

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金  
(LOF)  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	54

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 .....	54
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 .....	54
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 .....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
7.12 投资组合报告附注 .....	54
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
10.4 基金投资策略的改变 .....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）
基金简称	长盛同庆中证 800 指数（LOF）
场内简称	长盛中证 800LOF
基金主代码	160806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 22 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	51,949,785.04 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 8 月 6 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现中证 800 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4% 的投资目标。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率（税后）}$
风险收益特征	本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁
	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	021-60637228
传真	010-86497999	021-60635778
注册地址	深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院

	楼中建财富国际中心 3-5 层	1 号楼
邮政编码	100029	100033
法定代表人	胡甲	张金良

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-277,776.31
本期利润	-339,175.10
加权平均基金份额本期利润	-0.0064
本期加权平均净值利润率	-0.46%
本期基金份额净值增长率	-0.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	16,238,081.21
期末可供分配基金份额利润	0.3126
期末基金资产净值	71,729,873.09
期末基金份额净值	1.381
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.64%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

4、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2015 年 5 月 22 日（即基金合同生效日）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.02%	0.51%	-4.01%	0.54%	0.99%	-0.03%
过去三个月	-1.99%	0.77%	-3.08%	0.79%	1.09%	-0.02%
过去六个月	-0.50%	0.94%	-1.61%	0.98%	1.11%	-0.04%
过去一年	-9.20%	0.87%	-11.30%	0.89%	2.10%	-0.02%
过去三年	-22.28%	0.98%	-30.79%	0.99%	8.51%	-0.01%
自基金转型起至今	0.64%	1.35%	-32.23%	1.31%	32.87%	0.04%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

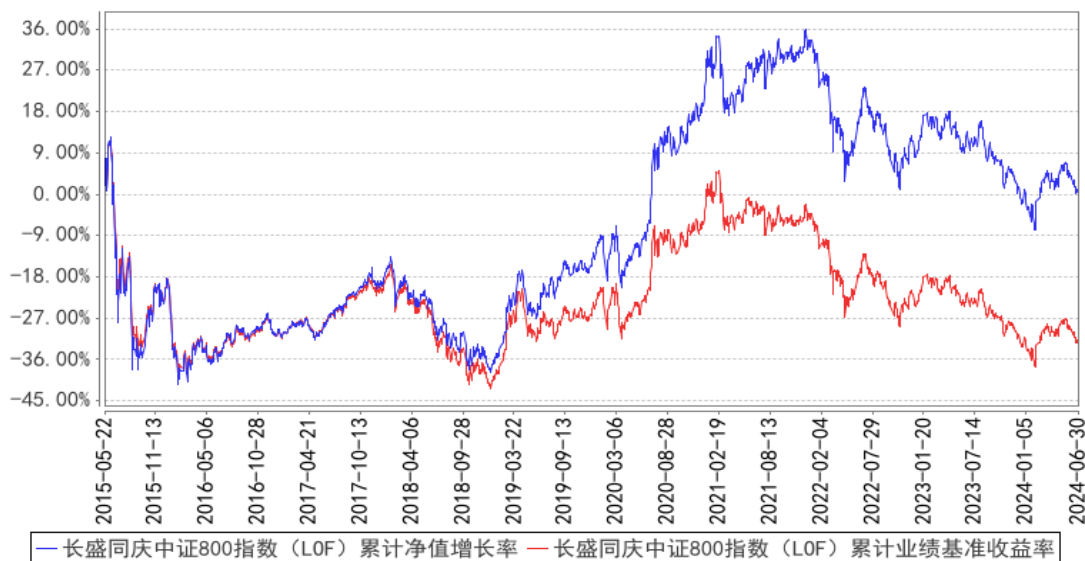
本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率 (税后)}$

本基金为指数型基金，股票资产跟踪的标的指数为中证 800 指数。中证 800 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数。其成份股由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长盛同庆中证800指数 (LOF) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

日 (即基金合同生效日)。

2、按基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日,本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司 (以下简称公司), 成立于 1999 年 3 月 26 日, 是国内首批成立的十家基金管理公司之一, 公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金注册地为深圳, 总部办公地位于北京, 在北京、上海、成都等地设有分支机构, 拥有全资子公司长盛基金 (香港) 有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前, 公司股东及其出资比例为: 国元证券股份有限公司占注册资本的 41%, 新加坡星展银行有限公司 (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、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 2024 年 6 月 30 日, 基金管理人共管理七十二只开放式基金, 并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理 (助理) 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日 期	离任日 期		
陈亘斯	本基金基金经理, 长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理, 长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理, 长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 长盛中证全指证券公司指数证券投资基金 (LOF) 基金经理, 长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理, 长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理, 长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2019 年 5 月 30 日	-	15 年	陈亘斯先生, 硕士。曾任 PineRiver 资产管理公司量化分析师, 国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理, 北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司, 曾任基金经理助理。



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

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

2024 年上半年，A 股市场先是延续了 2023 年末的下行趋势，并在各种结构性产品平仓的影响下，产生了加速下跌和流动性缺失的负向螺旋，但其后在果断坚决的政策支持下，市场快速恢复了信心和流动性。受限于权益市场的边际流动性不足以及风险偏好走弱的影响，市场在一季度的修复性快速反弹后进入了窄幅区间震荡且偏弱态势。代表供给受限的能源、矿产、交运等行业以及景气大幅改善的电子、半导体等行业涨幅靠前，消费、房地产等与宏观经济需求强关联的行业表现落后。大市值、高股息、稳健现金流一类的防御型风格在监管政策的引导下延续了 2023 年以来的良好走势。净资本回报率、净利润和毛利率等财务指标的提升所引导的景气投资策略在出海板块和新质生产力中的部分高科技细分业开始发酵并走出较为曲折的上行趋势。这意味着高胜率短久期的红利策略与高赔率长久期的成长策略依然呈现杠铃型结构，但更偏向于防御的一端，体现出投资者风险偏好持续的两极分化，其中以保守态度占优为主。

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 1.381 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.50%，同期业绩比较基准收益率为-1.61%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0100%，年度化跟踪误差为 1.2177%。

## 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 年下半年，市场大概率先沿着过去一年多的风险偏好两极化下的风格及行业特征继续运行，直到被某些重大的外生变化冲击后才更可能去寻找新结构和方向。受到美国就业数据疲软以及商业地产债务的拖累，美联储的降息预期在年中有望加强，但美国大选的不确定性仍然高企，目前其高赤字叠加高通胀和高名义经济增长的循环依然有较强的惯性，不能过度寄希望于美元利率的快速走低来改善 A 股的外部流动性环境，并且中美库存周期共振见底后的上行斜率和节奏可能会受到较低的产能利用率压制。因此我们依然相对看好具有盈利稳定性而带来股息水平可持续的公用事业、银行等板块以及成长性高度可预期可跟踪的半导体、电子等板块，前提是其估值的提升尚未透支未来一年至两年的业绩增速，否则便需要在高低估值之间切换平衡，确保组合

整体的安全边际来控制风险。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基

金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	5,667,141.95	5,716,523.04
结算备付金		6,952.18	-
存出保证金		761.86	1,251.56
交易性金融资产	6.4.7.2	67,056,624.45	69,614,146.88
其中：股票投资		67,023,151.01	69,560,802.81
基金投资		-	-
债券投资		33,473.44	53,344.07
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,520.22	12,476.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		72,733,000.66	75,344,397.56

负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,444.82	7,822.93
应付管理人报酬		59,904.44	62,444.97
应付托管费		11,980.86	12,489.00
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	929,797.45	1,037,664.81
负债合计		1,003,127.57	1,120,421.71
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	55,491,791.88	57,137,489.65
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	16,238,081.21	17,086,486.20
净资产合计		71,729,873.09	74,223,975.85
负债和净资产总计		72,733,000.66	75,344,397.56

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.381 元，基金份额总额 51,949,785.04 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		168,604.18	3,483,967.54
1. 利息收入		9,644.26	11,673.07
其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,644.26	11,673.07
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“-”		216,903.48	1,175,801.74

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-617,604.93	186,389.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	8,937.14	25,379.49
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
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	825,571.27	964,032.91
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	-61,398.79	2,292,161.65
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	3,455.23	4,331.08
<b>减：二、营业总支出</b>		507,779.28	753,386.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	364,735.43	543,976.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	72,946.99	119,674.74
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		0.04	0.02
8. 其他费用	6.4.7.23	70,096.82	89,735.15
<b>三、利润总额 (亏损总额以 “-”号填列)</b>		-339,175.10	2,730,581.26
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-” 号填列)</b>		-339,175.10	2,730,581.26
<b>五、其他综合收益的税后净 额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-339,175.10	2,730,581.26

