

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）证券投资基金  
2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 6         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 6         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>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.....                | 13        |
| 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 托管人对本中期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>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 39        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 39        |
| 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.....     | 40        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 59        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 61        |
| 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.....    | 61        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 61        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 61        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....    | 61        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 61        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 62        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 62        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>64</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 64        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人.....                      | 64        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 64        |
| 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.....     | 64        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>65</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>66</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 66        |
| 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.....      | 66        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 66        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 66        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 66        |
| 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.....         | 66        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 66        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 68        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>70</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 ..... | 70        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 70        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                   | <b>71</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 71        |
| 12.2 存放地点.....                           | 71        |
| 12.3 查阅方式.....                           | 71        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                            |
|--------------|----------------------------|
| 基金名称         | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) |
| 基金简称         | 长盛同庆中证 800 指数 (LOF)        |
| 场内简称         | 长盛同庆                       |
| 基金主代码        | 160806                     |
| 交易代码         | 160806                     |
| 基金运作方式       | 契约型开放式                     |
| 基金合同生效日      | 2015 年 5 月 22 日            |
| 基金管理人        | 长盛基金管理有限公司                 |
| 基金托管人        | 中国建设银行股份有限公司               |
| 报告期末基金份额总额   | 245,994,805.92 份           |
| 基金合同存续期      | 不定期                        |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                    |
| 上市日期         | 2015 年 8 月 6 日             |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现对中国证 800 指数的有效跟踪。   |
| 投资策略   | 本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4% 的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 95%×中证 800 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）  |
| 风险收益特征 | 本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                     | 基金托管人             |
|---------|------|---------------------------|-------------------|
| 名称      |      | 长盛基金管理有限公司                | 中国建设银行股份有限公司      |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 张利宁                       | 李申                |
|         | 联系电话 | 010-86497608              | 021-60637102      |
|         | 电子邮箱 | zhangln@csfunds.com.cn    | lishen.zh@ccb.com |
| 客户服务电话  |      | 400-888-2666、010-86497888 | 021-60637111      |

|       |                                   |                       |
|-------|-----------------------------------|-----------------------|
| 传真    | 010-86497999                      | 021-60635778          |
| 注册地址  | 深圳市福田区福中三路诺德金融中心主楼 10D            | 北京市西城区金融大街 25 号       |
| 办公地址  | 北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码  | 100029                            | 100033                |
| 法定代表人 | 周兵                                | 田国立                   |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》   |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人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(2020年1月1日 - 2020年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 22,022,013.76               |
| 本期利润          | 19,562,429.24               |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0733                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 5.25%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | 7.27%                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年6月30日)            |
| 期末可供分配利润      | 84,601,675.20               |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.3439                      |
| 期末基金资产净值      | 347,332,792.77              |
| 期末基金份额净值      | 1.412                       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020年6月30日)            |
| 基金份额累计净值增长率   | -4.90%                      |

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段       | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月    | 8.57%    | 0.82%       | 7.48%      | 0.83%         | 1.09%  | -0.01% |
| 过去三个月    | 15.14%   | 0.85%       | 13.10%     | 0.88%         | 2.04%  | -0.03% |
| 过去六个月    | 7.27%    | 1.43%       | 3.85%      | 1.48%         | 3.42%  | -0.05% |
| 过去一年     | 21.42%   | 1.16%       | 10.74%     | 1.19%         | 10.68% | -0.03% |
| 过去三年     | 28.76%   | 1.18%       | 8.77%      | 1.21%         | 19.99% | -0.03% |
| 自基金转型起至今 | -4.90%   | 1.55%       | -19.77%    | 1.48%         | 14.87% | 0.07%  |



注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

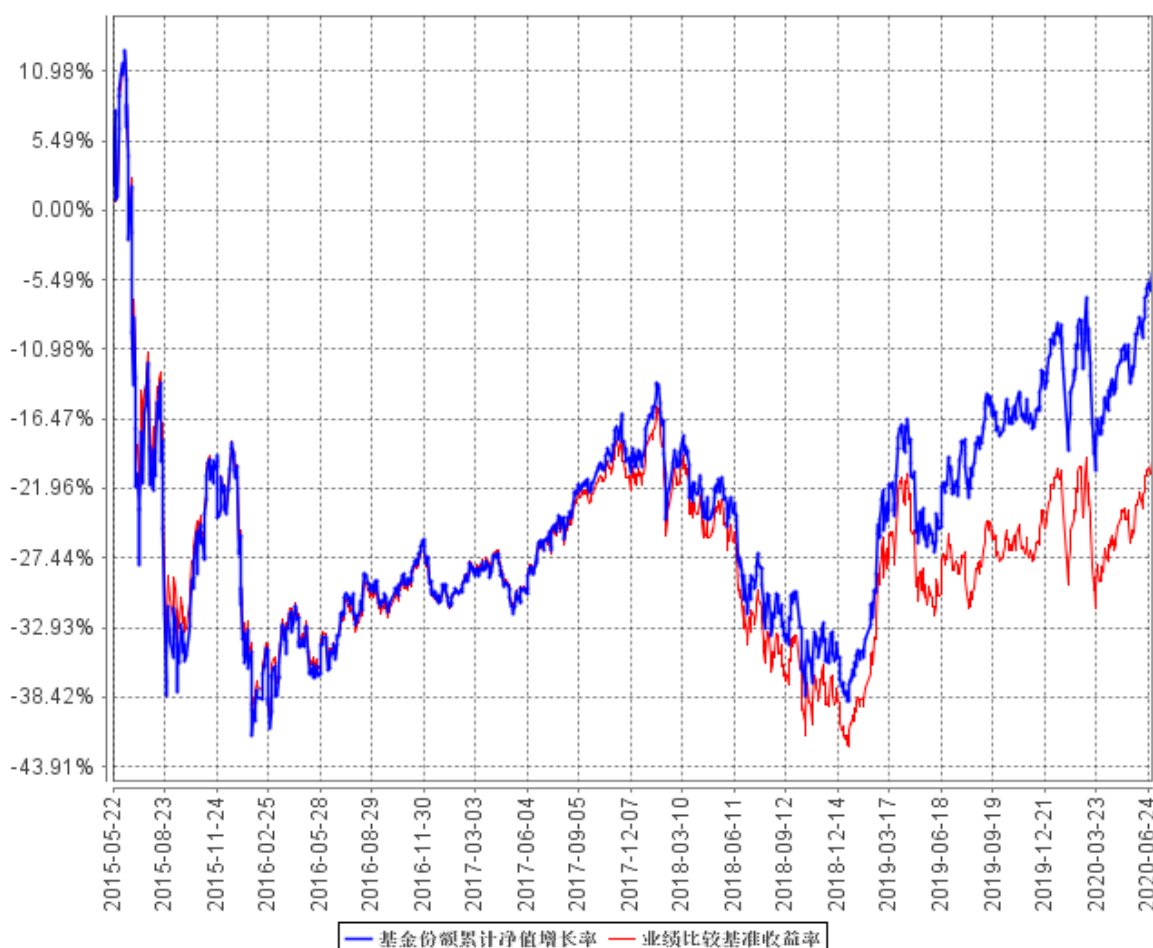
本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率 (税后)}$

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

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

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

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

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金总部办公地址位于北京，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、私募资产管理、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 2020 年 6 月 30 日，基金管理人共管理六十三只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|--|-----------------|------|--------|--|
|     |  | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 陈亘斯 | 本基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理。 | 2019 年 5 月 30 日 | -    | 11 年   | 陈亘斯先生，硕士。曾任 PineRiver 资产管理公司量化分析师，国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理，北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理。 |

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

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金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、私募资产管理计划等。具体如下：

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

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

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

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年一季度, 国内经历了新型冠状病毒的重大疫情的爆发, 社会经济活动急剧下降。二季度由于国家管控措施快速有力, 经济生产活动逐步恢复。然而, 国外疫情扩散势头始终未得到有效控制, 叠加主要产油国的减产协议破裂, 同期国际金融市场经历了二战以来前所未有的冲击。国内受益于货币和财政政策的快速应对, A 股在经历一季度两次急跌调整后得到快速修复、受益于国内市场和政策的行业逐步持续显现出超额收益。特别是直接受益于疫情的医药生物、医疗设备和用品等板块表现持续领先。伴随对支持经济的政策预期以及 PPI 下跌趋势得以扭转, 新基建相关的半导体、计算机和促进内需的食品饮料、商贸零售、休闲服务等表现也较为突出。在充裕的流动性和低利率水平影响下, A 股市场的风险溢价由高位逐步回落、市场估值有效提升、部分预期业绩高增长的公司形成“戴维斯双击”, 市场总体以结构性上涨为主。在多因子选股方面, 受益于国内流动性释放而表现最为突出的动量因子, 根据历史统计规律下半年大概率将逐步褪色。成长因子、财务质量因子和合理的利润增速与估值比值是我们持之以恒的因子选股依据。

在操作中, 我们严格遵守基金合同。在指数权重调整和基金申赎变动时, 应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.412 元; 本报告期基金份额净值增长率为 7.27%, 业绩比较基准收益率为 3.85%。本报告期内日均跟踪误差为 0.1318%, 年度化跟踪误差为 2.0837%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度末长端利率出现快速上行, 股市风险溢价的下行空间相对去年底今年初的高位有所下降。对于已处于高估值的板块和行业形成一定压力。随着特别国债发行、财政政策到位、金融政策推动资金进入实体, PPI 大概率修复向上。走势落后的低估值、强周期和高股息股票的利润有望得到提振, 进而估值得到修复。价值股与成长股的估值差有望分阶段逐步收敛。

当前社会就业形势较为严峻, 政府有动力加速推进新基建和部分传统基建项目。尤其值得关注的是单位资本投入对应更多新增就业的行业, 如 5G 建设、轨道交通、环保水利等。流动性充裕的背景下, 大宗商品已出现整体性地反弹, 尤其是黄金价格持续上涨。我们将密切跟踪年底前通胀的变化以及汇率、利率的走势, 尤其是流动性的高增速可能扭转对高估值股票的冲击。此外, 美国大选前后国际形势的变化对于国内经济商贸政策和企业的供应链的影响的不确定性可能持续升高。以上的情形如若发生, 投资者需要及时跟踪不同资产类别的相对强弱变化而调整相应的配置策略。

#### 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。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定, 本基金于 2020 年 3 月 24 日进行了利润分配, 分配金额为 16,500,335.54 元; 于 2020 年 6 月 17 日进行了利润分配, 分配金额为 16,996,848.62 元。

截至 2020 年 6 月 30 日, 期末可供分配利润为 84,601,675.20 元, 其中, 未分配利润已实现部分为 200,055,605.68 元, 未分配利润未实现部分为 -115,453,930.48 元。

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

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净

值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

本报告期内本基金进行了 2 次收益分配,分配金额为 33,497,184.16 元,符合基金合同的规定。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 半年度财务会计报告 (未经审计)

## 6.1 资产负债表

会计主体: 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2020 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产:</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 21,588,321.51                  | 24,513,502.70                    |
| 结算备付金           |            | -                              | 104,322.01                       |
| 存出保证金           |            | 31,730.76                      | 30,727.63                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 327,714,086.06                 | 346,962,131.59                   |
| 其中: 股票投资        |            | 327,659,186.06                 | 346,962,131.59                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 54,900.00                      | -                                |
| 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         |            | 384,110.01                     | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 4,873.51                       | 6,086.69                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 9,454.85                       | 15,328.21                        |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 349,732,576.70                 | 371,632,098.83                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 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           |            | 460,974.42                     | 29,589.46                        |
| 应付管理人报酬         |            | 270,567.03                     | 311,626.00                       |
| 应付托管费           |            | 59,524.71                      | 68,557.71                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 255,548.06                     | 37,273.21                        |
| 应交税费            |            | 0.21                           | -                                |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | -              | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 1,353,169.50   | 1,287,648.28   |
| 负债合计          |          | 2,399,783.93   | 1,734,694.66   |
| <b>所有者权益:</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 262,731,117.57 | 272,510,815.04 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 84,601,675.20  | 97,386,589.13  |
| 所有者权益合计       |          | 347,332,792.77 | 369,897,404.17 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 349,732,576.70 | 371,632,098.83 |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.412 元，基金份额总额 245,994,805.92 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |          | 22,552,060.90                            | 35,204,502.02                                 |
| 1.利息收入                |          | 91,848.14                                | 62,068.35                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11 | 91,843.76                                | 62,016.09                                     |
| 债券利息收入                |          | 4.38                                     | 52.26   |
| 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）      |          | 24,818,086.83                            | 4,366,803.75                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12 | 21,685,183.57                            | 1,669,778.25                                  |
| 基金投资收益                |          | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13 | -  | 37,806.04                                     |
| 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 | 3,132,903.26                             | 2,659,219.46                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | -2,459,584.52                            | 30,749,261.92                                 |
| 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 | 101,710.45                               | 26,368.00                                     |



|                            |            |               |               |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 列)                         |            |               |               |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 2,989,631.66  | 1,357,289.30  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 1,854,335.34  | 860,600.30    |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 407,953.73    | 189,332.10    |
| 3. 销售服务费                   |            | -             | -             |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 604,076.54    | 186,316.64    |
| 5. 利息支出                    |            | -             | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -             | -             |
| 6. 税金及附加                   |            | 0.02          | 0.02          |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 123,266.03    | 121,040.24    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 19,562,429.24 | 33,847,212.72 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 19,562,429.24 | 33,847,212.72 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 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）                        | 272,510,815.04                        | 97,386,589.13  | 369,897,404.17  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 19,562,429.24  | 19,562,429.24   |
| 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）      | -9,779,697.47                         | 1,149,840.99   | -8,629,856.48   |
| 其中：1. 基金申购款                            | 74,007,586.58                         | 25,434,612.83  | 99,442,199.41   |
| 2. 基金赎回款                               | -83,787,284.05                        | -24,284,771.84 | -108,072,055.89 |
| 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） | -                                     | -33,497,184.16 | -33,497,184.16  |
| 五、期末所有者权益                              | 262,731,117.57                        | 84,601,675.20  | 347,332,792.77  |

