

长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(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	11
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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
<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	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	43

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 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	48
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(LOF)
基金简称	长盛中证申万一带一路指数（LOF）
场内简称	一带一路 LOF
基金主代码	502013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 1 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	224,216,014.40 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 6 月 9 日

注：本基金由“长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金”终止分级运作转型而来，上述基金合同生效日为《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效日。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制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不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对中证申万一带一路主题指数的有效跟踪。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证申万一带一路主题指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	张利宁	许俊
	联系电话	010-86497608	010-66596688
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95566
传真		010-86497999	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100029	100818
法定代表人		胡甲	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

## 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	-14,536,386.71
本期利润	-8,890,623.17
加权平均基金份额本期利润	-0.0389
本期加权平均净值利润率	-3.51%
本期基金份额净值增长率	-3.54%
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	-318,613,856.10
期末可供分配基金份额利润	-1.4210
期末基金资产净值	240,767,096.33
期末基金份额净值	1.0738
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	-24.43%

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、本基金由长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2021 年 1 月 1 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

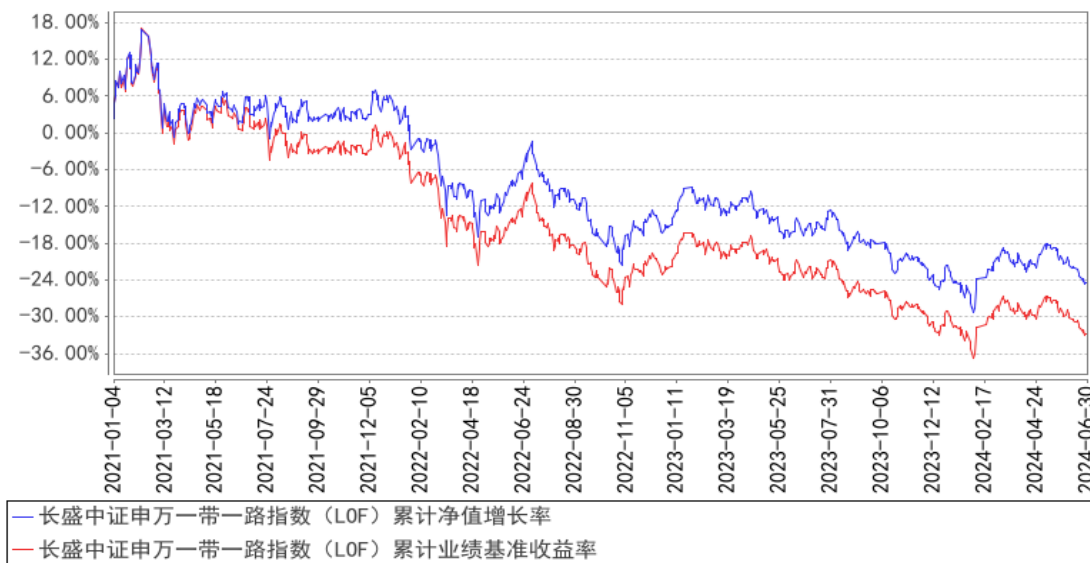
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.89%	0.51%	-4.24%	0.54%	0.35%	-0.03%
过去三个月	-4.16%	0.80%	-5.23%	0.83%	1.07%	-0.03%
过去六个月	-3.54%	0.94%	-5.18%	0.99%	1.64%	-0.05%
过去一年	-10.52%	0.85%	-13.18%	0.88%	2.66%	-0.03%
过去三年	-28.70%	0.98%	-35.36%	0.99%	6.66%	-0.01%
自基金转型起至今	-24.43%	1.04%	-32.79%	1.05%	8.36%	-0.01%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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，业绩比较基准中中证申万一带一路主题指数、银行活期存款利率每日按照 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

长盛中证申万一带一路指数（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、本基金由长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2021 年 1 月 1 日（即基金合同生效日）。

2、按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内首批成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金注册地为深圳，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，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证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。	2021 年 1 月 1 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。净资产回报率、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 1.0738 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.54%，同期业绩比较基准收益率为-5.18%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0144%，年化跟踪误差为 1.4939%。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

