

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 9 |
| §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..... | 13 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 15 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 16 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 16 |
| §6 审计报告 | 17 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 17 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 17 |
| §7 年度财务报表 | 20 |
| 7.1 资产负债表..... | 20 |
| 7.2 利润表..... | 21 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 22 |
| 7.4 报表附注..... | 23 |
| §8 投资组合报告 | 50 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 50 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 50 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 52 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 61 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 63 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 63 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 64 |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 64 |

| | |
|---|-----------|
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 64 |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 | 64 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 64 |
| 8.12 投资组合报告附注 | 64 |
| §9 基金份额持有人信息 | 66 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 66 |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 | 66 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 66 |
| 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 | 66 |
| §10 开放式基金份额变动 | 67 |
| §11 重大事件揭示 | 68 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 | 68 |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 68 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 68 |
| 11.4 基金投资策略的改变 | 68 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 68 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 68 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 68 |
| 11.8 其他重大事件 | 70 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 | 72 |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 | 72 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 72 |
| §13 备查文件目录 | 73 |
| 13.1 备查文件目录 | 73 |
| 13.2 存放地点 | 73 |
| 13.3 查阅方式 | 73 |

§ 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 | 220,620,424.75 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%，以实现对标指数的有效跟踪。 |
| 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 | | 深圳市福田区中心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 | 缪建民 |

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》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.csfunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的办公地址 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------------|-------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2020 年 | 2019 年 | 2018 年 |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期已实现收益 | 50,156,894.27 | 7,975,743.95 | 1,626,204.63 |
| 本期利润 | 112,011,115.81 | 33,075,769.88 | -10,739,705.63 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.5950 | 0.4040 | -0.2795 |
| 本期加权平均净值利润率 | 39.74% | 31.18% | -23.54% |
| 本期基金份额净值增长率 | 43.84% | 38.53% | -22.43% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2020 年末 | 2019 年末 | 2018 年末 |
| 期末可供分配利润 | 146,846,072.53 | 64,336,088.86 | 784,915.58 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6656 | 0.4133 | 0.0196 |
| 期末基金资产净值 | 367,466,497.28 | 220,009,050.55 | 40,872,962.77 |
| 期末基金份额净值 | 1.666 | 1.413 | 1.020 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2020 年末 | 2019 年末 | 2018 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 113.46% | 48.40% | 7.13% |

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 14.90% | 0.94% | 12.92% | 0.94% | 1.98% | 0.00% |
| 过去六个月 | 33.98% | 1.24% | 23.87% | 1.28% | 10.11% | -0.04% |
| 过去一年 | 43.84% | 1.33% | 25.94% | 1.36% | 17.90% | -0.03% |
| 过去三年 | 54.56% | 1.24% | 28.33% | 1.28% | 26.23% | -0.04% |
| 过去五年 | 64.58% | 1.18% | 38.51% | 1.18% | 26.07% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 113.46% | 1.39% | 80.82% | 1.37% | 32.64% | 0.02% |

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累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

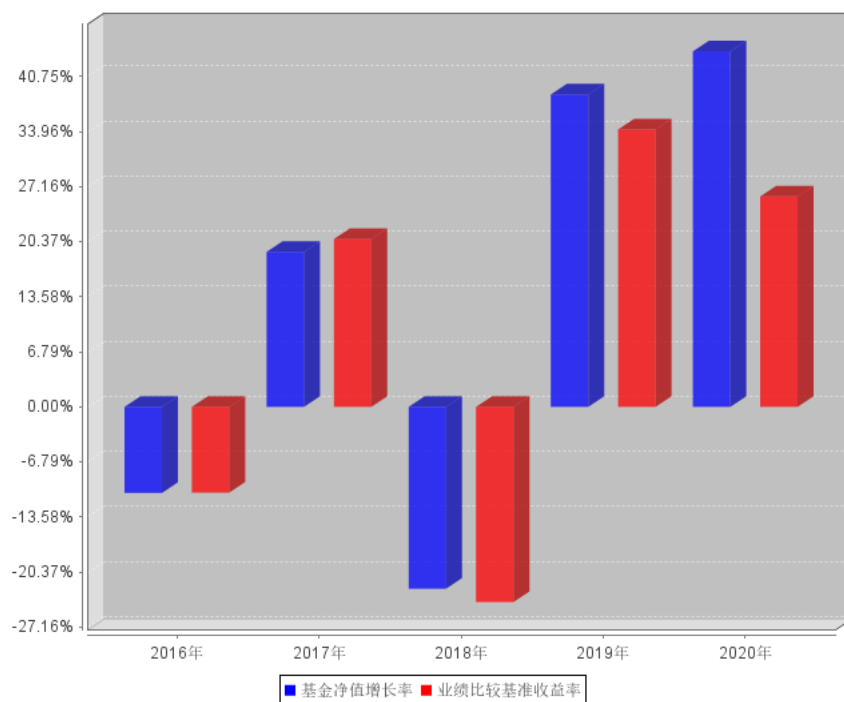
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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。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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 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 | 年度利润分配合 计 | 备注 |
|------|-----------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2020 | 2.9960 | 30,755,033.12 | 26,785,596.22 | 57,540,629.34 | |
| 2019 | - | - | - | - | |
| 2018 | - | - | - | - | |
| 合计 | 2.9960 | 30,755,033.12 | 26,785,596.22 | 57,540,629.34 | |

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金总部办公地位于北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，并拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格。截至 2020 年 12 月 31 日，基金管理人共管理六十六只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈亘斯 | 本基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证金融地产指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛上证 50 指数证券投资基金 (LOF) 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

注：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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公司公平交易细则》，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。具体如下：

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司对管理的不同投资组合过去 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原则及利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年以社会融资为代表的流动性前高后低，但总体仍然显著高于历史平均水平，而在以 PPI 为代表的实体经济则呈现前低后高，但其总体水平呈逐年下降的趋势。年初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，而在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。但国外疫情始终未得到有效控制，进入三季度又出现二次爆发形势，疫苗的大规模使用落后于计划进度，使得海外大部分国家的产能利用率始终受到抑制，而欧美日等发达国家的超大规模的货币释放或直接财政刺激又使得可贸易部门的商品需求维持在较高水平，而非可贸易部门的服务需求始终低迷。国内由于货币和财政政策的快速应对，使得经济在二季度逐步有效恢复，受益于供需两头国内循环以及补充海外产能缺口的行业逐步显现出超额收益。大科技、大消费、顺周期板块从年初到年末依次轮动。受国内外充裕的流动性和低利率水平影响，A 股市场的风险溢价由高位逐步回落，市场估值得到有效提升，尤其对于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，但部分板块估值已处于历史高位。成长因子、财务质量因子的超额收益贯穿全年，也是我们配置组合的长期偏好。由于机构投资者的资金占比今年大幅提升，市值因子由年初偏向中小盘转为年末高度偏向大市值，风格切换较剧烈。

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 1.666 元；本报告期基金份额净值增长率为 43.84%，业绩比较基准收益率为 25.94%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0544%，年度化跟踪误差为 1.9591%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着年末全球主要大国的新冠疫苗研发和生产的快速推进，以及疫苗分发和注射的速度进一步提升，全球主要国家的经济活动有望在二季度之后得到显著修复。尤其是美国新政府对于积极处理国内疫情和修复产能拉动经济的政策的转向，使得全球经济复苏前景转好。对于 A 股而言，国内外两方面的经济形势向好的预期使得人民币和美元的利率曲线变得陡峭化。此外大宗商品自 2020 年下半年普涨，通胀预期显著上升，中美两国的债券利差可能进一步收窄，使得离岸和在岸流动性可能在二季度以后边际上收紧。因此股市的估值继续提升的空间不大，甚至存在反转的可能性，对于已处于高估值的板块和行业形成相当压力，更需要关注上市公司的估值是否与业绩增长速度相匹配以及业绩增长的现金流质地和其可持续性，尤其是金融板块在 2020 年的利润压缩要求释放后，目前的低估值匹配合适的增速值得关注。价值因子、PEG 因子在 2021 年有望获得市场重新认可和定价。对于市场较有利的一面是美国新政府上任后短期更关注解决其本土问题，中美关系有望缓和，叠加 RCEP 和中欧 BIT 的签订，对于中国的对外贸易和投资环境有所改善。能充分利用好海外市场扩张机会的上市公司有可能带来持续的业绩改善并形成自我的护城河，这一板块值得重点关注。另外 A 股上市公司能扎实自主研发、做好国产替代，本质上也是通过技术和产品实力与海外企业在中国市场竞争，同样有望获得业绩支撑。总体而言，值得投资的优质公司需要具有参与到国内和国外其中至少一个市场和全球化对手同台竞技的竞争力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

1、加强合规宣导与培训，持续推动公司合规文化建设。报告期内，监察稽核部通过外请专业机构、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种形式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，及时组织学习法律法规与监管文件，深化员工合规理念，提升员工合规工作技能。

2、持续完善公司制度规章体系建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时督促、提示业务部门进行相关制度、流程的新订、修订与完善，保证公司制度规章的合法合规、

全面、适时、有效。报告期内，公司除完成有关制度的新订、修订工作外，还要求业务部门就制度、流程变化内容与其他相关执行部门进行沟通，确保各相关部门对新订、修订内容的理解保持一致，保证制度、流程被严格执行。

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

4、加强专项稽核与检查力度，完善发现问题与改进情况的跟踪、落实机制，保障公司运营及受托资产投资运作合规。报告期内，公司监察稽核部开展定期、临时专项稽核，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、产品开发、员工行为等。此外，根据业务发展需要、监管机构通报的业内问题，以及公司在日常监督中发现的问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，合理保障公司及受托资产合规、稳健运作。

