

# 长盛动态精选证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 27 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 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	57

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛动态精选证券投资基金
基金简称	长盛动态精选混合
基金主代码	510081
交易代码	510081
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 5 月 21 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	191,713,992.35 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为开放式混合型基金。将通过积极投资于能够充分分享中国经济长期增长的、在各自行业中已经或将要取得领袖地位的 50 家上市公司股票，在承担适度风险的前提下，追求当期收益和基金资产超过业绩比较基准的长期稳定回报。
投资策略	在资产配置过程中，将充分研究宏观经济周期以及股票市场周期变化，做出判断，适当控制股票仓位。当股票市场中股票呈现平均意义上价值被高估的迹象的时候，适当降低股票配置比例，反之适当增加股票仓位。 本基金采用自上而下的投资策略，即首先根据国家政策、国内外经济形势以及各产业的生命周期，编制行业景气度指标体系，对各主要行业投资价值进行优先排序，确定各行业的投资比重。然后采用长盛股票综合评级体系，对优选行业内的上市公司进行综合评级，精选出 50 只最有投资价值的股票。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+金融同业存款利率*5%
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的适度风险品种，在承担适度风险的前提下，获取长期稳定的收益。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	秦一楠
	联系电话	010-86497608	010-66060069
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-86497888	95599
传真		010-86497999	010-68121816

注册地址	深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100029	100031
法定代表人	周兵	谷澍

注：长盛基金管理有限公司法定代表人已于 2021 年 7 月 21 日变更为高民和。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	62,598,890.09
本期利润	11,618,079.56
加权平均基金份额本期利润	0.0586
本期加权平均净值利润率	3.36%
本期基金份额净值增长率	3.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	158,575,279.45
期末可供分配基金份额利润	0.8271
期末基金资产净值	350,289,271.80
期末基金份额净值	1.8271
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	864.27%

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

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

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

#### 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	0.04%	1.59%	-1.91%	0.76%	1.95%	0.83%
过去三个月	13.63%	1.36%	3.32%	0.93%	10.31%	0.43%
过去六个月	3.11%	1.81%	0.29%	1.25%	2.82%	0.56%
过去一年	26.27%	1.74%	22.96%	1.26%	3.31%	0.48%
过去三年	92.59%	1.46%	39.42%	1.30%	53.17%	0.16%
自基金合同生效起至今	864.27%	1.51%	388.62%	1.60%	475.65%	-0.09%

注：由于标普道琼斯指数有限公司停止计算标普中国 A 股综合指数行情数据，经履行适当程序，



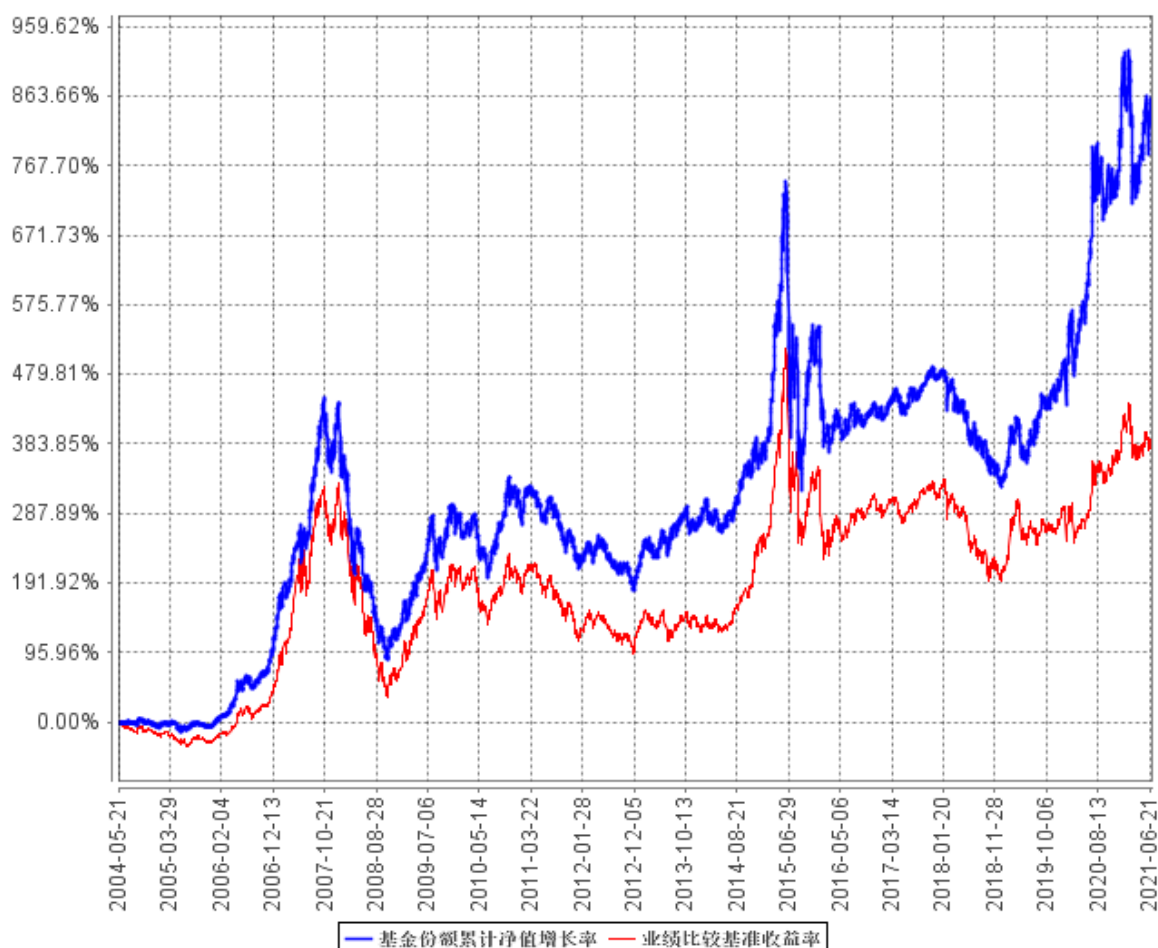
自 2020 年 9 月 14 日起，本基金业绩比较基准由“标普中国 A 股综合指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%”变更为“沪深 300 指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%”。

