700	551,145.00	0.26

102	002241	歌尔股份	26,204	550,546.04	0.26
103	600893	航发动力	14,641	547,280.58	0.26
104	600938	中国海油	26,002	545,261.94	0.26
105	000661	长春高新	3,700	539,460.00	0.25
106	002179	中航光电	13,828	539,292.00	0.25
107	000538	云南白药	10,827	532,147.05	0.25
108	601669	中国电建	107,973	527,987.97	0.25
109	002460	赣锋锂业	12,290	526,012.00	0.25
110	601628	中国人寿	18,299	518,776.65	0.24
111	601989	中国重工	124,334	513,499.42	0.24
112	600760	中航沈飞	12,112	510,884.16	0.24
113	603799	华友钴业	15,501	510,447.93	0.24
114	603019	中科曙光	12,820	506,261.80	0.24
115	688036	传音控股	3,627	501,976.80	0.24
116	600570	恒生电子	17,431	501,315.56	0.24
117	002049	紫光国微	7,380	497,781.00	0.23
118	600958	东方证券	57,106	496,822.20	0.23
119	601600	中国铝业	86,097	485,587.08	0.23
120	601939	建设银行	73,709	479,845.59	0.23
121	601006	大秦铁路	65,116	469,486.36	0.22
122	600584	长电科技	15,700	468,802.00	0.22
123	600009	上海机场	14,252	467,180.56	0.22
124	000425	徐工机械	84,826	463,149.96	0.22
125	601377	兴业证券	78,749	462,256.63	0.22
126	000776	广发证券	32,265	461,066.85	0.22
127	600547	山东黄金	19,720	450,996.40	0.21
128	600426	华鲁恒升	16,300	449,717.00	0.21
129	600926	杭州银行	44,720	447,647.20	0.21
130	300408	三环集团	15,100	444,695.00	0.21
131	002236	大华股份	23,922	441,360.90	0.21
132	000166	申万宏源	98,830	438,805.20	0.21
133	603392	万泰生物	5,825	437,632.25	0.21
134	002271	东方雨虹	22,700	435,840.00	0.21
135	002821	凯莱英	3,720	431,892.00	0.20
136	600886	国投电力	32,763	431,816.34	0.20
137	601800	中国交建	56,433	428,890.80	0.20
138	601009	南京银行	56,704	418,475.52	0.20
139	002920	德赛西威	3,200	414,432.00	0.20
140	002252	上海莱士	51,700	413,600.00	0.20
141	000596	古井贡酒	1,773	412,754.40	0.19
142	300142	沃森生物	17,500	411,425.00	0.19
143	601111	中国国航	55,796	409,542.64	0.19
144	002311	海大集团	9,100	408,681.00	0.19

145	600115	中国东航	105,109	407,822.92	0.19
146	600085	同仁堂	7,575	406,777.50	0.19
147	600795	国电电力	97,428	405,300.48	0.19
148	603993	洛阳钼业	77,605	403,546.00	0.19
149	000963	华东医药	9,679	401,291.34	0.19
150	600588	用友网络	22,553	401,217.87	0.19
151	600015	华夏银行	69,236	389,106.32	0.18
152	600674	川投能源	25,466	385,045.92	0.18
153	601186	中国铁建	50,595	385,027.95	0.18
154	600845	宝信软件	7,860	383,568.00	0.18
155	300033	同花顺	2,400	376,488.00	0.18
156	002459	晶澳科技	18,160	376,275.20	0.18
157	600011	华能国际	48,300	371,910.00	0.18
158	000977	浪潮信息	11,200	371,840.00	0.18
159	002812	恩捷股份	6,500	369,330.00	0.17
160	601995	中金公司	9,700	369,085.00	0.17
161	601901	方正证券	45,304	365,150.24	0.17
162	600010	包钢股份	249,641	364,475.86	0.17
163	601916	浙商银行	143,100	360,612.00	0.17
164	001979	招商蛇口	37,769	359,938.57	0.17
165	000157	中联重科	54,808	357,896.24	0.17
166	600989	宝丰能源	24,100	355,957.00	0.17
167	600029	南方航空	61,558	354,574.08	0.17
168	002001	新和成	20,888	354,260.48	0.17
169	300896	爱美客	1,200	353,196.00	0.17
170	601689	拓普集团	4,800	352,800.00	0.17
171	600196	复星医药	13,990	350,169.70	0.17
172	601360	三六零	38,800	349,588.00	0.16
173	002493	荣盛石化	33,300	344,655.00	0.16
174	601633	长城汽车	13,580	342,487.60	0.16
175	000768	中航西飞	15,241	340,941.17	0.16
176	688599	天合光能	11,926	340,248.78	0.16
177	601066	中信建投	14,200	335,972.00	0.16
178	603369	今世缘	6,800	331,500.00	0.16
179	601100	恒立液压	6,056	331,142.08	0.16
180	601788	光大证券	21,447	330,712.74	0.16
181	300661	圣邦股份	3,710	330,227.10	0.16
182	002709	天赐材料	13,000	326,040.00	0.15
183	300347	泰格医药	5,900	324,323.00	0.15
184	600346	恒力石化	24,240	319,240.80	0.15
185	002555	三七互娱	16,902	317,926.62	0.15
186	300450	先导智能	12,400	317,440.00	0.15
187	600489	中金黄金	31,501	313,749.96	0.15

