

# 长盛同锦研究精选混合型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
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>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>59</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.....	59

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

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同锦研究精选混合型证券投资基金
基金简称	长盛同锦混合
基金主代码	006199
交易代码	006199
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 28 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	110,341,441.25 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过优化的资产配置和灵活运用多种投资策略，臻选成长性和收入增长具有优势的行业和具有估值优势的个股，力争为投资者创造超过业绩基准的回报。
投资策略	本基金在传统的基本面分析框架的基础上，通过运用“三位一体”即 3T 投资方法论，对宏观基本面分析、行业基本面分析和个股基本面分析进行补充完善，臻选具有比较优势行业的投资价值较高的股票组建投资组合，并通过投研的双向反馈机制对股票初选池个股进行实时动态跟踪，根据市场变化及时调整组合配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

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	《证券日报》
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	长盛基金管理有限公司	北京市朝阳区安定路5号院3号楼 中建财富国际中心3-5层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	28,677,432.72
本期利润	16,261,345.87
加权平均基金份额本期利润	0.1286
本期加权平均净值利润率	8.76%
本期基金份额净值增长率	10.11%
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	53,230,933.05
期末可供分配基金份额利润	0.4824
期末基金资产净值	174,420,626.76
期末基金份额净值	1.5807
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	58.07%

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	-0.01%	1.53%	-1.35%	0.56%	1.34%	0.97%
过去三个月	14.45%	1.31%	2.86%	0.69%	11.59%	0.62%
过去六个月	10.11%	1.73%	1.04%	0.92%	9.07%	0.81%
过去一年	35.62%	1.56%	18.74%	0.93%	16.88%	0.63%
自基金合同生效起至今	58.07%	1.30%	30.83%	0.91%	27.24%	0.39%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率\*70%+中证综合债指数收益率\*30%



基准指数的构建考虑了三个原则：

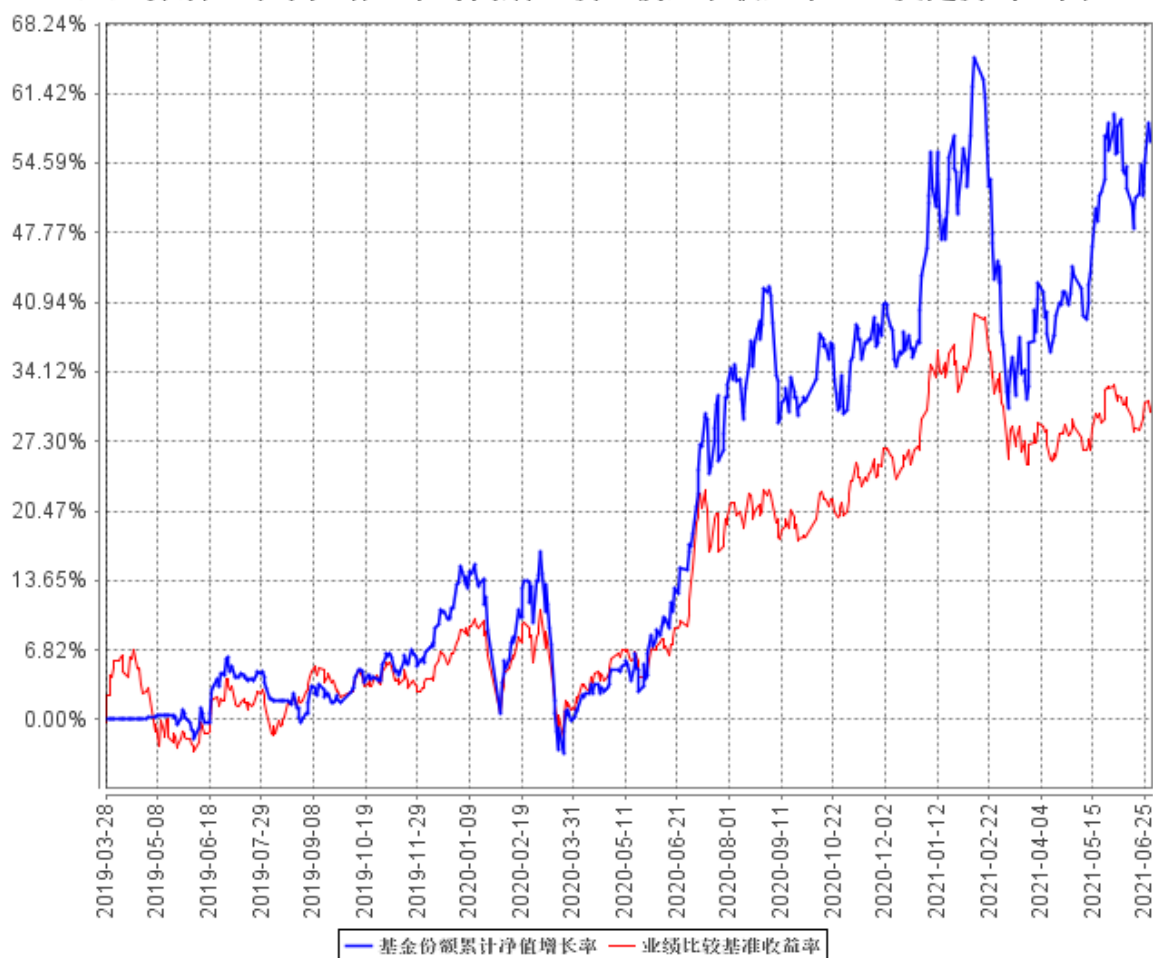
1、公允性。本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用中证综合债指数。沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本的综合性指数；样本选择标准为规模大、流动性好的股票，目前沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。中证综合债券指数由中证指数有限公司编制，是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债，以更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势，为债券投资者提供更切合的市场基准。

