

# 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF） 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>52</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	72
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	73
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	73

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	73
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	73
8.12 投资组合报告附注 .....	74
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>75</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	75
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	75
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	75
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>76</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>77</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	77
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	77
11.4 基金投资策略的改变 .....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	77
11.8 其他重大事件 .....	79
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>82</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>83</b>
13.1 备查文件目录 .....	83
13.2 存放地点 .....	83
13.3 查阅方式 .....	83

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)
基金简称	长盛同庆中证 800 指数 (LOF)
场内简称	长盛中证 800LOF
基金主代码	160806
交易代码	160806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 22 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	85,214,541.08 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 8 月 6 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内，以实现对中国证 800 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4% 的投资目标。
业绩比较基准	95%×中证 800 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为抽样复制指数的股票型基金，具有高风险、高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	李申
	联系电话	010-86497608	021-60637102
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666 010-86497888	021-60637111
传真		010-86497999	021-60635778

注册地址	深圳市福田区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100029	100033
法定代表人	高民和	田国立

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	68,864,246.10	90,967,993.66	27,703,715.80
本期利润	25,101,408.67	117,376,717.69	78,646,249.25
加权平均基金份额本期利润	0.2591	0.4530	0.4024
本期加权平均净值利润率	14.80%	29.53%	29.51%
本期基金份额净值增长率	8.46%	39.01%	43.02%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	65,227,060.20	107,479,115.14	97,386,589.13
期末可供分配基金份额利润	0.7654	0.6230	0.3817
期末基金资产净值	156,257,260.74	291,724,651.74	369,897,404.17
期末基金份额净值	1.834	1.691	1.450
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	33.66%	23.24%	-11.35%

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

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

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

4、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为 2015 年 5 月 22 日。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.98%	0.68%	1.93%	0.69%	1.05%	-0.01%
过去六个月	3.21%	0.89%	-2.25%	0.89%	5.46%	0.00%
过去一年	8.46%	1.04%	-0.58%	1.02%	9.04%	0.02%
过去三年	115.63%	1.19%	63.53%	1.21%	52.10%	-0.02%
过去五年	93.06%	1.12%	38.37%	1.13%	54.69%	-0.01%
自基金转型	33.66%	1.46%	-4.29%	1.41%	37.95%	0.05%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

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： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率（税后）}$

本基金为指数型基金，股票资产跟踪的标的指数为中证 800 指数。中证 800 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数。其成份股由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。

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 自基金转型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

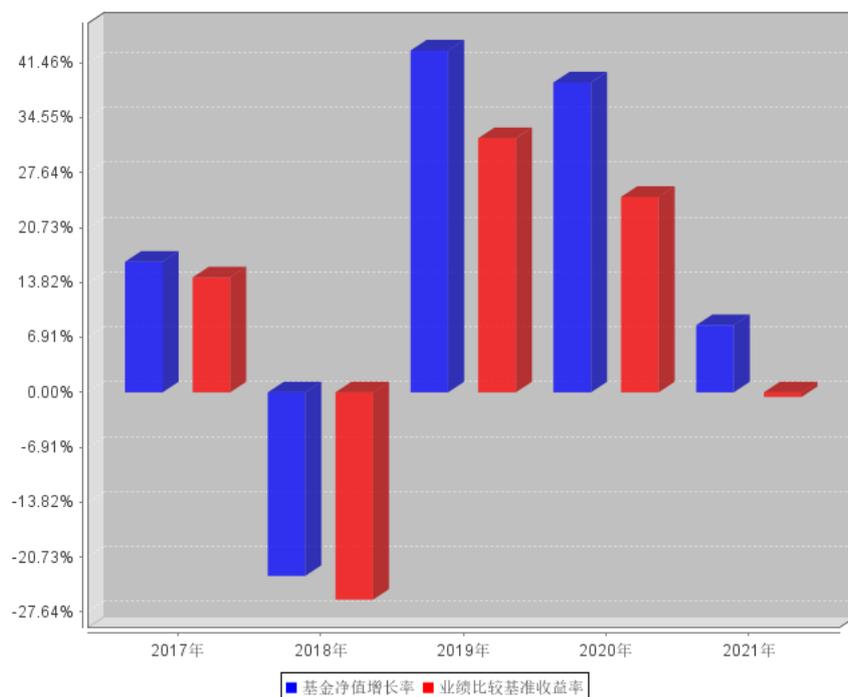


注：1、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2015 年 5 月 22 日（即基金合同生效日）。

