

长盛价值发现股票型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 4 月 15 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
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.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	14
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
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
§7 投资组合报告.....	39
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.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛价值发现股票型证券投资基金
基金简称	长盛价值发现
基金主代码	008410
交易代码	008410
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 15 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	59,391,329.98 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过定量分析方法精选质地优秀的上市公司，多维度发掘其中具有投资价值的股票构建投资组合，在控制风险的前提下，争取为投资者创造超越业绩基准的投资收益。
投资策略	<p>（一）大类资产配置策略：本基金将通过深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。</p> <p>（二）股票投资策略：本基金在综合分析国内外宏观经济市场形势、微观经济指标及货币财政政策的基础上，动态配置大类资产，在股票投资方面主要采用自下而上的个股精选方式，综合企业的垄断经营能力、核心技术优势、品牌效应、商业模式、持续盈利能力、产业发展前景、行业景气度等多个维度进行深入的案头研究，从成长型企业投资价值发现、低估值企业投资价值发现以及基于事件驱动的价值发现三个层面筛选具有投资价值的股票构建投资组合。</p> <p>（三）债券投资策略：本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 * 80% + 中证综合债指数收益率 * 20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及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	长盛基金管理有限公司	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

§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4月15日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	4,689,659.28
本期利润	10,987,915.66
加权平均基金份额本期利润	0.0665
本期加权平均净值利润率	6.59%
本期基金份额净值增长率	11.96%
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	3,334,970.44
期末可供分配基金份额利润	0.0562
期末基金资产净值	66,493,514.20
期末基金份额净值	1.1196
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	11.96%

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

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

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

4、本基金基金合同生效日为2020年4月15日，截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

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	10.45%	1.00%	5.96%	0.71%	4.49%	0.29%
自基金合同生效起至今	11.96%	0.71%	6.80%	0.67%	5.16%	0.04%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率 * 80% + 中证综合债指数收益率 * 20%

(1) 沪深300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，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国

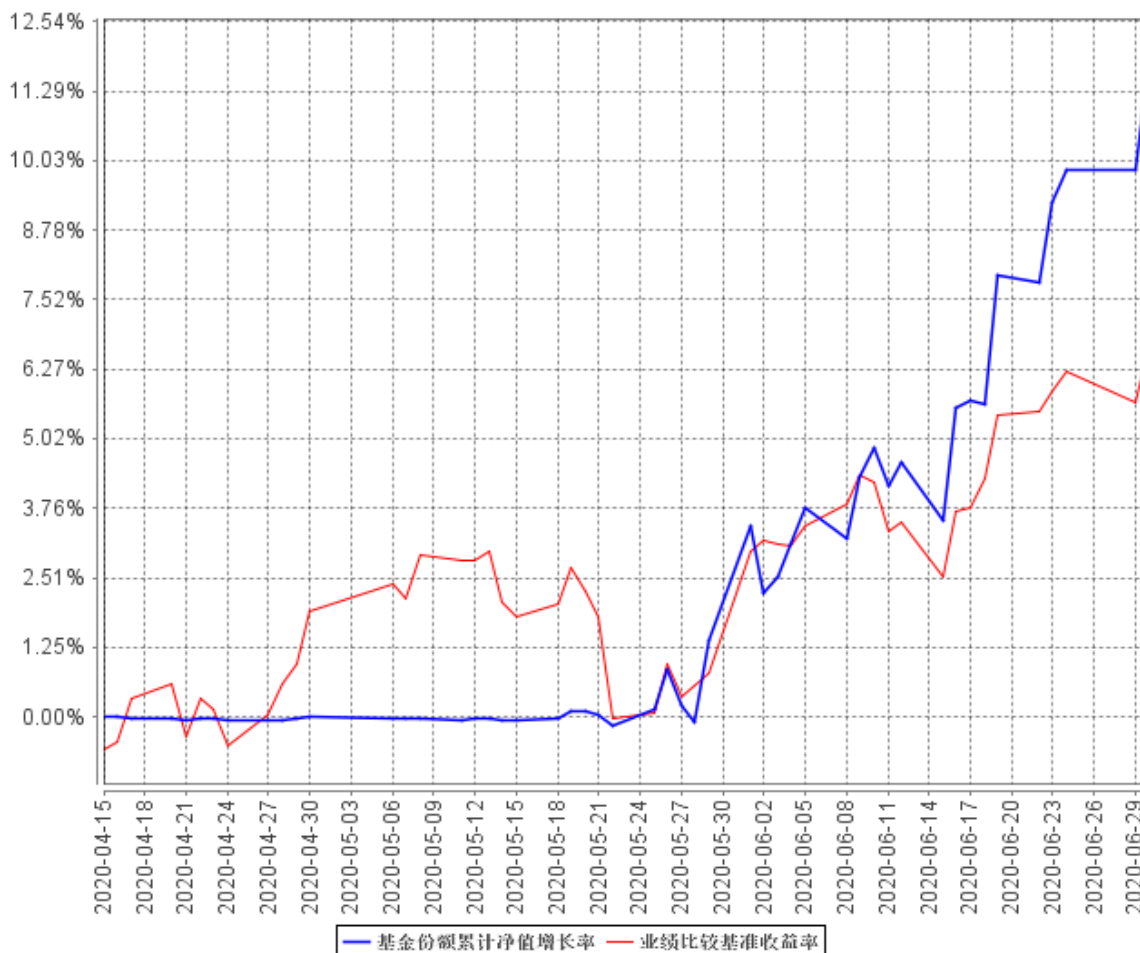
A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

