长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）
2026年中期报告

2026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：2026年8月29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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月28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2026年01月01日起至06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 8

4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
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 13

§5 托管人报告 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 18

§7 投资组合报告 37

7.1 期末基金资产组合情况 37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 37
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 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 60
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 60

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 61
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 61
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 61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 61
7.12 投资组合报告附注 61

§8 基金份额持有人信息 62

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 62

§9 开放式基金份额变动 62

§10 重大事件揭示 63

10.1 基金份额持有人大会决议 63
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 63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 63
10.4 基金投资策略的改变 63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 63
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 64
10.8 其他重大事件 65

§11 影响投资者决策的其他重要信息 66

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 66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 66

§12 备查文件目录 66

12.1 备查文件目录 66
12.2 存放地点 67
12.3 查阅方式 67

§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	108,769,762.11 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，以实现对中证 800 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×中证 800 指数收益率＋5%×一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	王小飞
	联系电话	010-86497608	021-60637103
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	021-60637228
传真		010-86497999	021-60635778
注册地址		深圳市福田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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金中期报告置备地点	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(2026年1月1日-2026年6月30日)
本期已实现收益	34,594,915.34
本期利润	31,511,042.26
加权平均基金份额本期利润	0.3113
本期加权平均净值利润率	14.96%
本期基金份额净值增长率	15.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026年6月30日)
期末可供分配利润	129,378,228.01
期末可供分配基金份额利润	1.1895
期末基金资产净值	245,575,579.95
期末基金份额净值	2.258
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026年6月30日)
基金份额累计净值增长率	64.56%

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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
过去三个月	16.15%	1.27%	13.04%	1.27%	3.11%	0.00%
过去六个月	15.85%	1.22%	10.62%	1.18%	5.23%	0.04%
过去一年	40.34%	1.07%	31.47%	1.04%	8.87%	0.03%
过去三年	48.45%	1.12%	33.67%	1.12%	14.78%	0.00%
过去五年	27.07%	1.08%	4.29%	1.09%	22.78%	-0.01%
过去七年	110.11%	1.12%	40.95%	1.12%	69.16%	0.00%
过去十年	147.66%	1.10%	53.53%	1.10%	94.13%	0.00%
自基金转型起至今	64.56%	1.33%	2.12%	1.29%	62.44%	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%×中证 800 指数收益率＋5%×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



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 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十八只开放式基金，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A100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，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛北证50成份指数增强型发起式证券投资基金基金经理，长盛中证红利低波动100指数型证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛中证A500指数增强型证券投资基金基金经理，长盛上证科创板芯片指数发起式证券投资基金基金经理，长盛上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理，长盛聚利债券型证券投资基金基金经理，量化投资部总经理助理。	2019年5月30日	-	17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。
石晓冉	本基金基金经理，长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证A500指数增强型证券投资基金基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛盛世灵活配置混合型证	2026年6月8日	-	9年	石晓冉先生，硕士。曾任中信建投基金管理有限公司量化研究员，中国人保资产管理有限公司量化研究员、基金经理助理、基金经理，万柏私募基金管理有限公司投资经理。2025年3月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理。

	券投资基金基金经理。				

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

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

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年上半年A股市场整体在经历2025年四季度的震荡调整后，在1月初重新启动快速上涨且成交量同步急剧放大，其中科技出海板块的光通信、电路板及其上游的玻纤、光纤等细分板块上行动能充沛，而红利板块走势呈现明显的负相关性。其后在主要宽基ETF的资金大幅流出的引导下，市场的波动率有所降低，价格水平在高位保持震荡。2月底3月初受到中东地缘冲突的突发影响，国际油价大幅调升并在高位剧烈震荡，使得全球投资者对于美联储本年度的降息空间转向极为谨慎的态度，对于滞胀风险的评估显著提升，风险偏好快速下降，进而传导至A股市场，使得国内股市发生显著的大面积回调，即使基本面受益的石油石化、储存芯片等板块亦冲高回落，而红利板块则走势相对稳健。

其后在二季度由于国内适度宽松的政策托底、新质生产力相关产业的持续落地，以及外部地缘风险的边际缓和，市场在4月后逐步修复并呈现结构性行情。本季度市场整体呈现“K型分化”特征，科技成长板块一枝独秀，而传统消费、金融地产等板块普遍承压。在板块结构上，AI硬科技产业链成为绝对主线。成长板块内部，电子、通信、半导体设备等细分领域受AI产业资本开支扩张、国产替代加速驱动，全季度涨幅位居行业前列，成为拉动A股指数的核心动力；成长板块内部亦呈现明显的结构性轮动，资金精准流向业绩落地、技术突破的上游细分环节，对缺乏业绩支撑的纯概念标的逐步规避。红利与价值板块方面，受消费复苏不及预期、地产行业持续承压影响，食品饮料、银行、非银金融、房地产等板块普遍出现下跌，仅高股息、业绩确定性强的地方性银行、公用事业板块展现出一定的抗跌性，成为市场震荡中的防御性选择。此外，本季度市场日均成交金额维持在3万亿左右的高位，但交易集中度显著提升，“一九行情”特征凸显，多数个股难以跑赢指数，需警惕板块极致分化后出现的风格再均衡带来的短期波动风险。

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2.258元，本报告期基金份额净值增长率为15.85%，同期业绩比较基准收益率为10.62%。本报告期内日均跟踪偏离度为0.1840%，年度化跟踪误差为

3.7644%。

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2026年下半年，美国科技巨头的资本开支在经历两年的大幅扩张的爆发期后，后续大概率进入边际增速放缓的平台期，目前AI应用在编程等方面的企业用户端有显著突破，但普通消费者端的应用性价比仍有待观察。AI科技行业的设备原料相关的PPI持续处于高企状态，即所谓的AI产业链通胀，使得AI科技行业能在高企的美债利率背景下持续吸引资本流入形成正循环，但目前我们一看到部分巨头对于算力的利用率出现裂隙，并且叠加巨头们开始普遍进行债务融资，现金流压力陡增，使得市场对于美国科技行业尤其是上游设备材料的定价开始由分子端转向分母端。我们预计AI科技行业的景气度大概率仍会持续一段时间，但其股价受到的影响因素可能会进入成长预期和建设成本二者的拉扯阶段。此外再考虑到上半年全球科技股极致走势所吸引的杠杆资金的入场比重，杠杆率对于波动率的敏感性大概率使得其股价走势的波动率加大，风险收益率比值下降，动量因子难以维持，而反转因子很可能重新回到历史水平。A股的科技板块受日韩和美国股市影响，亦容易进入类似的状态，但我们对A股市场整体仍维持震荡向上的较为乐观的态度，因为在上半年的极致分化行情中，以医药、消费、银行、公用事业为代表的红利板块和质量板块已经调整出有效的配置空间，并且当下我们看到国内宏观政策已经开始将注意力转向内需消费和居民收入提升。如果美国AI科技的成长预期无法维持高增速，外加中东地缘冲突的持续对于滞胀的引导，那么科技产业链的出口一旦受到较大压力，我们预计国内刺激政策会相应加码作为对冲来扭转K型经济走势，而这一转变目前是市场尚未充分预期的，也是未来收益弹性的希望所在。未来AI应用的大面积落地和形成有效的商业闭环可能亦需要居民的收入和消费信心的修复和提升来形成发育的土壤。

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：2026年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	13,208,905.40	11,217,435.92
结算备付金		2,276,213.58	-
存出保证金		65,550.36	3,274.77
交易性金融资产	6.4.7.2	213,635,054.94	189,328,250.07
其中：股票投资		213,635,054.94	189,289,987.41
基金投资		-	-
债券投资		-	38,262.66
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		-	532,500.98
应收股利		-	-
应收申购款		18,004,113.03	5,906.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		247,189,837.31	201,087,367.86
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026年6月30日**	**上年度末 2025年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.73	-
应付赎回款		76,961.74	62,529.19
应付管理人报酬		181,054.61	167,744.44
应付托管费		36,210.88	33,548.88
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.9	1,320,029.40	1,075,967.06
负债合计		1,614,257.36	1,339,789.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	116,197,351.94	109,512,526.66
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	129,378,228.01	90,235,051.28
净资产合计		245,575,579.95	199,747,577.94
负债和净资产总计		247,189,837.31	201,087,367.86

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.258 元，基金份额总额 108,769,762.11 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		32,836,321.38	2,158,625.30
1.利息收入		25,357.14	18,204.36
其中：存款利息收入	6.4.7.13	25,357.14	18,204.36
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		35,887,902.64	2,251,702.03
其中：股票投资收益	6.4.7.14	34,069,156.44	415,642.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	5,623.49	77.66
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	1,813,122.71	1,835,981.48
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	-3,083,873.08	-122,656.35
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	6,934.68	11,375.26
减：二、营业总支出		1,325,279.12	918,105.46
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	1,041,970.93	715,073.10
2．托管费	6.4.10.2.2	208,394.18	143,014.62
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		0.25	0.37
8．其他费用	6.4.7.23	74,913.76	60,017.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,511,042.26	1,240,519.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,511,042.26	1,240,519.84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		31,511,042.26	1,240,519.84

