

# 长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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.....	7
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>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本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.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<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.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>50</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金		
基金简称	长盛同瑞中证 200 分级		
场内简称	长盛同瑞		
基金主代码	160808		
交易代码	160808		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2011 年 12 月 6 日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	11,754,794.09 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012 年 1 月 12 日		
下属分级基金的基金简称	长盛同瑞 A	长盛同瑞 B	长盛同瑞中证 200 分级
下属分级基金场内简称:	同瑞 A	同瑞 B	长盛同瑞
下属分级基金的交易代码	150064	150065	160808
报告期末下属分级基金份额总额	1,220,839.00 份	1,831,258.00 份	8,702,697.09 份

### 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 200 指数的有效跟踪。		
投资策略	<p>本基金采用完全复制法，按照成份股在中证 200 指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合，以拟合、跟踪中证 200 指数的收益表现，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>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 200 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%（其中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 5%）。基金管理人将综合考虑市场情况、基金资产的流动性要求等因素确定各类资产的具体配置比例。</p>		
业绩比较基准	95%×中证 200 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	本基金为完全复制指数的股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，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。		
下属分级基金的风险收益特征	长盛同瑞 A 份额：低风险、收益相对稳定	长盛同瑞 B 份额：高风险、高预期收益	长盛同瑞中证 200 份额：较高风险、较高

			预期收益
--	--	--	------

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	贺倩
	联系电话	010-86497608	010-66060069
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-86497888	95599
传真		010-86497999	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京西城区复兴门内大街 28 号 凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		100029	100031
法定代表人		周兵	周慕冰

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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	-101,048.67
本期利润	1,835,102.27
加权平均基金份额本期利润	0.1501
本期加权平均净值利润率	17.81%
本期基金份额净值增长率	23.48%
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	-3,136,399.70
期末可供分配基金份额利润	-0.2668
期末基金资产净值	10,115,790.67
期末基金份额净值	0.861
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	5.06%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，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。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 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	2.99%	1.12%	2.62%	1.15%	0.37%	-0.03%
过去三个月	-6.31%	1.54%	-7.27%	1.59%	0.96%	-0.05%
过去六个月	23.48%	1.56%	22.07%	1.61%	1.41%	-0.05%
过去一年	-0.50%	1.55%	-0.82%	1.57%	0.32%	-0.02%
过去三年	-5.75%	1.15%	-6.31%	1.16%	0.56%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.06%	1.52%	17.98%	1.57%	-12.92%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准=95%×中证 200 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。



