

# 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 27 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 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 2019 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	57
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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	58
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>60</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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的情况.....	60
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>61</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	64
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>66</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.....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>67</b>
12.1 备查文件目录.....	67
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	长盛同庆
基金主代码	160806
交易代码	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	219,281,434.44 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 8 月 6 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内,年跟踪误差控制在 4%以内,以实现中证 800 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性,通过抽样方式构建基金股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%,且年化跟踪误差小于 4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×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	田青
	联系电话	010-86497608	010-67595096
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-86497888	010-67595096
传真		010-86497999	010-66275853
注册地址		深圳市福田区福中三路	北京市西城区金融大街 25 号

	诺德金融中心主楼 10D	
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	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	100029	100033
法定代表人	周兵	田国立

## 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》
登载基金半年度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>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,097,950.80
本期利润	33,847,212.72
加权平均基金份额本期利润	0.2567
本期加权平均净值利润率	19.30%
本期基金份额净值增长率	26.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	60,138,303.70
期末可供分配基金份额利润	0.2743
期末基金资产净值	294,359,749.81
期末基金份额净值	1.342
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-21.68%

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，基金转型日（即基金合同生效日）为 2015 年 5 月 22 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	5.09%	1.11%	4.08%	1.13%	1.01%	-0.02%
过去三个月	-0.91%	1.44%	-3.37%	1.49%	2.46%	-0.05%
过去六个月	26.35%	1.44%	23.79%	1.49%	2.56%	-0.05%
过去一年	10.11%	1.42%	5.34%	1.46%	4.77%	-0.04%
过去三年	17.87%	1.05%	8.92%	1.06%	8.95%	-0.01%
自基金转型起至今	-21.68%	1.63%	-27.55%	1.54%	5.87%	0.09%



注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

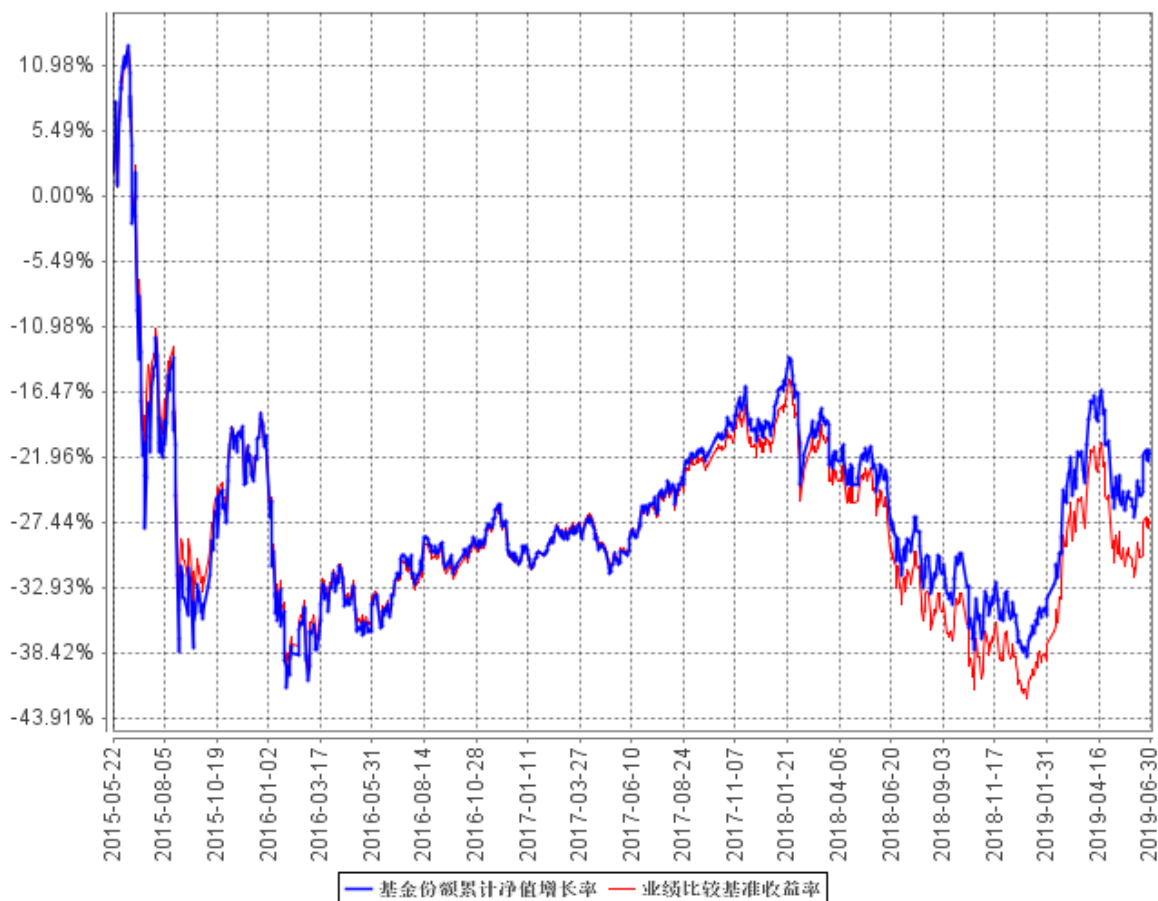
本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率 (税后)}$

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

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

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为 2015 年 5 月 22 日。

2、按照本基金合同规定，本基金将在基金合同生效 3 个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。截止本报告期末

本基金的各项资产配置比例符合本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，是国内最早成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金总部办公地位于北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，并拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用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。截至 2019 年 6 月 30 日，基金管理人共管理五十七只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

#### 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，长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理。	2019 年 5 月 30 日	-	10 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。
王超	本基金基金经理。	2015 年 5 月 22 日	2019 年 5 月 31 日	12 年	王超先生，硕士，CFA（特许金融分析师），FRM（金融风险管理师）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。目前已离任。

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”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相

关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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、特定客户资产管理组合等。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, 未发生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

2019 年一季度在流动性宽松以及 A 股市场整体估值处于历史低位的背景下,以社会融资数据大幅提升为契机,市场在短时间内快速上涨,完成风险溢价的修复。其后二季度在中美贸易冲突加剧以及对同业刚兑被打破的担忧下,市场先大幅下跌后有一定的反弹,投资者整体的风险偏好经历了快速上升至快速下降的过程;体现在风格上,超额收益贡献主要来源由一季度的小盘成长股切换为二季度的大盘价值股。

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 1.342 元;本报告期基金份额净值增长率为 26.35%,业绩比较基准收益率为 23.79%。本报告期内日均跟踪误差为 0.1155%,年度化跟踪误差为 1.8263%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,经济大概率继续筑底反复。在贸易战缓和、美联储降息预期大幅加强以及 OECD 外围国家开始降息的环境下,国内的风险偏好和风险溢价有望得到进一步的修复,对股市的估值起到支撑作用。尤其是在上半年的固定投资分项数据中,高科技服务业和高科技制造业的增速大幅超越平均水平,且科创板在三季度初开市,有利于高科技成长股的未来业绩增长,有助于修复对于高科技成长股的一致预期和风格偏好,对三季度我们保持谨慎的乐观。值得注意的是今年底明年初的国际政治环境有潜在风险,可能偏向于国际政治及经贸的局部区域化,对压低物价水平的生产供给侧和国际贸易流通存在不利因素,届时通胀有快速抬头的潜在风险,可能对市场的风险偏好和估值水平有明显的压制作用,需要投资者保持密切关注。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理(担任估值工作小组组长)、公司督察长(担任估值工作小组副组长)、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风

险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本基金于 2019 年 6 月 20 日进行了利润分配，分配金额为 13,449,247.16 元。

截至 2019 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 60,138,303.70 元，其中，未分配利润已实现部分为 180,635,655.13 元，未分配利润未实现部分为-120,497,351.43 元。