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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_ 林培富                      \_\_\_\_\_ 刁俊东                      \_\_\_\_\_ 龚珉  
 基金管理人负责人                      主管会计工作负责人                      会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

管理有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

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

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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<br>2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 21,588,321.51          |
| 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：            | 21,588,321.51          |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |                |               |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 287,240,958.40         | 327,659,186.06 | 40,418,227.66 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场                  | 54,900.00      | -             |
|               | 银行间市场                  | -              | -             |
|               | 合计                     | 54,900.00      | -             |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -             |
| 基金            | -                      | -              | -             |
| 其他            | -                      | -              | -             |
| 合计            | 287,295,858.40         | 327,714,086.06 | 40,418,227.66 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|----------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 4,856.07               |

|            |          |
|------------|----------|
| 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  | -        |
| 应收债券利息     | 4.57     |
| 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         | 12.87    |
| 合计         | 4,873.51 |

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 255,548.06        |
| 银行间市场应付交易费用 | -                 |
| 合计          | 255,548.06        |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 500,000.00        |
| 应付赎回费       | 1,348.41          |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 其他          | 612,478.23        |
| 预提费用        | 239,342.86        |
| 合计          | 1,353,169.50      |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                |
|------|----------------------------|----------------|
|      | 基金份额(份)                    | 账面金额           |
| 上年度末 | 255,127,274.93             | 272,510,815.04 |
| 本期申购 | 69,292,853.57              | 74,007,586.58  |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期赎回(以“-”号填列) | -78,425,322.58 | -83,787,284.05 |
| - 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           | 245,994,805.92 | 262,731,117.57 |

注：1，申购含红利再投及转换入份额及金额；赎回含转换出份额及金额。

2，截至 2020 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 62,021,343.00 份(2019 年 12 月 31 日：68,763,845.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 183,973,462.92 份(2019 年 12 月 31 日：186,363,429.93 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分           | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|-----------------|----------------|
| 上年度末           | 217,948,753.15 | -120,562,164.02 | 97,386,589.13  |
| 本期利润           | 22,022,013.76  | -2,459,584.52   | 19,562,429.24  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -6,417,977.07  | 7,567,818.06    | 1,149,840.99   |
| 其中：基金申购款       | 59,502,378.04  | -34,067,765.21  | 25,434,612.83  |
| 基金赎回款          | -65,920,355.11 | 41,635,583.27   | -24,284,771.84 |
| 本期已分配利润        | -33,497,184.16 | -               | -33,497,184.16 |
| 本期末            | 200,055,605.68 | -115,453,930.48 | 84,601,675.20  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 91,048.84                             |
| 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 | 586.38                                |
| 其他        | 208.54                                |
| 合计        | 91,843.76                             |

#### 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<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额    | 209,406,381.83                        |
| 减: 卖出股票成本总额 | 187,721,198.26                        |
| 买卖股票差价收入    | 21,685,183.57                         |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

| 项目             | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益    | 3,132,903.26                          |
| 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             | 3,132,903.26                          |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位: 人民币元

| 项目名称                        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                  | -2,459,584.52                         |
| ——股票投资                      | -2,459,584.52                         |
| ——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<br>增值税 | -                                     |
| 合计                          | -2,459,584.52                         |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 101,680.70                            |
| 转换费收入   | 29.75                                 |
| 合计      | 101,710.45                            |

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

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

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 604,076.54                            |
| 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        | 604,076.54                            |

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 29,835.26                             |
| 信息披露费   | 59,672.34                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 深交所上市年费 | 29,835.26                             |
| 银行划款费用  | 3,923.17                              |
| 合计      | 123,266.03                            |

**6.4.7.21 分部报告**

无。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

无。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系      |
|------------------------|--------------|
| 长盛基金管理有限公司(“长盛基金公司”)   | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |

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

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<br>2020年1月1日至2020年<br>6月30日 | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,854,335.34                   | 860,600.30                          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 41,787.81                      | 42,259.17                           |

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 407,953.73                               | 189,332.10                                    |

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 |
|---------------------------------|--|---|
| 基金合同生效日（2015 年 5 月 22 日）持有的基金份额 | -  | -   |
| 报告期初持有的基金份额                     | -  | -   |
| 报告期间申购/买入总份额                    | 7,142,857.14                             | -   |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -  | -   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | -  | -   |
| 报告期末持有的基金份额                     | 7,142,857.14                             | -   |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例             | 2.9037%                                  | -   |

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

| 关联方名称  | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |           |
|--------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
|        | 期末余额                       | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 中国建设银行 | 21,588,321.51              | 91,048.84 | 16,879,397.03                   | 55,643.71 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日              | 除息日                |                    | 每10份<br>基金份额分<br>红数 | 现金形式<br>发放总额  | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配<br>合计  | 备注 |
|----|--------------------|--------------------|--------------------|---------------------|---------------|---------------|---------------|----|
|    |                    | 场内                 | 场外                 |                     |               |               |               |    |
| 1  | 2020年<br>6月<br>17日 | 2020年<br>6月<br>18日 | 2020年<br>6月<br>17日 | 0.6930              | 14,760,030.58 | 2,236,818.04  | 16,996,848.62 |    |
| 2  | 2020年<br>3月<br>24日 | 2020年<br>3月<br>25日 | 2020年<br>3月<br>24日 | 0.5960              | 14,666,470.14 | 1,833,865.40  | 16,500,335.54 |    |
| 合计 | -                  | -                  | -                  | 1.2890              | 29,426,500.72 | 4,070,683.44  | 33,497,184.16 |    |

**6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                    |               |        |       |        |                  |            |            |    |
|----------------------|------|--------------------|---------------|--------|-------|--------|------------------|------------|------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日              | 可流通日          | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：<br>股) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 688568               | 中科星图 | 2020年<br>6月<br>30日 | 2020年<br>7月8日 | 新股未上市  | 16.21 | 16.21  | 11,020           | 178,634.20 | 178,634.20 | -  |
| 688377               | 迪威尔  | 2020年<br>6月        | 2020年<br>7月8日 | 新股未上市  | 16.42 | 16.42  | 7,894            | 129,619.48 | 129,619.48 | -  |

|        |      |                  |                  |        |        |        |        |            |              |   |
|--------|------|------------------|------------------|--------|--------|--------|--------|------------|--------------|---|
|        |      | 29 日             |                  |        |        |        |        |            |              |   |
| 688528 | 秦川物联 | 2020 年 6 月 19 日  | 2020 年 7 月 1 日   | 新股未上市  | 11.33  | 11.33  | 8,337  | 94,458.21  | 94,458.21    | - |
| 688600 | 皖仪科技 | 2020 年 6 月 23 日  | 2020 年 7 月 3 日   | 新股未上市  | 15.50  | 15.50  | 5,468  | 84,754.00  | 84,754.00    | - |
| 300847 | 中船汉光 | 2020 年 6 月 29 日  | 2020 年 7 月 9 日   | 新股未上市  | 6.94   | 6.94   | 1,420  | 9,854.80   | 9,854.80     | - |
| 300845 | 捷安高科 | 2020 年 6 月 24 日  | 2020 年 7 月 3 日   | 新股未上市  | 17.63  | 17.63  | 470    | 8,286.10   | 8,286.10     | - |
| 300843 | 胜蓝股份 | 2020 年 6 月 23 日  | 2020 年 7 月 2 日   | 新股未上市  | 10.01  | 10.01  | 751    | 7,517.51   | 7,517.51     | - |
| 300840 | 酷特智能 | 2020 年 6 月 30 日  | 2020 年 7 月 8 日   | 新股未上市  | 5.94   | 5.94   | 1,185  | 7,038.90   | 7,038.90     | - |
| 300846 | 首都在线 | 2020 年 6 月 22 日  | 2020 年 7 月 1 日   | 新股未上市  | 3.37   | 3.37   | 1,131  | 3,811.47   | 3,811.47     | - |
| 688396 | 华润微  | 2020 年 2 月 14 日  | 2020 年 8 月 27 日  | 新股流通受限 | 12.80  | 41.60  | 28,156 | 360,396.80 | 1,171,289.60 | - |
| 688298 | 东方生物 | 2020 年 1 月 20 日  | 2020 年 8 月 5 日   | 新股流通受限 | 21.25  | 143.98 | 5,286  | 112,327.50 | 761,078.28   | - |
| 688200 | 华峰测控 | 2020 年 2 月 11 日  | 2020 年 8 月 18 日  | 新股流通受限 | 107.41 | 269.85 | 2,520  | 270,673.20 | 680,022.00   | - |
| 688181 | 八亿时空 | 2019 年 12 月 27 日 | 2020 年 7 月 6 日   | 新股流通受限 | 43.98  | 60.97  | 4,306  | 189,377.88 | 262,536.82   | - |
| 688555 | 泽达易盛 | 2020 年 6 月 12 日  | 2020 年 12 月 23 日 | 新股流通受限 | 19.49  | 73.25  | 3,004  | 58,547.96  | 220,043.00   | - |
| 002500 | 山西证券 | 2020 年 6 月 29 日  | 2020 年 7 月 10 日  | 配股未上市  | 5.00   | 6.54   | 8,278  | 41,390.00  | 54,138.12    | - |

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |    |    |     |     |    |     |    |    |      |    |
|----------------------|----|----|-----|-----|----|-----|----|----|------|----|
| 证券                   | 证券 | 成功 | 可流通 | 流通受 | 认购 | 期末估 | 数量 | 期末 | 期末估值 | 备注 |

| 代码     | 名称    | 认购日                   | 日                     | 限类型       | 价格     | 值单价    | (单位: 张) | 成本总额      | 总额        |   |
|--------|-------|-----------------------|-----------------------|-----------|--------|--------|---------|-----------|-----------|---|
| 128112 | 歌尔转 2 | 2020 年<br>6 月<br>12 日 | 2020 年<br>7 月<br>13 日 | 新债未<br>上市 | 100.00 | 100.00 | 549     | 54,900.00 | 54,900.00 | - |

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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称   | 停牌日期                  | 停牌原因   | 期末估值单价 | 复牌日期                  | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额   | 备注 |
|--------|--------|-----------------------|--------|--------|-----------------------|--------|-------|--------|----------|----|
| 002254 | 泰和新材   | 2020 年<br>6 月<br>29 日 | 重大事项停牌 | 13.60  | 2020 年<br>7 月<br>14 日 | 14.96  | 88    | 989.30 | 1,196.80 | -  |
| 601880 | 大连港    | 2020 年<br>6 月<br>22 日 | 重大事项停牌 | 1.72   | 2020 年<br>7 月 8 日     | 1.89   | 31    | 64.10  | 53.32    | -  |
| 002470 | *ST 金正 | 2020 年<br>6 月<br>30 日 | 重大事项停牌 | 2.27   | 2020 年<br>7 月 1 日     | 2.16   | 16    | 67.85  | 36.32    | -  |

注：本基金截至 2020 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限



制以控制相应的信用风险。

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

于 2020 年 6 月 30 日：本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.02% (2019 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资)。

### 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 2020 年 06 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)。

本基金所持证券均在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 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 2020 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、存出保证金和债券投资等。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020 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                     | 21,588,321.51 | -     | -         | -              | 21,588,321.51  |
| 存出保证金                    | 31,730.76     | -     | -         | -              | 31,730.76      |
| 交易性金融资产                  | -             | -     | 54,900.00 | 327,659,186.06 | 327,714,086.06 |
| 应收证券清算款                  | -             | -     | -         | 384,110.01     | 384,110.01     |
| 应收利息                     | -             | -     | -         | 4,873.51       | 4,873.51       |
| 应收申购款                    | -             | -     | -         | 9,454.85       | 9,454.85       |
| 资产总计                     | 21,620,052.27 | -     | 54,900.00 | 328,057,624.43 | 349,732,576.70 |
| 负债                       |               |       |           |                |                |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -         | 460,974.42     | 460,974.42     |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -         | 270,567.03     | 270,567.03     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -         | 59,524.71      | 59,524.71      |
| 应付交易费用                   | -             | -     | -         | 255,548.06     | 255,548.06     |
| 应交税费                     | -             | -     | -         | 0.21           | 0.21           |
| 其他负债                     | -             | -     | -         | 1,353,169.50   | 1,353,169.50   |
| 负债总计                     | -             | -     | -         | 2,399,783.93   | 2,399,783.93   |
| 利率敏感度缺口                  | 21,620,052.27 | -     | 54,900.00 | 325,657,840.50 | 347,332,792.77 |
| 上年度末<br>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                     | 24,513,502.70 | -     | -         | -              | 24,513,502.70  |
| 结算备付金                    | 104,322.01    | -     | -         | -              | 104,322.01     |
| 存出保证金                    | 30,727.63     | -     | -         | -              | 30,727.63      |
| 交易性金融资产                  | -             | -     | -         | 346,962,131.59 | 346,962,131.59 |
| 应收利息                     | -             | -     | -         | 6,086.69       | 6,086.69       |
| 应收申购款                    | -             | -     | -         | 15,328.21      | 15,328.21      |
| 资产总计                     | 24,648,552.34 | -     | -         | 346,983,546.49 | 371,632,098.83 |
| 负债                       |               |       |           |                |                |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -         | 29,589.46      | 29,589.46      |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -         | 311,626.00     | 311,626.00     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -         | 68,557.71      | 68,557.71      |
| 应付交易费用                   | -             | -     | -         | 37,273.21      | 37,273.21      |
| 其他负债                     | -             | -     | -         | 1,287,648.28   | 1,287,648.28   |
| 负债总计                     | -             | -     | -         | 1,734,694.66   | 1,734,694.66   |
| 利率敏感度缺口                  | 24,648,552.34 | -     | -         | 345,248,851.83 | 369,897,404.17 |