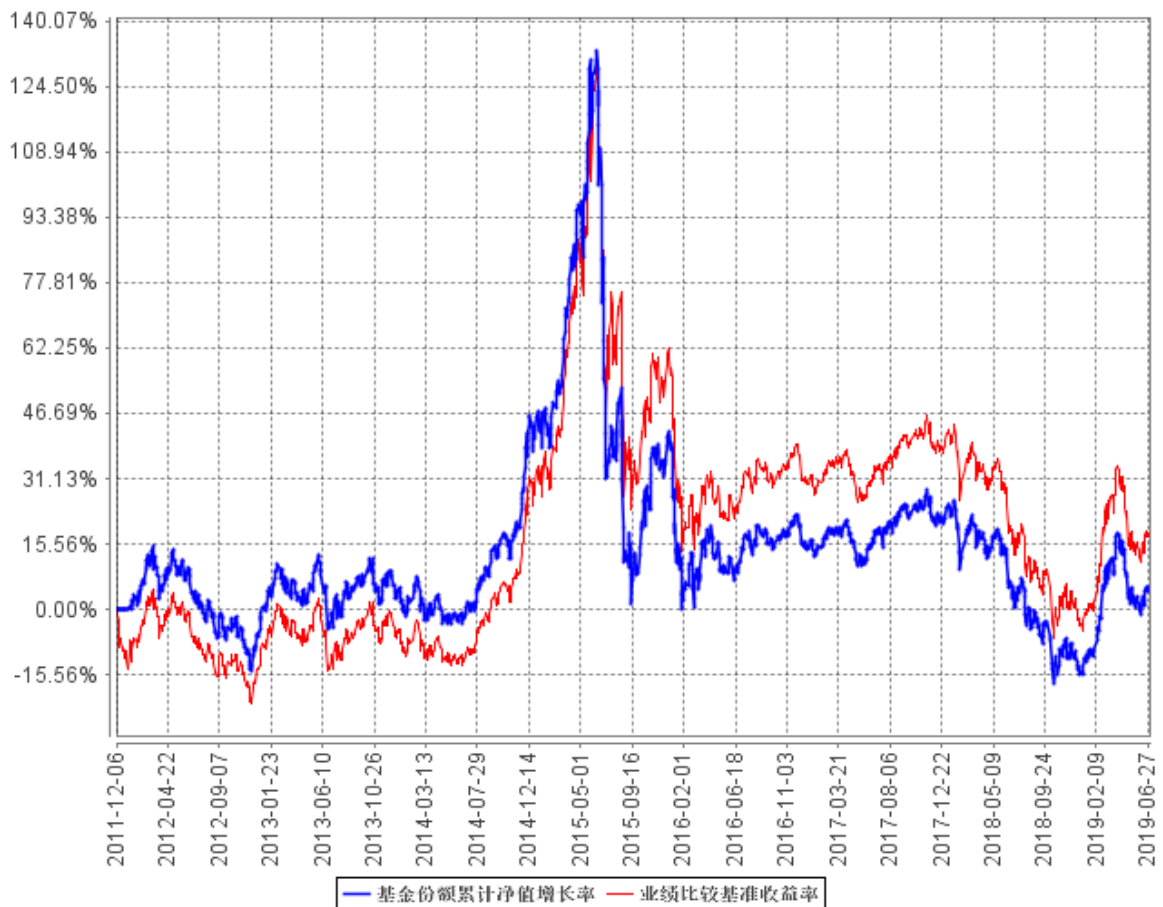
基准指数：中证 200 指数

本基金的业绩比较基准中证 200 指数由中证指数有限公司构建和发布。具体的编制规则和再平衡过程请参见中证 200 指数编制细则。

再平衡：由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，业绩比较基准中证 200 指数、一年期银行定期存款每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

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



## § 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，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）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。	2011 年 12 月 6 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 0.861 元；本报告期基金份额净值增长率为 23.48%，业绩比较基准收益率为 22.07%。本报告期内日均跟踪误差为 0.1107%，年度化跟踪误差为 1.7511%。

#### 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中对基金收益分配的约定，在存续期内，本基金（包括长盛同瑞中证 200 分级份额、长盛同瑞 A 份额、长盛同瑞 B 份额）不进行收益分配。

#### **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**

本基金自 2016 年 6 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日期间出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长盛基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金

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	712,219.05	822,780.61
结算备付金		6,929.99	-
存出保证金		411.22	47.98
交易性金融资产	6.4.7.2	9,519,765.58	7,748,797.07
其中：股票投资		9,519,765.58	7,748,797.07
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	419.85	351.96
应收股利		-	-
应收申购款		513.60	1,214.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,240,259.29	8,573,192.13
<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		41,037.59	25,462.17
应付管理人报酬		6,578.30	5,592.46
应付托管费		1,315.66	1,118.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,576.15	1,418.12
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	73,960.92	69,532.84
负债合计		124,468.62	103,124.09
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	9,963,293.91	10,169,228.11
未分配利润	6.4.7.10	152,496.76	-1,699,160.07
所有者权益合计		10,115,790.67	8,470,068.04
负债和所有者权益总计		10,240,259.29	8,573,192.13

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.861 元，基金份额总额 11,754,794.09 份，其中长盛同瑞 A 基金份额为 1,220,839.00 份，长盛同瑞 B 基金份额为 1,831,258.00 份，长盛同瑞基金份额为 8,702,697.09 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金

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>		1,943,292.51	-1,474,669.83
1.利息收入		6,970.31	7,792.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,967.79	7,787.35
债券利息收入		2.52	4.96
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）		-2,449.93	-91,932.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-65,484.11	-169,164.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,215.88	2,263.00
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	61,818.30	74,968.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,936,150.94	-1,391,290.77
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	2,621.19	761.10



列)			
<b>减：二、费用</b>		108,190.24	159,065.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	38,190.33	45,409.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,638.08	9,081.91
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,771.27	5,292.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	59,590.56	99,282.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,835,102.27	-1,633,735.45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,835,102.27	-1,633,735.45

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金

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）	10,169,228.11	-1,699,160.07	8,470,068.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,835,102.27	1,835,102.27
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）	-205,934.20	16,554.56	-189,379.64
其中：1. 基金申购款	1,971,737.21	101,253.77	2,072,990.98
2. 基金赎回款	-2,177,671.41	-84,699.21	-2,262,370.62
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）	9,963,293.91	152,496.76	10,115,790.67