(2) 中证综合债券指数是中国全市场债券指数，以 2001 年 12 月 31 日为基期，基点为 100 点，并于 2002 年 12 月 31 日起发布。中证综合债券指数的样本具有广泛的市场代表性，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成分债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类。

(3) 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 80%、20% 的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同生效日为 2020 年 4 月 15 日，截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。
- 2、按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截止本报告期末仍处于建仓期。
- 3、本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

§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		
冯雨生	本基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛多因子策略优选股票型证券投资基金基金经理，量化投资部负责人。	2020 年 4 月 15 日	-	13 年	冯雨生先生，硕士，CFA（特许金融分析师）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程研究员，基金经理助理等职务。

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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、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

上半年股票市场因新冠疫情影响大幅波动。在一季度宽幅震荡后，二季度大多数成长性行业和概念板块迎来单边显著上涨。行业上，医药生物、电子和食品饮料等行业涨幅靠前，采掘、银行和钢铁等行业表现较差。概念板块上，半导体硅片、医疗器械和光刻胶等板块大幅上涨，鸡产业、影视和大基建央企等板块表现不佳。风格上，大盘价值股上半年跑输小盘成长股。

组合操作上，我们严格按照基金契约规定的投资流程，通过定量分析方法精选质地优秀的上市公司，多维度发掘其中具有投资价值的股票构建投资组合。本基金主要关注三个方面的投资机会：成长型企业投资价值发现、低估值企业投资价值发现以及基于事件驱动的价值发现。

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 1.1196 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.96%，业绩比较基准收益率为 6.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中国经济将继续逐步恢复。市场面临的主要风险受海外疫情发展和中美贸易冲突影响。A 股市场整体估值仍处于较低的位置，估值和红利角度都对海外资金吸引力较高。受益于中国本土实现对疫情反复的高效管控，北上资金大概率会持续流入。目前利率环境下，债券的持有期收益率将长期处于低位，股债相对配置视角看权益类资产的投资性价比较高。我们认为在全球流动性延续宽松的环境下，下半年 A 股仍有较好的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2020 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 3,334,970.44 元，其中：未分配利润已实现部分为 3,334,970.44 元，未分配利润未实现部分为 3,767,213.78 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

本报告期内，本基金托管人在对长盛价值发现股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，长盛价值发现股票型证券投资基金的管理人——长盛基金管理有限公司在长盛价值发现股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的长盛价值发现股票型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛价值发现股票型证券投资基金

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 2020 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	4,666,397.13
结算备付金		4,530,153.63
存出保证金		22,315.54
交易性金融资产	6.4.7.2	58,808,516.97
其中：股票投资		58,808,516.97
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		3,665,397.48
应收利息	6.4.7.5	2,790.81
应收股利		-
应收申购款		136,591.22
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		71,832,162.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		4,942,107.22
应付管理人报酬		115,514.83
应付托管费		19,252.44
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	240,813.95
应交税费		0.66