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

于 2020 年 6 月 30 日, 本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02%。(2019 年 12 月 31 日: 本基金未持有交易性债券投资), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日: 同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

| 项目 | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |                   | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |                       |
|----|------------------------|-------------------|--------------------------|-----------------------|
|    | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例 | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
|    |                        |                   |                          |                       |

|              |                | (%)   |                |       |
|--------------|----------------|-------|----------------|-------|
| 交易性金融资产-股票投资 | 327,659,186.06 | 94.34 | 346,962,131.59 | 93.80 |
| 合计           | 327,659,186.06 | 94.34 | 346,962,131.59 | 93.80 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                               |                         |
|----|----------------------|-------------------------------|-------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元) |                         |
|    |                      | 本期末 (2020 年 6 月 30 日)         | 上年度末 (2019 年 12 月 31 日) |
|    | 1. 业绩比较基准上升 5%       | 16,519,185.83                 | 17,596,901.72           |
|    | 2. 业绩比较基准下降 5%       | -16,519,185.83                | -17,596,901.72          |

#### 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 2020 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 323,984,817.13 元, 属于第二层次的余额为 3,729,268.93 元, 无属于第三层次的余额。(2019 年 12 月 31 日: 属于第一层次的余额为 341,466,945.16 元, 属于第二层次的余额为 5,495,186.43 元, 无属于第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下:

| 项目   | 交易性金融资产                                  |            |    |   |            |            |
|--|--|------------|----|---|------------|------------|
|  | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 |            |    | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 |            |            |
|  | 债券投资                                     | 权益工具<br>投资 | 合计 | 债券投资  | 权益工具<br>投资 | 合计         |
| 期初   | -  | -          | -  | -   | 208,509.88 | 208,509.88 |
| 购买   | -  | -          | -  | -   |            |            |
| 出售   | -  | -          | -  | -   | 182,451.82 | 182,451.82 |
| 转入第三层次   | -  | -          | -  | -   | -          | -          |
| 转出第三层次   | -  | -          | -  | -   | -          | -          |
| 当期利得或损失总额                                      | -  | -          | -  | -   | 74,345.22  | 74,345.22  |
| 计入损益的利得或损失                                     | -  | -          | -  | -   | 74,345.22  | 74,345.22  |
| 期末   | -  | -          | -  | -   | 100,403.28 | 100,403.28 |
| 期末仍持有的资产计入上半年度<br>损益的未实现利得或损失的变动<br>——公允价值变动损益 | -  | -          | -  | -   | -          | -          |

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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 (2019 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              | 327,659,186.06 | 93.69         |
|    | 其中：股票             | 327,659,186.06 | 93.69         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 54,900.00      | 0.02          |
|    | 其中：债券             | 54,900.00      | 0.02          |
|    | 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      | 21,588,321.51  | 6.17          |
| 8  | 其他各项资产            | 430,169.13     | 0.12          |
| 9  | 合计                | 349,732,576.70 | 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         | 4,722,862.00   | 1.36          |
| B  | 采矿业              | 6,826,772.28   | 1.97          |
| C  | 制造业              | 163,013,202.32 | 46.93         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,226,445.07   | 1.79          |
| E  | 建筑业              | 6,149,953.54   | 1.77          |
| F  | 批发和零售业           | 6,035,027.14   | 1.74          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 7,735,282.05   | 2.23          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 159,229.50     | 0.05          |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 19,784,208.90  | 5.70          |
| J  | 金融业              | 75,839,258.20  | 21.83         |
| K  | 房地产业             | 10,957,706.28  | 3.15          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 4,871,762.78   | 1.40          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 2,252,948.00   | 0.65          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 277,728.04     | 0.08          |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | 0.00           | 0.00  |
| P | 教育            | 335,775.00     | 0.10  |
| Q | 卫生和社会工作       | 3,867,843.70   | 1.11  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 2,530,444.69   | 0.73  |
| S | 综合            | 579,200.12     | 0.17  |
|   | 合计            | 322,165,649.61 | 92.75 |

## 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         | 497.05       | 0.00         |
| B  | 采矿业              | 786.66       | 0.00         |
| C  | 制造业              | 4,503,030.08 | 1.30         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,095.09    | 0.00         |
| E  | 建筑业              | 499.00       | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 1,428.77     | 0.00         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 360.96       | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 970,729.75   | 0.28         |
| J  | 金融业              | -            | -            |
| K  | 房地产业             | 953.67       | 0.00         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 939.52       | 0.00         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 412.00       | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -            |
| P  | 教育               | -            | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -            | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 803.90       | 0.00         |
| S  | 综合               | -            | -            |
|    | 合计               | 5,493,536.45 | 1.58         |

## 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净 |
|----|------|------|-------|------|--------|
|----|------|------|-------|------|--------|



|    |        |       |         |               | 值比例 (%) |
|----|--------|-------|---------|---------------|---------|
| 1  | 601318 | 中国平安  | 193,587 | 13,822,111.80 | 3.98    |
| 2  | 600519 | 贵州茅台  | 9,003   | 13,170,308.64 | 3.79    |
| 3  | 600036 | 招商银行  | 184,416 | 6,218,507.52  | 1.79    |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药  | 66,308  | 6,120,228.40  | 1.76    |
| 5  | 000858 | 五粮液   | 34,598  | 5,920,409.76  | 1.70    |
| 6  | 000651 | 格力电器  | 85,923  | 4,860,664.11  | 1.40    |
| 7  | 000333 | 美的集团  | 69,038  | 4,127,782.02  | 1.19    |
| 8  | 002475 | 立讯精密  | 73,852  | 3,792,300.20  | 1.09    |
| 9  | 600030 | 中信证券  | 152,334 | 3,672,772.74  | 1.06    |
| 10 | 601166 | 兴业银行  | 222,871 | 3,516,904.38  | 1.01    |
| 11 | 600887 | 伊利股份  | 108,334 | 3,372,437.42  | 0.97    |
| 12 | 000002 | 万科 A  | 121,654 | 3,180,035.56  | 0.92    |
| 13 | 601398 | 工商银行  | 626,712 | 3,121,025.76  | 0.90    |
| 14 | 600900 | 长江电力  | 147,220 | 2,788,346.80  | 0.80    |
| 15 | 601888 | 中国中免  | 17,412  | 2,681,970.36  | 0.77    |
| 16 | 601328 | 交通银行  | 491,270 | 2,520,215.10  | 0.73    |
| 17 | 300059 | 东方财富  | 115,257 | 2,328,191.40  | 0.67    |
| 18 | 600585 | 海螺水泥  | 42,815  | 2,265,341.65  | 0.65    |
| 19 | 000725 | 京东方 A | 484,307 | 2,261,713.69  | 0.65    |
| 20 | 600000 | 浦发银行  | 209,825 | 2,219,948.50  | 0.64    |
| 21 | 000661 | 长春高新  | 5,068   | 2,206,100.40  | 0.64    |
| 22 | 002714 | 牧原股份  | 26,768  | 2,194,976.00  | 0.63    |
| 23 | 600016 | 民生银行  | 380,495 | 2,157,406.65  | 0.62    |
| 24 | 603288 | 海天味业  | 17,340  | 2,157,096.00  | 0.62    |
| 25 | 002415 | 海康威视  | 66,891  | 2,030,141.85  | 0.58    |
| 26 | 601688 | 华泰证券  | 105,291 | 1,979,470.80  | 0.57    |
| 27 | 000063 | 中兴通讯  | 48,262  | 1,936,754.06  | 0.56    |
| 28 | 601012 | 隆基股份  | 47,241  | 1,924,125.93  | 0.55    |
| 29 | 600048 | 保利地产  | 128,024 | 1,892,194.72  | 0.54    |
| 30 | 600837 | 海通证券  | 144,749 | 1,820,942.42  | 0.52    |
| 31 | 000001 | 平安银行  | 140,779 | 1,801,971.20  | 0.52    |
| 32 | 601668 | 中国建筑  | 375,199 | 1,789,699.23  | 0.52    |
| 33 | 603259 | 药明康德  | 18,440  | 1,781,304.00  | 0.51    |
| 34 | 300498 | 温氏股份  | 79,800  | 1,739,640.00  | 0.50    |
| 35 | 601288 | 农业银行  | 513,867 | 1,736,870.46  | 0.50    |
| 36 | 600031 | 三一重工  | 90,129  | 1,690,820.04  | 0.49    |
| 37 | 600570 | 恒生电子  | 14,934  | 1,608,391.80  | 0.46    |