2、按基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 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基金合同的有关约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2021	-	-	-	-	
2020	2.6340	49,523,424.08	6,960,918.46	56,484,342.54	
2019	1.2760	30,494,008.87	116,175.31	30,610,184.18	
合计	3.9100	80,017,432.95	7,077,093.77	87,094,526.72	

## § 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，是国内首批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%，安徽省信用融资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，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基金的投资顾问。截至 2021 年 12 月 31 日，基金管理人共管理六十八只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈亘斯	本基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛信息安全量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2019 年 5 月 30 日	-	12 年	陈亘斯先生，硕士。曾任 PineRiver 资产管理公司量化分析师，国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理，北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；  
2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公

司相关制度等规定, 通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行, 确保公平对待不同投资组合, 切实防范利益输送, 保护投资者的合法权益。

公司对管理的不同投资组合过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析, 计算溢价率、贡献率、占优比等指标, 使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验, 未发现违反公平交易原则及利益输送的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内, 本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年 A 股市场总体呈现区间震荡, 以结构性行情为主。春节前由于大市值的龙头公司的估值提升, 核心资产的市值加权后的整体风险溢价率处于历史低位水平, 叠加美国长期利率水平跳升和美元汇率暂时走强, 使得海外的具有套利性质的资金出现从陆股通撤出的迹象, 进而缺失了对核心资产交易的足够的流动性支持。核心资产整体发生快速深幅的回撤。但同时我们看到以红利股为代表的低估值价值股重新受到关注, 同时中小市值的高质量成长股开始活跃。估值和市值两个层面的风格开始发生转换。上半年在国内外经济显著复苏以及疫苗的快速推广的背景下, 上市公司的业绩高增长受到市场充分定价, 其中成长股的行情起起伏伏的贯穿前三季度, 由大盘成长板块向中盘以及小盘成长依次接力。在三季度末四季度初市场开始担忧 2022 年经济增长的持续性以及海外美联储应对通胀的紧缩政策可能带来的外部流动性收紧而带来成长股与价值股之间的风格频繁切换, 造成 A 股的波动显著放大。投资者整体对于上市公司业绩表现的评估逐步由 2021 年切换为 2022 年, 基于 CPI 相对于 PPI 收敛路径以及 2022 年政策对经济和产业的稳增长作用等投资逻辑的出发点重新调整投资组合。

在操作中, 我们严格遵守基金合同, 在指数权重调整和基金申赎变动时, 应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.834 元; 本报告期基金份额净值增长率为 8.46%, 业绩比较基准收益率为-0.58%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0360%, 年度化跟踪误差为 1.6727%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年, 预期国内货币以及财政政策发力将带来的对于基建相关板块譬如家居、建材、公用

事业等的业绩改善。过去两年受到疫情负面影响的行业的走势开始出现长期趋势的反转，这一现象本身也是对此类行业基本面随着明年疫情得到有效控制和平息的展望，更是考虑到 GDP 之三驾马车中的出口在过去两年的高增速的持续性有可能减弱，其他两架马车较可能发挥更大作用以增强内循环部分的这一情景。海外方面随着上半年美国经济强劲恢复以及美国通胀数据可能达到历史性高位，美联储的政策目标会大概率转向优先治理通胀，加快加息步伐，美债利率上行压力加大，进而会通过利差水平的传导进一步压制成长因子。A 股的估值水平可能会受到流动性边际变紧的压制，业绩增长及其持续性将扮演更重要的角色。此外随着全球对疫情管制的放开以及生产的逐步恢复，我国对外出口对经济的拉动存在弱化的趋势，经常账户带来的流动性支撑也将受到挑战。投资人需要关注过高估值水平的成长股与其成长性的不匹配带来下行风险。另一方面，如果上半年美联储的紧缩政策的力度和节奏高于其国内经济依赖的全球供应链的恢复程度，并且以过分压制其国内的总需求作为控制通胀的对价，那么下半年美国经济进入衰退的概率反而会对美联储的政策连贯性形成掣肘，进而减轻 A 股市场的估值压力。因此 2022 年 A 股风格和板块的切换会更加多变更具挑战性，需要我们持续跟踪经济形势变化和政策工具箱的使用情况。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