### 6.3 净资产变动表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	57,137,489.65	17,086,486.20	74,223,975.85
二、本期期初净资产	57,137,489.65	17,086,486.20	74,223,975.85
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-1,645,697.77	-848,404.99	-2,494,102.76
(一)、综合收益总额	-	-339,175.10	-339,175.10
(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)	-1,645,697.77	-509,229.89	-2,154,927.66
其中: 1. 基金申购款	1,061,333.62	290,112.20	1,351,445.82
2. 基金赎回款	-2,707,031.39	-799,342.09	-3,506,373.48
(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	55,491,791.88	16,238,081.21	71,729,873.09
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	80,273,634.05	32,288,517.75	112,562,151.80
二、本期期初净资产	80,273,634.05	32,288,517.75	112,562,151.80
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-19,829,962.97	-6,669,853.04	-26,499,816.01
(一)、综合收益总额	-	2,730,581.26	2,730,581.26
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-19,829,962.97	-9,400,434.30	-29,230,397.27
其中: 1. 基金申购款	2,706,027.39	1,259,715.14	3,965,742.53
2. 基金赎回款	-22,535,990.36	-10,660,149.44	-33,196,139.80
(三)、本期向基金份额持有人分配利	-	-	-

润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	60,443,671.08	25,618,664.71	86,062,335.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

根据原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金在分级运作期内的基金份额包括长盛同庆中证 800 分级份额 (以下简称“同庆分级份额”)、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额 (以下简称“同庆 800A”)以及长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之积极收益类份额 (以下简称“同庆 800B”)。原基金在分级运作期届满后，根据同庆 800A 和同庆 800B 基金份额转换比例对基金份额持有人基金份额转换基准日登记在册的基金份额实施转换，按照本基金基金合同参考净值计算规则分别对同庆 800A 份额和同庆 800B 份额计算分级运作期期末基金份额参考净值，并按照各自的份额参考净值转换为本基金基金份额。于 2015 年 5 月 21 日 (基金份额转换日) 日终，同庆 800A 转换前份额数为 157,659,406.00 份，转换比例为 0.593624387，转换后对应本基金份额数为 93,590,468.00 份；同庆 800B 转换前份额数为 236,489,110.00 份，转换比例为 1.270917071，转换后对应本基金份额数为 300,558,047.00 份；同庆分级份额转换前份额数为



148,119,975.78 份,转换后对应本基金份额数为 148,119,975.78 份。截至 2015 年 5 月 21 日转换完成当日,本基金基金份额总额为 542,268,490.78 份。本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司根据原基金基金合同约定,对同庆 800A、同庆 800B 的份额持有人的基金份额进行了计算,并向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

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

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,667,141.95
等于：本金	5,666,659.67
加：应计利息	482.28
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	5,667,141.95

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		77,412,346.12	-	67,023,151.01	-10,389,195.11
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	32,100.00	59.19	33,473.44	1,314.25
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	32,100.00	59.19	33,473.44	1,314.25
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		77,444,446.12	59.19	67,056,624.45	-10,387,880.86

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

无。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	3.28
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,640.56
其中：交易所市场	2,640.56
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	69,616.82
其他	607,536.79
合计	929,797.45

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	53,490,521.42	57,137,489.65
本期申购	993,634.61	1,061,333.62
本期赎回(以“-”号填列)	-2,534,370.99	-2,707,031.39
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	51,949,785.04	55,491,791.88

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 2024 年 6 月 30 日，本基金于深交所上市的基金份额为 36,976,525.00 份(2023 年 12 月 31 日：37,892,886.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 14,973,260.04 份(2023 年 12 月 31 日：15,597,635.42 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	96,825,394.02	-79,738,907.82	17,086,486.20
本期期初	96,825,394.02	-79,738,907.82	17,086,486.20
本期利润	-277,776.31	-61,398.79	-339,175.10
本期基金份额交易产生的变动数	-2,786,530.41	2,277,300.52	-509,229.89
其中：基金申购款	1,796,852.35	-1,506,740.15	290,112.20
基金赎回款	-4,583,382.76	3,784,040.67	-799,342.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,761,087.30	-77,523,006.09	16,238,081.21

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,630.04
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	9.11
其他	5.11
合计	9,644.26

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-617,604.93
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	-617,604.93

##### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,117,948.07
减：卖出股票成本总额	3,729,587.48
减：交易费用	5,965.52
买卖股票差价收入	-617,604.93

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	65.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,871.81
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	8,937.14

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	19,173.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,300.00
减：应计利息总额	1.08
减：交易费用	0.77
买卖债券差价收入	8,871.81

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	825,571.27
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	825,571.27

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-61,398.79
股票投资	-51,829.92
债券投资	-9,568.87
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	-61,398.79
----	------------

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,452.06
基金转换费收入	3.17
合计	3,455.23

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	480.00
合计	70,096.82

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构



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
---------------------	-----------------

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

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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	720,499.00	16.52	-	-

##### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30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	681.51	16.52	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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	-	-	-	-

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研究服务。

## 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	364,735.43	543,976.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	60,380.88	60,236.77
应支付基金管理人的净管理费	304,354.55	483,739.60

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 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

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	72,946.99	119,674.74

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金自 2023 年 8 月 21 日起年托管费率由 0.22% 调整为 0.20%。详情参阅 2023 年 8 月 19 日披露的《长盛基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》基金托管费计算方法如下：

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

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

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	5,667,141.95	9,630.04	6,562,926.55	11,658.06
合计	5,667,141.95	9,630.04	6,562,926.55	11,658.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。

#### 6.4.12 期末（2024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

无。

##### 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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日:本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.05%(2023 年 12 月 31 日:0.07%)。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持证券均在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 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 2024

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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,666,659.67	-	-	482.28	5,667,141.95
结算备付金	6,949.30	-	-	2.88	6,952.18
存出保证金	761.50	-	-	0.36	761.86
交易性金融资产	-	21,076.20	12,338.05	67,023,210.20	67,056,624.45
应收申购款	-	-	-	1,520.22	1,520.22
资产总计	5,674,370.47	21,076.20	12,338.05	67,025,215.94	72,733,000.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,444.82	1,444.82
应付管理人报酬	-	-	-	59,904.44	59,904.44

应付托管费	-	-	-	11,980.86	11,980.86
其他负债	-	-	-	929,797.45	929,797.45
负债总计	-	-	-	1,003,127.57	1,003,127.57
利率敏感度缺口	5,674,370.47	21,076.20	12,338.05	66,022,088.37	71,729,873.09
上年度末 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	5,715,962.99	-	-	560.05	5,716,523.04
存出保证金	1,250.96	-	-	0.60	1,251.56
交易性金融资产	-	33,889.47	19,393.65	69,560,863.76	69,614,146.88
应收申购款	-	-	-	12,476.08	12,476.08
资产总计	5,717,213.95	33,889.47	19,393.65	69,573,900.49	75,344,397.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,822.93	7,822.93
应付管理人报酬	-	-	-	62,444.97	62,444.97
应付托管费	-	-	-	12,489.00	12,489.00
其他负债	-	-	-	1,037,664.81	1,037,664.81
负债总计	-	-	-	1,120,421.71	1,120,421.71
利率敏感度缺口	5,717,213.95	33,889.47	19,393.65	68,453,478.78	74,223,975.85

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

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资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪中证 800 指数为原则，进行指数化长期投资，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0—3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	67,023,151.01	93.44	69,560,802.81	93.72
合计	67,023,151.01	93.44	69,560,802.81	93.72

#### 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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准上升 5%		3,496,209.42
2. 业绩比较基准下降 5%		-3,496,209.42	-3,691,244.79

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	67,056,624.45	69,614,146.88
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	67,056,624.45	69,614,146.88

##### 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 2024 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(2023 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	67,023,151.01	92.15
	其中：股票	67,023,151.01	92.15