沪深 300 指数是中证指数公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。

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



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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金总部办公地位于北京，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 2021 年 6 月 30 日，基金管理人共管理六十七只开放式基金，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		
代毅	本基金基金经理，长盛城镇化主题混合型证券投资基金基金经理，长盛生态环境主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2020 年 4 月 21 日	-	11 年	代毅先生，硕士。2010 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金经理助理等职务。

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

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

3、报经中国证券投资基金业协会同意，自 2021 年 8 月 18 日起，王宁同志担任长盛动态精选证券投资基金基金经理，代毅同志不再担任长盛动态精选证券投资基金基金经理。

#### 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。

### 4.2 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

2021 年上半年市场呈上冲回落、成长震荡向上占优的过程，上证指数、沪深 300、创业板指数分别上涨 3.40%、0.24%、17.22%，其中创业板指数创了新高。市场和去年趋势逆向且分化更加严重，一方面权重白马冲高回落，中小市值底部向上，估值差继续收敛，另一方面优质成长赛道

如新能源车及光伏、CXO 及医疗服务、半导体走出了牛市行情，不断创新高，反而是其它行业特别是“茅”股不断向正常估值回归，其中资金属性较强的军工板块没有完全体现其成长性，仍需业绩不断验证。

在全球范围内新冠疫苗接种快速推进的背景下，全球经济逐渐复苏，一方面中国出口增速逐渐下滑，另一方面市场预期货币政策正常化。中国经济复苏领先美欧半年左右，因此 A 股平均估值最早向正常水平回归。但是当下的宽松货币和稳健财政政策下，资金从增量入场到存量博弈，带来投资逻辑由“普涨”到向优质行业和个股“集中”，细分行业和个股的高增速成为关键。对于市场整体，Taper 并不会构成系统性风险，但近期国内利率的边际变化，也制约了指数的向上空间，市场仍将以震荡为主。

按照基金合同要求，本基金严格遵循 50 只个股持有限制要求，行业配置相对均衡，聚焦于医药、新能源车相关、新消费、新材料等优质赛道。一季度本基金白酒、军工配置较多，带来了净值回撤，二季度在反弹中作为仓位控制策略，阶段减少了白酒、军工的配置，加强了精选优质赛道中优质个股的策略。根据对经济和资本市场的判断，本基金保持中偏低的基金仓位，力争控制好回撤。

#### 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 1.8271 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.11%，业绩比较基准收益率为 0.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年上半年，在疫苗快速接种下全球经济逐步复苏，国内“十四五”开局之年财政和货币以稳定和均衡为主，稳增长压力较去年减少。中国作为全球经济的供给方作用在减弱，出口增速高位回落，但从上市公司半年报业绩预告来看大部分仍然增速较快，体现了经济良好的韧性。

2021 年下半年我国经济运行面临诸多挑战和风险，不确定因素较多，其中关键因素在于国内财政货币政策进一步趋稳，出口增速回落，以及中美（欧）关系的竞合。总体而言，下半年我国要保持经济平稳发展势头，增强经济发展韧性，宏观政策既保持稳健，又精准发力强弱项、防风险。下半年财政政策将继续维持“积极”取向，力度可能会大于上半年。

流动性方面，一是在全球货币政策趋于收紧大方向下，我国逆势维持宽松概率不大，处理好恢复经济与防范风险的关系；二是要灵活精准实施货币政策，保持经济运行在合理区间，推动经济在恢复中达到更高水平均衡。可以预见，政府在“滞”和“涨”更倾向于经济合理增长，货币政策不会明显收紧。