2、持续完善公司制度规章体系建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时督促、提示业务部门进行相关制度、流程的新订、修订与完善，保证公司制度规章的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司除完成有关制度的新订、修订工作外，还要求业务部门就制度、流程变化内容与其他相关执行部门进行沟通，确保各相关部门对新订、修订内容的理解保持一致，保证制度、流程被严格执行。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》的规定，通过量化分析、

日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待，防范非公平交易和利益输送。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

#### **4.7.1 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定, 本基金于本报告期内未进行利润分配。

本基金截至 2021 年 12 月 31 日, 期末可供分配利润为 65,227,060.20 元, 其中, 未分配利润已实现部分为 149,478,041.09 元, 未分配利润未实现部分为-84,250,980.89 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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 20934 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) (以下简称“长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF)”) 的财务报表, 包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表, 2021 年度的利润表和所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会 (以下简称“中国基金业协会”) 发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF) 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF), 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF) 的基金管理人长盛基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务

	<p>操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审</p>

	<p>计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF) 不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇   叶尔甸
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2022 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	9,746,598.73	16,946,147.35
结算备付金		-	-
存出保证金		7,315.96	63,821.98
交易性金融资产	7.4.7.2	147,883,040.05	276,069,701.87
其中：股票投资		147,655,774.45	275,812,063.07
基金投资		-	-
债券投资		227,265.60	257,638.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		6,376.46	668,811.91
应收利息	7.4.7.5	967.46	5,950.79
应收股利		-	-
应收申购款		11,081.90	15,730.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		157,655,380.56	293,770,164.62
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		64,969.10	203,586.57
应付管理人报酬		132,503.91	340,119.29
应付托管费		29,150.84	74,826.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,724.80	139,173.58
应交税费		-	1.21
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,167,771.17	1,287,806.01
负债合计		1,398,119.82	2,045,512.88
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	91,030,200.54	184,245,536.60
未分配利润	7.4.7.10	65,227,060.20	107,479,115.14
所有者权益合计		156,257,260.74	291,724,651.74
负债和所有者权益总计		157,655,380.56	293,770,164.62

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.834 元，基金份额总额 85,214,541.08 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		27,927,932.57	123,619,656.54
1.利息收入		40,936.60	160,609.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	40,860.43	160,454.59
债券利息收入		76.17	154.89
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）		71,440,490.77	96,638,404.72
其中：股票投资收益	7.4.7.12	68,850,985.67	89,881,891.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	63,391.95	193,878.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,526,113.15	6,562,635.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-43,762,837.43	26,408,724.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	209,342.63	411,918.31
<b>减：二、费用</b>		2,826,523.90	6,242,938.85
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,697,831.47	3,964,011.53

2. 托管费	7.4.10.2.2	373,522.92	872,082.54
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	509,920.44	1,159,074.99
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.10	0.44
7. 其他费用	7.4.7.20	245,248.97	247,769.35
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		25,101,408.67	117,376,717.69
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		25,101,408.67	117,376,717.69

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	184,245,536.60	107,479,115.14	291,724,651.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	25,101,408.67	25,101,408.67
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)	-93,215,336.06	-67,353,463.61	-160,568,799.67
其中: 1. 基金申购款	25,795,777.11	13,872,561.20	39,668,338.31
2. 基金赎回款	-119,011,113.17	-81,226,024.81	-200,237,137.98
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)	91,030,200.54	65,227,060.20	156,257,260.74
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基	272,510,815.04	97,386,589.13	369,897,404.17

