

长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 21 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 20 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。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 10 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 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..... | 11 |
| 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 15 |
| 4.9 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..... | 15 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 16 |
| §6 审计报告 | 17 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 17 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 17 |
| §7 年度财务报表 | 19 |
| 7.1 资产负债表..... | 19 |
| 7.2 利润表..... | 20 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 21 |
| 7.4 报表附注..... | 22 |
| §8 投资组合报告 | 47 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 47 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 47 |
| 8.3 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..... | 48 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 50 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 54 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 54 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 54 |

| | |
|---|-----------|
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 54 |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 54 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 55 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 55 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 55 |
| §9 基金份额持有人信息 | 57 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 57 |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 | 57 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 57 |
| 9.4 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 | 57 |
| §10 开放式基金份额变动 | 58 |
| §11 重大事件揭示 | 59 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 59 |
| 11.2 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 | 59 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 59 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 59 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 59 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 60 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 60 |
| 11.8 其他重大事件 | 61 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 | 65 |
| 12.1 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 | 65 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 65 |
| §13 备查文件目录 | 66 |
| 13.1 备查文件目录 | 66 |
| 13.2 存放地点 | 66 |
| 13.3 查阅方式 | 66 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|----------------------------|
| 基金名称 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF） |
| 基金简称 | 长盛同益成长回报混合（LOF） |
| 场内简称 | 长盛同益 |
| 基金主代码 | 160812 |
| 交易代码 | 160812 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 4 月 4 日 |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 136,890,312.32 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 | 2014 年 6 月 4 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 通过自上而下筛选增长预期良好或景气复苏的行业，结合挖掘目标行业的上市公司基本面，自下而上精选个股，为投资者实现资产长期增值，力争获得绝对回报。 |
| 投资策略 | <p>本基金将通过深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，动态调整基金资产在股票、股指期货、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>股票投资策略上，本基金将充分发挥基金管理人研究团队和投资团队“自下而上”的主动选股能力，采用定性和定量相结合的方式，以深入的基本面研究为基础，结合数据挖掘技术，密切跟踪市场景气变化，挖掘具有快速成长预期、且估值相对较低的个股进行投资，并通过对股票投资机会的精细操作，审慎选择投资时机，力争获取正回报。</p> <p>本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p> <p>本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，在市场向下带动净值走低时，通过股指期货快速降低投资组合的仓位，从而调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特</p> |

| | |
|--------|---|
| | 性；并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时，通过股指期货快速提高投资组合的仓位，从而提高基金资产收益。本基金的权证投资是以权证的市值价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。 |
| 业绩比较基准 | 50%*沪深300指数收益率+50%*中证综合债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于混合型证券投资基金，属于较高风险、较高收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 |

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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张利宁 | 郭明 |
| | 联系电话 | 010-86497608 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | zhangln@csfunds.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-888-2666 010-86497888 | 95588 |
| 传真 | | 010-86497999 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼10D | 北京市西城区复兴门内大街55号 |
| 办公地址 | | 北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心3-5层 | 北京市西城区复兴门内大街55号 |
| 邮政编码 | | 100029 | 100140 |
| 法定代表人 | | 周兵 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.csfunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |
|--------|--------------------|------------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2019 年 | 2018 年 | 2017 年 |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期已实现收益 | 13,144,187.67 | -10,453,786.18 | 2,998,665.80 |
| 本期利润 | 48,274,035.85 | -33,530,223.79 | 16,544,541.21 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.4131 | -0.3182 | 0.1215 |
| 本期加权平均净值利润率 | 29.29% | -22.49% | 8.30% |
| 本期基金份额净值增长率 | 32.70% | -21.06% | 8.49% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2019 年末 | 2018 年末 | 2017 年末 |
| 期末可供分配利润 | 83,217,328.29 | 21,901,136.47 | 58,641,728.60 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6079 | 0.2120 | 0.5342 |
| 期末基金资产净值 | 220,012,907.10 | 125,139,057.78 | 168,329,516.82 |
| 期末基金份额净值 | 1.607 | 1.211 | 1.534 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2019 年末 | 2018 年末 | 2017 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 59.40% | 20.12% | 52.16% |

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（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 12 月 31 日。

4、本基金由同益证券投资基金转型而来，转型日期为 2014 年 4 月 4 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-----------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 10.07% | 0.68% | 4.30% | 0.37% | 5.77% | 0.31% |
| 过去六个月 | 19.57% | 0.85% | 4.95% | 0.43% | 14.62% | 0.42% |
| 过去一年 | 32.70% | 1.10% | 19.92% | 0.62% | 12.78% | 0.48% |
| 过去三年 | 13.65% | 0.92% | 19.92% | 0.56% | -6.27% | 0.36% |
| 过去五年 | 11.91% | 1.40% | 24.97% | 0.77% | -13.06% | 0.63% |
| 自基金转型日起至今 | 59.40% | 1.36% | 65.74% | 0.75% | -6.34% | 0.61% |

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

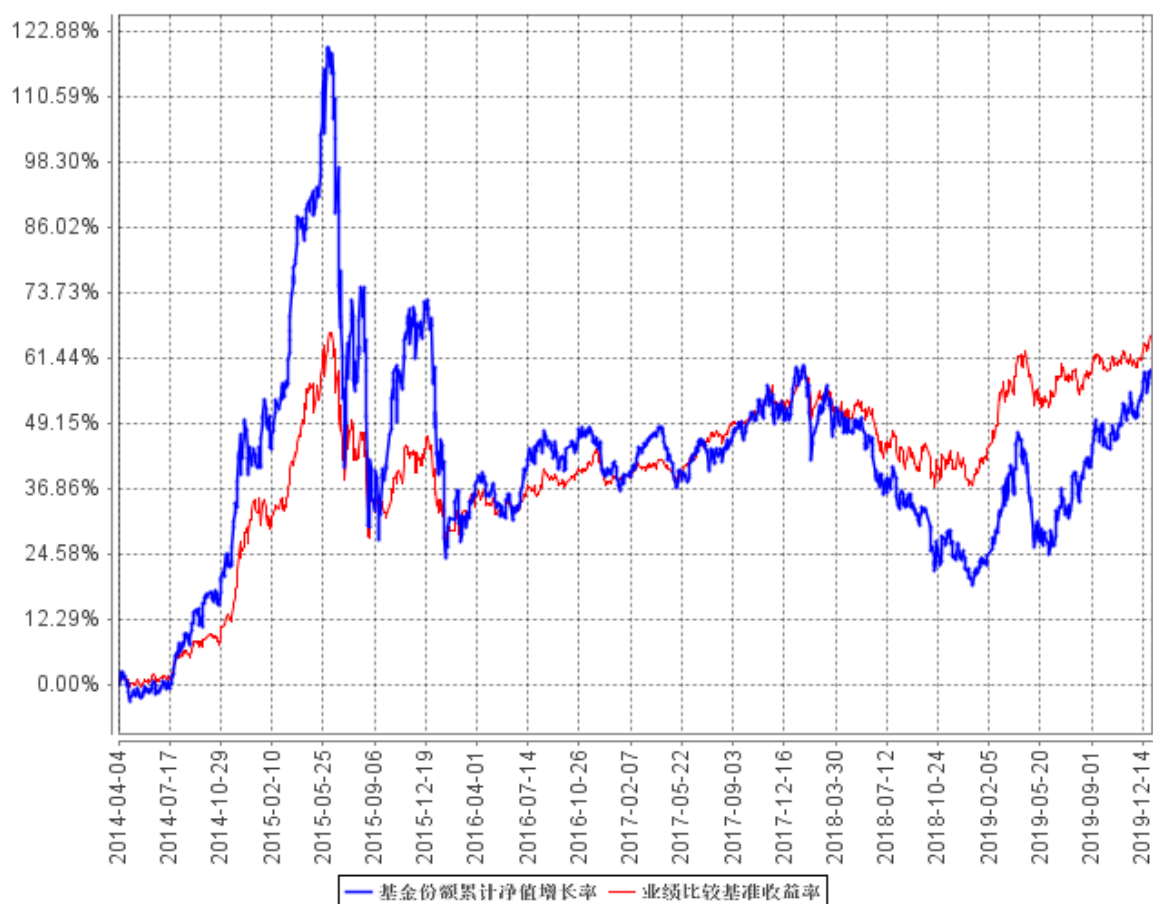
本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 50\% \times \text{中证综合债指数收益率}$