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	33,473.44	0.05
	其中：债券	33,473.44	0.05
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,674,094.13	7.80
8	其他各项资产	2,282.08	0.00
9	合计	72,733,000.66	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	819,510.00	1.14
B	采矿业	3,838,159.24	5.35
C	制造业	35,116,223.55	48.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,621,766.48	3.66
E	建筑业	1,399,326.53	1.95
F	批发和零售业	473,293.91	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	1,805,449.63	2.52
H	住宿和餐饮业	19,791.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,197,384.70	4.46
J	金融业	13,184,543.56	18.38
K	房地产业	632,971.48	0.88
L	租赁和商务服务业	585,314.30	0.82
M	科学研究和技术服务业	463,617.76	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	52,067.33	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	180,148.20	0.25
R	文化、体育和娱乐业	197,368.74	0.28
S	综合	34,165.12	0.05

	合计	64,621,101.53	90.09
--	----	---------------	-------

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	99,078.05	0.14
C	制造业	1,968,871.97	2.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,824.00	0.00
E	建筑业	31,032.81	0.04
F	批发和零售业	31,312.94	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	21,840.00	0.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	125,959.45	0.18
J	金融业	2,046.00	0.00
K	房地产业	55,041.80	0.08
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	44,882.46	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	20,160.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,402,049.48	3.35

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	2,103	3,085,921.17	4.30
2	300750	宁德时代	8,440	1,519,453.20	2.12
3	601318	中国平安	34,118	1,411,120.48	1.97
4	600036	招商银行	36,716	1,255,320.04	1.75
5	600900	长江电力	32,920	952,046.40	1.33

6	000333	美的集团	14,538	937,701.00	1.31
7	601899	紫金矿业	49,227	864,918.39	1.21
8	601166	兴业银行	43,071	758,911.02	1.06
9	000858	五粮液	5,898	755,179.92	1.05
10	002594	比亚迪	2,884	721,721.00	1.01
11	300760	迈瑞医疗	2,300	669,093.00	0.93
12	601328	交通银行	87,770	655,641.90	0.91
13	601398	工商银行	112,212	639,608.40	0.89
14	002475	立讯精密	15,352	603,487.12	0.84
15	600030	中信证券	31,424	572,859.52	0.80
16	000651	格力电器	14,023	549,982.06	0.77
17	600276	恒瑞医药	13,602	523,132.92	0.73
18	601088	中国神华	10,896	483,455.52	0.67
19	600887	伊利股份	18,134	468,582.56	0.65
20	000725	京东方 A	114,007	466,288.63	0.65
21	601288	农业银行	99,967	435,856.12	0.61
22	300124	汇川技术	8,402	431,022.60	0.60
23	600309	万华化学	5,279	426,859.94	0.60
24	300059	东方财富	38,894	410,720.64	0.57
25	002415	海康威视	12,691	392,278.81	0.55
26	002714	牧原股份	8,995	392,182.00	0.55
27	601816	京沪高铁	69,300	372,141.00	0.52
28	601857	中国石油	35,831	369,775.92	0.52
29	601668	中国建筑	68,399	363,198.69	0.51
30	600028	中国石化	57,096	360,846.72	0.50
31	600690	海尔智家	12,472	353,955.36	0.49
32	601138	工业富联	12,900	353,460.00	0.49
33	300866	安克创新	4,940	351,777.40	0.49
34	000568	泸州老窖	2,434	349,254.66	0.49
35	300308	中际旭创	2,520	347,457.60	0.48
36	601225	陕西煤业	13,192	339,957.84	0.47
37	601988	中国银行	70,338	324,961.56	0.45
38	600809	山西汾酒	1,534	323,489.92	0.45
39	300498	温氏股份	16,300	323,066.00	0.45
40	600406	国电南瑞	12,936	322,882.56	0.45
41	601919	中远海控	20,190	312,743.10	0.44
42	300274	阳光电源	4,984	309,157.52	0.43
43	600031	三一重工	18,629	307,378.50	0.43
44	000792	盐湖股份	17,500	305,375.00	0.43
45	601601	中国太保	10,940	304,788.40	0.42
46	600000	浦发银行	36,825	303,069.75	0.42
47	601766	中国中车	40,287	302,555.37	0.42
48	000001	平安银行	29,579	300,226.85	0.42

49	601728	中国电信	48,300	297,045.00	0.41
50	688981	中芯国际	6,350	292,735.00	0.41
51	601169	北京银行	49,994	291,964.96	0.41
52	600150	中国船舶	7,100	289,041.00	0.40
53	600016	民生银行	75,295	285,368.05	0.40
54	600050	中国联通	60,272	283,278.40	0.39
55	000338	潍柴动力	17,306	281,049.44	0.39
56	002142	宁波银行	12,566	277,205.96	0.39
57	601985	中国核电	25,988	277,032.08	0.39
58	002371	北方华创	859	274,785.51	0.38
59	600919	江苏银行	36,920	274,315.60	0.38
60	000063	中兴通讯	9,762	273,043.14	0.38
61	601012	隆基绿能	19,448	272,660.96	0.38
62	600941	中国移动	2,500	268,750.00	0.37
63	600837	海通证券	30,349	259,787.44	0.36
64	603259	药明康德	6,568	257,399.92	0.36
65	600660	福耀玻璃	5,353	256,408.70	0.36
66	002230	科大讯飞	5,850	251,257.50	0.35
67	600938	中国海油	7,402	244,266.00	0.34
68	603501	韦尔股份	2,310	229,544.70	0.32
69	002352	顺丰控股	6,400	228,416.00	0.32
70	601229	上海银行	31,269	227,012.94	0.32
71	000100	TCL 科技	52,427	226,484.64	0.32
72	600089	特变电工	16,194	224,610.78	0.31
73	601390	中国中铁	33,899	221,021.48	0.31
74	600104	上汽集团	15,566	215,744.76	0.30
75	000625	长安汽车	15,898	213,510.14	0.30
76	600048	保利发展	24,124	211,326.24	0.29
77	603986	兆易创新	2,200	210,364.00	0.29
78	601688	华泰证券	16,891	209,279.49	0.29
79	002027	分众传媒	34,500	209,070.00	0.29
80	601211	国泰君安	15,300	207,315.00	0.29
81	603993	洛阳钼业	23,556	200,226.00	0.28
82	688012	中微公司	1,391	196,492.66	0.27
83	600436	片仔癀	945	195,775.65	0.27
84	601888	中国中免	3,112	194,468.88	0.27
85	601600	中国铝业	25,172	192,062.36	0.27
86	600019	宝钢股份	28,459	189,252.35	0.26
87	600585	海螺水泥	7,751	182,846.09	0.25
88	600886	国投电力	9,978	181,998.72	0.25
89	603288	海天味业	5,240	180,622.80	0.25
90	600795	国电电力	29,753	178,220.47	0.25
91	600999	招商证券	12,700	176,657.00	0.25

92	601818	光大银行	55,296	175,288.32	0.24
93	601989	中国重工	34,926	172,185.18	0.24
94	601009	南京银行	16,401	170,406.39	0.24
95	600438	通威股份	8,600	164,346.00	0.23
96	600905	三峡能源	37,400	163,064.00	0.23
97	601628	中国人寿	5,147	159,814.35	0.22
98	601658	邮储银行	31,426	159,329.82	0.22
99	600547	山东黄金	5,734	156,996.92	0.22
100	300014	亿纬锂能	3,900	155,688.00	0.22
101	300015	爱尔眼科	15,085	155,677.20	0.22
102	600893	航发动力	4,226	154,460.30	0.22
103	603019	中科曙光	3,700	153,550.00	0.21
104	002241	歌尔股份	7,854	153,231.54	0.21
105	002304	洋河股份	1,895	153,002.30	0.21
106	000938	紫光股份	6,802	152,024.70	0.21
107	000002	万 科 A	21,454	148,676.22	0.21
108	601669	中国电建	26,288	146,949.92	0.20
109	688111	金山办公	618	140,595.00	0.20
110	600926	杭州银行	10,600	138,330.00	0.19
111	600489	中金黄金	9,313	137,832.40	0.19
112	600760	中航沈飞	3,416	136,981.60	0.19
113	688036	传音控股	1,774	135,781.96	0.19
114	002179	中航光电	3,489	132,756.45	0.19
115	600958	东方证券	17,440	132,544.00	0.18
116	000166	申万宏源	30,451	131,243.81	0.18
117	601006	大秦铁路	18,328	131,228.48	0.18
118	600011	华能国际	13,600	130,832.00	0.18
119	600111	北方稀土	7,583	130,427.60	0.18
120	002028	思源电气	1,917	128,247.30	0.18
121	600674	川投能源	6,718	125,962.50	0.18
122	600426	华鲁恒升	4,639	123,582.96	0.17
123	000425	徐工机械	17,254	123,366.10	0.17
124	300408	三环集团	4,200	122,598.00	0.17
125	002311	海大集团	2,600	122,330.00	0.17
126	600015	华夏银行	18,863	120,723.20	0.17
127	601186	中国铁建	14,051	120,417.07	0.17
128	002050	三花智控	6,278	119,784.24	0.17
129	000157	中联重科	15,535	119,308.80	0.17
130	000977	浪潮信息	3,274	119,075.38	0.17
131	600989	宝丰能源	6,800	117,844.00	0.16
132	000538	云南白药	2,295	117,389.25	0.16
133	300433	蓝思科技	6,400	116,800.00	0.16
134	003816	中国广核	24,900	115,287.00	0.16