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	20,959.48
负债合计		5,338,648.58
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	59,391,329.98
未分配利润	6.4.7.10	7,102,184.22
所有者权益合计		66,493,514.20
负债和所有者权益总计		71,832,162.78

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1196 元，基金份额总额 59,391,329.98 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛价值发现股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		11,978,158.25
1.利息收入		247,055.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	86,400.24
债券利息收入		16.51
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		160,638.74
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,750,297.37
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,158,314.36
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	20,343.60
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
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	571,639.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,298,256.38
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	682,549.01

减：二、费用		990,242.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	517,540.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	86,256.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	368,892.75
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.07
7. 其他费用	6.4.7.20	17,552.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,987,915.66
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,987,915.66

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛价值发现股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益（基金净值）	235,997,860.33	-	235,997,860.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,987,915.66	10,987,915.66
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）	-176,606,530.35	-3,885,731.44	-180,492,261.79
其中：1.基金申购款	1,399,399.63	51,078.34	1,450,477.97
2.基金赎回款	-178,005,929.98	-3,936,809.78	-181,942,739.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益	59,391,329.98	7,102,184.22	66,493,514.20

(基金净值)			
--------	--	--	--

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

长盛价值发现股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1503号《关于准予长盛价值发现股票型证券投资基金注册的批复》及证监许可[2019]2088号《关于准予长盛价值发现股票型证券投资基金变更注册的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛价值发现股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币235,969,215.05元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0284号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛价值发现股票型证券投资基金基金合同》于2020年4月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为235,997,860.33份基金份额,其中认购资金利息折合28,645.28份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛价值发现股票型证券投资基金基金合同》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(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行交易的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、次级债、可转债等)、资产支持证券、货币市场工具、股指期货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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例为80%-95%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

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》、《长盛价值发现股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 15 日(基金合同生效日)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的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关

资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关

于发布《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	4,666,397.13
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:	4,666,397.13
-----	--------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	52,510,260.59	58,808,516.97	6,298,256.38
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	52,510,260.59	58,808,516.97	6,298,256.38

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	946.98
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	1,834.74
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	9.09
合计	2,790.81

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	240,813.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	240,813.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,208.59
应付证券出借违约金	-
预提费用	14,750.89
合计	20,959.48

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	235,997,860.33	235,997,860.33
本期申购	1,399,399.63	1,399,399.63
本期赎回(以“-”号填列)	-178,005,929.98	-178,005,929.98
- 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	59,391,329.98	59,391,329.98

注：(1) 申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

(2) 本基金合同生效日为 2020 年 4 月 15 日。

(3) 基金合同生效日的基金份额总额为 235,997,860.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 28,645.28 份基金份额。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,689,659.28	6,298,256.38	10,987,915.66
本期基金份额交易产生的变动数	-1,354,688.84	-2,531,042.60	-3,885,731.44
其中：基金申购款	25,138.33	25,940.01	51,078.34
基金赎回款	-1,379,827.17	-2,556,982.61	-3,936,809.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,334,970.44	3,767,213.78	7,102,184.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年 6月30日
活期存款利息收入	79,102.27
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	7,268.22
其他	29.75
合计	86,400.24

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至 2020年6月30日
卖出股票成交总额	105,139,569.60
减：卖出股票成本总额	100,981,255.24
买卖股票差价收入	4,158,314.36

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年 6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	20,343.60

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	20,343.60

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年 6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	85,360.70
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	65,000.00
减：应收利息总额	17.10
买卖债券差价收入	20,343.60

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 2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年 6月30日
股票投资产生的股利收益	571,639.41
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	571,639.41

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至 2020年6月30日
1. 交易性金融资产	6,298,256.38
——股票投资	6,298,256.38
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	6,298,256.38

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至 2020年6月30日
基金赎回费收入	682,468.43
基金转换费收入	80.58
合计	682,549.01

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至 2020年6月30日
交易所市场交易费用	368,892.75
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	368,892.75

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至 2020年6月30日
审计费用	14,750.89
信息披露费	-
证券出借违约金	-
其他手续费	400.00
银行费用	2,401.96

合计	17,552.85
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国元证券	41,342,382.42	15.99%