基准指数的构建考虑了三个原则：

- 1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证全债指数。目前沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，用为衡量本基金业绩的基准较为合适。
- 2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；根据本基金较为灵活的资产配置策略来确定加权计算的权数，可使业绩比较更具有合理性。
- 3、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，基准指数每日按照 50%、50%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

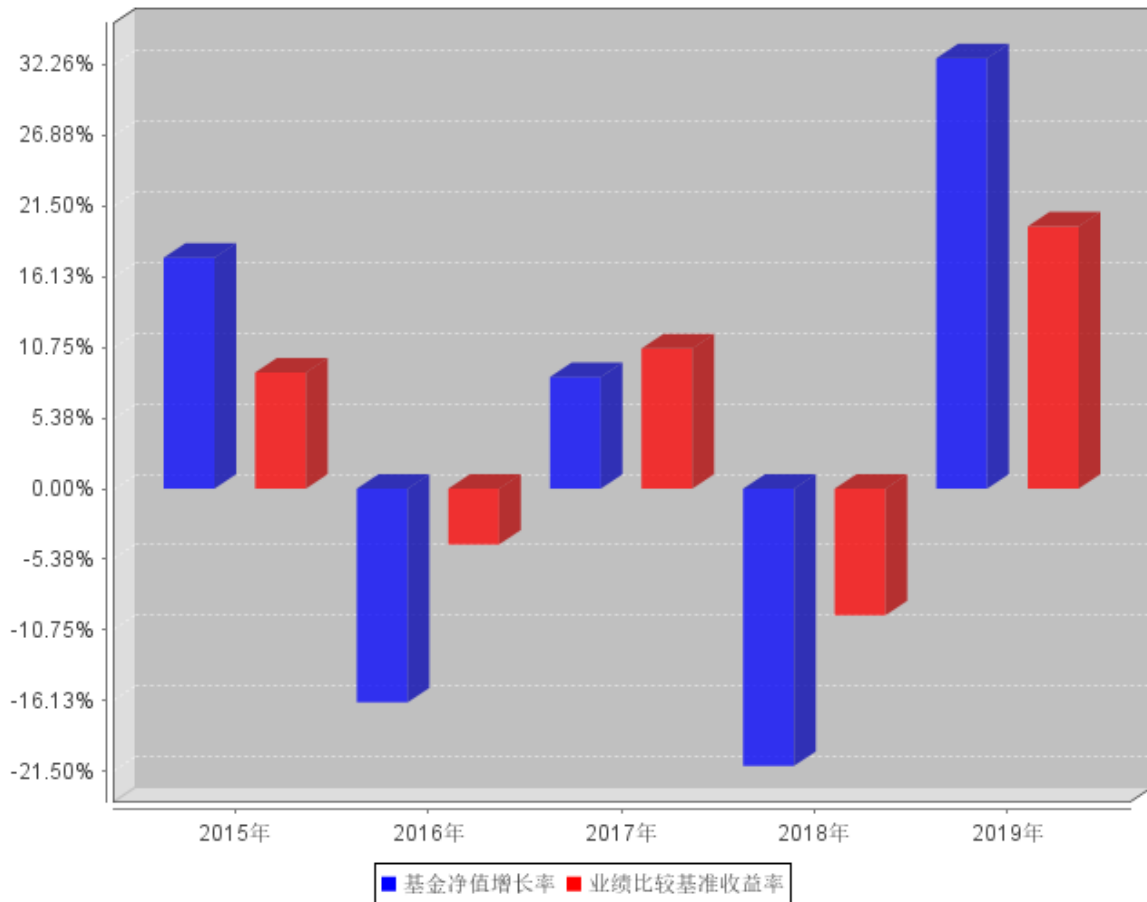


注：1、长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同益证券投资基金转型而来，转型日期为2014年4月4日（即基金合同生效日）。

2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金于 2019 年度、2018 年度、2017 年度会计期间未进行利润分配。

§ 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 12 月 31 日，基金管理人共管理六十只开放式基金，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 | | |
| 张谊然 | 本基金基金经理，长盛同享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 | 2019 年 5 月 22 日 | - | 11 年 | 张谊然女士，硕士。曾任中国国际金融股份有限公司基础分析组分析员。2012 年 9 月加入长盛基金管理有限公司，现任研究部总监助理。 |
| 乔培涛 | 本基金基金经理。 | 2017 年 3 月 17 日 | 2019 年 5 月 23 日 | 11 年 | 乔培涛先生，硕士。曾任长城证券研究员、行业研究部经理。2011 年 8 月加入长盛基金管理有限公司。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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

公司对该基金过去 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易

成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易。

本报告期内，本基金未发生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，市场整体呈现类 N 型走势，结构性机会明显。年初，在财政政策前置发力与金融机构年初加快信贷投放的共同作用下，叠加市场预期回暖、风险偏好修复、外资流入等因素，资本市场出现一波快速上涨行情。4 月，随着政治局会议对于前期偏乐观的宏观、流动性环境予以修正，叠加 5、6 月中美贸易谈判阶段性中断，包商银行被接管并发酵，导致市场情绪快速降温，市场震荡回落。三、四季度，市场维持震荡格局，结构性机会明显。一方面以 5G 为代表的相关产业链表现持续活跃并有所扩散，另一方面，11-12 月，随着经济企稳预期提升，以及地产竣工数据好转，地产产业链有所修复。

报告期内，本组合对于优质的蓝筹股以及处在长期成长赛道的成长股积极操作，组合风格保持均衡，组合仓位根据市场情况动态调整。

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 1.607 元；本报告期基金份额净值增长率为 32.70%，业绩比较基准收益率为 19.92%。

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 2020 年，受疫情的冲击，中国经济下行压力加大，但考虑保持就业稳定的需要，经济增速要维持在合理区间，稳增长政策将陆续出台。流动性层面，预计央行将采取多种手段保持整体流动性合理充裕，但通胀阶段性维持高位可能将掣肘货币政策显著宽松。市场方面，具有基本面支持的行业、个股依然是投资的重点，具体关注以下主线：1) 盈利能够保持稳定的优质消费龙头；2) 基本面与政策红利叠加的先进制造业及高科技产业，如 5G 产业链、新能源产业链等；3) 关注高股息品种的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合规运作，保障资产委托人利益出发，结合监管要求、市场形势及自身业务发展需要，由独立于业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产的运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时督促相关部门改进，并定期制作检查报告报送公司管理层。具体工作情况如下：

1、强调合规宣导与培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种形式，有重点、有针对性地开展合规

培训工作，深化员工合规理念，提高员工合规意识，改善员工合规工作技能，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、持续推动公司完善制度规章建设，扎实公司内控制度基础。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时督促业务部门调整相关业务制度与流程，保证公司制度规章的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司新订或修订了《公司信息披露管理规则》《公司信息披露管理流程》《公司转融通业务及风险管理办法》《营销策划中心舆情管理及媒体危机处理规定》《关于参加股东大会和对外行使表决权的工作指引》《公司公平交易细则》《长盛基金管理有限公司风险控制制度》《交易部可转换公司债券网下申购业务操作细则》《交易部上交所固定收益平台债券交易细则》《交易部深交所综合协议平台债券交易细则》《交易部网下新股申购业务管理细则》等多部制度或流程。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》的规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，严肃制度规章执行力，合理保障公司运营及受托资产投资运作合规。报告期内，公司监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核四十余项，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、产品开发、员工行为等。此外，根据业务发展需要、监管机构通报的业内问题，以及公司在日常监督中发现的问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题整改效率与效果，合理保障公司及受托资产合规、稳健运作。