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：2026年1月1日至2026年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026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	109,512,526.66	90,235,051.28	199,747,577.94
二、本期期初净资产	109,512,526.66	90,235,051.28	199,747,577.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,684,825.28	39,143,176.73	45,828,002.01
（一）、综合收益总额	-	31,511,042.26	31,511,042.26
（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）	6,684,825.28	7,632,134.47	14,316,959.75
其中：1.基金申购款	10,389,886.28	11,115,936.37	21,505,822.65

2.基金赎回款	-3,705,061.00	-3,483,801.90	-7,188,862.90
（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	116,197,351.94	129,378,228.01	245,575,579.95

项目	上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	53,039,620.31	25,487,016.03	78,526,636.34
二、本期期初净资产	53,039,620.31	25,487,016.03	78,526,636.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	63,873,185.34	33,682,118.30	97,555,303.64
（一）、综合收益总额	-	1,240,519.84	1,240,519.84
（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）	63,873,185.34	32,441,598.46	96,314,783.80
其中：1.基金申购款	71,114,508.19	35,846,567.79	106,961,075.98
2.基金赎回款	-7,241,322.85	-3,404,969.33	-10,646,292.18
（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	116,912,805.65	59,169,134.33	176,081,939.98

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	张壬午	龚珉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛同庆中证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×95%＋一年期银行定期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集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>》《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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年1月1日至2026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2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部　税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，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。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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 2026年6月30日
活期存款	13,208,905.40
等于：本金	13,207,768.29
加：应计利息	1,137.11
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	13,208,905.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		199,173,521.15	-	213,635,054.94	14,461,533.79
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	199,173,521.15	-	213,635,054.94	14,461,533.79

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 2026年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	185.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	387,923.31
其中：交易所市场	387,923.31
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,383.76
其他	607,536.79
合计	1,320,029.40

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	102,510,849.62	109,512,526.66
本期申购	9,727,105.16	10,389,886.28
本期赎回（以“-”号填列）	-3,468,192.67	-3,705,061.00
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	108,769,762.11	116,197,351.94

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2026年6月30日止，本基金于深交所上市的基金份额为28,890,224.00份(2025年12月31日：31,042,067.00份)，托管在场外未上市交易的基金份额为79,879,538.11份(2025年12月31日：71,468,782.62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	204,963,887.99	-114,728,836.71	90,235,051.28
本期期初	204,963,887.99	-114,728,836.71	90,235,051.28
本期利润	34,594,915.34	-3,083,873.08	31,511,042.26
本期基金份额交易产生的变动数	14,982,294.10	-7,350,159.63	7,632,134.47
其中：基金申购款	22,608,834.37	-11,492,898.00	11,115,936.37
基金赎回款	-7,626,540.27	4,142,738.37	-3,483,801.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	254,541,097.43	-125,162,869.42	129,378,228.01

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
活期存款利息收入	20,988.15
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	4,300.69
其他	68.30
合计	25,357.14

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	34,069,156.44
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	34,069,156.44

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,103,313,182.37
减：卖出股票成本总额	2,067,100,941.91
减：交易费用	2,143,084.02
买卖股票差价收入	34,069,156.44

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	65.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,558.22
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	5,623.49

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	37,488.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,821.97
减：应计利息总额	106.91
减：交易费用	1.52
买卖债券差价收入	5,558.22

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,813,122.71
其中:证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,813,122.71

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-3,083,873.08
股票投资	-3,077,506.85
债券投资	-6,366.23
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	-3,083,873.08

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	6,934.46
基金转换费收入	0.22
合计	6,934.68

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 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	530.00
合计	74,913.76

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

根据本基金管理人于2026年7月9日披露的《关于长盛同庆中证800指数型证券投资基金（LOF）增加C类份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同等法律文件的公告》，本基金自2026年7月9日起，增加C类份额并调整基金份额净值计算精度。详见长盛官网相关公告。

6.4.9 关联方、关联关系

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	2,420,678,759.67	57.68	-	-

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026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	474,286.48	57.68	217,137.38	55.97
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025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。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,041,970.93	715,073.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	181,412.82	103,857.94
应支付基金管理人的净管理费	860,558.11	611,215.16

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×年管理费率/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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	208,394.18	143,014.62

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年托管费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率/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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	13,208,905.40	20,988.15	10,738,720.88	17,945.77
合计	13,208,905.40	20,988.15	10,738,720.88	17,945.77

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（2026年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026年1月27日	6个月	限售期锁定	28.00	27.77	54	1,512.00	1,499.58	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	6个月	限售期锁定	10.11	10.11	7,418	74,995.98	74,995.98	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	3,179	32,139.69	32,139.69	-
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	限售期锁定	7.82	25.28	864	6,756.48	21,841.92	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	限售期锁定	18.38	18.20	77	1,415.26	1,401.40	-
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	限售期锁定	26.66	63.44	136	3,625.76	8,627.84	-
301666	大	2026	6个月	限售	46.08	571.99	314	14,469.12	179,604.86	-

	普微	年4月8日		期锁定						
301680	固德电材	2026年2月27日	6个月	限售期锁定	58.00	112.13	68	3,944.00	7,624.84	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	限售期锁定	69.66	159.94	191	13,305.06	30,548.54	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	限售期锁定	78.38	129.27	46	3,605.48	5,946.42	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	限售期锁定	21.93	76.74	162	3,552.66	12,431.88	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	限售期锁定	24.68	104.80	132	3,257.76	13,833.60	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	限售期锁定	11.18	17.57	194	2,168.92	3,408.58	-
603284	林平发展	2026年2月3日	6个月	限售期锁定	37.88	34.86	42	1,590.96	1,464.12	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	限售期锁定	33.49	38.45	38	1,272.62	1,461.10	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	限售期锁定	21.88	25.50	69	1,509.72	1,759.50	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	限售期锁定	17.70	99.76	136	2,407.20	13,567.36	-
688712	北	2026	6个月	限售	17.52	35.90	858	15,032.16	30,802.20	-

	芯生命	年1月28日		期锁定						
688781	视涯科技	2026年3月18日	9个月	限售期锁定	22.68	46.82	1,923	43,613.64	90,034.86	-
688783	西安奕材	2025年10月20日	9个月	限售期锁定	8.62	57.30	8,710	75,080.20	499,083.00	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	限售期锁定	92.18	462.56	52	4,793.36	24,053.12	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	限售期锁定	114.28	675.74	738	84,338.64	498,696.12	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	限售期锁定	81.88	2,086.66	54	4,421.52	112,679.64	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	限售期锁定	6.41	27.75	654	4,192.14	18,148.50	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	6个月	限售期锁定	26.28	182.77	158	4,152.24	28,877.66	-
688816	易思维	2026年2月4日	6个月	限售期锁定	55.95	57.08	86	4,811.70	4,908.88	-
688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	限售期锁定	9.47	70.09	617	5,842.99	43,245.53	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	限售期锁定	19.68	170.81	304	5,982.72	51,926.24	-

注：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中需要限售的部分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。

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。本基金的活期银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，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。

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，因而信用风险不重大。

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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约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公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026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	13,207,768.29	-	-	1,137.11	13,208,905.40
结算备付金	2,276,014.41	-	-	199.17	2,276,213.58
存出保证金	65,544.69	-	-	5.67	65,550.36
交易性金融资产	-	-	-	213,635,054.94	213,635,054.94
应收申购款	-	-	-	18,004,113.03	18,004,113.03
资产总计	15,549,327.39	-	-	231,640,509.92	247,189,837.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	76,961.74	76,961.74
应付管理人报酬	-	-	-	181,054.61	181,054.61
应付托管费	-	-	-	36,210.88	36,210.88

应付清算款	-	-	-	0.73	0.73
其他负债	-	-	-	1,320,029.40	1,320,029.40
负债总计	-	-	-	1,614,257.36	1,614,257.36
利率敏感度缺口	15,549,327.39	-	-	230,026,252.56	245,575,579.95
上年度末 2025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	11,216,323.16	-	-	1,112.76	11,217,435.92
存出保证金	3,274.47	-	-	0.30	3,274.77
交易性金融资产	-	38,188.20	-	189,290,061.87	189,328,250.07
应收申购款	-	-	-	5,906.12	5,906.12
应收清算款	-	-	-	532,500.98	532,500.98
资产总计	11,219,597.63	38,188.20	-	189,829,582.03	201,087,367.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	62,529.19	62,529.19
应付管理人报酬	-	-	-	167,744.44	167,744.44
应付托管费	-	-	-	33,548.88	33,548.88
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	1,075,967.06	1,075,967.06
负债总计	-	-	-	1,339,789.92	1,339,789.92
利率敏感度缺口	11,219,597.63	38,188.20	-	188,489,792.11	199,747,577.94

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，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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 2026年6月30日		上年度末 2025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	213,635,054.94	86.99	189,289,987.41	94.76
合计	213,635,054.94	86.99	189,289,987.41	94.76

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（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	1.业绩比较基准上升5%	12,354,512.05	9,910,137.51
	2.业绩比较基准下降5%	-12,354,512.05	-9,910,137.51

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	211,820,441.98	187,666,534.05
第二层次	107,135.67	688,890.72
第三层次	1,707,477.29	972,825.30
合计	213,635,054.94	189,328,250.07

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证券等投资，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投资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，确定相关投资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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债等，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	213,635,054.94	86.43
	其中：股票	213,635,054.94	86.43
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	15,485,118.98	6.26
8	其他各项资产	18,069,663.39	7.31
9	合计	247,189,837.31	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	972,088.00	0.40