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	38,502.91	15.99%	38,502.91	15.99%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

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 2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	517,540.26
其中：支付销售机构的客户维护费	247,442.09

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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 X 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	86,256.66

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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自有资金投资本基金的情况**

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月15日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	4,666,397.13	79,102.27

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-
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	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金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

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及股指期货等。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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，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，本基金无债券投资。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，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、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	4,666,397.13	-	-	-	4,666,397.13
结算备付金	4,530,153.63	-	-	-	4,530,153.63

存出保证金	22,315.54	-	-	22,315.54
交易性金融资产	-	-	-58,808,516.97	58,808,516.97
应收证券清算款	-	-	-3,665,397.48	3,665,397.48
应收利息	-	-	2,790.81	2,790.81
应收申购款	-	-	136,591.22	136,591.22
资产总计	9,218,866.30	-	-62,613,296.48	71,832,162.78
负债				
应付赎回款	-	-	-4,942,107.22	4,942,107.22
应付管理人报酬	-	-	-115,514.83	115,514.83
应付托管费	-	-	-19,252.44	19,252.44
应付交易费用	-	-	-240,813.95	240,813.95
应交税费	-	-	0.66	0.66
其他负债	-	-	-20,959.48	20,959.48
负债总计	-	-	-5,338,648.58	5,338,648.58
利率敏感度缺口	9,218,866.30	-	-57,274,647.90	66,493,514.20

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

于报告期末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。

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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金投资组合中股票资产比例为基金总资产的 80%-95%。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 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	58,808,516.97	88.44
合计	58,808,516.97	88.44

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金成立未满一年，尚无充足的经验数据。

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人民币 58,788,901.89 元，属于第二层次的余额为人民币 19,615.08 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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

无。

(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

(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	58,808,516.97	81.87
	其中：股票	58,808,516.97	81.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,196,550.76	12.80
8	其他各项资产	3,827,095.05	5.33
9	合计	71,832,162.78	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	46,868,056.08	70.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,709,660.00	4.08
G	交通运输、仓储和邮政业	1,414,672.00	2.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,231,975.57	4.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,925,564.00	2.90
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,535,981.00	2.31
R	文化、体育和娱乐业	1,109,842.00	1.67
S	综合	-	-
	合计	58,808,516.97	88.44

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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	603444	吉比特	2,800	1,537,228.00	2.31
2	603259	药明康德	15,740	1,520,484.00	2.29
3	600132	重庆啤酒	19,500	1,423,500.00	2.14
4	603713	密尔克卫	13,600	1,414,672.00	2.13
5	600779	水井坊	22,598	1,410,567.16	2.12
6	600298	安琪酵母	27,500	1,360,700.00	2.05
7	601231	环旭电子	61,076	1,333,899.84	2.01
8	603605	珀莱雅	7,400	1,332,148.00	2.00
9	600519	贵州茅台	900	1,316,592.00	1.98
10	600885	宏发股份	32,284	1,295,234.08	1.95
11	600872	中炬高新	22,000	1,287,660.00	1.94
12	603236	移远通信	6,180	1,285,440.00	1.93
13	603501	韦尔股份	6,300	1,272,285.00	1.91
14	600809	山西汾酒	8,700	1,261,500.00	1.90
15	601100	恒立液压	15,700	1,259,140.00	1.89
16	603338	浙江鼎力	16,560	1,254,751.20	1.89
17	600201	生物股份	44,960	1,251,686.40	1.88
18	603737	三棵树	13,440	1,239,436.80	1.86
19	600867	通化东宝	70,000	1,220,100.00	1.83
20	600835	上海机电	72,000	1,218,960.00	1.83
21	603939	益丰药房	13,140	1,195,740.00	1.80
22	603288	海天味业	9,609	1,195,359.60	1.80
23	600406	国电南瑞	59,000	1,194,750.00	1.80
24	601799	星宇股份	9,400	1,193,800.00	1.80
25	603833	欧派家居	10,300	1,193,770.00	1.80
26	601138	工业富联	78,000	1,181,700.00	1.78
27	603515	欧普照明	43,100	1,179,647.00	1.77