5、参与新产品设计、新业务、新流程的合规论证工作，提供合规意见或建议，确保依法依规开展相关业务。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7.1 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，本基金分别于 2020 年 1 月 20 日、2020 年 6 月 29 日、2020 年 12 月 25 日进行了利润分配，分配金额共为 57,540,629.34 元。

期末可供分配利润为 146,846,072.53 元，其中：未分配利润已实现部分为 173,523,499.92 元，未分配利润未实现部分为-26,677,427.39 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

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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2021)第 21385 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|-----------------|---|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“长盛沪深 300 指数基金(LOF)”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了长盛沪深 300 指数基金(LOF)2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于长盛沪深 300 指数基金(LOF),并履行了职业道德方面的其他责任。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>长盛沪深 300 指数基金(LOF)的基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估长盛沪深 300 指数基金(LOF)的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算长盛沪深</p> |

| | |
|------------------------|---|
| | <p>300 指数基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长盛沪深 300 指数基金(LOF)的财务报告过程。</p> |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长盛沪深 300 指数基金(LOF)持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛沪深 300 指数基金(LOF)不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> |

| | | |
|-----------|---|-----|
| | 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 | |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | |
| 注册会计师的姓名 | 张勇 | 叶尔甸 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 · 上海市 | |
| 审计报告日期 | 2021 年 3 月 26 日 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2020 年 12 月 31 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 21,384,229.50 | 17,098,595.40 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | 42,665.10 | 51,931.32 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 348,126,629.99 | 203,357,242.22 |
| 其中：股票投资 | | 347,863,629.99 | 203,357,242.22 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 263,000.00 | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 247,695.92 | - |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 2,326.34 | 3,726.15 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 2,382,824.58 | 167,480.50 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 372,186,371.43 | 220,678,975.59 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020 年 12 月 31 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 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 4,186,594.19 | 373,206.42 |
| 应付管理人报酬 | | 227,666.86 | 135,431.98 |
| 应付托管费 | | 45,533.35 | 27,086.40 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 64,928.76 | 23,433.73 |
| 应交税费 | | 1.21 | - |
| 应付利息 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 195,149.78 | 110,766.51 |
| 负债合计 | | 4,719,874.15 | 669,925.04 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 220,620,424.75 | 155,672,961.69 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 146,846,072.53 | 64,336,088.86 |
| 所有者权益合计 | | 367,466,497.28 | 220,009,050.55 |
| 负债和所有者权益总计 | | 372,186,371.43 | 220,678,975.59 |

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.666 元，基金份额总额 220,620,424.75 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|------------|---|--|
| 一、收入 | | 115,475,579.50 | 34,481,922.92 |
| 1.利息收入 | | 86,493.04 | 69,438.40 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 86,369.98 | 69,438.40 |
| 债券利息收入 | | 123.06 | - |
| 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） | | 53,160,369.85 | 9,233,210.34 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 47,597,177.39 | 7,931,645.22 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 152,661.88 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 5,410,530.58 | 1,301,565.12 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | 61,854,221.54 | 25,100,025.93 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.18 | 374,495.07 | 79,248.25 |
| 减：二、费用 | | 3,464,463.69 | 1,406,153.04 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 2,099,531.79 | 795,898.66 |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------|---------------|
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 419,906.34 | 159,179.75 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 694,491.33 | 274,994.07 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 0.40 | - |
| 7. 其他费用 | 7.4.7.20 | 250,533.83 | 176,080.56 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 112,011,115.81 | 33,075,769.88 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 112,011,115.81 | 33,075,769.88 |

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 | | |
|--|---|----------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 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） | - | 112,011,115.81 | 112,011,115.81 |
| 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） | 64,947,463.06 | 28,039,497.20 | 92,986,960.26 |
| 其中：1. 基金申购款 | 232,930,771.78 | 107,867,759.04 | 340,798,530.82 |
| 2. 基金赎回款 | -167,983,308.72 | -79,828,261.84 | -247,811,570.56 |
| 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） | - | -57,540,629.34 | -57,540,629.34 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 220,620,424.75 | 146,846,072.53 | 367,466,497.28 |
| 项目 | 上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |

| | | | |
|--|----------------|----------------|----------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 40,088,047.19 | 784,915.58 | 40,872,962.77 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 33,075,769.88 | 33,075,769.88 |
| 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) | 115,584,914.50 | 30,475,403.40 | 146,060,317.90 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 169,567,634.98 | 42,418,027.84 | 211,985,662.82 |
| 2. 基金赎回款 | -53,982,720.48 | -11,942,624.44 | -65,925,344.92 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 155,672,961.69 | 64,336,088.86 | 220,009,050.55 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

| | | |
|----------|-----------|---------|
| _____ | _____ | _____ |
| 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 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)(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”)证监基金字[2010]第 646 号《关于核准长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》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《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)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 898,648,405.80 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 193 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2010 年 8 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 898,915,869.33 份,其中认购资金利息折合 267,463.53 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：沪深 300 指数收益率 \times 95%+一年期银行定期存款利率(税后) \times 5%。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。

7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费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。

7.4.4.11 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，其中场外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，场内基金份额持有人只能选择现金分红。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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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)》(以下简称“指引”)，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中债金融估值中心有限公司根据指引所独立提供的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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 12 月 31 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 21,384,229.50 | 17,098,595.40 |
| 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： | 21,384,229.50 | 17,098,595.40 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 12 月 31 日 | | |
|---------------|--------------------------|----------------|---------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 266,675,504.52 | 347,863,629.99 | 81,188,125.47 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 263,000.00 | 263,000.00 |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | 263,000.00 | 263,000.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 266,938,504.52 | 348,126,629.99 | 81,188,125.47 |
| 项目 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 | | |
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 184,023,338.29 | 203,357,242.22 | 19,333,903.93 |
| 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 | 184,023,338.29 | 203,357,242.22 | 19,333,903.93 |
|----|----------------|----------------|---------------|

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年12月31日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 2,285.45 | 3,700.41 |
| 应收定期存款利息 | - | - |
| 应收其他存款利息 | - | - |
| 应收结算备付金利息 | - | - |
| 应收债券利息 | 19.77 | - |
| 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 | 21.12 | 25.74 |
| 合计 | 2,326.34 | 3,726.15 |

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年12月31日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 64,928.76 | 23,433.73 |
| 银行间市场应付交易费用 | - | - |
| 合计 | 64,928.76 | 23,433.73 |

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 12 月 31 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | 15,149.78 | 766.51 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 预提费用 | 180,000.00 | 110,000.00 |
| 合计 | 195,149.78 | 110,766.51 |

7.4.7.9 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 12 月 31 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 | 232,930,771.78 | 232,930,771.78 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -167,983,308.72 | -167,983,308.72 |
| - 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 | 220,620,424.75 | 220,620,424.75 |

注：1. 申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

2. 截至 2020 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 1,971,903.00 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 218,648,521.75 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。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 129,061,203.98 | -64,725,115.12 | 64,336,088.86 |
| 本期利润 | 50,156,894.27 | 61,854,221.54 | 112,011,115.81 |
| 本期基金份额交易 | 51,846,031.01 | -23,806,533.81 | 28,039,497.20 |

| | | | |
|----------|-----------------|----------------|----------------|
| 产生的变动数 | | | |
| 其中：基金申购款 | 189,242,227.69 | -81,374,468.65 | 107,867,759.04 |
| 基金赎回款 | -137,396,196.68 | 57,567,934.84 | -79,828,261.84 |
| 本期已分配利润 | -57,540,629.34 | - | -57,540,629.34 |
| 本期末 | 173,523,499.92 | -26,677,427.39 | 146,846,072.53 |

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 活期存款利息收入 | 83,367.69 | 66,519.22 |
| 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 | 2,297.12 | 2,563.75 |
| 其他 | 705.17 | 355.43 |
| 合计 | 86,369.98 | 69,438.40 |

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 卖出股票成交总额 | 199,694,454.66 | 38,798,870.00 |
| 减：卖出股票成本总额 | 152,097,277.27 | 30,867,224.78 |
| 买卖股票差价收入 | 47,597,177.39 | 7,931,645.22 |

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 152,661.88 | - |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - | - |
| 合计 | 152,661.88 | - |

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日 至2020年12月31日 | 上年度可 比期间 2019年1月 1日至2019年12 月31日 |
|-------------------------|---------------------------------|--|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 701,168.50 | - |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 548,400.00 | - |
| 减：应收利息总额 | 106.62 | - |
| 买卖债券差价收入 | 152,661.88 | - |

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年12 月31日 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日 |
|---------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 5,410,530.58 | 1,301,565.12 |
| 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 | 5,410,530.58 | 1,301,565.12 |

7.4.7.17 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12月31日 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 61,854,221.54 | 25,100,025.93 |
| ——股票投资 | 61,854,221.54 | 25,100,025.93 |
| ——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 | 61,854,221.54 | 25,100,025.93 |

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 359,274.72 | 79,186.03 |
| 基金转换费收入 | 15,220.35 | 62.22 |
| 合计 | 374,495.07 | 79,248.25 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
| | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 694,491.33 | 274,994.07 |
| 银行间市场交易费用 | - | - |
| 合计 | 694,491.33 | 274,994.07 |

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 审计费用 | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 50,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |

| | | |
|--------|------------|------------|
| 银行划款手续 | 10,533.83 | 6,080.56 |
| 上市年费 | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 合计 | 250,533.83 | 176,080.56 |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|-----------------|
| 长盛基金管理有限公司（“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 |
| 新加坡星展银行有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 安徽省信用担保集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 安徽省投资集团控股有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 长盛创富资产管理有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |
| 长盛基金（香港）有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020年1月1日至2020年12月31日 | | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 |
| 国元证券 | 265,628,854.77 | 64.47% | 141,748,102.96 | 69.98% |

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020年1月1日至2020年12月31日 | | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
| | 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 成交总额的 比例 |
| 国元证券 | 496,071.80 | 70.75% | - | - |