2021 年下半年，结构性行情依然可期。国内的上市公司基本上是本行业内的翘楚，优势企业

在全球竞争力不断加强，盈利不断改善。因此在微观上，我们反而会看到更多积极的因素。新冠疫情的冲击将随着时间逐渐向均值回归，由市场流动性驱动的贝塔行情逐渐转向优质行业和优质公司。较低利率水平下成长股估值的锚有所抬升，市场核心是盈利成长，我们要积极关注季度盈利不断增长的个股。

不分行业赛道，前期的部分核心资产下半年将随着景气周期的变化，估值继续回归到与业绩增速匹配的水平，低增速的资产在过去两年的上涨中变贵了。那些盈利持续且稳定增长的公司才能消化高企的估值，这非常考验我们识别跟踪优质个股的能力。相对上半年，固化行业的投资模式将弱化，比如新能源行业好本质在于企业收入盈利增速好。本基金将自下而上为主，聚焦业绩驱动的真成长和确定性高的核心资产，积极寻找季度盈利不断改善的优质行业中优质个股，争取为投资者创造良好收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金基金合同中对基金利润分配原则的约定，本基金于本报告期内进行了利润分配，分配金额为 8,348,349.68 元。

本基金截至 2021 年 6 月 30 日，期末可供分配收益为 158,575,279.45 元，其中，未分配收益已实现部分为 289,721,759.69 元，未分配收益未实现部分为-131,146,480.24 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——长盛基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，长盛基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：长盛动态精选证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	10,700,899.90	23,507,105.59
结算备付金		875,076.30	1,551,167.94
存出保证金		501,272.11	489,310.73
交易性金融资产	6.4.7.2	314,076,568.75	357,319,098.01
其中：股票投资		196,663,224.39	355,801,936.45
基金投资		-	-
债券投资		117,413,344.36	1,517,161.56
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		24,891,147.06	2,277,616.27
应收利息	6.4.7.5	1,360,881.78	13,039.75
应收股利		-	-
应收申购款		37,720.36	10,737.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		352,443,566.26	385,168,075.50
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,623,398.14
应付赎回款		544,662.80	1,135,901.77
应付管理人报酬		420,718.00	459,422.51
应付托管费		56,095.72	61,256.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	659,893.46	663,929.55
应交税费		62,579.95	62,557.59



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	410,344.53	501,831.27
负债合计		2,154,294.46	4,508,297.14
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	191,713,992.35	210,119,817.96
未分配利润	6.4.7.10	158,575,279.45	170,539,960.40
所有者权益合计		350,289,271.80	380,659,778.36
负债和所有者权益总计		352,443,566.26	385,168,075.50

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.8271 元，基金份额总额 191,713,992.35 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛动态精选证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		17,068,233.56	96,607,502.61
1.利息收入		221,993.78	319,056.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	211,756.41	236,755.17
债券利息收入		10,237.37	82,301.28
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）		67,815,688.26	36,825,116.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	67,179,667.84	35,697,006.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-3,530.00
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	636,020.42	1,131,640.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-50,980,810.53	59,455,397.03
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	11,362.05	7,932.79
<b>减：二、费用</b>		5,450,154.00	3,863,091.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,582,483.95	2,365,113.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	344,331.18	315,348.45

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,412,269.17	1,071,026.06
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		7.76	1.70
7. 其他费用	6.4.7.20	111,061.94	111,602.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,618,079.56	92,744,410.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,618,079.56	92,744,410.72

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛动态精选证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	210,119,817.96	170,539,960.40	380,659,778.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,618,079.56	11,618,079.56
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）	-18,405,825.61	-15,234,410.83	-33,640,236.44
其中：1.基金申购款	7,403,137.18	5,882,972.79	13,286,109.97
2.基金赎回款	-25,808,962.79	-21,117,383.62	-46,926,346.41
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）	-	-8,348,349.68	-8,348,349.68
五、期末所有者权益（基金净值）	191,713,992.35	158,575,279.45	350,289,271.80
项目	上年度可比期间 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)	273,855,739.11	30,713,263.48	304,569,002.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	92,744,410.72	92,744,410.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-28,054,765.66	-5,652,023.88	-33,706,789.54
其中：1.基金申购款	6,832,222.56	1,692,783.61	8,525,006.17
2.基金赎回款	-34,886,988.22	-7,344,807.49	-42,231,795.71
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)	245,800,973.45	117,805,650.32	363,606,623.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵

刁俊东

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长盛动态精选证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]第 35 号《关于同意长盛动态精选证券投资基金设立的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《长盛动态精选证券投资基金基金契约》(后更名为《长盛动态精选证券投资基金基金合同》)发起,并于 2004 年 5 月 21 日募集成立。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 4,105,260,456.17 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(2004)第 79 号验资报告予以验证。募集期内产生的认购资金利息折合 2,926,788.63 份基金份额,分别计入各投资者基金账户。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》和最近公

