

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 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：招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。

基金托管人招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 01 月 01 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.....	6
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.....	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
§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.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 市场中性策略执行情况.....	52
7.13 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	58

§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)
基金简称	长盛沪深 300 指数(LOF)
场内简称	长盛 300
基金主代码	160807
交易代码	160807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 8 月 4 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	200,900,831.33 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	2010 年 9 月 6 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资，跟踪沪深 300 指数，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%，以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金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均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×沪深 300 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	本基金是股票指数型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	张燕
	联系电话	010-86497608	0755-83199084
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95555

传真	010-86497999	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区福中三路诺德金融中心主楼 10D	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100029	518040
法定代表人	周兵	李建红

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	http://www.csfunds.com.cn
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	14,919,503.76
本期利润	18,063,557.57
加权平均基金份额本期利润	0.1092
本期加权平均净值利润率	8.23%
本期基金份额净值增长率	7.37%
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	71,402,456.56
期末可供分配基金份额利润	0.3554
期末基金资产净值	272,303,287.89
期末基金份额净值	1.355
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	59.33%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.79%	0.84%	7.29%	0.85%	1.50%	-0.01%
过去三个月	15.11%	0.85%	12.31%	0.85%	2.80%	0.00%
过去六个月	7.37%	1.43%	1.67%	1.45%	5.70%	-0.02%
过去一年	18.99%	1.14%	8.56%	1.16%	10.43%	-0.02%
过去三年	24.96%	1.16%	13.41%	1.19%	11.55%	-0.03%
自基金合同生效起至今	59.33%	1.39%	45.97%	1.38%	13.36%	0.01%

注：本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。

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。

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



按照本基金合同规定，本基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)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 10 月 9 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

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 1.355 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.37%，业绩比较基准收益率为 1.67%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0973%，年度化跟踪误差为 1.5390%。

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并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同中对基金利润分配原则的约定，本基金于 2020 年 1 月 20 日进行了利润分配，分配金额为 13,513,231.96 元；于 2020 年 6 月 29 日进行了利润分配，分配金额为 13,613,048.77 元。

本基金截至 2020 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 71,402,456.56 元，其中，未分配利润

已实现部分为 153,194,658.46 元，未分配利润未实现部分为-81,792,201.90 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	21,038,872.17	17,098,595.40
结算备付金		62,376.47	-
存出保证金		30,366.30	51,931.32
交易性金融资产	6.4.7.2	252,548,552.39	203,357,242.22
其中：股票投资		252,515,752.39	203,357,242.22
基金投资		-	-
债券投资		32,800.00	-
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		5,969,618.70	-
应收利息	6.4.7.5	1,710.69	3,726.15
应收股利		-	-
应收申购款		1,509,432.68	167,480.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		281,160,929.40	220,678,975.59
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 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		887,896.39	373,206.42
应付管理人报酬		156,862.09	135,431.98
应付托管费		31,372.41	27,086.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	104,354.63	23,433.73
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		7,499,637.61	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	177,518.38	110,766.51
负债合计		8,857,641.51	669,925.04
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	200,900,831.33	155,672,961.69
未分配利润	6.4.7.10	71,402,456.56	64,336,088.86
所有者权益合计		272,303,287.89	220,009,050.55
负债和所有者权益总计		281,160,929.40	220,678,975.59

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.355 元，基金份额总额 200,900,831.33 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		19,550,078.48	11,411,957.26
1.利息收入		45,512.94	15,722.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	45,510.21	15,722.73
债券利息收入		2.73	-
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）		16,203,588.90	1,184,385.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,761,918.63	634,681.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,441,670.27	549,704.32
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,144,053.81	10,176,351.36
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	156,922.83	35,497.18

列)			
减：二、费用		1,486,520.91	331,791.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	821,105.08	179,935.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	164,221.04	35,987.06
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	377,972.65	28,347.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	123,222.14	87,521.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,063,557.57	11,080,165.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,063,557.57	11,080,165.69

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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 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）	155,672,961.69	64,336,088.86	220,009,050.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,063,557.57	18,063,557.57
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）	45,227,869.64	16,129,090.86	61,356,960.50
其中：1.基金申购款	120,130,970.19	39,730,385.03	159,861,355.22
2.基金赎回款	-74,903,100.55	-23,601,294.17	-98,504,394.72
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）	-	-27,126,280.73	-27,126,280.73
五、期末所有者权益	200,900,831.33	71,402,456.56	272,303,287.89

份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第 276 号文审核同意，本基金 112,932,582 份基金份额于 2010 年 9 月 6 日在深交所挂牌交易。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交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《长盛沪深 300 指数证券投资基金(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、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票资产投资比例不低于基金资产净值的 90%，其中，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5%的现金以及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。

本基金力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 沪深 300 指数收益率 + $5\% \times$ 一年期银行定期存款利率（税后）。本基金标的指数使用费由基金管理人长盛基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