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 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1月1日至2020年12月31日 | | | |
|-------|----------------------------------|----------------|-----------|------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 国元证券 | 247,374.69 | 64.46% | 38,243.00 | 58.90% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 国元证券 | 132,002.48 | 69.98% | 18,458.36 | 78.77% |

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。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年12月31日 | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日 |
|----|-----------------------------|----------------------------------|
| | | |

| | | |
|-----------------|--------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,099,531.79 | 795,898.66 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 252,026.45 | 176,094.86 |

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 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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.75%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 419,906.34 | 159,179.75 |

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2020年1月1日至2020年12月31日 | 2019年1月1日至2019年12月31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 | 7,685,626.44 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | - |

注: 1. 期间申购/买入总份额含转换入份额, 期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 基金管理人长盛基金公司在本年度申购/赎回本基金的交易委托长盛直销中心办理, 交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

| 关联方名称 | 本期 2020年1月1日至2020年12月31日 | | 上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|-----------|----------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行 | 21,384,229.50 | 83,367.69 | 17,098,595.40 | 66,519.22 |

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

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12月25日 | 2020年12月28日 | 2020年12月25日 | 1.4300 | 17,060,487.82 | 13,353,860.79 | 30,414,348.61 | |
| 2 | 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 | |
| 3 | 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 | - | - | 2.9960 | 30,755,033.12 | 26,785,596.22 | 57,540,629.34 | |
|----|---|---|--------|---------------|---------------|---------------|--|

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-------------|------------|--------|--------|--------|--------------|------------|--------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 600919 | 江苏银行 | 2020年12月17日 | 2021年1月14日 | 配股未上市 | 4.59 | 5.46 | 53,670 | 246,345.30 | 293,038.20 | - |
| 688617 | 惠泰医疗 | 2020年12月30日 | 2021年1月7日 | 新股未上市 | 74.46 | 74.46 | 1,372 | 102,159.12 | 102,159.12 | - |
| 300926 | 博俊科技 | 2020年12月29日 | 2021年1月7日 | 新股未上市 | 10.76 | 10.76 | 3,225 | 34,701.00 | 34,701.00 | - |
| 300927 | 江天化学 | 2020年12月29日 | 2021年1月7日 | 新股未上市 | 13.39 | 13.39 | 1,946 | 26,056.94 | 26,056.94 | - |
| 605277 | 新亚电子 | 2020年12月25日 | 2021年1月6日 | 新股未上市 | 16.95 | 16.95 | 507 | 8,593.65 | 8,593.65 | - |
| 003030 | 祖名股份 | 2020年12月25日 | 2021年1月6日 | 新股未上市 | 15.18 | 15.18 | 480 | 7,286.40 | 7,286.40 | - |
| 003031 | 中瓷电子 | 2020年12月24日 | 2021年1月4日 | 新股未上市 | 15.27 | 15.27 | 387 | 5,909.49 | 5,909.49 | - |
| 601995 | 中金公司 | 2020年10月22日 | 2021年5月6日 | 限售期锁定 | 28.78 | 70.41 | 24,951 | 718,089.78 | 1,756,799.91 | - |
| 688050 | 爱博医疗 | 2020年7月22日 | 2021年1月29日 | 限售期锁定 | 33.55 | 168.51 | 3,520 | 118,096.00 | 593,155.20 | - |
| 688686 | 奥普特 | 2020年12月24日 | 2021年6月30日 | 限售期锁定 | 78.49 | 206.10 | 1,515 | 118,912.35 | 312,241.50 | - |
| 688301 | 奕瑞科技 | 2020年9月9日 | 2021年3月18日 | 限售期锁定 | 119.60 | 162.70 | 1,262 | 150,935.20 | 205,327.40 | - |
| 300999 | 金龙鱼 | 2020年9月29日 | 2021年4月15日 | 限售期锁定 | 25.70 | 98.81 | 1,742 | 44,769.40 | 172,127.02 | - |
| 688579 | 山大地纬 | 2020年7月8日 | 2021年1月18日 | 限售期锁定 | 8.12 | 14.37 | 9,617 | 78,090.04 | 138,196.29 | - |
| 688336 | 三生国健 | 2020年7月15日 | 2021年1月22日 | 限售期锁定 | 28.18 | 24.28 | 5,679 | 160,034.22 | 137,886.12 | - |
| 688528 | 秦川物联 | 2020年6月19日 | 2021年1月4日 | 限售期锁定 | 11.33 | 16.29 | 8,337 | 94,458.21 | 135,809.73 | - |
| 688668 | 鼎通 | 2020年12月 | 2021年6月 | 限售期 | 20.07 | 28.16 | 3,037 | 60,952.59 | 85,521.92 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------|-----------------|-----------|--------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| | 科技 | 月 11 日 | 月 21 日 | 锁定 | | | | | | |
| 300896 | 爱美客 | 2020 年 9 月 21 日 | 2021 年 3 月 29 日 | 限售期 锁定 | 118.27 | 603.96 | 128 | 15,138.56 | 77,306.88 | - |
| 688056 | 莱伯泰科 | 2020 年 8 月 25 日 | 2021 年 3 月 2 日 | 限售期 锁定 | 24.80 | 30.54 | 2,010 | 49,848.00 | 61,385.40 | - |
| 300894 | 火星 | 2020 年 12 月 24 日 | 2021 年 6 月 30 日 | 限售期 锁定 | 14.07 | 46.91 | 628 | 8,835.96 | 29,459.48 | - |
| 300919 | 中伟股份 | 2020 年 12 月 15 日 | 2021 年 6 月 23 日 | 限售期 锁定 | 24.60 | 77.12 | 354 | 8,708.40 | 27,300.48 | - |
| 300861 | 美畅股份 | 2020 年 8 月 6 日 | 2021 年 2 月 24 日 | 限售期 锁定 | 43.76 | 51.08 | 424 | 18,554.24 | 21,657.92 | - |
| 300908 | 仲景食品 | 2020 年 11 月 13 日 | 2021 年 5 月 24 日 | 限售期 锁定 | 39.74 | 73.81 | 285 | 11,325.90 | 21,035.85 | - |
| 300898 | 熊猫乳品 | 2020 年 10 月 9 日 | 2021 年 4 月 16 日 | 限售期 锁定 | 10.78 | 41.18 | 496 | 5,346.88 | 20,425.28 | - |
| 300909 | 汇创达 | 2020 年 11 月 11 日 | 2021 年 5 月 18 日 | 限售期 锁定 | 29.57 | 50.16 | 386 | 11,414.02 | 19,361.76 | - |
| 300910 | 瑞丰新材 | 2020 年 11 月 20 日 | 2021 年 5 月 27 日 | 限售期 锁定 | 30.26 | 59.62 | 316 | 9,562.16 | 18,839.92 | - |
| 300891 | 惠云钛业 | 2020 年 9 月 10 日 | 2021 年 3 月 17 日 | 限售期 锁定 | 3.64 | 16.40 | 1,143 | 4,160.52 | 18,745.20 | - |
| 300902 | 国安达 | 2020 年 10 月 22 日 | 2021 年 4 月 29 日 | 限售期 锁定 | 15.38 | 30.82 | 551 | 8,474.38 | 16,981.82 | - |
| 300907 | 康平科技 | 2020 年 11 月 11 日 | 2021 年 5 月 18 日 | 限售期 锁定 | 14.30 | 34.55 | 473 | 6,763.90 | 16,342.15 | - |
| 300925 | 法本信息 | 2020 年 12 月 21 日 | 2021 年 6 月 30 日 | 限售期 锁定 | 20.08 | 44.69 | 353 | 7,088.24 | 15,775.57 | - |
| 300887 | 谱尼测试 | 2020 年 9 月 9 日 | 2021 年 3 月 16 日 | 限售期 锁定 | 44.47 | 74.49 | 210 | 9,338.70 | 15,642.90 | - |
| 300884 | 狄耐克 | 2020 年 11 月 5 日 | 2021 年 5 月 12 日 | 限售期 锁定 | 24.87 | 41.46 | 369 | 9,177.03 | 15,298.74 | - |
| 300864 | 南大环境 | 2020 年 8 月 13 日 | 2021 年 2 月 25 日 | 限售期 锁定 | 71.71 | 90.83 | 166 | 11,903.86 | 15,077.78 | - |
| 300889 | 爱克股份 | 2020 年 9 月 9 日 | 2021 年 3 月 16 日 | 限售期 锁定 | 27.97 | 30.12 | 479 | 13,397.63 | 14,427.48 | - |
| 300890 | 翔丰华 | 2020 年 9 月 10 日 | 2021 年 3 月 18 日 | 限售期 锁定 | 14.69 | 48.84 | 286 | 4,201.34 | 13,968.24 | - |
| 300895 | 铜牛信息 | 2020 年 9 月 17 日 | 2021 年 3 月 24 日 | 限售期 锁定 | 12.65 | 45.30 | 283 | 3,579.95 | 12,819.90 | - |
| 300879 | 大叶股份 | 2020 年 8 月 25 日 | 2021 年 3 月 1 日 | 限售期 锁定 | 10.58 | 27.14 | 466 | 4,930.28 | 12,647.24 | - |
| 300911 | 亿田智能 | 2020 年 11 月 24 日 | 2021 年 6 月 3 日 | 限售期 锁定 | 24.35 | 39.32 | 309 | 7,524.15 | 12,149.88 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|------------|-------|-------|-------|-------|----------|-----------|---|
| 300918 | 南山智尚 | 2020年12月15日 | 2021年6月22日 | 限售期锁定 | 4.97 | 11.20 | 1,063 | 5,283.11 | 11,905.60 | - |
| 300882 | 万胜智能 | 2020年8月27日 | 2021年3月10日 | 限售期锁定 | 10.33 | 25.79 | 440 | 4,545.20 | 11,347.60 | - |
| 300922 | 天秦装备 | 2020年12月18日 | 2021年6月25日 | 限售期锁定 | 16.05 | 36.78 | 287 | 4,606.35 | 10,555.86 | - |
| 300917 | 特发服务 | 2020年12月14日 | 2021年6月21日 | 限售期锁定 | 18.78 | 36.25 | 281 | 5,277.18 | 10,186.25 | - |
| 300893 | 松原股份 | 2020年9月17日 | 2021年3月24日 | 限售期锁定 | 13.47 | 35.08 | 276 | 3,717.72 | 9,682.08 | - |
| 300881 | 盛德鑫泰 | 2020年8月25日 | 2021年3月5日 | 限售期锁定 | 14.17 | 32.30 | 291 | 4,123.47 | 9,399.30 | - |
| 300926 | 博俊科技 | 2020年12月29日 | 2021年7月7日 | 限售期锁定 | 10.76 | 10.76 | 359 | 3,862.84 | 3,862.84 | - |
| 300927 | 江天化学 | 2020年12月29日 | 2021年7月7日 | 限售期锁定 | 13.39 | 13.39 | 217 | 2,905.63 | 2,905.63 | - |