|    |        |        |         |              |      |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 38 | 300015 | 爱尔眼科   | 35,998  | 1,564,113.10 | 0.45 |
| 39 | 601601 | 中国太保   | 56,240  | 1,532,540.00 | 0.44 |
| 40 | 000100 | TCL 科技 | 241,915 | 1,499,873.00 | 0.43 |
| 41 | 601229 | 上海银行   | 177,860 | 1,476,238.00 | 0.43 |
| 42 | 300142 | 沃森生物   | 27,500  | 1,439,900.00 | 0.41 |
| 43 | 002142 | 宁波银行   | 53,724  | 1,411,329.48 | 0.41 |
| 44 | 600309 | 万华化学   | 28,079  | 1,403,669.21 | 0.40 |
| 45 | 601211 | 国泰君安   | 80,700  | 1,392,882.00 | 0.40 |
| 46 | 603986 | 兆易创新   | 5,900   | 1,391,869.00 | 0.40 |
| 47 | 601988 | 中国银行   | 376,938 | 1,311,744.24 | 0.38 |
| 48 | 601169 | 北京银行   | 264,694 | 1,297,000.60 | 0.37 |
| 49 | 002352 | 顺丰控股   | 23,700  | 1,296,390.00 | 0.37 |
| 50 | 600588 | 用友网络   | 29,079  | 1,282,383.90 | 0.37 |
| 51 | 600009 | 上海机场   | 17,204  | 1,239,892.28 | 0.36 |
| 52 | 601766 | 中国中车   | 217,487 | 1,211,402.59 | 0.35 |
| 53 | 600690 | 海尔智家   | 67,672  | 1,197,794.40 | 0.34 |
| 54 | 000568 | 泸州老窖   | 13,134  | 1,196,770.08 | 0.34 |
| 55 | 002241 | 歌尔股份   | 40,654  | 1,193,601.44 | 0.34 |
| 56 | 000338 | 潍柴动力   | 85,706  | 1,175,886.32 | 0.34 |
| 57 | 002594 | 比亚迪    | 16,184  | 1,162,011.20 | 0.33 |
| 58 | 300122 | 智飞生物   | 11,400  | 1,141,710.00 | 0.33 |
| 59 | 002304 | 洋河股份   | 10,795  | 1,134,986.30 | 0.33 |
| 60 | 002410 | 广联达    | 16,141  | 1,125,027.70 | 0.32 |
| 61 | 000876 | 新希望    | 37,712  | 1,123,817.60 | 0.32 |
| 62 | 600999 | 招商证券   | 51,169  | 1,123,159.55 | 0.32 |
| 63 | 600703 | 三安光电   | 43,758  | 1,093,950.00 | 0.31 |
| 64 | 601899 | 紫金矿业   | 245,827 | 1,081,638.80 | 0.31 |
| 65 | 600104 | 上汽集团   | 62,666  | 1,064,695.34 | 0.31 |
| 66 | 002555 | 三七互娱   | 22,700  | 1,062,360.00 | 0.31 |
| 67 | 002230 | 科大讯飞   | 27,550  | 1,031,196.50 | 0.30 |
| 68 | 002027 | 分众传媒   | 183,700 | 1,023,209.00 | 0.29 |
| 69 | 601818 | 光大银行   | 284,796 | 1,019,569.68 | 0.29 |
| 70 | 600745 | 闻泰科技   | 8,000   | 1,007,600.00 | 0.29 |
| 71 | 002007 | 华兰生物   | 19,530  | 978,648.30   | 0.28 |
| 72 | 300601 | 康泰生物   | 6,000   | 972,960.00   | 0.28 |
| 73 | 300347 | 泰格医药   | 9,370   | 954,615.60   | 0.27 |
| 74 | 600919 | 江苏银行   | 165,200 | 936,684.00   | 0.27 |
| 75 | 600028 | 中国石化   | 239,296 | 935,647.36   | 0.27 |
| 76 | 001979 | 招商蛇口   | 56,636  | 931,095.84   | 0.27 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 77  | 600436 | 片仔癀  | 5,345   | 909,986.25 | 0.26 |
| 78  | 000538 | 云南白药 | 9,111   | 854,702.91 | 0.25 |
| 79  | 600547 | 山东黄金 | 23,224  | 850,462.88 | 0.24 |
| 80  | 601088 | 中国神华 | 58,996  | 847,182.56 | 0.24 |
| 81  | 600406 | 国电南瑞 | 41,335  | 837,033.75 | 0.24 |
| 82  | 300413 | 芒果超媒 | 12,700  | 828,040.00 | 0.24 |
| 83  | 000895 | 双汇发展 | 17,837  | 822,107.33 | 0.24 |
| 84  | 300003 | 乐普医疗 | 22,300  | 814,396.00 | 0.23 |
| 85  | 000166 | 申万宏源 | 161,251 | 814,317.55 | 0.23 |
| 86  | 601628 | 中国人寿 | 29,747  | 809,415.87 | 0.23 |
| 87  | 600050 | 中国联通 | 166,472 | 805,724.48 | 0.23 |
| 88  | 002271 | 东方雨虹 | 19,700  | 800,411.00 | 0.23 |
| 89  | 600438 | 通威股份 | 46,000  | 799,480.00 | 0.23 |
| 90  | 300014 | 亿纬锂能 | 16,500  | 789,525.00 | 0.23 |
| 91  | 601009 | 南京银行 | 107,401 | 787,249.33 | 0.23 |
| 92  | 000938 | 紫光股份 | 18,244  | 784,127.12 | 0.23 |
| 93  | 002129 | 中环股份 | 34,876  | 783,314.96 | 0.23 |
| 94  | 002371 | 北方华创 | 4,459   | 762,087.69 | 0.22 |
| 95  | 601006 | 大秦铁路 | 106,328 | 748,549.12 | 0.22 |
| 96  | 000776 | 广发证券 | 52,977  | 748,035.24 | 0.22 |
| 97  | 300136 | 信维通信 | 13,900  | 736,978.00 | 0.21 |
| 98  | 603160 | 汇顶科技 | 3,300   | 735,570.00 | 0.21 |
| 99  | 002460 | 赣锋锂业 | 13,700  | 733,909.00 | 0.21 |
| 100 | 601390 | 中国中铁 | 145,699 | 731,408.98 | 0.21 |
| 101 | 600196 | 复星医药 | 21,574  | 730,279.90 | 0.21 |
| 102 | 601857 | 中国石油 | 173,731 | 727,932.89 | 0.21 |
| 103 | 600019 | 宝钢股份 | 159,359 | 726,677.04 | 0.21 |
| 104 | 603019 | 中科曙光 | 18,600  | 714,240.00 | 0.21 |
| 105 | 000977 | 浪潮信息 | 18,074  | 708,139.32 | 0.20 |
| 106 | 002044 | 美年健康 | 49,100  | 707,531.00 | 0.20 |
| 107 | 300124 | 汇川技术 | 18,535  | 704,144.65 | 0.20 |
| 108 | 002050 | 三花智控 | 32,078  | 702,508.20 | 0.20 |
| 109 | 300253 | 卫宁健康 | 30,348  | 696,183.12 | 0.20 |
| 110 | 601186 | 中国铁建 | 82,251  | 689,263.38 | 0.20 |
| 111 | 002602 | 世纪华通 | 44,592  | 682,703.52 | 0.20 |
| 112 | 600809 | 山西汾酒 | 4,653   | 674,685.00 | 0.19 |
| 113 | 600015 | 华夏银行 | 110,063 | 673,585.56 | 0.19 |
| 114 | 002001 | 新和成  | 23,100  | 672,210.00 | 0.19 |
| 115 | 002311 | 海大集团 | 14,100  | 671,019.00 | 0.19 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 116 | 002624 | 完美世界 | 11,600  | 668,624.00 | 0.19 |
| 117 | 601336 | 新华保险 | 14,959  | 662,384.52 | 0.19 |
| 118 | 300433 | 蓝思科技 | 23,500  | 658,940.00 | 0.19 |
| 119 | 601989 | 中国重工 | 163,126 | 652,504.00 | 0.19 |
| 120 | 002127 | 南极电商 | 30,700  | 649,919.00 | 0.19 |
| 121 | 601933 | 永辉超市 | 68,425  | 641,826.50 | 0.18 |
| 122 | 603501 | 韦尔股份 | 3,100   | 626,045.00 | 0.18 |
| 123 | 002456 | 欧菲光  | 33,755  | 620,754.45 | 0.18 |
| 124 | 002236 | 大华股份 | 32,265  | 619,810.65 | 0.18 |
| 125 | 002821 | 凯莱英  | 2,500   | 607,500.00 | 0.17 |
| 126 | 600958 | 东方证券 | 64,000  | 607,360.00 | 0.17 |
| 127 | 000157 | 中联重科 | 92,735  | 596,286.05 | 0.17 |
| 128 | 600352 | 浙江龙盛 | 46,562  | 595,527.98 | 0.17 |
| 129 | 600183 | 生益科技 | 20,309  | 594,444.43 | 0.17 |
| 130 | 600741 | 华域汽车 | 28,233  | 586,964.07 | 0.17 |
| 131 | 002024 | 苏宁易购 | 66,582  | 583,924.14 | 0.17 |
| 132 | 601377 | 兴业证券 | 83,802  | 574,043.70 | 0.17 |
| 133 | 600201 | 生物股份 | 20,169  | 561,504.96 | 0.16 |
| 134 | 600383 | 金地集团 | 40,362  | 552,959.40 | 0.16 |
| 135 | 002008 | 大族激光 | 15,221  | 547,194.95 | 0.16 |
| 136 | 002463 | 沪电股份 | 21,555  | 538,443.90 | 0.16 |
| 137 | 601138 | 工业富联 | 35,500  | 537,825.00 | 0.15 |
| 138 | 000860 | 顺鑫农业 | 9,311   | 530,540.78 | 0.15 |
| 139 | 002185 | 华天科技 | 39,200  | 530,376.00 | 0.15 |
| 140 | 600346 | 恒力石化 | 37,800  | 529,200.00 | 0.15 |
| 141 | 600660 | 福耀玻璃 | 25,053  | 522,856.11 | 0.15 |
| 142 | 601901 | 方正证券 | 73,604  | 521,116.32 | 0.15 |
| 143 | 600739 | 辽宁成大 | 27,312  | 517,016.16 | 0.15 |
| 144 | 601225 | 陕西煤业 | 71,492  | 515,457.32 | 0.15 |
| 145 | 300408 | 三环集团 | 18,600  | 515,220.00 | 0.15 |
| 146 | 002120 | 韵达股份 | 20,700  | 506,115.00 | 0.15 |
| 147 | 300033 | 同花顺  | 3,800   | 505,704.00 | 0.15 |
| 148 | 601877 | 正泰电器 | 19,182  | 505,445.70 | 0.15 |
| 149 | 300558 | 贝达药业 | 3,600   | 503,928.00 | 0.15 |
| 150 | 601155 | 新城控股 | 16,100  | 502,964.00 | 0.14 |
| 151 | 600522 | 中天科技 | 43,898  | 502,632.10 | 0.14 |
| 152 | 002736 | 国信证券 | 44,000  | 497,200.00 | 0.14 |
| 153 | 000425 | 徐工机械 | 84,054  | 496,759.14 | 0.14 |
| 154 | 600109 | 国金证券 | 43,292  | 493,961.72 | 0.14 |

|     |        |       |         |            |      |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 155 | 600529 | 山东药玻  | 8,500   | 493,000.00 | 0.14 |
| 156 | 002439 | 启明星辰  | 11,700  | 492,219.00 | 0.14 |
| 157 | 002202 | 金风科技  | 49,361  | 492,129.17 | 0.14 |
| 158 | 600340 | 华夏幸福  | 21,522  | 491,992.92 | 0.14 |
| 159 | 300088 | 长信科技  | 43,620  | 488,544.00 | 0.14 |
| 160 | 300144 | 宋城演艺  | 28,100  | 486,130.00 | 0.14 |
| 161 | 002385 | 大北农   | 52,510  | 478,366.10 | 0.14 |
| 162 | 603799 | 华友钴业  | 12,290  | 477,589.40 | 0.14 |
| 163 | 601669 | 中国电建  | 136,788 | 473,286.48 | 0.14 |
| 164 | 300012 | 华测检测  | 23,800  | 470,288.00 | 0.14 |
| 165 | 002841 | 视源股份  | 4,700   | 467,744.00 | 0.13 |
| 166 | 000783 | 长江证券  | 69,194  | 466,367.56 | 0.13 |
| 167 | 002131 | 利欧股份  | 120,803 | 466,299.58 | 0.13 |
| 168 | 601788 | 光大证券  | 29,000  | 465,740.00 | 0.13 |
| 169 | 603993 | 洛阳钼业  | 126,356 | 463,726.52 | 0.13 |
| 170 | 601800 | 中国交建  | 63,067  | 462,911.78 | 0.13 |
| 171 | 300285 | 国瓷材料  | 13,800  | 462,438.00 | 0.13 |
| 172 | 600079 | 人福医药  | 16,930  | 460,834.60 | 0.13 |
| 173 | 601108 | 财通证券  | 44,900  | 460,225.00 | 0.13 |
| 174 | 601985 | 中国核电  | 111,388 | 455,576.92 | 0.13 |
| 175 | 601555 | 东吴证券  | 55,498  | 452,863.68 | 0.13 |
| 176 | 600089 | 特变电工  | 66,388  | 449,446.76 | 0.13 |
| 177 | 603369 | 今世缘   | 11,200  | 445,648.00 | 0.13 |
| 178 | 600867 | 通化东宝  | 25,500  | 444,465.00 | 0.13 |
| 179 | 000069 | 华侨城 A | 73,341  | 444,446.46 | 0.13 |
| 180 | 600521 | 华海药业  | 13,000  | 441,090.00 | 0.13 |
| 181 | 600010 | 包钢股份  | 407,616 | 440,225.28 | 0.13 |
| 182 | 000768 | 中航飞机  | 24,791  | 439,792.34 | 0.13 |
| 183 | 603444 | 吉比特   | 800     | 439,208.00 | 0.13 |
| 184 | 600298 | 安琪酵母  | 8,868   | 438,788.64 | 0.13 |
| 185 | 002465 | 海格通信  | 32,934  | 426,165.96 | 0.12 |
| 186 | 600143 | 金发科技  | 32,221  | 424,350.57 | 0.12 |
| 187 | 600161 | 天坛生物  | 9,310   | 422,022.30 | 0.12 |
| 188 | 002916 | 深南电路  | 2,500   | 418,800.00 | 0.12 |
| 189 | 002493 | 荣盛石化  | 33,800  | 415,740.00 | 0.12 |
| 190 | 000066 | 中国长城  | 31,385  | 414,282.00 | 0.12 |
| 191 | 600606 | 绿地控股  | 65,300  | 403,554.00 | 0.12 |
| 192 | 002179 | 中航光电  | 9,803   | 402,021.03 | 0.12 |
| 193 | 600487 | 亨通光电  | 24,480  | 401,716.80 | 0.12 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 194 | 600029 | 南方航空 | 76,882  | 397,479.94 | 0.11 |
| 195 | 000963 | 华东医药 | 15,679  | 396,678.70 | 0.11 |
| 196 | 002075 | 沙钢股份 | 31,600  | 395,000.00 | 0.11 |
| 197 | 002223 | 鱼跃医疗 | 10,791  | 392,792.40 | 0.11 |
| 198 | 000009 | 中国宝安 | 46,139  | 392,642.89 | 0.11 |
| 199 | 002157 | 正邦科技 | 22,400  | 391,552.00 | 0.11 |
| 200 | 600795 | 国电电力 | 210,853 | 390,078.05 | 0.11 |
| 201 | 300496 | 中科创达 | 5,000   | 388,500.00 | 0.11 |
| 202 | 601099 | 太平洋  | 121,900 | 386,423.00 | 0.11 |
| 203 | 002212 | 南洋股份 | 14,500  | 385,410.00 | 0.11 |
| 204 | 300482 | 万孚生物 | 3,700   | 384,800.00 | 0.11 |
| 205 | 600061 | 国投资本 | 30,200  | 384,446.00 | 0.11 |
| 206 | 000625 | 长安汽车 | 34,906  | 383,966.00 | 0.11 |
| 207 | 603517 | 绝味食品 | 5,400   | 381,996.00 | 0.11 |
| 208 | 600886 | 国投电力 | 48,578  | 381,823.08 | 0.11 |
| 209 | 600705 | 中航资本 | 96,360  | 381,585.60 | 0.11 |
| 210 | 601607 | 上海医药 | 20,637  | 379,308.06 | 0.11 |
| 211 | 600893 | 航发动力 | 16,126  | 378,638.48 | 0.11 |
| 212 | 002074 | 国轩高科 | 14,100  | 378,444.00 | 0.11 |
| 213 | 600926 | 杭州银行 | 42,400  | 378,208.00 | 0.11 |
| 214 | 002422 | 科伦药业 | 18,000  | 378,000.00 | 0.11 |
| 215 | 601100 | 恒立液压 | 4,700   | 376,940.00 | 0.11 |
| 216 | 000636 | 风华高科 | 12,836  | 374,682.84 | 0.11 |
| 217 | 300595 | 欧普康视 | 5,400   | 374,436.00 | 0.11 |
| 218 | 603658 | 安图生物 | 2,300   | 373,612.00 | 0.11 |
| 219 | 002273 | 水晶光电 | 21,793  | 373,532.02 | 0.11 |
| 220 | 300207 | 欣旺达  | 19,600  | 370,440.00 | 0.11 |
| 221 | 601128 | 常熟银行 | 49,000  | 367,990.00 | 0.11 |
| 222 | 603882 | 金城医学 | 4,100   | 366,950.00 | 0.11 |
| 223 | 300418 | 昆仑万维 | 14,700  | 366,912.00 | 0.11 |
| 224 | 002466 | 天齐锂业 | 15,861  | 364,009.95 | 0.10 |
| 225 | 600111 | 北方稀土 | 38,983  | 363,321.56 | 0.10 |
| 226 | 600498 | 烽火通信 | 12,545  | 362,675.95 | 0.10 |
| 227 | 300315 | 掌趣科技 | 49,300  | 361,369.00 | 0.10 |
| 228 | 601162 | 天风证券 | 59,600  | 361,176.00 | 0.10 |
| 229 | 603899 | 晨光文具 | 6,600   | 360,360.00 | 0.10 |
| 230 | 600426 | 华鲁恒升 | 20,338  | 359,575.84 | 0.10 |
| 231 | 601066 | 中信建投 | 9,100   | 358,358.00 | 0.10 |
| 232 | 002507 | 涪陵榨菜 | 9,900   | 356,499.00 | 0.10 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 233 | 600637 | 东方明珠 | 36,657  | 353,740.05 | 0.10 |
| 234 | 601111 | 中国国航 | 53,424  | 353,132.64 | 0.10 |
| 235 | 000988 | 华工科技 | 14,391  | 351,572.13 | 0.10 |
| 236 | 300357 | 我武生物 | 5,600   | 348,600.00 | 0.10 |
| 237 | 603939 | 益丰药房 | 3,800   | 345,800.00 | 0.10 |
| 238 | 600176 | 中国巨石 | 37,564  | 343,710.60 | 0.10 |
| 239 | 002340 | 格林美  | 68,500  | 340,445.00 | 0.10 |
| 240 | 600115 | 东方航空 | 80,137  | 338,178.14 | 0.10 |
| 241 | 002603 | 以岭药业 | 10,800  | 336,852.00 | 0.10 |
| 242 | 002601 | 龙蟠佰利 | 18,200  | 336,700.00 | 0.10 |
| 243 | 002607 | 中公教育 | 12,100  | 335,775.00 | 0.10 |
| 244 | 000975 | 银泰黄金 | 21,332  | 334,485.76 | 0.10 |
| 245 | 002414 | 高德红外 | 11,356  | 332,503.68 | 0.10 |
| 246 | 600011 | 华能国际 | 78,700  | 332,114.00 | 0.10 |
| 247 | 601360 | 三六零  | 18,100  | 331,411.00 | 0.10 |
| 248 | 601727 | 上海电气 | 65,368  | 329,454.72 | 0.09 |
| 249 | 600233 | 圆通速递 | 22,600  | 329,056.00 | 0.09 |
| 250 | 300168 | 万达信息 | 14,900  | 328,843.00 | 0.09 |
| 251 | 601816 | 京沪高铁 | 52,700  | 328,321.00 | 0.09 |
| 252 | 300628 | 亿联网络 | 4,800   | 327,648.00 | 0.09 |
| 253 | 300271 | 华宇软件 | 11,600  | 327,236.00 | 0.09 |
| 254 | 600118 | 中国卫星 | 10,596  | 326,674.68 | 0.09 |
| 255 | 600332 | 白云山  | 10,100  | 326,533.00 | 0.09 |
| 256 | 300212 | 易华录  | 5,800   | 324,800.00 | 0.09 |
| 257 | 600271 | 航天信息 | 19,976  | 324,410.24 | 0.09 |
| 258 | 601600 | 中国铝业 | 116,972 | 322,842.72 | 0.09 |
| 259 | 000786 | 北新建材 | 15,124  | 322,594.92 | 0.09 |
| 260 | 600885 | 宏发股份 | 8,000   | 320,960.00 | 0.09 |
| 261 | 601618 | 中国中冶 | 127,706 | 320,542.06 | 0.09 |
| 262 | 000513 | 丽珠集团 | 6,672   | 320,322.72 | 0.09 |
| 263 | 002373 | 千方科技 | 13,300  | 319,067.00 | 0.09 |
| 264 | 601799 | 星宇股份 | 2,500   | 317,500.00 | 0.09 |
| 265 | 002353 | 杰瑞股份 | 10,238  | 317,378.00 | 0.09 |
| 266 | 600859 | 王府井  | 6,954   | 316,754.70 | 0.09 |
| 267 | 000596 | 古井贡酒 | 2,108   | 316,705.92 | 0.09 |
| 268 | 600699 | 均胜电子 | 13,300  | 316,673.00 | 0.09 |
| 269 | 000547 | 航天发展 | 23,013  | 314,587.71 | 0.09 |
| 270 | 600132 | 重庆啤酒 | 4,300   | 313,900.00 | 0.09 |
| 271 | 003816 | 中国广核 | 105,500 | 312,280.00 | 0.09 |