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

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

## § 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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配,分配金额为 13,449,247.16 元,符合基金合同的规定。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	16,879,397.03	11,659,812.87
结算备付金		1,345,282.59	-
存出保证金		46,676.15	3,241.89
交易性金融资产	6.4.7.2	277,771,316.88	98,320,603.44
其中：股票投资		277,771,316.88	98,302,594.54
基金投资		-	-
债券投资		-	18,008.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	4,428.56	2,306.85
应收股利		-	-
应收申购款		1,524.59	634.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		296,048,625.80	109,986,599.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		7,621.90	6,168.14
应付管理人报酬		241,210.02	94,979.88
应付托管费		53,066.21	20,895.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	156,133.96	4,601.84
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,230,843.90	1,437,557.85
负债合计		1,688,875.99	1,564,203.27
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	234,221,446.11	104,169,534.71
未分配利润	6.4.7.10	60,138,303.70	4,252,861.92
所有者权益合计		294,359,749.81	108,422,396.63
负债和所有者权益总计		296,048,625.80	109,986,599.90

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.342 元，基金份额总额 219,281,434.44 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		35,204,502.02	-15,789,399.69
1.利息收入		62,068.35	41,178.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	62,016.09	41,094.79
债券利息收入		52.26	84.16
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）		4,366,803.75	1,218,901.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,669,778.25	3,278.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	37,806.04	27,859.91
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,659,219.46	1,187,763.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	30,749,261.92	-17,055,220.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	26,368.00	5,740.62
<b>减：二、费用</b>		1,357,289.30	1,090,622.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	860,600.30	709,396.92

2. 托管费	6.4.10.2.2	189,332.10	156,067.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	186,316.64	30,089.75
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.02	-
7. 其他费用	6.4.7.20	121,040.24	195,068.50
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		33,847,212.72	-16,880,022.21
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		33,847,212.72	-16,880,022.21

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 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: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	104,169,534.71	4,252,861.92	108,422,396.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	33,847,212.72	33,847,212.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	130,051,911.40	35,487,476.22	165,539,387.62
其中: 1. 基金申购款	142,300,030.99	39,346,204.66	181,646,235.65
2. 基金赎回款	-12,248,119.59	-3,858,728.44	-16,106,848.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-13,449,247.16	-13,449,247.16
五、期末所有者权益 (基金净值)	234,221,446.11	60,138,303.70	294,359,749.81
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	111,143,123.68	39,339,222.22	150,482,345.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-16,880,022.21	-16,880,022.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-4,929,785.61	-1,803,771.34	-6,733,556.95
其中: 1.基金申购款	165,967.62	61,700.26	227,667.88
2.基金赎回款	-5,095,753.23	-1,865,471.60	-6,961,224.83
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	106,213,338.07	20,655,428.67	126,868,766.74

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:

林培富	刁俊东	龚珉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

根据原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金在分级运作期内的基金份额包括长盛同庆中

证 800 分级份额(以下简称“同庆分级份额”)、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“同庆 800A”)以及长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“同庆 800B”)。原基金在分级运作期届满后,根据同庆 800A 和同庆 800B 基金份额转换比例对基金份额持有人基金份额转换基准日登记在册的基金份额实施转换,按照本基金基金合同参考净值计算规则分别对同庆 800A 份额和同庆 800B 份额计算分级运作期期末基金份额参考净值,并按照各自的份额参考净值转换为本基金基金份额。于 2015 年 5 月 21 日(基金份额转换日)日终,同庆 800A 转换前份额数为 157,659,406.00 份,转换比例为 0.593624387,转换后对应本基金份额数为 93,590,468.00 份;同庆 800B 转换前份额数为 236,489,110.00 份,转换比例为 1.270917071,转换后对应本基金份额数为 300,558,047.00 份;同庆分级份额转换前份额数为 148,119,975.78 份,转换后对应本基金份额数为 148,119,975.78 份。截至 2015 年 5 月 21 日转换完成当日,本基金基金份额总额为 542,268,490.78 份。本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司根据原基金基金合同约定,对同庆 800A、同庆 800B 的份额持有人的基金份额进行了计算,并向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2019 年 8 月 26 日批准报出。

#### 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投

资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值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

本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管

产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税, 对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货, 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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	16,879,397.03
定期存款	-
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	-
合计:	16,879,397.03

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	255,086,776.23	277,771,316.88	22,684,540.65
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	255,086,776.23	277,771,316.88	22,684,540.65

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无余额。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

注：无余额。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,864.80
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	544.86
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	18.90
合计	4,428.56

#### 6.4.7.6 其他资产

注：无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	156,133.96
银行间市场应付交易费用	-
合计	156,133.96

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	28.71
其他	612,450.79
预提费用	118,364.40
合计	1,230,843.90

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	97,526,920.54	104,169,534.71
本期申购	133,221,569.62	142,300,030.99
本期赎回(以“-”号填列)	-11,467,055.72	-12,248,119.59
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	219,281,434.44	234,221,446.11

注：1，申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2，截至 2019 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 72,314,609.00 份(2018 年 12 月 31 日：81,652,696.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 146,966,825.44 份(2018 年 12 月 31 日：15,874,224.54 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。

#### 6.4.7.10 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	84,335,391.56	-80,082,529.64	4,252,861.92
本期利润	3,097,950.80	30,749,261.92	33,847,212.72
本期基金份额交易产生的变动数	106,651,559.93	-71,164,083.71	35,487,476.22
其中：基金申购款	116,622,902.54	-77,276,697.88	39,346,204.66
基金赎回款	-9,971,342.61	6,112,614.17	-3,858,728.44
本期已分配利润	-13,449,247.16	-	-13,449,247.16
本期末	180,635,655.13	-120,497,351.43	60,138,303.70

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	55,643.71
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	1,893.78
其他	4,478.60
合计	62,016.09

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	12,706,670.71
减：卖出股票成本总额	11,036,892.46
买卖股票差价收入	1,669,778.25

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债	37,806.04

券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	37,806.04

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	196,959.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	159,100.00
减：应收利息总额	53.73
买卖债券差价收入	37,806.04

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,659,219.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,659,219.46

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	30,749,261.92
——股票投资	30,749,270.82
——债券投资	-8.90
——资产支持证券投资	-
——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	30,749,261.92

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	26,368.00
基金转换费收入	-
合计	26,368.00

注：1. 本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.50%，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	186,316.64
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	186,316.64

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	58,858.84
深交所上市年费	29,752.78
银行划款费用	2,675.84

合计	121,040.24
----	------------

#### 6.4.7.21 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

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无。

##### 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

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

注：无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	860,600.30	709,396.92
其中：支付销售机构的客户维护费	42,259.17	47,760.82

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	189,332.10	156,067.35

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.10.4.2 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

注：无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 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	16,879,397.03	55,643.71	13,864,151.16	41,070.16

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2019年6月20日	2019年6月21日	2019年6月20日	0.6120	13,396,781.83	52,465.33	13,449,247.16	
合计				0.6120	13,396,781.83	52,465.33	13,449,247.16	

## 6.4.12 期末 (2019 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	可流 通日	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
601236	红塔 证券	2019年 6月26 日	2019 年7月 5日	新股流 通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信 出版	2019年 6月27 日	2019 年7月 5日	新股流 通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票 名称	停牌 日期	停牌原 因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
600485	*ST 信威	2016 年12 月26 日	重大事 项停牌	6.21	2019年7 月12日	13.86	16,168	296,006.55	100,403.28	-

注：本基金截至 2019 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险

可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2018 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.02%）。

#### 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 2019 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

##### 6.4.13.3.2 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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持证券均在证券交易所上市,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 6 月 30 日,本基金持有流动性受限的资产的估值占基金资产净值的比例符合上述要求(2018 年 12 月 31 日,同)。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 6 月 30 日,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额(2018 年 12 月 31 日,同)。