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》、《长盛沪深 300 指数证券投资基金(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

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 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	21,038,872.17
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：	21,038,872.17

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	230,037,794.65	252,515,752.39	22,477,957.74
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	32,800.00	32,800.00
	银行间市场	-	-
	合计	32,800.00	32,800.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	230,070,594.65	252,548,552.39	22,477,957.74

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 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,666.16
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	28.10
应收债券利息	2.73
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	13.70
合计	1,710.69

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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	104,354.63
银行间市场应付交易费用	-

合计	104,354.63
----	------------

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	3,234.08
应付证券出借违约金	-
其他	4,941.44
预提费用	169,342.86
合计	177,518.38

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 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	155,672,961.69	155,672,961.69
本期申购	120,130,970.19	120,130,970.19
本期赎回(以“-”号填列)	-74,903,100.55	-74,903,100.55
- 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	200,900,831.33	200,900,831.33

注：1. 申购含转换入；赎回含转换出。

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3,827,346.00份(2019年12月31日：1,597,349.00份)，托管在场外未上市交易的基金份额为197,073,485.33份(2019年12月31日：154,075,612.69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	129,061,203.98	-64,725,115.12	64,336,088.86
本期利润	14,919,503.76	3,144,053.81	18,063,557.57
本期基金份额交易	36,340,231.45	-20,211,140.59	16,129,090.86

产生的变动数			
其中：基金申购款	95,268,945.44	-55,538,560.41	39,730,385.03
基金赎回款	-58,928,713.99	35,327,419.82	-23,601,294.17
本期已分配利润	-27,126,280.73	-	-27,126,280.73
本期末	153,194,658.46	-81,792,201.90	71,402,456.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	44,338.83
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	894.92
其他	276.46
合计	45,510.21

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	106,860,194.25
减：卖出股票成本总额	93,098,275.62
买卖股票差价收入	13,761,918.63

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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,441,670.27

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,441,670.27

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1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	3,144,053.81
——股票投资	3,144,053.81
——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	3,144,053.81

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	156,846.72
基金转换费收入	76.11
合计	156,922.83

注：1. 本基金的赎回费率场外按持有期间递减，场内为赎回金额的0.5%。对持续持有期少于7天的基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产；其余赎回费总额的25%计入基金资产。

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
	2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	377,972.65
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	377,972.65

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 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	-
上市费	29,835.26
银行汇划费	3,879.28
合计	123,222.14

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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：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

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1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国元证券	155,292,885.36	64.84%	14,540,679.81	71.19%

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1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	144,621.94	64.84%	65,596.38	62.86%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	13,541.42	71.19%	11,192.31	69.13%

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。债券及权证交易不计佣金。

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

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1月1日至2020年 6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	821,105.08	179,935.27
其中：支付销售机构的客户维护费	110,325.27	83,569.12

注：支付基金管理人长盛基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	164,221.04	35,987.06

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金合同生效日（ 2010 年 8 月 4 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	7,685,626.44	-

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	7,685,626.44	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.8256%	-

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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		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
招商银行	21,038,872.17	44,338.83	3,623,037.00	15,377.25

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2020年6月29日	2020年6月30日	2020年6月29日	0.6960	7,499,637.61	6,113,411.16	13,613,048.77	
2	2020年1月20日	2020年1月21日	2020年1月20日	0.8700	6,194,907.69	7,318,324.27	13,513,231.96	
合计	-	-	-	1.5660	13,694,545.30	13,431,735.43	27,126,280.73	

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
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	16.21	16.21	9,642	156,296.82	156,296.82	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股未上市	16.42	16.42	7,406	121,606.52	121,606.52	-
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	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

			1 日							
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	15,358	196,582.40	638,892.80	-
688278	特宝生物	2020 年 1 月 9 日	2020 年 7 月 17 日	新股流通受限	8.24	67.60	8,002	65,936.48	540,935.20	-
688080	映翰通	2020 年 2 月 3 日	2020 年 8 月 12 日	新股流通受限	27.63	86.71	2,233	61,697.79	193,623.43	-

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转 2	2020 年 6 月 12 日	2020 年 7 月 13 日	新债未上市	100.00	100.00	328	32,800.00	32,800.00	-

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

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

本基金为抽样复制的指数型基金，采用抽样复制指数的投资策略，跟踪沪深 300 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人招商银行，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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%（2019 年 12 月 31 日，无），因此不存在重大信用风险（2019 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 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）。