135	600009	上海机场	3,504	113,004.00	0.16
136	688008	澜起科技	1,966	112,376.56	0.16
137	000776	广发证券	9,186	111,793.62	0.16
138	002049	紫光国微	2,100	110,460.00	0.15
139	600066	宇通客车	4,234	109,237.20	0.15
140	601377	兴业证券	21,463	108,602.78	0.15
141	000596	古井贡酒	508	107,223.56	0.15
142	601168	西部矿业	5,963	107,035.85	0.15
143	002466	天齐锂业	3,561	106,509.51	0.15
144	600584	长电科技	3,355	106,387.05	0.15
145	300122	智飞生物	3,700	103,711.00	0.14
146	601058	赛轮轮胎	7,400	103,600.00	0.14
147	000768	中航西飞	4,291	103,112.73	0.14
148	601633	长城汽车	4,025	101,832.50	0.14
149	002460	赣锋锂业	3,540	101,421.00	0.14
150	601901	方正证券	12,904	99,747.92	0.14
151	600029	南方航空	16,882	99,434.98	0.14
152	002493	荣盛石化	10,250	99,015.00	0.14
153	000988	华工科技	3,291	98,499.63	0.14
154	601800	中国交建	10,967	98,044.98	0.14
155	000661	长春高新	1,068	98,010.36	0.14
156	601838	成都银行	6,433	97,717.27	0.14
157	603369	今世缘	2,100	97,020.00	0.14
158	600010	包钢股份	69,216	96,902.40	0.14
159	300418	昆仑万维	2,900	93,496.00	0.13
160	001979	招商蛇口	10,636	93,490.44	0.13
161	002001	新和成	4,860	93,312.00	0.13
162	603799	华友钴业	4,207	93,100.91	0.13
163	000786	北新建材	3,124	92,657.84	0.13
164	601117	中国化学	11,200	92,288.00	0.13
165	000895	双汇发展	3,837	91,205.49	0.13
166	002384	东山精密	4,400	91,080.00	0.13
167	600570	恒生电子	5,146	90,878.36	0.13
168	600346	恒力石化	6,500	90,675.00	0.13
169	601788	光大证券	6,200	90,644.00	0.13
170	600418	江淮汽车	5,700	90,288.00	0.13
171	600196	复星医药	4,074	90,198.36	0.13
172	002252	上海莱士	11,500	89,930.00	0.13
173	002129	TCL 中环	10,370	89,700.50	0.13
174	002236	大华股份	5,749	88,879.54	0.12
175	600188	兖矿能源	3,900	88,647.00	0.12
176	600845	宝信软件	2,698	86,147.14	0.12
177	600219	南山铝业	22,600	86,106.00	0.12

178	300347	泰格医药	1,770	86,022.00	0.12
179	600085	同仁堂	2,234	85,361.14	0.12
180	002648	卫星化学	4,746	85,333.08	0.12
181	601868	中国能建	40,133	85,081.96	0.12
182	600176	中国巨石	7,604	84,024.20	0.12
183	688256	寒武纪	422	83,838.74	0.12
184	002601	龙佰集团	4,500	83,565.00	0.12
185	002736	国信证券	9,600	83,424.00	0.12
186	601336	新华保险	2,759	82,852.77	0.12
187	000400	许继电气	2,400	82,584.00	0.12
188	600741	华域汽车	5,033	82,440.54	0.11
189	601233	桐昆股份	5,100	81,396.00	0.11
190	600233	圆通速递	5,200	81,380.00	0.11
191	600362	江西铜业	3,435	81,340.80	0.11
192	000630	铜陵有色	22,523	81,308.03	0.11
193	600183	生益科技	3,809	80,217.54	0.11
194	600161	天坛生物	3,287	80,202.80	0.11
195	000963	华东医药	2,879	80,064.99	0.11
196	300002	神州泰岳	9,835	79,860.20	0.11
197	002271	东方雨虹	6,450	79,593.00	0.11
198	002938	鹏鼎控股	2,000	79,520.00	0.11
199	002078	太阳纸业	5,625	78,468.75	0.11
200	002920	德赛西威	900	78,381.00	0.11
201	601100	恒立液压	1,656	77,136.48	0.11
202	601066	中信建投	4,000	76,960.00	0.11
203	600885	宏发股份	2,780	76,950.40	0.11
204	600600	青岛啤酒	1,050	76,408.50	0.11
205	600027	华电国际	10,900	75,646.00	0.11
206	600115	中国东航	18,837	75,536.37	0.11
207	300661	圣邦股份	910	75,329.80	0.11
208	002223	鱼跃医疗	1,991	74,861.60	0.10
209	601111	中国国航	10,124	74,715.12	0.10
210	300782	卓胜微	960	74,630.40	0.10
211	002916	深南电路	700	74,039.00	0.10
212	002156	通富微电	3,300	73,887.00	0.10
213	601555	东吴证券	12,428	73,325.20	0.10
214	601607	上海医药	3,837	73,325.07	0.10
215	601021	春秋航空	1,300	73,229.00	0.10
216	601360	三六零	9,500	72,960.00	0.10
217	300033	同花顺	700	72,590.00	0.10
218	300896	爱美客	420	72,282.00	0.10
219	600096	云天化	3,700	71,854.00	0.10
220	002709	天赐材料	4,080	71,644.80	0.10



221	601618	中国中冶	22,906	71,008.60	0.10
222	000876	新希望	7,712	70,487.68	0.10
223	600352	浙江龙盛	8,162	70,111.58	0.10
224	601128	常熟银行	9,240	69,946.80	0.10
225	601077	渝农商行	13,800	69,276.00	0.10
226	300628	亿联网络	1,860	68,392.20	0.10
227	601108	财通证券	10,310	68,149.10	0.10
228	600745	闻泰科技	2,400	67,800.00	0.09
229	600332	白云山	2,300	67,459.00	0.09
230	600642	申能股份	7,635	67,417.05	0.09
231	601877	正泰电器	3,482	66,366.92	0.09
232	002138	顺络电子	2,400	65,904.00	0.09
233	688396	华润微	1,753	65,632.32	0.09
234	600157	永泰能源	55,300	65,254.00	0.09
235	300207	欣旺达	4,300	65,231.00	0.09
236	002273	水晶光电	3,814	64,761.72	0.09
237	002353	杰瑞股份	1,838	64,477.04	0.09
238	002185	华天科技	7,900	64,385.00	0.09
239	601878	浙商证券	6,000	64,320.00	0.09
240	601998	中信银行	9,584	64,212.80	0.09
241	600497	驰宏锌锗	12,000	64,080.00	0.09
242	600588	用友网络	6,379	63,790.00	0.09
243	000009	中国宝安	7,339	63,115.40	0.09
244	600415	小商品城	8,473	62,869.66	0.09
245	000807	云铝股份	4,600	62,146.00	0.09
246	603160	汇顶科技	900	61,875.00	0.09
247	600109	国金证券	8,192	61,849.60	0.09
248	600177	雅戈尔	8,684	61,830.08	0.09
249	603806	福斯特	4,194	61,651.80	0.09
250	002074	国轩高科	3,200	61,280.00	0.09
251	600060	海信视像	2,473	61,182.02	0.09
252	600583	海油工程	10,348	61,156.68	0.09
253	300136	信维通信	3,100	60,698.00	0.08
254	600079	人福医药	3,530	60,610.10	0.08
255	600988	赤峰黄金	3,700	60,458.00	0.08
256	300142	沃森生物	5,300	60,314.00	0.08
257	300017	网宿科技	7,595	60,000.50	0.08
258	300450	先导智能	3,600	59,868.00	0.08
259	600039	四川路桥	7,587	59,861.43	0.08
260	603392	万泰生物	904	59,555.52	0.08
261	002465	海格通信	5,734	59,404.24	0.08
262	601995	中金公司	2,000	59,220.00	0.08
263	600873	梅花生物	5,900	59,118.00	0.08