布的《长盛动态精选证券投资基金更新招募说明书》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，主要包括国内依法发行、上市或拟上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。其中股票投资占基金资产净值的比例为 20%-95%，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛动态精选证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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。

(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 2021年6月30日
活期存款	10,700,899.90
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：	10,700,899.90

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	141,375,591.12	196,663,224.39	55,287,633.27
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	57,407,344.36	256,143.86
	银行间市场	60,006,000.00	14,480.00
	合计	117,413,344.36	270,623.86
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	258,518,311.62	314,076,568.75	55,558,257.13

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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

注：无余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无余额。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,995.85
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	354.42
应收债券利息	1,352,328.56
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	202.95
合计	1,360,881.78

**6.4.7.6 其他资产**

注：无余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	655,918.46
银行间市场应付交易费用	3,975.00
合计	659,893.46

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	144.38
应付证券出借违约金	-
预提费用	93,760.15
征管费退还	66,440.00
合计	410,344.53

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	210,119,817.96	210,119,817.96
本期申购	7,403,137.18	7,403,137.18
本期赎回(以“-”号填列)	-25,808,962.79	-25,808,962.79
本期末	191,713,992.35	191,713,992.35

注：申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

#### 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	259,856,869.70	-89,316,909.30	170,539,960.40
本期利润	62,598,890.09	-50,980,810.53	11,618,079.56
本期基金份额交易产生的变动数	-24,385,650.42	9,151,239.59	-15,234,410.83
其中：基金申购款	9,617,185.83	-3,734,213.04	5,882,972.79
基金赎回款	-34,002,836.25	12,885,452.63	-21,117,383.62
本期已分配利润	-8,348,349.68	-	-8,348,349.68
本期末	289,721,759.69	-131,146,480.24	158,575,279.45

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	197,029.07
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	10,571.99
其他	4,155.35
合计	211,756.41

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	860,435,176.73
减：卖出股票成本总额	793,255,508.89
买卖股票差价收入	67,179,667.84



**6.4.7.13 债券投资收益**

注：无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

注：无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

注：无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	636,020.42
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	636,020.42

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-50,980,810.53
——股票投资	-51,139,872.83
——债券投资	159,062.30
——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	-50,980,810.53

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	10,237.62
基金转换费收入	1,124.43

合计	11,362.05
----	-----------

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。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,411,819.17
银行间市场交易费用	450.00
合计	2,412,269.17

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	12,801.79
合计	111,061.94

#### 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	基金管理人、基金销售机构

司”)	
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	279,013,932.43	18.12%	114,886,989.51	17.11%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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	55,538,800.50	100.00%	-	-

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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	259,843.58	18.58%	187,506.15	28.59%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

		量的比例		总额的比例
国元证券	106,842.26	17.09%	59,767.77	14.37%

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,582,483.95	2,365,113.31
其中：支付销售机构的客户维护费	1,052,264.96	344,566.21

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	344,331.18	315,348.45

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 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

注：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

注：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**

注：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**

注：无。

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

注：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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	10,700,899.90	197,029.07	31,357,310.16	228,078.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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**

注：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	2021年1月15日	-	2021年1月15日	0.410	3,494,376.36	4,853,973.32	8,348,349.68	
合计	-	-		0.410	3,494,376.36	4,853,973.32	8,348,349.68	

## 6.4.12 期末（2021 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
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688696	极米科技	2021 年 2 月 23 日	2021 年 9 月 3 日	限售期锁定	133.73	779.94	787	105,245.51	613,812.78	-
688097	博众精工	2021 年 4 月 29 日	2021 年 11 月 12 日	限售期锁定	11.27	30.45	3,983	44,888.41	121,282.35	-
688682	霍莱沃	2021 年 4 月 13 日	2021 年 10 月 20 日	限售期锁定	45.72	117.45	946	43,251.12	111,107.70	-
688663	新风光	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 13 日	限售期锁定	14.48	20.36	3,279	47,479.92	66,760.44	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	限售期锁定	47.33	252.43	229	10,838.57	57,806.47	-
688350	富淼科技	2021 年 1 月 21 日	2021 年 7 月 28 日	限售期锁定	13.58	22.43	2,552	34,656.16	57,241.36	-
300979	华利集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	限售期锁定	33.22	105.33	412	13,686.64	43,395.96	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	限售期锁定	28.28	145.09	291	8,229.48	42,221.19	-
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	限售期锁定	48.59	106.28	236	11,467.24	25,082.08	-

			日							
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	限售期锁定	28.77	99.89	240	6,904.80	23,973.60	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	限售期锁定	6.87	14.98	1,162	7,982.94	17,406.76	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	限售期锁定	9.19	49.61	329	3,023.51	16,321.69	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	限售期锁定	15.83	50.96	317	5,018.11	16,154.32	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	限售期锁定	24.69	31.70	492	12,147.48	15,596.40	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	限售期锁定	18.71	76.32	201	3,760.71	15,340.32	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	限售期锁定	12.76	43.35	307	3,917.32	13,308.45	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	限售期锁定	12.25	53.66	244	2,989.00	13,093.04	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	限售期锁定	3.40	22.12	576	1,958.40	12,741.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	限售期锁定	20.81	50.60	241	5,015.21	12,194.60	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	限售期锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	限售期锁定	16.53	46.05	232	3,834.96	10,683.60	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月	限售期锁定	6.79	34.76	301	2,043.79	10,462.76	-