B	采矿业	7,138,726.55	2.91
C	制造业	143,491,149.30	58.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,457,716.11	3.85
E	建筑业	1,574,293.00	0.64
F	批发和零售业	1,594,013.80	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	7,239,607.48	2.95
H	住宿和餐饮业	5,397.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,368,892.09	2.19
J	金融业	28,965,389.65	11.79
K	房地产业	386,901.00	0.16
L	租赁和商务服务业	1,808,917.52	0.74
M	科学研究和技术服务业	2,267,009.06	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	1,001,991.20	0.41
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	331,775.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	211,603,866.76	86.17

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	42,862.92	0.02
C	制造业	1,852,923.83	0.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	107,135.67	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,774.58	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	22,464.18	0.01
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	669.00	0.00
S	综合	3,358.00	0.00
	合计	2,031,188.18	0.83

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	300308	中际旭创	6,700	8,509,000.00	3.46
2	300750	宁德时代	14,940	5,871,569.40	2.39
3	300502	新易盛	9,000	5,463,000.00	2.22
4	600519	贵州茅台	3,200	3,793,568.00	1.54
5	603986	兆易创新	4,200	3,423,000.00	1.39
6	688256	寒武纪	1,828	2,916,665.40	1.19
7	688008	澜起科技	8,687	2,692,101.30	1.10
8	601318	中国平安	55,718	2,659,977.32	1.08
9	000333	美的集团	31,200	2,356,536.00	0.96
10	600030	中信证券	76,724	2,204,280.52	0.90
11	600036	招商银行	60,800	2,158,400.00	0.88
12	002384	东山精密	8,200	2,151,270.00	0.88
13	601899	紫金矿业	84,840	2,132,877.60	0.87
14	600900	长江电力	79,420	2,102,247.40	0.86
15	002475	立讯精密	29,400	2,069,760.00	0.84
16	603259	药明康德	15,068	1,876,116.68	0.76
17	002371	北方华创	2,105	1,861,998.80	0.76
18	002463	沪电股份	11,000	1,680,800.00	0.68
19	000725	京东方A	193,200	1,676,976.00	0.68
20	600176	中国巨石	21,500	1,566,920.00	0.64
21	300408	三环集团	8,900	1,485,410.00	0.60

22	600919	江苏银行	137,620	1,483,543.60	0.60
23	600150	中国船舶	43,886	1,482,907.94	0.60
24	600887	伊利股份	61,034	1,462,374.64	0.60
25	000338	潍柴动力	51,800	1,411,550.00	0.57
26	300394	天孚通信	4,580	1,386,274.40	0.56
27	601328	交通银行	199,970	1,285,807.10	0.52
28	000988	华工科技	6,900	1,273,809.00	0.52
29	688981	中芯国际	8,008	1,271,830.56	0.52
30	000651	格力电器	32,900	1,233,750.00	0.50
31	300857	协创数据	3,500	1,189,650.00	0.48
32	688012	中微公司	2,434	1,140,329.00	0.46
33	600183	生益科技	6,500	1,127,100.00	0.46
34	300054	鼎龙股份	10,600	1,123,282.00	0.46
35	601166	兴业银行	67,571	1,118,975.76	0.46
36	600584	长电科技	10,700	1,107,985.00	0.45
37	000977	浪潮信息	15,500	1,085,000.00	0.44
38	600999	招商证券	51,100	1,078,210.00	0.44
39	688041	海光信息	2,909	1,077,202.70	0.44
40	601985	中国核电	119,100	1,075,473.00	0.44
41	001389	广合科技	4,500	1,067,625.00	0.43
42	002353	杰瑞股份	6,938	1,058,045.00	0.43
43	301308	江波龙	1,500	1,055,700.00	0.43
44	002851	麦格米特	6,200	1,036,516.00	0.42
45	688396	华润微	10,406	1,015,105.30	0.41
46	002049	紫光国微	11,400	1,011,750.00	0.41
47	600460	士兰微	18,500	1,011,210.00	0.41
48	002436	兴森科技	19,800	1,008,810.00	0.41
49	605117	德业股份	9,500	1,008,710.00	0.41
50	002916	深南电路	2,200	1,007,380.00	0.41
51	300373	扬杰科技	6,400	1,006,272.00	0.41
52	300661	圣邦股份	7,000	1,004,360.00	0.41
53	688002	睿创微纳	6,319	977,486.11	0.40
54	002281	光迅科技	3,800	976,372.00	0.40
55	300223	北京君正	3,900	970,710.00	0.40
56	300274	阳光电源	6,100	970,022.00	0.39
57	601138	工业富联	13,300	959,595.00	0.39
58	601009	南京银行	95,600	945,484.00	0.39
59	601688	华泰证券	45,800	944,396.00	0.38
60	000408	藏格矿业	13,300	921,956.00	0.38
61	002273	水晶光电	25,414	901,688.72	0.37
62	300476	胜宏科技	2,600	900,718.00	0.37
63	300475	香农芯创	3,000	900,000.00	0.37
64	600498	烽火通信	12,145	893,872.00	0.36

65	688361	中科飞测	2,011	864,730.00	0.35
66	600875	东方电气	29,400	845,838.00	0.34
67	601825	沪农商行	111,900	838,131.00	0.34
68	600497	驰宏锌锗	68,000	823,480.00	0.34
69	603993	洛阳钼业	46,900	823,095.00	0.34
70	002409	雅克科技	3,600	808,200.00	0.33
71	601077	渝农商行	130,000	794,300.00	0.32
72	000166	申万宏源	179,751	790,904.40	0.32
73	600674	川投能源	55,800	790,686.00	0.32
74	002027	分众传媒	161,800	783,112.00	0.32
75	002138	顺络电子	10,700	782,170.00	0.32
76	601916	浙商银行	297,400	782,162.00	0.32
77	600105	永鼎股份	11,500	776,020.00	0.32
78	600909	华安证券	69,420	771,256.20	0.31
79	600926	杭州银行	53,300	770,185.00	0.31
80	002179	中航光电	16,600	766,920.00	0.31
81	002028	思源电气	4,417	764,141.00	0.31
82	600585	海螺水泥	44,600	755,970.00	0.31
83	601665	齐鲁银行	131,000	755,870.00	0.31
84	688498	源杰科技	400	754,400.00	0.31
85	300059	东方财富	36,994	753,937.72	0.31
86	600809	山西汾酒	6,834	747,434.58	0.30
87	300628	亿联网络	22,100	747,422.00	0.30
88	002460	赣锋锂业	11,400	745,560.00	0.30
89	603799	华友钴业	14,907	719,411.82	0.29
90	600549	厦门钨业	8,400	715,680.00	0.29
91	688521	芯原股份	1,917	711,475.38	0.29
92	601000	唐山港	171,400	711,310.00	0.29
93	600027	华电国际	159,400	709,330.00	0.29
94	002466	天齐锂业	11,500	705,180.00	0.29
95	002266	浙富控股	139,300	704,858.00	0.29
96	601018	宁波港	223,500	704,025.00	0.29
97	600522	中天科技	11,600	703,888.00	0.29
98	300124	汇川技术	10,402	689,964.66	0.28
99	000708	中信特钢	54,000	681,480.00	0.28
100	000598	兴蓉环境	105,200	675,384.00	0.28
101	000683	博源化工	117,100	674,496.00	0.27
102	605499	东鹏饮料	5,400	666,522.00	0.27
103	002850	科达利	3,500	662,550.00	0.27
104	600795	国电电力	140,453	655,915.51	0.27
105	603833	欧派家居	21,740	654,591.40	0.27
106	688052	纳芯微	2,244	646,967.64	0.26
107	603893	瑞芯微	3,400	640,424.00	0.26

108	600482	中国动力	19,400	636,320.00	0.26
109	600066	宇通客车	23,634	633,627.54	0.26
110	688301	奕瑞科技	5,094	631,656.00	0.26
111	600563	法拉电子	3,300	629,640.00	0.26
112	000807	云铝股份	28,400	628,776.00	0.26
113	002594	比亚迪	7,800	621,660.00	0.25
114	600886	国投电力	46,500	618,915.00	0.25
115	601398	工商银行	86,800	613,676.00	0.25
116	603156	养元饮品	12,500	613,375.00	0.25
117	000157	中联重科	87,535	610,118.95	0.25
118	301536	星宸科技	4,700	604,937.00	0.25
119	003816	中国广核	154,500	604,095.00	0.25
120	600233	圆通速递	37,900	596,925.00	0.24
121	601872	招商轮船	33,800	593,866.00	0.24
122	002966	苏州银行	84,900	590,904.00	0.24
123	002532	天山铝业	54,800	588,004.00	0.24
124	000568	泸州老窖	7,534	584,035.68	0.24
125	000895	双汇发展	25,650	574,560.00	0.23
126	000975	山金国际	33,645	571,965.00	0.23
127	600276	恒瑞医药	10,802	562,136.08	0.23
128	000596	古井贡酒	7,008	559,238.40	0.23
129	300285	国瓷材料	5,400	557,172.00	0.23
130	300567	精测电子	1,700	539,920.00	0.22
131	603688	石英股份	6,500	536,965.00	0.22
132	000032	深桑达A	21,500	536,425.00	0.22
133	300498	温氏股份	43,000	529,760.00	0.22
134	600901	江苏金租	90,700	521,525.00	0.21
135	603816	顾家家居	23,300	520,988.00	0.21
136	000951	中国重汽	26,600	518,966.00	0.21
137	000415	渤海租赁	126,600	515,262.00	0.21
138	000938	紫光股份	17,802	513,765.72	0.21
139	600398	海澜之家	98,100	513,063.00	0.21
140	688019	安集科技	1,505	510,887.30	0.21
141	600153	建发股份	64,300	509,899.00	0.21
142	600282	南钢股份	110,900	509,031.00	0.21
143	600941	中国移动	5,900	508,167.00	0.21
144	601298	青岛港	62,500	503,125.00	0.20
145	601880	辽港股份	363,500	501,630.00	0.20
146	601156	东航物流	31,100	501,332.00	0.20
147	600660	福耀玻璃	9,900	499,356.00	0.20
148	601211	国泰海通	27,400	498,680.00	0.20
149	002299	圣农发展	32,100	486,636.00	0.20
150	002600	领益智造	27,700	480,318.00	0.20