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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

| 7.4.12.1.2 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 |
| 113044 | 大秦转债 | 2020年12月15日 | 2021年1月15日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 2,470 | 247,000.00 | 247,000.00 | - |
| 113616 | 韦尔转债 | 2020年12月29日 | 2021年1月22日 | 新债未上市 | 100.00 | 100.00 | 160 | 16,000.00 | 16,000.00 | - |

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管人招商银行，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 12 月 31 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 0.07% (2019 年 12 月 31 日：本基金无债券投资)。

7.4.13.3 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 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发

行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持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 7.4.12。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 12 月 31 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 12 月 31 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。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2020 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 | 21,384,229.50 | - | - | - | 21,384,229.50 |
| 存出保证金 | 42,665.10 | - | - | - | 42,665.10 |
| 交易性金融资产 | - | - | 263,000.00 | 347,863,629.99 | 348,126,629.99 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 247,695.92 | 247,695.92 |
| 应收利息 | - | - | - | 2,326.34 | 2,326.34 |
| 应收申购款 | - | - | - | 2,382,824.58 | 2,382,824.58 |
| 资产总计 | 21,426,894.60 | - | 263,000.00 | 350,496,476.83 | 372,186,371.43 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 4,186,594.19 | 4,186,594.19 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 227,666.86 | 227,666.86 |
| 应付托管费 | - | - | - | 45,533.35 | 45,533.35 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 64,928.76 | 64,928.76 |
| 应交税费 | - | - | - | 1.21 | 1.21 |
| 其他负债 | - | - | - | 195,149.78 | 195,149.78 |
| 负债总计 | - | - | - | 4,719,874.15 | 4,719,874.15 |
| 利率敏感度缺口 | 21,426,894.60 | - | 263,000.00 | 345,776,602.68 | 367,466,497.28 |
| 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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.07%（2019 年 12 月 31 日：未持有交易性债券投资），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 12 月 31 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 | 347,863,629.99 | 94.67 | 203,357,242.22 | 92.43 |
| 合计 | 347,863,629.99 | 94.67 | 203,357,242.22 | 92.43 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准（附注 7.4.1）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 12 月 31 日） | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |

| | | |
|--------------------------|----------------|----------------|
| 1. 业绩比较基准（附注 7.4.1）上升 5% | 17,922,753.98 | 10,730,138.41 |
| 2. 业绩比较基准（附注 7.4.1）下降 5% | -17,922,753.98 | -10,730,138.41 |

7.4.14 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 12 月 31 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 343,302,325.07 元，属于第二层次的余额为 4,824,304.92 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 201,864,190.53 元，第二层次 1,493,051.69 元，无第三层次)。

(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

2020 年度：无。

2019 年度：

| | | | |
|--|--------|--------|--|
| 交易性金融资产 | 合计 | | |
| <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%; text-align: center;">债券投资</td> <td style="width: 50%; text-align: center;">权益工具投资</td> </tr> </table> | 债券投资 | 权益工具投资 | |
| 债券投资 | 权益工具投资 | | |

| | | | |
|--------------------------------------|---|------------|------------|
| 2019 年 1 月 1 日 | - | 118,194.27 | 118,194.27 |
| 购买 | - | | - |
| 出售 | - | -74,017.50 | -74,017.50 |
| 转入第三层次 | - | - | - |
| 转出第三层次 | - | -63,159.07 | -63,159.07 |
| 当期利得或损失总额 | - | 18,982.30 | 18,982.30 |
| 计入损益的利得或损失 | - | 18,982.30 | 18,982.30 |
| 2019 年 12 月 31 日 | - | - | - |
| 2019 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2019 | | | |
| 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。

于本期末或上年度可比期末无需使用重要不可观察输入值计量的第三层次交易性金融资产公允价值。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 347,863,629.99 | 93.46 |
| | 其中：股票 | 347,863,629.99 | 93.46 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 263,000.00 | 0.07 |
| | 其中：债券 | 263,000.00 | 0.07 |
| | 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 | 21,384,229.50 | 5.75 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,675,511.94 | 0.72 |
| 9 | 合计 | 372,186,371.43 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 3,671,390.13 | 1.00 |
| B | 采矿业 | 7,992,388.92 | 2.17 |
| C | 制造业 | 181,022,211.75 | 49.26 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,669,878.44 | 1.54 |
| E | 建筑业 | 5,412,630.40 | 1.47 |
| F | 批发和零售业 | 2,624,297.64 | 0.71 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 9,354,741.23 | 2.55 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 10,186,877.16 | 2.77 |
| J | 金融业 | 82,552,295.74 | 22.47 |
| K | 房地产业 | 10,442,748.08 | 2.84 |
| L | 租赁和商务服务业 | 7,034,458.20 | 1.91 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,728,117.12 | 0.74 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| 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 | 442,638.00 | 0.12 |
| Q | 卫生和社会工作 | 5,310,485.90 | 1.45 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,771,963.20 | 0.48 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 336,217,121.91 | 91.50 |

8.2.2 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 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 587,965.76 | 0.16 |
| C | 制造业 | 7,057,640.80 | 1.92 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 249,903.30 | 0.07 |
| E | 建筑业 | 249,294.22 | 0.07 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 799,809.80 | 0.22 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 191,004.00 | 0.05 |
| J | 金融业 | 2,228,032.91 | 0.61 |
| K | 房地产业 | 10,186.25 | 0.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 63,759.90 | 0.02 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 15,642.90 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,077.78 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 178,190.46 | 0.05 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 11,646,508.08 | 3.17 |