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

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

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

保证金和债券投资等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,879,397.03	-	-	-	16,879,397.03
结算备付金	1,345,282.59	-	-	-	1,345,282.59
存出保证金	46,676.15	-	-	-	46,676.15
交易性金融资产	-	-	-	277,771,316.88	277,771,316.88
应收利息	-	-	-	4,428.56	4,428.56
应收申购款	-	-	-	1,524.59	1,524.59
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,271,355.77	-	-	277,777,270.03	296,048,625.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,621.90	7,621.90
应付管理人报酬	-	-	-	241,210.02	241,210.02
应付托管费	-	-	-	53,066.21	53,066.21
应付交易费用	-	-	-	156,133.96	156,133.96
其他负债	-	-	-	1,230,843.90	1,230,843.90
负债总计	-	-	-	1,688,875.99	1,688,875.99
利率敏感度缺口	18,271,355.77	-	-	-276,088,394.04	294,359,749.81
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,659,812.87	-	-	-	11,659,812.87
存出保证金	3,241.89	-	-	-	3,241.89
交易性金融资产	-	-	18,008.90	98,302,594.54	98,320,603.44
应收利息	-	-	-	2,306.85	2,306.85
应收申购款	-	-	-	634.85	634.85
资产总计	11,663,054.76	-	18,008.90	98,305,536.24	109,986,599.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,168.14	6,168.14
应付管理人报酬	-	-	-	94,979.88	94,979.88
应付托管费	-	-	-	20,895.56	20,895.56
应付交易费用	-	-	-	4,601.84	4,601.84
其他负债	-	-	-	1,437,557.85	1,437,557.85
负债总计	-	-	-	1,564,203.27	1,564,203.27
利率敏感度缺口	11,663,054.76	-	18,008.90	96,741,332.97	108,422,396.63

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2018 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	277,771,316.88	94.36	98,302,594.54	90.67
合计	277,771,316.88	94.36	98,302,594.54	90.67

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	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(2019年6月30日)	上年度末(2018年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	14,130,246.74	5,404,491.09
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-14,130,246.74	-5,404,491.09	

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 277,613,937.06 元，属于第二层次的余额为 56,976.54 元，属于第三层次的余额为 100,403.28 元（2018 年 12 月 31 日：第一层次 96,778,678.35 元，第二层次 1,333,415.21 元，属于第三层次余额 208,509.88 元）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下:

	交易性金融资产		
	债券投资	权益工具投资	合计
2019 年 1 月 1 日		208,509.88	208,509.88
购买	-		
出售	-	182,451.82	182,451.82
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	74,345.22	74,345.22
计入损益的利得或损失	-	74,345.22	74,345.22
2019 年 6 月 30 日	-	100,403.28	100,403.28

2019 年 6 月 30 日仍持有的资产计入

2019 年上半年度损益的未实现利得 或损失的变动——公允价值变动损益	-	-
--	---	---

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外, 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	277,771,316.88	93.83
	其中：股票	277,771,316.88	93.83
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	18,224,679.62	6.16
8	其他各项资产	52,629.30	0.02
9	合计	296,048,625.80	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,303,755.92	0.44
B	采矿业	8,498,718.89	2.89
C	制造业	115,635,179.60	39.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,043,653.56	2.39
E	建筑业	7,732,673.96	2.63
F	批发和零售业	6,270,509.51	2.13
G	交通运输、仓储和邮政业	8,116,578.45	2.76
H	住宿和餐饮业	104,424.32	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,375,305.23	3.86
J	金融业	84,119,258.09	28.58
K	房地产业	14,261,138.88	4.84
L	租赁和商务服务业	3,551,784.48	1.21
M	科学研究和技术服务业	141,041.88	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	769,630.05	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,290,417.60	0.44
R	文化、体育和娱乐业	1,243,795.50	0.42
S	综合	1,080,794.82	0.37
	合计	272,538,660.74	92.59

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	64,950.78	0.02
B	采矿业	623,511.81	0.21
C	制造业	2,789,811.84	0.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	39,693.00	0.01
F	批发和零售业	319,518.51	0.11
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	950,509.91	0.32
J	金融业	33,869.94	0.01
K	房地产业	283,719.03	0.10
L	租赁和商务服务业	63,664.72	0.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	63,406.60	0.02
S	综合	-	-
	合计	5,232,656.14	1.78

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	218,287	19,342,411.07	6.57

2	600519	贵州茅台	11,103	10,925,352.00	3.71
3	600036	招商银行	207,516	7,466,425.68	2.54
4	000651	格力电器	104,723	5,759,765.00	1.96
5	601166	兴业银行	268,471	4,910,334.59	1.67
6	000858	五粮液	39,398	4,646,994.10	1.58
7	000002	万科A	150,654	4,189,687.74	1.42
8	600887	伊利股份	121,834	4,070,473.94	1.38
9	601398	工商银行	663,912	3,910,441.68	1.33
10	600030	中信证券	159,534	3,798,504.54	1.29
11	600276	恒瑞医药	55,640	3,672,240.00	1.25
12	600016	民生银行	553,795	3,516,598.25	1.19
13	601328	交通银行	549,770	3,364,592.40	1.14
14	000333	美的集团	56,638	2,937,246.68	1.00
15	601288	农业银行	766,367	2,758,921.20	0.94
16	600000	浦发银行	224,225	2,618,948.00	0.89
17	600900	长江电力	134,720	2,411,488.00	0.82
18	601668	中国建筑	415,099	2,386,819.25	0.81
19	601601	中国太保	64,240	2,345,402.40	0.80
20	600837	海通证券	163,349	2,317,922.31	0.79
21	601211	国泰君安	119,800	2,198,330.00	0.75
22	002415	海康威视	77,791	2,145,475.78	0.73
23	601888	中国国旅	21,212	1,880,443.80	0.64
24	601169	北京银行	317,494	1,876,389.54	0.64
25	600048	保利地产	146,924	1,874,750.24	0.64
26	600009	上海机场	21,204	1,776,471.12	0.60
27	600104	上汽集团	68,966	1,758,633.00	0.60
28	600585	海螺水泥	41,615	1,727,022.50	0.59
29	000725	京东方A	487,307	1,676,336.08	0.57
30	002304	洋河股份	13,695	1,664,764.20	0.57
31	000063	中兴通讯	50,062	1,628,516.86	0.55
32	000001	平安银行	117,879	1,624,372.62	0.55
33	601988	中国银行	430,538	1,610,212.12	0.55
34	603288	海天味业	15,200	1,596,000.00	0.54
35	601688	华泰证券	68,891	1,537,647.12	0.52
36	601766	中国中车	185,187	1,498,162.83	0.51
37	600690	海尔智家	80,972	1,400,005.88	0.48
38	600309	万华化学	29,478	1,261,363.62	0.43
39	002142	宁波银行	51,924	1,258,637.76	0.43
40	000338	潍柴动力	101,606	1,248,737.74	0.42



41	601818	光大银行	325,596	1,240,520.76	0.42
42	600050	中国联通	200,472	1,234,907.52	0.42
43	601229	上海银行	103,900	1,231,215.00	0.42
44	000661	长春高新	3,584	1,211,392.00	0.41
45	600019	宝钢股份	185,959	1,208,733.50	0.41
46	600028	中国石化	214,696	1,174,387.12	0.40
47	601989	中国重工	208,926	1,161,628.56	0.39
48	300059	东方财富	78,364	1,061,832.20	0.36
49	001979	招商蛇口	50,136	1,047,842.40	0.36
50	002714	牧原股份	17,740	1,042,934.60	0.35
51	600999	招商证券	60,969	1,041,960.21	0.35
52	600031	三一重工	78,129	1,021,927.32	0.35
53	600015	华夏银行	131,963	1,016,115.10	0.35
54	002475	立讯精密	40,640	1,007,465.60	0.34
55	601390	中国中铁	154,399	1,006,681.48	0.34
56	000538	云南白药	12,011	1,001,957.62	0.34
57	601006	大秦铁路	123,028	995,296.52	0.34
58	600570	恒生电子	14,549	991,514.35	0.34
59	000568	泸州老窖	12,254	990,490.82	0.34
60	601628	中国人寿	34,747	984,035.04	0.33
61	002230	科大讯飞	29,450	978,918.00	0.33
62	600919	江苏银行	131,000	951,060.00	0.32
63	601336	新华保险	17,159	944,259.77	0.32
64	601088	中国神华	45,496	927,208.48	0.31
65	002024	苏宁易购	77,882	894,085.36	0.30
66	601933	永辉超市	85,525	873,210.25	0.30
67	600436	片仔癀	7,545	869,184.00	0.30
68	601009	南京银行	104,301	861,526.26	0.29
69	000776	广发证券	62,177	854,311.98	0.29
70	601012	隆基股份	34,641	800,553.51	0.27
71	601225	陕西煤业	85,692	791,794.08	0.27
72	601155	新城控股	19,504	776,454.24	0.26
73	000876	新希望	43,812	761,014.44	0.26
74	002027	分众传媒	143,300	758,057.00	0.26
75	601899	紫金矿业	198,127	746,938.79	0.25
76	600352	浙江龙盛	47,262	745,321.74	0.25
77	600588	用友网络	27,676	743,930.88	0.25
78	300015	爱尔眼科	23,160	717,265.20	0.24
79	002594	比亚迪	13,784	699,124.48	0.24