188	300316	晶盛机电	7,100	313,039.00	0.15
189	000895	双汇发展	11,347	303,078.37	0.14
190	600188	兖矿能源	15,216	301,428.96	0.14
191	601021	春秋航空	6,000	301,200.00	0.14
192	600600	青岛啤酒	4,000	299,000.00	0.14
193	601868	中国能建	142,300	298,830.00	0.14
194	300759	康龙化成	10,100	292,698.00	0.14
195	000301	东方盛虹	30,300	290,880.00	0.14
196	600741	华域汽车	17,829	290,256.12	0.14
197	300433	蓝思科技	21,700	286,440.00	0.14
198	601336	新华保险	9,174	285,586.62	0.13
199	601699	潞安环能	13,000	284,830.00	0.13
200	300496	中科创达	3,500	280,210.00	0.13
201	601838	成都银行	24,500	275,870.00	0.13
202	002007	华兰生物	12,365	273,637.45	0.13
203	002648	卫星化学	18,480	272,580.00	0.13
204	002601	龙佰集团	15,800	270,654.00	0.13
205	002736	国信证券	31,609	269,940.86	0.13
206	003816	中国广核	86,400	268,704.00	0.13
207	000786	北新建材	11,500	268,640.00	0.13
208	688126	沪硅产业	15,493	268,338.76	0.13
209	688396	华润微	5,989	267,648.41	0.13
210	688223	晶科能源	30,102	266,703.72	0.13
211	601881	中国银河	22,000	265,100.00	0.12
212	603260	合盛硅业	5,180	264,180.00	0.12
213	600176	中国巨石	26,390	259,413.70	0.12
214	601117	中国化学	40,300	256,308.00	0.12
215	002180	纳思达	11,300	255,719.00	0.12
216	601877	正泰电器	11,800	253,818.00	0.12
217	002074	国轩高科	11,700	251,550.00	0.12
218	002410	广联达	14,480	248,187.20	0.12
219	000983	山西焦煤	24,800	245,024.00	0.12
220	002202	金风科技	30,282	242,256.00	0.11
221	600183	生益科技	13,200	241,692.00	0.11
222	000733	振华科技	4,100	241,244.00	0.11
223	603659	璞泰来	11,430	239,229.90	0.11
224	601618	中国中冶	78,086	238,943.16	0.11
225	605117	德业股份	2,760	231,564.00	0.11
226	000876	新希望	24,714	230,334.48	0.11
227	600233	圆通速递	18,700	229,823.00	0.11
228	000408	藏格矿业	9,000	228,060.00	0.11
229	300999	金龙鱼	6,800	226,984.00	0.11
230	601615	明阳智能	18,100	226,974.00	0.11