本基金所持证券在证券交易所上市，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，本基金持有的流动性受限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、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	21,038,872.17	-	-	-	21,038,872.17
结算备付金	62,376.47	-	-	-	62,376.47
存出保证金	30,366.30	-	-	-	30,366.30
交易性金融资产	-	-	32,800.00	252,515,752.39	252,548,552.39
应收证券清算款	-	-	-	5,969,618.70	5,969,618.70
应收利息	-	-	-	1,710.69	1,710.69
应收申购款	-	-	-	1,509,432.68	1,509,432.68
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	21,131,614.94	-	32,800.00	259,996,514.46	281,160,929.40
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	887,896.39	887,896.39
应付管理人报酬	-	-	-	156,862.09	156,862.09
应付托管费	-	-	-	31,372.41	31,372.41
应付交易费用	-	-	-	104,354.63	104,354.63
应付利润	-	-	-	7,499,637.61	7,499,637.61
其他负债	-	-	-	177,518.38	177,518.38
负债总计	-	-	-	8,857,641.51	8,857,641.51
利率敏感度缺口	21,131,614.94	-	32,800.00	251,138,872.95	272,303,287.89
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,098,595.40	-	-	-	17,098,595.40
存出保证金	51,931.32	-	-	-	51,931.32
交易性金融资产	-	-	-	203,357,242.22	203,357,242.22
应收利息	-	-	-	3,726.15	3,726.15
应收申购款	-	-	-	167,480.50	167,480.50
资产总计	17,150,526.72	-	-	203,528,448.87	220,678,975.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	373,206.42	373,206.42
应付管理人报酬	-	-	-	135,431.98	135,431.98
应付托管费	-	-	-	27,086.40	27,086.40
应付交易费用	-	-	-	23,433.73	23,433.73
其他负债	-	-	-	110,766.51	110,766.51
负债总计	-	-	-	669,925.04	669,925.04
利率敏感度缺口	17,150,526.72	-	-	202,858,523.83	220,009,050.55

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 0.01%（2019 年 12 月 31 日：无），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。

本基金采用抽样复制指数的投资策略，股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例占基金资产净值的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%。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		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	252,515,752.39	92.73	203,357,242.22	92.43
合计	252,515,752.39	92.73	203,357,242.22	92.43

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	13,319,324.57	10,730,138.41
2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-13,319,324.57	-10,730,138.41	

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250,681,476.63元，属于第二层次的余额为1,867,075.76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201,766,618.59元，属于第二层次的余额为1,590,623.63元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层级间的重大变动

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

上述第三层次资产变动如下：

项目	交易性金融资产	
	本期	上年度可比期间

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	债券投 资	权益工 具投资	合计	债券投 资	权益工具投资	合计
期初	-	-	-	-	118,194.27	118,194.27
购买	-	-	-	-		-
出售	-	-	-	-	73,867.99	73,867.99
转入第三层次	-	-	-	-	-	-
转出第三层次	-	-	-	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-	-	19,866.49	19,866.49
计入损益的利得或损 失	-	-	-	-	19,866.49	19,866.49
期末	-	-	-	-	64,192.77	64,192.77
期末仍持有的资产计 入上半年度损益的未 实现利得或损失的变 动——公允价值变动 损益	-	-	-	-	-	-

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 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	252,515,752.39	89.81
	其中：股票	252,515,752.39	89.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	32,800.00	0.01
	其中：债券	32,800.00	0.01
	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	21,101,248.64	7.51
8	其他各项资产	7,511,128.37	2.67
9	合计	281,160,929.40	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	3,812,467.80	1.40
B	采矿业	6,189,897.67	2.27
C	制造业	123,337,585.16	45.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,215,477.83	1.92
E	建筑业	5,066,683.59	1.86
F	批发和零售业	2,650,401.80	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	7,215,773.76	2.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,558,142.11	3.88
J	金融业	66,110,099.93	24.28
K	房地产业	9,571,484.20	3.52
L	租赁和商务服务业	3,686,018.44	1.35
M	科学研究和技术服务业	1,748,073.60	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	330,225.00	0.12
Q	卫生和社会工作	3,147,971.54	1.16
R	文化、体育和娱乐业	1,674,822.13	0.62
S	综合	-	-
	合计	250,315,124.56	91.93

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,866,251.79	0.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,462.70	0.01
E	建筑业	4,244.40	0.00
F	批发和零售业	4,883.60	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,824.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	290,077.50	0.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,605.00	0.00
L	租赁和商务服务业	5,350.00	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	4,928.84	0.00
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,200,627.83	0.81