5、积极参与新产品设计、新业务拓展工作，提供合规意见或建议。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

4.7 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。

4.8 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，本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至 2019 年 12 月 31 日，期末可供分配利润为 83,217,328.29 元，其中：未分配利润已实现部分为 112,914,428.59 元，未分配利润未实现部分为-29,697,100.30 元。

4.9 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

本报告期内，本基金托管人在对长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的管理人——长盛基金管理有限公司在长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|------------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 安永华明（2020）审字第 60468688_A06 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|-----------------|---|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 |
| 其他信息 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的财务报告过程。 |

| | |
|-----------------|--|
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 王珊珊 马剑英 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 北京 |
| 审计报告日期 | 2020 年 4 月 17 日 |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 43,844,579.70 | 63,040,663.52 |
| 结算备付金 | | 321,179.50 | 117,836.00 |
| 存出保证金 | | 80,039.69 | 19,211.46 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 178,201,081.22 | 63,977,609.80 |
| 其中：股票投资 | | 178,201,081.22 | 63,977,609.80 |
| 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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 1,390,404.19 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 8,746.41 | 12,559.67 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 9.99 | 125.82 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 223,846,040.70 | 127,168,006.27 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 1,662,503.81 | - |
| 应付赎回款 | | 19,137.35 | 9.24 |
| 应付管理人报酬 | | 273,540.44 | 163,489.61 |
| 应付托管费 | | 45,590.07 | 27,248.29 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 188,494.95 | 44,406.46 |
| 应交税费 | | 815,699.68 | 815,699.68 |
| 应付利息 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 828,167.30 | 978,095.21 |
| 负债合计 | | 3,833,133.60 | 2,028,948.49 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 136,795,578.81 | 103,237,921.31 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 83,217,328.29 | 21,901,136.47 |
| 所有者权益合计 | | 220,012,907.10 | 125,139,057.78 |
| 负债和所有者权益总计 | | 223,846,040.70 | 127,168,006.27 |

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 1.607 元，基金份额总额 136,890,312.32 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| 一、收入 | | 52,935,021.52 | -29,980,993.17 |
| 1. 利息收入 | | 290,515.61 | 519,667.72 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 290,515.61 | 463,563.79 |
| 债券利息收入 | | - | 56,103.93 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 17,501,280.61 | -7,436,282.82 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 15,099,685.71 | -8,624,570.81 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | - | 22,102.80 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 2,401,594.90 | 1,166,185.19 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 35,129,848.18 | -23,076,437.61 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | 13,377.12 | 12,059.54 |
| 减：二、费用 | | 4,660,985.67 | 3,549,230.62 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 2,470,112.70 | 2,236,873.90 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 411,685.52 | 372,812.41 |

| | | | |
|----------------------------|----------|---------------|----------------|
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 1,511,326.45 | 512,753.31 |
| 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 | 7.4.7.20 | 267,861.00 | 426,791.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 48,274,035.85 | -33,530,223.79 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 48,274,035.85 | -33,530,223.79 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019年1月1日至2019年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年12月31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） | 103,237,921.31 | 21,901,136.47 | 125,139,057.78 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 48,274,035.85 | 48,274,035.85 |
| 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） | 33,557,657.50 | 13,042,155.97 | 46,599,813.47 |
| 其中：1. 基金申购款 | 41,015,301.53 | 16,128,202.52 | 57,143,504.05 |
| 2. 基金赎回款 | -7,457,644.03 | -3,086,046.55 | -10,543,690.58 |
| 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） | 136,795,578.81 | 83,217,328.29 | 220,012,907.10 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31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） | 109,687,788.22 | 58,641,728.60 | 168,329,516.82 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -33,530,223.79 | -33,530,223.79 |
| 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） | -6,449,866.91 | -3,210,368.34 | -9,660,235.25 |
| 其中：1. 基金申购款 | 187,992.58 | 72,402.15 | 260,394.73 |
| 2. 基金赎回款 | -6,637,859.49 | -3,282,770.49 | -9,920,629.98 |
| 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） | 103,237,921.31 | 21,901,136.47 | 125,139,057.78 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由同益证券投资基金（以下简称“基金同益”）转型而成。根据基金同益的基金份额持有人大会审议通过的《关于同益证券投资基金转型有关事项的议案》，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）基金监管部《关于同益证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函[2014]150号）及深圳证券交易所《终止上市通知书》（深证上[2014]118号）的同意，基金同益于2014年4月3日进行终止上市权益登记，2014年4月4日终止上市。自基金同益终止上市之日起，基金同益转型为长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），由《同益证券投资基金基金合同》修订而成的《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》、《关于同益证券投资基金转换所得长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金份额折算的公告》等相关规定，基金管理人确定2014年5月14日作为基金份额折算基准日。经本基金管理人计算

并经基金托管人复核的折算基准日基金份额净值为人民币 1.000821371 元，折算基准日本基金份额净值采用四舍五入的方法保留到小数点后第 9 位。本基金管理人按照 1:1.000821371 的折算比例对基金同益进行了基金份额折算，折算后的基金份额净值为人民币 1.000 元，折算后本基金的基金份额数采用截尾的方式保留到整数，所产生的误差归入基金资产。折算前基金同益份额总额为 20 亿份，折算后基金份额总额为 2,001,642,742.00 份。本基金注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2014 年 5 月 16 日对折算后的份额进行了变更登记。

本基金于基金合同生效后自 2014 年 4 月 14 日至 2014 年 5 月 9 日期间内开放集中申购，集中申购款扣除申购费后的净申购金额为人民币 686,467,684.84 元，折合 686,467,684.84 份基金份额；申购资金在集中申购期间产生的利息为人民币 182,782.70 元，折合 182,782.70 份基金份额；集中申购期间收到的实收基金共计人民币 686,650,467.54 元，折合 686,650,467.54 份基金份额。

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）、股指期货、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相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的 0%-95%；其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具；权证投资占基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或到期日在一年期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：50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，

同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，若事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；场内基金份额的收益分配方式为现金分红，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及注册登记机构的相关规定；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 投资者的现金红利保留到小数点后第 2 位，由此产生的收益或损失由基金资产承担；

(6) 当日申购的基金份额自申购确认日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自赎回确认日起，不享有基金的分配权益；

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

7.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服

务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

7.4.6.3 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年12月31日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款 | 43,844,579.70 | 63,040,663.52 |
| 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： | 43,844,579.70 | 63,040,663.52 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年12月31日 | | |
|---------------|--------------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 159,989,589.82 | 178,201,081.22 | 18,211,491.40 |
| 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 | 159,989,589.82 | 178,201,081.22 | 18,211,491.40 |

| 项目 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | | |
|---------------|--------------------------|---------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 80,895,966.58 | 63,977,609.80 | -16,918,356.78 |
| 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 | 80,895,966.58 | 63,977,609.80 | -16,918,356.78 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息 | 8,565.81 | 12,497.97 |
| 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 | 144.60 | 53.00 |
| 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 | - | - |
| 应收出借证券利息 | - | - |
| 其他 | 36.00 | 8.70 |
| 合计 | 8,746.41 | 12,559.67 |

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 188,494.95 | 44,406.46 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 188,494.95 | 44,406.46 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 12 月 31 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 555,208.31 | 555,208.31 |
| 应付赎回费 | 72.13 | 0.04 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 其他 | 93,886.86 | 93,886.86 |
| 预提费用 | 179,000.00 | 329,000.00 |
| 合计 | 828,167.30 | 978,095.21 |