231	300308	中际旭创	2,000	225,820.00	0.11
232	600219	南山铝业	76,500	224,910.00	0.11
233	601878	浙商证券	21,300	222,159.00	0.10
234	600332	白云山	7,763	222,021.80	0.10
235	688303	大全能源	7,486	221,361.02	0.10
236	600732	爱旭股份	12,360	218,030.40	0.10
237	601872	招商轮船	36,700	215,796.00	0.10
238	300413	芒果超媒	8,500	214,200.00	0.10
239	600039	四川路桥	28,540	213,764.60	0.10
240	601238	广汽集团	24,340	212,975.00	0.10
241	002841	视源股份	4,600	210,496.00	0.10
242	688041	海光信息	2,962	210,242.76	0.10
243	600460	士兰微	9,200	210,036.00	0.10
244	601799	星宇股份	1,600	209,776.00	0.10
245	601607	上海医药	12,500	209,125.00	0.10
246	600918	中泰证券	30,400	208,544.00	0.10
247	600362	江西铜业	11,407	203,729.02	0.10
248	300454	深信服	2,800	202,412.00	0.10
249	300919	中伟股份	4,100	201,433.00	0.09
250	300751	迈为股份	1,540	199,445.40	0.09
251	603806	福斯特	8,164	198,140.28	0.09
252	601898	中煤能源	20,000	193,800.00	0.09
253	600061	国投资本	28,216	190,175.84	0.09
254	600132	重庆啤酒	2,800	186,060.00	0.09
255	600875	东方电气	12,500	182,750.00	0.09
256	603290	斯达半导	1,000	181,000.00	0.09
257	600803	新奥股份	10,600	178,292.00	0.08
258	601998	中信银行	33,588	177,680.52	0.08
259	002938	鹏鼎控股	7,900	176,328.00	0.08
260	600025	华能水电	20,400	176,052.00	0.08
261	300223	北京君正	2,700	174,555.00	0.08
262	688271	联影医疗	1,272	174,276.72	0.08
263	601319	中国人保	35,000	169,400.00	0.08
264	601865	福莱特	6,300	168,210.00	0.08
265	002916	深南电路	2,320	164,696.80	0.08
266	300628	亿联网络	5,500	162,525.00	0.08
267	688363	华熙生物	2,405	160,966.65	0.08
268	600372	中航机载	12,162	160,295.16	0.08
269	600018	上港集团	31,873	156,177.70	0.07
270	000617	中油资本	28,900	156,060.00	0.07
271	000708	中信特钢	11,100	155,844.00	0.07
272	600754	锦江酒店	5,200	155,480.00	0.07
273	603899	晨光股份	4,100	153,955.00	0.07

274	300763	锦浪科技	2,200	153,780.00	0.07
275	000877	天山股份	23,000	153,640.00	0.07
276	605499	东鹏饮料	800	146,008.00	0.07
277	603833	欧派家居	2,020	140,612.20	0.07
278	000069	华侨城 A	44,899	139,635.89	0.07
279	300957	贝泰妮	1,900	129,523.00	0.06
280	603195	公牛集团	1,332	127,405.80	0.06
281	688561	奇安信	3,043	121,993.87	0.06
282	601698	中国卫通	6,800	117,708.00	0.06
283	601155	新城控股	10,300	117,523.00	0.06
284	688065	凯赛生物	2,090	114,908.20	0.05
285	601236	红塔证券	15,030	114,077.70	0.05
286	600606	绿地控股	48,218	110,901.40	0.05
287	688187	时代电气	2,967	107,791.11	0.05
288	603486	科沃斯	2,500	103,600.00	0.05
289	601808	中海油服	6,800	99,416.00	0.05
290	300979	华利集团	1,700	89,488.00	0.04
291	688256	寒武纪	644	86,914.24	0.04
292	000800	一汽解放	10,100	85,850.00	0.04
293	600515	海南机场	23,100	85,470.00	0.04
294	301269	华大九天	700	74,095.00	0.03
295	000999	华润三九	1,400	69,622.00	0.03
296	002603	以岭药业	2,800	64,596.00	0.03
297	600023	浙能电力	13,500	62,235.00	0.03
298	001289	龙源电力	1,700	33,677.00	0.02
299	601059	信达证券	1,200	21,588.00	0.01