2、可比性。本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，其余资产主要投资于债券、货币市场工具、资产支持证券等固定收益类金融工具。因此，“沪深 300 指数收益率\*70%+中证综合债指数收益率\*30%”是适合衡量本基金投资业绩的比较基准。

3、再平衡。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 70%、30%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六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、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 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		
赵楠	本基金基金经理，长盛新兴成长主题混合型证券投资 基金基金经理，长盛互联网+主题灵活配置混合型证券投资 基金基金经理，权益投资 部执行总监，兼任私募资 产管理计划投资经理。	2019 年 3 月 28 日	-	14 年	赵楠先生，MBA。历任安信证券研究中心研究员，光大永明资产管理股份有限公司权益投资部高级股票投资经理、资深股票投资经理、权益创新业务负责人、投行总部执行董事等职务。2015 年 2 月加入长盛基金管理有限公司。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
赵楠	公募基金	3	564,209,289.18	2015-11-06
	私募资产管理计划	1	68,672,943.14	2020-09-14
	其他组合	0	-	-
	合计	4	632,882,232.32	-

## 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，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

上半年股票市场表现波澜不惊，但结构缤纷纷呈。整体来看，周期性和成长性行业表现更强一些。股票市场整体的表现并不是典型的牛熊市，而是震荡平衡市。由于去年一部分偏大市值的公司股价涨幅较大、估值也处于相对偏贵水平，进一步大幅上涨的可能性较小，另一方面，目前仍处于经济复苏过程中，流动性整体处于偏宽松状况，这样有利于股票市场的表现。

在投资运作方面，上半年取得了一定的稳定收益。欠缺的是没有把握新能源、半导体等方面的机会，比较好的是把握住次高端白酒和医疗器械的机会，在上述两方面都取得了不错的收益。

### 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 1.5807 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.11%，业绩比较基准收益率为 1.04%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济方面来看，相对比较清晰。虽然一季度经济增速强劲，但很大因素是低基数造成的，经济复苏的力度整体来讲是偏弱的，居民收入和消费水平没有恢复到疫情前的 2019 年。上游原材料价格在供给受限、需求复苏的强预期下，不断的创新高，在一定程度上削弱了中下游行业的盈利能力和竞争力，导致企业投资动力不足，工资收入增长放缓。所以从宏观经济政策的角度来看，政策全面收紧必要性并不高。我们看到今年以来政策的主基调是货币政策整体保持中性偏温和，通过降低银行负债端融资成本引导降低实体经济融资成本，较低的利率水平有利于进一步促进经济增长，刺激投资、消费需求，保持稳定的就业水平，另外通过行政的手段来调控上游原材料大幅上涨的问题，打击投机囤货，破坏大宗商品紧供给的预期，通过调节上游价格，来缓解中下游企业的盈利压力。预计下半年宏观经济政策仍维持相对稳定状态。

下半年，由于经济边际放缓、流动性偏宽松，偏成长、偏主题的一些行业预计机会相对较好。具体来看在行业方面，对中上游行业整体偏谨慎，尤其是上游行业，二季度大概率是盈利的顶点，中游行业因盈利受损，需要观察盈利和需求的恢复程度。所以预计下半年主要机会在于下游的一些行业中，由于下游行业非常多，更偏向自下而上的策略去选择。在选股逻辑方面相对更注重一些估值和逆向投资因素，在提高确定性的前提下，去减少选股的决策变量，在较高的认知程度方向去选股。

下半年在投资运作方面，坚持稳中求进，不断拓展一些行业、一些领域和一些公司的深度理解。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2021 年 6 月 30 日期末可供分配利润为 53,230,933.05 元，其中：未分配利润已实现部分为 53,230,933.05 元，未分配利润未实现部分为 10,848,252.46 元。