限公司。

根据《长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金的基金份额包括长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“同瑞基金份额”)、长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“同瑞 A 份额”)及长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“同瑞 B 份额”)。本基金通过场外、场内两种方式公开发售同瑞基金份额。投资人场外认购所得的同瑞基金份额，不进行自动分离或分拆。投资人场内认购所得的同瑞基金份额，将按 4:6 的基金份额配比自动分离为同瑞 A 份额和同瑞 B 份额。同瑞 A 份额和同瑞 B 份额的数量保持 4:6 的比例不变。基金合同生效后，同瑞基金份额将根据基金合同约定分别开放场外和场内申购、赎回，但是不进行上市交易。在满足上市条件的情况下，同瑞 A 份额和同瑞 B 份额将申请上市交易但是不开放申购和赎回等业务。场内同瑞基金份额与同瑞 A 份额和同瑞 B 份额之间可以按照规定约定的规则进行场内份额的配对转换，包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每 1 份场内同瑞基金份额按照 4:6 的份额配比转换成 0.4 份同瑞 A 份额与 0.6 份同瑞 B 份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每 0.4 份同瑞 A 份额与 0.6 份同瑞 B 份额按照 4:6 的基金份额配比转换成 1 份场内同瑞基金份额的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：同瑞基金份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净值除以基金份额总数，其中基金份额总数为同瑞基金份额、同瑞 A 份额和同瑞 B 份额数量的总和。本基金每 0.4 份同瑞 A 份额与每 0.6 份同瑞 B 份额构成一对份额组合，该份额组合的基金份额参考净值之和等于 1 份同瑞基金份额的基金份额净值。同瑞 A 份额的约定收益率为一年期同期银行定期存款利率（税后）+3.5%，同瑞 A 份额的份额净值每日按该约定收益率逐日计算，计算出同瑞 A 份额的基金份额参考净值后，根据同瑞基金份额的基金份额净值与同瑞 A 份额、同瑞 B 份额之间的基金份额参考净值关系，可以计算出同瑞 B 份额的基金份额参考净值。

本基金进行定期份额折算。在本基金存续期内每年第一个工作日(除基金合同生效日所在会计年度外)，本基金将进行基金的定期份额折算：定期份额折算后同瑞 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，基金份额折算基准日折算前同瑞 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为场内同瑞基金份额分配给同瑞 A 份额持有人。同瑞基金份额持有人持有的每 1 份同瑞基金份额将按 0.4 份同瑞 A 份额获得新增同瑞基金份额的分配。持有场外同瑞基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外同瑞基金份额的分配；持有场内同瑞基金份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内同瑞基金份额的分配。经过上述份额折算后，同瑞 A 份额的参考净值和同瑞基金份额的净值将相应调整。在基金份额折算前与折算后，同瑞 A 份额和同瑞 B 份额的份额配比保持 4:6 的比例。同瑞 B 份额不参与定期份额折算，每次定期份额折算不改变

同瑞 B 份额的基金份额参考净值及其份额数。

除以上的定期份额折算外，当同瑞基金份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时，或当同瑞 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，本基金将以该日后的次一交易日为本基金不定期折算基准日，进行不定期份额折算：份额折算后本基金将确保同瑞 A 份额和同瑞 B 份额的比例为 4:6，份额折算后同瑞 A 份额的基金份额参考净值、同瑞 B 份额的基金份额参考净值和同瑞基金份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。当同瑞基金份额的基金份额净值大于或等于 2.000 元时，基金份额折算基准日折算前同瑞基金份额的基金份额净值及同瑞 A 份额、同瑞 B 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分均将折算为同瑞基金份额分别分配给同瑞基金份额、同瑞 A 份额和同瑞 B 份额的持有人。当同瑞 B 份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时，同瑞基金份额、同瑞 A 份额和同瑞 B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2012]4 号核准，本基金同瑞 A 份额 41,364,880.00 份基金份额与同瑞 B 份额 62,047,320.00 份基金份额于 2012 年 1 月 12 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的同瑞基金份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为同瑞 A 份额和同瑞 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的同瑞基金份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为同瑞 A 份额和同瑞 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为股票(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。本基金投资的标的指数为中证 200 指数，股票投资占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资于中证 200 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-10%(其中权证资产占基金资产比例为 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 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等)。本基金通过被动的指数化投资管理，实现对中证指数的有效跟踪，力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 200 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款税后利率}$ 。

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》、《长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金合同》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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2019 年 6 月 30 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日期间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 6 月 30 日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	712,219.05
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：	712,219.05

#### 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	9,841,899.81	9,519,765.58	-322,134.23
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	9,841,899.81	9,519,765.58	-322,134.23

#### 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

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 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	416.88
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	2.79
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	0.18
合计	419.85

#### 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	1,576.15
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,576.15

#### 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	-
应付赎回费	34.56
其他	14,420.80
预提费用	59,505.56
合计	73,960.92

#### 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	11,663,475.23	10,169,228.11
本期申购	27.52	23.98
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
2019年1月2日 基金拆分/份额折算前	11,663,502.75	10,169,252.09