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

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

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	19,195,567.55	16,091,583.19
结算备付金		-	-
存出保证金		14,631.29	8,842.60

交易性金融资产	6.4.7.2	222,193,934.90	245,366,897.02
其中：股票投资		222,193,934.90	245,366,897.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		19,453.52	163,018.30
应收股利		-	-
应收申购款		10,938.76	12,477.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		241,434,526.02	261,642,818.60
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		116,191.39	125,981.33
应付管理人报酬		203,220.06	216,661.87
应付托管费		40,643.98	43,332.41
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	307,374.26	421,393.59
负债合计		667,429.69	807,369.20
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	518,053,548.29	541,398,097.83
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-277,286,451.96	-280,562,648.43
净资产合计		240,767,096.33	260,835,449.40

负债和净资产总计		241,434,526.02	261,642,818.60
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0738 元，基金份额总额 224,216,014.40 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（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>		-7,188,726.97	1,832,052.04
1. 利息收入		27,963.37	43,157.67
其中：存款利息收入	6.4.7.13	27,963.37	27,200.96
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		-	15,956.71
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-12,867,850.96	-10,060,418.33
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-15,606,104.52	-13,791,798.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	24,416.88
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,738,253.56	3,706,963.25
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	5,645,763.54	11,843,464.18
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	5,397.08	5,848.52
<b>减：二、营业总支出</b>		1,701,896.20	2,042,449.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,258,191.85	1,516,397.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	251,638.28	333,607.45
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		-	57.51
8. 其他费用	6.4.7.23	192,066.07	192,386.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,890,623.17	-210,397.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,890,623.17	-210,397.42
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,890,623.17	-210,397.42

注：比较数据已根据更新发布的《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〉》中的利润表格式的要求进行重新列示，即将上年度可比期间利润表中的“证券出借利息收入”合并于“其他利息收入”中列示。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金(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	541,398,097.83	-280,562,648.43	260,835,449.40
二、本期期初净资产	541,398,097.83	-280,562,648.43	260,835,449.40
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-23,344,549.54	3,276,196.47	-20,068,353.07
(一)、综合收益总额	-	-8,890,623.17	-8,890,623.17
(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)	-23,344,549.54	12,166,819.64	-11,177,729.90
其中：1. 基金申购款	2,766,063.40	-1,439,089.56	1,326,973.84
2. 基金赎回款	-26,110,612.94	13,605,909.20	-12,504,703.74

（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	518,053,548.29	-277,286,451.96	240,767,096.33
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	583,955,975.57	-279,880,561.18	304,075,414.39
二、本期期初净资产	583,955,975.57	-279,880,561.18	304,075,414.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-26,489,142.26	11,973,904.87	-14,515,237.39
（一）、综合收益总额	-	-210,397.42	-210,397.42
（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）	-26,489,142.26	12,184,302.29	-14,304,839.97
其中：1. 基金申购款	8,764,664.65	-4,057,329.15	4,707,335.50
2. 基金赎回款	-35,253,806.91	16,241,631.44	-19,012,175.47
（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	557,466,833.31	-267,906,656.31	289,560,177.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

胡甲

刁俊东

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

根据《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》约定，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律



法规规定终止长盛中证申万一带一路 A 份额与长盛中证申万一带一路 B 份额的运作，无需召开基金份额持有人大会。据此，基金管理人已于 2020 年 12 月 2 日在规定媒介发布《长盛基金管理有限公司关于长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金之长盛中证申万一带一路 A 份额和长盛中证申万一带一路 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向上海证券交易所申请长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金的两类子份额退市，并于 2020 年 12 月 31 日（基金折算基准日）进行基金份额折算，《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》于基金折算基准日次日正式生效，《长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金合同》同日失效。本基金为上市契约型开放式（LOF），存续期限为不定期。本基金的管理人为长盛基金管理有限公司，托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、权证、股指期货、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具，（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 85%以上，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，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占基金资产比例为 5%—10%，其中每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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，权证投资不高于基金资产净值的 3%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证申万一带一路主题指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 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

#### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 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	19,195,567.55
等于：本金	19,193,995.98
加：应计利息	1,571.57
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	19,195,567.55