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

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的长盛同锦研究精选混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛同锦研究精选混合型证券投资基金

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	11,007,166.15	17,735,467.56
结算备付金		500,309.09	205,330.38
存出保证金		125,263.70	79,591.40
交易性金融资产	6.4.7.2	160,986,538.16	160,022,543.97
其中：股票投资		160,889,138.16	160,022,543.97
基金投资		-	-
债券投资		97,400.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,760,463.75	1,517,313.06
应收利息	6.4.7.5	1,168.27	1,736.91
应收股利		-	-
应收申购款		13,380.38	221.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		175,394,289.50	179,562,204.45
<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		195,645.42	1,469,502.98
应付赎回款		39,305.15	29,243.70
应付管理人报酬		212,610.08	227,624.13
应付托管费		35,435.00	37,937.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	397,364.23	338,530.31
应交税费		0.17	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,302.69	59,073.32
负债合计		973,662.74	2,161,911.79
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	110,341,441.25	123,568,399.03
未分配利润	6.4.7.10	64,079,185.51	53,831,893.63
所有者权益合计		174,420,626.76	177,400,292.66
负债和所有者权益总计		175,394,289.50	179,562,204.45

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5807 元，基金份额总额 110,341,441.25 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛同锦研究精选混合型证券投资基金

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>		19,562,519.97	7,464,019.03
1.利息收入		53,072.49	86,160.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	51,159.11	59,930.47
债券利息收入		39.41	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,873.97	26,229.76
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		31,831,256.60	3,717,330.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	30,923,526.05	2,369,979.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	92,194.03	-
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	815,536.52	1,347,350.62
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-12,416,086.85	3,544,646.88
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	94,277.73	115,881.40
<b>减：二、费用</b>		3,301,174.10	2,325,897.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,384,655.08	1,092,033.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	230,775.84	182,005.50

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,590,795.88	946,784.14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.14	-
7. 其他费用	6.4.7.20	94,947.16	105,075.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		16,261,345.87	5,138,121.31
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		16,261,345.87	5,138,121.31

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同锦研究精选混合型证券投资基金

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）	123,568,399.03	53,831,893.63	177,400,292.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,261,345.87	16,261,345.87
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）	-13,226,957.78	-6,014,053.99	-19,241,011.77
其中：1.基金申购款	46,472,824.11	24,000,419.52	70,473,243.63
2.基金赎回款	-59,699,781.89	-30,014,473.51	-89,714,255.40
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）	110,341,441.25	64,079,185.51	174,420,626.76
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）	165,260,183.03	22,217,155.39	187,477,338.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,138,121.31	5,138,121.31

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)	-7,701,851.51	-1,282,705.79	-8,984,557.30
其中：1.基金申购款	59,469,864.08	4,804,075.45	64,273,939.53
2.基金赎回款	-67,171,715.59	-6,086,781.24	-73,258,496.83
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)	157,558,331.52	26,072,570.91	183,630,902.43

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：

<u>周兵</u>	<u>刁俊东</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长盛同锦研究精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1503号《关于准予长盛同锦研究精选混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由长盛基金管理有限公司于2018年12月26日至2019年3月25日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具（2019）验字60468688\_A02号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年3月28日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。截至2019年3月27日止，本基金已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币329,599,834.29元，折合329,599,834.29份长盛同锦混合基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币86,248.29元，折合86,248.29份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币329,686,082.58元，折合329,686,082.58份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债及其他经中国证监会允许基金投资的债券)、权证、股指期货、国债期货、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届

时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%；权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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 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 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 6.4.6 税项

#### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

#### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政

策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 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	11,007,166.15
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：	11,007,166.15

### 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	143,778,834.23	160,889,138.16	17,110,303.93
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	97,400.00	97,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	97,400.00	97,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	143,876,234.23	160,986,538.16	17,110,303.93

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

### 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。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

**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	909.80
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	202.68
应收债券利息	5.12
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	50.67
合计	1,168.27

**6.4.7.6 其他资产**

注：无。

**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	397,364.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	397,364.23

**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	-
应付赎回费	0.13
应付证券出借违约金	-
预提费用	93,302.56
合计	93,302.69

**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	123,568,399.03	123,568,399.03
本期申购	46,472,824.11	46,472,824.11
本期赎回(以“-”号填列)	-59,699,781.89	-59,699,781.89
- 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	110,341,441.25	110,341,441.25