基金拆分/份额折算变动份额	334,919.86	-
本期申购	2,326,008.77	1,971,713.23
本期赎回(以“-”号填列)	-2,569,637.29	-2,177,671.41
本期末	11,754,794.09	9,963,293.91

注：1. 申购含转换入；赎回含转换出。

2. 根据《长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定和《关于长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金定期份额折算结果及同瑞 A 恢复交易的公告》，本基金的基金管理人确定 2019 年 1 月 2 日为份额折算基准日，对同瑞基金份额的场外份额和场内份额以及同瑞 A 份额实施定期份额折算。折算前，同瑞基金份额场外份额总额和场内份额总额分别为 7,712,494.75 份和 859,196.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 0.028715205，折算后同瑞基金份额场外份额总额和场内份额总额分别为 7,933,961.61 份和 972,649.00 份，同瑞基金份额份额净值为 0.696 元；折算前，同瑞 A 份额的份额总额为 1,236,725.00 份，根据基金份额折算公式，份额折算比例为 0.071788012，折算后同瑞 A 份额的份额总额为 1,236,725.00 份，份额净值为 1.000 元。

3. 截至 2019 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的同瑞 A 份额为 1,220,839.00 份，同瑞 B 份额为 1,831,258.00 份，托管在场内未上市交易的同瑞基金份额为 908,208.00 份，托管在场外未上市交易的同瑞基金份额 7,794,489.09 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。同瑞基金份额与同瑞 A 份额、同瑞 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。

#### 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	-3,100,380.76	1,401,220.69	-1,699,160.07
本期利润	-101,048.67	1,936,150.94	1,835,102.27
本期基金份额交易产生的变动数	65,029.73	-48,475.17	16,554.56
其中：基金申购款	-613,679.89	714,933.66	101,253.77
基金赎回款	678,709.62	-763,408.83	-84,699.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,136,399.70	3,288,896.46	152,496.76

**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	6,945.31
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	21.32
其他	1.16
合计	6,967.79

**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	950,384.48
减：卖出股票成本总额	1,015,868.59
买卖股票差价收入	-65,484.11

**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（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,215.88
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	1,215.88

**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	9,218.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,000.00
减：应收利息总额	2.52

买卖债券差价收入	1,215.88
----------	----------

#### 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	61,818.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	61,818.30

#### 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	1,936,150.94
——股票投资	1,936,150.94
——债券投资	-
——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	1,936,150.94

#### 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	2,621.19
合计	2,621.19

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 0.5%，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	2,771.27
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	2,771.27

#### 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	-
上市费	29,752.78
银行汇划费	85.00
合计	59,590.56

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

无。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行	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 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
当期发生的基金应支付的管理费	38,190.33	45,409.55
其中：支付销售机构的客户维护费	12,689.65	15,571.09

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 0.75%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：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	7,638.08	9,081.91

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	712,219.05	6,945.31	1,005,101.13	7,766.53

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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**

注：无。

**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**

注：无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：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。

## 6.4.13 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，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，本基金未持有债券(2018 年 12 月 31 日：同)。

### 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 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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 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的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持证券在证券交易所上市。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。

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。

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、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	712,219.05	-	-	-	712,219.05
结算备付金	6,929.99	-	-	-	6,929.99
存出保证金	411.22	-	-	-	411.22
交易性金融资产	-	-	-	9,519,765.58	9,519,765.58

应收利息	-	-	-	419.85	419.85
应收申购款	-	-	-	513.60	513.60
资产总计	719,560.26	-	-	9,520,699.03	10,240,259.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	41,037.59	41,037.59
应付管理人报酬	-	-	-	6,578.30	6,578.30
应付托管费	-	-	-	1,315.66	1,315.66
应付交易费用	-	-	-	1,576.15	1,576.15
其他负债	-	-	-	73,960.92	73,960.92
负债总计	-	-	-	124,468.62	124,468.62
利率敏感度缺口	719,560.26	-	-	9,396,230.41	10,115,790.67
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	822,780.61	-	-	-	822,780.61
存出保证金	47.98	-	-	-	47.98
交易性金融资产	-	-	-	7,748,797.07	7,748,797.07
应收利息	-	-	-	351.96	351.96
应收申购款	-	-	-	1,214.51	1,214.51
资产总计	822,828.59	-	-	7,750,363.54	8,573,192.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	25,462.17	25,462.17
应付管理人报酬	-	-	-	5,592.46	5,592.46
应付托管费	-	-	-	1,118.50	1,118.50
应付交易费用	-	-	-	1,418.12	1,418.12
其他负债	-	-	-	69,532.84	69,532.84
负债总计	-	-	-	103,124.09	103,124.09
利率敏感度缺口	822,828.59	-	-	7,647,239.45	8,470,068.04

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

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：同），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。