80	601857	中国石油	101,331	697,157.28	0.24
81	002736	国信证券	51,800	681,688.00	0.23
82	601186	中国铁建	68,351	680,092.45	0.23
83	600660	福耀玻璃	29,798	677,308.54	0.23
84	600547	山东黄金	16,260	669,424.20	0.23
85	600795	国电电力	262,053	665,614.62	0.23
86	601377	兴业证券	98,602	664,577.48	0.23
87	000166	申万宏源	130,451	653,559.51	0.22
88	600340	华夏幸福	19,922	648,859.54	0.22
89	600406	国电南瑞	34,635	645,596.40	0.22
90	002202	金风科技	51,761	643,389.23	0.22
91	300142	沃森生物	22,500	638,100.00	0.22
92	000100	TCL 集团	189,215	630,085.95	0.21
93	002008	大族激光	18,221	626,437.98	0.21
94	601901	方正证券	88,004	625,708.44	0.21
95	600196	复星医药	24,474	619,192.20	0.21
96	600958	东方证券	55,500	592,740.00	0.20
97	600741	华域汽车	27,133	586,072.80	0.20
98	600111	北方稀土	44,883	576,297.72	0.20
99	600029	南方航空	72,682	561,105.04	0.19
100	600383	金地集团	46,762	557,870.66	0.19
101	600271	航天信息	23,876	550,341.80	0.19
102	000783	长江证券	70,294	548,996.14	0.19
103	000895	双汇发展	22,037	548,500.93	0.19
104	000963	华东医药	21,079	547,210.84	0.19
105	600886	国投电力	70,178	545,283.06	0.19
106	000157	中联重科	90,335	542,913.35	0.18
107	000860	顺鑫农业	11,611	541,653.15	0.18
108	300296	利亚德	68,600	537,138.00	0.18
109	601985	中国核电	96,088	534,249.28	0.18
110	600872	中炬高新	12,456	533,490.48	0.18
111	601111	中国国航	53,524	512,224.68	0.17
112	600703	三安光电	44,758	504,870.24	0.17
113	600332	白云山	12,200	499,834.00	0.17
114	601611	中国核建	63,800	496,364.00	0.17
115	600705	中航资本	91,560	496,255.20	0.17
116	002422	科伦药业	16,600	493,518.00	0.17
117	601600	中国铝业	125,672	492,634.24	0.17
118	600011	华能国际	78,600	489,678.00	0.17

119	000938	紫光股份	17,644	480,799.00	0.16
120	000069	华侨城 A	68,341	474,969.95	0.16
121	002410	广联达	14,441	474,964.49	0.16
122	000423	东阿阿胶	11,917	474,534.94	0.16
123	600010	包钢股份	276,916	467,988.04	0.16
124	002007	华兰生物	15,177	462,746.73	0.16
125	300124	汇川技术	20,135	461,292.85	0.16
126	300003	乐普医疗	20,000	460,400.00	0.16
127	600018	上港集团	66,761	455,310.02	0.15
128	601555	东吴证券	44,260	453,665.00	0.15
129	600089	特变电工	62,488	453,038.00	0.15
130	601607	上海医药	24,937	452,606.55	0.15
131	002044	美年健康	36,000	447,840.00	0.15
132	600809	山西汾酒	6,453	445,579.65	0.15
133	600487	亨通光电	26,580	445,480.80	0.15
134	002236	大华股份	30,665	445,255.80	0.15
135	600115	东方航空	70,537	442,266.99	0.15
136	601669	中国电建	83,288	440,593.52	0.15
137	002311	海大集团	14,100	435,690.00	0.15
138	601919	中远海控	85,700	430,214.00	0.15
139	000066	中国长城	40,785	419,269.80	0.14
140	000656	金科股份	68,971	415,895.13	0.14
141	600637	东方明珠	39,057	411,660.78	0.14
142	600674	川投能源	46,218	411,340.20	0.14
143	600867	通化东宝	26,700	411,180.00	0.14
144	600739	辽宁成大	28,012	407,294.48	0.14
145	002179	中航光电	12,103	404,966.38	0.14
146	000596	古井贡酒	3,408	403,882.08	0.14
147	601727	上海电气	74,368	400,099.84	0.14
148	600516	方大炭素	32,551	400,051.79	0.14
149	600177	雅戈尔	62,884	399,313.40	0.14
150	601877	正泰电器	16,982	392,114.38	0.13
151	000425	徐工机械	87,754	391,382.84	0.13
152	600893	航发动力	17,126	388,931.46	0.13
153	002493	荣盛石化	32,000	385,920.00	0.13
154	600536	中国软件	7,186	385,672.62	0.13
155	600201	生物股份	24,469	383,918.61	0.13
156	600109	国金证券	38,792	377,058.24	0.13
157	300408	三环集团	19,300	375,385.00	0.13

158	601998	中信银行	62,484	373,029.48	0.13
159	002466	天齐锂业	14,755	373,006.40	0.13
160	600085	同仁堂	12,834	372,186.00	0.13
161	600066	宇通客车	28,434	370,210.68	0.13
162	000768	中航飞机	23,491	369,983.25	0.13
163	600489	中金黄金	36,013	369,853.51	0.13
164	600023	浙能电力	83,661	369,781.62	0.13
165	000413	东旭光电	71,900	369,566.00	0.13
166	002465	海格通信	38,434	366,660.36	0.12
167	601800	中国交建	32,367	366,394.44	0.12
168	600338	西藏珠峰	20,780	363,234.40	0.12
169	600426	华鲁恒升	24,438	363,148.68	0.12
170	300122	智飞生物	8,400	362,040.00	0.12
171	600100	同方股份	39,825	360,416.25	0.12
172	600673	东阳光	45,653	358,376.05	0.12
173	300024	机器人	23,496	357,844.08	0.12
174	002049	紫光国微	8,100	357,291.00	0.12
175	300136	信维通信	14,500	354,525.00	0.12
176	002081	金螳螂	34,042	350,973.02	0.12
177	000786	北新建材	19,324	350,344.12	0.12
178	600183	生益科技	23,209	349,295.45	0.12
179	601018	宁波港	79,451	348,789.89	0.12
180	600895	张江高科	16,989	348,614.28	0.12
181	600068	葛洲坝	55,954	348,593.42	0.12
182	002241	歌尔股份	39,154	348,079.06	0.12
183	002460	赣锋锂业	14,800	346,764.00	0.12
184	600161	天坛生物	13,610	343,652.50	0.12
185	600061	国投资本	24,400	341,844.00	0.12
186	600606	绿地控股	50,000	341,500.00	0.12
187	300017	网宿科技	31,259	336,972.02	0.11
188	000623	吉林敖东	20,555	336,896.45	0.11
189	000630	铜陵有色	136,523	335,846.58	0.11
190	600535	天士力	19,962	330,371.10	0.11
191	002439	启明星辰	12,100	325,490.00	0.11
192	002129	中环股份	33,076	322,821.76	0.11
193	603993	洛阳钼业	79,756	315,833.76	0.11
194	600498	烽火通信	11,245	313,285.70	0.11
195	601168	西部矿业	49,063	313,021.94	0.11
196	600522	中天科技	34,098	312,678.66	0.11