151	300666	江丰电子	1,300	479,180.00	0.20
152	688469	芯联集成	44,830	475,646.30	0.19
153	600968	海油发展	141,700	471,861.00	0.19
154	000792	盐湖股份	15,600	470,964.00	0.19
155	601006	大秦铁路	100,228	462,051.08	0.19
156	600566	济川药业	20,800	461,552.00	0.19
157	600141	兴发集团	9,700	455,609.00	0.19
158	600489	中金黄金	25,213	455,094.65	0.19
159	300395	菲利华	3,400	454,682.00	0.19
160	600019	宝钢股份	83,359	452,639.37	0.18
161	600426	华鲁恒升	18,900	452,088.00	0.18
162	002821	凯莱英	2,780	450,360.00	0.18
163	000776	广发证券	19,200	449,280.00	0.18
164	601838	成都银行	25,333	448,394.10	0.18
165	601995	中金公司	12,300	444,645.00	0.18
166	002422	科伦药业	11,500	442,980.00	0.18
167	002185	华天科技	19,800	441,738.00	0.18
168	000630	铜陵有色	69,300	440,748.00	0.18
169	002738	中矿资源	7,400	436,526.00	0.18
170	688120	华海清科	1,351	435,265.18	0.18
171	600011	华能国际	55,900	424,281.00	0.17
172	002001	新 和 成	14,800	420,616.00	0.17
173	600392	盛和资源	14,000	416,780.00	0.17
174	600483	福能股份	40,900	416,771.00	0.17
175	688187	时代电气	6,031	414,088.46	0.17
176	002444	巨星科技	13,100	407,410.00	0.17
177	601108	财通证券	47,000	406,550.00	0.17
178	600816	建元信托	165,300	403,332.00	0.16
179	603290	斯达半导	2,600	397,644.00	0.16
180	601456	国联民生	44,600	394,264.00	0.16
181	300001	特锐德	10,400	393,432.00	0.16
182	000423	东阿阿胶	8,600	390,096.00	0.16
183	300548	长芯博创	1,400	389,200.00	0.16
184	002487	大金重工	6,700	388,399.00	0.16
185	001979	招商蛇口	59,100	380,013.00	0.15
186	300604	长川科技	1,100	375,562.00	0.15
187	603766	隆鑫通用	31,400	374,602.00	0.15
188	300012	华测检测	27,000	374,220.00	0.15
189	600177	雅戈尔	49,200	370,476.00	0.15
190	601988	中国银行	64,738	370,301.36	0.15
191	000623	吉林敖东	20,700	367,011.00	0.15
192	603345	安井食品	4,500	360,855.00	0.15
193	000893	亚钾国际	8,800	359,832.00	0.15

194	601865	福莱特	34,200	359,442.00	0.15
195	300432	富临精工	17,600	353,584.00	0.14
196	001965	招商公路	38,400	351,744.00	0.14
197	002025	航天电器	4,600	350,612.00	0.14
198	600803	新奥股份	22,100	349,180.00	0.14
199	601288	农业银行	56,500	342,955.00	0.14
200	601816	京沪高铁	75,700	342,921.00	0.14
201	601966	玲珑轮胎	33,100	337,289.00	0.14
202	600938	中国海油	12,402	336,714.30	0.14
203	603565	中谷物流	34,100	334,521.00	0.14
204	000932	华菱钢铁	96,100	333,467.00	0.14
205	001286	陕西能源	31,500	319,410.00	0.13
206	002008	大族激光	2,121	318,383.31	0.13
207	601857	中国石油	36,500	316,820.00	0.13
208	601598	中国外运	62,800	311,488.00	0.13
209	601601	中国太保	10,900	310,868.00	0.13
210	002714	牧原股份	8,800	307,912.00	0.13
211	600292	电投水电	24,500	294,980.00	0.12
212	002142	宁波银行	9,800	290,962.00	0.12
213	601128	常熟银行	49,910	290,476.20	0.12
214	000001	平安银行	28,800	289,440.00	0.12
215	688702	盛科通信	732	285,472.68	0.12
216	601668	中国建筑	65,600	284,704.00	0.12
217	000657	中钨高新	2,900	277,588.00	0.11
218	601229	上海银行	31,469	273,150.92	0.11
219	002352	顺丰控股	8,600	268,836.00	0.11
220	300346	南大光电	2,900	268,685.00	0.11
221	603256	宏和科技	1,000	265,330.00	0.11
222	000425	徐工机械	32,700	264,543.00	0.11
223	601225	陕西煤业	12,992	264,387.20	0.11
224	002938	鹏鼎控股	2,500	263,450.00	0.11
225	300751	迈为股份	900	254,214.00	0.10
226	600871	石化油服	123,800	251,314.00	0.10
227	601766	中国中车	48,100	250,120.00	0.10
228	605358	立昂微	3,200	248,320.00	0.10
229	300757	罗博特科	400	247,600.00	0.10
230	600988	赤峰黄金	9,400	247,408.00	0.10
231	601127	赛力斯	3,900	238,875.00	0.10
232	600601	方正科技	17,200	238,048.00	0.10
233	603650	彤程新材	2,400	235,152.00	0.10
234	000060	中金岭南	30,900	233,913.00	0.10
235	600893	航发动力	6,026	231,036.84	0.09
236	000039	中集集团	28,300	229,513.00	0.09

237	600885	宏发股份	6,600	227,634.00	0.09
238	002311	海大集团	5,100	227,511.00	0.09
239	300620	光库科技	600	226,920.00	0.09
240	000538	云南白药	4,700	222,639.00	0.09
241	688213	思特威	2,066	221,206.62	0.09
242	301377	鼎泰高科	400	220,360.00	0.09
243	300316	晶盛机电	3,600	217,440.00	0.09
244	601390	中国中铁	52,100	217,257.00	0.09
245	300458	全志科技	5,500	217,030.00	0.09
246	002236	大华股份	13,149	216,827.01	0.09
247	000831	中国稀土	3,900	216,411.00	0.09
248	002056	横店东磁	7,036	214,457.28	0.09
249	002812	恩捷股份	3,200	214,112.00	0.09
250	000960	锡业股份	5,000	213,450.00	0.09
251	600547	山东黄金	9,200	212,428.00	0.09
252	688582	芯动联科	3,256	211,640.00	0.09
253	688200	华峰测控	400	210,040.00	0.09
254	600438	通威股份	17,300	209,503.00	0.09
255	600352	浙江龙盛	17,100	207,081.00	0.08
256	600009	上海机场	8,904	205,682.40	0.08
257	688027	国盾量子	408	205,636.08	0.08
258	688322	奥比中光	1,572	205,224.60	0.08
259	688676	金盘科技	2,411	204,067.04	0.08
260	003031	中瓷电子	1,100	198,330.00	0.08
261	002271	东方雨虹	16,700	198,229.00	0.08
262	300570	太辰光	800	197,368.00	0.08
263	002648	卫星化学	8,400	197,316.00	0.08
264	301358	湖南裕能	2,600	197,262.00	0.08
265	000783	长江证券	20,200	196,950.00	0.08
266	603806	福斯特	11,600	194,764.00	0.08
267	601186	中国铁建	32,700	194,565.00	0.08
268	000733	振华科技	3,400	192,576.00	0.08
269	300803	指南针	2,100	192,507.00	0.08
270	002155	湖南黄金	7,940	189,527.80	0.08
271	601991	大唐发电	26,700	189,036.00	0.08
272	600023	浙能电力	35,500	186,730.00	0.08
273	000786	北新建材	10,300	186,327.00	0.08
274	601555	东吴证券	23,500	186,120.00	0.08
275	002493	荣盛石化	17,300	185,975.00	0.08
276	601012	隆基绿能	14,148	185,621.76	0.08
277	600918	中泰证券	34,800	185,136.00	0.08
278	600741	华域汽车	11,900	184,688.00	0.08
279	002841	视源股份	5,300	183,009.00	0.07