本基金原则上采用复制指数投资策略，股票资产跟踪的标的指数为中证 200 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中包括中证 200 指数成份股、备选成份股、新股（如一级市场初次发行或增发）等，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	9,519,765.58	94.11	7,748,797.07	91.48
合计	9,519,765.58	94.11	7,748,797.07	91.48

##### 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%	492,161.19	424,892.28
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-492,161.19	-424,892.28	

#### 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 9,519,765.58 元，无属于第二层次、第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 7,701,788.57 元，无属于第二层次的余额，第三层次的余额为 47,008.50 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

	交易性金融资产		合计	
	债券投资	权益工具投资	债券投资	权益工具投资
2019 年 1 月 1 日	-	47,008.50	-	47,008.50
购买	-		-	-
出售	-	60,228.09	-	60,228.09
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	-	-	-
当期利得或损失总额	-	13,219.59	-	13,219.59
计入损益的利得或损失	-	13,219.59	-	13,219.59
2019 年 6 月 30 日	-	0.00	-	0.00
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	-	-	-	-

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	9,519,765.58	92.96
	其中：股票	9,519,765.58	92.96
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	719,149.04	7.02
8	其他各项资产	1,344.67	0.01
9	合计	10,240,259.29	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	142,271.80	1.41
B	采矿业	226,080.56	2.23
C	制造业	5,151,018.06	50.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	254,659.00	2.52
E	建筑业	184,229.67	1.82
F	批发和零售业	255,596.66	2.53
G	交通运输、仓储和邮政业	236,032.46	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	838,436.46	8.29
J	金融业	905,979.95	8.96
K	房地产业	417,797.10	4.13
L	租赁和商务服务业	33,512.08	0.33
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	35,140.69	0.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	178,327.10	1.76
R	文化、体育和娱乐业	97,050.28	0.96
S	综合	-	-
	合计	8,956,131.87	88.54

### 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	-	-
B	采矿业	47,098.56	0.47
C	制造业	80,873.10	0.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	14,004.00	0.14
F	批发和零售业	62,623.78	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	31,650.77	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	237,428.36	2.35
J	金融业	57,066.00	0.56
K	房地产业	4,404.50	0.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	28,484.64	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	563,633.71	5.57

### 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	002230	科大讯飞	7,750	257,610.00	2.55

2	600332	白云山	4,774	195,590.78	1.93
3	600031	三一重工	13,700	179,196.00	1.77
4	000338	潍柴动力	14,544	178,745.76	1.77
5	601939	建设银行	23,900	177,816.00	1.76
6	601012	隆基股份	7,406	171,152.66	1.69
7	600570	恒生电子	2,374	161,788.10	1.60
8	002475	立讯精密	5,979	148,219.41	1.47
9	002714	牧原股份	2,420	142,271.80	1.41
10	600436	片仔癀	1,100	126,720.00	1.25
11	600588	用友网络	4,688	126,013.44	1.25
12	300015	爱尔眼科	3,830	118,615.10	1.17
13	601155	新城控股	2,898	115,369.38	1.14
14	600352	浙江龙盛	7,108	112,093.16	1.11
15	600547	山东黄金	2,702	111,241.34	1.10
16	000876	新希望	6,200	107,694.00	1.06
17	600660	福耀玻璃	4,700	106,831.00	1.06
18	000661	长春高新	300	101,400.00	1.00
19	600741	华域汽车	4,500	97,200.00	0.96
20	002202	金风科技	7,713	95,872.59	0.95
21	600196	复星医药	3,638	92,041.40	0.91
22	300142	沃森生物	3,200	90,752.00	0.90
23	601377	兴业证券	13,400	90,316.00	0.89
24	600271	航天信息	3,869	89,180.45	0.88
25	600886	国投电力	11,100	86,247.00	0.85
26	002008	大族激光	2,502	86,018.76	0.85
27	002007	华兰生物	2,742	83,603.58	0.83
28	000100	TCL 集团	24,000	79,920.00	0.79
29	600111	北方稀土	6,200	79,608.00	0.79
30	000963	华东医药	3,048	79,126.08	0.78
31	601901	方正证券	11,100	78,921.00	0.78
32	300033	同花顺	800	78,688.00	0.78
33	600795	国电电力	30,900	78,486.00	0.78
34	000157	中联重科	12,928	77,697.28	0.77
35	600383	金地集团	6,500	77,545.00	0.77
36	300124	汇川技术	3,301	75,625.91	0.75
37	601607	上海医药	4,100	74,415.00	0.74
38	000423	东阿阿胶	1,812	72,153.84	0.71
39	002422	科伦药业	2,400	71,352.00	0.71
40	600029	南方航空	9,228	71,240.16	0.70