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	186,890	13,343,946.00	4.90
2	600519	贵州茅台	8,789	12,857,252.32	4.72
3	600276	恒瑞医药	64,355	5,939,966.50	2.18
4	000858	五粮液	33,603	5,750,145.36	2.11
5	000333	美的集团	84,688	5,063,495.52	1.86
6	000651	格力电器	83,017	4,696,271.69	1.72
7	002475	立讯精密	72,714	3,733,863.90	1.37
8	600030	中信证券	146,717	3,537,346.87	1.30
9	601166	兴业银行	216,430	3,415,265.40	1.25
10	600887	伊利股份	104,710	3,259,622.30	1.20
11	000002	万科A	117,047	3,059,608.58	1.12
12	601398	工商银行	602,887	3,002,377.26	1.10
13	600900	长江电力	151,992	2,878,728.48	1.06
14	601888	中国中免	17,028	2,622,822.84	0.96
15	601328	交通银行	474,181	2,432,548.53	0.89
16	300059	东方财富	111,379	2,249,855.80	0.83
17	600585	海螺水泥	41,290	2,184,653.90	0.80
18	000725	京东方A	466,088	2,176,630.96	0.80
19	000001	平安银行	167,979	2,150,131.20	0.79
20	600000	浦发银行	202,929	2,146,988.82	0.79
21	000661	长春高新	4,900	2,132,970.00	0.78
22	002714	牧原股份	25,972	2,129,704.00	0.78
23	603288	海天味业	16,980	2,112,312.00	0.78
24	600016	民生银行	368,239	2,087,915.13	0.77
25	002415	海康威视	64,696	1,963,523.60	0.72
26	600031	三一重工	102,059	1,914,626.84	0.70
27	601688	华泰证券	101,362	1,905,605.60	0.70
28	601012	隆基股份	45,864	1,868,040.72	0.69
29	000063	中兴通讯	46,289	1,857,577.57	0.68
30	600048	保利地产	123,734	1,828,788.52	0.67
31	600837	海通证券	139,794	1,758,608.52	0.65
32	603259	药明康德	18,096	1,748,073.60	0.64
33	601668	中国建筑	362,003	1,726,754.31	0.63
34	601288	农业银行	499,165	1,687,177.70	0.62
35	300498	温氏股份	77,191	1,682,763.80	0.62
36	600570	恒生电子	14,658	1,578,666.60	0.58
37	300015	爱尔眼科	34,622	1,504,325.90	0.55

38	000100	TCL 科技	233,535	1,447,917.00	0.53
39	601229	上海银行	171,051	1,419,723.30	0.52
40	300142	沃森生物	26,500	1,387,540.00	0.51
41	603986	兆易创新	5,820	1,372,996.20	0.50
42	600309	万华化学	27,426	1,371,025.74	0.50
43	002142	宁波银行	51,838	1,361,784.26	0.50
44	601211	国泰君安	78,000	1,346,280.00	0.49
45	601601	中国太保	47,366	1,290,723.50	0.47
46	601988	中国银行	363,960	1,266,580.80	0.47
47	601169	北京银行	255,652	1,252,694.80	0.46
48	002352	顺丰控股	22,900	1,252,630.00	0.46
49	600588	用友网络	28,253	1,245,957.30	0.46
50	600009	上海机场	16,952	1,221,730.64	0.45
51	000568	泸州老窖	12,857	1,171,529.84	0.43
52	601766	中国中车	209,243	1,165,483.51	0.43
53	600690	海尔智家	65,415	1,157,845.50	0.43
54	002241	歌尔股份	39,204	1,151,029.44	0.42
55	002594	比亚迪	15,903	1,141,835.40	0.42
56	000338	潍柴动力	82,792	1,135,906.24	0.42
57	002304	洋河股份	10,797	1,135,196.58	0.42
58	300122	智飞生物	11,000	1,101,650.00	0.40
59	002410	广联达	15,700	1,094,290.00	0.40
60	000876	新希望	36,614	1,091,097.20	0.40
61	600999	招商证券	49,497	1,086,459.15	0.40
62	600703	三安光电	42,406	1,060,150.00	0.39
63	601899	紫金矿业	237,401	1,044,564.40	0.38
64	600104	上汽集团	60,743	1,032,023.57	0.38
65	002555	三七互娱	21,902	1,025,013.60	0.38
66	002230	科大讯飞	26,809	1,003,460.87	0.37
67	600745	闻泰科技	7,900	995,005.00	0.37
68	002027	分众传媒	177,380	988,006.60	0.36
69	601818	光大银行	275,067	984,739.86	0.36
70	300347	泰格医药	9,400	957,672.00	0.35
71	002007	华兰生物	19,065	955,347.15	0.35
72	300601	康泰生物	5,800	940,528.00	0.35
73	600919	江苏银行	159,600	904,932.00	0.33
74	600028	中国石化	230,962	903,061.42	0.33
75	001979	招商蛇口	54,369	893,826.36	0.33
76	600436	片仔癀	5,100	868,275.00	0.32