28	600031	三一重工	60,943	1,143,290.68	1.72
29	603883	老百姓	11,400	1,140,456.00	1.72
30	601877	正泰电器	43,000	1,133,050.00	1.70
31	603816	顾家家居	25,100	1,129,751.00	1.70
32	600660	福耀玻璃	54,000	1,126,980.00	1.69
33	600803	新奥股份	107,525	1,111,808.50	1.67
34	601098	中南传媒	104,900	1,109,842.00	1.67
35	600066	宇通客车	89,700	1,094,340.00	1.65
36	600522	中天科技	92,800	1,062,560.00	1.60
37	600801	华新水泥	42,500	1,007,675.00	1.52
38	603027	千禾味业	28,820	910,135.60	1.37
39	300595	欧普康视	9,571	663,653.14	1.00
40	300244	迪安诊断	15,300	540,090.00	0.81
41	300015	爱尔眼科	11,900	517,055.00	0.78
42	002242	九阳股份	13,653	508,847.31	0.77
43	002557	洽洽食品	9,200	498,548.00	0.75
44	002410	广联达	7,000	487,900.00	0.73
45	300347	泰格医药	4,700	478,836.00	0.72
46	002050	三花股份	21,300	466,470.00	0.70
47	002690	美亚光电	8,300	436,580.00	0.66
48	000651	格力电器	7,700	435,589.00	0.66
49	300760	迈瑞医疗	1,417	433,176.90	0.65
50	002179	中航光电	10,500	430,605.00	0.65
51	000581	威孚高科	20,800	430,144.00	0.65
52	000858	五粮液	2,500	427,800.00	0.64
53	002511	中顺洁柔	19,100	425,930.00	0.64
54	000333	美的集团	6,900	412,551.00	0.62
55	002572	索菲亚	17,000	410,890.00	0.62
56	002271	东方雨虹	10,100	410,363.00	0.62
57	300012	华测检测	20,500	405,080.00	0.61
58	002304	洋河股份	3,844	404,158.16	0.61
59	002916	深南电路	2,400	402,048.00	0.60
60	000538	云南白药	4,200	394,002.00	0.59
61	300124	汇川技术	10,300	391,297.00	0.59
62	000999	华润三九	13,100	382,389.00	0.58
63	300747	锐科激光	3,500	380,905.00	0.57
64	002032	苏泊尔	5,300	376,300.00	0.57
65	002697	红旗连锁	34,200	373,464.00	0.56
66	603087	甘李药业	322	32,296.60	0.05

67	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.03
68	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.02
69	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
70	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
71	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002624	完美世界	1,639,795.00	2.47
2	000333	美的集团	1,634,978.00	2.46
3	300498	温氏股份	1,633,766.00	2.46
4	603883	老百姓	1,620,249.15	2.44
5	002602	世纪华通	1,607,129.00	2.42
6	601888	中国中免	1,599,010.00	2.40
7	600031	三一重工	1,597,052.14	2.40
8	603833	欧派家居	1,596,355.00	2.40
9	300724	捷佳伟创	1,596,121.00	2.40
10	000089	深圳机场	1,595,487.00	2.40
11	603501	韦尔股份	1,593,435.00	2.40
12	002415	海康威视	1,592,900.00	2.40
13	000858	五粮液	1,587,036.00	2.39
14	600522	中天科技	1,585,543.00	2.38
15	603236	移远通信	1,582,310.00	2.38
16	601098	中南传媒	1,582,186.00	2.38
17	300244	迪安诊断	1,578,515.00	2.37
18	002557	洽洽食品	1,577,427.00	2.37
19	002050	三花智控	1,576,980.00	2.37
20	002304	洋河股份	1,572,972.00	2.37
21	300012	华测检测	1,572,583.00	2.37
22	600132	重庆啤酒	1,570,898.00	2.36
23	300316	晶盛机电	1,570,703.00	2.36
24	603658	安图生物	1,569,635.36	2.36
25	603605	珀莱雅	1,568,821.00	2.36
26	002371	北方华创	1,566,825.00	2.36