		日	月 11 日							
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	限售期 锁定	8.42	16.77	593	4,993.06	9,944.61	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	限售期 锁定	14.79	37.23	264	3,904.56	9,828.72	-
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	限售期 锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	限售期 锁定	12.10	23.23	410	4,961.00	9,524.30	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	限售期 锁定	11.72	27.07	340	3,984.80	9,203.80	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	限售期 锁定	4.56	18.87	474	2,161.44	8,944.38	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	限售期 锁定	13.00	27.39	324	2,808.00	8,874.36	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	限售期 锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	限售期 锁定	13.06	34.14	254	3,317.24	8,671.56	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	限售期 锁定	8.41	39.12	219	1,841.79	8,567.28	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	限售期 锁定	5.48	17.07	492	2,696.16	8,398.44	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	限售期 锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300985	致远	2021 年	2021	限售期	24.90	27.29	295	7,345.50	8,050.55	-



	新能	4月21日	年10月29日	锁定						
300930	屹通新材	2021年1月13日	2021年7月21日	限售期锁定	13.11	24.47	322	4,221.42	7,879.34	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	限售期锁定	12.13	27.73	283	3,432.79	7,847.59	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	限售期锁定	4.54	15.34	507	2,301.78	7,777.38	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	限售期锁定	7.19	16.20	430	3,091.70	6,966.00	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	限售期锁定	9.79	23.00	255	2,496.45	5,865.00	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	限售期锁定	14.72	28.81	191	2,811.52	5,502.71	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	限售期锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	限售期锁定	9.36	26.89	200	1,872.00	5,378.00	-

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。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。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：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**

注：无。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，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 0.40%。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	115,538,450.00	-
合计	115,538,450.00	-

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
--------	------------------------	--------------------------

AAA	-	-
AAA 以下	1,874,894.36	-
未评级	-	-
合计	1,874,894.36	-

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 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 2021 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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证

券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 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 2021 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、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	10,700,899.90	-	-	-	10,700,899.90
结算备付金	875,076.30	-	-	-	875,076.30
存出保证金	501,272.11	-	-	-	501,272.11
交易性金融资产	115,538,450.00	972,807.00	902,087.36	196,663,224.39	314,076,568.75
应收证券清算款	-	-	-	24,891,147.06	24,891,147.06
应收利息	-	-	-	1,360,881.78	1,360,881.78
应收申购款	-	-	-	37,720.36	37,720.36
资产总计	127,615,698.31	972,807.00	902,087.36	222,952,973.59	352,443,566.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	544,662.80	544,662.80
应付管理人报酬	-	-	-	420,718.00	420,718.00
应付托管费	-	-	-	56,095.72	56,095.72
应付交易费用	-	-	-	659,893.46	659,893.46
应交税费	-	-	-	62,579.95	62,579.95
其他负债	-	-	-	410,344.53	410,344.53
负债总计	-	-	-	2,154,294.46	2,154,294.46
利率敏感度缺口	127,615,698.31	972,807.00	902,087.36	220,798,679.13	350,289,271.80
上年度末 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	23,507,105.59	-	-	-	23,507,105.59
结算备付金	1,551,167.94	-	-	-	1,551,167.94
存出保证金	489,310.73	-	-	-	489,310.73
交易性金融资产	-	-	1,517,161.56	355,801,936.45	357,319,098.01
应收证券清算款	-	-	-	2,277,616.27	2,277,616.27
应收利息	-	-	-	13,039.75	13,039.75
应收申购款	-	-	-	10,737.21	10,737.21
资产总计	25,547,584.26	-	1,517,161.56	358,103,329.68	385,168,075.50
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,623,398.14	1,623,398.14
应付赎回款	-	-	-	1,135,901.77	1,135,901.77
应付管理人报酬	-	-	-	459,422.51	459,422.51
应付托管费	-	-	-	61,256.31	61,256.31
应付交易费用	-	-	-	663,929.55	663,929.55
应交税费	-	-	-	7.19	7.19
其他负债	-	-	-	564,381.67	564,381.67

负债总计	-	-	-	4,508,297.14	4,508,297.14
利率敏感度缺口	25,547,584.26	-	1,517,161.56	353,595,032.54	380,659,778.36

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

假设	除市场利率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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	162,443.36	-
	市场利率上升 25 个基点	-162,443.36	-

注：于 2020 年 12 月 31 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 0.40%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，投资组合中股票投资比例占基金资产净值的 20%-95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	196,663,224.39	56.14	355,801,936.45	93.47
合计	196,663,224.39	56.14	355,801,936.45	93.47