77	000538	云南白药	9,048	848,792.88	0.31
78	600547	山东黄金	22,486	823,437.32	0.30
79	601088	中国神华	57,178	821,076.08	0.30
80	600406	国电南瑞	40,088	811,782.00	0.30
81	300413	芒果超媒	12,400	808,480.00	0.30
82	000895	双汇发展	17,247	794,914.23	0.29
83	601628	中国人寿	28,999	789,062.79	0.29
84	300003	乐普医疗	21,600	788,832.00	0.29
85	000166	申万宏源	155,730	786,436.50	0.29
86	600050	中国联通	160,648	777,536.32	0.29
87	002271	东方雨虹	19,000	771,970.00	0.28
88	600438	通威股份	44,300	769,934.00	0.28
89	601009	南京银行	103,804	760,883.32	0.28
90	300014	亿纬锂能	15,900	760,815.00	0.28
91	000938	紫光股份	17,672	759,542.56	0.28
92	002129	中环股份	33,700	756,902.00	0.28
93	002371	北方华创	4,300	734,913.00	0.27
94	601939	建设银行	116,009	732,016.79	0.27
95	002460	赣锋锂业	13,550	725,873.50	0.27
96	300136	信维通信	13,641	723,245.82	0.27
97	601006	大秦铁路	102,716	723,120.64	0.27
98	000776	广发证券	51,065	721,037.80	0.26
99	600196	复星医药	20,890	707,126.50	0.26
100	601390	中国中铁	140,729	706,459.58	0.26
101	601857	中国石油	167,865	703,354.35	0.26
102	600019	宝钢股份	153,888	701,729.28	0.26
103	300124	汇川技术	18,224	692,329.76	0.25
104	603160	汇顶科技	3,100	690,990.00	0.25
105	603019	中科曙光	17,920	688,128.00	0.25
106	002044	美年健康	47,604	685,973.64	0.25
107	000977	浪潮信息	17,500	685,650.00	0.25
108	002050	三花智控	31,150	682,185.00	0.25
109	002311	海大集团	14,000	666,260.00	0.24
110	601186	中国铁建	79,395	665,330.10	0.24
111	002602	世纪华通	43,134	660,381.54	0.24
112	002001	新和成	22,600	657,660.00	0.24
113	601336	新华保险	14,774	654,192.72	0.24
114	600809	山西汾酒	4,500	652,500.00	0.24
115	600015	华夏银行	106,436	651,388.32	0.24

116	002624	完美世界	11,200	645,568.00	0.24
117	300433	蓝思科技	22,600	633,704.00	0.23
118	601989	中国重工	157,634	630,536.00	0.23
119	601933	永辉超市	66,292	621,818.96	0.23
120	603501	韦尔股份	3,000	605,850.00	0.22
121	002456	欧菲光	32,737	602,033.43	0.22
122	002236	大华股份	31,222	599,774.62	0.22
123	600958	东方证券	62,108	589,404.92	0.22
124	600183	生益科技	19,800	579,546.00	0.21
125	000157	中联重科	89,908	578,108.44	0.21
126	600352	浙江龙盛	45,012	575,703.48	0.21
127	600741	华域汽车	27,529	572,327.91	0.21
128	002024	苏宁易购	64,564	566,226.28	0.21
129	601377	兴业证券	81,130	555,740.50	0.20
130	601788	光大证券	33,947	545,188.82	0.20
131	600383	金地集团	39,240	537,588.00	0.20
132	002008	大族激光	14,900	535,655.00	0.20
133	002463	沪电股份	20,900	522,082.00	0.19
134	300033	同花顺	3,900	519,012.00	0.19
135	601138	工业富联	34,200	518,130.00	0.19
136	600660	福耀玻璃	24,541	512,170.67	0.19
137	600346	恒力石化	36,540	511,560.00	0.19
138	601901	方正证券	71,104	503,416.32	0.18
139	000860	顺鑫农业	8,800	501,424.00	0.18
140	300408	三环集团	18,100	501,370.00	0.18
141	601225	陕西煤业	69,117	498,333.57	0.18
142	601155	新城控股	15,900	496,716.00	0.18
143	601877	正泰电器	18,800	495,380.00	0.18
144	002120	韵达股份	20,093	491,273.85	0.18
145	600522	中天科技	42,600	487,770.00	0.18
146	000425	徐工机械	81,326	480,636.66	0.18
147	002736	国信证券	42,509	480,351.70	0.18
148	600340	华夏幸福	20,972	479,419.92	0.18
149	002202	金风科技	47,782	476,386.54	0.17
150	600109	国金证券	41,739	476,241.99	0.17
151	300144	宋城演艺	27,260	471,598.00	0.17
152	603799	华友钴业	11,862	460,957.32	0.17
153	002841	视源股份	4,600	457,792.00	0.17
154	601669	中国电建	132,173	457,318.58	0.17