27	600009	上海机场	1,564,228.00	2.35
28	000651	格力电器	1,563,117.00	2.35
29	600690	海尔智家	1,558,099.00	2.34
30	603259	药明康德	1,556,949.00	2.34
31	002511	中顺洁柔	1,556,700.24	2.34
32	601100	恒立液压	1,556,429.00	2.34
33	603515	欧普照明	1,555,812.00	2.34
34	600867	通化东宝	1,555,173.00	2.34
35	300015	爱尔眼科	1,555,044.76	2.34
36	300815	玉禾田	1,554,962.00	2.34
37	603939	益丰药房	1,553,708.60	2.34
38	002508	老板电器	1,552,824.00	2.34
39	002410	广联达	1,551,907.00	2.33
40	002242	九阳股份	1,549,855.30	2.33
41	002271	东方雨虹	1,548,183.89	2.33
42	600872	中炬高新	1,546,719.20	2.33
43	300365	恒华科技	1,546,020.00	2.33
44	600779	水井坊	1,543,036.52	2.32
45	600801	华新水泥	1,542,603.00	2.32
46	600276	恒瑞医药	1,541,827.20	2.32
47	300298	三诺生物	1,541,251.00	2.32
48	601328	交通银行	1,539,800.00	2.32
49	000001	平安银行	1,539,586.00	2.32
50	002697	红旗连锁	1,538,474.00	2.31
51	600406	国电南瑞	1,538,361.00	2.31
52	000999	华润三九	1,538,343.00	2.31
53	603713	密尔克卫	1,537,444.00	2.31
54	600201	生物股份	1,536,911.20	2.31
55	603228	景旺电子	1,534,624.00	2.31
56	002690	美亚光电	1,532,899.00	2.31
57	300124	汇川技术	1,532,620.00	2.30
58	600298	安琪酵母	1,532,568.00	2.30
59	300595	欧普康视	1,531,680.74	2.30
60	002572	索菲亚	1,530,146.00	2.30
61	002439	启明星辰	1,529,130.00	2.30
62	601288	农业银行	1,528,686.00	2.30

63	601799	星宇股份	1,527,875.00	2.30
64	600585	海螺水泥	1,527,210.31	2.30
65	601138	工业富联	1,526,963.00	2.30
66	603986	兆易创新	1,526,779.00	2.30
67	000063	中兴通讯	1,524,000.00	2.29
68	300347	泰格医药	1,522,929.00	2.29
69	603444	吉比特	1,522,459.00	2.29
70	000157	中联重科	1,521,352.00	2.29
71	002179	中航光电	1,520,617.00	2.29
72	002032	苏泊尔	1,519,103.00	2.28
73	600885	宏发股份	1,518,734.00	2.28
74	603737	三棵树	1,517,194.96	2.28
75	601231	环旭电子	1,510,148.44	2.27
76	000538	云南白药	1,509,927.00	2.27
77	300760	迈瑞医疗	1,508,355.00	2.27
78	600835	上海机电	1,508,023.00	2.27
79	601877	正泰电器	1,507,718.00	2.27
80	300747	锐科激光	1,506,484.00	2.27
81	603288	海天味业	1,506,093.52	2.27
82	002916	深南电路	1,503,475.80	2.26
83	603338	浙江鼎力	1,503,325.00	2.26
84	603816	顾家家居	1,502,598.00	2.26
85	688268	华特气体	1,500,826.18	2.26
86	603882	金域医学	1,500,435.00	2.26
87	600584	长电科技	1,497,419.00	2.25
88	603877	太平鸟	1,494,045.00	2.25
89	000581	威孚高科	1,484,489.00	2.23
90	600066	宇通客车	1,479,905.98	2.23
91	600900	长江电力	1,472,924.00	2.22
92	600519	贵州茅台	1,472,150.00	2.21
93	600660	福耀玻璃	1,470,497.06	2.21
94	600809	山西汾酒	1,467,533.00	2.21
95	600803	新奥股份	1,463,070.00	2.20
96	601939	建设银行	1,448,875.00	2.18
97	688012	中微公司	1,436,788.09	2.16
98	688019	安集科技	1,424,403.73	2.14