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,275,457.30	21,556,436.33	53,831,893.63
本期利润	28,677,432.72	-12,416,086.85	16,261,345.87
本期基金份额交易产生的变动数	-7,721,956.97	1,707,902.98	-6,014,053.99
其中：基金申购款	13,551,217.91	10,449,201.61	24,000,419.52
基金赎回款	-21,273,174.88	-8,741,298.63	-30,014,473.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,230,933.05	10,848,252.46	64,079,185.51

#### 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	43,029.17
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,346.90
其他	783.04
合计	51,159.11

#### 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	531,862,977.42

减：卖出股票成本总额	500,939,451.37
买卖股票差价收入	30,923,526.05

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	92,194.03
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	92,194.03

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	330,229.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	238,000.00
减：应收利息总额	35.47
买卖债券差价收入	92,194.03

### 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	815,536.52
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	815,536.52

**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	-12,416,086.85
——股票投资	-12,416,086.85
——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	-12,416,086.85

**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	93,834.04
基金转换费收入	443.69
合计	94,277.73

**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	1,590,795.88
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,590,795.88

**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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款费用	1,644.60
账户维护费	9,000.00
合计	94,947.16

#### 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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

#### 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	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	365,463,948.75	35.14%	197,344,460.28	31.92%

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

**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	340,358.42	35.82%	151,906.55	38.23%
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	183,787.37	32.68%	62,205.56	19.12%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费后的净额列示。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。

**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	1,384,655.08
其中：支付销售机构的客户维护费	202,856.66	47,455.64

注：基金管理费每日计算，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

#### 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	230,775.84	182,005.50

注：基金托管费每日计算，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值。

#### 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
中国工商银行	11,007,166.15	43,029.17	12,814,904.02	52,901.84

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

注：无。

#### 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
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
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	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

		日	6日								
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39		-
688269	凯立新材	2021年6月1日	2021年12月9日	限售期锁定	18.94	124.87	1,941	36,762.54	242,372.67		-
688314	康拓医疗	2021年5月11日	2021年11月18日	限售期锁定	17.34	96.65	1,085	18,813.90	104,865.25		-
688317	之江生物	2021年1月8日	2021年7月19日	限售期锁定	43.22	63.78	1,435	62,020.70	91,524.30		-
688656	浩欧博	2021年1月6日	2021年7月13日	限售期锁定	35.26	72.51	1,096	38,644.96	79,470.96		-
688611	杭州柯林	2021年4月1日	2021年10月12日	限售期锁定	33.44	45.39	1,316	44,007.04	59,733.24		-
688195	腾景科技	2021年3月18日	2021年9月27日	限售期锁定	13.60	19.86	2,693	36,624.80	53,482.98		-
688499	利元亨	2021年6月23日	2022年1月3日	限售期锁定	38.85	38.85	1,323	51,398.55	51,398.55		-
688565	力源科技	2021年5月6日	2021年11月15日	限售期锁定	9.39	16.52	2,464	23,136.96	40,705.28		-
688087	英科再生	2021年6月30日	2022年1月10日	限售期锁定	21.96	21.96	1,654	36,321.84	36,321.84		-
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	132	6,247.56	33,320.76		-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	限售期锁定	24.60	163.00	189	4,649.40	30,807.00		-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	限售期锁定	7.64	54.81	462	3,529.68	25,322.22		-



			日							
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	236	7,839.92	24,857.88	-
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	165	4,666.20	23,939.85	-
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	195	5,610.15	19,478.55	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	限售期锁定	8.72	35.33	471	4,107.12	16,640.43	-
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	-
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	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	限售期锁定	12.54	31.22	489	6,132.06	15,266.58	-
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	138	6,705.42	14,666.64	-
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	限售期锁定	3.40	22.12	576	1,958.40	12,741.12	-

		日	月 11 日							
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	-
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	791	5,434.17	11,849.18	-
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	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	限售期锁定	13.75	41.07	275	3,781.25	11,294.25	-
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 11 日	限售期锁定	6.79	34.76	301	2,043.79	10,462.76	-
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	325	8,024.25	10,302.50	-
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	-

301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	限售期锁定	7.81	28.93	312	2,436.72	9,026.16	-
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	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	限售期锁定	10.76	22.16	359	3,862.84	7,955.44	-
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	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月	限售期锁定	14.20	44.02	175	2,485.00	7,703.50	-

			月 17 日								
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	-	
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	限售期锁定	13.39	30.08	217	2,905.63	6,527.36	-	
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	限售期锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-	
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	-	
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	限售期锁定	8.05	32.12	170	1,368.50	5,460.40	-	
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	限售期锁定	24.90	27.29	198	4,930.20	5,403.42	-	
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	-	
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	限售期锁定	7.83	22.61	218	1,706.94	4,928.98	-	
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	限售期锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-	
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月	限售期锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-	