280	601607	上海医药	11,837	182,289.80	0.07
281	600369	西南证券	45,300	182,106.00	0.07
282	603308	应流股份	3,000	181,200.00	0.07
283	002429	兆驰股份	17,300	179,747.00	0.07
284	000703	恒逸石化	13,200	179,124.00	0.07
285	601898	中煤能源	14,700	179,046.00	0.07
286	600332	白云山	8,900	178,356.00	0.07
287	000739	普洛药业	10,700	178,262.00	0.07
288	601901	方正证券	24,504	176,428.80	0.07
289	688017	绿的谐波	422	176,336.92	0.07
290	002756	永兴材料	3,100	175,584.00	0.07
290	600704	物产中大	37,200	175,584.00	0.07
291	601212	白银有色	34,500	175,260.00	0.07
292	600820	隧道股份	33,600	175,056.00	0.07
293	000983	山西焦煤	29,700	172,260.00	0.07
294	600985	淮北矿业	12,200	171,410.00	0.07
295	000088	盐 田 港	41,900	171,371.00	0.07
296	601098	中南传媒	17,400	171,216.00	0.07
297	603737	三棵树	7,100	171,110.00	0.07
298	600578	京能电力	26,500	170,925.00	0.07
299	002064	华峰化学	18,000	170,820.00	0.07
299	603858	步长制药	11,700	170,820.00	0.07
300	603939	益丰药房	9,500	170,810.00	0.07
301	000429	粤高速A	12,500	170,625.00	0.07
301	300919	中伟新材	3,900	170,625.00	0.07
302	600295	鄂尔多斯	15,800	169,376.00	0.07
303	000987	越秀资本	21,600	168,912.00	0.07
304	600377	宁沪高速	14,500	167,765.00	0.07
305	000709	河钢股份	86,447	167,707.18	0.07
306	600517	国网英大	35,800	167,544.00	0.07
307	600026	中远海能	9,300	166,842.00	0.07
308	002032	苏 泊 尔	4,200	166,320.00	0.07
309	601699	潞安环能	11,600	165,648.00	0.07
310	603233	大参林	11,000	165,330.00	0.07
311	603979	金诚信	2,800	165,284.00	0.07
312	600970	中材国际	22,800	162,564.00	0.07
313	600801	华新建材	10,343	161,350.80	0.07
314	600927	永安期货	12,800	159,360.00	0.06
315	601019	山东出版	24,800	158,720.00	0.06
316	601228	广州港	54,900	154,818.00	0.06
317	600098	广州发展	26,000	153,660.00	0.06
318	000858	五 粮 液	1,998	147,852.00	0.06
319	600598	北大荒	12,400	134,416.00	0.05

320	601577	长沙银行	14,000	121,940.00	0.05
321	001221	悍高集团	3,029	121,826.38	0.05
322	001309	德明利	100	94,290.00	0.04
323	688349	三一重能	5,553	84,294.54	0.03
324	688082	盛美上海	180	77,760.00	0.03
325	601878	浙商证券	7,400	70,300.00	0.03
326	600989	宝丰能源	3,400	69,122.00	0.03
327	002500	山西证券	12,700	65,532.00	0.03
328	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.02
329	002152	广电运通	5,750	53,935.00	0.02
330	688347	华虹宏力	127	42,710.10	0.02
331	688617	惠泰医疗	196	35,585.76	0.01
332	688188	柏楚电子	270	28,809.00	0.01
333	000100	TCL科技	4,800	27,936.00	0.01
334	002837	英维克	340	27,050.40	0.01
335	688629	华丰科技	134	25,126.34	0.01
336	301526	国际复材	500	23,335.00	0.01
337	688375	国博电子	209	21,798.70	0.01
338	002415	海康威视	600	20,520.00	0.01
339	688578	艾力斯	178	19,437.60	0.01
340	688266	泽璟制药	153	17,848.98	0.01
341	688248	南网科技	241	16,672.38	0.01
342	688234	天岳先进	94	16,309.94	0.01
343	688183	生益电子	121	16,020.40	0.01
344	688169	石头科技	160	15,195.20	0.01
345	000063	中兴通讯	400	14,476.00	0.01
346	601100	恒立液压	100	10,756.00	0.00
347	600160	巨化股份	200	10,602.00	0.00
348	688295	中复神鹰	162	9,807.48	0.00
349	300033	同花顺	40	9,640.00	0.00
350	688065	凯赛生物	195	9,330.75	0.00
351	300763	锦浪科技	100	9,035.00	0.00
352	600905	三峡能源	2,400	8,904.00	0.00
353	688385	复旦微电	121	8,626.09	0.00
354	688563	航材股份	164	8,401.72	0.00
355	688692	达梦数据	34	8,305.86	0.00
356	603885	吉祥航空	800	8,232.00	0.00
357	688018	乐鑫科技	64	8,186.88	0.00
358	688608	恒玄科技	47	7,857.93	0.00
359	600378	昊华科技	100	7,538.00	0.00
360	688568	中科星图	174	7,215.78	0.00
361	688278	特宝生物	120	6,528.00	0.00
362	300014	亿纬锂能	100	6,503.00	0.00

363	688220	翱捷科技	52	6,464.64	0.00
364	000021	深科技	100	6,427.00	0.00
365	689009	九号公司	166	6,332.90	0.00
366	300487	蓝晓科技	100	5,885.00	0.00
367	688172	燕东微	70	5,856.20	0.00
368	688235	百济神州	23	5,856.03	0.00
369	600754	锦江酒店	300	5,397.00	0.00
370	300433	蓝思科技	100	5,366.00	0.00
371	688336	三生国健	96	5,097.60	0.00
372	688475	萤石网络	179	4,895.65	0.00
373	600018	上港集团	1,000	4,720.00	0.00
374	688111	金山办公	22	4,687.10	0.00
375	300623	捷捷微电	100	4,499.00	0.00
376	002120	韵达股份	700	4,452.00	0.00
377	600025	华能水电	500	4,445.00	0.00
378	600515	海南机场	1,500	4,110.00	0.00
379	600166	福田汽车	1,400	4,074.00	0.00
380	300450	先导智能	100	4,072.00	0.00
381	688318	财富趋势	57	4,064.67	0.00
382	300418	昆仑万维	100	4,036.00	0.00
383	002414	高德红外	300	3,978.00	0.00
384	601088	中国神华	100	3,904.00	0.00
385	688819	天能股份	173	3,840.60	0.00
386	688114	华大智造	75	3,831.00	0.00
387	688126	沪硅产业	90	3,590.10	0.00
388	601112	振石股份	194	3,408.58	0.00
389	688561	奇安信	131	3,141.38	0.00
390	688271	联影医疗	30	3,036.90	0.00
391	601117	中国化学	400	2,940.00	0.00
392	601958	金钼股份	100	2,811.00	0.00
393	688387	信科移动	141	2,797.44	0.00
394	688047	龙芯中科	18	2,784.06	0.00
395	600048	保利发展	600	2,778.00	0.00
396	002558	巨人网络	100	2,756.00	0.00
397	601238	广汽集团	500	2,540.00	0.00
398	688615	合合信息	22	2,488.20	0.00
399	002318	久立特材	100	2,390.00	0.00
400	603568	伟明环保	140	2,153.20	0.00
401	601666	平煤股份	300	2,145.00	0.00
402	688036	传音控股	35	2,063.25	0.00
403	688281	华秦科技	41	2,059.43	0.00
404	001386	马可波罗	136	1,925.76	0.00
405	688303	大全能源	107	1,865.01	0.00

406	600188	兖矿能源	100	1,777.00	0.00
407	600346	恒力石化	100	1,771.00	0.00
408	600031	三一重工	100	1,728.00	0.00
409	002517	恺英网络	100	1,625.00	0.00
410	688472	阿特斯	150	1,623.00	0.00
411	601059	信达证券	100	1,619.00	0.00
412	600362	江西铜业	35	1,515.50	0.00
413	601567	三星电气	100	1,494.00	0.00
414	600008	首创环保	535	1,455.20	0.00
415	601136	首创证券	100	1,395.00	0.00
416	601198	东兴证券	100	1,359.00	0.00
417	688166	博瑞医药	38	1,330.38	0.00
418	601919	中远海控	100	1,326.00	0.00
419	688772	珠海冠宇	67	1,315.21	0.00
420	002984	森麒麟	100	1,307.00	0.00
421	002078	太阳纸业	100	1,249.00	0.00
422	002624	完美世界	100	1,242.00	0.00
423	688778	厦钨新能	22	1,196.80	0.00
424	601058	赛轮轮胎	100	1,153.00	0.00
425	000301	东方盛虹	100	1,145.00	0.00
426	688099	晶晨股份	10	1,029.00	0.00
427	002736	国信证券	100	999.00	0.00
428	002739	儒意电影	100	960.00	0.00
429	688363	华熙生物	26	930.02	0.00
430	688728	格科微	44	925.76	0.00
431	688223	晶科能源	194	921.50	0.00
432	688599	天合光能	65	917.80	0.00
433	601928	凤凰传媒	100	879.00	0.00
434	600642	申能股份	100	873.00	0.00
435	688180	君实生物	25	845.50	0.00
436	603606	东方电缆	20	830.20	0.00
437	600085	同仁堂	34	785.74	0.00
438	688009	中国通号	165	785.40	0.00
439	600299	安迪苏	100	785.00	0.00
440	600039	四川路桥	100	782.00	0.00
441	688425	铁建重工	182	731.64	0.00
442	002065	东华软件	100	714.00	0.00
443	601319	中国人保	100	676.00	0.00
444	601888	中国中免	12	644.52	0.00
445	688709	成都华微	16	609.44	0.00
446	601728	中国电信	100	519.00	0.00
447	601997	贵阳银行	100	513.00	0.00
448	600583	海油工程	100	503.00	0.00