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	117,376,717.69	117,376,717.69
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)	-88,265,278.44	-50,799,849.14	-139,065,127.58
其中: 1. 基金申购款	199,051,572.24	87,934,935.65	286,986,507.89
2. 基金赎回款	-287,316,850.68	-138,734,784.79	-426,051,635.47
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)	-	-56,484,342.54	-56,484,342.54
五、期末所有者权益 (基金净值)	184,245,536.60	107,479,115.14	291,724,651.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

<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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)是由原长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 (以下简称“原基金”)转型而来。根据原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》，原基金分级运作期为三年，分级运作期届满后转为上市开放式基金 (LOF)。根据深圳证券交易所深证上[2015]205 号《终止上市同意书》，原基金于 2015 年 5 月 20 日进行基金份额权益登记，于 2015 年 5 月 21 日终止上市。自 2015 年 5 月 22 日起，原基金分级运作期届满自动转为上市开放式基金 (LOF)，并更名为长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)。经向中国证监会备案，《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)》于 2015 年 5 月 22 日正式生效，本基金为契约型开放式，存续期间不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金在分级运作期内的基金份额包括长盛同庆中证 800 分级份额 (以下简称“同庆分级份额”)、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额 (以下简称“同庆 800A”)以及长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之积极收益类

份额(以下简称“同庆 800B”)。原基金在分级运作期届满后,根据同庆 800A 和同庆 800B 基金份额转换比例对基金份额持有人基金份额转换基准日登记在册的基金份额实施转换,按照本基金基金合同参考净值计算规则分别对同庆 800A 份额和同庆 800B 份额计算分级运作期期末基金份额参考净值,并按照各自的份额参考净值转换为本基金基金份额。于 2015 年 5 月 21 日(基金份额转换日)日终,同庆 800A 转换前份额数为 157,659,406.00 份,转换比例为 0.593624387,转换后对应本基金份额数为 93,590,468.00 份;同庆 800B 转换前份额数为 236,489,110.00 份,转换比例为 1.270917071,转换后对应本基金份额数为 300,558,047.00 份;同庆分级份额转换前份额数为 148,119,975.78 份,转换后对应本基金份额数为 148,119,975.78 份。截至 2015 年 5 月 21 日转换完成当日,本基金基金份额总额为 542,268,490.78 份。本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司根据原基金基金合同约定,对同庆 800A、同庆 800B 的份额持有人的基金份额进行了计算,并向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

经深圳证券交易所深证上[2015]378 号审核同意,本基金 292,227,017.00 份基金份额于 2015 年 8 月 6 日在深圳证券交易所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、货币市场工具、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的相关规定)。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%,其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%;其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种,其中权证资产占基金资产净值的比例为 0—3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券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。本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率 $\times$ 95%+一年期银行定期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发

布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

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

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金

份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中债金融估值中心有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固

定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》,本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则,该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府

债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	9,746,598.73	16,946,147.35
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：	9,746,598.73	16,946,147.35

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	122,140,741.27	147,655,774.45	25,515,033.18
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	218,600.00	227,265.60	8,665.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	218,600.00	227,265.60	8,665.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		122,359,341.27	147,883,040.05	25,523,698.78
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		206,528,165.66	275,812,063.07	69,283,897.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	255,000.00	257,638.80	2,638.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	255,000.00	257,638.80	2,638.80
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		206,783,165.66	276,069,701.87	69,286,536.21

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	952.92	5,901.86
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	11.24	20.23
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	3.30	28.70
合计	967.46	5,950.79

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,724.80	139,173.58
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,724.80	139,173.58

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	234.38	269.22
应付证券出借违约金	-	-
其他	607,536.79	607,536.79
预提费用	60,000.00	180,000.00
合计	1,167,771.17	1,287,806.01

#### 7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	172,510,529.46	184,245,536.60
本期申购	24,147,776.61	25,795,777.11
本期赎回(以“-”号填列)	-111,443,764.99	-119,011,113.17
- 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	85,214,541.08	91,030,200.54

注：1、申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

2、截至 2021 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 43,850,559.00 份(2020 年 12 月 31 日：49,731,481.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 41,363,982.08 份(2020 年 12 月 31 日：122,779,048.46 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	174,066,307.75	-66,587,192.61	107,479,115.14
本期利润	68,864,246.10	-43,762,837.43	25,101,408.67
本期基金份额交易产生的变动数	-93,452,512.76	26,099,049.15	-67,353,463.61
其中：基金申购款	37,158,372.03	-23,285,810.83	13,872,561.20
基金赎回款	-130,610,884.79	49,384,859.98	-81,226,024.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	149,478,041.09	-84,250,980.89	65,227,060.20