99	688111	金山办公	1,410,031.76	2.12
----	--------	------	--------------	------

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601888	中国中免	2,140,630.00	3.22
2	300724	捷佳伟创	1,843,569.00	2.77
3	600690	海尔智家	1,774,445.00	2.67
4	600276	恒瑞医药	1,768,144.00	2.66
5	300298	三诺生物	1,765,237.80	2.65
6	603882	金域医学	1,721,311.00	2.59
7	002508	老板电器	1,716,358.00	2.58
8	002624	完美世界	1,670,203.00	2.51
9	603986	兆易创新	1,650,000.00	2.48
10	600009	上海机场	1,649,243.00	2.48
11	600900	长江电力	1,621,817.00	2.44
12	000089	深圳机场	1,592,550.61	2.40
13	300316	晶盛机电	1,589,939.00	2.39
14	000001	平安银行	1,575,836.60	2.37
15	603658	安图生物	1,573,661.00	2.37
16	300498	温氏股份	1,561,607.21	2.35
17	002602	世纪华通	1,561,417.00	2.35
18	688019	安集科技	1,554,896.00	2.34
19	600584	长电科技	1,548,920.52	2.33
20	002415	海康威视	1,547,688.00	2.33
21	300365	恒华科技	1,542,609.00	2.32
22	000063	中兴通讯	1,533,632.00	2.31
23	000157	中联重科	1,532,366.00	2.30
24	601328	交通银行	1,528,740.00	2.30
25	601288	农业银行	1,525,634.00	2.29
26	002371	北方华创	1,502,160.00	2.26
27	603228	景旺电子	1,501,002.00	2.26
28	002439	启明星辰	1,477,096.00	2.22
29	300815	玉禾田	1,469,148.00	2.21
30	601939	建设银行	1,460,115.00	2.20
31	300244	迪安诊断	1,451,189.00	2.18
32	000858	五粮液	1,434,383.57	2.16

33	603877	太平鸟	1,427,095.00	2.15
34	600585	海螺水泥	1,418,761.00	2.13
35	688111	金山办公	1,342,453.72	2.02

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	153,491,515.83
卖出股票收入（成交）总额	105,139,569.60

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

本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	22,315.54
2	应收证券清算款	3,665,397.48
3	应收股利	-
4	应收利息	2,790.81
5	应收申购款	136,591.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,827,095.05

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,101	53,943.08	-	-	59,391,329.98	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	13,838.39	0.0233%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年4月15日）基金份额总额	235,997,860.33
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,399,399.63
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	178,005,929.98
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	59,391,329.98

§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

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2020 年 4 月 15 日起，冯雨生同志担任长盛价值发现股票型证券投资基金基金经理。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

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

本报告期内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

报告期内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	
申万宏源	2	120,529,520.53	46.61%	112,250.61	46.61%	-
中信建投	1	68,512,812.11	26.50%	63,806.11	26.50%	-
国元证券	2	41,342,382.42	15.99%	38,502.91	15.99%	-
银河证券	1	28,191,049.51	10.90%	26,254.32	10.90%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	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
申万宏源	85,360.70	100.00%	860,000,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

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) 财力雄厚，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，并能为本公司基金提供全面的信息服。

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、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、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：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：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	长盛价值发现股票型证券投资基金开放日常申购 赎回 转换及定期定额投资业务的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年5月12日
2	长盛基金管理有限公司关于旗下基金可参与投资科创板股票及相关风险揭示的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年5月8日
3	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	证券时报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月28日
4	长盛价值发现股票型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月16日
5	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金 参加中信建投证券认购费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月8日
6	长盛基金管理有限公司关于增加长盛价值发现股票型证券投资基金代销机构的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月7日
7	长盛价值发现股票型证券投资基	证券时报、本公司	2020年3月19日

	金托管协议	网站、中国证监会 基金电子披露网站	
8	长盛价值发现股票型证券投资基金基金合同	证券时报、本公司 网站、中国证监会 基金电子披露网站	2020 年 3 月 19 日
9	长盛价值发现股票型证券投资基金招募说明书	本公司网站、中国 证监会基金电子披 露网站	2020 年 3 月 19 日
10	长盛价值发现股票型证券投资基金基金份额发售公告	证券时报、本公司 网站、中国证监会 基金电子披露网站	2020 年 3 月 19 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

本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、长盛价值发现股票型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛价值发现股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛价值发现股票型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛价值发现股票型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址及/或基金管理人网站免费查阅备查文件。

在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2020年8月29日