7.4.7.9 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 12 月 31 日 | |
|---------------|--|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 103,311,749.45 | 103,237,921.31 |
| 本期申购 | 41,041,219.11 | 41,015,301.53 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -7,462,656.24 | -7,457,644.03 |
| - 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 | 136,890,312.32 | 136,795,578.81 |

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

7.4.7.10 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 | 76,599,107.27 | -54,697,970.80 | 21,901,136.47 |
| 本期利润 | 13,144,187.67 | 35,129,848.18 | 48,274,035.85 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 23,171,133.65 | -10,128,977.68 | 13,042,155.97 |
| 其中：基金申购款 | 28,694,277.46 | -12,566,074.94 | 16,128,202.52 |
| 基金赎回款 | -5,523,143.81 | 2,437,097.26 | -3,086,046.55 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |

| | | | |
|-----|----------------|----------------|---------------|
| 本期末 | 112,914,428.59 | -29,697,100.30 | 83,217,328.29 |
|-----|----------------|----------------|---------------|

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 282,923.54 | 460,889.06 |
| 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 | 6,712.46 | 1,886.47 |
| 其他 | 879.61 | 788.26 |
| 合计 | 290,515.61 | 463,563.79 |

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 卖出股票成交总额 | 465,145,891.62 | 182,070,008.08 |
| 减：卖出股票成本总额 | 450,046,205.91 | 190,694,578.89 |
| 买卖股票差价收入 | 15,099,685.71 | -8,624,570.81 |

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31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 | - | 22,102.80 |
| 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 | - | 22,102.80 |

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2019年1月1日至2019年12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | - | 10,299,686.50 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | - | 9,974,897.20 |
| 减：应收利息总额 | - | 302,686.50 |
| 买卖债券差价收入 | - | 22,102.80 |

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年12月31日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 |
|---------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 2,401,594.90 | 1,166,185.19 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - | - |
| 合计 | 2,401,594.90 | 1,166,185.19 |

7.4.7.17 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12月31日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 |
|------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 35,129,848.18 | -23,076,437.61 |
| ——股票投资 | 35,129,848.18 | -23,071,288.21 |
| ——债券投资 | - | -5,149.40 |
| ——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 | 35,129,848.18 | -23,076,437.61 |

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年12月31日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 13,377.11 | 12,059.54 |
| 基金转换费收入 | 0.01 | - |
| 合计 | 13,377.12 | 12,059.54 |

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年12月31日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,511,326.45 | 512,753.31 |
| 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 | 1,511,326.45 | 512,753.31 |

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年12月31日 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用 | 50,000.00 | 50,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 270,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 账户维护费用 | 36,000.00 | 45,000.00 |
| 上市年费 | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 银行费用 | 661.00 | 591.00 |
| 其他 | 1,200.00 | 1,200.00 |
| 合计 | 267,861.00 | 426,791.00 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|----------------|
| 长盛基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 国元证券股份有限公司（“国元证券”） | 基金管理人股东、基金代销机构 |
| 新加坡星展银行有限公司 | 基金管理人股东 |
| 安徽省信用担保集团有限公司 | 基金管理人股东 |
| 安徽省投资集团控股有限公司 | 基金管理人股东 |
| 长盛创富资产管理有限公司 | 基金管理人子公司 |
| 长盛基金（香港）有限公司 | 基金管理人子公司 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年12月31日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例 |
| 国元证券 | 37,505,908.91 | 3.84% | - | - |

7.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年12月31日 | | | |
|-------|----------------------------------|----------------|-----------|------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 国元证券 | 34,929.75 | 3.84% | 22,509.20 | 11.94% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 国元证券 | - | - | - | - |

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,470,112.70 | 2,236,873.90 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 132,584.36 | 108,311.54 |

注：基金管理费每日计算，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 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12月31日 | 2018年1月1日至2018年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 411,685.52 | 372,812.41 |

注：基金托管费每日计算，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2019年12月31日 | | 上年度末 2018年12月31日 | |
|-------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 国元证券 | 4,003,286.00 | 2.9244% | 4,003,286.00 | 3.8750% |

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日至2019年12月31日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 | |
|--------|-----------------------------|------------|----------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 43,844,579.70 | 282,923.54 | 63,040,663.52 | 460,889.06 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计算。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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 |
|--------|------|-------------|------------|--------|-------|--------|--------------|--------------|--------------|----|
| 688181 | 八亿时空 | 2019年12月27日 | 2020年1月6日 | 新股未上市 | 43.98 | 43.98 | 2,691 | 118,350.18 | 118,350.18 | - |
| 688081 | 兴图新科 | 2019年12月26日 | 2020年1月6日 | 新股未上市 | 28.21 | 28.21 | 3,153 | 88,946.13 | 88,946.13 | - |
| 002973 | 侨银环保 | 2019年12月27日 | 2020年1月6日 | 新股未上市 | 5.74 | 5.74 | 1,146 | 6,578.04 | 6,578.04 | - |
| 601077 | 渝农商行 | 2019年10月16日 | 2020年4月29日 | 新股流通受限 | 7.36 | 6.45 | 101,597 | 747,753.92 | 655,300.65 | - |
| 601658 | 邮储银行 | 2019年12月2日 | 2020年6月10日 | 新股流通受限 | 5.50 | 5.72 | 265,526 | 1,460,393.00 | 1,518,808.72 | - |
| 688012 | 中微公司 | 2019年7月12日 | 2020年1月22日 | 新股流通受限 | 29.01 | 89.03 | 11,925 | 345,944.25 | 1,061,682.75 | - |
| 688015 | 交控科技 | 2019年7月16日 | 2020年1月22日 | 新股流通受限 | 16.18 | 32.29 | 12,549 | 203,042.82 | 405,207.21 | - |
| 688018 | 乐鑫科技 | 2019年7月12日 | 2020年1月22日 | 新股流通受限 | 62.60 | 163.66 | 4,234 | 265,048.40 | 692,936.44 | - |
| 688023 | 安恒信息 | 2019年10月29日 | 2020年5月6日 | 新股流通受限 | 56.50 | 125.72 | 2,728 | 154,132.00 | 342,964.16 | - |
| 688139 | 海尔生物 | 2019年10月18日 | 2020年4月27日 | 新股流通受限 | 15.53 | 26.38 | 13,249 | 205,756.97 | 349,508.62 | - |
| 688168 | 安博通 | 2019年8月30日 | 2020年3月6日 | 新股流通受限 | 56.88 | 98.04 | 2,252 | 128,093.76 | 220,786.08 | - |
| 688357 | 建龙微纳 | 2019年11月26日 | 2020年6月4日 | 新股流通受限 | 43.28 | 45.84 | 2,332 | 100,928.96 | 106,898.88 | - |
| 688368 | 晶丰明源 | 2019年9月27日 | 2020年4月14日 | 新股流通受限 | 56.68 | 82.24 | 2,557 | 144,930.76 | 210,287.68 | - |