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	39,542.42	156,767.63
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	608.43	2,777.79
其他	709.58	909.17
合计	40,860.43	160,454.59

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	213,319,003.54	435,664,167.21
减：卖出股票成本总额	144,468,017.87	345,782,275.93
买卖股票差价收入	68,850,985.67	89,881,891.28

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	63,391.95	193,878.00
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	63,391.95	193,878.00

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	499,277.95	857,616.34
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	435,800.00	663,600.00
减：应收利息总额	86.00	138.34
买卖债券差价收入	63,391.95	193,878.00

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

注：无。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

注：无。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
股票投资产生的股利收益	2,526,113.15	6,562,635.44
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	2,526,113.15	6,562,635.44
----	--------------	--------------

#### 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
1. 交易性金融资产	-43,762,837.43	26,408,724.03
——股票投资	-43,768,864.23	26,406,085.23
——债券投资	6,026.80	2,638.80
——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	-43,762,837.43	26,408,724.03

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
基金赎回费收入	105,761.57	384,524.10
基金转换费收入	103,581.06	27,394.21
合计	209,342.63	411,918.31

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

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

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
交易所市场交易费用	509,920.44	1,159,074.99
银行间市场交易费用	-	-

合计	509,920.44	1,159,074.99
----	------------	--------------

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
深交所上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款费用	5,248.97	7,769.35
合计	245,248.97	247,769.35

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司 (“长盛基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司 (“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司 (“国元证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用融资担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国元证券	-	-	31,139,315.52	4.74%

#### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
国元证券	-	-	1,131,299.20	63.69%

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国元证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国元证券	28,733.20	5.08%	8,595.90	6.18%

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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,697,831.47	3,964,011.53
其中：支付销售机构的客户维护费	125,492.99	120,519.99

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 1.00%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×1.00%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	373,522.92	872,082.54

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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×0.22%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
基金合同生效日 ( 2015 年 5 月 22 日 ) 持有的基金份额	-	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	7,142,857.14	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-	7,142,857.14	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-

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

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

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

注: 无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	9,746,598.73	39,542.42	16,946,147.35	156,767.63

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管, 按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注: 无。

## 7.4.12 期末 (2021 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位: 人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	10.52	10.52	4,491	47,245.32	47,245.32	-
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
688789	宏华数科	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	限售期锁定	30.28	258.25	1,237	37,456.36	319,455.25	-
688793	倍轻松	2021 年 7 月 7 日	2022 年 1 月 17 日	限售期锁定	27.40	101.41	1,454	39,839.60	147,450.14	-
688103	国力股份	2021 年 9 月 2 日	2022 年 3 月 10 日	限售期锁定	12.04	66.07	1,595	19,203.80	105,381.65	-
688787	海天瑞声	2021 年 8 月 5 日	2022 年 2 月 14 日	限售期锁定	36.94	87.30	817	30,179.98	71,324.10	-
688767	博拓生物	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 8 日	限售期锁定	34.55	66.37	1,012	34,964.60	67,166.44	-
688049	炬芯科技	2021 年 11 月 22 日	2022 年 5 月 30 日	限售期锁定	42.98	58.05	1,123	48,266.54	65,190.15	-
688272	富吉瑞	2021 年 10 月 8 日	2022 年 4 月 18 日	限售期锁定	22.56	43.56	1,263	28,493.28	55,016.28	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	限售期锁定	6.42	15.75	2,693	17,289.06	42,414.75	-
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	限售期锁定	14.14	89.74	359	5,076.26	32,216.66	-
301069	凯盛新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月	限售期锁定	5.17	44.15	539	2,786.63	23,796.85	-