8.2.3 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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 | 600519 | 贵州茅台 | 9,589 | 19,158,822.00 | 5.21 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 201,190 | 17,499,506.20 | 4.76 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 36,006 | 10,508,351.10 | 2.86 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 90,888 | 8,947,014.72 | 2.43 |
| 5 | 600276 | 恒瑞医药 | 69,355 | 7,730,308.30 | 2.10 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 89,517 | 5,544,682.98 | 1.51 |
| 7 | 601888 | 中国中免 | 18,228 | 5,148,498.60 | 1.40 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 112,710 | 5,000,942.70 | 1.36 |
| 9 | 601166 | 兴业银行 | 233,030 | 4,863,336.10 | 1.32 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 158,017 | 4,645,699.80 | 1.26 |
| 11 | 601012 | 隆基股份 | 49,164 | 4,532,920.80 | 1.23 |
| 12 | 002475 | 立讯精密 | 78,264 | 4,392,175.68 | 1.20 |
| 13 | 600031 | 三一重工 | 109,759 | 3,839,369.82 | 1.04 |
| 14 | 300059 | 东方财富 | 120,179 | 3,725,549.00 | 1.01 |
| 15 | 603288 | 海天味业 | 18,280 | 3,665,871.20 | 1.00 |
| 16 | 000002 | 万科 A | 126,047 | 3,617,548.90 | 0.98 |
| 17 | 000001 | 平安银行 | 180,679 | 3,494,331.86 | 0.95 |
| 18 | 002415 | 海康威视 | 69,596 | 3,376,101.96 | 0.92 |
| 19 | 002594 | 比亚迪 | 16,803 | 3,264,822.90 | 0.89 |
| 20 | 601398 | 工商银行 | 649,087 | 3,238,944.13 | 0.88 |
| 21 | 000568 | 泸州老窖 | 14,057 | 3,179,131.12 | 0.87 |
| 22 | 600900 | 长江电力 | 163,692 | 3,136,338.72 | 0.85 |
| 23 | 000725 | 京东方 A | 502,188 | 3,013,128.00 | 0.82 |
| 24 | 002352 | 顺丰控股 | 33,800 | 2,982,174.00 | 0.81 |
| 25 | 300015 | 爱尔眼科 | 37,322 | 2,795,044.58 | 0.76 |
| 26 | 600309 | 万华化学 | 29,626 | 2,697,151.04 | 0.73 |
| 27 | 002304 | 洋河股份 | 11,397 | 2,689,578.03 | 0.73 |
| 28 | 603259 | 药明康德 | 19,296 | 2,599,557.12 | 0.71 |
| 29 | 600809 | 山西汾酒 | 6,400 | 2,401,856.00 | 0.65 |
| 30 | 601899 | 紫金矿业 | 255,401 | 2,372,675.29 | 0.65 |
| 31 | 000661 | 长春高新 | 5,100 | 2,289,441.00 | 0.62 |
| 32 | 601328 | 交通银行 | 510,481 | 2,286,954.88 | 0.62 |
| 33 | 600585 | 海螺水泥 | 44,190 | 2,281,087.80 | 0.62 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 34 | 002714 | 牧原股份 | 27,972 | 2,156,641.20 | 0.59 |
| 35 | 600000 | 浦发银行 | 218,329 | 2,113,424.72 | 0.58 |
| 36 | 600048 | 保利地产 | 133,034 | 2,104,597.88 | 0.57 |
| 37 | 600016 | 民生银行 | 396,239 | 2,060,442.80 | 0.56 |
| 38 | 600690 | 海尔智家 | 70,415 | 2,056,822.15 | 0.56 |
| 39 | 002142 | 宁波银行 | 55,638 | 1,966,246.92 | 0.54 |
| 40 | 601688 | 华泰证券 | 109,162 | 1,966,007.62 | 0.54 |
| 41 | 600837 | 海通证券 | 152,494 | 1,961,072.84 | 0.53 |
| 42 | 601601 | 中国太保 | 50,966 | 1,957,094.40 | 0.53 |
| 43 | 601668 | 中国建筑 | 389,603 | 1,936,326.91 | 0.53 |
| 44 | 002027 | 分众传媒 | 191,080 | 1,885,959.60 | 0.51 |
| 45 | 600438 | 通威股份 | 47,600 | 1,829,744.00 | 0.50 |
| 46 | 300124 | 汇川技术 | 19,424 | 1,812,259.20 | 0.49 |
| 47 | 000100 | TCL 科技 | 251,735 | 1,782,283.80 | 0.49 |
| 48 | 300122 | 智飞生物 | 11,600 | 1,715,756.00 | 0.47 |
| 49 | 601288 | 农业银行 | 536,965 | 1,686,070.10 | 0.46 |
| 50 | 000063 | 中兴通讯 | 49,789 | 1,675,399.85 | 0.46 |
| 51 | 600570 | 恒生电子 | 15,758 | 1,653,014.20 | 0.45 |
| 52 | 300347 | 泰格医药 | 10,100 | 1,632,261.00 | 0.44 |
| 53 | 600104 | 上汽集团 | 65,343 | 1,596,982.92 | 0.43 |
| 54 | 002241 | 歌尔股份 | 42,204 | 1,575,053.28 | 0.43 |
| 55 | 300498 | 温氏股份 | 83,091 | 1,514,748.93 | 0.41 |
| 56 | 600999 | 招商证券 | 64,446 | 1,504,169.64 | 0.41 |
| 57 | 002460 | 赣锋锂业 | 14,650 | 1,482,580.00 | 0.40 |
| 58 | 601211 | 国泰君安 | 84,000 | 1,472,520.00 | 0.40 |
| 59 | 601229 | 上海银行 | 184,251 | 1,444,527.84 | 0.39 |
| 60 | 600436 | 片仔癀 | 5,300 | 1,417,803.00 | 0.39 |
| 61 | 000338 | 潍柴动力 | 89,192 | 1,408,341.68 | 0.38 |
| 62 | 600009 | 上海机场 | 18,252 | 1,380,946.32 | 0.38 |
| 63 | 300014 | 亿纬锂能 | 16,800 | 1,369,200.00 | 0.37 |
| 64 | 600588 | 用友网络 | 30,353 | 1,331,586.11 | 0.36 |
| 65 | 601169 | 北京银行 | 275,052 | 1,331,251.68 | 0.36 |
| 66 | 002410 | 广联达 | 16,600 | 1,307,084.00 | 0.36 |
| 67 | 600660 | 福耀玻璃 | 26,441 | 1,270,490.05 | 0.35 |
| 68 | 603501 | 韦尔股份 | 5,400 | 1,247,940.00 | 0.34 |
| 69 | 601988 | 中国银行 | 391,660 | 1,245,478.80 | 0.34 |
| 70 | 600703 | 三安光电 | 45,506 | 1,229,117.06 | 0.33 |
| 71 | 600919 | 江苏银行 | 223,170 | 1,218,508.20 | 0.33 |
| 72 | 600196 | 复星医药 | 22,390 | 1,208,836.10 | 0.33 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 73 | 603986 | 兆易创新 | 6,120 | 1,208,700.00 | 0.33 |
| 74 | 601628 | 中国人寿 | 31,299 | 1,201,568.61 | 0.33 |
| 75 | 601766 | 中国中车 | 225,243 | 1,196,040.33 | 0.33 |
| 76 | 002271 | 东方雨虹 | 30,700 | 1,191,160.00 | 0.32 |
| 77 | 601818 | 光大银行 | 296,067 | 1,181,307.33 | 0.32 |
| 78 | 002230 | 科大讯飞 | 28,859 | 1,179,467.33 | 0.32 |
| 79 | 600406 | 国电南瑞 | 42,988 | 1,142,191.16 | 0.31 |
| 80 | 000538 | 云南白药 | 9,748 | 1,107,372.80 | 0.30 |
| 81 | 601088 | 中国神华 | 61,478 | 1,107,218.78 | 0.30 |
| 82 | 300142 | 沃森生物 | 28,600 | 1,102,816.00 | 0.30 |
| 83 | 600346 | 恒力石化 | 39,140 | 1,094,745.80 | 0.30 |
| 84 | 601919 | 中远海控 | 89,600 | 1,094,016.00 | 0.30 |
| 85 | 300601 | 康泰生物 | 6,000 | 1,047,000.00 | 0.28 |
| 86 | 600893 | 航发动力 | 16,941 | 1,005,448.35 | 0.27 |
| 87 | 600028 | 中国石化 | 248,562 | 1,001,704.86 | 0.27 |
| 88 | 603799 | 华友钴业 | 12,562 | 996,166.60 | 0.27 |
| 89 | 600019 | 宝钢股份 | 165,588 | 985,248.60 | 0.27 |
| 90 | 002493 | 荣盛石化 | 35,300 | 974,633.00 | 0.27 |
| 91 | 300413 | 芒果超媒 | 13,400 | 971,500.00 | 0.26 |
| 92 | 002311 | 海大集团 | 14,800 | 969,400.00 | 0.26 |
| 93 | 000157 | 中联重科 | 96,408 | 954,439.20 | 0.26 |
| 94 | 000768 | 中航西飞 | 25,641 | 940,511.88 | 0.26 |
| 95 | 002129 | 中环股份 | 36,200 | 923,100.00 | 0.25 |
| 96 | 601336 | 新华保险 | 15,774 | 914,418.78 | 0.25 |
| 97 | 601009 | 南京银行 | 111,604 | 901,760.32 | 0.25 |
| 98 | 000876 | 新希望 | 39,514 | 885,113.60 | 0.24 |
| 99 | 000166 | 申万宏源 | 167,530 | 884,558.40 | 0.24 |
| 100 | 000895 | 双汇发展 | 18,447 | 865,902.18 | 0.24 |
| 101 | 002007 | 华兰生物 | 20,465 | 864,441.60 | 0.24 |
| 102 | 000776 | 广发证券 | 52,665 | 857,386.20 | 0.23 |
| 103 | 600741 | 华域汽车 | 29,729 | 856,789.78 | 0.23 |
| 104 | 601633 | 长城汽车 | 22,580 | 853,749.80 | 0.23 |
| 105 | 601100 | 恒立液压 | 7,456 | 842,528.00 | 0.23 |
| 106 | 600745 | 闻泰科技 | 8,300 | 821,700.00 | 0.22 |
| 107 | 603993 | 洛阳钼业 | 131,305 | 820,656.25 | 0.22 |
| 108 | 002050 | 三花智控 | 33,250 | 819,612.50 | 0.22 |
| 109 | 002001 | 新和成 | 24,200 | 815,056.00 | 0.22 |
| 110 | 000625 | 长安汽车 | 36,838 | 806,015.44 | 0.22 |
| 111 | 600547 | 山东黄金 | 33,820 | 798,828.40 | 0.22 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 112 | 002179 | 中航光电 | 10,200 | 798,558.00 | 0.22 |
| 113 | 601390 | 中国中铁 | 151,229 | 796,976.83 | 0.22 |
| 114 | 002371 | 北方华创 | 4,400 | 795,256.00 | 0.22 |
| 115 | 601901 | 方正证券 | 76,604 | 794,383.48 | 0.22 |
| 116 | 601877 | 正泰电器 | 20,200 | 791,032.00 | 0.22 |
| 117 | 601939 | 建设银行 | 125,009 | 785,056.52 | 0.21 |
| 118 | 001979 | 招商蛇口 | 58,769 | 781,040.01 | 0.21 |
| 119 | 600958 | 东方证券 | 66,408 | 772,325.04 | 0.21 |
| 120 | 600050 | 中国联通 | 172,848 | 770,902.08 | 0.21 |
| 121 | 601377 | 兴业证券 | 87,130 | 756,288.40 | 0.21 |
| 122 | 601857 | 中国石油 | 180,465 | 748,929.75 | 0.20 |
| 123 | 300433 | 蓝思科技 | 24,300 | 743,823.00 | 0.20 |
| 124 | 600109 | 国金证券 | 45,239 | 736,038.53 | 0.20 |
| 125 | 002202 | 金风科技 | 51,282 | 730,768.50 | 0.20 |
| 126 | 600176 | 中国巨石 | 36,600 | 730,536.00 | 0.20 |
| 127 | 002555 | 三七互娱 | 23,302 | 727,721.46 | 0.20 |
| 128 | 300408 | 三环集团 | 19,300 | 718,925.00 | 0.20 |
| 129 | 600015 | 华夏银行 | 114,236 | 713,975.00 | 0.19 |
| 130 | 601006 | 大秦铁路 | 110,316 | 712,641.36 | 0.19 |
| 131 | 601989 | 中国重工 | 169,534 | 710,347.46 | 0.19 |
| 132 | 601225 | 陕西煤业 | 74,317 | 694,120.78 | 0.19 |
| 133 | 000860 | 顺鑫农业 | 9,500 | 689,130.00 | 0.19 |
| 134 | 002008 | 大族激光 | 15,900 | 679,725.00 | 0.18 |
| 135 | 601788 | 光大证券 | 36,447 | 674,998.44 | 0.18 |
| 136 | 601186 | 中国铁建 | 85,395 | 674,620.50 | 0.18 |
| 137 | 603369 | 今世缘 | 11,600 | 665,608.00 | 0.18 |
| 138 | 002236 | 大华股份 | 33,322 | 662,774.58 | 0.18 |
| 139 | 600352 | 浙江龙盛 | 48,412 | 659,371.44 | 0.18 |
| 140 | 603019 | 中科曙光 | 19,120 | 654,477.60 | 0.18 |
| 141 | 600926 | 杭州银行 | 43,820 | 653,794.40 | 0.18 |
| 142 | 000596 | 古井贡酒 | 2,400 | 652,800.00 | 0.18 |
| 143 | 603899 | 晨光文具 | 7,200 | 637,632.00 | 0.17 |
| 144 | 002736 | 国信证券 | 46,109 | 628,926.76 | 0.17 |
| 145 | 000786 | 北新建材 | 15,700 | 628,785.00 | 0.17 |
| 146 | 600760 | 中航沈飞 | 8,000 | 625,440.00 | 0.17 |
| 147 | 300003 | 乐普医疗 | 23,000 | 625,140.00 | 0.17 |
| 148 | 000066 | 中国长城 | 32,300 | 613,377.00 | 0.17 |
| 149 | 600183 | 生益科技 | 21,400 | 602,624.00 | 0.16 |
| 150 | 601108 | 财通证券 | 46,900 | 593,285.00 | 0.16 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 151 | 601155 | 新城控股 | 16,800 | 585,144.00 | 0.16 |
| 152 | 002601 | 龙麟佰利 | 19,000 | 584,630.00 | 0.16 |
| 153 | 002044 | 美年健康 | 51,104 | 579,008.32 | 0.16 |
| 154 | 000783 | 长江证券 | 68,894 | 578,709.60 | 0.16 |
| 155 | 600383 | 金地集团 | 42,340 | 571,590.00 | 0.16 |
| 156 | 601985 | 中国核电 | 115,895 | 570,203.40 | 0.16 |
| 157 | 601555 | 东吴证券 | 57,754 | 569,454.44 | 0.15 |
| 158 | 002841 | 视源股份 | 4,800 | 552,144.00 | 0.15 |
| 159 | 601669 | 中国电建 | 142,273 | 552,019.24 | 0.15 |
| 160 | 000069 | 华侨城 A | 76,499 | 542,377.91 | 0.15 |
| 161 | 000938 | 紫光股份 | 26,421 | 540,309.45 | 0.15 |
| 162 | 002024 | 苏宁易购 | 69,264 | 534,025.44 | 0.15 |
| 163 | 002624 | 完美世界 | 18,000 | 531,000.00 | 0.14 |
| 164 | 600111 | 北方稀土 | 40,470 | 529,752.30 | 0.14 |
| 165 | 300136 | 信维通信 | 14,641 | 525,319.08 | 0.14 |
| 166 | 300144 | 宋城演艺 | 29,460 | 522,031.20 | 0.14 |
| 167 | 603160 | 汇顶科技 | 3,300 | 513,315.00 | 0.14 |
| 168 | 601933 | 永辉超市 | 71,392 | 512,594.56 | 0.14 |
| 169 | 000977 | 浪潮信息 | 18,900 | 508,032.00 | 0.14 |
| 170 | 601138 | 工业富联 | 36,800 | 503,792.00 | 0.14 |
| 171 | 600522 | 中天科技 | 45,700 | 495,388.00 | 0.13 |
| 172 | 600010 | 包钢股份 | 422,841 | 494,723.97 | 0.13 |
| 173 | 600795 | 国电电力 | 219,328 | 493,488.00 | 0.13 |
| 174 | 600029 | 南方航空 | 82,358 | 490,853.68 | 0.13 |
| 175 | 601800 | 中国交建 | 65,333 | 474,317.58 | 0.13 |
| 176 | 300033 | 同花顺 | 3,800 | 471,124.00 | 0.13 |
| 177 | 000425 | 徐工机械 | 87,426 | 469,477.62 | 0.13 |
| 178 | 002456 | 欧菲光 | 35,037 | 461,787.66 | 0.13 |
| 179 | 603658 | 安图生物 | 3,100 | 450,058.00 | 0.12 |
| 180 | 002607 | 中公教育 | 12,600 | 442,638.00 | 0.12 |
| 181 | 601600 | 中国铝业 | 121,597 | 441,397.11 | 0.12 |
| 182 | 600886 | 国投电力 | 50,963 | 440,320.32 | 0.12 |
| 183 | 600061 | 国投资本 | 31,700 | 438,411.00 | 0.12 |
| 184 | 600705 | 中航资本 | 99,944 | 437,754.72 | 0.12 |
| 185 | 603833 | 欧派家居 | 3,220 | 433,090.00 | 0.12 |
| 186 | 000703 | 恒逸石化 | 33,820 | 432,896.00 | 0.12 |
| 187 | 000963 | 华东医药 | 16,279 | 432,370.24 | 0.12 |
| 188 | 601838 | 成都银行 | 40,300 | 430,001.00 | 0.12 |
| 189 | 002463 | 沪电股份 | 22,400 | 420,896.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 190 | 600066 | 宇通客车 | 24,798 | 419,582.16 | 0.11 |
| 191 | 601111 | 中国国航 | 55,496 | 415,665.04 | 0.11 |
| 192 | 601607 | 上海医药 | 21,547 | 413,702.40 | 0.11 |
| 193 | 601021 | 春秋航空 | 7,200 | 399,096.00 | 0.11 |
| 194 | 601066 | 中信建投 | 9,500 | 399,000.00 | 0.11 |
| 195 | 600606 | 绿地控股 | 67,806 | 395,308.98 | 0.11 |
| 196 | 002602 | 世纪华通 | 55,501 | 394,612.11 | 0.11 |
| 197 | 002157 | 正邦科技 | 23,000 | 391,920.00 | 0.11 |
| 198 | 600115 | 东方航空 | 83,509 | 390,822.12 | 0.11 |
| 199 | 002938 | 鹏鼎控股 | 7,800 | 387,426.00 | 0.11 |
| 200 | 600362 | 江西铜业 | 19,307 | 385,174.65 | 0.10 |
| 201 | 600340 | 华夏幸福 | 29,404 | 380,193.72 | 0.10 |
| 202 | 601878 | 浙商证券 | 24,700 | 377,910.00 | 0.10 |
| 203 | 601162 | 天风证券 | 61,790 | 376,919.00 | 0.10 |
| 204 | 600177 | 雅戈尔 | 51,752 | 372,096.88 | 0.10 |
| 205 | 601727 | 上海电气 | 68,105 | 367,767.00 | 0.10 |
| 206 | 600011 | 华能国际 | 81,700 | 366,016.00 | 0.10 |
| 207 | 002422 | 科伦药业 | 18,800 | 365,472.00 | 0.10 |
| 208 | 002508 | 老板电器 | 8,900 | 362,942.00 | 0.10 |
| 209 | 601618 | 中国中冶 | 132,586 | 361,959.78 | 0.10 |
| 210 | 600118 | 中国卫星 | 11,194 | 360,222.92 | 0.10 |
| 211 | 600487 | 亨通光电 | 25,620 | 358,423.80 | 0.10 |
| 212 | 300628 | 亿联网络 | 4,900 | 358,288.00 | 0.10 |
| 213 | 600068 | 葛洲坝 | 52,732 | 346,976.56 | 0.09 |
| 214 | 601198 | 东兴证券 | 25,800 | 343,656.00 | 0.09 |
| 215 | 002120 | 韵达股份 | 21,593 | 339,010.10 | 0.09 |
| 216 | 600637 | 东方明珠 | 37,913 | 338,942.22 | 0.09 |
| 217 | 002673 | 西部证券 | 32,588 | 330,442.32 | 0.09 |
| 218 | 600498 | 烽火通信 | 13,600 | 327,488.00 | 0.09 |
| 219 | 002812 | 恩捷股份 | 2,300 | 326,094.00 | 0.09 |
| 220 | 600332 | 白云山 | 10,663 | 311,892.75 | 0.08 |
| 221 | 601216 | 君正集团 | 63,008 | 311,889.60 | 0.08 |
| 222 | 601816 | 京沪高铁 | 54,600 | 309,036.00 | 0.08 |
| 223 | 003816 | 中国广核 | 109,400 | 308,508.00 | 0.08 |
| 224 | 002916 | 深南电路 | 2,820 | 304,729.20 | 0.08 |
| 225 | 600763 | 通策医疗 | 1,100 | 304,172.00 | 0.08 |
| 226 | 600489 | 中金黄金 | 34,501 | 303,953.81 | 0.08 |
| 227 | 000961 | 中南建设 | 34,300 | 302,869.00 | 0.08 |
| 228 | 601881 | 中国银河 | 24,000 | 300,240.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 229 | 601360 | 三六零 | 18,900 | 296,919.00 | 0.08 |
| 230 | 600018 | 上港集团 | 64,873 | 296,469.61 | 0.08 |
| 231 | 002049 | 紫光国微 | 2,200 | 294,382.00 | 0.08 |
| 232 | 600390 | 五矿资本 | 41,940 | 292,741.20 | 0.08 |
| 233 | 601998 | 中信银行 | 57,188 | 292,230.68 | 0.08 |
| 234 | 600369 | 西南证券 | 53,198 | 286,205.24 | 0.08 |
| 235 | 000656 | 金科股份 | 40,200 | 285,018.00 | 0.08 |
| 236 | 002252 | 上海莱士 | 37,700 | 278,980.00 | 0.08 |
| 237 | 002739 | 万达电影 | 15,400 | 278,432.00 | 0.08 |
| 238 | 600004 | 白云机场 | 19,700 | 278,361.00 | 0.08 |
| 239 | 601117 | 中国化学 | 45,900 | 269,433.00 | 0.07 |
| 240 | 600271 | 航天信息 | 21,132 | 266,263.20 | 0.07 |
| 241 | 600233 | 圆通速递 | 23,100 | 265,650.00 | 0.07 |
| 242 | 002958 | 青农商行 | 51,400 | 261,626.00 | 0.07 |
| 243 | 600655 | 豫园股份 | 29,300 | 260,477.00 | 0.07 |
| 244 | 601319 | 中国人保 | 39,300 | 258,201.00 | 0.07 |
| 245 | 600998 | 九州通 | 14,100 | 256,056.00 | 0.07 |
| 246 | 600085 | 同仁堂 | 10,575 | 252,742.50 | 0.07 |
| 247 | 603156 | 养元饮品 | 9,724 | 251,268.16 | 0.07 |
| 248 | 600208 | 新湖中宝 | 79,790 | 247,349.00 | 0.07 |
| 249 | 600584 | 长电科技 | 5,700 | 242,649.00 | 0.07 |
| 250 | 601658 | 邮储银行 | 49,400 | 236,132.00 | 0.06 |
| 251 | 002032 | 苏泊尔 | 3,000 | 233,970.00 | 0.06 |
| 252 | 601231 | 环旭电子 | 12,000 | 232,080.00 | 0.06 |
| 253 | 601238 | 广汽集团 | 17,140 | 227,790.60 | 0.06 |
| 254 | 002773 | 康弘药业 | 4,680 | 225,342.00 | 0.06 |
| 255 | 600848 | 上海临港 | 11,000 | 220,220.00 | 0.06 |
| 256 | 002939 | 长城证券 | 17,040 | 219,304.80 | 0.06 |
| 257 | 600482 | 中国动力 | 12,002 | 215,075.84 | 0.06 |
| 258 | 600297 | 广汇汽车 | 75,200 | 215,072.00 | 0.06 |
| 259 | 002146 | 荣盛发展 | 32,156 | 209,978.68 | 0.06 |
| 260 | 002821 | 凯莱英 | 700 | 209,398.00 | 0.06 |
| 261 | 600027 | 华电国际 | 60,600 | 206,040.00 | 0.06 |
| 262 | 688008 | 澜起科技 | 2,409 | 199,657.92 | 0.05 |
| 263 | 000671 | 阳光城 | 30,600 | 199,512.00 | 0.05 |
| 264 | 002558 | 巨人网络 | 11,340 | 197,656.20 | 0.05 |
| 265 | 600872 | 中炬高新 | 2,800 | 186,620.00 | 0.05 |
| 266 | 601577 | 长沙银行 | 19,100 | 181,832.00 | 0.05 |
| 267 | 002153 | 石基信息 | 5,781 | 179,731.29 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 268 | 000627 | 天茂集团 | 36,800 | 179,216.00 | 0.05 |
| 269 | 688012 | 中微公司 | 1,136 | 179,022.24 | 0.05 |
| 270 | 600600 | 青岛啤酒 | 1,800 | 178,920.00 | 0.05 |
| 271 | 600989 | 宝丰能源 | 15,000 | 175,500.00 | 0.05 |
| 272 | 002600 | 领益智造 | 14,200 | 170,258.00 | 0.05 |
| 273 | 601916 | 浙商银行 | 40,300 | 164,424.00 | 0.04 |
| 274 | 002384 | 东山精密 | 6,100 | 158,600.00 | 0.04 |
| 275 | 000723 | 美锦能源 | 22,800 | 152,304.00 | 0.04 |
| 276 | 600025 | 华能水电 | 33,400 | 148,964.00 | 0.04 |
| 277 | 000708 | 中信特钢 | 6,800 | 148,172.00 | 0.04 |
| 278 | 601808 | 中海油服 | 11,300 | 144,301.00 | 0.04 |
| 279 | 300529 | 健帆生物 | 2,100 | 142,422.00 | 0.04 |
| 280 | 601236 | 红塔证券 | 7,500 | 139,425.00 | 0.04 |
| 281 | 002414 | 高德红外 | 3,300 | 137,775.00 | 0.04 |
| 282 | 601698 | 中国卫通 | 7,500 | 136,050.00 | 0.04 |
| 283 | 600161 | 天坛生物 | 3,200 | 133,440.00 | 0.04 |
| 284 | 688036 | 传音控股 | 849 | 129,166.86 | 0.04 |
| 285 | 300676 | 华大基因 | 1,000 | 128,560.00 | 0.03 |
| 286 | 601077 | 渝农商行 | 21,000 | 94,500.00 | 0.03 |
| 287 | 601990 | 南京证券 | 7,400 | 90,798.00 | 0.02 |
| 288 | 002945 | 华林证券 | 4,700 | 70,829.00 | 0.02 |
| 289 | 603195 | 公牛集团 | 300 | 61,587.00 | 0.02 |
| 290 | 600299 | 安迪苏 | 4,800 | 55,248.00 | 0.02 |
| 291 | 603392 | 万泰生物 | 200 | 40,306.00 | 0.01 |
| 292 | 603087 | 甘李药业 | 300 | 39,666.00 | 0.01 |