197	000625	长安汽车	47,106	312,312.78	0.11
198	300144	宋城演艺	13,411	310,330.54	0.11
199	300253	卫宁健康	21,845	309,762.10	0.11
200	600801	华新水泥	15,243	308,670.75	0.10
201	600208	新湖中宝	97,687	306,737.18	0.10
202	600298	安琪酵母	9,668	305,798.84	0.10
203	002352	顺丰控股	9,000	305,640.00	0.10
204	002456	欧菲光	38,955	305,407.20	0.10
205	002463	沪电股份	21,955	299,027.10	0.10
206	601618	中国中冶	98,106	298,242.24	0.10
207	600584	长电科技	23,155	297,541.75	0.10
208	600153	建发股份	33,264	295,384.32	0.10
209	002371	北方华创	4,259	294,935.75	0.10
210	600369	西南证券	58,992	291,420.48	0.10
211	600118	中国卫星	12,896	290,804.80	0.10
212	600460	士兰微	17,461	289,852.60	0.10
213	002153	石基信息	7,987	289,049.53	0.10
214	600549	厦门钨业	20,110	287,774.10	0.10
215	000960	锡业股份	25,700	287,069.00	0.10
216	600362	江西铜业	18,235	287,018.90	0.10
217	600176	中国巨石	30,064	286,509.92	0.10
218	002508	老板电器	10,439	283,314.46	0.10
219	601788	光大证券	24,400	278,648.00	0.09
220	000401	冀东水泥	15,799	278,220.39	0.09
221	002223	鱼跃医疗	11,291	277,984.42	0.09
222	000709	河钢股份	92,547	276,715.53	0.09
223	600718	东软集团	21,059	269,976.38	0.09
224	000686	东北证券	30,582	269,427.42	0.09
225	000999	华润三九	9,124	267,698.16	0.09
226	002065	东华软件	38,172	266,822.28	0.09
227	601021	春秋航空	5,900	265,500.00	0.09
228	002146	荣盛发展	28,174	264,553.86	0.09
229	300070	碧水源	33,607	261,798.53	0.09
230	002299	圣农发展	10,301	260,821.32	0.09
231	600170	上海建工	69,296	260,552.96	0.09
232	600221	海航控股	128,108	260,059.24	0.09
233	000009	中国宝安	44,799	255,802.29	0.09
234	600583	海油工程	45,548	255,068.80	0.09
235	002353	杰瑞股份	11,038	254,977.80	0.09

236	601198	东兴证券	21,200	251,856.00	0.09
237	002340	格林美	52,700	248,217.00	0.08
238	002191	劲嘉股份	19,916	247,157.56	0.08
239	600388	龙净环保	19,600	242,844.00	0.08
240	000402	金融街	30,696	240,656.64	0.08
241	600816	安信信托	47,636	240,561.80	0.08
242	000975	银泰资源	18,232	240,480.08	0.08
243	000997	新大陆	14,228	240,310.92	0.08
244	000750	国海证券	47,675	239,805.25	0.08
245	000830	鲁西化工	21,984	239,185.92	0.08
246	600643	爱建集团	24,861	238,168.38	0.08
247	002268	卫士通	9,700	237,165.00	0.08
248	600688	上海石化	45,451	234,527.16	0.08
249	600415	小商品城	56,473	232,668.76	0.08
250	002050	三花智控	22,006	232,163.30	0.08
251	601333	广深铁路	70,796	228,671.08	0.08
252	603799	华友钴业	10,690	227,803.90	0.08
253	002385	大北农	42,810	226,464.90	0.08
254	002038	双鹭药业	9,596	226,081.76	0.08
255	000060	中金岭南	48,004	225,138.76	0.08
256	002572	索菲亚	12,102	224,613.12	0.08
257	600038	中直股份	5,475	224,584.50	0.08
258	603000	人民网	12,530	223,409.90	0.08
259	000671	阳光城	34,332	222,471.36	0.08
260	300088	长信科技	43,820	221,729.20	0.08
261	000988	华工科技	13,991	221,337.62	0.08
262	002281	光迅科技	8,182	216,659.36	0.07
263	601838	成都银行	24,533	216,626.39	0.07
264	300027	华谊兄弟	43,595	214,051.45	0.07
265	600879	航天电子	34,648	213,431.68	0.07
266	002797	第一创业	33,620	213,150.80	0.07
267	600064	南京高科	19,794	211,993.74	0.07
268	600376	首开股份	23,609	210,828.37	0.07
269	000039	中集集团	19,691	210,299.88	0.07
270	601633	长城汽车	25,425	210,264.75	0.07
271	600755	厦门国贸	24,340	210,054.20	0.07
272	000513	丽珠集团	6,286	208,883.78	0.07
273	601872	招商轮船	47,800	208,408.00	0.07
274	000983	西山煤电	34,350	208,161.00	0.07

275	600325	华发股份	26,636	208,027.16	0.07
276	600260	凯乐科技	10,390	207,592.20	0.07
277	600808	马钢股份	60,500	206,305.00	0.07
278	000961	中南建设	23,775	205,891.50	0.07
279	600482	中国动力	8,690	205,257.80	0.07
280	002440	闰土股份	16,418	204,568.28	0.07
281	600079	人福医药	19,430	204,015.00	0.07
282	000778	新兴铸管	45,582	202,384.08	0.07
283	000970	中科三环	17,810	202,143.50	0.07
284	000547	航天发展	21,113	201,840.28	0.07
285	600171	上海贝岭	12,420	201,825.00	0.07
286	600820	隧道股份	31,700	200,027.00	0.07
287	002500	山西证券	24,594	199,211.40	0.07
288	300072	三聚环保	24,889	197,369.77	0.07
289	600863	内蒙华电	62,751	197,038.14	0.07
290	600704	物产中大	36,015	195,201.30	0.07
291	000878	云南铜业	18,300	194,529.00	0.07
292	000826	启迪桑德	16,480	194,299.20	0.07
293	000581	威孚高科	10,444	193,840.64	0.07
294	600737	中粮糖业	22,200	192,696.00	0.07
295	600143	金发科技	39,321	192,672.90	0.07
296	600649	城投控股	29,431	190,418.57	0.06
297	600266	北京城建	23,620	190,377.20	0.06
298	600026	中远海能	29,138	189,105.62	0.06
299	600008	首创股份	53,496	188,305.92	0.06
300	601216	君正集团	56,608	186,240.32	0.06
301	600648	外高桥	8,861	185,903.78	0.06
302	002195	二三四五	47,643	185,331.27	0.06
303	000690	宝新能源	28,661	184,576.84	0.06
304	002078	太阳纸业	27,025	184,040.25	0.06
305	000559	万向钱潮	30,656	183,322.88	0.06
306	002152	广电运通	26,550	181,867.50	0.06
307	000703	恒逸石化	13,267	181,227.22	0.06
308	600804	鹏博士	24,012	180,570.24	0.06
309	002399	海普瑞	8,601	180,534.99	0.06
310	002092	中泰化学	22,675	180,493.00	0.06
311	600160	巨化股份	25,369	180,373.59	0.06
312	601866	中远海发	65,753	178,848.16	0.06
313	600500	中化国际	23,900	178,533.00	0.06

314	000636	风华高科	14,636	177,095.60	0.06
315	600158	中体产业	17,017	174,083.91	0.06
316	000930	中粮生化	23,138	173,997.76	0.06
317	600511	国药股份	7,485	171,930.45	0.06
318	002266	浙富控股	35,865	170,358.75	0.06
319	600021	上海电力	19,614	170,249.52	0.06
320	600392	盛和资源	15,391	170,224.46	0.06
321	000598	兴蓉环境	37,395	170,147.25	0.06
322	600729	重庆百货	5,625	170,100.00	0.06
323	600410	华胜天成	15,696	168,418.08	0.06
324	600572	康恩贝	26,167	167,468.80	0.06
325	600372	中航电子	11,250	166,950.00	0.06
326	600967	内蒙一机	14,868	166,521.60	0.06
327	002384	东山精密	11,214	163,387.98	0.06
328	300001	特锐德	9,000	162,180.00	0.06
329	600827	百联股份	16,476	161,629.56	0.05
330	300315	掌趣科技	46,700	161,115.00	0.05
331	002310	东方园林	26,850	161,100.00	0.05
332	000031	大悦城	24,993	160,455.06	0.05
333	601678	滨化股份	23,634	159,765.84	0.05
334	600138	中青旅	12,567	159,475.23	0.05
335	000563	陕国投 A	35,835	159,107.40	0.05
336	002414	高德红外	8,233	158,073.60	0.05
337	600120	浙江东方	12,404	158,026.96	0.05
338	600166	福田汽车	66,456	157,500.72	0.05
339	002368	太极股份	5,161	156,378.30	0.05
340	002273	水晶光电	13,502	156,353.16	0.05
341	600259	广晟有色	3,866	155,799.80	0.05
342	002373	千方科技	9,100	155,610.00	0.05
343	600373	中文传媒	12,327	154,827.12	0.05
344	000027	深圳能源	24,941	154,634.20	0.05
345	002155	湖南黄金	15,300	154,071.00	0.05
346	600759	洲际油气	39,779	153,546.94	0.05
347	600557	康缘药业	10,247	152,270.42	0.05
348	002242	九阳股份	7,317	152,266.77	0.05
349	000877	天山股份	13,092	152,129.04	0.05
350	300113	顺网科技	9,700	152,096.00	0.05
351	002004	华邦健康	31,247	151,860.42	0.05
352	600037	歌华有线	14,800	151,700.00	0.05