264	002625	光启技术	3,400	58,990.00	0.08
265	002555	三七互娱	4,500	58,725.00	0.08
266	605117	德业股份	784	58,282.56	0.08
267	002202	金风科技	8,661	58,201.92	0.08
268	300003	乐普医疗	3,900	57,876.00	0.08
269	300316	晶盛机电	2,000	57,460.00	0.08
270	000783	长江证券	11,894	57,448.02	0.08
271	002812	恩捷股份	1,800	56,970.00	0.08
272	688599	天合光能	3,331	56,360.52	0.08
273	601799	星宇股份	500	56,020.00	0.08
274	002007	华兰生物	3,530	55,738.70	0.08
275	300496	中科创达	1,200	54,708.00	0.08
276	002008	大族激光	2,621	54,516.80	0.08
277	002195	岩山科技	21,543	54,072.93	0.08
278	002797	第一创业	10,620	54,055.80	0.08
279	600536	中国软件	1,792	53,616.64	0.07
280	300012	华测检测	5,300	53,318.00	0.07
281	002673	西部证券	8,600	53,234.00	0.07
282	600018	上港集团	9,161	52,950.58	0.07
283	002180	纳思达	2,000	52,840.00	0.07
284	601997	贵阳银行	10,000	52,700.00	0.07
285	000301	东方盛虹	6,600	52,602.00	0.07
286	002966	苏州银行	7,000	52,500.00	0.07
287	000878	云南铜业	4,200	52,332.00	0.07
288	600298	安琪酵母	1,868	52,173.24	0.07
289	600839	四川长虹	11,500	51,635.00	0.07
290	002821	凯莱英	780	51,324.00	0.07
291	002459	晶澳科技	4,576	51,251.20	0.07
292	603939	益丰药房	2,081	51,088.55	0.07
293	600282	南钢股份	10,200	50,796.00	0.07
294	600862	中航高科	2,700	50,706.00	0.07
295	601179	中国西电	6,300	50,652.00	0.07
296	000933	神火股份	2,500	50,575.00	0.07
297	000039	中集集团	5,450	50,467.00	0.07
298	600372	中航机载	4,200	50,274.00	0.07
299	600549	厦门钨业	2,910	50,197.50	0.07
300	300413	芒果超媒	2,400	50,160.00	0.07
301	000960	锡业股份	3,210	49,722.90	0.07
302	600820	隧道股份	7,500	48,975.00	0.07
303	000703	恒逸石化	6,907	48,970.63	0.07
304	601319	中国人保	9,500	48,925.00	0.07
305	601872	招商轮船	5,760	48,672.00	0.07
306	600132	重庆啤酒	800	48,560.00	0.07

307	600348	华阳股份	4,850	48,306.00	0.07
308	000408	藏格矿业	2,000	48,140.00	0.07
309	002294	信立泰	1,800	47,934.00	0.07
310	002281	光迅科技	1,282	47,908.34	0.07
311	600879	航天电子	6,148	47,769.96	0.07
312	601198	东兴证券	6,000	47,760.00	0.07
313	600521	华海药业	2,800	47,740.00	0.07
314	600141	兴发集团	2,500	47,700.00	0.07
315	600486	扬农化工	840	47,418.00	0.07
316	000513	丽珠集团	1,272	47,331.12	0.07
317	603589	口子窖	1,200	47,028.00	0.07
318	600765	中航重机	2,300	46,920.00	0.07
319	600061	国投资本	8,252	46,623.80	0.06
320	600460	士兰微	2,661	46,594.11	0.06
321	000021	深科技	3,063	46,312.56	0.06
322	600895	张江高科	2,489	45,996.72	0.06
323	002739	万达电影	3,800	45,942.00	0.06
324	600699	均胜电子	3,100	45,942.00	0.06
325	601881	中国银河	4,200	45,612.00	0.06
326	600004	白云机场	4,800	45,504.00	0.06
327	300037	新宙邦	1,580	45,124.80	0.06
328	300285	国瓷材料	2,500	44,625.00	0.06
329	300759	康龙化成	2,400	44,592.00	0.06
330	688126	沪硅产业	3,214	44,385.34	0.06
331	600118	中国卫星	1,996	44,371.08	0.06
332	000423	东阿阿胶	700	43,820.00	0.06
333	600153	建发股份	4,864	43,435.52	0.06
334	300144	宋城演艺	5,400	43,362.00	0.06
335	600529	山东药玻	1,700	43,078.00	0.06
336	000598	兴蓉环境	5,695	42,826.40	0.06
337	601615	明阳智能	4,500	42,480.00	0.06
338	002152	广电运通	4,050	42,363.00	0.06
339	300001	特锐德	2,100	42,252.00	0.06
340	300058	蓝色光标	7,751	42,165.44	0.06
341	600704	物产中大	9,715	42,163.10	0.06
342	688777	中控技术	1,101	41,507.70	0.06
343	688390	固德威	739	41,472.68	0.06
344	000623	吉林敖东	3,055	40,937.00	0.06
345	600977	中国电影	3,800	40,888.00	0.06
346	300529	健帆生物	1,500	40,815.00	0.06
347	002670	国盛金控	4,800	40,656.00	0.06
348	000027	深圳能源	5,549	40,507.70	0.06
349	601966	玲珑轮胎	2,200	40,414.00	0.06

350	600170	上海建工	18,796	40,411.40	0.06
351	002410	广联达	4,197	40,207.26	0.06
352	600038	中直股份	975	40,082.25	0.06
353	601699	潞安环能	2,200	39,886.00	0.06
354	002385	大北农	10,310	39,693.50	0.06
355	603659	璞泰来	2,802	39,592.26	0.06
356	600392	盛和资源	4,591	39,574.42	0.06
357	600511	国药股份	1,285	39,565.15	0.06
358	600369	西南证券	10,992	39,351.36	0.05
359	600998	九州通	8,029	39,181.52	0.05
360	601216	君正集团	10,608	39,143.52	0.05
361	600380	健康元	3,500	39,095.00	0.05
362	603195	公牛集团	505	38,945.60	0.05
363	300024	机器人	3,996	38,921.04	0.05
364	600498	烽火通信	2,445	38,875.50	0.05
365	601238	广汽集团	5,000	38,700.00	0.05
366	600637	东方明珠	6,365	38,699.20	0.05
367	600909	华安证券	9,120	38,395.20	0.05
368	300751	迈为股份	320	38,233.60	0.05
369	000738	航发控制	1,900	38,133.00	0.05
370	688099	晶晨股份	641	38,024.12	0.05
371	000729	燕京啤酒	4,300	37,969.00	0.05
372	600143	金发科技	5,721	37,815.81	0.05
373	300724	捷佳伟创	700	37,807.00	0.05
374	603899	晨光股份	1,200	37,536.00	0.05
375	601689	拓普集团	700	37,527.00	0.05
376	603260	合盛硅业	800	37,368.00	0.05
377	000060	中金岭南	8,804	37,328.96	0.05
378	600535	天士力	2,962	37,261.96	0.05
379	002120	韵达股份	4,800	37,152.00	0.05
380	603000	人民网	1,830	36,581.70	0.05
381	000997	新大陆	2,628	36,555.48	0.05
382	600008	首创环保	13,635	36,541.80	0.05
383	002407	多氟多	2,980	36,445.40	0.05
384	002340	格林美	5,700	36,309.00	0.05
385	300088	长信科技	7,720	36,284.00	0.05
386	002439	启明星辰	2,100	36,246.00	0.05
387	601898	中煤能源	2,900	36,192.00	0.05
388	603156	养元饮品	1,700	36,159.00	0.05
389	000983	山西焦煤	3,500	36,085.00	0.05
390	000629	钒钛股份	14,400	36,000.00	0.05
391	600867	通化东宝	4,300	35,991.00	0.05
392	300390	天华新能	2,090	35,906.20	0.05