41	000783	长江证券	9,083	70,938.23	0.70
42	600438	通威股份	5,000	70,300.00	0.69
43	601600	中国铝业	17,900	70,168.00	0.69
44	300003	乐普医疗	3,001	69,083.02	0.68
45	300122	智飞生物	1,600	68,960.00	0.68
46	600705	中航资本	12,200	66,124.00	0.65
47	600089	特变电工	8,999	65,242.75	0.64
48	002311	海大集团	2,100	64,890.00	0.64
49	601555	东吴证券	6,204	63,591.00	0.63
50	600867	通化东宝	4,047	62,323.80	0.62
51	002236	大华股份	4,250	61,710.00	0.61
52	601919	中远海控	12,155	61,018.10	0.60
53	600487	亨通光电	3,640	61,006.40	0.60
54	600674	川投能源	6,800	60,520.00	0.60
55	601877	正泰电器	2,600	60,034.00	0.59
56	002044	美年健康	4,800	59,712.00	0.59
57	600066	宇通客车	4,538	59,084.76	0.58
58	600489	中金黄金	5,724	58,785.48	0.58
59	002153	石基信息	1,622	58,700.18	0.58
60	601788	光大证券	5,100	58,242.00	0.58
61	600177	雅戈尔	9,112	57,861.20	0.57
62	000768	中航飞机	3,665	57,723.75	0.57
63	000425	徐工机械	12,926	57,649.96	0.57
64	002460	赣锋锂业	2,450	57,403.50	0.57
65	600176	中国巨石	6,000	57,180.00	0.57
66	600100	同方股份	6,300	57,015.00	0.56
67	600522	中天科技	6,200	56,854.00	0.56
68	300136	信维通信	2,300	56,235.00	0.56
69	002493	荣盛石化	4,600	55,476.00	0.55
70	002241	歌尔股份	6,202	55,135.78	0.55
71	600109	国金证券	5,625	54,675.00	0.54
72	600893	航发动力	2,400	54,504.00	0.54
73	600085	同仁堂	1,838	53,302.00	0.53
74	002466	天齐锂业	2,101	53,113.28	0.53
75	600516	方大炭素	4,321	53,105.09	0.52
76	300024	机器人	3,469	52,832.87	0.52
77	000413	东旭光电	10,100	51,914.00	0.51
78	002081	金螳螂	4,933	50,859.23	0.50
79	300017	网宿科技	4,692	50,579.76	0.50

80	300408	三环集团	2,600	50,570.00	0.50
81	600068	葛洲坝	8,100	50,463.00	0.50
82	600498	烽火通信	1,801	50,175.86	0.50
83	600362	江西铜业	3,168	49,864.32	0.49
84	601021	春秋航空	1,100	49,500.00	0.49
85	002673	西部证券	4,900	49,392.00	0.49
86	600809	山西汾酒	700	48,335.00	0.48
87	600637	东方明珠	4,580	48,273.20	0.48
88	600118	中国卫星	2,101	47,377.55	0.47
89	300144	宋城演艺	2,042	47,251.88	0.47
90	000630	铜陵有色	19,010	46,764.60	0.46
91	002508	老板电器	1,700	46,138.00	0.46
92	600038	中直股份	1,100	45,122.00	0.45
93	600535	天士力	2,701	44,701.55	0.44
94	600153	建发股份	5,032	44,684.16	0.44
95	600398	海澜之家	4,800	43,536.00	0.43
96	000786	北新建材	2,400	43,512.00	0.43
97	002146	荣盛发展	4,594	43,137.66	0.43
98	601198	东兴证券	3,600	42,768.00	0.42
99	600219	南山铝业	18,900	42,714.00	0.42
100	600369	西南证券	8,628	42,622.32	0.42
101	600583	海油工程	6,900	38,640.00	0.38
102	600221	海航控股	18,840	38,245.20	0.38
103	000709	河钢股份	12,254	36,639.46	0.36
104	002294	信立泰	1,600	35,808.00	0.35
105	300070	碧水源	4,511	35,140.69	0.35
106	002065	东华软件	5,022	35,103.78	0.35
107	600688	上海石化	6,700	34,572.00	0.34
108	000625	长安汽车	5,100	33,813.00	0.33
109	600816	安信信托	6,668	33,673.40	0.33
110	600415	小商品城	8,134	33,512.08	0.33
111	600208	新湖中宝	10,624	33,359.36	0.33
112	600482	中国动力	1,400	33,068.00	0.33
113	002456	欧菲光	4,213	33,029.92	0.33
114	603799	华友钴业	1,538	32,774.78	0.32
115	600170	上海建工	8,619	32,407.44	0.32
116	000402	金融街	4,126	32,347.84	0.32
117	603833	欧派家居	300	32,286.00	0.32
118	002050	三花智控	3,020	31,861.00	0.31