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600161	天坛生物	11,260	348,384.40	0.16
2	600352	浙江龙盛	36,712	308,380.80	0.15
3	688347	华虹公司	6,279	263,969.16	0.12
4	002756	永兴材料	4,940	257,917.40	0.12
5	300207	欣旺达	17,000	250,920.00	0.12
6	688428	诺诚健华	20,503	235,784.50	0.11
7	603160	汇顶科技	3,300	228,030.00	0.11
8	300003	乐普医疗	13,600	219,776.00	0.10
9	000066	中国长城	21,500	217,580.00	0.10
10	300866	安克创新	2,400	212,640.00	0.10
11	300601	康泰生物	7,600	206,340.00	0.10
12	300769	德方纳米	3,360	205,060.80	0.10
13	600763	通策医疗	2,500	191,125.00	0.09
14	002568	百润股份	7,680	189,004.80	0.09

15	000723	美锦能源	28,300	188,478.00	0.09
16	600177	雅戈尔	28,552	187,015.60	0.09
17	600066	宇通客车	13,798	182,823.50	0.09
18	600884	杉杉股份	12,900	175,698.00	0.08
19	603087	甘李药业	3,200	168,480.00	0.08
20	000703	恒逸石化	24,520	164,774.40	0.08
21	002064	华峰化学	22,600	151,646.00	0.07
22	600383	金地集团	34,740	151,466.40	0.07
23	600867	通化东宝	13,800	149,454.00	0.07
24	601216	君正集团	38,708	144,767.92	0.07
25	688076	诺泰生物	3,133	140,828.35	0.07
26	688005	容百科技	3,502	139,379.60	0.07
27	002414	高德红外	18,715	136,619.50	0.06
28	601018	宁波港	37,309	132,820.04	0.06
29	600583	海油工程	21,232	126,118.08	0.06
30	002120	韵达股份	15,993	119,307.78	0.06
31	600516	方大炭素	21,856	114,525.44	0.05
32	600038	中直股份	2,924	112,661.72	0.05
33	601997	贵阳银行	21,740	111,743.60	0.05
34	603185	弘元绿能	3,274	108,958.72	0.05
35	002607	中公教育	26,600	108,528.00	0.05
36	600655	豫园股份	16,961	105,327.81	0.05
37	600170	上海建工	42,422	99,267.48	0.05
38	688351	微电生理	3,785	97,085.25	0.05
39	600398	海澜之家	12,900	95,718.00	0.05
40	600208	新湖中宝	43,490	94,373.30	0.04
41	600977	中国电影	7,701	94,260.24	0.04
42	000709	河钢股份	40,475	86,211.75	0.04
43	002791	坚朗五金	2,000	80,980.00	0.04
44	601825	沪农商行	13,900	79,786.00	0.04
45	688119	中钢洛耐	13,542	66,084.96	0.03
46	688448	磁谷科技	1,615	62,710.45	0.03
47	601992	金隅集团	32,100	61,311.00	0.03
48	600968	海油发展	18,700	53,295.00	0.03
49	002468	申通快递	6,000	46,740.00	0.02
50	688236	春立医疗	1,678	44,131.40	0.02
51	600928	西安银行	12,800	42,624.00	0.02
52	601298	青岛港	6,400	39,552.00	0.02
53	301487	盟固利	867	35,338.92	0.02
54	601212	白银有色	12,900	34,701.00	0.02
55	301526	国际复材	3,547	18,657.22	0.01
56	601828	美凯龙	4,110	15,905.70	0.01
57	301566	达利凯普	562	15,707.90	0.01