393	600580	卧龙电驱	2,948	35,818.20	0.05
394	300699	光威复材	1,440	35,755.20	0.05
395	600021	上海电力	3,614	35,742.46	0.05
396	000636	风华高科	2,736	35,732.16	0.05
397	603444	吉比特	200	35,602.00	0.05
398	002841	视源股份	1,200	35,436.00	0.05
399	300601	康泰生物	2,267	35,387.87	0.05
400	300454	深信服	700	35,371.00	0.05
401	000708	中信特钢	2,600	35,282.00	0.05
402	603658	安图生物	760	35,013.20	0.05
403	002532	天山铝业	4,300	34,873.00	0.05
404	600166	福田汽车	15,456	34,776.00	0.05
405	600325	华发股份	5,336	34,684.00	0.05
406	002624	完美世界	4,550	34,580.00	0.05
407	300073	当升科技	1,000	34,310.00	0.05
408	000750	国海证券	11,771	34,253.61	0.05
409	002500	山西证券	7,272	34,178.40	0.05
410	002507	涪陵榨菜	2,790	34,177.50	0.05
411	600673	东阳光	4,853	34,165.12	0.05
412	002056	横店东磁	2,736	34,117.92	0.05
413	002958	青农商行	12,700	34,036.00	0.05
414	002508	老板电器	1,539	34,011.90	0.05
415	601611	中国核建	4,200	33,978.00	0.05
416	002372	伟星新材	2,200	33,924.00	0.05
417	601162	天风证券	15,500	33,790.00	0.05
418	002429	兆驰股份	7,000	33,670.00	0.05
419	002926	华西证券	5,100	33,609.00	0.05
420	600516	方大炭素	7,771	33,493.01	0.05
421	600875	东方电气	1,800	33,210.00	0.05
422	603486	科沃斯	700	33,026.00	0.05
423	603927	中科软	1,820	32,923.80	0.05
424	300251	光线传媒	3,914	32,916.74	0.05
425	002368	太极股份	1,445	32,584.75	0.05
426	000998	隆平高科	3,300	32,439.00	0.05
427	300253	卫宁健康	5,448	32,143.20	0.04
428	002444	巨星科技	1,300	32,110.00	0.04
429	002203	海亮股份	4,000	31,920.00	0.04
430	603228	景旺电子	1,000	31,800.00	0.04
431	601696	中银证券	3,500	31,780.00	0.04
432	300009	安科生物	3,720	31,768.80	0.04
433	002373	千方科技	3,500	31,745.00	0.04
434	002409	雅克科技	500	31,455.00	0.04
435	600755	厦门国贸	4,340	31,117.80	0.04

436	300146	汤臣倍健	2,286	30,975.30	0.04
437	002831	裕同科技	1,200	30,708.00	0.04
438	002414	高德红外	5,168	30,439.52	0.04
439	002497	雅化集团	3,400	30,328.00	0.04
440	300070	碧水源	7,207	30,197.33	0.04
441	300999	金龙鱼	1,100	30,085.00	0.04
442	600598	北大荒	2,400	29,976.00	0.04
443	000050	深天马 A	4,100	29,848.00	0.04
444	601098	中南传媒	2,400	29,808.00	0.04
445	002019	亿帆医药	2,400	29,664.00	0.04
446	600848	上海临港	3,240	29,516.40	0.04
447	600801	华新水泥	2,143	29,466.25	0.04
448	601990	南京证券	3,800	29,184.00	0.04
449	002572	索菲亚	1,902	29,157.66	0.04
450	600803	新奥股份	1,400	29,120.00	0.04
451	000683	远兴能源	4,200	29,022.00	0.04
452	603833	欧派家居	540	28,922.40	0.04
453	600918	中泰证券	5,100	28,917.00	0.04
454	600859	王府井	2,454	28,809.96	0.04
455	000932	华菱钢铁	6,500	28,795.00	0.04
456	600390	五矿资本	7,100	28,755.00	0.04
457	600739	辽宁成大	3,412	28,558.44	0.04
458	002268	电科网安	2,000	28,460.00	0.04
459	603816	顾家家居	880	28,415.20	0.04
460	002558	巨人网络	3,000	28,320.00	0.04
461	002557	洽洽食品	1,000	28,190.00	0.04
462	300296	利亚德	6,200	27,900.00	0.04
463	600546	山煤国际	1,900	27,778.00	0.04
464	603858	步长制药	1,800	27,270.00	0.04
465	000066	中国长城	3,100	27,125.00	0.04
466	600271	航天信息	3,676	27,055.36	0.04
467	600985	淮北矿业	1,600	26,784.00	0.04
468	600655	豫园股份	5,189	26,723.35	0.04
469	601155	新城控股	3,000	26,610.00	0.04
470	000519	中兵红箭	1,800	26,406.00	0.04
471	300558	贝达药业	800	26,040.00	0.04
472	300595	欧普康视	1,660	26,028.80	0.04
473	000739	普洛药业	1,900	25,783.00	0.04
474	000778	新兴铸管	7,382	25,689.36	0.04
475	600528	中铁工业	3,476	25,444.32	0.04
476	600155	华创云信	4,300	25,413.00	0.04
477	002756	永兴材料	710	25,403.80	0.04
478	300474	景嘉微	400	25,292.00	0.04

479	603885	吉祥航空	2,300	25,277.00	0.04
480	000709	河钢股份	12,947	25,117.18	0.04
481	300763	锦浪科技	600	24,984.00	0.03
482	000733	振华科技	600	24,918.00	0.03
483	603882	金城医学	900	24,471.00	0.03
484	000800	一汽解放	3,100	24,273.00	0.03
485	002240	盛新锂能	1,800	24,156.00	0.03
486	002738	中矿资源	900	24,120.00	0.03
487	601118	海南橡胶	5,300	24,115.00	0.03
488	603290	斯达半导	280	24,110.80	0.03
489	600737	中粮糖业	2,500	23,975.00	0.03
490	600499	科达制造	2,800	23,604.00	0.03
491	600959	江苏有线	8,860	23,390.40	0.03
492	002065	东华软件	5,072	22,925.44	0.03
493	600563	法拉电子	300	22,854.00	0.03
494	600025	华能水电	2,100	22,638.00	0.03
495	601636	旗滨集团	3,500	22,575.00	0.03
496	300212	易华录	1,320	22,215.60	0.03
497	300223	北京君正	400	22,176.00	0.03
498	002939	长城证券	3,300	22,110.00	0.03
499	605499	东鹏饮料	100	21,575.00	0.03
500	000617	中油资本	3,900	21,528.00	0.03
501	603883	老百姓	1,165	21,389.40	0.03
502	600208	新湖中宝	13,287	20,993.46	0.03
503	605358	立昂微	900	20,826.00	0.03
504	603077	和邦生物	12,600	20,790.00	0.03
505	688223	晶科能源	2,925	20,767.50	0.03
506	603233	大参林	1,425	20,377.50	0.03
507	000831	中国稀土	800	20,280.00	0.03
508	300832	新产业	300	20,232.00	0.03
509	300357	我武生物	1,000	20,220.00	0.03
510	601865	福莱特	1,000	20,100.00	0.03
511	603517	绝味食品	1,300	20,020.00	0.03
512	000723	美锦能源	4,200	19,992.00	0.03
513	002690	美亚光电	1,210	19,965.00	0.03
514	600967	内蒙一机	2,768	19,929.60	0.03
515	000591	太阳能	4,200	19,782.00	0.03
516	600315	上海家化	1,100	19,558.00	0.03
517	688002	睿创微纳	694	19,411.18	0.03
518	688303	大全能源	936	19,085.04	0.03
519	600827	百联股份	2,576	19,010.88	0.03
520	601016	节能风电	6,310	18,866.90	0.03
521	688005	容百科技	806	18,763.68	0.03