119	002602	世纪华通	2,876	31,405.92	0.31
120	300072	三聚环保	3,900	30,927.00	0.31
121	000671	阳光城	4,700	30,456.00	0.30
122	601117	中国化学	5,000	30,100.00	0.30
123	002411	延安必康	1,700	29,580.00	0.29
124	600027	华电国际	7,800	29,406.00	0.29
125	600704	物产中大	5,401	29,273.42	0.29
126	601992	金隅集团	7,552	28,395.52	0.28
127	600926	杭州银行	3,400	28,322.00	0.28
128	600977	中国电影	1,800	28,188.00	0.28
129	600297	广汇汽车	6,300	28,098.00	0.28
130	601216	君正集团	8,500	27,965.00	0.28
131	000961	中南建设	3,201	27,720.66	0.27
132	600372	中航电子	1,801	26,726.84	0.26
133	000938	紫光股份	980	26,705.00	0.26
134	601997	贵阳银行	2,840	24,566.00	0.24
135	000627	天茂集团	3,700	24,013.00	0.24
136	002555	三七互娱	1,600	21,680.00	0.21
137	300251	光线传媒	3,178	21,610.40	0.21
138	002310	东方园林	3,400	20,400.00	0.20
139	600188	兖州煤业	1,602	17,413.74	0.17
140	600233	圆通速递	1,300	16,029.00	0.16
141	603160	汇顶科技	100	13,880.00	0.14
142	603858	步长制药	460	11,854.20	0.12

### 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	600406	国电南瑞	8,297	154,656.08	1.53
2	600739	辽宁成大	4,307	62,623.78	0.62
3	000503	国新健康	3,008	51,617.28	0.51
4	002797	第一创业	5,700	36,138.00	0.36
5	002572	索菲亚	1,800	33,408.00	0.33
6	601333	广深铁路	9,799	31,650.77	0.31
7	600549	厦门钨业	2,210	31,625.10	0.31
8	000839	中信国安	7,750	31,155.00	0.31
9	000826	启迪桑德	2,416	28,484.64	0.28
10	000983	西山煤电	4,600	27,876.00	0.28

11	600909	华安证券	3,200	20,928.00	0.21
12	600157	永泰能源	11,442	19,222.56	0.19
13	000959	首钢股份	4,500	15,840.00	0.16
14	601611	中国核建	1,800	14,004.00	0.14
15	000540	中天金融	1,150	4,404.50	0.04

#### 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	002230	科大讯飞	129,655.00	1.53
2	601012	隆基股份	39,317.90	0.46
3	600332	白云山	17,380.00	0.21
4	601939	建设银行	17,044.00	0.20
5	600031	三一重工	16,650.00	0.20
6	002202	金风科技	16,413.26	0.19
7	000338	潍柴动力	16,390.00	0.19
8	601877	正泰电器	16,281.00	0.19
9	600406	国电南瑞	14,966.00	0.18
10	002475	立讯精密	14,323.00	0.17
11	600352	浙江龙盛	11,260.00	0.13
12	000876	新希望	9,666.00	0.11
13	600660	福耀玻璃	9,409.00	0.11
14	600741	华域汽车	8,819.00	0.10
15	600588	用友网络	8,751.00	0.10
16	600886	国投电力	8,537.00	0.10
17	000100	TCL 集团	8,231.00	0.10
18	601377	兴业证券	8,145.00	0.10
19	600196	复星医药	8,020.00	0.09
20	600795	国电电力	7,908.00	0.09

##### 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	000540	中天金融	60,350.00	0.71
2	000792	*ST 盐湖	27,838.48	0.33

3	000338	潍柴动力	22,845.00	0.27
4	601939	建设银行	22,648.00	0.27
5	002230	科大讯飞	22,309.00	0.26
6	600031	三一重工	22,309.00	0.26
7	600332	白云山	19,948.00	0.24
8	600406	国电南瑞	19,352.00	0.23
9	002475	立讯精密	16,333.00	0.19
10	600588	用友网络	13,869.00	0.16
11	600352	浙江龙盛	12,458.00	0.15
12	002714	牧原股份	12,441.00	0.15
13	000876	新希望	11,622.00	0.14
14	601377	兴业证券	11,583.00	0.14
15	002202	金风科技	11,478.00	0.14
16	601012	隆基股份	11,341.00	0.13
17	600660	福耀玻璃	11,131.00	0.13
18	000100	TCL 集团	10,747.00	0.13
19	600886	国投电力	10,544.00	0.12
20	600795	国电电力	10,179.00	0.12

#### 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	850,686.16
卖出股票收入（成交）总额	950,384.48

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投资。

**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**

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，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	411.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	419.85
5	应收申购款	513.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,344.67