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业

倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不

超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2019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 | 43,844,579.70 | - | - | - | 43,844,579.70 |
| 结算备付金 | 321,179.50 | - | - | - | 321,179.50 |
| 存出保证金 | 80,039.69 | - | - | - | 80,039.69 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 178,201,081.22 | 178,201,081.22 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,390,404.19 | 1,390,404.19 |
| 应收利息 | - | - | - | 8,746.41 | 8,746.41 |
| 应收申购款 | - | - | - | 9.99 | 9.99 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 44,245,798.89 | - | - | 179,600,241.81 | 223,846,040.70 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,662,503.81 | 1,662,503.81 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 19,137.35 | 19,137.35 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 273,540.44 | 273,540.44 |
| 应付托管费 | - | - | - | 45,590.07 | 45,590.07 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 188,494.95 | 188,494.95 |
| 应交税费 | - | - | - | 815,699.68 | 815,699.68 |
| 其他负债 | - | - | - | 828,167.30 | 828,167.30 |
| 负债总计 | - | - | - | 3,833,133.60 | 3,833,133.60 |
| 利率敏感度缺口 | 44,245,798.89 | - | - | 175,767,108.21 | 220,012,907.10 |
| 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 | 63,040,663.52 | - | - | - | 63,040,663.52 |
| 结算备付金 | 117,836.00 | - | - | - | 117,836.00 |
| 存出保证金 | 19,211.46 | - | - | - | 19,211.46 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 63,977,609.80 | 63,977,609.80 |
| 应收利息 | - | - | - | 12,559.67 | 12,559.67 |

| | | | | | |
|---------|---------------|---|---|---------------|----------------|
| 应收申购款 | - | - | - | 125.82 | 125.82 |
| 资产总计 | 63,177,710.98 | - | - | 63,990,295.29 | 127,168,006.27 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 9.24 | 9.24 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 163,489.61 | 163,489.61 |
| 应付托管费 | - | - | - | 27,248.29 | 27,248.29 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 44,406.46 | 44,406.46 |
| 应交税费 | - | - | - | 815,699.68 | 815,699.68 |
| 其他负债 | - | - | - | 978,095.21 | 978,095.21 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,028,948.49 | 2,028,948.49 |
| 利率敏感度缺口 | 63,177,710.98 | - | - | 61,961,346.80 | 125,139,057.78 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年12月31日 | | 上年度末 2018年12月31日 | |
|----|--------------------|------------|---------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 | 公允价值 | 占基金资 产净值比 |
| | | | | |

| | | 值比例 (%) | | 例 (%) |
|--------------|----------------|------------|---------------|-------|
| 交易性金融资产-股票投资 | 178,201,081.22 | 81.00 | 63,977,609.80 | 51.13 |
| 合计 | 178,201,081.22 | 81.00 | 63,977,609.80 | 51.13 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变； | | |
| | 用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险； | | |
| | Beta 系数是根据组合在过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。 | | |
| 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 12 月 31 日） | 上年度末（2018 年 12 月 31 日） |
| | +5% | 17,224,468.38 | 7,897,633.56 |
| | -5% | -17,224,468.38 | -7,897,633.56 |

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 172,422,825.68 元，属于第二层次的余额为人民币 5,778,255.54 元，无属于第三层次的余额（2018 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 62,810,010.80 元，属于第二层次的余额为人民币 2,099.00 元，属于第三层次的余额为人民币 1,165,500.00 元）。

(2) 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可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（2018 年：本基金持有的以公允价值计量的金融工具转出第三层次公允价值的金额为人民币 1,165,500.00 元）。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2020 年 4 月 17 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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 | 178,201,081.22 | 79.61 |
| | 其中：股票 | 178,201,081.22 | 79.61 |
| 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 | 44,165,759.20 | 19.73 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,479,200.28 | 0.66 |
| 9 | 合计 | 223,846,040.70 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 4,032,000.00 | 1.83 |
| B | 采矿业 | 2,367,000.00 | 1.08 |
| C | 制造业 | 84,194,428.14 | 38.27 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,838,000.00 | 0.84 |
| E | 建筑业 | 3,751,800.00 | 1.71 |
| F | 批发和零售业 | 6,212,000.00 | 2.82 |
| 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 | 22,722,029.92 | 10.33 |
| J | 金融业 | 32,074,789.37 | 14.58 |
| K | 房地产业 | 3,045,000.00 | 1.38 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,134,800.00 | 0.97 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,842,400.00 | 0.84 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,578.04 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 6,143,547.75 | 2.79 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 7,836,708.00 | 3.56 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 178,201,081.22 | 81.00 |