		日	6 日							
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	限售期锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123117	健帆转债	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 12 日	新债未上市	100.00	100.00	974	97,400.00	97,400.00	-

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无

##### 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	97,400.00	-

未评级	-	-
合计	97,400.00	-

#### 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所持金融工具变现的难易程度。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。

#### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持大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。因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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。

##### 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	11,007,166.15	-	-	-	11,007,166.15
结算备付金	500,309.09	-	-	-	500,309.09
存出保证金	125,263.70	-	-	-	125,263.70
交易性金融资产	-	-	97,400.00	160,889,138.16	160,986,538.16
应收证券清算款	-	-	-	2,760,463.75	2,760,463.75
应收利息	-	-	-	1,168.27	1,168.27
应收申购款	-	-	-	13,380.38	13,380.38
资产总计	11,632,738.94	-	97,400.00	163,664,150.56	175,394,289.50
负债					
应付证券清算款	-	-	-	195,645.42	195,645.42
应付赎回款	-	-	-	39,305.15	39,305.15
应付管理人报酬	-	-	-	212,610.08	212,610.08
应付托管费	-	-	-	35,435.00	35,435.00
应付交易费用	-	-	-	397,364.23	397,364.23
应交税费	-	-	-	0.17	0.17
其他负债	-	-	-	93,302.69	93,302.69
负债总计	-	-	-	973,662.74	973,662.74
利率敏感度缺口	11,632,738.94	-	97,400.00	162,690,487.82	174,420,626.76
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	17,735,467.56	-	-	-	17,735,467.56
结算备付金	205,330.38	-	-	-	205,330.38
存出保证金	79,591.40	-	-	-	79,591.40
交易性金融资产	-	-	-	160,022,543.97	160,022,543.97
应收证券清算款	-	-	-	1,517,313.06	1,517,313.06
应收利息	-	-	-	1,736.91	1,736.91



应收申购款	-	-	-	221.17	221.17
资产总计	18,020,389.34	-	-	161,541,815.11	179,562,204.45
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,469,502.98	1,469,502.98
应付赎回款	-	-	-	29,243.70	29,243.70
应付管理人报酬	-	-	-	227,624.13	227,624.13
应付托管费	-	-	-	37,937.35	37,937.35
应付交易费用	-	-	-	338,530.31	338,530.31
其他负债	-	-	-	59,073.32	59,073.32
负债总计	-	-	-	2,161,911.79	2,161,911.79
利率敏感度缺口	18,020,389.34	-	-	159,379,903.32	177,400,292.66

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进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。（2020年12月31日：同）

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 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	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	160,889,138.16	92.24	160,022,543.97	90.20
合计	160,889,138.16	92.24	160,022,543.97	90.20

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合在过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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）
	5%	12,744,932.64	11,894,012.84
	-5%	-12,744,932.64	-11,894,012.84

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 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 159,272,242.42 元，属于第二层次的余额为 1,714,295.74 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 155,446,367.73 元，第二层次的余额为 4,576,176.24 元，无属于第三层次的余额)。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（2020 年上半年：无）。

##### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.14.3 其他事项

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	160,889,138.16	91.73
	其中：股票	160,889,138.16	91.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	97,400.00	0.06
	其中：债券	97,400.00	0.06
	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	11,507,475.24	6.56
8	其他各项资产	2,900,276.10	1.65
9	合计	175,394,289.50	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	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	156,513,663.88	89.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	27,168.76	0.02
F	批发和零售业	104,931.08	0.06
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	34,887.76	0.02
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	82,762.91	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	4,097,960.00	2.35
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	160,889,138.16	92.24

### 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	000538	云南白药	125,800	14,557,576.00	8.35
2	002304	洋河股份	55,600	11,520,320.00	6.60
3	600779	水井坊	75,122	9,491,664.70	5.44
4	300653	正海生物	102,651	8,037,573.30	4.61
5	000858	五粮液	24,100	7,179,149.00	4.12
6	603027	千禾味业	266,240	6,999,449.60	4.01
7	600872	中炬高新	166,100	6,979,522.00	4.00
8	300529	健帆生物	78,400	6,770,624.00	3.88
9	300601	康泰生物	45,100	6,719,900.00	3.85
10	300357	我武生物	97,600	6,258,112.00	3.59
11	002507	涪陵榨菜	147,300	5,547,318.00	3.18
12	603369	今世缘	97,700	5,291,432.00	3.03
13	600882	妙可蓝多	75,600	5,276,880.00	3.03
14	603317	天味食品	177,700	5,229,711.00	3.00
15	688677	海泰新光	47,112	5,158,764.00	2.96
16	002568	百润股份	53,380	5,059,890.20	2.90
17	600600	青岛啤酒	43,400	5,019,210.00	2.88
18	300896	爱美客	5,900	4,654,392.00	2.67
19	603198	迎驾贡酒	95,400	4,226,220.00	2.42
20	300347	泰格医药	21,200	4,097,960.00	2.35
21	688029	南微医学	12,937	4,032,333.53	2.31
22	600305	恒顺醋业	193,920	3,707,750.40	2.13
23	002901	大博医疗	49,500	3,608,055.00	2.07
24	688050	爱博医疗	8,330	3,146,907.40	1.80
25	300999	金龙鱼	30,985	2,632,485.60	1.51
26	688617	惠泰医疗	6,142	2,340,040.58	1.34
27	688613	奥精医疗	21,766	1,976,135.14	1.13
28	688085	三友医疗	45,005	1,963,568.15	1.13