|     |        |       |         |            |      |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 272 | 000656 | 金科股份  | 38,171  | 311,475.36 | 0.09 |
| 273 | 002156 | 通富微电  | 12,400  | 310,620.00 | 0.09 |
| 274 | 600221 | 海航控股  | 205,808 | 308,712.00 | 0.09 |
| 275 | 601838 | 成都银行  | 38,733  | 308,314.68 | 0.09 |
| 276 | 002252 | 上海莱士  | 36,200  | 306,252.00 | 0.09 |
| 277 | 300009 | 安科生物  | 17,100  | 306,090.00 | 0.09 |
| 278 | 002019 | 亿帆医药  | 13,300  | 305,501.00 | 0.09 |
| 279 | 300024 | 机器人   | 22,296  | 304,786.32 | 0.09 |
| 280 | 600489 | 中金黄金  | 33,213  | 303,566.82 | 0.09 |
| 281 | 002797 | 第一创业  | 43,820  | 303,234.40 | 0.09 |
| 282 | 002030 | 达安基因  | 11,026  | 300,789.28 | 0.09 |
| 283 | 000703 | 恒逸石化  | 32,907  | 300,440.91 | 0.09 |
| 284 | 601919 | 中远海控  | 86,500  | 300,155.00 | 0.09 |
| 285 | 600177 | 雅戈尔   | 49,684  | 296,116.64 | 0.09 |
| 286 | 300017 | 网宿科技  | 34,859  | 295,952.91 | 0.09 |
| 287 | 000750 | 国海证券  | 68,187  | 295,931.58 | 0.09 |
| 288 | 000961 | 中南建设  | 33,175  | 295,257.50 | 0.09 |
| 289 | 603858 | 步长制药  | 10,200  | 294,270.00 | 0.08 |
| 290 | 600068 | 葛洲坝   | 49,454  | 294,251.30 | 0.08 |
| 291 | 002557 | 洽洽食品  | 5,400   | 292,626.00 | 0.08 |
| 292 | 600066 | 宇通客车  | 23,734  | 289,554.80 | 0.08 |
| 293 | 002174 | 游族网络  | 11,100  | 289,488.00 | 0.08 |
| 294 | 002250 | 联化科技  | 13,246  | 288,762.80 | 0.08 |
| 295 | 601997 | 贵阳银行  | 40,300  | 288,548.00 | 0.08 |
| 296 | 600801 | 华新水泥  | 12,143  | 287,910.53 | 0.08 |
| 297 | 002195 | 二三四五  | 102,343 | 287,583.83 | 0.08 |
| 298 | 600315 | 上海家化  | 6,000   | 287,400.00 | 0.08 |
| 299 | 000021 | 深科技   | 13,163  | 287,348.29 | 0.08 |
| 300 | 002138 | 顺络电子  | 11,500  | 286,925.00 | 0.08 |
| 301 | 300316 | 晶盛机电  | 11,500  | 284,510.00 | 0.08 |
| 302 | 603233 | 大参林   | 3,500   | 284,270.00 | 0.08 |
| 303 | 600390 | 五矿资本  | 40,200  | 283,812.00 | 0.08 |
| 304 | 600895 | 张江高科  | 13,889  | 282,918.93 | 0.08 |
| 305 | 600380 | 健康元   | 17,400  | 282,576.00 | 0.08 |
| 306 | 601998 | 中信银行  | 54,784  | 282,137.60 | 0.08 |
| 307 | 600004 | 白云机场  | 18,500  | 281,940.00 | 0.08 |
| 308 | 000050 | 深天马 A | 18,300  | 281,088.00 | 0.08 |
| 309 | 002152 | 广电运通  | 21,550  | 278,857.00 | 0.08 |
| 310 | 300058 | 蓝色光标  | 35,651  | 278,077.80 | 0.08 |