155	000783	长江证券	66,994	451,539.56	0.17
156	603993	洛阳钼业	122,205	448,492.35	0.16
157	601108	财通证券	43,600	446,900.00	0.16
158	601800	中国交建	60,733	445,780.22	0.16
159	601985	中国核电	107,695	440,472.55	0.16
160	002916	深南电路	2,620	438,902.40	0.16
161	601555	东吴证券	53,754	438,632.64	0.16
162	603369	今世缘	11,000	437,690.00	0.16
163	600089	特变电工	64,327	435,493.79	0.16
164	600867	通化东宝	24,700	430,521.00	0.16
165	000069	华侨城 A	70,999	430,253.94	0.16
166	000768	中航飞机	24,141	428,261.34	0.16
167	600010	包钢股份	393,341	424,808.28	0.16
168	002493	荣盛石化	32,700	402,210.00	0.15
169	000066	中国长城	30,200	398,640.00	0.15
170	600029	南方航空	76,358	394,770.86	0.14
171	002466	天齐锂业	17,111	392,697.45	0.14
172	600487	亨通光电	23,820	390,886.20	0.14
173	600606	绿地控股	63,106	389,995.08	0.14
174	002179	中航光电	9,500	389,595.00	0.14
175	000963	华东医药	15,379	389,088.70	0.14
176	601100	恒立液压	4,700	376,940.00	0.14
177	600795	国电电力	203,528	376,526.80	0.14
178	002157	正邦科技	21,500	375,820.00	0.14
179	600061	国投资本	29,400	374,262.00	0.14
180	603658	安图生物	2,300	373,612.00	0.14
181	600886	国投电力	47,363	372,273.18	0.14
182	000625	长安汽车	33,838	372,218.00	0.14
183	601607	上海医药	20,147	370,301.86	0.14
184	600893	航发动力	15,741	369,598.68	0.14
185	600705	中航资本	92,944	368,058.24	0.14
186	002422	科伦药业	17,400	365,400.00	0.13
187	600926	杭州银行	40,820	364,114.40	0.13
188	600498	烽火通信	12,500	361,375.00	0.13
189	603899	晨光文具	6,500	354,900.00	0.13
190	600111	北方稀土	37,770	352,016.40	0.13
191	601162	天风证券	57,490	348,389.40	0.13
192	601066	中信建投	8,800	346,544.00	0.13
193	600637	东方明珠	35,413	341,735.45	0.13

194	601111	中国国航	51,596	341,049.56	0.13
195	600176	中国巨石	36,500	333,975.00	0.12
196	002607	中公教育	11,900	330,225.00	0.12
197	002601	龙蟒佰利	17,800	329,300.00	0.12
198	300628	亿联网络	4,800	327,648.00	0.12
199	600115	东方航空	77,509	327,087.98	0.12
200	600332	白云山	9,963	322,103.79	0.12
201	600011	华能国际	76,000	320,720.00	0.12
202	600118	中国卫星	10,394	320,447.02	0.12
203	601360	三六零	17,500	320,425.00	0.12
204	601727	上海电气	63,305	319,057.20	0.12
205	600271	航天信息	19,632	318,823.68	0.12
206	601816	京沪高铁	50,800	316,484.00	0.12
207	600233	圆通速递	21,700	315,952.00	0.12
208	000786	北新建材	14,700	313,551.00	0.12
209	601600	中国铝业	112,997	311,871.72	0.11
210	601618	中国中冶	123,386	309,698.86	0.11
211	000656	金科股份	37,200	303,552.00	0.11
212	003816	中国广核	101,600	300,736.00	0.11
213	600221	海航控股	198,601	297,901.50	0.11
214	601838	成都银行	37,400	297,704.00	0.11
215	002252	上海莱士	35,000	296,100.00	0.11
216	600489	中金黄金	32,301	295,231.14	0.11
217	601919	中远海控	83,200	288,704.00	0.11
218	000703	恒逸石化	31,620	288,690.60	0.11
219	600177	雅戈尔	48,252	287,581.92	0.11
220	000961	中南建设	32,200	286,580.00	0.11
221	000596	古井贡酒	1,900	285,456.00	0.10
222	600068	葛洲坝	47,932	285,195.40	0.10
223	600066	宇通客车	23,098	281,795.60	0.10
224	601997	贵阳银行	39,240	280,958.40	0.10
225	600004	白云机场	18,100	275,844.00	0.10
226	601998	中信银行	53,288	274,433.20	0.10
227	600390	五矿资本	38,840	274,210.40	0.10
228	600085	同仁堂	9,775	265,098.00	0.10
229	601198	东兴证券	24,000	261,600.00	0.10
230	601881	中国银河	22,600	259,222.00	0.10
231	002508	老板电器	8,300	258,213.00	0.09
232	603833	欧派家居	2,200	254,980.00	0.09