## 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(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	20,651,995.59	20,753,069.67
2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-20,651,995.59	-20,753,069.67	

## 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 2021 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 196,984,918.56 元，属于第二层次的余额为 117,091,650.19 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额 352,858,708.70 元，属于第二层次的余额 4,460,389.31 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动



本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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(2020 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	196,663,224.39	55.80
	其中：股票	196,663,224.39	55.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	117,413,344.36	33.31
	其中：债券	117,413,344.36	33.31
	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	11,575,976.20	3.28
8	其他各项资产	26,791,021.31	7.60
9	合计	352,443,566.26	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	14,743.38	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	196,426,068.14	56.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,154.32	0.00
F	批发和零售业	30,435.86	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	133,765.06	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	42,057.63	0.01
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	196,663,224.39	56.14

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	500,330	31,030,466.60	8.86
2	300122	智飞生物	159,700	29,820,781.00	8.51
3	000568	泸州老窖	115,570	27,267,585.80	7.78
4	600771	广誉远	650,000	25,415,000.00	7.26
5	002324	普利特	2,140,024	25,038,280.80	7.15
6	300953	震裕科技	180,040	19,613,183.60	5.60
7	300777	中简科技	387,000	17,484,660.00	4.99
8	300979	华利集团	93,012	10,590,535.96	3.02
9	300973	立高食品	40,291	6,242,221.19	1.78
10	300957	贝泰妮	10,229	2,774,706.47	0.79
11	688696	极米科技	787	613,812.78	0.18
12	688097	博众精工	3,983	121,282.35	0.03
13	688682	霍莱沃	946	111,107.70	0.03
14	688663	新风光	3,279	66,760.44	0.02
15	688350	富淼科技	2,552	57,241.36	0.02
16	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
17	300981	中红医疗	236	25,082.08	0.01
18	300968	格林精密	1,162	17,406.76	0.00
19	300614	百川畅银	329	16,321.69	0.00
20	300982	苏文电能	317	16,154.32	0.00
21	300932	三友联众	492	15,596.40	0.00
22	301002	崧盛股份	201	15,340.32	0.00
23	300940	南极光	307	13,308.45	0.00
24	300937	药易购	244	13,093.04	0.00
25	300962	中金辐照	576	12,741.12	0.00
26	300996	普联软件	241	12,194.60	0.00
27	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
28	300955	嘉亨家化	232	10,683.60	0.00

29	300987	川网传媒	301	10,462.76	0.00
30	300978	东箭科技	593	9,944.61	0.00
31	300986	志特新材	264	9,828.72	0.00
32	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
33	300993	玉马遮阳	410	9,524.30	0.00
34	300952	恒辉安防	340	9,203.80	0.00
35	300945	曼卡龙	474	8,944.38	0.00
36	300948	冠中生态	324	8,874.36	0.00
37	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
38	300991	创益通	254	8,671.56	0.00
39	300950	德固特	219	8,567.28	0.00
40	300975	商络电子	492	8,398.44	0.00
41	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
42	300985	致远新能	295	8,050.55	0.00
43	300930	屹通新材	322	7,879.34	0.00
44	300963	中洲特材	283	7,847.59	0.00
45	300967	晓鸣股份	507	7,777.38	0.00
46	300972	万辰生物	430	6,966.00	0.00
47	300943	春晖智控	255	5,865.00	0.00
48	300995	奇德新材	191	5,502.71	0.00
49	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
50	300992	泰福泵业	200	5,378.00	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	603993	洛阳钼业	29,818,075.00	7.83
2	600309	万华化学	24,630,390.00	6.47
3	300777	中简科技	21,861,856.00	5.74
4	300618	寒锐钴业	19,274,618.78	5.06
5	600771	广誉远	17,839,024.00	4.69
6	300953	震裕科技	16,907,092.78	4.44
7	600873	梅花生物	16,711,645.02	4.39
8	000301	东方盛虹	16,709,619.00	4.39
9	605499	东鹏饮料	14,412,430.78	3.79
10	002960	青鸟消防	14,042,893.00	3.69

11	601233	桐昆股份	13,071,058.46	3.43
12	300142	沃森生物	12,963,319.00	3.41
13	002326	永太科技	12,218,202.16	3.21
14	600519	贵州茅台	11,323,733.84	2.97
15	002192	融捷股份	10,908,422.00	2.87
16	600760	中航沈飞	10,667,786.00	2.80
17	600499	科达制造	10,642,506.77	2.80
18	300979	华利集团	10,611,368.52	2.79
19	000799	酒鬼酒	10,518,268.16	2.76
20	601658	邮储银行	10,109,330.00	2.66
21	002386	天原股份	9,543,891.00	2.51
22	300750	宁德时代	8,896,475.00	2.34
23	601888	中国中免	8,773,470.00	2.30
24	600075	新疆天业	8,399,552.00	2.21
25	600900	长江电力	8,329,840.24	2.19
26	603113	金能科技	8,031,416.45	2.11
27	000568	泸州老窖	7,999,385.00	2.10
28	002756	永兴材料	7,860,173.00	2.06
29	300379	东方通	7,793,893.16	2.05