8.3.2 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 | 601995 | 中金公司 | 24,951 | 1,756,799.91 | 0.48 |
| 2 | 688396 | 华润微 | 13,832 | 864,361.68 | 0.24 |
| 3 | 002466 | 天齐锂业 | 18,311 | 719,072.97 | 0.20 |
| 4 | 600089 | 特变电工 | 69,027 | 700,624.05 | 0.19 |
| 5 | 688050 | 爱博医疗 | 3,520 | 593,155.20 | 0.16 |
| 6 | 600219 | 南山铝业 | 133,100 | 420,596.00 | 0.11 |
| 7 | 600867 | 通化东宝 | 26,400 | 353,232.00 | 0.10 |
| 8 | 601997 | 贵阳银行 | 42,140 | 335,013.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 9 | 600038 | 中直股份 | 5,224 | 327,597.04 | 0.09 |
| 10 | 600221 | 海航控股 | 213,401 | 324,369.52 | 0.09 |
| 11 | 688686 | 奥普特 | 1,515 | 312,241.50 | 0.08 |
| 12 | 600516 | 方大炭素 | 42,456 | 300,163.92 | 0.08 |
| 13 | 601018 | 宁波港 | 72,709 | 285,019.28 | 0.08 |
| 14 | 600674 | 川投能源 | 24,866 | 249,903.30 | 0.07 |
| 15 | 600170 | 上海建工 | 82,822 | 249,294.22 | 0.07 |
| 16 | 600372 | 中航电子 | 10,462 | 205,578.30 | 0.06 |
| 17 | 688301 | 奕瑞科技 | 1,262 | 205,327.40 | 0.06 |
| 18 | 601992 | 金隅集团 | 62,200 | 184,734.00 | 0.05 |
| 19 | 600583 | 海油工程 | 41,032 | 184,233.68 | 0.05 |
| 20 | 600977 | 中国电影 | 14,301 | 178,190.46 | 0.05 |
| 21 | 000709 | 河钢股份 | 78,975 | 176,904.00 | 0.05 |
| 22 | 300999 | 金龙鱼 | 1,742 | 172,127.02 | 0.05 |
| 23 | 600188 | 兖州煤业 | 16,544 | 166,598.08 | 0.05 |
| 24 | 600398 | 海澜之家 | 24,800 | 159,216.00 | 0.04 |
| 25 | 601898 | 中煤能源 | 33,900 | 150,855.00 | 0.04 |
| 26 | 688579 | 山大地纬 | 9,617 | 138,196.29 | 0.04 |
| 27 | 688336 | 三生国健 | 5,679 | 137,886.12 | 0.04 |
| 28 | 600928 | 西安银行 | 24,500 | 136,220.00 | 0.04 |
| 29 | 688528 | 秦川物联 | 8,337 | 135,809.73 | 0.04 |
| 30 | 002468 | 申通快递 | 11,300 | 113,904.00 | 0.03 |
| 31 | 688617 | 惠泰医疗 | 1,372 | 102,159.12 | 0.03 |
| 32 | 300862 | 蓝盾光电 | 2,400 | 95,568.00 | 0.03 |
| 33 | 600968 | 海油发展 | 36,100 | 86,279.00 | 0.02 |
| 34 | 603260 | 合盛硅业 | 2,580 | 86,275.20 | 0.02 |
| 35 | 688668 | 鼎通科技 | 3,037 | 85,521.92 | 0.02 |
| 36 | 300896 | 爱美客 | 128 | 77,306.88 | 0.02 |
| 37 | 601298 | 青岛港 | 11,900 | 76,517.00 | 0.02 |
| 38 | 601212 | 白银有色 | 24,900 | 73,704.00 | 0.02 |
| 39 | 601828 | 美凯龙 | 7,510 | 63,759.90 | 0.02 |
| 40 | 688056 | 莱伯泰科 | 2,010 | 61,385.40 | 0.02 |
| 41 | 300926 | 博俊科技 | 3,584 | 38,563.84 | 0.01 |
| 42 | 300894 | 火星人 | 628 | 29,459.48 | 0.01 |
| 43 | 300927 | 江天化学 | 2,163 | 28,962.57 | 0.01 |
| 44 | 300861 | 美畅股份 | 534 | 27,511.02 | 0.01 |
| 45 | 300919 | 中伟股份 | 354 | 27,300.48 | 0.01 |
| 46 | 003026 | 中晶科技 | 460 | 21,693.60 | 0.01 |
| 47 | 300908 | 仲景食品 | 285 | 21,035.85 | 0.01 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 48 | 300898 | 熊猫乳品 | 496 | 20,425.28 | 0.01 |
| 49 | 300909 | 汇创达 | 386 | 19,361.76 | 0.01 |
| 50 | 300910 | 瑞丰新材 | 316 | 18,839.92 | 0.01 |
| 51 | 300891 | 惠云钛业 | 1,143 | 18,745.20 | 0.01 |
| 52 | 003029 | 吉大正元 | 716 | 18,716.24 | 0.01 |
| 53 | 003028 | 振邦智能 | 432 | 18,010.08 | 0.00 |
| 54 | 300902 | 国安达 | 551 | 16,981.82 | 0.00 |
| 55 | 605179 | 一鸣食品 | 939 | 16,582.74 | 0.00 |
| 56 | 300907 | 康平科技 | 473 | 16,342.15 | 0.00 |
| 57 | 300925 | 法本信息 | 353 | 15,775.57 | 0.00 |
| 58 | 300887 | 谱尼测试 | 210 | 15,642.90 | 0.00 |
| 59 | 300884 | 狄耐克 | 369 | 15,298.74 | 0.00 |
| 60 | 300864 | 南大环境 | 166 | 15,077.78 | 0.00 |
| 61 | 300889 | 爱克股份 | 479 | 14,427.48 | 0.00 |
| 62 | 300890 | 翔丰华 | 286 | 13,968.24 | 0.00 |
| 63 | 300895 | 铜牛信息 | 283 | 12,819.90 | 0.00 |
| 64 | 300879 | 大叶股份 | 466 | 12,647.24 | 0.00 |
| 65 | 300911 | 亿田智能 | 309 | 12,149.88 | 0.00 |
| 66 | 300918 | 南山智尚 | 1,063 | 11,905.60 | 0.00 |
| 67 | 300882 | 万胜智能 | 440 | 11,347.60 | 0.00 |
| 68 | 688080 | 映翰通 | 200 | 10,940.00 | 0.00 |
| 69 | 605155 | 西大门 | 350 | 10,668.00 | 0.00 |
| 70 | 300922 | 天秦装备 | 287 | 10,555.86 | 0.00 |
| 71 | 300917 | 特发服务 | 281 | 10,186.25 | 0.00 |
| 72 | 300893 | 松原股份 | 276 | 9,682.08 | 0.00 |
| 73 | 300881 | 盛德鑫泰 | 291 | 9,399.30 | 0.00 |
| 74 | 605277 | 新亚电子 | 507 | 8,593.65 | 0.00 |
| 75 | 003030 | 祖名股份 | 480 | 7,286.40 | 0.00 |
| 76 | 003031 | 中瓷电子 | 387 | 5,909.49 | 0.00 |
| 77 | 688078 | 龙软科技 | 200 | 5,496.00 | 0.00 |
| 78 | 688299 | 长阳科技 | 100 | 2,498.00 | 0.00 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超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 | 11,285,410.40 | 5.13 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 7,953,084.25 | 3.61 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 4,184,779.21 | 1.90 |
| 4 | 600276 | 恒瑞医药 | 4,061,402.00 | 1.85 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 3,925,034.00 | 1.78 |
| 6 | 000651 | 格力电器 | 3,787,079.00 | 1.72 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 3,412,517.00 | 1.55 |
| 8 | 000002 | 万科 A | 2,893,916.00 | 1.32 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 2,847,981.00 | 1.29 |
| 10 | 601398 | 工商银行 | 2,839,922.00 | 1.29 |
| 11 | 000001 | 平安银行 | 2,698,843.36 | 1.23 |
| 12 | 600900 | 长江电力 | 2,686,343.47 | 1.22 |
| 13 | 002475 | 立讯精密 | 2,566,333.04 | 1.17 |
| 14 | 600887 | 伊利股份 | 2,555,857.00 | 1.16 |
| 15 | 002352 | 顺丰控股 | 2,013,016.00 | 0.91 |
| 16 | 688981 | 中芯国际 | 1,946,007.82 | 0.88 |
| 17 | 601328 | 交通银行 | 1,883,385.00 | 0.86 |
| 18 | 603259 | 药明康德 | 1,816,919.00 | 0.83 |
| 19 | 600016 | 民生银行 | 1,811,451.00 | 0.82 |
| 20 | 601688 | 华泰证券 | 1,803,004.00 | 0.82 |