449	601658	邮储银行	100	493.00	0.00
450	600028	中国石化	100	446.00	0.00
451	688192	迪哲医药	9	359.37	0.00
452	600143	金发科技	21	324.45	0.00
453	688538	和辉光电	115	299.00	0.00
454	601818	光大银行	100	289.00	0.00
455	600808	马钢股份	100	250.00	0.00
456	600000	浦发银行	25	215.25	0.00
457	002797	第一创业	20	131.40	0.00
458	688777	中控技术	1	117.50	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	688783	西安奕材	8,710	499,083.00	0.20
2	688795	摩尔线程	738	498,696.12	0.20
3	301666	大普微	314	179,604.86	0.07
4	688808	联讯仪器	54	112,679.64	0.05
5	001248	华润新能源	10,597	107,135.67	0.04
6	688781	视涯科技	1,923	90,034.86	0.04
7	688820	盛合晶微	304	51,926.24	0.02
8	688525	佰维存储	93	46,009.89	0.02
9	688818	电科蓝天	617	43,245.53	0.02
10	688809	强一股份	61	38,003.00	0.02
11	688712	北芯生命	858	30,802.20	0.01
12	301682	宏明电子	191	30,548.54	0.01
13	688813	泰金新能	158	28,877.66	0.01
14	688785	恒运昌	52	24,053.12	0.01
15	001257	盛龙股份	864	21,841.92	0.01
16	000933	神火股份	1,000	21,200.00	0.01
17	688796	百奥赛图	183	20,020.20	0.01
18	688811	有研复材	654	18,148.50	0.01
19	301696	三瑞智能	132	13,833.60	0.01
20	601168	西部矿业	500	13,570.00	0.01
21	603459	红板科技	136	13,567.36	0.01
22	301687	新广益	162	12,431.88	0.01
23	300782	卓胜微	100	10,958.00	0.00
24	600487	亨通光电	100	10,934.00	0.00
25	688249	晶合集成	153	9,031.59	0.00
26	002080	中材科技	100	9,000.00	0.00
27	301513	尚水智能	136	8,627.84	0.00
28	301680	固德电材	68	7,624.84	0.00
29	002156	通富微电	100	7,587.00	0.00
30	000426	兴业银锡	200	6,592.00	0.00

31	301683	慧谷新材	46	5,946.42	0.00
32	688816	易思维	86	4,908.88	0.00
33	001369	双欣材料	335	4,529.20	0.00
34	603195	公牛集团	100	3,915.00	0.00
35	600673	东阳光	100	3,358.00	0.00
36	601231	环旭电子	100	3,240.00	0.00
37	600096	云天化	100	3,040.00	0.00
38	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
39	603352	至信股份	69	1,759.50	0.00
40	688805	健信超导	36	1,690.92	0.00
41	001220	世盟股份	54	1,499.58	0.00
42	603284	林平发展	42	1,464.12	0.00
43	603293	埃泰克	38	1,461.10	0.00
44	001312	福恩股份	77	1,401.40	0.00
45	301575	艾芬达	36	965.16	0.00
46	601918	新集能源	100	859.00	0.00
47	002372	伟星新材	100	819.00	0.00
48	688153	唯捷创芯	25	803.00	0.00
49	601921	浙版传媒	100	669.00	0.00
50	601333	广深铁路	100	275.00	0.00
51	601026	道生天合	14	204.12	0.00
52	002459	晶澳科技	12	97.20	0.00
53	688100	威胜信息	3	91.77	0.00
54	603707	健友股份	11	77.77	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	300502	新易盛	13,870,215.00	6.94
2	600036	招商银行	13,835,900.99	6.93
3	300308	中际旭创	12,262,958.00	6.14
4	600030	中信证券	11,116,726.00	5.57
5	601899	紫金矿业	10,792,749.00	5.40
6	300750	宁德时代	10,777,581.00	5.40
7	000333	美的集团	10,142,307.80	5.08
8	600519	贵州茅台	9,864,300.00	4.94
9	600487	亨通光电	9,756,000.00	4.88
10	002475	立讯精密	9,687,798.00	4.85
11	688012	中微公司	9,382,279.28	4.70
12	688981	中芯国际	9,372,119.97	4.69
13	300124	汇川技术	9,226,016.00	4.62
14	600188	兖矿能源	8,661,915.50	4.34
15	601318	中国平安	8,481,222.00	4.25

16	601838	成都银行	8,478,704.00	4.24
17	300857	协创数据	8,426,429.40	4.22
18	300394	天孚通信	8,383,242.00	4.20
19	000338	潍柴动力	8,323,756.00	4.17
20	601555	东吴证券	8,089,237.00	4.05
21	603799	华友钴业	7,984,319.00	4.00
22	000725	京东方A	7,953,532.00	3.98
23	600919	江苏银行	7,944,897.00	3.98
24	600900	长江电力	7,940,197.00	3.98
25	002648	卫星化学	7,882,708.00	3.95
26	300014	亿纬锂能	7,876,585.42	3.94
27	600026	中远海能	7,869,573.00	3.94
28	000009	中国宝安	7,825,443.00	3.92
29	601668	中国建筑	7,814,959.00	3.91
30	002028	思源电气	7,796,400.00	3.90
31	600150	中国船舶	7,793,444.39	3.90
32	600309	万华化学	7,791,230.00	3.90
33	600482	中国动力	7,614,809.00	3.81
34	603259	药明康德	7,576,614.00	3.79
35	002384	东山精密	7,492,255.00	3.75
36	601872	招商轮船	7,458,506.00	3.73
37	601398	工商银行	7,450,815.00	3.73
38	300274	阳光电源	7,431,613.00	3.72
39	002493	荣盛石化	7,327,475.00	3.67
40	600362	江西铜业	7,274,553.00	3.64
41	601088	中国神华	7,255,844.00	3.63
42	601166	兴业银行	7,217,512.00	3.61
43	688008	澜起科技	7,187,271.22	3.60
44	600522	中天科技	7,148,033.00	3.58
45	600926	杭州银行	7,146,255.00	3.58
46	001979	招商蛇口	7,093,721.00	3.55
47	002594	比亚迪	7,079,232.00	3.54
48	002415	海康威视	7,037,834.00	3.52
49	600887	伊利股份	6,994,891.22	3.50
50	601816	京沪高铁	6,976,630.00	3.49
51	000933	神火股份	6,853,161.00	3.43
52	601688	华泰证券	6,839,495.00	3.42
53	000063	中兴通讯	6,834,897.00	3.42
54	600938	中国海油	6,801,793.00	3.41
55	002371	北方华创	6,768,396.00	3.39
56	000001	平安银行	6,738,156.00	3.37
57	601211	国泰海通	6,681,011.00	3.34
58	600893	航发动力	6,605,604.00	3.31

59	600066	宇通客车	6,602,611.49	3.31
60	688120	华海清科	6,600,907.99	3.30
61	300347	泰格医药	6,526,461.00	3.27
62	002152	广电运通	6,488,142.00	3.25
63	603986	兆易创新	6,437,117.00	3.22
64	002851	麦格米特	6,425,768.00	3.22
65	300498	温氏股份	6,373,485.00	3.19
66	000651	格力电器	6,348,131.96	3.18
67	601225	陕西煤业	6,327,439.40	3.17
68	600739	辽宁成大	6,304,707.00	3.16
69	688777	中控技术	6,303,702.74	3.16
70	000975	山金国际	6,262,358.00	3.14
71	600096	云天化	6,244,681.00	3.13
72	300628	亿联网络	6,200,597.00	3.10
73	600019	宝钢股份	6,194,207.00	3.10
74	601077	渝农商行	6,191,223.00	3.10
75	688525	佰维存储	6,188,828.73	3.10
76	600660	福耀玻璃	6,179,810.70	3.09
77	300418	昆仑万维	6,170,280.00	3.09
78	600989	宝丰能源	6,145,678.00	3.08
79	002532	天山铝业	6,128,790.00	3.07
80	000792	盐湖股份	6,100,304.00	3.05
81	002340	格林美	6,025,815.00	3.02
82	300433	蓝思科技	6,022,007.00	3.01
83	601825	沪农商行	5,987,541.00	3.00
84	600183	生益科技	5,984,389.00	3.00
85	601601	中国太保	5,964,427.00	2.99
86	600426	华鲁恒升	5,927,311.00	2.97
87	603993	洛阳钼业	5,918,271.00	2.96
88	600584	长电科技	5,863,610.00	2.94
89	000415	渤海租赁	5,849,950.00	2.93
90	000776	广发证券	5,794,186.29	2.90
91	002049	紫光国微	5,765,616.00	2.89
92	002156	通富微电	5,729,639.06	2.87
93	600219	南山铝业	5,728,065.00	2.87
94	300136	信维通信	5,697,056.27	2.85
95	002966	苏州银行	5,657,674.00	2.83
96	000166	申万宏源	5,651,383.00	2.83
97	600988	赤峰黄金	5,638,989.00	2.82
98	603019	中科曙光	5,635,996.20	2.82
99	002738	中矿资源	5,621,407.00	2.81
100	002001	新 和 成	5,620,940.00	2.81
101	601229	上海银行	5,575,550.00	2.79