8.2.2 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。

8.3 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

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 | 300347 | 泰格医药 | 97,285 | 6,143,547.75 | 2.79 |
| 2 | 600584 | 长电科技 | 272,983 | 6,000,166.34 | 2.73 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 300,000 | 5,940,000.00 | 2.70 |
| 4 | 002475 | 立讯精密 | 160,080 | 5,842,920.00 | 2.66 |
| 5 | 300750 | 宁德时代 | 50,000 | 5,320,000.00 | 2.42 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 89,768 | 5,228,986.00 | 2.38 |
| 7 | 002368 | 太极股份 | 120,000 | 4,670,400.00 | 2.12 |
| 8 | 600036 | 招商银行 | 120,000 | 4,509,600.00 | 2.05 |
| 9 | 601336 | 新华保险 | 90,000 | 4,423,500.00 | 2.01 |
| 10 | 000001 | 平安银行 | 250,000 | 4,112,500.00 | 1.87 |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 48,000 | 4,102,080.00 | 1.86 |
| 12 | 300498 | 温氏股份 | 120,000 | 4,032,000.00 | 1.83 |
| 13 | 300144 | 宋城演艺 | 130,000 | 4,018,300.00 | 1.83 |
| 14 | 002078 | 太阳纸业 | 399,903 | 3,935,045.52 | 1.79 |
| 15 | 601186 | 中国铁建 | 370,000 | 3,751,800.00 | 1.71 |
| 16 | 000034 | 神州数码 | 180,000 | 3,573,000.00 | 1.62 |
| 17 | 000858 | 五粮液 | 26,000 | 3,458,260.00 | 1.57 |
| 18 | 600887 | 伊利股份 | 110,000 | 3,403,400.00 | 1.55 |
| 19 | 600104 | 上汽集团 | 130,000 | 3,100,500.00 | 1.41 |
| 20 | 600383 | 金地集团 | 210,000 | 3,045,000.00 | 1.38 |
| 21 | 600030 | 中信证券 | 120,000 | 3,036,000.00 | 1.38 |
| 22 | 002624 | 完美世界 | 65,000 | 2,869,100.00 | 1.30 |
| 23 | 688012 | 中微公司 | 30,925 | 2,817,282.75 | 1.28 |
| 24 | 300413 | 芒果超媒 | 79,950 | 2,795,052.00 | 1.27 |
| 25 | 300659 | 中孚信息 | 42,000 | 2,686,740.00 | 1.22 |
| 26 | 601933 | 永辉超市 | 350,000 | 2,639,000.00 | 1.20 |
| 27 | 600741 | 华域汽车 | 100,000 | 2,599,000.00 | 1.18 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 28 | 600031 | 三一重工 | 150,000 | 2,557,500.00 | 1.16 |
| 29 | 000063 | 中兴通讯 | 70,000 | 2,477,300.00 | 1.13 |
| 30 | 600612 | 老凤祥 | 50,000 | 2,380,500.00 | 1.08 |
| 31 | 002155 | 湖南黄金 | 300,000 | 2,367,000.00 | 1.08 |
| 32 | 600519 | 贵州茅台 | 2,000 | 2,366,000.00 | 1.08 |
| 33 | 600570 | 恒生电子 | 30,000 | 2,331,900.00 | 1.06 |
| 34 | 300122 | 智飞生物 | 45,000 | 2,234,700.00 | 1.02 |
| 35 | 601818 | 光大银行 | 500,000 | 2,205,000.00 | 1.00 |
| 36 | 002555 | 三七互娱 | 80,000 | 2,154,400.00 | 0.98 |
| 37 | 601888 | 中国国旅 | 24,000 | 2,134,800.00 | 0.97 |
| 38 | 600406 | 国电南瑞 | 100,000 | 2,118,000.00 | 0.96 |
| 39 | 002129 | 中环股份 | 170,000 | 2,007,700.00 | 0.91 |
| 40 | 000932 | 华菱钢铁 | 410,000 | 1,959,800.00 | 0.89 |
| 41 | 688018 | 乐鑫科技 | 11,734 | 1,951,211.44 | 0.89 |
| 42 | 688321 | 微芯生物 | 33,000 | 1,851,300.00 | 0.84 |
| 43 | 603259 | 药明康德 | 20,000 | 1,842,400.00 | 0.84 |
| 44 | 002271 | 东方雨虹 | 69,990 | 1,841,436.90 | 0.84 |
| 45 | 600900 | 长江电力 | 100,000 | 1,838,000.00 | 0.84 |
| 46 | 688111 | 金山办公 | 11,000 | 1,802,900.00 | 0.82 |
| 47 | 603345 | 安井食品 | 30,000 | 1,782,300.00 | 0.81 |
| 48 | 600885 | 宏发股份 | 50,000 | 1,722,500.00 | 0.78 |
| 49 | 603986 | 兆易创新 | 8,000 | 1,639,120.00 | 0.75 |
| 50 | 600195 | 中牧股份 | 140,000 | 1,617,000.00 | 0.73 |
| 51 | 000538 | 云南白药 | 18,000 | 1,609,740.00 | 0.73 |
| 52 | 688023 | 安恒信息 | 11,728 | 1,602,964.16 | 0.73 |
| 53 | 601788 | 光大证券 | 120,000 | 1,572,000.00 | 0.71 |
| 54 | 601658 | 邮储银行 | 265,526 | 1,518,808.72 | 0.69 |
| 55 | 002938 | 鹏鼎控股 | 31,000 | 1,391,900.00 | 0.63 |
| 56 | 688363 | 华熙生物 | 16,000 | 1,334,400.00 | 0.61 |
| 57 | 600967 | 内蒙一机 | 120,000 | 1,275,600.00 | 0.58 |
| 58 | 300760 | 迈瑞医疗 | 7,000 | 1,273,300.00 | 0.58 |
| 59 | 002202 | 金风科技 | 100,000 | 1,195,000.00 | 0.54 |
| 60 | 600426 | 华鲁恒升 | 60,000 | 1,192,200.00 | 0.54 |
| 61 | 603833 | 欧派家居 | 10,000 | 1,170,000.00 | 0.53 |
| 62 | 300770 | 新媒股份 | 8,000 | 1,040,000.00 | 0.47 |
| 63 | 688088 | 虹软科技 | 21,472 | 1,014,552.00 | 0.46 |
| 64 | 300251 | 光线传媒 | 80,000 | 944,000.00 | 0.43 |
| 65 | 300793 | 佳禾智能 | 18,176 | 880,627.20 | 0.40 |
| 66 | 600507 | 方大特钢 | 80,000 | 804,800.00 | 0.37 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 67 | 601077 | 渝农商行 | 101,597 | 655,300.65 | 0.30 |
| 68 | 002384 | 东山精密 | 20,000 | 463,000.00 | 0.21 |
| 69 | 688015 | 交控科技 | 12,549 | 405,207.21 | 0.18 |
| 70 | 688139 | 海尔生物 | 13,249 | 349,508.62 | 0.16 |
| 71 | 300782 | 卓胜微 | 743 | 304,904.91 | 0.14 |
| 72 | 688168 | 安博通 | 2,252 | 220,786.08 | 0.10 |
| 73 | 688368 | 晶丰明源 | 2,557 | 210,287.68 | 0.10 |
| 74 | 688181 | 八亿时空 | 2,691 | 118,350.18 | 0.05 |
| 75 | 688357 | 建龙微纳 | 2,332 | 106,898.88 | 0.05 |
| 76 | 002970 | 锐明技术 | 787 | 96,478.33 | 0.04 |
| 77 | 688081 | 兴图新科 | 3,153 | 88,946.13 | 0.04 |
| 78 | 300788 | 中信出版 | 1,556 | 79,356.00 | 0.04 |
| 79 | 002972 | 科安达 | 1,075 | 21,532.25 | 0.01 |
| 80 | 603109 | 神驰机电 | 684 | 18,105.48 | 0.01 |
| 81 | 002973 | 侨银环保 | 1,146 | 6,578.04 | 0.00 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超期初基金资产净值 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 | 600036 | 招商银行 | 8,949,401.01 | 7.15 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 8,857,786.00 | 7.08 |
| 3 | 601186 | 中国铁建 | 8,320,343.00 | 6.65 |
| 4 | 000001 | 平安银行 | 7,984,915.57 | 6.38 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 7,860,242.00 | 6.28 |
| 6 | 002624 | 完美世界 | 7,525,487.00 | 6.01 |
| 7 | 002938 | 鹏鼎控股 | 7,456,545.00 | 5.96 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 7,180,822.44 | 5.74 |
| 9 | 002129 | 中环股份 | 7,073,170.00 | 5.65 |
| 10 | 600570 | 恒生电子 | 6,765,883.30 | 5.41 |
| 11 | 600872 | 中炬高新 | 6,301,706.00 | 5.04 |
| 12 | 300122 | 智飞生物 | 5,841,147.20 | 4.67 |
| 13 | 600406 | 国电南瑞 | 5,608,655.07 | 4.48 |
| 14 | 000333 | 美的集团 | 5,397,613.00 | 4.31 |
| 15 | 600507 | 方大特钢 | 5,352,145.00 | 4.28 |
| 16 | 600584 | 长电科技 | 5,321,750.82 | 4.25 |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 5,293,878.00 | 4.23 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 18 | 600741 | 华域汽车 | 5,014,089.98 | 4.01 |
| 19 | 600519 | 贵州茅台 | 4,974,961.00 | 3.98 |
| 20 | 300498 | 温氏股份 | 4,965,172.00 | 3.97 |
| 21 | 603259 | 药明康德 | 4,851,425.00 | 3.88 |
| 22 | 601318 | 中国平安 | 4,763,573.00 | 3.81 |
| 23 | 300347 | 泰格医药 | 4,626,373.50 | 3.70 |
| 24 | 300450 | 先导智能 | 4,598,689.32 | 3.67 |
| 25 | 002475 | 立讯精密 | 4,536,845.00 | 3.63 |
| 26 | 002236 | 大华股份 | 4,523,656.24 | 3.61 |
| 27 | 601688 | 华泰证券 | 4,521,480.00 | 3.61 |
| 28 | 002368 | 太极股份 | 4,452,287.00 | 3.56 |
| 29 | 000063 | 中兴通讯 | 4,407,876.00 | 3.52 |
| 30 | 601336 | 新华保险 | 4,403,260.00 | 3.52 |
| 31 | 000568 | 泸州老窖 | 4,322,275.88 | 3.45 |
| 32 | 300659 | 中孚信息 | 4,265,269.00 | 3.41 |
| 33 | 603444 | 吉比特 | 4,242,658.00 | 3.39 |
| 34 | 603816 | 顾家家居 | 4,238,902.80 | 3.39 |
| 35 | 300673 | 佩蒂股份 | 4,221,875.20 | 3.37 |
| 36 | 002410 | 广联达 | 4,017,990.00 | 3.21 |
| 37 | 002035 | 华帝股份 | 4,016,565.92 | 3.21 |
| 38 | 002555 | 三七互娱 | 3,924,492.00 | 3.14 |
| 39 | 600655 | 豫园股份 | 3,859,666.48 | 3.08 |
| 40 | 600195 | 中牧股份 | 3,839,621.72 | 3.07 |
| 41 | 300750 | 宁德时代 | 3,692,325.00 | 2.95 |
| 42 | 600201 | 生物股份 | 3,591,546.00 | 2.87 |
| 43 | 000938 | 紫光股份 | 3,558,665.60 | 2.84 |
| 44 | 000039 | 中集集团 | 3,540,676.00 | 2.83 |
| 45 | 600048 | 保利地产 | 3,513,727.00 | 2.81 |
| 46 | 000034 | 神州数码 | 3,495,248.00 | 2.79 |
| 47 | 600867 | 通化东宝 | 3,477,541.99 | 2.78 |
| 48 | 000418 | 小天鹅A | 3,468,697.00 | 2.77 |
| 49 | 603043 | 广州酒家 | 3,453,561.19 | 2.76 |
| 50 | 600885 | 宏发股份 | 3,443,945.00 | 2.75 |
| 51 | 300144 | 宋城演艺 | 3,432,849.08 | 2.74 |
| 52 | 600340 | 华夏幸福 | 3,411,111.96 | 2.73 |
| 53 | 601818 | 光大银行 | 3,395,663.00 | 2.71 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 54 | 002138 | 顺络电子 | 3,321,004.00 | 2.65 |
| 55 | 603983 | 丸美股份 | 3,273,862.52 | 2.62 |
| 56 | 601128 | 常熟银行 | 3,267,318.00 | 2.61 |
| 57 | 600837 | 海通证券 | 3,266,497.00 | 2.61 |
| 58 | 000002 | 万科A | 3,253,578.96 | 2.60 |
| 59 | 002415 | 海康威视 | 3,242,421.78 | 2.59 |
| 60 | 600031 | 三一重工 | 3,230,869.50 | 2.58 |
| 61 | 002384 | 东山精密 | 3,177,649.00 | 2.54 |
| 62 | 600104 | 上汽集团 | 3,173,115.00 | 2.54 |
| 63 | 601138 | 工业富联 | 3,166,746.00 | 2.53 |
| 64 | 002078 | 太阳纸业 | 3,154,904.88 | 2.52 |
| 65 | 601933 | 永辉超市 | 3,102,388.62 | 2.48 |
| 66 | 600436 | 片仔癀 | 3,054,811.00 | 2.44 |
| 67 | 603833 | 欧派家居 | 3,053,079.00 | 2.44 |
| 68 | 300760 | 迈瑞医疗 | 3,016,933.00 | 2.41 |
| 69 | 300271 | 华宇软件 | 2,992,378.00 | 2.39 |
| 70 | 300383 | 光环新网 | 2,989,223.00 | 2.39 |
| 71 | 002268 | 卫士通 | 2,891,278.00 | 2.31 |
| 72 | 600820 | 隧道股份 | 2,867,960.00 | 2.29 |
| 73 | 600426 | 华鲁恒升 | 2,805,643.25 | 2.24 |
| 74 | 002916 | 深南电路 | 2,790,322.00 | 2.23 |
| 75 | 002155 | 湖南黄金 | 2,758,577.00 | 2.20 |
| 76 | 000538 | 云南白药 | 2,615,049.00 | 2.09 |
| 77 | 600258 | 首旅酒店 | 2,552,613.00 | 2.04 |
| 78 | 002463 | 沪电股份 | 2,551,103.00 | 2.04 |
| 79 | 601058 | 赛轮轮胎 | 2,541,948.80 | 2.03 |
| 80 | 603986 | 兆易创新 | 2,538,479.00 | 2.03 |
| 81 | 002049 | 紫光国微 | 2,524,030.00 | 2.02 |
| 82 | 600383 | 金地集团 | 2,510,881.00 | 2.01 |