#### 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	255,612,118.84	-	222,193,934.90	-33,418,183.94
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	255,612,118.84	-	222,193,934.90	-33,418,183.94

#### 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

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	-
应付赎回费	159.40
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	107,707.26
其中：交易所市场	107,707.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	149,507.60

应付指数使用费	50,000.00
合计	307,374.26

#### 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	234,319,610.03	541,398,097.83
本期申购	1,197,159.46	2,766,063.40
本期赎回（以“-”号填列）	-11,300,755.09	-26,110,612.94
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	224,216,014.40	518,053,548.29

注：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。

#### 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	-317,863,599.26	37,300,950.83	-280,562,648.43
本期期初	-317,863,599.26	37,300,950.83	-280,562,648.43
本期利润	-14,536,386.71	5,645,763.54	-8,890,623.17
本期基金份额交易产生的变动数	13,786,129.87	-1,619,310.23	12,166,819.64
其中：基金申购款	-1,633,181.98	194,092.42	-1,439,089.56
基金赎回款	15,419,311.85	-1,813,402.65	13,605,909.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-318,613,856.10	41,327,404.14	-277,286,451.96

#### 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	27,025.36
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	827.24	
其他	110.77	
合计	27,963.37	

## 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	-15,606,104.52
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-15,606,104.52

## 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	75,206,301.16
减：卖出股票成本总额	90,650,798.85
减：交易费用	161,606.83
买卖股票差价收入	-15,606,104.52

## 6.4.7.15 债券投资收益

无。

## 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	2,738,253.56
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,738,253.56

## 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	5,645,763.54
股票投资	5,645,763.54
债券投资	-
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	5,645,763.54

#### 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	5,390.61
基金转换费收入	6.47
合计	5,397.08

#### 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	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	2,558.47
指数使用费	100,000.00
合计	192,066.07

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

#### 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“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	206,946.59	0.15	-	-

###### 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	195.76	0.17	-	-

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	1,258,191.85	1,516,397.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	458,438.36	549,620.49
应支付基金管理人的净管理费	799,753.49	966,777.04

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 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	251,638.28	333,607.45

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固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
中国银行	19,195,567.55	27,025.36	17,225,086.91	26,377.72
合计	19,195,567.55	27,025.36	17,225,086.91	26,377.72

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值总	备注

代码	券名称	认购日	期	受限类型	价格	估值单价	（单位：股）	成本总额	额	
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	限售期锁定	17.39	20.61	180	3,130.20	3,709.80	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	限售期锁定	16.98	13.48	191	3,243.18	2,574.68	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	限售期锁定	15.38	15.23	173	2,045.54	2,634.79	-
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	限售期锁定	17.43	42.03	221	3,852.03	9,288.63	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	限售期锁定	12.20	55.87	219	2,671.80	12,235.53	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	限售期锁定	28.01	37.81	138	3,865.38	5,217.78	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	限售期锁定	16.16	32.26	451	7,288.16	14,549.26	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	限售期锁定	55.82	91.22	150	5,972.74	13,683.00	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	限售期锁定	10.64	24.30	361	3,841.04	8,772.30	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	限售期锁定	11.88	23.32	590	7,009.20	13,758.80	-
301566	达	2023	6个月	限售	8.90	16.75	576	5,126.40	9,648.00	-

	利凯普	2024年12月22日		限售期锁定						
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	限售期锁定	21.73	27.10	306	6,649.38	8,292.60	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	限售期锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	限售期锁定	126.89	188.33	533	37,559.44	100,379.89	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	限售期锁定	19.43	36.92	219	4,255.17	8,085.48	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	6个月	限售期锁定	16.20	15.95	361	5,848.20	5,757.95	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	限售期锁定	21.28	29.48	107	2,276.96	3,154.36	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	限售期锁定	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	限售期锁定	29.02	25.34	94	2,727.88	2,381.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	限售期锁定	26.00	37.47	135	3,510.00	5,058.45	-
603344	星	2024	6个月	限售	19.18	22.66	153	2,934.54	3,466.98	-