233	600018	上港集团	60,473	253,986.60	0.09
234	600219	南山铝业	123,900	251,517.00	0.09
235	600760	中航沈飞	7,600	249,432.00	0.09
236	601231	环旭电子	11,400	248,976.00	0.09
237	002673	西部证券	30,488	248,782.08	0.09
238	600516	方大炭素	39,556	248,411.68	0.09
239	601018	宁波港	68,509	244,577.13	0.09
240	600362	江西铜业	18,107	243,720.22	0.09
241	002146	荣盛发展	30,056	243,453.60	0.09
242	600998	九州通	12,900	240,198.00	0.09
243	600655	豫园股份	27,100	240,106.00	0.09
244	600170	上海建工	76,922	236,150.54	0.09
245	601319	中国人保	36,600	235,704.00	0.09
246	601117	中国化学	42,700	233,996.00	0.09
247	601878	浙商证券	23,300	230,903.00	0.08
248	601021	春秋航空	6,500	229,060.00	0.08
249	600369	西南证券	48,898	224,441.82	0.08
250	600297	广汇汽车	69,800	222,662.00	0.08
251	002773	康弘药业	4,480	222,208.00	0.08
252	002739	万达电影	14,500	221,415.00	0.08
253	600208	新湖中宝	74,290	221,384.20	0.08
254	600848	上海临港	10,200	218,994.00	0.08
255	002153	石基信息	5,581	217,826.43	0.08
256	002938	鹏鼎控股	4,300	215,258.00	0.08
257	600674	川投能源	23,066	213,821.82	0.08
258	002958	青农商行	47,900	212,197.00	0.08
259	601658	邮储银行	46,100	210,677.00	0.08
260	600038	中直股份	5,024	206,335.68	0.08
261	002939	长城证券	16,140	198,844.80	0.07
262	002032	苏泊尔	2,800	198,800.00	0.07
263	603156	养元饮品	9,024	194,016.00	0.07
264	600027	华电国际	56,600	193,572.00	0.07
265	002558	巨人网络	10,840	188,616.00	0.07
266	000671	阳光城	28,600	181,324.00	0.07
267	600482	中国动力	11,402	179,011.40	0.07
268	000627	天茂集团	34,300	178,703.00	0.07
269	601992	金隅集团	57,800	176,868.00	0.06
270	600583	海油工程	38,232	173,955.60	0.06
271	600977	中国电影	13,201	173,329.13	0.06

272	002468	申通快递	10,500	172,305.00	0.06
273	601633	长城汽车	21,080	162,737.60	0.06
274	000709	河钢股份	73,575	150,093.00	0.06
275	601216	君正集团	58,308	148,102.32	0.05
276	601916	浙商银行	37,300	146,962.00	0.05
277	601238	广汽集团	16,240	146,160.00	0.05
278	601577	长沙银行	17,800	141,332.00	0.05
279	601808	中海油服	10,600	139,284.00	0.05
280	601236	红塔证券	7,100	137,740.00	0.05
281	600188	兖州煤业	15,544	136,165.44	0.05
282	600398	海澜之家	23,100	134,442.00	0.05
283	000723	美锦能源	21,400	133,964.00	0.05
284	601698	中国卫通	7,100	127,871.00	0.05
285	600372	中航电子	9,462	126,033.84	0.05
286	601898	中煤能源	31,700	120,460.00	0.04
287	600928	西安银行	22,900	120,454.00	0.04
288	600989	宝丰能源	14,200	119,564.00	0.04
289	600025	华能水电	31,300	118,627.00	0.04
290	000708	中信特钢	6,200	105,958.00	0.04
291	601077	渝农商行	19,800	93,456.00	0.03
292	600968	海油发展	35,400	82,482.00	0.03
293	601828	美凯龙	7,100	75,189.00	0.03
294	603260	合盛硅业	2,580	70,537.20	0.03
295	601298	青岛港	12,200	69,296.00	0.03
296	002945	华林证券	4,800	66,288.00	0.02
297	601212	白银有色	25,700	65,535.00	0.02
298	600299	安迪苏	5,000	61,100.00	0.02

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	15,358	638,892.80	0.23
2	688278	特宝生物	8,002	540,935.20	0.20
3	688080	映翰通	2,233	193,623.43	0.07
4	688568	中科星图	9,642	156,296.82	0.06
5	688377	迪威尔	7,406	121,606.52	0.04
6	688078	龙软科技	2,811	115,813.20	0.04
7	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.03