8.4.2 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 | 002938 | 鹏鼎控股 | 6,741,348.00 | 5.39 |
| 2 | 600872 | 中炬高新 | 6,658,771.88 | 5.32 |
| 3 | 002035 | 华帝股份 | 6,290,686.99 | 5.03 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 4 | 002624 | 完美世界 | 6,173,657.00 | 4.93 |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 6,044,167.00 | 4.83 |
| 6 | 600048 | 保利地产 | 5,658,085.00 | 4.52 |
| 7 | 300383 | 光环新网 | 5,643,415.53 | 4.51 |
| 8 | 002129 | 中环股份 | 5,520,915.00 | 4.41 |
| 9 | 603816 | 顾家家居 | 5,322,079.00 | 4.25 |
| 10 | 600507 | 方大特钢 | 5,251,641.00 | 4.20 |
| 11 | 603444 | 吉比特 | 5,220,072.98 | 4.17 |
| 12 | 002236 | 大华股份 | 5,216,115.00 | 4.17 |
| 13 | 000001 | 平安银行 | 5,155,445.00 | 4.12 |
| 14 | 601186 | 中国铁建 | 5,028,212.00 | 4.02 |
| 15 | 600570 | 恒生电子 | 4,898,621.68 | 3.91 |
| 16 | 600340 | 华夏幸福 | 4,853,249.48 | 3.88 |
| 17 | 600036 | 招商银行 | 4,808,773.87 | 3.84 |
| 18 | 000568 | 泸州老窖 | 4,774,058.00 | 3.82 |
| 19 | 601688 | 华泰证券 | 4,766,776.00 | 3.81 |
| 20 | 603259 | 药明康德 | 4,711,744.32 | 3.77 |
| 21 | 002410 | 广联达 | 4,620,037.79 | 3.69 |
| 22 | 600741 | 华域汽车 | 4,481,568.76 | 3.58 |
| 23 | 000858 | 五粮液 | 4,465,503.00 | 3.57 |
| 24 | 300450 | 先导智能 | 4,431,548.00 | 3.54 |
| 25 | 601800 | 中国交建 | 3,974,200.00 | 3.18 |
| 26 | 300122 | 智飞生物 | 3,933,256.04 | 3.14 |
| 27 | 300673 | 佩蒂股份 | 3,918,531.60 | 3.13 |
| 28 | 600201 | 生物股份 | 3,887,829.44 | 3.11 |
| 29 | 603983 | 丸美股份 | 3,836,355.24 | 3.07 |
| 30 | 600837 | 海通证券 | 3,800,019.00 | 3.04 |
| 31 | 600406 | 国电南瑞 | 3,781,464.97 | 3.02 |
| 32 | 600655 | 豫园股份 | 3,707,773.00 | 2.96 |
| 33 | 600867 | 通化东宝 | 3,610,229.36 | 2.88 |
| 34 | 600004 | 白云机场 | 3,582,528.12 | 2.86 |
| 35 | 600519 | 贵州茅台 | 3,479,518.00 | 2.78 |
| 36 | 600426 | 华鲁恒升 | 3,463,593.00 | 2.77 |
| 37 | 000039 | 中集集团 | 3,432,908.06 | 2.74 |
| 38 | 000002 | 万科A | 3,383,519.04 | 2.70 |
| 39 | 002415 | 海康威视 | 3,379,748.00 | 2.70 |
| 40 | 601138 | 工业富联 | 3,338,576.00 | 2.67 |
| 41 | 000938 | 紫光股份 | 3,282,496.61 | 2.62 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 42 | 300271 | 华宇软件 | 3,244,551.30 | 2.59 |
| 43 | 603043 | 广州酒家 | 3,242,718.00 | 2.59 |
| 44 | 002463 | 沪电股份 | 3,128,395.00 | 2.50 |
| 45 | 601128 | 常熟银行 | 3,060,952.00 | 2.45 |
| 46 | 002508 | 老板电器 | 3,034,733.12 | 2.43 |
| 47 | 002138 | 顺络电子 | 3,023,981.36 | 2.42 |
| 48 | 002916 | 深南电路 | 2,967,850.00 | 2.37 |
| 49 | 002049 | 紫光国微 | 2,891,026.00 | 2.31 |
| 50 | 600436 | 片仔癀 | 2,873,910.50 | 2.30 |
| 51 | 002268 | 卫士通 | 2,814,038.00 | 2.25 |
| 52 | 601668 | 中国建筑 | 2,798,962.00 | 2.24 |
| 53 | 002384 | 东山精密 | 2,745,985.00 | 2.19 |
| 54 | 600745 | 闻泰科技 | 2,731,531.00 | 2.18 |
| 55 | 600567 | 山鹰纸业 | 2,719,130.00 | 2.17 |
| 56 | 600196 | 复星医药 | 2,697,965.00 | 2.16 |
| 57 | 000977 | 浪潮信息 | 2,686,072.00 | 2.15 |
| 58 | 601058 | 赛轮轮胎 | 2,573,923.00 | 2.06 |
| 59 | 600183 | 生益科技 | 2,561,534.30 | 2.05 |