353	002221	东华能源	17,614	151,656.54	0.05
354	600060	海信电器	17,585	151,582.70	0.05
355	000028	国药一致	3,603	150,713.49	0.05
356	600525	长园集团	23,759	150,156.88	0.05
357	000415	渤海租赁	38,099	149,348.08	0.05
358	600094	大名城	23,700	149,073.00	0.05
359	600348	阳泉煤业	25,567	148,544.27	0.05
360	000528	柳 工	22,268	148,304.88	0.05
361	600056	中国医药	10,962	147,877.38	0.05
362	300266	兴源环境	32,468	147,404.72	0.05
363	600563	法拉电子	3,538	145,659.46	0.05
364	600811	东方集团	38,908	144,737.76	0.05
365	002250	联化科技	13,046	144,680.14	0.05
366	000887	中鼎股份	15,077	144,588.43	0.05
367	600435	北方导航	16,024	144,055.76	0.05
368	600216	浙江医药	14,009	143,452.16	0.05
369	600528	中铁工业	12,376	143,190.32	0.05
370	600664	哈药股份	34,583	143,173.62	0.05
371	002056	横店东磁	18,836	143,153.60	0.05
372	600282	南钢股份	40,800	142,800.00	0.05
373	600062	华润双鹤	11,265	142,051.65	0.05
374	600970	中材国际	22,043	141,736.49	0.05
375	600645	中源协和	8,148	141,041.88	0.05
376	002051	中工国际	12,294	141,012.18	0.05
377	600859	王府井	9,254	140,568.26	0.05
378	600717	天津港	21,840	140,212.80	0.05
379	002602	世纪华通	12,792	139,688.64	0.05
380	002128	露天煤业	16,106	139,316.90	0.05
381	600597	光明乳业	12,912	138,804.00	0.05
382	002701	奥瑞金	29,644	138,437.48	0.05
383	601880	大连港	64,831	138,090.03	0.05
384	601958	金钼股份	20,552	137,698.40	0.05
385	600316	洪都航空	9,559	136,789.29	0.05
386	000738	航发控制	10,200	136,680.00	0.05
387	601928	凤凰传媒	16,890	136,302.30	0.05
388	600267	海正药业	13,617	136,170.00	0.05
389	002030	达安基因	12,678	136,034.94	0.05
390	600039	四川路桥	37,291	135,739.24	0.05
391	000685	中山公用	15,885	135,657.90	0.05

392	000758	中色股份	24,676	135,471.24	0.05
393	600787	中储股份	23,286	133,428.78	0.05
394	300251	光线传媒	19,414	132,015.20	0.04
395	002470	金正大	36,016	131,098.24	0.04
396	000712	锦龙股份	10,207	131,057.88	0.04
397	600884	杉杉股份	12,228	130,228.20	0.04
398	000021	深科技	15,963	129,779.19	0.04
399	601608	中信重工	30,011	129,647.52	0.04
400	601000	唐山港	47,123	129,588.25	0.04
401	002002	鸿达兴业	20,859	129,117.21	0.04
402	600073	上海梅林	14,000	128,800.00	0.04
403	002183	怡亚通	27,000	128,790.00	0.04
404	600993	马应龙	7,228	127,574.20	0.04
405	600633	浙数文化	13,642	127,552.70	0.04
406	300058	蓝色光标	29,851	127,463.77	0.04
407	601717	郑煤机	22,146	126,453.66	0.04
408	600835	上海机电	7,568	125,628.80	0.04
409	000727	华东科技	60,000	125,400.00	0.04
410	300244	迪安诊断	7,380	125,312.40	0.04
411	600125	铁龙物流	19,346	124,781.70	0.04
412	601718	际华集团	31,843	124,506.13	0.04
413	600881	亚泰集团	38,031	123,600.75	0.04
414	000006	深振业 A	22,370	121,916.50	0.04
415	300274	阳光电源	12,960	121,176.00	0.04
416	600611	大众交通	25,996	120,881.40	0.04
417	600017	日照港	38,323	120,717.45	0.04
418	000012	南玻 A	28,795	119,787.20	0.04
419	000078	海王生物	34,420	119,781.60	0.04
420	002408	齐翔腾达	15,429	119,574.75	0.04
421	002028	思源电气	11,917	118,693.32	0.04
422	600565	迪马股份	31,700	118,241.00	0.04
423	000400	许继电气	13,045	118,187.70	0.04
424	002603	以岭药业	10,200	118,116.00	0.04
425	600770	综艺股份	17,665	118,002.20	0.04
426	600582	天地科技	34,100	117,645.00	0.04
427	600580	卧龙电驱	13,748	115,620.68	0.04
428	002573	清新环境	14,328	115,340.40	0.04
429	600478	科力远	20,578	115,031.02	0.04
430	600312	平高电气	14,938	114,873.22	0.04

431	600694	大商股份	4,090	114,151.90	0.04
432	002074	国轩高科	8,700	114,057.00	0.04
433	600409	三友化工	20,099	113,760.34	0.04
434	600545	卓郎智能	15,900	113,049.00	0.04
435	000156	华数传媒	10,192	112,213.92	0.04
436	600151	航天机电	21,381	110,112.15	0.04
437	002131	利欧股份	57,303	109,448.73	0.04
438	300026	红日药业	31,400	108,330.00	0.04
439	000848	承德露露	13,001	108,298.33	0.04
440	600499	科达洁能	24,566	107,599.08	0.04
441	300115	长盈精密	10,193	106,924.57	0.04
442	002048	宁波华翔	9,798	106,014.36	0.04
443	600188	兖州煤业	9,745	105,928.15	0.04
444	000543	皖能电力	22,388	105,447.48	0.04
445	600098	广州发展	17,100	105,336.00	0.04
446	600754	锦江股份	4,238	104,424.32	0.04
447	601311	骆驼股份	9,542	103,530.70	0.04
448	002254	泰和新材	9,688	102,499.04	0.03
449	600748	上实发展	12,362	102,480.98	0.03
450	000600	建投能源	15,286	102,416.20	0.03
451	002444	巨星科技	10,169	101,486.62	0.03
452	002672	东江环保	8,945	101,436.30	0.03
453	000090	天健集团	20,231	99,941.14	0.03
454	603766	隆鑫通用	23,788	99,671.72	0.03
455	300002	神州泰岳	24,935	99,241.30	0.03
456	002118	紫鑫药业	14,700	99,078.00	0.03
457	600750	江中药业	7,530	97,965.30	0.03
458	000062	深圳华强	6,997	92,990.13	0.03
459	300134	大富科技	5,516	85,663.48	0.03
460	002665	首航节能	24,658	83,590.62	0.03
461	600639	浦东金桥	4,896	79,168.32	0.03
462	300010	立思辰	8,300	77,937.00	0.03
463	600195	中牧股份	5,548	76,839.80	0.03
464	300133	华策影视	11,265	75,813.45	0.03
465	600277	亿利洁能	14,900	72,563.00	0.02
466	000061	农产品	13,180	71,435.60	0.02
467	300055	万邦达	10,000	71,300.00	0.02
468	600458	时代新材	6,800	70,652.00	0.02
469	000501	鄂武商 A	6,517	70,057.75	0.02