|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 311 | 002572 | 索菲亚  | 11,402  | 275,586.34 | 0.08 |
| 312 | 300070 | 碧水源  | 33,907  | 275,324.84 | 0.08 |
| 313 | 000998 | 隆平高科 | 16,500  | 274,725.00 | 0.08 |
| 314 | 300244 | 迪安诊断 | 7,780   | 274,634.00 | 0.08 |
| 315 | 600486 | 扬农化工 | 3,300   | 272,250.00 | 0.08 |
| 316 | 600845 | 宝信软件 | 4,600   | 271,768.00 | 0.08 |
| 317 | 000401 | 冀东水泥 | 16,899  | 271,059.96 | 0.08 |
| 318 | 601198 | 东兴证券 | 24,700  | 269,230.00 | 0.08 |
| 319 | 600410 | 华胜天成 | 19,696  | 267,865.60 | 0.08 |
| 320 | 600667 | 太极实业 | 22,600  | 267,132.00 | 0.08 |
| 321 | 600085 | 同仁堂  | 9,834   | 266,698.08 | 0.08 |
| 322 | 603833 | 欧派家居 | 2,300   | 266,570.00 | 0.08 |
| 323 | 603338 | 浙江鼎力 | 3,500   | 265,195.00 | 0.08 |
| 324 | 601881 | 中国银河 | 23,100  | 264,957.00 | 0.08 |
| 325 | 002078 | 太阳纸业 | 27,825  | 264,894.00 | 0.08 |
| 326 | 600037 | 歌华有线 | 17,400  | 264,480.00 | 0.08 |
| 327 | 600535 | 天士力  | 16,262  | 263,769.64 | 0.08 |
| 328 | 300274 | 阳光电源 | 18,260  | 262,761.40 | 0.08 |
| 329 | 002508 | 老板电器 | 8,439   | 262,537.29 | 0.08 |
| 330 | 000623 | 吉林敖东 | 16,655  | 261,983.15 | 0.08 |
| 331 | 600155 | 华创阳安 | 21,800  | 261,382.00 | 0.08 |
| 332 | 600018 | 上港集团 | 62,161  | 261,076.20 | 0.08 |
| 333 | 002511 | 中顺洁柔 | 11,700  | 260,910.00 | 0.08 |
| 334 | 600219 | 南山铝业 | 128,200 | 260,246.00 | 0.07 |
| 335 | 600642 | 申能股份 | 43,900  | 259,449.00 | 0.07 |
| 336 | 002382 | 蓝帆医疗 | 8,600   | 258,946.00 | 0.07 |
| 337 | 002396 | 星网锐捷 | 7,300   | 257,909.00 | 0.07 |
| 338 | 600516 | 方大炭素 | 40,871  | 256,669.88 | 0.07 |
| 339 | 601231 | 环旭电子 | 11,700  | 255,528.00 | 0.07 |
| 340 | 002673 | 西部证券 | 31,300  | 255,408.00 | 0.07 |
| 341 | 002013 | 中航机电 | 32,219  | 254,530.10 | 0.07 |
| 342 | 000630 | 铜陵有色 | 131,823 | 254,418.39 | 0.07 |
| 343 | 601233 | 桐昆股份 | 19,800  | 252,648.00 | 0.07 |
| 344 | 002690 | 美亚光电 | 4,800   | 252,480.00 | 0.07 |
| 345 | 601018 | 宁波港  | 70,651  | 252,224.07 | 0.07 |
| 346 | 603707 | 健友股份 | 3,900   | 251,823.00 | 0.07 |
| 347 | 002146 | 荣盛发展 | 31,074  | 251,699.40 | 0.07 |
| 348 | 600126 | 杭钢股份 | 24,200  | 251,680.00 | 0.07 |
| 349 | 600879 | 航天电子 | 38,948  | 250,825.12 | 0.07 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 350 | 002926 | 华西证券 | 23,500 | 249,805.00 | 0.07 |
| 351 | 600998 | 九州通  | 13,400 | 249,508.00 | 0.07 |
| 352 | 600362 | 江西铜业 | 18,535 | 249,481.10 | 0.07 |
| 353 | 600153 | 建发股份 | 30,464 | 246,758.40 | 0.07 |
| 354 | 600655 | 豫园股份 | 27,810 | 246,396.60 | 0.07 |
| 355 | 600760 | 中航沈飞 | 7,500  | 246,150.00 | 0.07 |
| 356 | 601319 | 中国人保 | 38,100 | 245,364.00 | 0.07 |
| 357 | 000739 | 普洛药业 | 10,500 | 244,545.00 | 0.07 |
| 358 | 600170 | 上海建工 | 79,596 | 244,359.72 | 0.07 |
| 359 | 300010 | 立思辰  | 12,400 | 242,668.00 | 0.07 |
| 360 | 601117 | 中国化学 | 44,100 | 241,668.00 | 0.07 |
| 361 | 600884 | 杉杉股份 | 20,391 | 240,409.89 | 0.07 |
| 362 | 002281 | 光迅科技 | 7,282  | 239,286.52 | 0.07 |
| 363 | 600415 | 小商品城 | 48,673 | 237,037.51 | 0.07 |
| 364 | 603659 | 璞泰来  | 2,300  | 236,946.00 | 0.07 |
| 365 | 601878 | 浙商证券 | 23,800 | 235,858.00 | 0.07 |
| 366 | 600167 | 联美控股 | 16,400 | 235,176.00 | 0.07 |
| 367 | 600811 | 东方集团 | 53,108 | 234,737.36 | 0.07 |
| 368 | 002500 | 山西证券 | 35,872 | 234,602.88 | 0.07 |
| 369 | 001914 | 招商积余 | 7,600  | 233,548.00 | 0.07 |
| 370 | 600216 | 浙江医药 | 12,109 | 233,219.34 | 0.07 |
| 371 | 002773 | 康弘药业 | 4,700  | 233,120.00 | 0.07 |
| 372 | 601021 | 春秋航空 | 6,600  | 232,584.00 | 0.07 |
| 373 | 600369 | 西南证券 | 50,492 | 231,758.28 | 0.07 |
| 374 | 600297 | 广汇汽车 | 72,500 | 231,275.00 | 0.07 |
| 375 | 600804 | 鹏博士  | 25,612 | 229,995.76 | 0.07 |
| 376 | 600848 | 上海临港 | 10,700 | 229,729.00 | 0.07 |
| 377 | 300251 | 光线传媒 | 21,014 | 229,262.74 | 0.07 |
| 378 | 600208 | 新湖中宝 | 76,887 | 229,123.26 | 0.07 |
| 379 | 600728 | 佳都科技 | 25,100 | 228,661.00 | 0.07 |
| 380 | 002739 | 万达电影 | 14,900 | 227,523.00 | 0.07 |
| 381 | 002938 | 鹏鼎控股 | 4,500  | 225,270.00 | 0.06 |
| 382 | 002268 | 卫士通  | 10,500 | 224,070.00 | 0.06 |
| 383 | 300001 | 特锐德  | 10,700 | 224,058.00 | 0.06 |
| 384 | 300115 | 长盈精密 | 9,793  | 223,770.05 | 0.06 |
| 385 | 002028 | 思源电气 | 10,917 | 223,361.82 | 0.06 |
| 386 | 002294 | 信立泰  | 7,500  | 222,450.00 | 0.06 |
| 387 | 002153 | 石基信息 | 5,687  | 221,963.61 | 0.06 |
| 388 | 600909 | 华安证券 | 32,400 | 221,292.00 | 0.06 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 389 | 002958 | 青农商行 | 49,700 | 220,171.00 | 0.06 |
| 390 | 601658 | 邮储银行 | 48,026 | 219,478.82 | 0.06 |
| 391 | 600511 | 国药股份 | 5,385  | 219,007.95 | 0.06 |
| 392 | 600674 | 川投能源 | 23,618 | 218,938.86 | 0.06 |
| 393 | 600779 | 水井坊  | 3,500  | 218,470.00 | 0.06 |
| 394 | 300002 | 神州泰岳 | 35,035 | 216,866.65 | 0.06 |
| 395 | 600038 | 中直股份 | 5,275  | 216,644.25 | 0.06 |
| 396 | 000581 | 威孚高科 | 10,444 | 215,981.92 | 0.06 |
| 397 | 600325 | 华发股份 | 30,336 | 214,172.16 | 0.06 |
| 398 | 000686 | 东北证券 | 25,082 | 211,942.90 | 0.06 |
| 399 | 600528 | 中铁工业 | 23,876 | 210,586.32 | 0.06 |
| 400 | 603883 | 老百姓  | 2,100  | 210,084.00 | 0.06 |
| 401 | 002387 | 维信诺  | 14,700 | 209,916.00 | 0.06 |
| 402 | 000997 | 新大陆  | 13,128 | 209,785.44 | 0.06 |
| 403 | 600446 | 金证股份 | 10,800 | 209,520.00 | 0.06 |
| 404 | 600418 | 江淮汽车 | 23,700 | 209,271.00 | 0.06 |
| 405 | 601689 | 拓普集团 | 7,500  | 209,250.00 | 0.06 |
| 406 | 601611 | 中国核建 | 33,700 | 208,266.00 | 0.06 |
| 407 | 600827 | 百联股份 | 14,376 | 207,733.20 | 0.06 |
| 408 | 600460 | 士兰微  | 14,061 | 206,415.48 | 0.06 |
| 409 | 002032 | 苏泊尔  | 2,900  | 205,900.00 | 0.06 |
| 410 | 002939 | 长城证券 | 16,700 | 205,744.00 | 0.06 |
| 411 | 002242 | 九阳股份 | 5,517  | 205,618.59 | 0.06 |
| 412 | 000999 | 华润三九 | 7,024  | 205,030.56 | 0.06 |
| 413 | 600598 | 北大荒  | 12,700 | 204,470.00 | 0.06 |
| 414 | 600959 | 江苏有线 | 53,660 | 201,761.60 | 0.06 |
| 415 | 600733 | 北汽蓝谷 | 31,180 | 200,487.40 | 0.06 |
| 416 | 002317 | 众生药业 | 11,682 | 200,463.12 | 0.06 |
| 417 | 600027 | 华电国际 | 58,300 | 199,386.00 | 0.06 |
| 418 | 603605 | 珀莱雅  | 1,100  | 198,022.00 | 0.06 |
| 419 | 601168 | 西部矿业 | 34,063 | 197,565.40 | 0.06 |
| 420 | 603000 | 人民网  | 9,930  | 196,911.90 | 0.06 |
| 421 | 600256 | 广汇能源 | 72,848 | 196,689.60 | 0.06 |
| 422 | 603156 | 养元饮品 | 9,100  | 195,650.00 | 0.06 |
| 423 | 002368 | 太极股份 | 4,461  | 194,901.09 | 0.06 |
| 424 | 603806 | 福斯特  | 3,900  | 194,649.00 | 0.06 |
| 425 | 600260 | 凯乐科技 | 14,366 | 194,228.32 | 0.06 |
| 426 | 000878 | 云南铜业 | 18,200 | 193,102.00 | 0.06 |
| 427 | 000564 | 供销大集 | 43,000 | 193,070.00 | 0.06 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 428 | 300296 | 利亚德  | 31,800 | 193,026.00 | 0.06 |
| 429 | 600704 | 物产中大 | 45,315 | 190,776.15 | 0.05 |
| 430 | 600820 | 隧道股份 | 33,700 | 190,405.00 | 0.05 |
| 431 | 002670 | 国盛金控 | 20,800 | 190,320.00 | 0.05 |
| 432 | 002558 | 巨人网络 | 10,900 | 189,660.00 | 0.05 |
| 433 | 600839 | 四川长虹 | 66,000 | 189,420.00 | 0.05 |
| 434 | 002081 | 金螳螂  | 24,042 | 188,970.12 | 0.05 |
| 435 | 300113 | 顺网科技 | 7,400  | 187,960.00 | 0.05 |
| 436 | 600497 | 驰宏锌锗 | 54,600 | 187,824.00 | 0.05 |
| 437 | 300166 | 东方国信 | 15,100 | 187,391.00 | 0.05 |
| 438 | 002124 | 天邦股份 | 14,500 | 186,325.00 | 0.05 |
| 439 | 600673 | 东阳光  | 26,953 | 186,245.23 | 0.05 |
| 440 | 002080 | 中材科技 | 12,000 | 186,000.00 | 0.05 |
| 441 | 000671 | 阳光城  | 29,332 | 185,964.88 | 0.05 |
| 442 | 300630 | 普利制药 | 2,500  | 184,875.00 | 0.05 |
| 443 | 002920 | 德赛西威 | 3,000  | 183,990.00 | 0.05 |
| 444 | 000627 | 天茂集团 | 35,300 | 183,913.00 | 0.05 |
| 445 | 600008 | 首创股份 | 60,996 | 183,597.96 | 0.05 |
| 446 | 600572 | 康恩贝  | 33,367 | 183,518.50 | 0.05 |
| 447 | 601992 | 金隅集团 | 59,700 | 182,682.00 | 0.05 |
| 448 | 600482 | 中国动力 | 11,590 | 181,963.00 | 0.05 |
| 449 | 002221 | 东华能源 | 20,614 | 181,197.06 | 0.05 |
| 450 | 002468 | 申通快递 | 11,000 | 180,510.00 | 0.05 |
| 451 | 600583 | 海油工程 | 39,548 | 179,943.40 | 0.05 |
| 452 | 300618 | 寒锐钴业 | 2,900  | 179,858.00 | 0.05 |
| 453 | 000158 | 常山北明 | 17,200 | 179,568.00 | 0.05 |
| 454 | 600718 | 东软集团 | 15,559 | 178,928.50 | 0.05 |
| 455 | 600549 | 厦门钨业 | 15,110 | 178,902.40 | 0.05 |
| 456 | 300026 | 红日药业 | 32,300 | 178,296.00 | 0.05 |
| 457 | 603866 | 桃李面包 | 3,500  | 178,115.00 | 0.05 |
| 458 | 601179 | 中国西电 | 36,700 | 177,628.00 | 0.05 |
| 459 | 000800 | 一汽解放 | 16,500 | 177,210.00 | 0.05 |
| 460 | 600875 | 东方电气 | 19,900 | 176,115.00 | 0.05 |
| 461 | 600977 | 中国电影 | 13,400 | 175,942.00 | 0.05 |
| 462 | 600171 | 上海贝岭 | 10,120 | 175,885.60 | 0.05 |
| 463 | 002217 | 合力泰  | 33,400 | 175,350.00 | 0.05 |
| 464 | 601966 | 玲珑轮胎 | 8,600  | 173,720.00 | 0.05 |
| 465 | 002831 | 裕同科技 | 6,300  | 173,313.00 | 0.05 |
| 466 | 600021 | 上海电力 | 23,414 | 173,263.60 | 0.05 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 467 | 000729 | 燕京啤酒 | 25,200  | 172,620.00 | 0.05 |
| 468 | 600060 | 海信视像 | 14,073  | 170,986.95 | 0.05 |
| 469 | 000877 | 天山股份 | 11,292  | 170,509.20 | 0.05 |
| 470 | 600567 | 山鹰纸业 | 57,500  | 169,625.00 | 0.05 |
| 471 | 600094 | 大名城  | 28,500  | 169,575.00 | 0.05 |
| 472 | 600862 | 中航高科 | 10,000  | 169,200.00 | 0.05 |
| 473 | 600881 | 亚泰集团 | 58,131  | 169,161.21 | 0.05 |
| 474 | 002399 | 海普瑞  | 6,701   | 167,793.04 | 0.05 |
| 475 | 601633 | 长城汽车 | 21,725  | 167,717.00 | 0.05 |
| 476 | 600160 | 巨化股份 | 24,169  | 166,524.41 | 0.05 |
| 477 | 000060 | 中金岭南 | 44,704  | 166,298.88 | 0.05 |
| 478 | 002056 | 横店东磁 | 14,736  | 165,780.00 | 0.05 |
| 479 | 002709 | 天赐材料 | 4,900   | 165,571.00 | 0.05 |
| 480 | 600597 | 光明乳业 | 10,912  | 162,152.32 | 0.05 |
| 481 | 603228 | 景旺电子 | 4,600   | 161,874.00 | 0.05 |
| 482 | 000090 | 天健集团 | 23,407  | 161,742.37 | 0.05 |
| 483 | 600026 | 中远海能 | 24,838  | 160,453.48 | 0.05 |
| 484 | 002429 | 兆驰股份 | 32,400  | 160,380.00 | 0.05 |
| 485 | 002458 | 益生股份 | 10,500  | 160,335.00 | 0.05 |
| 486 | 300133 | 华策影视 | 21,965  | 159,246.25 | 0.05 |
| 487 | 600754 | 锦江酒店 | 5,738   | 159,229.50 | 0.05 |
| 488 | 600580 | 卧龙电驱 | 13,948  | 156,775.52 | 0.05 |
| 489 | 600967 | 内蒙一机 | 15,068  | 156,556.52 | 0.05 |
| 490 | 600273 | 嘉化能源 | 17,900  | 156,446.00 | 0.05 |
| 491 | 601005 | 重庆钢铁 | 104,900 | 156,301.00 | 0.05 |
| 492 | 600392 | 盛和资源 | 21,991  | 155,036.55 | 0.04 |
| 493 | 000709 | 河钢股份 | 75,947  | 154,931.88 | 0.04 |
| 494 | 002648 | 卫星石化 | 9,500   | 154,565.00 | 0.04 |
| 495 | 000629 | 攀钢钒钛 | 76,800  | 154,368.00 | 0.04 |
| 496 | 002233 | 塔牌集团 | 12,813  | 154,140.39 | 0.04 |
| 497 | 600282 | 南钢股份 | 47,600  | 153,748.00 | 0.04 |
| 498 | 601216 | 君正集团 | 60,408  | 153,436.32 | 0.04 |
| 499 | 601916 | 浙商银行 | 38,900  | 153,266.00 | 0.04 |
| 500 | 000960 | 锡业股份 | 17,900  | 153,224.00 | 0.04 |
| 501 | 002203 | 海亮股份 | 17,500  | 153,125.00 | 0.04 |
| 502 | 600755 | 厦门国贸 | 23,140  | 152,724.00 | 0.04 |
| 503 | 002004 | 华邦健康 | 28,347  | 152,506.86 | 0.04 |
| 504 | 002807 | 江阴银行 | 38,800  | 152,484.00 | 0.04 |
| 505 | 002085 | 万丰奥威 | 23,500  | 152,280.00 | 0.04 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 506 | 600039 | 四川路桥 | 39,791 | 152,001.62 | 0.04 |
| 507 | 600064 | 南京高科 | 15,494 | 150,601.68 | 0.04 |
| 508 | 601238 | 广汽集团 | 16,600 | 149,400.00 | 0.04 |
| 509 | 000970 | 中科三环 | 15,210 | 148,753.80 | 0.04 |
| 510 | 601118 | 海南橡胶 | 30,600 | 148,716.00 | 0.04 |
| 511 | 600166 | 福田汽车 | 82,356 | 148,240.80 | 0.04 |
| 512 | 601975 | 招商南油 | 61,900 | 147,941.00 | 0.04 |
| 513 | 000598 | 兴蓉环境 | 31,995 | 147,177.00 | 0.04 |
| 514 | 000690 | 宝新能源 | 31,161 | 147,079.92 | 0.04 |
| 515 | 300182 | 捷成股份 | 36,800 | 146,832.00 | 0.04 |
| 516 | 000778 | 新兴铸管 | 42,782 | 146,742.26 | 0.04 |
| 517 | 002110 | 三钢闽光 | 21,900 | 145,854.00 | 0.04 |
| 518 | 000681 | 视觉中国 | 7,500  | 139,650.00 | 0.04 |
| 519 | 600808 | 马钢股份 | 53,400 | 137,772.00 | 0.04 |
| 520 | 601098 | 中南传媒 | 12,800 | 135,424.00 | 0.04 |
| 521 | 600717 | 天津港  | 16,168 | 71,462.56  | 0.02 |
| 522 | 600694 | 大商股份 | 90     | 2,159.10   | 0.00 |
| 523 | 600259 | 广晟有色 | 66     | 1,980.00   | 0.00 |
| 524 | 603568 | 伟明环保 | 78     | 1,809.60   | 0.00 |
| 525 | 600639 | 浦东金桥 | 96     | 1,534.08   | 0.00 |
| 526 | 002048 | 宁波华翔 | 98     | 1,513.12   | 0.00 |
| 527 | 000062 | 深圳华强 | 97     | 1,410.38   | 0.00 |
| 528 | 600645 | 中源协和 | 48     | 1,356.00   | 0.00 |
| 529 | 002038 | 双鹭药业 | 94     | 1,204.14   | 0.00 |
| 530 | 600835 | 上海机电 | 68     | 1,151.24   | 0.00 |
| 531 | 600195 | 中牧股份 | 67     | 1,087.41   | 0.00 |
| 532 | 600765 | 中航重机 | 99     | 1,011.78   | 0.00 |
| 533 | 600329 | 中新药业 | 58     | 1,004.56   | 0.00 |
| 534 | 000156 | 华数传媒 | 92     | 996.36     | 0.00 |
| 535 | 002375 | 亚厦股份 | 93     | 950.46     | 0.00 |
| 536 | 600316 | 洪都航空 | 59     | 932.20     | 0.00 |
| 537 | 600056 | 中国医药 | 62     | 877.30     | 0.00 |
| 538 | 600648 | 外高桥  | 61     | 862.54     | 0.00 |
| 539 | 600062 | 华润双鹤 | 65     | 859.30     | 0.00 |
| 540 | 600338 | 西藏珠峰 | 80     | 800.00     | 0.00 |
| 541 | 600729 | 重庆百货 | 25     | 780.50     | 0.00 |
| 542 | 600640 | 号百控股 | 37     | 738.15     | 0.00 |
| 543 | 600372 | 中航电子 | 50     | 666.00     | 0.00 |
| 544 | 600138 | 中青旅  | 67     | 661.29     | 0.00 |