	德胜	年 3 月 13 日		期锁定						
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	限售期锁定	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	限售期锁定	38.18	38.88	71	2,710.78	2,760.48	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	限售期锁定	23.35	26.59	108	2,521.80	2,871.72	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	限售期锁定	9.60	18.96	344	3,302.40	6,522.24	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	限售期锁定	22.66	15.87	355	8,044.30	5,633.85	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	限售期锁定	19.86	49.38	247	4,905.42	12,196.86	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	限售期锁定	86.96	209.54	91	7,913.36	19,068.14	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	限售期锁定	22.43	31.54	186	4,171.98	5,866.44	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	限售期锁定	15.69	18.77	471	7,389.99	8,840.67	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中

基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

3、本基金可作为特定投资者，参与上市公司公开或非公开发行股份认购。本基金可作为特定投资者所认购的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

4、本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。本基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

5、本基金可以通过网下发行获配的创业板股票。发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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；监察稽核部和风险管理部负责监察公司风险管理措施的执行；各职能部门在一定范围内负责本部门的风险评估和监控。

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人

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，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，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。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2023 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

##### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。



本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。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资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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。

##### 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	19,193,995.98	-	-	1,571.57	19,195,567.55
存出保证金	14,625.35	-	-	5.94	14,631.29
交易性金融资产	-	-	-	-222,193,934.90	222,193,934.90
应收申购款	-	-	-	10,938.76	10,938.76
应收清算款	-	-	-	19,453.52	19,453.52
资产总计	19,208,621.33	-	-	-222,225,904.69	241,434,526.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	116,191.39	116,191.39
应付管理人报酬	-	-	-	203,220.06	203,220.06
应付托管费	-	-	-	40,643.98	40,643.98
其他负债	-	-	-	307,374.26	307,374.26
负债总计	-	-	-	667,429.69	667,429.69
利率敏感度缺口	19,208,621.33	-	-	-221,558,475.00	240,767,096.33

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	16,090,030.39	-	-	1,552.80	16,091,583.19
存出保证金	8,838.60	-	-	4.00	8,842.60
交易性金融资产	-	-	-	-245,366,897.02	245,366,897.02
应收申购款	-	-	-	12,477.49	12,477.49
应收清算款	-	-	-	163,018.30	163,018.30
资产总计	16,098,868.99	-	-	-245,543,949.61	261,642,818.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	125,981.33	125,981.33
应付管理人报酬	-	-	-	216,661.87	216,661.87
应付托管费	-	-	-	43,332.41	43,332.41
其他负债	-	-	-	421,393.59	421,393.59
负债总计	-	-	-	807,369.20	807,369.20
利率敏感度缺口	16,098,868.99	-	-	-244,736,580.41	260,835,449.40

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进行了分类。

#### 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

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 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	222,193,934.90	92.29	245,366,897.02	94.07
合计	222,193,934.90	92.29	245,366,897.02	94.07

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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%	11,607,171.04	12,922,129.86
	2. 业绩比较基准下降5%	-11,607,171.04	-12,922,129.86

#### 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	221,846,451.90	244,416,360.22
第二层次	45,611.11	-
第三层次	301,871.89	950,536.80
合计	222,193,934.90	245,366,897.02

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 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	222,193,934.90	92.03
	其中：股票	222,193,934.90	92.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	19,195,567.55	7.95
8	其他各项资产	45,023.57	0.02
9	合计	241,434,526.02	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	-	-

B	采矿业	23,993,816.00	9.97
C	制造业	153,340,849.55	63.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,039,716.00	0.85
E	建筑业	7,820,725.83	3.25
F	批发和零售业	3,515,380.00	1.46
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,423,656.08	5.58
J	金融业	12,709,700.94	5.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,702,669.00	0.71
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	3,293,844.72	1.37
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	221,840,358.12	92.14

### 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	-	-
C	制造业	310,687.39	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,131.44	0.02
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,757.95	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	353,576.78	0.15