#### 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	603993	洛阳钼业	33,035,461.69	8.68
2	600519	贵州茅台	32,356,865.20	8.50
3	002960	青鸟消防	31,430,551.37	8.26
4	300618	寒锐钴业	30,568,214.00	8.03
5	000858	五粮液	26,548,640.40	6.97
6	600309	万华化学	21,514,726.72	5.65
7	000596	古井贡酒	18,089,790.60	4.75
8	603787	新日股份	17,782,341.55	4.67
9	603799	华友钴业	17,610,851.53	4.63
10	000568	泸州老窖	17,201,885.20	4.52
11	600862	中航高科	17,097,834.00	4.49
12	000301	东方盛虹	16,518,231.00	4.34
13	000733	振华科技	16,061,191.65	4.22

14	600873	梅花生物	15,574,221.00	4.09
15	600316	洪都航空	15,319,841.00	4.02
16	300122	智飞生物	15,283,483.00	4.01
17	300015	爱尔眼科	15,262,478.28	4.01
18	605499	东鹏饮料	14,750,384.67	3.87
19	600760	中航沈飞	14,058,764.60	3.69
20	002326	永太科技	12,857,642.75	3.38
21	300142	沃森生物	11,991,192.78	3.15
22	601233	桐昆股份	11,611,302.40	3.05
23	002192	融捷股份	11,522,698.00	3.03
24	000799	酒鬼酒	11,111,878.00	2.92
25	601658	邮储银行	10,560,069.00	2.77
26	002386	天原股份	10,123,775.00	2.66
27	688122	西部超导	9,922,791.02	2.61
28	300750	宁德时代	9,517,861.00	2.50
29	600499	科达制造	9,487,858.00	2.49
30	002240	盛新锂能	9,408,221.00	2.47
31	603876	鼎胜新材	9,104,847.72	2.39
32	601888	中国中免	9,096,024.00	2.39
33	688012	中微公司	8,834,624.03	2.32
34	002756	永兴材料	8,723,002.00	2.29
35	300379	东方通	8,440,677.55	2.22
36	688308	欧科亿	8,347,871.86	2.19
37	600900	长江电力	8,140,504.88	2.14
38	600075	新疆天业	8,049,631.00	2.11
39	688625	呈和科技	7,970,056.41	2.09

### 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	685,256,669.66
卖出股票收入（成交）总额	860,435,176.73

注：本项中 7.4.1、7.4.2 和 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	55,532,450.00	15.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,006,000.00	17.13
	其中：政策性金融债	60,006,000.00	17.13
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）	1,874,894.36	0.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	117,413,344.36	33.52

## 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	210206	21 国开 06	600,000	60,006,000.00	17.13
2	019640	20 国债 10	400,000	40,000,000.00	11.42
3	019645	20 国债 15	90,000	9,027,900.00	2.58
4	019649	21 国债 01	65,000	6,504,550.00	1.86
5	113588	润达转债	9,020	972,807.00	0.28

## 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：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

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：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

#### 一、普利特：

公司于 2020 年 11 月收到中国证券监督管理委员会上海监管局下发的《关于对上海普利特复合材料股份有限公司采取出具警示函措施的决定》，警示函指出公司在信息披露方面存在两点问题：

(1) 2019 年 7 月 17 日，你公司收到财政扶持资金 1,437 万元，并计入当期损益，相关利润超过公司最近一个会计年度（2018 年度）经审计净利润的 10%。你公司直至 2019 年 7 月 26 日才通过临时报告予以披露。2019 年 11 月 6 日，你公司收到专项扶持资金 984.7 万元，并计入当期损益，相关利润超过公司最近一个会计年度（2018 年度）经审计净利润的 10%。你公司未通过临时报告及时履行信息披露义务，直至 2020 年 3 月 21 日才在 2019 年年度报告中予以披露。

(2) 公司控股子公司浙江普利特新材料有限公司为环境保护部门公布的 2019 年浙江省重点排污单位，公司 2019 年半年度报告、2019 年年度报告均未披露相关环境保护信息；公司控股子公司上海普利特化工新材料有限公司、浙江普利特新材料有限公司分别为环境保护部门公布的 2020 年上海市、浙江省重点排污单位，公司于 2020 年 7 月 31 日披露的 2020 年半年度报告未披露相关环境保护信息，直至 2020 年 9 月 19 日才披露更新后的 2020 年半年度报告，对相关环境保护信息进行补充披露。