8.4.3 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 | 529,139,829.15 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 465,145,891.62 |

注：本项中 8.4.1, 8.4.2, 8.4.3 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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

1. 兴业银行

兴业银行：2019 年 8 月 19 日，交易商协会自律处分信息显示，兴业银行作为北京粮食集团有限责任公司（以下简称“京粮集团”）相关债务融资工具的主承销商，在债务融资工具存续期间未能对京粮集团资产无偿划转重大事项进行有效监测，及时督导京粮集团进行存续期重大事项披露，也未及时召开持有人会议，依据相关自律规定，给予兴业银行诫勉谈话处分，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。对以上事件，本基金判断，兴业银行作为大型全国性股份制银行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续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。

2. 招商银行

招商银行：2019 年 7 月 2 日，招商银行和平安银行在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09% 的异常利率交易，经自查，为交易员操作失误所致，全国银行间同业拆借中心现对平安银行和招商银行进行通报批评，要求两家机构加强风险控制和内部管理，并依据《银行间本币市场交易员管理办法（试行）》（中汇交发〔2014〕196 号），暂停平安银行和招商银行相关交易员的银行间本币市场交易员资格 1 年。对以上事件，本基金判断，招商银行作为大型全国性股份制银行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续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。

3. 平安银行

平安银行：2019 年 7 月 2 日，招商银行和平安银行在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09% 的异常利率交易，经自查，为交易员操作失误所致，全国银行间同业拆借中心现对平安银行和招商银行进行通报批评，要求两家机构加强风险控制和内部管理，并依据《银行间本币市场交易员管理办法（试行）》（中汇交发〔2014〕196 号），暂停平安银行和招商银行相关交易员的银行间本币市场交易员资格 1 年。对以上事件，本基金判断，平安银行作为大型全国性股份制银行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续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。

8.12.2 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

本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。

8.12.3 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 | 80,039.69 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,390,404.19 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 8,746.41 |
| 5 | 应收申购款 | 9.99 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,479,200.28 |

8.12.4 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）。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|---------------|------------|---------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 7,204 | 19,001.99 | 48,837,352.00 | 35.68% | 88,052,960.32 | 64.32% |

9.2 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 | 国元证券股份有限公司 | 4,003,286.00 | 2.98% |
| 2 | 何继军 | 3,143,000.00 | 2.34% |
| 3 | 俞河会 | 1,651,355.00 | 1.23% |
| 4 | 周嘉宁 | 1,260,000.00 | 0.94% |
| 5 | 张启 | 1,145,100.00 | 0.85% |
| 6 | 刘晓娟 | 800,000.00 | 0.60% |
| 7 | 黄良珍 | 710,000.00 | 0.53% |
| 8 | 竺爱琴 | 700,041.00 | 0.52% |
| 9 | 蔡景玲 | 675,996.00 | 0.50% |
| 10 | 倪秀英 | 631,218.00 | 0.47% |

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。

9.3 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 | 225,247.08 | 0.1645% |

9.4 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、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2014年4月4日）基金份额总额 | 2,000,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 103,311,749.45 |
| 本报告期基金总申购份额 | 41,041,219.11 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 7,462,656.24 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 136,890,312.32 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 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 年第一次临时股东大会会议决议，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。该董事人员变更，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。该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。该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 2019 年第二次临时股东大会会议决议，同意严琛不再担任公司第七届董事会董事，选举江娅担任公司第七届董事会董事。该董事人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

11.2.2 基金经理的变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2019 年 5 月 22 日起，张谊然同志担任长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。自 2019 年 5 月 23 日起，乔培涛同志不再担任长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

11.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期内应支付该会计师事务所的报酬为 50,000.00 元。已连续为本基金服务 21 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元 数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|------------|----------------|----------------------|------------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例 | 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | |
| 招商证券 | 1 | 503,418,917.93 | 51.56% | 468,832.21 | 51.56% | - |
| 申万宏源 | 2 | 163,189,415.84 | 16.71% | 151,978.82 | 16.71% | - |
| 华安证券 | 1 | 125,807,050.18 | 12.89% | 117,164.47 | 12.89% | - |
| 平安证券 | 1 | 98,951,145.86 | 10.14% | 92,153.80 | 10.14% | - |
| 中信建投 | 1 | 45,663,376.96 | 4.68% | 42,526.40 | 4.68% | - |
| 国元证券 | 2 | 37,505,908.91 | 3.84% | 34,929.75 | 3.84% | - |
| 银河证券 | 1 | 1,774,112.00 | 0.18% | 1,652.41 | 0.18% | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资力雄厚，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：无。

11.8 其他重大事件

注：除上述事项外，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增加中信期货为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投和转换业务的公告 | 《证券时报》及本公司网站 | 2019年11月11日 |
| 2 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同 | 同上 | 2019年10月26日 |
| 3 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议 | 同上 | 2019年10月26日 |
| 4 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说 | 同上 | 2019年10月26日 |

| | | | |
|----|---|----|-------------|
| | 说明书（更新） | | |
| 5 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)招募说明书更新（更新）摘要 | 同上 | 2019年10月26日 |
| 6 | 关于修改长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同等法律文件的公告 | 同上 | 2019年10月26日 |
| 7 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019年第三季度报告 | 同上 | 2019年10月23日 |
| 8 | 长盛基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司销售旗下部分基金并开通定投和转换业务 及参加费率优惠活动的公告 | 同上 | 2019年10月21日 |
| 9 | 关于长盛基金管理有限公司旗下部分基金参加网上直销平台和直销中心申购费率优惠活动的公告 | 同上 | 2019年9月26日 |
| 10 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（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9月3日 |
| 11 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019年半年度报告 | 同上 | 2019年8月27日 |
| 12 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 | 同上 | 2019年8月27日 |

| | | | |
|----|---|----|-----------------|
| | 年半年度报告 摘要 | | |
| 13 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 年第 2 季度报告 | 同上 | 2019 年 7 月 18 日 |
| 14 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告 | 同上 | 2019 年 7 月 9 日 |
| 15 | 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 |
| 16 | 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 |
| 17 | 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 |
| 18 | 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 |
| 19 | 长盛基金管理有限公司关于调整长盛同益成长回报灵活配置混合型投资基金 (LOF) 基金经理的公告 | 同上 | 2019 年 5 月 24 日 |
| 20 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书（更新）摘要 | 同上 | 2019 年 5 月 16 日 |
| 21 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书（更新） | 同上 | 2019 年 5 月 16 日 |

| | | | |
|----|---|----|-----------------|
| 22 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2019 年第 1 季度报告 | 同上 | 2019 年 4 月 22 日 |
| 23 | 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 |
| 24 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2018 年度报告 | 同上 | 2019 年 3 月 29 日 |
| 25 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2018 年度报告 摘要 | 同上 | 2019 年 3 月 29 日 |
| 26 | 长盛基金管理有限公司关于增加广发证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投和转换业务并推出申购（含定投）费率优惠活动的公告 | 同上 | 2019 年 3 月 22 日 |
| 27 | 长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）2018 年第 4 季度报告 | 同上 | 2019 年 1 月 19 日 |
| 28 | 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 |
| 29 | 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 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 | 20190725~20191210 | 0.00 | 28,776,258.00 | 28,776,258.00 | 0.00 | 0.00% |
| 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> | | | | | | | |

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、中国证监会基金监管部《关于同益证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》（基金部函〔2014〕150号）；
- 3、《同益证券投资基金基金合同》；
- 4、《同益证券投资基金基金托管协议》；
- 5、《同益证券投资基金基金招募说明书》；
- 6、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 7、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 8、《长盛同益成长回报灵活配置混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 9、法律意见书；
- 10、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 11、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 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住址。

13.3 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

2020年4月21日