29	603899	晨光文具	20,800	1,758,848.00	1.01
30	688269	凯立新材	1,941	242,372.67	0.14
31	688314	康拓医疗	1,085	104,865.25	0.06
32	688317	之江生物	1,435	91,524.30	0.05
33	688656	浩欧博	1,096	79,470.96	0.05
34	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.04
35	688611	杭州柯林	1,316	59,733.24	0.03
36	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
37	688195	腾景科技	2,693	53,482.98	0.03
38	688499	利元亨	1,323	51,398.55	0.03
39	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.03
40	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.03
41	688565	力源科技	2,464	40,705.28	0.02
42	688087	英科再生	1,654	36,321.84	0.02
43	300957	贝泰妮	132	33,320.76	0.02
44	300919	中伟股份	189	30,807.00	0.02
45	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.02
46	301015	百洋医药	462	25,322.22	0.01
47	300979	华利集团	236	24,857.88	0.01
48	300973	立高食品	165	23,939.85	0.01
49	300953	震裕科技	195	19,478.55	0.01
50	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
51	301013	利和兴	471	16,640.43	0.01
52	300614	百川畅银	329	16,321.69	0.01
53	300982	苏文电能	317	16,154.32	0.01
54	301002	崧盛股份	201	15,340.32	0.01
55	301009	可靠股份	489	15,266.58	0.01
56	300981	中红医疗	138	14,666.64	0.01
57	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
58	300940	南极光	307	13,308.45	0.01
59	300937	药易购	244	13,093.04	0.01
60	300962	中金辐照	576	12,741.12	0.01
61	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
62	300996	普联软件	241	12,194.60	0.01
63	300968	格林精密	791	11,849.18	0.01
64	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
65	301016	雷尔伟	275	11,294.25	0.01
66	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
67	300955	嘉亨家化	232	10,683.60	0.01

68	300987	川网传媒	301	10,462.76	0.01
69	300932	三友联众	325	10,302.50	0.01
70	300978	东箭科技	593	9,944.61	0.01
71	300986	志特新材	264	9,828.72	0.01
72	300956	英力股份	371	9,571.80	0.01
73	300993	玉马遮阳	410	9,524.30	0.01
74	300952	恒辉安防	340	9,203.80	0.01
75	301004	嘉益股份	312	9,026.16	0.01
76	300945	曼卡龙	474	8,944.38	0.01
77	300948	冠中生态	324	8,874.36	0.01
78	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
79	300991	创益通	254	8,671.56	0.00
80	300950	德固特	219	8,567.28	0.00
81	300975	商络电子	492	8,398.44	0.00
82	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
83	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
84	300926	博俊科技	359	7,955.44	0.00
85	300930	屹通新材	322	7,879.34	0.00
86	300963	中洲特材	283	7,847.59	0.00
87	300967	晓鸣股份	507	7,777.38	0.00
88	301011	华立科技	175	7,703.50	0.00
89	300972	万辰生物	430	6,966.00	0.00
90	300927	江天化学	217	6,527.36	0.00
91	300943	春晖智控	255	5,865.00	0.00
92	300995	奇德新材	191	5,502.71	0.00
93	301012	扬电科技	170	5,460.40	0.00
94	300985	致远新能	198	5,403.42	0.00
95	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
96	300992	泰福泵业	200	5,378.00	0.00
97	301010	晶雪节能	218	4,928.98	0.00
98	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	603338	浙江鼎力	19,088,433.41	10.76
2	000858	五粮液	15,520,155.00	8.75