#### **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处于转股期的可转换债券（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

份额级别	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
长盛同瑞 A	158	7,726.83	0.00	0.00%	1,220,839.00	100.00%
长盛同瑞 B	865	2,117.06	0.00	0.00%	1,831,258.00	100.00%
长盛同瑞 中证 200 分 级	2,477	3,513.40	522,026.05	6.00%	8,180,671.04	94.00%
合计	3,500	3,358.51	522,026.05	4.44%	11,232,768.04	95.56%

注：1、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。

2、对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

长盛同瑞 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	周达宏	165,300.00	13.54%
2	何峻	151,418.00	12.40%
3	吴益群	132,674.00	10.87%
4	李燕	128,848.00	10.55%
5	黄晖	125,000.00	10.24%
6	康凯	90,100.00	7.38%
7	苏全胜	57,000.00	4.67%
8	王少男	49,476.00	4.05%
9	张殿刚	46,982.00	3.85%
10	方纯	34,200.00	2.80%

长盛同瑞 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	谢志松	97,587.00	5.33%
2	杜炳金	68,144.00	3.72%
3	谢昭镇	55,764.00	3.05%
4	林锦龙	53,578.00	2.93%
5	丁兴朝	45,137.00	2.46%



6	张润强	35,136.00	1.92%
7	甘遵义	33,819.00	1.85%
8	李小剑	30,289.00	1.65%
9	戚海勇	29,258.00	1.60%
10	杨吉利	28,983.00	1.58%

注：1、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。

2、对于长盛同瑞 A、长盛同瑞 B 前十名持有人持有份额比例的分母采用各自级别的份额。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长盛同瑞 A	0.00	0.0000%
	长盛同瑞 B	0.00	0.0000%
	长盛同瑞中证 200 分级	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 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	份额级别	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	长盛同瑞 A	0
	长盛同瑞 B	0
	长盛同瑞中证 200 分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛同瑞 A	0
	长盛同瑞 B	0
	长盛同瑞中证 200 分级	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛同瑞 A	长盛同瑞 B	长盛同瑞中证 200 分级
基金合同生效日（2011 年 12 月 6 日）基金份额总额	41,364,880.00	62,047,320.00	519,784,068.63
本报告期期初基金份额总额	1,236,725.00	1,855,087.00	8,571,663.23
本报告期期间基金总申购份额	-	-	2,326,036.29
减:本报告期期间基金总赎回份额	-	-	2,569,637.29
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-15,886.00	-23,829.00	374,634.86
本报告期末基金份额总额	1,220,839.00	1,831,258.00	8,702,697.09

注：1、拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

2、依照本基金合同的规定，本基金于 2019 年 1 月 2 日进行了份额折算。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理。自 2019 年 5 月 31 日起，王超同志不再担任长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理。

#### 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

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
华创证券	1	954,951.00	53.52%	889.39	53.52%	-
国联证券	1	829,413.48	46.48%	772.43	46.48%	-

### 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
华创证券	9,218.40	100.00%	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

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：无。

## 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	长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金 B 类份额 溢价风险提示公告	《证券日报》及本公司网站	2019 年 6 月 27 日
2	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	同上	2019 年 6 月 27 日
3	长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金暂停场内申购业务并暂停跨系统转托管（场外转场内）业务的公告	同上	2019 年 6 月 26 日
4	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
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
7	长盛基金管理有限公司关于调整长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理的公告	同上	2019 年 6 月 1 日
8	长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	同上	2019 年 4 月 22 日
9	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金 参加中国工商银行个人电子银行基金 申购优惠活动的公告	同上	2019 年 4 月 1 日
10	长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金 2018 年度报告 摘要	同上	2019 年 3 月 29 日
11	长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金 2018 年度报告	同上	2019 年 3 月 29 日
12	长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2019 年 1 月 19 日
13	长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金招募说明书（更新）摘要	同上	2019 年 1 月 19 日
14	长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资	同上	2019 年 1 月 19 日

	基金 2018 年第 4 季度报告		
15	关于长盛同瑞 A 份额定期份额折算后次日 前收盘价调整的公告	同上	2019 年 1 月 4 日
16	关于长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金定期份额折算 结果及同瑞 A 恢复交易的公告	同上	2019 年 1 月 4 日
17	长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金 关于长盛同瑞 A 份额调整约定年收益率的公告	同上	2019 年 1 月 3 日
18	关于长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务期间同瑞 A 份额停复牌的公告	同上	2019 年 1 月 3 日
19	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
20	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加工商银行定投申购优惠活动的公告	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

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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、关于中国证券监督管理委员会同意设立长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金的批复；
- 2、《长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金招募说明书》；
- 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场所及/或管理人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