8	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.03
9	603087	甘李药业	596	59,778.80	0.02
10	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
11	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
12	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
13	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
14	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
15	600566	济川药业	300	7,638.00	0.00
16	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
17	300024	机器人	518	7,081.06	0.00
18	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
19	600100	同方股份	953	6,947.37	0.00
20	300842	帝科股份	155	6,311.60	0.00
21	002294	信立泰	200	5,932.00	0.00
22	600663	陆家嘴	500	5,605.00	0.00
23	600535	天士力	320	5,190.40	0.00
24	300070	碧水源	607	4,928.84	0.00
25	000630	铜陵有色	2,550	4,921.50	0.00
26	600023	浙能电力	1,338	4,696.38	0.00
27	000413	东旭光电	1,592	4,250.64	0.00
28	002081	金螳螂	540	4,244.40	0.00
29	000423	东阿阿胶	117	4,189.77	0.00
30	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
31	300017	网宿科技	423	3,591.27	0.00
32	600153	建发股份	421	3,410.10	0.00
33	002010	传化智联	600	3,264.00	0.00
34	600733	北汽蓝谷	500	3,215.00	0.00
35	688299	长阳科技	100	2,869.00	0.00
36	002411	延安必康	400	2,704.00	0.00
37	000629	攀钢钒钛	1,208	2,428.08	0.00
38	300296	利亚德	400	2,428.00	0.00
39	002065	东华软件	182	2,278.64	0.00
40	000898	鞍钢股份	860	2,107.00	0.00
41	000415	渤海租赁	700	2,086.00	0.00
42	601228	广州港	600	1,824.00	0.00
43	600704	物产中大	350	1,473.50	0.00
44	600688	上海石化	298	1,037.04	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	6,996,571.40	3.18
2	600519	贵州茅台	4,385,228.25	1.99
3	600276	恒瑞医药	2,410,523.00	1.10
4	000651	格力电器	2,403,664.00	1.09
5	601166	兴业银行	2,342,350.00	1.06
6	000333	美的集团	2,271,568.00	1.03
7	000858	五粮液	2,169,100.40	0.99
8	601398	工商银行	1,968,681.00	0.89
9	000001	平安银行	1,958,367.36	0.89
10	000002	万科A	1,955,485.00	0.89
11	600900	长江电力	1,853,396.00	0.84
12	600030	中信证券	1,602,471.00	0.73
13	600887	伊利股份	1,502,342.00	0.68
14	002475	立讯精密	1,497,684.04	0.68
15	603259	药明康德	1,336,344.00	0.61
16	600016	民生银行	1,233,498.00	0.56
17	601328	交通银行	1,232,976.00	0.56
18	601688	华泰证券	1,210,872.00	0.55
19	601288	农业银行	1,137,931.00	0.52
20	600585	海螺水泥	1,117,699.00	0.51

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	5,428,999.00	2.47
2	601166	兴业银行	3,036,859.00	1.38
3	600519	贵州茅台	2,739,467.00	1.25
4	000651	格力电器	1,830,016.00	0.83
5	600276	恒瑞医药	1,785,390.00	0.81
6	000333	美的集团	1,697,108.00	0.77
7	000858	五粮液	1,590,016.56	0.72

8	601288	农业银行	1,415,644.00	0.64
9	000001	平安银行	1,302,398.00	0.59
10	600016	民生银行	1,284,400.00	0.58
11	002475	立讯精密	1,229,322.00	0.56
12	600887	伊利股份	1,193,553.00	0.54
13	600030	中信证券	1,024,911.00	0.47
14	601328	交通银行	949,372.00	0.43
15	600900	长江电力	942,774.00	0.43
16	600000	浦发银行	849,353.00	0.39
17	601601	中国太保	806,580.00	0.37
18	688588	凌志软件	803,380.50	0.37
19	000002	万科A	793,810.00	0.36
20	601398	工商银行	791,383.00	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	139,112,731.98
卖出股票收入（成交）总额	106,860,194.25

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）	32,800.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	32,800.00	0.01

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	328	32,800.00	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

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投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	30,366.30
2	应收证券清算款	5,969,618.70
3	应收股利	-
4	应收利息	1,710.69
5	应收申购款	1,509,432.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,511,128.37

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	638,892.80	0.23	新股流通受限
2	688278	特宝生物	540,935.20	0.20	新股流通受限
3	688080	映翰通	193,623.43	0.07	新股流通受限
4	688568	中科星图	156,296.82	0.06	新股未上市
5	688377	迪威尔	121,606.52	0.04	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,950	40,586.03	130,470,482.83	64.94%	70,430,348.50	35.06%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	吴浙闽	405,758.00	10.60%
2	倪俊	350,000.00	9.14%
3	刘小云	329,888.00	8.62%
4	邱贤奕	195,600.00	5.11%
5	杨凯	117,749.00	3.08%
6	曾素春	100,100.00	2.62%
7	林树瀚	74,633.00	1.95%
8	邱贤奕	70,500.00	1.84%
9	陈雄	63,523.00	1.66%
10	缪晏	60,000.00	1.57%

注：持有人为场内持有人。

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	590,158.59	0.2938%

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 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（2010年8月4日）基金份额总额	898,915,869.33
本报告期期初基金份额总额	155,672,961.69
本报告期基金总申购份额	120,130,970.19
减:本报告期基金总赎回份额	74,903,100.55
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	200,900,831.33

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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	
国元证券	1	155,292,885.36	64.84%	144,621.94	64.84%	-
招商证券	1	84,198,555.59	35.16%	78,415.89	35.16%	-

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
国元证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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 23 日
2	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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 19 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	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
4	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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
5	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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
6	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
7	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (lof) 招募说明书 (摘要)	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 16 日
8	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (lof) 招募说明书 (更新)	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 16 日
9	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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 2 月 11 日
10	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (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	20200302~20200305、 20200605~20200630	27,215,396.58	16,566,040.53	0.00	43,781,437.11	21.79%
	2	20200101~20200301	39,871,610.85	0.00	39,871,610.85	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（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