3	600309	万华化学	14,970,356.00	8.44
4	000581	威孚高科	11,536,758.15	6.50
5	300677	英科医疗	10,991,802.00	6.20
6	002304	洋河股份	9,554,384.00	5.39
7	000538	云南白药	9,502,811.58	5.36
8	601088	中国神华	9,190,617.00	5.18
9	601658	邮储银行	8,990,790.00	5.07
10	601939	建设银行	8,967,663.00	5.06
11	601799	星宇股份	8,882,725.52	5.01
12	603369	今世缘	8,869,636.00	5.00
13	000951	中国重汽	8,861,630.00	5.00
14	002706	良信股份	8,079,898.00	4.55
15	300601	康泰生物	7,825,004.00	4.41
16	300529	健帆生物	7,452,371.00	4.20
17	600872	中炬高新	7,374,459.00	4.16
18	600779	水井坊	7,338,135.27	4.14
19	603027	千禾味业	6,993,414.11	3.94
20	300896	爱美客	6,885,899.00	3.88
21	002597	金禾实业	6,753,975.53	3.81
22	300776	帝尔激光	6,627,446.00	3.74
23	600600	青岛啤酒	6,511,624.00	3.67
24	002810	山东赫达	6,418,157.20	3.62
25	603737	三棵树	6,415,521.00	3.62
26	601636	旗滨集团	6,124,570.03	3.45
27	603583	捷昌驱动	6,003,848.00	3.38
28	603317	天味食品	5,894,448.00	3.32
29	300999	金龙鱼	5,858,908.00	3.30
30	002507	涪陵榨菜	5,702,589.00	3.21
31	600567	山鹰国际	5,698,296.00	3.21
32	002475	立讯精密	5,607,209.47	3.16
33	300285	国瓷材料	5,592,387.00	3.15
34	600009	上海机场	5,585,562.00	3.15
35	600426	华鲁恒升	5,582,711.00	3.15
36	688185	康希诺	5,502,528.32	3.10
37	300357	我武生物	5,461,168.00	3.08
38	600882	妙可蓝多	5,121,826.00	2.89

39	002508	老板电器	5,099,130.00	2.87
40	300653	正海生物	5,015,748.81	2.83
41	000338	潍柴动力	5,005,249.00	2.82
42	300274	阳光电源	4,984,961.00	2.81
43	600030	中信证券	4,938,848.00	2.78
44	002601	龙佰集团	4,611,189.18	2.60
45	002568	百润股份	4,594,557.52	2.59
46	600085	同仁堂	4,510,703.00	2.54
47	601058	赛轮轮胎	4,484,427.00	2.53
48	601689	拓普集团	4,480,076.19	2.53
49	300012	华测检测	4,460,483.14	2.51
50	002648	卫星石化	4,423,487.00	2.49
51	600346	恒力石化	4,371,135.00	2.46
52	002043	兔宝宝	4,294,349.00	2.42
53	603489	八方股份	4,248,472.00	2.39
54	000488	晨鸣纸业	4,154,777.78	2.34
55	601899	紫金矿业	4,041,654.00	2.28
56	601100	恒立液压	4,015,291.00	2.26
57	300558	贝达药业	4,010,151.78	2.26
58	002493	荣盛石化	3,924,300.00	2.21
59	600006	东风汽车	3,827,195.00	2.16
60	600276	恒瑞医药	3,798,589.12	2.14
61	603337	杰克股份	3,766,461.00	2.12
62	002901	大博医疗	3,736,433.00	2.11
63	002832	比音勒芬	3,713,924.00	2.09
64	601633	长城汽车	3,622,159.00	2.04
65	603520	司太立	3,580,375.00	2.02
66	600438	通威股份	3,575,412.00	2.02
67	002594	比亚迪	3,574,059.08	2.01
68	600066	宇通客车	3,558,005.00	2.01
69	601318	中国平安	3,556,923.00	2.01

#### 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	601100	恒立液压	19,594,061.70	11.05



2	300059	东方财富	17,015,809.40	9.59
3	601799	星宇股份	16,898,090.00	9.53
4	603338	浙江鼎力	16,598,743.92	9.36
5	600519	贵州茅台	16,384,135.90	9.24
6	000858	五粮液	15,554,193.00	8.77
7	600309	万华化学	13,537,979.00	7.63
8	000581	威孚高科	11,341,739.00	6.39
9	600030	中信证券	10,277,086.28	5.79
10	300012	华测检测	10,243,313.59	5.77
11	603369	今世缘	9,781,671.62	5.51
12	601088	中国神华	9,185,109.00	5.18
13	601995	中金公司	9,053,446.00	5.10
14	601658	邮储银行	8,865,075.00	5.00
15	601939	建设银行	8,687,395.00	4.90
16	300677	英科医疗	8,662,596.00	4.88
17	000596	古井贡酒	8,507,865.00	4.80
18	000951	中国重汽	8,400,401.00	4.74
19	002706	良信股份	8,138,840.40	4.59
20	600276	恒瑞医药	7,969,587.67	4.49
21	002810	山东赫达	7,834,696.22	4.42
22	688185	康希诺	7,104,860.00	4.00
23	603737	三棵树	6,568,175.00	3.70
24	600132	重庆啤酒	6,479,529.14	3.65
25	600600	青岛啤酒	6,444,495.00	3.63
26	600999	招商证券	6,154,250.40	3.47
27	002597	金禾实业	6,120,503.00	3.45
28	600567	山鹰国际	6,063,120.00	3.42
29	000488	晨鸣纸业	5,803,603.00	3.27
30	600436	片仔癀	5,726,943.11	3.23
31	002648	卫星石化	5,726,039.00	3.23
32	688526	科前生物	5,600,990.60	3.16
33	000568	泸州老窖	5,583,122.46	3.15
34	601636	旗滨集团	5,477,485.40	3.09
35	600763	通策医疗	5,332,950.00	3.01
36	002475	立讯精密	5,305,927.00	2.99
37	300776	帝尔激光	5,280,694.00	2.98
38	002043	兔宝宝	5,022,049.00	2.83
39	601058	赛轮轮胎	4,992,795.29	2.81