102	002352	顺丰控股	5,524,135.00	2.77
103	000807	云铝股份	5,492,416.00	2.75
104	600489	中金黄金	5,489,421.00	2.75
105	000100	TCL科技	5,486,222.00	2.75
106	002230	科大讯飞	5,413,713.00	2.71
107	300408	三环集团	5,339,065.40	2.67
108	601138	工业富联	5,255,262.00	2.63
109	601328	交通银行	5,252,531.00	2.63
110	600999	招商证券	5,236,485.00	2.62
111	600039	四川路桥	5,216,613.00	2.61
112	300476	胜宏科技	5,201,299.00	2.60
113	002422	科伦药业	5,199,686.00	2.60
114	000157	中联重科	5,189,631.00	2.60
115	002821	凯莱英	5,187,690.20	2.60
116	002436	兴森科技	5,187,523.00	2.60
117	002027	分众传媒	5,155,110.80	2.58
118	600176	中国巨石	5,141,725.00	2.57
119	000938	紫光股份	5,129,805.00	2.57
120	002409	雅克科技	5,125,710.99	2.57
121	000960	锡业股份	5,076,314.00	2.54
122	000426	兴业银锡	5,070,068.79	2.54
123	688361	中科飞测	5,061,902.18	2.53
124	600941	中国移动	4,983,178.00	2.49
125	688256	寒武纪	4,979,813.44	2.49
126	002460	赣锋锂业	4,972,219.00	2.49
127	600795	国电电力	4,962,948.00	2.48
128	600160	巨化股份	4,961,727.00	2.48
129	600050	中国联通	4,933,674.00	2.47
130	601100	恒立液压	4,920,261.00	2.46
131	002064	华峰化学	4,873,298.00	2.44
132	603156	养元饮品	4,870,182.00	2.44
133	603288	海天味业	4,862,266.00	2.43
134	001389	广合科技	4,853,625.00	2.43
135	603806	福斯特	4,842,483.77	2.42
136	600406	国电南瑞	4,839,120.00	2.42
137	600875	东方电气	4,831,024.00	2.42
138	603296	华勤技术	4,825,403.00	2.42
139	000708	中信特钢	4,821,852.00	2.41
140	601061	中信金属	4,817,028.00	2.41
141	002138	顺络电子	4,793,040.00	2.40
142	002281	光迅科技	4,788,719.40	2.40
143	000657	中钨高新	4,761,454.00	2.38
144	300432	富临精工	4,748,957.00	2.38

145	002714	牧原股份	4,730,300.00	2.37
146	600141	兴发集团	4,709,618.60	2.36
147	601009	南京银行	4,700,975.00	2.35
148	688772	珠海冠宇	4,675,641.85	2.34
149	600025	华能水电	4,651,040.00	2.33
150	600497	驰宏锌锗	4,637,915.71	2.32
151	300751	迈为股份	4,609,989.00	2.31
152	688347	华虹宏力	4,596,777.24	2.30
153	601001	晋控煤业	4,593,428.00	2.30
154	601108	财通证券	4,582,309.00	2.29
155	601168	西部矿业	4,556,381.00	2.28
156	600352	浙江龙盛	4,554,256.00	2.28
157	600674	川投能源	4,553,120.00	2.28
158	601991	大唐发电	4,528,572.00	2.27
159	002008	大族激光	4,512,485.00	2.26
160	600801	华新建材	4,477,261.20	2.24
161	000408	藏格矿业	4,455,237.00	2.23
162	002736	国信证券	4,452,754.00	2.23
163	601288	农业银行	4,449,340.00	2.23
164	300604	长川科技	4,422,147.00	2.21
165	002236	大华股份	4,378,519.00	2.19
166	600023	浙能电力	4,347,857.00	2.18
167	600741	华域汽车	4,331,531.20	2.17
168	601689	拓普集团	4,317,813.00	2.16
169	300037	新宙邦	4,308,456.00	2.16
170	603345	安井食品	4,293,506.00	2.15
171	605117	德业股份	4,271,431.80	2.14
172	000932	华菱钢铁	4,234,487.00	2.12
173	688538	和辉光电	4,227,435.66	2.12
174	002050	三花智控	4,210,530.85	2.11
175	601179	中国西电	4,199,784.00	2.10
176	601233	桐昆股份	4,189,218.59	2.10
177	601728	中国电信	4,181,654.00	2.09
178	600111	北方稀土	4,157,741.85	2.08
179	002466	天齐锂业	4,155,698.50	2.08
180	002271	东方雨虹	4,150,870.00	2.08
181	601665	齐鲁银行	4,150,444.00	2.08
182	000630	铜陵有色	4,127,784.00	2.07
183	601231	环旭电子	4,127,481.00	2.07
184	600927	永安期货	4,094,459.00	2.05
185	600018	上港集团	4,081,788.00	2.04
186	600585	海螺水泥	4,080,891.00	2.04
187	688041	海光信息	4,075,652.67	2.04

188	002273	水晶光电	4,074,910.00	2.04
189	601598	中国外运	4,066,180.00	2.04
190	601985	中国核电	4,057,191.00	2.03
191	603766	隆鑫通用	4,050,665.00	2.03
192	600547	山东黄金	4,047,831.62	2.03
193	001286	陕西能源	4,017,917.00	2.01
194	000858	五 粮 液	4,003,608.97	2.00
195	600886	国投电力	3,996,940.00	2.00

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	12,872,487.60	6.44
2	600036	招商银行	12,657,541.38	6.34
3	600487	亨通光电	11,707,691.40	5.86
4	300750	宁德时代	11,442,987.00	5.73
5	600519	贵州茅台	11,016,637.43	5.52
6	601899	紫金矿业	10,970,566.10	5.49
7	300308	中际旭创	10,828,717.60	5.42
8	000333	美的集团	10,593,350.18	5.30
9	002475	立讯精密	10,239,496.40	5.13
10	600030	中信证券	9,820,520.00	4.92
11	688012	中微公司	9,713,867.39	4.86
12	600309	万华化学	9,170,599.14	4.59
13	601318	中国平安	9,004,430.01	4.51
14	688981	中芯国际	8,973,611.72	4.49
15	300124	汇川技术	8,878,309.00	4.44
16	600188	兖矿能源	8,819,362.60	4.42
17	600026	中远海能	8,371,832.00	4.19
18	601398	工商银行	8,263,618.24	4.14
19	601838	成都银行	8,188,154.00	4.10
20	000338	潍柴动力	8,176,660.64	4.09
21	601088	中国神华	8,141,666.40	4.08
22	300014	亿纬锂能	8,012,182.81	4.01
23	601555	东吴证券	7,954,939.44	3.98
24	000725	京东方Ａ	7,913,683.83	3.96
25	601166	兴业银行	7,896,903.00	3.95
26	601211	国泰海通	7,879,042.92	3.94
27	000009	中国宝安	7,858,852.21	3.93
28	300857	协创数据	7,803,750.00	3.91
29	002648	卫星化学	7,801,404.16	3.91
30	600938	中国海油	7,756,966.00	3.88
31	601668	中国建筑	7,725,453.93	3.87
32	002415	海康威视	7,718,520.03	3.86

33	603799	华友钴业	7,680,439.94	3.85
34	002384	东山精密	7,621,353.00	3.82
35	600482	中国动力	7,619,708.10	3.81
36	600926	杭州银行	7,593,473.00	3.80
37	002493	荣盛石化	7,569,277.50	3.79
38	300394	天孚通信	7,403,209.00	3.71
39	000933	神火股份	7,220,467.00	3.61
40	603259	药明康德	7,186,064.00	3.60
41	002594	比亚迪	7,172,938.96	3.59
42	000063	中兴通讯	7,166,426.32	3.59
43	001979	招商蛇口	7,134,355.08	3.57
44	601872	招商轮船	7,130,752.32	3.57
45	600900	长江电力	7,130,633.00	3.57
46	600362	江西铜业	7,113,022.36	3.56
47	600096	云天化	7,056,813.00	3.53
48	002028	思源电气	7,038,434.00	3.52
49	300274	阳光电源	7,012,256.12	3.51
50	600522	中天科技	6,965,428.00	3.49
51	600887	伊利股份	6,961,638.00	3.49
52	688525	佰维存储	6,929,705.68	3.47
53	000001	平安银行	6,883,649.57	3.45
54	300347	泰格医药	6,827,947.80	3.42
55	002156	通富微电	6,825,295.00	3.42
56	002371	北方华创	6,809,521.00	3.41
57	688120	华海清科	6,786,000.44	3.40
58	600739	辽宁成大	6,777,687.08	3.39
59	600919	江苏银行	6,742,070.00	3.38
60	601816	京沪高铁	6,735,208.00	3.37
61	002152	广电运通	6,652,554.00	3.33
62	601601	中国太保	6,603,493.00	3.31
63	603986	兆易创新	6,576,455.00	3.29
64	688777	中控技术	6,522,158.68	3.27
65	600893	航发动力	6,489,956.00	3.25
66	600989	宝丰能源	6,483,774.00	3.25
67	601225	陕西煤业	6,468,026.60	3.24
68	000100	TCL科技	6,437,566.15	3.22
69	603019	中科曙光	6,349,695.00	3.18
70	002340	格林美	6,322,691.00	3.17
71	601688	华泰证券	6,312,192.20	3.16
72	300418	昆仑万维	6,295,948.00	3.15
73	600019	宝钢股份	6,238,013.00	3.12
74	002001	新 和 成	6,164,073.20	3.09
75	600150	中国船舶	6,144,480.87	3.08