|     |        |      |    |        |      |
|-----|--------|------|----|--------|------|
| 545 | 000685 | 中山公用 | 85 | 654.50 | 0.00 |
| 546 | 600557 | 康缘药业 | 47 | 654.24 | 0.00 |
| 547 | 000402 | 金融街  | 96 | 637.44 | 0.00 |
| 548 | 000830 | 鲁西化工 | 84 | 626.64 | 0.00 |
| 549 | 601928 | 凤凰传媒 | 90 | 612.00 | 0.00 |
| 550 | 000887 | 中鼎股份 | 77 | 604.45 | 0.00 |
| 551 | 000400 | 许继电气 | 45 | 594.00 | 0.00 |
| 552 | 000826 | 启迪环境 | 80 | 593.60 | 0.00 |
| 553 | 000061 | 农产品  | 80 | 592.80 | 0.00 |
| 554 | 600643 | 爱建集团 | 61 | 484.95 | 0.00 |
| 555 | 000012 | 南玻 A | 95 | 476.90 | 0.00 |
| 556 | 600757 | 长江传媒 | 92 | 468.28 | 0.00 |
| 557 | 600409 | 三友化工 | 99 | 461.34 | 0.00 |
| 558 | 002589 | 瑞康医药 | 82 | 439.52 | 0.00 |
| 559 | 000600 | 建投能源 | 86 | 437.74 | 0.00 |
| 560 | 600466 | 蓝光发展 | 80 | 431.20 | 0.00 |
| 561 | 000528 | 柳工   | 68 | 429.08 | 0.00 |
| 562 | 600633 | 浙数文化 | 42 | 410.76 | 0.00 |
| 563 | 600188 | 兖州煤业 | 45 | 394.20 | 0.00 |
| 564 | 300072 | 三聚环保 | 89 | 380.92 | 0.00 |
| 565 | 600787 | 中储股份 | 86 | 377.54 | 0.00 |
| 566 | 002093 | 国脉科技 | 42 | 371.70 | 0.00 |
| 567 | 600478 | 科力远  | 78 | 367.38 | 0.00 |
| 568 | 000848 | 承德露露 | 51 | 357.00 | 0.00 |
| 569 | 000543 | 皖能电力 | 88 | 353.76 | 0.00 |
| 570 | 600874 | 创业环保 | 53 | 351.92 | 0.00 |
| 571 | 603766 | 隆鑫通用 | 88 | 340.56 | 0.00 |
| 572 | 600141 | 兴发集团 | 38 | 340.10 | 0.00 |
| 573 | 600058 | 五矿发展 | 54 | 326.16 | 0.00 |
| 574 | 601958 | 金钼股份 | 52 | 321.36 | 0.00 |
| 575 | 600373 | 中文传媒 | 27 | 318.06 | 0.00 |
| 576 | 000758 | 中色股份 | 76 | 317.68 | 0.00 |
| 577 | 600748 | 上实发展 | 62 | 316.82 | 0.00 |
| 578 | 600770 | 综艺股份 | 65 | 312.00 | 0.00 |
| 579 | 000415 | 渤海租赁 | 99 | 295.02 | 0.00 |
| 580 | 600348 | 阳泉煤业 | 67 | 282.74 | 0.00 |
| 581 | 600312 | 平高电气 | 38 | 281.96 | 0.00 |
| 582 | 600657 | 信达地产 | 67 | 276.04 | 0.00 |
| 583 | 002244 | 滨江集团 | 64 | 273.28 | 0.00 |

|     |        |       |    |        |      |
|-----|--------|-------|----|--------|------|
| 584 | 000559 | 万向钱潮  | 56 | 271.04 | 0.00 |
| 585 | 601717 | 郑煤机   | 46 | 270.94 | 0.00 |
| 586 | 002285 | 世联行   | 95 | 265.05 | 0.00 |
| 587 | 000937 | 冀中能源  | 87 | 262.74 | 0.00 |
| 588 | 002390 | 信邦制药  | 57 | 259.92 | 0.00 |
| 589 | 000930 | 中粮科技  | 38 | 259.54 | 0.00 |
| 590 | 002503 | 搜于特   | 92 | 258.52 | 0.00 |
| 591 | 600125 | 铁龙物流  | 46 | 256.68 | 0.00 |
| 592 | 600664 | 哈药股份  | 83 | 255.64 | 0.00 |
| 593 | 002266 | 浙富控股  | 65 | 251.55 | 0.00 |
| 594 | 000983 | 西山煤电  | 65 | 243.75 | 0.00 |
| 595 | 000027 | 深圳能源  | 49 | 227.36 | 0.00 |
| 596 | 600970 | 中材国际  | 43 | 227.04 | 0.00 |
| 597 | 300134 | 大富科技  | 16 | 223.68 | 0.00 |
| 598 | 601333 | 广深铁路  | 96 | 216.00 | 0.00 |
| 599 | 002002 | 鸿达兴业  | 59 | 212.99 | 0.00 |
| 600 | 002701 | 奥瑞金   | 44 | 184.36 | 0.00 |
| 601 | 600649 | 城投控股  | 31 | 184.14 | 0.00 |
| 602 | 600435 | 北方导航  | 24 | 181.44 | 0.00 |
| 603 | 002408 | 齐翔腾达  | 29 | 180.09 | 0.00 |
| 604 | 002440 | 闰土股份  | 18 | 164.52 | 0.00 |
| 605 | 000718 | 苏宁环球  | 49 | 151.41 | 0.00 |
| 606 | 601678 | 滨化股份  | 34 | 144.16 | 0.00 |
| 607 | 601718 | 际华集团  | 43 | 142.76 | 0.00 |
| 608 | 002191 | 劲嘉股份  | 16 | 142.56 | 0.00 |
| 609 | 002665 | 首航高科  | 58 | 141.52 | 0.00 |
| 610 | 600158 | 中体产业  | 17 | 139.06 | 0.00 |
| 611 | 600869 | 智慧能源  | 34 | 136.00 | 0.00 |
| 612 | 000563 | 陕国投 A | 35 | 129.85 | 0.00 |
| 613 | 600863 | 内蒙华电  | 51 | 125.46 | 0.00 |
| 614 | 600266 | 城建发展  | 24 | 121.68 | 0.00 |
| 615 | 002064 | 华峰氨纶  | 22 | 111.54 | 0.00 |
| 616 | 601866 | 中远海发  | 53 | 97.52  | 0.00 |
| 617 | 000712 | 锦龙股份  | 7  | 87.50  | 0.00 |
| 618 | 000078 | 海王生物  | 20 | 83.80  | 0.00 |
| 619 | 600335 | 国机汽车  | 18 | 83.16  | 0.00 |
| 620 | 600006 | 东风汽车  | 18 | 72.54  | 0.00 |
| 621 | 002092 | 中泰化学  | 14 | 63.42  | 0.00 |
| 622 | 600120 | 浙江东方  | 9  | 61.83  | 0.00 |



|     |        |        |    |       |      |
|-----|--------|--------|----|-------|------|
| 623 | 600017 | 日照港    | 23 | 57.27 | 0.00 |
| 624 | 601880 | 大连港    | 31 | 53.32 | 0.00 |
| 625 | 600376 | 首开股份   | 9  | 52.74 | 0.00 |
| 626 | 601000 | 唐山港    | 23 | 51.29 | 0.00 |
| 627 | 600500 | 中化国际   | 10 | 50.60 | 0.00 |
| 628 | 000519 | 中兵红箭   | 5  | 47.10 | 0.00 |
| 629 | 002128 | 露天煤业   | 6  | 46.50 | 0.00 |
| 630 | 600022 | 山东钢铁   | 30 | 38.70 | 0.00 |
| 631 | 601608 | 中信重工   | 11 | 37.62 | 0.00 |
| 632 | 002470 | *ST 金正 | 16 | 36.32 | 0.00 |
| 633 | 002505 | 大康农业   | 16 | 36.00 | 0.00 |
| 634 | 000031 | 大悦城    | 3  | 15.27 | 0.00 |
| 635 | 600917 | 重庆燃气   | 1  | 7.14  | 0.00 |

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量 (股) | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------|--------------|---------------|
| 1  | 688396 | 华润微  | 28,156 | 1,171,289.60 | 0.34          |
| 2  | 688298 | 东方生物 | 5,286  | 761,078.28   | 0.22          |
| 3  | 688200 | 华峰测控 | 2,520  | 680,022.00   | 0.20          |
| 4  | 600584 | 长电科技 | 12,255 | 383,213.85   | 0.11          |
| 5  | 300673 | 佩蒂股份 | 8,800  | 342,144.00   | 0.10          |
| 6  | 600536 | 中国软件 | 3,886  | 307,771.20   | 0.09          |
| 7  | 600600 | 青岛啤酒 | 3,650  | 279,225.00   | 0.08          |
| 8  | 688181 | 八亿时空 | 4,306  | 262,536.82   | 0.08          |
| 9  | 002065 | 东华软件 | 20,072 | 251,301.44   | 0.07          |
| 10 | 688555 | 泽达易盛 | 3,004  | 220,043.00   | 0.06          |
| 11 | 688568 | 中科星图 | 11,020 | 178,634.20   | 0.05          |
| 12 | 300146 | 汤臣倍健 | 8,486  | 167,089.34   | 0.05          |
| 13 | 688377 | 迪威尔  | 7,894  | 129,619.48   | 0.04          |
| 14 | 603087 | 甘李药业 | 947    | 94,984.10    | 0.03          |
| 15 | 688528 | 秦川物联 | 8,337  | 94,458.21    | 0.03          |
| 16 | 688600 | 皖仪科技 | 5,468  | 84,754.00    | 0.02          |
| 17 | 600956 | 新天绿能 | 2,533  | 12,766.32    | 0.00          |
| 18 | 300839 | 博汇股份 | 502    | 11,751.82    | 0.00          |
| 19 | 300847 | 中船汉光 | 1,420  | 9,854.80     | 0.00          |
| 20 | 300845 | 捷安高科 | 470    | 8,286.10     | 0.00          |