522	600399	抚顺特钢	3,300	18,579.00	0.03
523	000830	鲁西化工	1,600	18,544.00	0.03
524	603568	伟明环保	900	18,522.00	0.03
525	300395	菲利华	600	18,450.00	0.03
526	300979	华利集团	300	18,255.00	0.03
527	002683	广东宏大	900	18,117.00	0.03
528	600970	中材国际	1,500	18,090.00	0.03
529	603707	健友股份	1,511	17,950.68	0.03
530	601992	金隅集团	13,100	17,947.00	0.03
531	002430	杭氧股份	800	17,800.00	0.02
532	300383	光环新网	2,100	17,745.00	0.02
533	002299	圣农发展	1,300	17,732.00	0.02
534	600863	内蒙华电	3,800	17,632.00	0.02
535	300919	中伟股份	560	17,354.40	0.02
536	600126	杭钢股份	4,200	17,262.00	0.02
537	000156	华数传媒	2,700	16,956.00	0.02
538	688065	凯赛生物	369	16,748.91	0.02
539	300604	长川科技	600	16,302.00	0.02
540	600754	锦江酒店	700	16,086.00	0.02
541	600732	爱旭股份	1,760	15,928.00	0.02
542	300568	星源材质	1,900	15,580.00	0.02
543	601577	长沙银行	1,900	15,542.00	0.02
544	600808	马钢股份	7,500	15,150.00	0.02
545	603185	弘元绿能	878	15,005.02	0.02
546	002153	石基信息	2,607	14,938.11	0.02
547	601717	郑煤机	1,000	14,800.00	0.02
548	603737	三棵树	392	14,217.84	0.02
549	300676	华大基因	400	14,004.00	0.02
550	688521	芯原股份	519	13,883.25	0.02
551	300114	中航电测	300	13,575.00	0.02
552	688363	华熙生物	239	13,520.23	0.02
553	002568	百润股份	800	13,464.00	0.02
554	000401	冀东水泥	3,299	13,393.94	0.02
555	603688	石英股份	450	13,324.50	0.02
556	002506	协鑫集成	6,800	13,192.00	0.02
557	603456	九洲药业	900	12,348.00	0.02
558	000887	中鼎股份	1,000	12,240.00	0.02
559	601156	东航物流	600	12,210.00	0.02
560	688567	孚能科技	1,240	11,904.00	0.02
561	002408	齐翔腾达	2,100	11,760.00	0.02
562	002244	滨江集团	1,600	11,616.00	0.02
563	600995	南网储能	1,200	11,592.00	0.02
564	603868	飞科电器	300	11,520.00	0.02



565	002936	郑州银行	6,570	11,366.10	0.02
566	601866	中远海发	4,300	11,094.00	0.02
567	603529	爱玛科技	400	10,932.00	0.02
568	601456	国联证券	1,100	10,604.00	0.01
569	300677	英科医疗	380	10,187.80	0.01
570	688561	奇安信	428	10,109.36	0.01
571	000031	大悦城	4,300	10,062.00	0.01
572	688187	时代电气	200	9,876.00	0.01
573	300957	贝泰妮	200	9,664.00	0.01
574	603712	七一二	500	9,095.00	0.01
575	002128	电投能源	400	8,440.00	0.01
576	600316	洪都航空	500	8,315.00	0.01
577	688220	翱捷科技	220	8,241.20	0.01
578	002432	九安医疗	200	8,108.00	0.01
579	002850	科达利	100	7,638.00	0.01
580	002595	豪迈科技	200	7,634.00	0.01
581	600398	海澜之家	800	7,392.00	0.01
582	002155	湖南黄金	400	7,240.00	0.01
583	601666	平煤股份	600	6,720.00	0.01
584	601000	唐山港	1,400	6,580.00	0.01
585	002064	华峰化学	900	6,453.00	0.01
586	601236	红塔证券	1,000	6,420.00	0.01
587	600566	济川药业	200	6,342.00	0.01
588	688385	复旦微电	200	6,276.00	0.01
589	603225	新凤鸣	400	6,236.00	0.01
590	603338	浙江鼎力	100	6,042.00	0.01
591	603893	瑞芯微	100	5,917.00	0.01
592	601568	北元集团	1,500	5,565.00	0.01
593	600582	天地科技	800	5,512.00	0.01
594	603596	伯特利	140	5,446.00	0.01
595	000883	湖北能源	900	5,409.00	0.01
596	603127	昭衍新药	392	5,201.84	0.01
597	601808	中海油服	300	5,160.00	0.01
598	601991	大唐发电	1,700	5,117.00	0.01
599	601665	齐鲁银行	1,000	4,910.00	0.01
600	000893	亚钾国际	300	4,848.00	0.01
601	601231	环旭电子	300	4,815.00	0.01
602	688819	天能股份	200	4,772.00	0.01
603	600707	彩虹股份	700	4,767.00	0.01
604	002025	航天电器	100	4,638.00	0.01
605	600373	中文传媒	300	4,452.00	0.01
606	600435	北方导航	500	4,310.00	0.01
607	688772	珠海冠宇	288	4,291.20	0.01

608	601880	辽港股份	3,400	4,182.00	0.01
609	300487	蓝晓科技	100	4,176.00	0.01
610	601958	金钼股份	400	4,164.00	0.01
611	600884	杉杉股份	500	4,060.00	0.01
612	300373	扬杰科技	100	3,890.00	0.01
613	300748	金力永磁	300	3,888.00	0.01
614	002080	中材科技	300	3,870.00	0.01
615	600258	首旅酒店	300	3,705.00	0.01
616	300118	东方日升	300	3,630.00	0.01
617	002531	天顺风能	400	3,576.00	0.00
618	688538	和辉光电	1,755	3,474.90	0.00
619	000987	越秀资本	700	3,472.00	0.00
620	600517	国网英大	800	3,464.00	0.00
621	600906	财达证券	600	3,438.00	0.00
622	000825	太钢不锈	1,000	3,380.00	0.00
623	002266	浙富控股	1,200	3,348.00	0.00
624	600871	石化油服	1,900	3,306.00	0.00
625	600329	达仁堂	100	3,239.00	0.00
626	000155	川能动力	300	3,231.00	0.00
627	001227	兰州银行	1,300	3,094.00	0.00
628	003035	南网能源	700	3,080.00	0.00
629	600056	中国医药	300	3,036.00	0.00
630	601106	中国一重	1,300	3,003.00	0.00
631	600416	湘电股份	300	2,982.00	0.00
632	600022	山东钢铁	2,400	2,928.00	0.00
633	600378	昊华科技	100	2,890.00	0.00
634	002791	坚朗五金	100	2,587.00	0.00
635	300682	朗新集团	300	2,553.00	0.00
636	300888	稳健医疗	100	2,530.00	0.00
637	002487	大金重工	100	2,288.00	0.00
638	000785	居然之家	900	2,187.00	0.00
639	603218	日月股份	200	2,054.00	0.00
640	300861	美畅股份	100	1,935.00	0.00
641	688779	五矿新能	406	1,879.78	0.00
642	300438	鹏辉能源	100	1,834.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002463	沪电股份	5,261	192,026.50	0.27
2	688076	诺泰生物	2,318	181,453.04	0.25
3	300862	蓝盾光电	7,620	173,431.20	0.24
4	600703	三安光电	11,658	136,631.76	0.19
5	002422	科伦药业	3,700	112,221.00	0.16

6	600160	巨化股份	4,269	103,010.97	0.14
7	600487	亨通光电	6,360	100,297.20	0.14
8	000975	银泰黄金	5,345	87,070.05	0.12
9	601127	赛力斯	900	82,008.00	0.11
10	002456	欧菲光	9,455	73,843.55	0.10
11	600482	中国动力	3,390	66,037.20	0.09
12	688480	赛恩斯	1,611	44,882.46	0.06
13	000799	酒鬼酒	1,000	43,870.00	0.06
14	600779	水井坊	1,100	41,393.00	0.06
15	688496	清越科技	4,400	40,656.00	0.06
16	600273	嘉化能源	5,600	39,984.00	0.06
17	002317	众生药业	3,282	37,513.26	0.05
18	002600	领益智造	5,200	37,024.00	0.05
19	002773	康弘药业	1,600	34,640.00	0.05
20	300115	长盈精密	2,752	32,996.48	0.05
21	600383	金地集团	9,662	32,850.80	0.05
22	603888	新华网	1,500	32,265.00	0.04
23	600171	上海贝岭	1,920	32,025.60	0.04
24	688306	均普智能	7,837	31,818.22	0.04
25	002221	东华能源	3,814	31,312.94	0.04
26	688400	凌云光	1,839	30,674.52	0.04
27	000860	顺鑫农业	1,811	30,316.14	0.04
28	002032	苏泊尔	600	30,060.00	0.04
29	688409	富创精密	811	29,958.34	0.04
30	000681	视觉中国	2,300	26,450.00	0.04
31	000581	威孚高科	1,544	25,136.32	0.04
32	600718	东软集团	2,959	24,470.93	0.03
33	000970	中科三环	3,197	24,457.05	0.03
34	000547	航天发展	4,113	24,102.18	0.03
35	000012	南玻 A	4,600	23,184.00	0.03
36	002468	申通快递	2,600	21,840.00	0.03
37	300113	顺网科技	2,100	21,504.00	0.03
38	600410	华胜天成	5,496	21,269.52	0.03
39	300244	迪安诊断	1,680	20,160.00	0.03
40	300026	红日药业	6,200	18,910.00	0.03
41	300618	寒锐钴业	700	18,515.00	0.03
42	002511	中顺洁柔	2,600	17,992.00	0.03
43	600606	绿地控股	12,793	17,270.55	0.02
44	600597	光明乳业	2,212	17,187.24	0.02
45	002081	金螳螂	4,542	13,762.26	0.02
46	300769	德方纳米	480	13,536.00	0.02
47	001914	招商积余	1,300	13,026.00	0.02
48	000877	天山股份	2,292	12,376.80	0.02