76	000792	盐湖股份	6,114,841.00	3.06
77	000415	渤海租赁	6,022,627.00	3.02
78	601229	上海银行	5,973,902.96	2.99
79	300433	蓝思科技	5,945,031.00	2.98
80	000651	格力电器	5,914,696.50	2.96
81	600660	福耀玻璃	5,904,878.95	2.96
82	000975	山金国际	5,836,756.00	2.92
83	300498	温氏股份	5,811,436.00	2.91
84	688008	澜起科技	5,797,036.43	2.90
85	600066	宇通客车	5,792,927.09	2.90
86	600183	生益科技	5,788,146.69	2.90
87	601077	渝农商行	5,784,108.00	2.90
88	600219	南山铝业	5,765,474.00	2.89
89	300136	信维通信	5,760,298.40	2.88
90	002008	大族激光	5,657,659.00	2.83
91	603993	洛阳钼业	5,605,351.48	2.81
92	300628	亿联网络	5,569,536.80	2.79
93	002851	麦格米特	5,557,142.00	2.78
94	600039	四川路桥	5,550,692.43	2.78
95	601288	农业银行	5,520,931.60	2.76
96	600406	国电南瑞	5,461,902.00	2.73
97	002532	天山铝业	5,457,463.00	2.73
98	300408	三环集团	5,454,834.50	2.73
99	000157	中联重科	5,437,104.99	2.72
100	600584	长电科技	5,396,184.30	2.70
101	601825	沪农商行	5,358,689.00	2.68
102	600160	巨化股份	5,336,197.03	2.67
103	600426	华鲁恒升	5,328,748.13	2.67
104	600176	中国巨石	5,280,219.08	2.64
105	600988	赤峰黄金	5,271,902.00	2.64
106	601168	西部矿业	5,268,488.45	2.64
107	002422	科伦药业	5,266,065.00	2.64
108	688347	华虹宏力	5,257,545.04	2.63
109	000776	广发证券	5,244,156.84	2.63
110	600050	中国联通	5,211,651.32	2.61
111	002738	中矿资源	5,196,898.00	2.60
112	002352	顺丰控股	5,180,705.00	2.59
113	600025	华能水电	5,161,804.00	2.58
114	002409	雅克科技	5,160,597.00	2.58
115	600795	国电电力	5,156,549.00	2.58
116	002230	科大讯飞	5,149,719.00	2.58
117	002966	苏州银行	5,147,359.39	2.58
118	000657	中钨高新	5,133,549.00	2.57

119	000426	兴业银锡	5,124,098.00	2.57
120	601100	恒立液压	5,100,275.32	2.55
121	603806	福斯特	5,099,323.50	2.55
122	601138	工业富联	5,092,127.12	2.55
123	601991	大唐发电	5,076,048.00	2.54
124	300604	长川科技	5,073,736.00	2.54
125	603296	华勤技术	5,063,397.60	2.53
126	600489	中金黄金	5,040,267.00	2.52
127	000807	云铝股份	4,988,005.00	2.50
128	000960	锡业股份	4,963,703.20	2.48
129	000938	紫光股份	4,963,349.00	2.48
130	688772	珠海冠宇	4,926,537.78	2.47
131	600941	中国移动	4,878,939.00	2.44
132	600023	浙能电力	4,861,850.00	2.43
133	300476	胜宏科技	4,858,128.55	2.43
134	002027	分众传媒	4,856,663.00	2.43
135	601061	中信金属	4,856,451.00	2.43
136	001389	广合科技	4,845,236.00	2.43
137	601001	晋控煤业	4,841,264.00	2.42
138	002281	光迅科技	4,834,405.51	2.42
139	601336	新华保险	4,810,066.24	2.41
140	601009	南京银行	4,807,935.18	2.41
141	688361	中科飞测	4,790,403.92	2.40
142	601328	交通银行	4,788,342.00	2.40
143	002049	紫光国微	4,778,877.00	2.39
144	002821	凯莱英	4,764,080.00	2.39
145	603288	海天味业	4,759,915.96	2.38
146	000166	申万宏源	4,754,677.00	2.38
147	601233	桐昆股份	4,753,400.00	2.38
148	601108	财通证券	4,732,277.80	2.37
149	600352	浙江龙盛	4,720,293.94	2.36
150	002436	兴森科技	4,694,058.17	2.35
151	002064	华峰化学	4,685,856.00	2.35
152	601728	中国电信	4,678,283.00	2.34
153	002236	大华股份	4,613,388.00	2.31
154	688256	寒武纪	4,536,602.22	2.27
155	601117	中国化学	4,479,990.00	2.24
156	300432	富临精工	4,466,900.00	2.24
157	600141	兴发集团	4,455,286.00	2.23
158	002714	牧原股份	4,449,854.70	2.23
159	000708	中信特钢	4,435,698.00	2.22
160	300037	新宙邦	4,428,656.40	2.22
161	002736	国信证券	4,416,984.00	2.21

162	600999	招商证券	4,402,558.00	2.20
163	002138	顺络电子	4,394,192.00	2.20
164	600875	东方电气	4,389,545.95	2.20
165	601689	拓普集团	4,384,190.70	2.19
166	600166	福田汽车	4,356,060.76	2.18
167	688538	和辉光电	4,331,580.47	2.17
168	300751	迈为股份	4,330,906.60	2.17
169	600690	海尔智家	4,322,930.80	2.16
170	001286	陕西能源	4,273,662.00	2.14
171	600111	北方稀土	4,242,884.51	2.12
172	603156	养元饮品	4,230,607.60	2.12
173	000858	五 粮 液	4,224,992.94	2.12
174	600801	华新建材	4,219,841.00	2.11
175	000932	华菱钢铁	4,206,256.00	2.11
176	002460	赣锋锂业	4,202,479.80	2.10
177	601179	中国西电	4,199,849.00	2.10
178	000623	吉林敖东	4,172,227.45	2.09
179	600018	上港集团	4,123,402.32	2.06
180	601128	常熟银行	4,103,203.94	2.05
181	601766	中国中车	4,080,499.10	2.04
182	600741	华域汽车	4,075,432.35	2.04
183	600497	驰宏锌锗	4,060,314.41	2.03
184	603345	安井食品	4,058,678.00	2.03
185	600031	三一重工	4,053,941.40	2.03
186	605117	德业股份	4,046,960.30	2.03
187	002050	三花智控	4,019,810.70	2.01
188	601918	新集能源	4,014,608.00	2.01
189	600276	恒瑞医药	4,009,163.00	2.01
190	601231	环旭电子	4,004,186.76	2.00
191	601615	明阳智能	4,002,602.00	2.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,094,523,516.29
卖出股票收入（成交）总额	2,103,313,182.37

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

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约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票，均为基金合同约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	65,550.36
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,004,113.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,069,663.39

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	688783	西安奕材	499,083.00	0.20	限售期锁定
2	688795	摩尔线程	498,696.12	0.20	限售期锁定
3	301666	大普微	179,604.86	0.07	限售期锁定
4	688808	联讯仪器	112,679.64	0.05	限售期锁定
5	001248	华润新能源	107,135.67	0.04	新股未上市

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（%）
5,801	18,750.17	68,217,261.98	62.72	40,552,500.13	37.28

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	6.73	0.0000

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	102,510,849.62
本报告期基金总申购份额	9,727,105.16
减：本报告期基金总赎回份额	3,468,192.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	108,769,762.11

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司 2026 年 1 月 13 日第九届董事会第十五次会议决议，公司副总经理郭堃同志不再担任公司高级管理人员。郭堃同志目前是公司“首席投研专家”，专注于投研工作。公司已按规定向相关监管机构报告并发布变更公告。

10.2.2 基金经理变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2026 年 6 月 8 日起，石晓冉同志担任长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理。

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容诚会计师事务所（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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国元证券	1	2,420,678,759.67	57.68	474,286.48	57.68	-
东北证券	1	1,776,228,642.15	42.32	347,973.16	42.32	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国元证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	37,488.62	100.00	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准

（1）具备监管机构规定的相关资质、财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力较强。

（2）具有较强的研究服务能力、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。

（3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要。

2、 交易单元的选择程序：

（1）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协议。

3、本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：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	2026 年 1 月 15 日
2	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	2026 年 1 月 15 日
3	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 15 日
4	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 22 日
5	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 1 月 22 日
6	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 3 月 28 日
7	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2025 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 3 月 28 日
8	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加易方达财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 15 日
9	长盛基金管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 日
10	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基	中国证监会指定披露媒	2026 年 4 月 22 日

	金（LOF）2026 年第 1 季度报告	介	
11	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加东莞农商行为销售机构并参加费率优惠的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 4 月 22 日
12	长盛基金管理有限公司关于调整长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 10 日
13	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	2026 年 6 月 11 日
14	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	2026 年 6 月 11 日
15	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加福克斯基金为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2026 年 6 月 24 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260101~20260630	43,585,927.77	-	-	43,585,927.77	40.07
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)相关批准文件；

2、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）招募说明书》；

5、法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司

2026年8月29日