40	300274	阳光电源	4,822,061.00	2.72
41	600009	上海机场	4,776,111.00	2.69
42	002601	龙佰集团	4,772,262.15	2.69
43	002791	坚朗五金	4,715,629.80	2.66
44	600426	华鲁恒升	4,673,857.00	2.63
45	300896	爱美客	4,600,288.92	2.59
46	002508	老板电器	4,595,179.00	2.59
47	000338	潍柴动力	4,572,844.86	2.58
48	600085	同仁堂	4,487,782.00	2.53
49	300285	国瓷材料	4,451,621.00	2.51
50	601633	长城汽车	4,383,343.00	2.47
51	601012	隆基股份	4,315,807.00	2.43
52	603583	捷昌驱动	4,163,971.00	2.35
53	300558	贝达药业	4,042,775.00	2.28
54	600006	东风汽车	4,032,303.92	2.27
55	600346	恒力石化	3,940,747.00	2.22
56	603489	八方股份	3,934,658.00	2.22
57	002832	比音勒芬	3,906,521.00	2.20
58	603899	晨光文具	3,841,694.00	2.17
59	601689	拓普集团	3,683,187.40	2.08
60	002493	荣盛石化	3,668,665.00	2.07
61	002594	比亚迪	3,653,556.84	2.06
62	000799	酒鬼酒	3,641,987.00	2.05
63	002353	杰瑞股份	3,625,703.00	2.04

### 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	514,222,132.41
卖出股票收入（成交）总额	531,862,977.42

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	97,400.00	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	97,400.00	0.06

## 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	123117	健帆转债	974	97,400.00	0.06

注：本基金本报告期末仅持有上述 1 只债券。

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

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

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

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

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	125,263.70
2	应收证券清算款	2,760,463.75
3	应收股利	-
4	应收利息	1,168.27
5	应收申购款	13,380.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,900,276.10

### 7.12.4 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）。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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
238	463,619.50	108,143,601.73	98.01%	2,197,839.52	1.99%

### 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	19.78	0.0000%

### 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（2019年3月28日）基金份额总额	329,686,082.58
本报告期期初基金份额总额	123,568,399.03
本报告期基金总申购份额	46,472,824.11
减：本报告期基金总赎回份额	59,699,781.89
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	110,341,441.25

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

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

本报告期内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

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（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

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。

### 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
光大证券	1	582,871,015.12	56.05%	542,828.21	57.13%	-
国元证券	1	365,463,948.75	35.14%	340,358.42	35.82%	-
渤海证券	1	91,575,618.15	8.81%	66,969.15	7.05%	-
中信建投	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
光大证券	330,229.50	100.00%	30,000,000.00	100.00%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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、本基金租用证券公司深圳交易单元为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于增加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	证券日报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月29日
2	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	证券日报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月18日
3	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	证券日报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月10日
4	长盛同锦研究精选混合型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3日
5	长盛同锦研究精选混合型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3日
6	长盛同锦研究精选混合型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3日
7	长盛同锦研究精选混合型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3日
8	关于旗下由中国工商银行股份有限公司托管的7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	证券日报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月3日
9	长盛同锦研究精选混合型证券投资	证券日报、本公司网	2021年5月14日

	资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	站、中国证监会基金信息披露网站	
10	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	证券日报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 22 日
11	长盛同锦研究精选混合型证券投资基金 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
12	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	证券日报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 4 月 6 日
13	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	证券日报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 31 日
14	长盛同锦研究精选混合型证券投资基金 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
15	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	证券日报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021 年 3 月 18 日
16	长盛同锦研究精选混合型证券投资基金 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

## § 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

- 1、长盛同锦研究精选混合型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛同锦研究精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同锦研究精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同锦研究精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/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