58	301421	波长光电	250	14,840.00	0.01
59	301510	固高科技	396	13,860.00	0.01
60	301516	中远通	604	12,116.24	0.01
61	688627	精智达	130	11,397.10	0.01
62	688080	映翰通	280	11,362.40	0.01
63	301413	安培龙	158	11,099.50	0.01
64	688592	司南导航	216	10,914.48	0.01
65	301558	三态股份	771	10,539.57	0.00
66	688548	广钢气体	810	10,319.40	0.00
67	301508	中机认检	313	10,094.25	0.00
68	688652	京仪装备	173	9,871.38	0.00
69	301499	维科精密	341	9,854.90	0.00
70	688549	中巨芯	1,215	9,829.35	0.00
71	688720	艾森股份	165	9,489.15	0.00
72	688653	康希通信	498	9,392.28	0.00
73	688603	天承科技	126	9,336.60	0.00
74	688563	航材股份	151	9,130.97	0.00
75	301555	惠柏新材	224	8,888.32	0.00
76	688591	泰凌微	314	8,798.28	0.00
77	301568	思泰克	197	8,522.22	0.00
78	601096	宏盛华源	1,592	8,326.16	0.00
79	688078	龙软科技	200	8,064.00	0.00
80	301517	陕西华达	150	7,785.00	0.00
81	301459	丰茂股份	173	7,695.04	0.00
82	301251	威尔高	222	7,690.08	0.00
83	301578	辰奕智能	103	7,666.29	0.00
84	301489	思泉新材	113	7,658.01	0.00
85	301507	民生健康	477	7,560.45	0.00
86	688648	中邮科技	303	7,547.73	0.00
87	688651	盛邦安全	159	7,318.77	0.00
88	688702	盛科通信	151	7,276.69	0.00
89	301505	苏州规划	194	6,943.26	0.00
90	301329	信音电子	301	6,685.21	0.00
91	301486	致尚科技	141	6,649.56	0.00
92	301528	多浦乐	96	6,610.56	0.00
93	688602	康鹏科技	557	6,154.85	0.00
94	301550	斯菱股份	139	6,057.62	0.00
95	688716	中研股份	166	6,039.08	0.00
96	688693	锆威特	139	6,032.60	0.00
97	688638	誉辰智能	98	5,845.70	0.00
98	301202	朗威股份	181	5,750.37	0.00
99	688480	赛恩斯	142	5,498.24	0.00
100	688429	时创能源	259	5,488.21	0.00

101	688719	爱科赛博	91	5,469.10	0.00
102	301529	福赛科技	143	5,416.84	0.00
103	301525	儒竞科技	65	5,294.90	0.00
104	301500	飞南资源	249	5,201.61	0.00
105	001378	德冠新材	141	5,130.99	0.00
106	301515	港通医疗	180	5,086.80	0.00
107	301559	中集环科	267	4,872.75	0.00
108	688646	逸飞激光	135	4,868.10	0.00
109	301371	敷尔佳	121	4,543.55	0.00
110	688612	威迈斯	119	4,514.86	0.00
111	301520	万邦医药	83	4,377.42	0.00
112	688657	浩辰软件	55	4,362.05	0.00
113	001326	联域股份	84	4,346.16	0.00
114	301548	崇德科技	72	4,250.16	0.00
115	001239	永达股份	189	4,146.66	0.00
116	601083	锦江航运	346	4,100.10	0.00
117	603004	鼎龙科技	117	4,036.50	0.00
118	603273	天元智能	178	3,640.10	0.00
119	603373	安邦护卫	88	3,561.36	0.00
120	001306	夏厦精密	41	3,469.42	0.00
121	603270	金帝股份	117	3,460.86	0.00
122	603107	上海汽配	145	3,184.20	0.00
123	001358	兴欣新材	63	2,915.64	0.00
124	603119	浙江荣泰	116	2,767.76	0.00
125	605133	嵘泰股份	100	2,767.00	0.00
126	603193	润本股份	140	2,382.80	0.00
127	603276	恒兴新材	95	2,363.60	0.00
128	603075	热威股份	94	2,192.08	0.00
129	603231	索宝蛋白	97	2,159.22	0.00
130	605303	园林股份	100	1,220.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	1,221,584.00	0.55
2	600028	中国石化	942,588.00	0.42
3	600941	中国移动	679,273.00	0.31
4	300760	迈瑞医疗	650,905.00	0.29
5	600905	三峡能源	578,880.00	0.26
6	600919	江苏银行	573,147.00	0.26
7	300750	宁德时代	493,151.00	0.22
8	688347	华虹公司	466,388.00	0.21

9	000938	紫光股份	448,850.00	0.20
10	601899	紫金矿业	395,230.00	0.18
11	601728	中国电信	383,532.00	0.17
12	600111	北方稀土	369,369.00	0.17
13	001286	陕西能源	361,603.20	0.16
14	600732	爱旭股份	337,595.00	0.15
15	688111	金山办公	321,093.18	0.14
16	002180	纳思达	276,265.00	0.12
17	000333	美的集团	275,673.00	0.12
18	605117	德业股份	274,253.00	0.12
19	000100	TCL 科技	273,606.00	0.12
20	601607	上海医药	269,641.00	0.12