### 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	601088	中国神华	318,600	14,136,282.00	5.87
2	600036	招商银行	364,126	12,449,467.94	5.17
3	000651	格力电器	300,000	11,766,000.00	4.89
4	600519	贵州茅台	8,000	11,739,120.00	4.88
5	000333	美的集团	179,480	11,576,460.00	4.81
6	300760	迈瑞医疗	39,500	11,490,945.00	4.77
7	600406	国电南瑞	459,568	11,470,817.28	4.76
8	002475	立讯精密	216,000	8,490,960.00	3.53
9	601899	紫金矿业	482,900	8,484,553.00	3.52
10	000568	泸州老窖	57,411	8,237,904.39	3.42
11	600660	福耀玻璃	121,600	5,824,640.00	2.42
12	600690	海尔智家	175,100	4,969,338.00	2.06
13	600436	片仔癀	22,500	4,661,325.00	1.94
14	601390	中国中铁	698,429	4,553,757.08	1.89
15	300122	智飞生物	150,950	4,231,128.50	1.76
16	002179	中航光电	87,530	3,330,516.50	1.38
17	300015	爱尔眼科	319,171	3,293,844.72	1.37
18	601186	中国铁建	356,875	3,058,418.75	1.27
19	002050	三花智控	156,200	2,980,296.00	1.24
20	000596	古井贡酒	13,600	2,870,552.00	1.19
21	000661	长春高新	28,600	2,624,622.00	1.09

22	002463	沪电股份	63,000	2,299,500.00	0.96
23	000963	华东医药	77,200	2,146,932.00	0.89
24	601877	正泰电器	109,600	2,088,976.00	0.87
25	600845	宝信软件	61,160	1,952,838.80	0.81
26	002028	思源电气	28,900	1,933,410.00	0.80
27	000999	华润三九	44,900	1,911,842.00	0.79
28	002353	杰瑞股份	54,200	1,901,336.00	0.79
29	300832	新产业	27,300	1,841,112.00	0.76
30	300394	天孚通信	19,660	1,738,337.20	0.72
31	600025	华能水电	157,200	1,694,616.00	0.70
32	000538	云南白药	33,000	1,687,950.00	0.70
33	600600	青岛啤酒	22,900	1,666,433.00	0.69
34	600885	宏发股份	59,000	1,633,120.00	0.68
35	300316	晶盛机电	52,500	1,508,325.00	0.63
36	300628	亿联网络	38,062	1,399,539.74	0.58
37	600161	天坛生物	56,860	1,387,384.00	0.58
38	605117	德业股份	18,200	1,352,988.00	0.56
39	300699	光威复材	54,260	1,347,275.80	0.56
40	603816	顾家家居	40,600	1,310,974.00	0.54
41	000807	云铝股份	93,600	1,264,536.00	0.53
42	688036	传音控股	16,419	1,256,710.26	0.52
43	688009	中国通号	208,353	1,250,118.00	0.52
44	603195	公牛集团	16,023	1,235,693.76	0.51
45	600332	白云山	39,800	1,167,334.00	0.48
46	002595	豪迈科技	30,000	1,145,100.00	0.48
47	300012	华测检测	112,000	1,126,720.00	0.47
48	600096	云天化	57,500	1,116,650.00	0.46
49	002262	恩华药业	47,000	1,115,780.00	0.46
50	600862	中航高科	56,400	1,059,192.00	0.44
51	603979	金诚信	20,200	1,020,706.00	0.42
52	002130	沃尔核材	72,200	1,019,464.00	0.42
53	600779	水井坊	26,200	985,906.00	0.41
54	603338	浙江鼎力	16,000	966,720.00	0.40
55	002372	伟星新材	59,000	909,780.00	0.38
56	002032	苏泊尔	17,490	876,249.00	0.36
57	600085	同仁堂	21,300	813,873.00	0.34
58	600873	梅花生物	80,700	808,614.00	0.34
59	002444	巨星科技	31,800	785,460.00	0.33
60	000034	神州数码	33,700	771,393.00	0.32
61	603899	晨光股份	24,000	750,720.00	0.31
62	600563	法拉电子	9,600	731,328.00	0.30
63	600549	厦门钨业	40,000	690,000.00	0.29
64	300724	捷佳伟创	12,400	669,724.00	0.28