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 8,487,342.00 | 3.86 |
| 2 | 688981 | 中芯国际 | 5,867,767.05 | 2.67 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 5,010,242.00 | 2.28 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 3,809,849.00 | 1.73 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 3,202,068.56 | 1.46 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 3,071,541.00 | 1.40 |
| 7 | 600276 | 恒瑞医药 | 2,972,611.00 | 1.35 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 2,808,372.00 | 1.28 |
| 9 | 002475 | 立讯精密 | 2,018,212.00 | 0.92 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 2,016,274.00 | 0.92 |
| 11 | 600030 | 中信证券 | 1,898,556.00 | 0.86 |
| 12 | 000001 | 平安银行 | 1,867,498.00 | 0.85 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 13 | 601288 | 农业银行 | 1,738,835.00 | 0.79 |
| 14 | 600016 | 民生银行 | 1,683,290.00 | 0.77 |
| 15 | 600900 | 长江电力 | 1,543,471.00 | 0.70 |
| 16 | 000002 | 万科 A | 1,455,369.00 | 0.66 |
| 17 | 601398 | 工商银行 | 1,401,539.00 | 0.64 |
| 18 | 601328 | 交通银行 | 1,392,100.00 | 0.63 |
| 19 | 002415 | 海康威视 | 1,315,562.00 | 0.60 |
| 20 | 600031 | 三一重工 | 1,266,446.00 | 0.58 |