470	600765	中航重机	7,499	69,215.77	0.02
471	002426	胜利精密	27,000	69,120.00	0.02
472	002233	塔牌集团	5,913	69,063.84	0.02
473	000718	苏宁环球	19,949	69,023.54	0.02
474	002589	瑞康医药	9,082	68,932.38	0.02
475	600169	太原重工	25,688	68,586.96	0.02
476	002064	华峰氨纶	13,522	67,880.44	0.02
477	600006	东风汽车	12,718	67,786.94	0.02
478	600874	创业环保	8,153	67,588.37	0.02
479	300199	翰宇药业	7,300	66,941.00	0.02
480	000926	福星股份	9,650	66,778.00	0.02
481	002093	国脉科技	7,142	66,349.18	0.02
482	600141	兴发集团	6,438	66,182.64	0.02
483	600757	长江传媒	9,692	66,002.52	0.02
484	000519	中兵红箭	8,505	65,743.65	0.02
485	300257	开山股份	5,800	64,264.00	0.02
486	000937	冀中能源	16,587	64,025.82	0.02
487	600466	蓝光发展	10,180	63,319.60	0.02
488	002358	森源电气	6,176	62,686.40	0.02
489	601001	大同煤业	13,657	62,412.49	0.02
490	600058	五矿发展	7,354	62,141.30	0.02
491	600640	号百控股	4,637	62,043.06	0.02
492	002317	众生药业	7,282	61,969.82	0.02
493	002375	亚厦股份	10,393	61,422.63	0.02
494	002244	滨江集团	14,764	61,270.60	0.02
495	000829	天音控股	10,464	60,900.48	0.02
496	002635	安洁科技	4,497	60,664.53	0.02
497	000552	靖远煤电	21,964	59,522.44	0.02
498	002285	世联行	13,195	59,509.45	0.02
499	002489	浙江永强	17,680	59,051.20	0.02
500	002332	仙琚制药	8,648	58,460.48	0.02
501	600971	恒源煤电	9,960	58,266.00	0.02
502	600329	中新药业	4,058	57,988.82	0.02
503	603328	依顿电子	5,634	57,861.18	0.02
504	002505	大康农业	29,216	57,555.52	0.02
505	002390	信邦制药	10,857	57,216.39	0.02
506	600657	信达地产	13,767	56,720.04	0.02
507	600022	山东钢铁	33,830	56,496.10	0.02
508	002366	台海核电	6,000	56,160.00	0.02

509	600959	江苏有线	12,460	55,447.00	0.02
510	000541	佛山照明	10,410	54,548.40	0.02
511	002640	跨境通	6,400	53,312.00	0.02
512	000426	兴业矿业	9,600	51,552.00	0.02
513	603568	伟明环保	2,360	50,787.20	0.02
514	600428	中远海特	13,600	50,320.00	0.02
515	600416	湘电股份	8,357	50,309.14	0.02
516	002437	誉衡药业	12,676	50,070.20	0.02
517	002482	广田集团	10,250	49,815.00	0.02
518	000008	神州高铁	13,200	49,764.00	0.02
519	000158	常山北明	8,400	45,528.00	0.02
520	600869	智慧能源	9,934	44,901.68	0.02
521	002251	步步高	5,559	44,305.23	0.02
522	002344	海宁皮城	9,464	44,102.24	0.01
523	601777	力帆股份	10,155	43,564.95	0.01
524	002699	美盛文化	6,975	41,850.00	0.01
525	002249	大洋电机	9,500	41,230.00	0.01
526	002681	奋达科技	9,095	38,562.80	0.01
527	300287	飞利信	9,600	38,112.00	0.01
528	600335	国机汽车	5,118	35,416.56	0.01
529	002431	棕榈股份	8,930	35,273.50	0.01
530	000587	金洲慈航	13,112	33,828.96	0.01
531	002503	搜于特	12,292	33,803.00	0.01
532	600280	中央商场	9,204	33,042.36	0.01
533	603198	迎驾贡酒	1,400	25,074.00	0.01
534	600917	重庆燃气	2,901	20,190.96	0.01
535	600751	海航科技	6,300	20,034.00	0.01
536	601016	节能风电	5,500	14,630.00	0.00
537	603260	合盛硅业	65	3,058.90	0.00
538	603650	彤程新材	76	1,659.84	0.00
539	601869	长飞光纤	39	1,462.50	0.00
540	603806	福斯特	30	1,101.90	0.00
541	603056	德邦股份	46	647.68	0.00
542	601019	山东出版	50	389.00	0.00
543	603025	大豪科技	21	215.04	0.00
544	603077	和邦生物	82	155.80	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	占基金资产净值比例 (%)
1	600600	青岛啤酒	6,850	342,020.50	0.12
2	000503	国新健康	18,176	311,900.16	0.11
3	300146	汤臣倍健	15,786	306,248.40	0.10
4	600256	广汇能源	85,148	303,126.88	0.10
5	600989	宝丰能源	25,556	301,816.36	0.10
6	000839	中信国安	58,515	235,230.30	0.08
7	002013	中航机电	34,019	234,050.72	0.08
8	600655	豫园股份	27,310	223,668.90	0.08
9	600968	海油发展	55,991	198,768.05	0.07
10	300770	新媒股份	2,271	196,441.50	0.07
11	600503	华丽家族	34,800	132,240.00	0.04
12	603068	博通集成	2,231	129,353.38	0.04
13	600157	永泰能源	72,391	121,616.88	0.04
14	000667	美好置业	43,030	113,168.90	0.04
15	600366	宁波韵升	11,204	102,852.72	0.03
16	600485	*ST 信威	16,168	100,403.28	0.03
17	300773	拉卡拉	1,863	96,466.14	0.03
18	000049	德赛电池	3,703	96,389.09	0.03
19	603267	鸿远电子	1,751	86,044.14	0.03
20	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.03
21	000969	安泰科技	8,582	72,432.08	0.02
22	603697	有友食品	3,783	71,574.36	0.02
23	002955	鸿合科技	1,208	71,078.72	0.02
24	002041	登海种业	5,937	64,950.78	0.02
25	002400	省广集团	21,364	63,664.72	0.02
26	000612	焦作万方	11,901	63,551.34	0.02
27	600594	益佰制药	10,300	54,075.00	0.02
28	300768	迪普科技	1,428	53,735.64	0.02
29	002276	万马股份	9,249	50,407.05	0.02
30	600086	东方金钰	11,400	50,160.00	0.02
31	002277	友阿股份	14,628	49,442.64	0.02
32	002308	威创股份	9,600	47,808.00	0.02
33	600122	宏图高科	14,457	46,406.97	0.02
34	300777	中简科技	1,156	42,540.80	0.01

35	603982	泉峰汽车	1,845	42,121.35	0.01
36	603169	兰石重装	5,800	42,108.00	0.01
37	300291	华录百纳	6,500	40,300.00	0.01
38	002663	普邦股份	13,100	39,693.00	0.01
39	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
40	603217	元利科技	584	39,268.16	0.01
41	600743	华远地产	15,263	38,310.13	0.01
42	300202	聚龙股份	4,796	37,360.84	0.01
43	300772	运达股份	2,236	35,507.68	0.01
44	002588	史丹利	7,868	35,091.28	0.01
45	002345	潮宏基	7,482	34,043.10	0.01
46	603327	福蓉科技	1,323	34,014.33	0.01
47	600184	光电股份	2,956	33,905.32	0.01
48	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
49	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
50	002953	日丰股份	1,172	28,971.84	0.01
51	600618	氯碱化工	3,554	27,934.44	0.01
52	300780	德恩精工	935	27,676.00	0.01
53	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
54	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
55	002354	天神娱乐	4,909	17,132.41	0.01
56	603863	松炆资源	403	9,301.24	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	601318	中国平安	10,431,338.60	9.62
2	600519	贵州茅台	5,871,943.60	5.42
3	600036	招商银行	4,283,958.00	3.95
4	601166	兴业银行	3,043,827.00	2.81
5	000651	格力电器	2,979,748.00	2.75
6	000858	五粮液	2,420,921.86	2.23
7	601398	工商银行	2,298,302.00	2.12
8	600887	伊利股份	2,267,126.00	2.09
9	600276	恒瑞医药	2,146,192.79	1.98
10	600016	民生银行	2,116,355.00	1.95