49	002192	融捷股份	400	12,008.00	0.02
50	002110	三钢闽光	4,000	11,800.00	0.02
51	002250	联化科技	2,446	11,740.80	0.02
52	000402	金融街	3,900	9,165.00	0.01
53	603267	鸿远电子	200	6,820.00	0.01
54	002326	永太科技	800	6,256.00	0.01
55	300363	博腾股份	500	5,975.00	0.01
56	002249	大洋电机	800	3,784.00	0.01
57	603638	艾迪精密	220	3,086.60	0.00
58	600782	新钢股份	900	2,988.00	0.00
59	605377	华旺科技	196	2,597.00	0.00
60	600409	三友化工	500	2,510.00	0.00
61	601136	首创证券	100	2,046.00	0.00
62	603866	桃李面包	400	2,028.00	0.00
63	601778	晶科科技	800	1,824.00	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	300866	安克创新	317,193.00	0.43
2	300760	迈瑞医疗	212,354.00	0.29
3	300124	汇川技术	159,303.00	0.21
4	601728	中国电信	117,274.00	0.16
5	688036	传音控股	54,745.60	0.07
6	600873	梅花生物	30,854.00	0.04
7	000408	藏格矿业	28,345.00	0.04
8	603195	公牛集团	24,917.00	0.03
9	600141	兴发集团	24,213.00	0.03
10	002938	鹏鼎控股	24,180.00	0.03
11	605499	东鹏饮料	23,033.00	0.03
12	300628	亿联网络	22,260.00	0.03
13	688390	固德威	20,320.00	0.03
14	605117	德业股份	19,635.00	0.03
15	002372	伟星新材	17,820.00	0.02
16	000738	航发控制	16,363.00	0.02
17	300390	天华新能	15,476.00	0.02
18	002240	盛新锂能	15,159.00	0.02
19	600737	中粮糖业	14,482.00	0.02
20	300979	华利集团	13,654.00	0.02

##### 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	600938	中国海油	613,509.00	0.83
2	601099	太平洋	111,639.00	0.15
3	002415	海康威视	95,533.00	0.13
4	601018	宁波港	80,177.62	0.11
5	601727	上海电气	73,733.12	0.10
6	600809	山西汾酒	51,490.00	0.07
7	600705	中航产融	50,748.60	0.07
8	002807	江阴银行	47,702.00	0.06
9	600763	通策医疗	46,996.00	0.06
10	600436	片仔癀	45,386.00	0.06
11	600094	大名城	33,287.00	0.04
12	300182	捷成股份	32,561.00	0.04
13	600667	太极实业	31,165.00	0.04
14	600795	国电电力	30,948.00	0.04
15	002463	沪电股份	30,588.00	0.04
16	002131	利欧股份	30,280.35	0.04
17	000069	华侨城 A	30,009.33	0.04
18	002371	北方华创	29,885.00	0.04
19	300482	万孚生物	29,873.80	0.04
20	603501	韦尔股份	28,954.00	0.04

#### 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	1,243,765.60
卖出股票收入（成交）总额	3,117,948.07

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	33,473.44	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	33,473.44	0.05
----	----	-----------	------

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127089	晶澳转债	127	12,357.42	0.02
2	127073	天赐转债	102	11,439.09	0.02
3	127085	韵达转债	58	6,385.86	0.01
4	127061	美锦转债	34	3,291.07	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述 4 只债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

#### 一、招商银行

2023 年 11 月，招商银行因违反规定办理结汇、售汇业务行为、违反规定办理资本项目资金收付行为，被国家外汇管理局深圳市分局没收违法所得 89.03 万元，并罚款 475 万元。

2023 年 12 月 1 日，招商银行宁波分行因“为环保不达标企业办理贴现业务；违规收费；员工行为管理存在薄弱环节；房地产业务管理不审慎；个人经营性贷款用于置换按揭贷款；贷款“三查”不尽职；贸易背景真实性审查不到位；投后管理不尽职导致理财投资资金被挪用”，被国家金融监督管理总局宁波监管局合计罚款 285 万元，没收未退费的违法所得 1516.68 元。

2023 年 12 月 15 日, 招商银行因“未按规定承担小微企业押品评估费; 未按规定承担房屋抵押登记费; 未落实价格目录, 向小微企业收取委托贷款手续费; 小微企业规模划型依据不足”, 被国家金融监督管理总局深圳监管局罚款 160 万元。

2024 年 6 月 28 日, 招商银行因“理财业务存在以下违法违规行: 一、未能有效穿透识别底层资产, 二、信息披露不规范”, 被国家金融监督管理总局罚款 350 万元。

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。

## 二、兴业银行

2023 年 9 月 11 日, 兴业银行任丘支行存在“贷款尽职调查不到位”的违法违规事实, 被国家金融监督管理总局沧州监管分局处罚款 30 万元。

2023 年 12 月 22 日, 兴业银行深圳分行因未按规定承担小微企业押品评估费, 未区分押品风险状况、统一要求小微企业购买抵押物财产保险, 被国家金融监督管理总局深圳监管局罚款 100 万元。

2024 年 2 月 18 日, 国家金融监督管理总局北京监管局发布的处罚信息显示, 兴业银行北京分行因存贷挂钩, 流动资金贷款挪用于股权投资, 个人按揭贷款业务严重违反审慎经营规则, 项目融资业务合规要件不全及未从严审核项目资本金, 发放贷款用于为违规领域垫资等五项违法违规事实, 被处以罚款 210 万元。

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。

### 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	761.86
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,520.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	2,282.08

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127089	晶澳转债	12,357.42	0.02
2	127073	天赐转债	11,439.09	0.02
3	127085	韵达转债	6,385.86	0.01
4	127061	美锦转债	3,291.07	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
7,720	6,729.25	407,788.62	0.78	51,541,996.42	99.22

注:以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	王飞舟	1,677,417.00	4.54
2	靳宁卿	980,400.00	2.65
3	纪伟才	938,029.00	2.54
4	于成福	932,390.00	2.52
5	于君	711,529.00	1.92
6	李坚	500,000.00	1.35
7	于延年	499,916.00	1.35
8	符王莹月	466,006.00	1.26



9	肖诚	437,235.00	1.18
10	袁湘芸	366,133.00	0.99

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	19,048.59	0.0367

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 5 月 22 日) 基金份额总额	542,268,490.78
本报告期期初基金份额总额	53,490,521.42
本报告期基金总申购份额	993,634.61
减：本报告期基金总赎回份额	2,534,370.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	51,949,785.04

## § 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

本报告期本基金管理人的高级管理人员无重大人事变动。

#### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动情况。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

##### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券	2	1,767,311.72	40.52	1,671.81	40.52	-
长江证券	1	1,743,858.95	39.98	1,649.68	39.98	-
国元证券	1	720,499.00	16.52	681.51	16.52	-
东北证券	1	130,044.00	2.98	123.05	2.98	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-

##### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
招商证券	19,173.66	100.00	-	-	-	-
长江证	-	-	-	-	-	-

券						
国元证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中金证 券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

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

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

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

2、基金交易单元的选择程序如下：

(1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

(2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 报告期内，本基金新增租用：无。

(2) 报告期内，本基金停止租用：申万宏源 1 个交易单元。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023	中国证监会指定披露媒	2024 年 1 月 20 日

	年第 4 季度报告提示性公告	介	
2	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 1 月 20 日
3	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)	中国证监会指定披露媒介	2024 年 2 月 7 日
4	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 2 月 7 日
5	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加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	2024 年 3 月 1 日
6	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加江苏银行为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 6 日
7	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2023 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 30 日
8	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 30 日
9	长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 20 日
10	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 4 月 20 日
11	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 6 月 25 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、长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 相关批准文件；
- 2、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 4、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

## 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日