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,720,521.00	0.77
2	600519	贵州茅台	1,384,380.00	0.62
3	600887	伊利股份	546,273.00	0.25
4	600309	万华化学	526,151.00	0.24
5	002602	世纪华通	445,326.43	0.20
6	002352	顺丰控股	436,222.00	0.20
7	002129	TCL 中环	399,452.00	0.18
8	000792	盐湖股份	389,851.00	0.18
9	001286	陕西能源	369,324.35	0.17
10	601816	京沪高铁	355,920.00	0.16
11	300896	爱美客	355,655.00	0.16
12	688515	裕太微	341,900.00	0.15
13	688169	石头科技	319,996.14	0.14
14	688249	晶合集成	254,767.04	0.11
15	301510	固高科技	253,195.00	0.11
16	301526	国际复材	237,440.16	0.11
17	603882	金域医学	236,547.00	0.11
18	002008	大族激光	236,356.00	0.11
19	002600	领益智造	202,506.00	0.09
20	000895	双汇发展	196,991.00	0.09

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	35,774,589.37
卖出股票收入（成交）总额	29,837,613.98

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	61,427.67	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	61,427.67	0.03

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127089	晶澳转债	459	47,186.67	0.02
2	127085	韵达转债	130	14,241.00	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述两只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

兴业银行：

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。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,938.72
2	应收清算款	157,143.15
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	600,839.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	761,921.57

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127085	韵达转债	14,241.00	0.01

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	---------------	----------

1	688347	华虹公司	263,969.16	0.12	限售期锁定
---	--------	------	------------	------	-------

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
11,207	14,283.03	36,594,203.47	22.86	123,475,723.62	77.14

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	管玉良	620,396.00	18.28
2	倪敬	275,093.00	8.11
3	王立霞	264,432.00	7.79
4	鲍建平	177,067.00	5.22
5	郭莉芬	127,320.00	3.75
6	柳楠	75,000.00	2.21
7	张睿珈	74,700.00	2.2
8	余丽华	68,200.00	2.01
9	杨凯	61,400.00	1.81
10	缪晏	60,000.00	1.77

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	200,791.50	0.1254

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 8 月 4 日) 基金份额总额	898,915,869.33
本报告期期初基金份额总额	156,454,690.75
本报告期基金总申购份额	38,202,603.54
减: 本报告期基金总赎回份额	34,587,367.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	160,069,927.09

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司 2023 年 2 月 18 日召开的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。

根据公司 2023 年 8 月 30 日召开的第八届董事会相关会议决议, 聘任汤琰女士担任公司总经理, 董事长胡甲先生不再代为履行公司总经理职务。公司已按规定向相关监管机构报告并发布变更公告

11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期内本基金基金经理未发生变动。

11.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙), 本报告期内本基金未更换会计师事务所, 本报告期应付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元, 已连续为本基金提供审计服务 14 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	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	-

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国元证券	1	32,101,697.56	56.01	30,017.84	56.00	-
招商证券	1	25,217,570.48	43.99	23,585.67	44.00	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国元证券	57,616.76	69.75	-	-	-	-
招商证券	24,992.22	30.25	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

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

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

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

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

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

(3) 研究、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023年1月17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	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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
4	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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3日

5	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)	中国证监会指定披露媒介	2023 年 2 月 3 日
6	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
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	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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的公告	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	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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
13	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
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财富证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投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 2 日
16	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2023 年第 2 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 7 月 21 日
17	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 7 月 21 日
18	长盛基金管理有限公司关于增加博时财富为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投、转换及费率优惠业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 29 日
19	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2023 年中期报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 30 日
20	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 8 月 30 日
21	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 9 月 1 日
22	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2023 年第 3 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 10 月 25 日

23	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 10 月 25 日
----	------------------------------------	-------------	------------------

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 相关批准文件；
- 2、《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 4、《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所和/或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

2024 年 3 月 30 日