11	601328	交通银行	2,050,491.00	1.89
12	600030	中信证券	2,045,824.00	1.89
13	601288	农业银行	1,728,215.00	1.59
14	000002	万 科 A	1,607,752.00	1.48
15	600000	浦发银行	1,557,051.11	1.44
16	601668	中国建筑	1,470,247.45	1.36
17	600900	长江电力	1,378,494.11	1.27
18	002415	海康威视	1,337,969.00	1.23
19	601601	中国太保	1,312,524.00	1.21
20	600837	海通证券	1,275,130.00	1.18

#### 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	601318	中国平安	936,159.00	0.86
2	600519	贵州茅台	450,076.00	0.42
3	600036	招商银行	374,725.00	0.35
4	000651	格力电器	276,472.00	0.25
5	601166	兴业银行	265,481.00	0.24
6	000002	万 科 A	245,663.00	0.23
7	601398	工商银行	204,898.00	0.19
8	600887	伊利股份	198,204.00	0.18
9	601298	青岛港	191,194.24	0.18
10	600016	民生银行	189,115.00	0.17
11	000858	五 粮 液	187,413.00	0.17
12	600030	中信证券	186,713.00	0.17
13	600518	ST 康美	184,149.24	0.17
14	601328	交通银行	183,967.00	0.17
15	000540	中天金融	182,821.20	0.17
16	600276	恒瑞医药	175,453.00	0.16
17	600928	西安银行	174,941.28	0.16
18	002958	青农商行	166,911.00	0.15
19	601288	农业银行	154,253.00	0.14
20	000333	美的集团	153,980.00	0.14



### 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	159,756,343.98
卖出股票收入（成交）总额	12,706,670.71

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

注：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

注：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所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 7.11.3 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股兴业银行。

根据银保监会 2018 年 5 月 4 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表-银保监银罚决字（2018）1 号-兴业银行股份有限公司》的公告，兴业银行因同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保、债券卖出回购业务违规出表、个人理财资金违规投资、向四证不全的房地产项目提供融资等 12 项违规被罚 5870 万元，这 12 项案由中，多涉及违反宏观调控政策、影子银行和交叉金融产品风险以及违法违规展业。与兴业银行一同被罚的还有该银行旗下的兴业金融租赁有限责任公司。兴业金融租赁因未制定明确的服务收费标准并公示以及办理融资租赁业务时搭售理财产品被罚 110 万元。除此之外，兴业银行苏州分行还存在买入返售业务项下基础资产不合规的情况，该银行两名直接责任人受到银保监会处罚。其中，原兴业银行苏州分行行长黄立峰受到警告处分，并被罚款 5 万元；胡刚被警告并罚款 10 万元。根据 4 月 16 日《上海银监局行政处罚信息公开表（沪银监罚决字（2018）12 号）》，2015 年 9 月，兴业银行股份有限公司上海分行在某理财业务中，对底层资产为非标准化债权资产的投资投前尽职调查严重不审慎。责令改正，罚款人民币 50 万元。根据 4 月 2 日中国人民银行福州中心支行公布了福银罚字（2018）10 号行政处罚公示表，兴业银行股份有限公司因违反国库管理规定，被警告并处罚款 5 万元人民币。对以上事件，本基金做出如下说明：兴业银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，公司高度重视内部控制建设，并围绕内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督等方面不断加强和完善内部控制机制。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	46,676.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	4,428.56
5	应收申购款	1,524.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,629.30

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券（可交换债券）。

#### 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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

##### 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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,965	31,483.34	141,626,675.63	64.59%	77,654,758.81	35.41%

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	中国工商银行股份有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	4,000,000.00	5.53%
2	中国工商银行股份有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	3,728,891.00	5.16%
3	余栋腾	2,392,881.00	3.31%
4	王飞舟	1,677,417.00	2.32%
5	靳宁卿	980,000.00	1.36%
6	中国银行股份有限公司企业年金计划—中国农业银行	949,200.00	1.31%
7	纪伟才	938,029.00	1.30%
8	于成福	932,390.00	1.29%
9	洪文煌	859,700.00	1.19%
10	陈美辰	761,556.00	1.05%

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	71.84	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的情况

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、基金投资和相关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	97,526,920.54
本报告期期间基金总申购份额	133,221,569.62
减:本报告期期间基金总赎回份额	11,467,055.72
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	219,281,434.44

## § 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 2019 年第一次临时股东会议决议, 同意钱力不再担任公司第七届董事会董事, 选举严琛担任公司第七届董事会董事。以上董事人员变更, 已向中国证监会北京监管局报备。

因个人原因, 杨思乐向公司申请辞去副总经理职务, 根据公司第七届董事会第十二次会议决议, 杨思乐不再担任公司副总经理职务。以上公司高级管理人员变更, 已向中国证监会北京监管局报备。

根据公司第七届董事会第十三次会议决议, 聘任张壬午担任首席信息官。以上公司高级管理人员变更, 已向中国证监会北京监管局报备。

#### 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 2019 年 5 月 30 日起, 陈亘斯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。自 2019 年 5 月 31 日起, 王超同志不再担任长盛同庆中证 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

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告, 聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、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

本报告期本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	113,499,290.35	66.58%	105,683.00	66.58%	-
光大证券	1	55,130,105.99	32.34%	51,344.12	32.35%	-
东兴证券	1	1,577,586.06	0.93%	1,469.67	0.93%	-

海通证券	1	241,453.19	0.14%	224.86	0.14%	-
联合证券	1	24,499.80	0.01%	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
银河证券	44,129.70	13.05%	-	-	-	-
光大证券	151,814.67	44.91%	-	-	-	-
东兴证券	19,000.00	5.62%	-	-	-	-
海通证券	1,015.40	0.30%	-	-	-	-
联合证券	122,100.00	36.12%	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资力雄厚，信誉良好。

- (3) 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (4) 经营行为规范, 最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。
- (5) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。
- (6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要, 并能为本公司基金提供全面的信息服务。

## 2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 研究机构提出服务意向, 并提供相关研究报告;
- (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定;
- (3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后, 按照研究服务评价规定, 对研究机构进行综合评价;
- (4) 试用期满后, 评价结果符合条件, 双方认为有必要继续合作, 经公司领导审批后, 我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》, 并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用;
- (5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价, 若本公司认为签约机构的服务不能满足要求, 或签约机构违规受到国家有关部门的处罚, 本公司有权终止签署的协议, 并撤销租用的交易单元;
- (6) 交易单元租用协议期限为一年, 到期后若双方没有异议可自动延期一年。

## 3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况:

无

- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况:

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	国泰君安	上海	1

## 10.8 其他重大事件

除上述事项之外, 均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下:

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加 中国银行定投申购优惠活动的公告	《上海证券报》及本公司网站	2019 年 6 月 27 日
2	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、转换转入、	同上	2019 年 6 月 26 日



	定期定额投资业务的公告		
3	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	同上	2019 年 6 月 22 日
4	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 收益分配公告	同上	2019 年 6 月 17 日
5	长盛基金管理有限公司关于高级管理人员 (首席信息官) 变更的公告	同上	2019 年 6 月 15 日
6	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	同上	2019 年 6 月 11 日
7	长盛基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2019 年 6 月 1 日
8	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	同上	2019 年 6 月 1 日
9	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2019 年第 1 季度报告	同上	2019 年 4 月 22 日
10	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2018 年度报告 - 摘要	同上	2019 年 3 月 29 日
11	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2018 年度报告	同上	2019 年 3 月 29 日
12	长盛基金管理有限公司关于中投证券开通旗下部分开放式基金基金定投业务并推出申购 (含定投) 费率优惠活动的公告	同上	2019 年 3 月 29 日
13	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2018 年第 4 季度报告	同上	2019 年 1 月 19 日
14	长盛基金管理有限公司关于增加腾安基金销售 (深圳) 有限公司为旗下部分基金销售机构并推出定投业务和参加费率优惠活动的公告	同上	2019 年 1 月 11 日
15	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)	同上	2019 年 1 月 4 日
16	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新) 摘要	同上	2019 年 1 月 4 日
17	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行基金交易优惠活动的公告	同上	2019 年 1 月 2 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	20190508~20190630	-	74,045,259.81	-	74,045,259.81	33.77%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

### 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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 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

2019 年 8 月 27 日