|    |        |       |       |          |      |
|----|--------|-------|-------|----------|------|
| 21 | 300843 | 胜蓝股份  | 751   | 7,517.51 | 0.00 |
| 22 | 300840 | 酷特智能  | 1,185 | 7,038.90 | 0.00 |
| 23 | 300846 | 首都在线  | 1,131 | 3,811.47 | 0.00 |
| 24 | 688299 | 长阳科技  | 100   | 2,869.00 | 0.00 |
| 25 | 300842 | 帝科股份  | 55    | 2,239.60 | 0.00 |
| 26 | 002254 | 泰和新材  | 88    | 1,196.80 | 0.00 |
| 27 | 300202 | 聚龙股份  | 96    | 1,032.00 | 0.00 |
| 28 | 000503 | 国新健康  | 76    | 846.64   | 0.00 |
| 29 | 002251 | 步步高   | 59    | 824.82   | 0.00 |
| 30 | 002332 | 仙琚制药  | 48    | 808.32   | 0.00 |
| 31 | 300824 | 北鼎股份  | 54    | 740.34   | 0.00 |
| 32 | 600750 | 江中药业  | 56    | 707.84   | 0.00 |
| 33 | 002400 | 省广集团  | 64    | 671.36   | 0.00 |
| 34 | 000423 | 东阿阿胶  | 17    | 608.77   | 0.00 |
| 35 | 600184 | 光电股份  | 56    | 539.84   | 0.00 |
| 36 | 000006 | 深振业 A | 70    | 476.70   | 0.00 |
| 37 | 002041 | 登海种业  | 37    | 468.05   | 0.00 |
| 38 | 002699 | 美盛文化  | 75    | 455.25   | 0.00 |
| 39 | 002384 | 东山精密  | 14    | 419.30   | 0.00 |
| 40 | 000829 | 天音控股  | 64    | 419.20   | 0.00 |
| 41 | 002672 | 东江环保  | 45    | 405.45   | 0.00 |
| 42 | 600151 | 航天机电  | 81    | 391.23   | 0.00 |
| 43 | 600618 | 氯碱化工  | 54    | 383.40   | 0.00 |
| 44 | 601311 | 骆驼股份  | 42    | 381.36   | 0.00 |
| 45 | 002358 | 森源电气  | 76    | 379.24   | 0.00 |
| 46 | 600611 | 大众交通  | 96    | 360.96   | 0.00 |
| 47 | 002276 | 万马股份  | 49    | 349.86   | 0.00 |
| 48 | 300027 | 华谊兄弟  | 95    | 348.65   | 0.00 |
| 49 | 002489 | 浙江永强  | 80    | 318.40   | 0.00 |
| 50 | 002588 | 史丹利   | 68    | 286.96   | 0.00 |
| 51 | 600525 | 长园集团  | 59    | 286.15   | 0.00 |
| 52 | 600971 | 恒源煤电  | 60    | 274.20   | 0.00 |
| 53 | 002345 | 潮宏基   | 82    | 273.06   | 0.00 |
| 54 | 600499 | 科达洁能  | 66    | 271.92   | 0.00 |
| 55 | 002344 | 海宁皮城  | 64    | 268.16   | 0.00 |
| 56 | 000926 | 福星股份  | 50    | 262.50   | 0.00 |
| 57 | 300266 | 兴源环境  | 79    | 259.12   | 0.00 |
| 58 | 601777 | 力帆股份  | 55    | 246.95   | 0.00 |
| 59 | 002437 | 誉衡药业  | 76    | 245.48   | 0.00 |

|    |        |      |    |        |      |
|----|--------|------|----|--------|------|
| 60 | 600267 | 海正药业 | 17 | 243.95 | 0.00 |
| 61 | 002310 | 东方园林 | 50 | 241.50 | 0.00 |
| 62 | 601001 | 大同煤业 | 57 | 223.44 | 0.00 |
| 63 | 600023 | 浙能电力 | 61 | 214.11 | 0.00 |
| 64 | 600100 | 同方股份 | 25 | 182.25 | 0.00 |
| 65 | 600688 | 上海石化 | 51 | 177.48 | 0.00 |
| 66 | 600169 | 太原重工 | 88 | 168.08 | 0.00 |
| 67 | 002482 | 广田集团 | 50 | 167.50 | 0.00 |
| 68 | 002573 | 清新环境 | 28 | 152.88 | 0.00 |
| 69 | 000049 | 德赛电池 | 3  | 147.03 | 0.00 |
| 70 | 600759 | 洲际油气 | 79 | 146.94 | 0.00 |
| 71 | 000552 | 靖远煤电 | 64 | 142.08 | 0.00 |
| 72 | 600743 | 华远地产 | 63 | 131.67 | 0.00 |
| 73 | 600157 | 永泰能源 | 91 | 114.66 | 0.00 |
| 74 | 002277 | 友阿股份 | 28 | 112.00 | 0.00 |
| 75 | 002431 | 棕榈股份 | 30 | 90.00  | 0.00 |
| 76 | 000667 | 美好置业 | 30 | 82.80  | 0.00 |
| 77 | 600993 | 马应龙  | 3  | 72.75  | 0.00 |
| 78 | 000969 | 安泰科技 | 11 | 72.60  | 0.00 |
| 79 | 000541 | 佛山照明 | 10 | 51.70  | 0.00 |
| 80 | 000839 | 中信国安 | 15 | 35.70  | 0.00 |
| 81 | 002299 | 圣农发展 | 1  | 29.00  | 0.00 |
| 82 | 600366 | 宁波韵升 | 4  | 22.80  | 0.00 |
| 83 | 000612 | 焦作万方 | 1  | 5.21   | 0.00 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 5,150,378.00 | 1.39            |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 4,309,148.00 | 1.16            |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 2,194,707.00 | 0.59            |
| 4  | 000651 | 格力电器 | 2,028,497.00 | 0.55            |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 1,837,246.00 | 0.50            |
| 6  | 300498 | 温氏股份 | 1,724,467.80 | 0.47            |
| 7  | 603259 | 药明康德 | 1,654,823.80 | 0.45            |
| 8  | 000333 | 美的集团 | 1,583,602.00 | 0.43            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 9  | 600276 | 恒瑞医药 | 1,569,779.00 | 0.42 |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 1,414,160.00 | 0.38 |
| 11 | 603986 | 兆易创新 | 1,363,347.00 | 0.37 |
| 12 | 000002 | 万科 A | 1,349,262.00 | 0.36 |
| 13 | 600887 | 伊利股份 | 1,194,133.00 | 0.32 |
| 14 | 600030 | 中信证券 | 1,164,268.00 | 0.31 |
| 15 | 601398 | 工商银行 | 1,097,029.00 | 0.30 |
| 16 | 601688 | 华泰证券 | 1,038,418.00 | 0.28 |
| 17 | 600016 | 民生银行 | 979,449.00   | 0.26 |
| 18 | 600745 | 闻泰科技 | 962,177.00   | 0.26 |
| 19 | 002555 | 三七互娱 | 953,027.00   | 0.26 |
| 20 | 300601 | 康泰生物 | 928,687.98   | 0.25 |

#### 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  | 600519 | 贵州茅台 | 10,196,125.00 | 2.76            |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 8,961,358.00  | 2.42            |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 3,960,371.00  | 1.07            |
| 4  | 000651 | 格力电器 | 3,883,124.55  | 1.05            |
| 5  | 000858 | 五粮液  | 3,553,147.00  | 0.96            |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 2,712,536.00  | 0.73            |
| 7  | 000002 | 万科 A | 2,625,366.00  | 0.71            |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药 | 2,558,856.00  | 0.69            |
| 9  | 600016 | 民生银行 | 2,434,610.00  | 0.66            |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 2,068,827.00  | 0.56            |
| 11 | 000661 | 长春高新 | 2,049,050.00  | 0.55            |
| 12 | 601288 | 农业银行 | 2,042,275.00  | 0.55            |
| 13 | 600030 | 中信证券 | 1,875,015.00  | 0.51            |
| 14 | 601398 | 工商银行 | 1,771,268.00  | 0.48            |
| 15 | 601328 | 交通银行 | 1,598,789.00  | 0.43            |
| 16 | 601211 | 国泰君安 | 1,554,759.00  | 0.42            |
| 17 | 601888 | 中国中免 | 1,498,355.00  | 0.41            |
| 18 | 002415 | 海康威视 | 1,371,773.26  | 0.37            |
| 19 | 600383 | 金地集团 | 1,340,262.00  | 0.36            |
| 20 | 000333 | 美的集团 | 1,336,332.00  | 0.36            |

### 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 | 170,877,837.25 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 209,406,381.83 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -         | -            |
| 2  | 央行票据      | -         | -            |
| 3  | 金融债券      | -         | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -         | -            |
| 4  | 企业债券      | -         | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -         | -            |
| 6  | 中期票据      | -         | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 54,900.00 | 0.02         |
| 8  | 同业存单      | -         | -            |
| 9  | 其他        | -         | -            |
| 10 | 合计        | 54,900.00 | 0.02         |

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称  | 数量（张） | 公允价值      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 128112 | 歌尔转 2 | 549   | 54,900.00 | 0.02         |

注：本基金本报告期末仅持有 1 只债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 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

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

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

招商银行

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股招商银行。

根据全国银行间同业拆借中心 2019 年 7 月 8 日公布的《全国银行间同业拆借中心关于通报批评平安银行和招商银行的公告》，2019 年 7 月 2 日，平安银行和招商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。经两家银行自查，为交易员操作失误所致。全国银行间同业拆借中心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，本基金做出如下说明：

招商银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，公司高度重视内部控制建设，并围绕内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督等方面不断加强和完善内部控制机制。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

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

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

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 31,730.76  |
| 2  | 应收证券清算款 | 384,110.01 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 4,873.51   |
| 5  | 应收申购款   | 9,454.85   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 430,169.13 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券（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

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|---------------|----------|
| 1  | 688396 | 华润微  | 1,171,289.60 | 0.34          | 新股流通受限   |
| 2  | 688298 | 东方生物 | 761,078.28   | 0.22          | 新股流通受限   |
| 3  | 688200 | 华峰测控 | 680,022.00   | 0.20          | 新股流通受限   |

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 6,542        | 37,602.39     | 178,167,197.92 | 72.43%     | 67,827,608.00 | 27.57%     |

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                           | 持有份额 (份)     | 占上市总份额<br>比例 |
|----|---------------------------------|--------------|--------------|
| 1  | 中国工商银行股份有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司 | 4,000,000.00 | 6.45%        |
| 2  | 中国工商银行股份有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司 | 3,728,891.00 | 6.01%        |
| 3  | 余栋腾                             | 2,000,000.00 | 3.22%        |
| 4  | 王飞舟                             | 1,677,417.00 | 2.70%        |
| 5  | 靳宁卿                             | 980,000.00   | 1.58%        |
| 6  | 纪伟才                             | 938,029.00   | 1.51%        |
| 7  | 于成福                             | 932,390.00   | 1.50%        |
| 8  | 陈美辰                             | 761,556.00   | 1.23%        |
| 9  | 于君                              | 711,529.00   | 1.15%        |
| 10 | 李坚                              | 538,128.00   | 0.87%        |

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0.80       | 0.0000%  |

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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



## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                  |                |
|----------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日 (2015 年 5 月 22 日) 基金份额总额 | 542,268,490.78 |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 255,127,274.93 |
| 本报告期基金总申购份额                      | 69,292,853.57  |
| 减:本报告期基金总赎回份额                    | 78,425,322.58  |
| 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                     | 245,994,805.92 |

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本报告期本基金管理人的高级管理人员无重大人事变动。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易           |              | 应支付该券商的佣金  |            | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
|      |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 华西证券 | 1      | 124,098,836.01 | 33.45%       | 90,755.67  | 28.32%     | -  |
| 长江证券 | 1      | 119,968,460.99 | 32.34%       | 111,725.44 | 34.86%     | -  |
| 海通证券 | 1      | 109,467,812.04 | 29.51%       | 101,831.07 | 31.78%     | -  |
| 兴业证券 | 1      | 11,702,885.17  | 3.15%        | 10,898.93  | 3.40%      | -  |
| 光大证券 | 1      | 5,646,282.35   | 1.52%        | 5,258.04   | 1.64%      | -  |
| 华泰证券 | 1      | 95,379.00      | 0.03%        | -          | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金证券 | 1 | - | - | - | - | - |

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易      |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|------|-----------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额      | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 华西证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |
| 海通证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |
| 兴业证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |
| 光大证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华泰证券 | 54,900.00 | 100.00%      | -      | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |
| 银河证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国元证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东兴证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东方证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |
| 申银万国 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东北证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中金证券 | -         | -            | -      | -              | -    | -            |

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:

| 序号 | 证券公司名称 | 交易单元所属市场 | 数量 |
|----|--------|----------|----|
| 1  | 华西证券   | 深圳       | 1  |

- (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

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式                    | 法定披露日期          |
|----|--|---------------------------|-----------------|
| 1  | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 6 月 18 日 |
| 2  | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 收益分配公告                  | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 6 月 15 日 |

|    |  |                           |                 |
|----|--|---------------------------|-----------------|
| 3  | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 6 月 11 日 |
| 4  | 长盛基金管理有限公司关于取消旗下部分开放式基金在中信证券 (华南) 申购费率优惠的公告        | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 4 月 28 日 |
| 5  | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2020 年第 1 季度报告          | 本公司网站、中国证监会基金电子披露网站       | 2020 年 4 月 22 日 |
| 6  | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 证券投资基金 2019 年度报告        | 本公司网站、中国证监会基金电子披露网站       | 2020 年 4 月 21 日 |
| 7  | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 27 日 |
| 8  | 长盛基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告                 | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 25 日 |
| 9  | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 收益分配公告                  | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 20 日 |
| 10 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 17 日 |
| 11 | 关于长盛基金管理有限公司直销柜台开展旗下部分基金费率优惠活动的公告                  | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 16 日 |
| 12 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2019 年第 4 季度报告          | 本公司网站、中国证监会基金电子披露网站       | 2020 年 1 月 18 日 |

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |               |      |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|---|----------------|-------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构  | 1              | 20200101~20200630       | 74,045,259.81 | -    | -    | 74,045,259.81 | 30.10% |
| 产品特有风险  |                |                         |               |      |      |               |        |
| <p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。</p> |                |                         |               |      |      |               |        |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 相关批准文件；
- 2、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 4、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日