65	002557	洽洽食品	23,302	656,883.38	0.27
66	300979	华利集团	10,300	626,755.00	0.26
67	002043	兔宝宝	56,900	590,053.00	0.25
68	000513	丽珠集团	15,600	580,476.00	0.24
69	601965	中国汽研	34,100	575,949.00	0.24
70	300487	蓝晓科技	13,650	570,024.00	0.24
71	600329	达仁堂	17,500	566,825.00	0.24
72	002850	科达利	6,800	519,384.00	0.22
73	688516	奥特维	11,897	497,413.57	0.21
74	000739	普洛药业	36,300	492,591.00	0.20
75	603658	安图生物	9,800	451,486.00	0.19
76	002831	裕同科技	16,900	432,471.00	0.18
77	002690	美亚光电	25,900	427,350.00	0.18
78	603228	景旺电子	13,200	419,760.00	0.17
79	600422	昆药集团	22,400	399,392.00	0.17
80	688016	心脉医疗	3,975	389,748.75	0.16
81	600562	国睿科技	27,300	372,918.00	0.15
82	688050	爱博医疗	5,060	370,999.20	0.15
83	300257	开山股份	35,800	361,580.00	0.15
84	688100	威胜信息	9,338	356,244.70	0.15
85	002683	广东宏大	17,500	352,275.00	0.15
86	605090	九丰能源	11,900	345,100.00	0.14
87	600710	苏美达	41,500	338,225.00	0.14
88	002003	伟星股份	24,600	308,730.00	0.13
89	601369	陕鼓动力	34,200	274,284.00	0.11
90	300861	美畅股份	13,600	263,160.00	0.11
91	600517	国网英大	60,100	260,233.00	0.11
92	301015	百洋医药	11,000	258,830.00	0.11
93	600502	安徽建工	48,500	208,550.00	0.09
94	002158	汉钟精机	11,600	193,952.00	0.08
95	603699	纽威股份	11,300	193,456.00	0.08
96	601882	海天精工	8,100	185,571.00	0.08
97	603868	飞科电器	3,700	142,080.00	0.06
98	300969	恒帅股份	1,600	110,608.00	0.05
99	601968	宝钢包装	18,400	86,112.00	0.04
100	603966	法兰泰克	11,540	79,279.80	0.03

### 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	301589	诺瓦星云	533	100,379.89	0.04
2	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
3	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
4	688692	达梦数据	91	19,068.14	0.01



5	301536	星辰科技	451	14,549.26	0.01
6	301565	中仑新材	590	13,758.80	0.01
7	301538	骏鼎达	150	13,683.00	0.01
8	301392	汇成真空	219	12,235.53	0.01
9	688691	灿芯股份	247	12,196.86	0.01
10	301566	达利凯普	576	9,648.00	0.00
11	001389	广合科技	221	9,288.63	0.00
12	688709	成都华微	471	8,840.67	0.00
13	301539	宏鑫科技	361	8,772.30	0.00
14	301587	中瑞股份	306	8,292.60	0.00
15	301591	肯特股份	219	8,085.48	0.00
16	688530	欧莱新材	344	6,522.24	0.00
17	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
18	688695	中创股份	186	5,866.44	0.00
19	601033	永兴股份	361	5,757.95	0.00
20	688584	上海合晶	355	5,633.85	0.00
21	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
22	301502	华阳智能	138	5,217.78	0.00
23	603341	龙旗科技	135	5,058.45	0.00
24	001359	平安电工	180	3,709.80	0.00
25	603344	星德胜	153	3,466.98	0.00
26	603082	北自科技	107	3,154.36	0.00
27	603381	永臻股份	108	2,871.72	0.00
28	603375	盛景微	71	2,760.48	0.00
29	001387	雪祺电气	173	2,634.79	0.00
30	001379	腾达科技	191	2,574.68	0.00
31	603312	西典新能	94	2,381.96	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	8,350,086.00	3.20
2	002475	立讯精密	8,174,908.22	3.13
3	600690	海尔智家	5,193,990.00	1.99
4	002463	沪电股份	2,381,291.00	0.91
5	000333	美的集团	2,088,646.00	0.80
6	002028	思源电气	2,039,703.00	0.78
7	600845	宝信软件	2,014,479.80	0.77
8	000538	云南白药	1,736,554.00	0.67
9	601390	中国中铁	1,519,090.00	0.58
10	600161	天坛生物	1,433,138.80	0.55
11	300394	天孚通信	1,379,391.00	0.53