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 234,749,443.50 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 199,694,454.66 |

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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） | 263,000.00 | 0.07 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 263,000.00 | 0.07 |

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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 | 113044 | 大秦转债 | 2,470 | 247,000.00 | 0.07 |
| 2 | 113616 | 韦尔转债 | 160 | 16,000.00 | 0.00 |

注：本基金本报告期末仅持有上述两只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 42,665.10 |
| 2 | 应收证券清算款 | 247,695.92 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,326.34 |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 5 | 应收申购款 | 2,382,824.58 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,675,511.94 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券（可交换债券）。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.5.2 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 | 601995 | 中金公司 | 1,756,799.91 | 0.48 | 限售期锁定 |
| 2 | 688050 | 爱博医疗 | 593,155.20 | 0.16 | 限售期锁定 |

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|----------------|------------|---------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 6,491 | 33,988.67 | 135,720,801.21 | 61.52% | 84,899,623.54 | 38.48% |

9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额 比例 |
|----|-----------------------------------|------------|--------------|
| 1 | 杨凯 | 227,202.00 | 11.52% |
| 2 | 苏海琼 | 110,000.00 | 5.58% |
| 3 | 傅涛涌 | 105,095.00 | 5.33% |
| 4 | 林树瀚 | 74,633.00 | 3.78% |
| 5 | 共青城树山投资管理有限公司—树山远星多策略精选1号私募证券投资基金 | 67,224.00 | 3.41% |
| 6 | 丁继兰 | 60,794.00 | 3.08% |
| 7 | 缪晏 | 60,000.00 | 3.04% |
| 8 | 李泽华 | 51,000.00 | 2.59% |
| 9 | 吴辉 | 50,003.00 | 2.54% |
| 10 | 石如刚 | 43,600.00 | 2.21% |

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 1,029,604.54 | 0.4667% |

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（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 | 232,930,771.78 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 167,983,308.72 |
| 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 | 220,620,424.75 |

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司 2020 年第一次临时股东会议决议,同意陈健元不再担任公司第七届董事会董事,选举钟德兴担任公司第七届董事会董事。该董事人员变更,已向中国证监会北京监管局报备。

11.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

11.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

自 2020 年 8 月 28 日起,刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为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,本报告期应付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元,已连续为本基金提供审计服务 11 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|-------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| | | | | | | |

| | | | 例 | | | |
|------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 国元证券 | 1 | 265,628,854.77 | 64.47% | 247,374.69 | 64.46% | - |
| 招商证券 | 1 | 146,420,301.87 | 35.53% | 136,363.18 | 35.54% | - |

11.7.2 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 | 496,071.80 | 70.75% | - | - | - | - |
| 招商证券 | 205,096.70 | 29.25% | - | - | - | - |

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要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

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

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

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

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

撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元：无。

11.8 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 12 月 23 日 |
| 2 | 长盛基金管理有限公司关于增加腾安基金销售(深圳)有限公司销售旗下部分基金并开通定投及参加费率优惠活动的公告 | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 12 月 16 日 |
| 3 | 长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年第 3 季度报告 | 本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 10 月 28 日 |
| 4 | 长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年中期报告 | 本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 8 月 29 日 |
| 5 | 长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金基金产品资料概要(更新) | 本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 8 月 27 日 |
| 6 | 关于公司旗下开放式基金降低申购和定投起点金额的公告 | 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 7 月 28 日 |
| 7 | 长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2020 年第 2 季度报告 | 本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 7 月 21 日 |
| 8 | 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 7 月 1 日 |
| 9 | 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 |
| 10 | 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 |
| 11 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 6 月 18 日 |
| 12 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 收益分配公告 | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 6 月 15 日 |

| | | | |
|----|--|---------------------------|-----------------|
| 13 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 6 月 11 日 |
| 14 | 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 |
| 15 | 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 |
| 16 | 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 |
| 17 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 证券投资基金 2019 年度报告 | 本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 4 月 21 日 |
| 18 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 27 日 |
| 19 | 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 |
| 20 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 收益分配公告 | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 20 日 |
| 21 | 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2020 年 3 月 17 日 |
| 22 | 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 |
| 23 | 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 |
| 24 | 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 |
| 25 | 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 |
| 26 | 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 1 月 16 日 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|---|---------------|---------------|---------------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20200302~20200305、 20200605~20200715、 20200717~20201227 | 27,215,396.58 | 16,566,040.53 | 0.00 | 43,781,437.11 | 19.84% |
| | 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）相关批准文件；
- 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。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2021 年 3 月 31 日