本基金做如下说明：普利特是高端汽车用改性塑料龙头，公司全力以赴攻克 LCP 薄膜产业化难题，LCP 是 5G 通信关键材料，公司基本面持续向好。警示函指出的问题主要是信息的延迟披露，不影响公司经营业绩。经与公司沟通，公司及相关责任人将严格按照信息披露制度的有关规定执行，杜绝此类事件的再次发生。我们也将继续加强与该公司的沟通，密切关注其在环保、信息披露等方面的合规性以及企业的经营状况。

#### 二、21 国开 06：

2021 年 1 月 8 日，银保监会银保监罚决字〔2020〕67 号显示，国家开发银行存在为违规的政府购买服务项目提供融资等 24 项违法违规事实，对其处以罚款 4880 万元。对以上事件，本基金判断，国家开发银行经营稳健，上述处罚对公司影响可控。后续关注其制度建设与执行等公司基



基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

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

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

本基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 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	501,272.11
2	应收证券清算款	24,891,147.06
3	应收股利	-
4	应收利息	1,360,881.78
5	应收申购款	37,720.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,791,021.31

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113588	润达转债	972,807.00	0.28
2	128142	新乳转债	391,838.72	0.11
3	128136	立讯转债	195,540.40	0.06

### 7.12.5 期末前十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	300957	贝泰妮	57,806.47	0.02	限售期锁定
2	300979	华利集团	43,395.96	0.01	限售期锁定
3	300973	立高食品	42,221.19	0.01	限售期锁定
4	300953	震裕科技	23,973.60	0.01	限售期锁定

### 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
16,497	11,621.14	2,469,568.22	1.29%	189,244,424.13	98.71%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	9,913.01	0.0052%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年5月21日）基金份额总额	4,108,187,244.80
本报告期期初基金份额总额	210,119,817.96
本报告期基金总申购份额	7,403,137.18
减：本报告期基金总赎回份额	25,808,962.79
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	191,713,992.35

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

我公司第七届董事会任期已满，根据《公司法》和《公司章程》的有关规定，2021年6月6日，我公司召开了2021年第一次临时股东大会会议。会议选举俞仕新、高民和、毕功兵、杜愚为新任董事，蔡咏、陈翔、李伟强、朱慈蕴不再担任董事。公司已按规定向相关监管机构报备。

根据公司第八届董事会第二次会议决议，聘任周兵同志担任公司总经理，林培富同志不再担任公司总经理。公司已按规定向相关监管机构报备。

原董事会秘书孙杰同志退休，根据公司第八届董事会第二次会议决议，聘任刁俊东同志担任财务负责人兼董事会秘书。

#### 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

2021年5月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

### 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	
中信建投	1	522,377,382.63	33.93%	486,492.37	34.80%	-

国都证券	1	411,453,207.46	26.72%	383,187.33	27.41%	-
国元证券	2	279,013,932.43	18.12%	259,843.58	18.58%	-
中信证券	2	179,285,746.55	11.64%	131,110.16	9.38%	-
中投证券	1	118,584,340.51	7.70%	110,437.30	7.90%	-
中金公司	1	29,075,928.50	1.89%	27,078.35	1.94%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	55,538,800.50	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

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

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

- (4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。
- (5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

## 2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；
- (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；
- (3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；
- (4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；
- (5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；
- (6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

## 3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	华福证券	上海	1

## 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	长盛动态精选证券投资基金招募说明书（更新）	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月29日
2	长盛动态精选证券投资基金托管协议	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月29日
3	长盛动态精选证券投资基金基金产品资料概要（更新）	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月29日
4	长盛基金管理有限公司关于增加	证券时报、本公司网	2021年6月29日

	华西证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投和转换业务的公告	站、中国证监会基金信息披露网站	
5	长盛基金管理有限公司关于旗下由中国农业银行股份有限公司托管的 5 只公募基金引入侧袋机制并修改基金合同等法律文件的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 29 日
6	长盛动态精选证券投资基金基金合同	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 29 日
7	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 18 日
8	长盛动态精选证券投资基金招募说明书（更新）	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 17 日
9	长盛动态精选证券投资基金基金产品资料概要（更新）	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 17 日
10	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 6 月 10 日
11	长盛旗下基金 2021 年第 1 季度报	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 22 日
12	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 1 季度报告提示性公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 22 日
13	长盛动态精选证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 22 日
14	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 6 日
15	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 31 日
16	长盛动态精选证券投资基金 2020 年年度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 31 日
17	长盛基金管理有限公司关于旗下	证券时报、本公司网	2021 年 3 月 18 日

	基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	站、中国证监会基金信息披露网站	
18	长盛动态精选证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 1 月 22 日
19	长盛动态精选证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 1 月 18 日
20	长盛动态精选证券投资基金收益分配公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 1 月 13 日
21	长盛动态精选证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 1 月 8 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

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (二) 《长盛动态精选证券投资基金基金合同》；
- (三) 《长盛动态精选证券投资基金托管协议》；
- (四) 《长盛动态精选证券投资基金招募说明书》；
- (五) 法律意见书；
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (七) 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

2021 年 8 月 28 日