12	688036	传音控股	1,372,398.37	0.53
13	000999	华润三九	1,317,876.00	0.51
14	000807	云铝股份	1,295,661.00	0.50
15	600436	片仔癀	1,189,164.00	0.46
16	600096	云天化	1,171,350.00	0.45
17	300832	新产业	1,047,701.00	0.40
18	002262	恩华药业	843,826.00	0.32
19	600873	梅花生物	828,765.00	0.32
20	002444	巨星科技	811,516.00	0.31

#### 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	300274	阳光电源	11,923,948.80	4.57
2	601012	隆基绿能	8,128,403.52	3.12
3	601939	建设银行	3,684,547.00	1.41
4	603392	万泰生物	3,656,830.80	1.40
5	601100	恒立液压	3,552,162.00	1.36
6	000333	美的集团	3,395,245.00	1.30
7	300347	泰格医药	2,769,328.00	1.06
8	002709	天赐材料	2,277,615.00	0.87
9	601088	中国神华	1,637,227.00	0.63
10	688390	固德威	1,581,641.02	0.61
11	688363	华熙生物	1,434,867.87	0.55
12	600036	招商银行	1,433,671.00	0.55
13	000651	格力电器	1,391,719.00	0.53
14	300395	菲利华	1,348,433.00	0.52
15	300760	迈瑞医疗	1,341,953.00	0.51
16	600406	国电南瑞	1,303,690.00	0.50
17	002332	仙琚制药	1,224,300.00	0.47
18	601611	中国核建	1,097,825.00	0.42
19	601717	郑煤机	1,083,694.91	0.42
20	000568	泸州老窖	1,016,830.00	0.39

#### 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	61,832,073.19
卖出股票收入（成交）总额	75,206,301.16

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

招商银行：

本基金跟踪的标的指数为中证申万一带一路主题指数，配置了中证申万一带一路主题指数成分股招商银行。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 1,516.68 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为：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。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,631.29
2	应收清算款	19,453.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,938.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,023.57

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 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

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	301589	诺瓦星云	100,379.89	0.04	限售期锁定
2	603285	键邦股份	24,002.55	0.01	新股未上市和限售期锁定
3	603350	安乃达	21,608.56	0.01	新股未上市和限售期锁定
4	688692	达梦数据	19,068.14	0.01	限售期锁定
5	301536	星辰科技	14,549.26	0.01	限售期锁定

### 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 (%)
20,512	10,930.97	1,491,604.08	0.67	222,724,410.32	99.33

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	张迈	844,000.00	2.74
2	胡玉平	416,710.00	1.35
3	徐伟	406,738.00	1.32
4	迟吉成	393,885.00	1.28
5	上海市基督教三自爱 国运动委员会	385,678.00	1.25
6	杨丽	343,027.00	1.11
7	丁荣才	281,458.00	0.91
8	蒋翰章	272,899.00	0.89
9	戚远洋	259,692.00	0.84
10	张敏	257,119.00	0.84

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	1.91	0.0000

### 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 (2021 年 1 月 1 日) 基	350,198,092.48
----------------------------	----------------

基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	234,319,610.03
本报告期基金总申购份额	1,197,159.46
减：本报告期基金总赎回份额	11,300,755.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	224,216,014.40

## § 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 基金经理的变动情况

本报告期内本基金基金经理未发生变动。

#### 10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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安永华明会计师事务所（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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	2	65,612,475.12	48.33	48,936.70	42.45	-
国泰君安	2	62,075,673.20	45.72	58,717.75	50.93	-
中信证券	2	4,909,809.44	3.62	4,644.19	4.03	-
东北证券	1	2,957,494.97	2.18	2,798.49	2.43	-
国元证券	2	206,946.59	0.15	195.76	0.17	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资历雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

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

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

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

2、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：无。

## 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 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 1 月 20 日
2	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (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
4	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
5	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (LOF) 2023 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2024 年 3 月 30 日
6	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
7	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
8	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (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
9	长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2024 年 6 月 20 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、长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）相关批准文件；
- 2、《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（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。



## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日