		日	28 日							
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	限售期 锁定	8.29	26.02	782	6,482.78	20,347.64	-
301060	兰卫医学	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	限售期 锁定	4.17	30.91	587	2,447.79	18,144.17	-
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	限售期 锁定	60.64	234.57	77	4,669.28	18,061.89	-
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	限售期 锁定	11.90	45.42	328	3,903.20	14,897.76	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	限售期 锁定	8.34	48.96	290	2,418.60	14,198.40	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	限售期 锁定	8.86	23.76	555	4,917.30	13,186.80	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	限售期 锁定	10.64	30.38	421	4,479.44	12,789.98	-
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	限售期 锁定	18.03	62.64	203	3,660.09	12,715.92	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	限售期 锁定	9.46	41.39	290	2,743.40	12,003.10	-
301035	润丰股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 28 日	限售期 锁定	22.04	56.23	199	4,385.96	11,189.77	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 28 日	限售期 锁定	4.13	12.95	826	3,411.38	10,696.70	-
301127	天源环保	2021 年 12 月 23 日	2022 年 6 月 30 日	限售期 锁定	12.03	19.21	549	6,604.47	10,546.29	-
301039	中集车辆	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	限售期 锁定	6.96	12.44	764	5,317.44	9,504.16	-
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	限售期 锁定	5.31	13.49	697	3,701.07	9,402.53	-
300774	倍杰	2021 年	2022	限售期	4.57	20.90	444	2,029.08	9,279.60	-

	特	7月26日	2022年2月16日	锁定							
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	限售期锁定	13.57	38.41	241	3,270.37	9,256.81		-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	限售期锁定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23		-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	限售期锁定	1.55	20.84	403	624.65	8,398.52		-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	限售期锁定	8.40	23.80	328	2,755.20	7,806.40		-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	限售期锁定	6.90	21.69	355	2,449.50	7,699.95		-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	限售期锁定	15.14	59.93	108	1,635.12	6,472.44		-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	限售期锁定	4.97	12.49	513	2,549.61	6,407.37		-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	限售期锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48		-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	限售期锁定	7.31	28.18	215	1,571.65	6,058.70		-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	限售期锁定	7.46	33.38	181	1,350.26	6,041.78		-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	限售期锁定	19.34	32.88	181	3,500.54	5,951.28		-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	限售期锁定	66.18	57.13	97	6,419.46	5,541.61		-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	限售期锁定	9.96	27.28	203	2,021.88	5,537.84		-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	限售期锁定	17.40	36.13	153	2,662.20	5,527.89		-

301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	限售期锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	限售期锁定	8.09	19.29	259	2,095.31	4,996.11	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	限售期锁定	23.38	29.80	164	3,834.32	4,887.20	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	限售期锁定	11.45	16.61	286	3,274.70	4,750.46	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	限售期锁定	14.82	24.17	193	2,860.26	4,664.81	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	限售期锁定	12.24	32.06	144	1,762.56	4,616.64	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	限售期锁定	8.03	19.01	218	1,750.54	4,144.18	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	限售期锁定	13.98	28.36	144	2,013.12	4,083.84	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021年12月28日	2022年1月14日	配债未上市	100.00	100.00	1,910	191,000.00	191,000.00	-
113634	珀莱转债	2021年12月9日	2022年1月4日	配债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-

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。

#### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：无。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

注：无。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风

险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行,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 2021 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 0.15% (2020 年 12 月 31 日: 0.09%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 12 月 31 日,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持证券均在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金主动投资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 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### **7.4.13.4 市场风险**

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2021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	9,746,598.73	-	-	-	9,746,598.73
存出保证金	7,315.96	-	-	-	7,315.96
交易性金融资产	-	-	227,265.60	147,655,774.45	147,883,040.05
应收证券清算款	-	-	-	6,376.46	6,376.46
应收利息	-	-	-	967.46	967.46
应收申购款	-	-	-	11,081.90	11,081.90
资产总计	9,753,914.69	-	227,265.60	147,674,200.27	157,655,380.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	64,969.10	64,969.10
应付管理人报酬	-	-	-	132,503.91	132,503.91
应付托管费	-	-	-	29,150.84	29,150.84
应付交易费用	-	-	-	3,724.80	3,724.80
其他负债	-	-	-	1,167,771.17	1,167,771.17
负债总计	-	-	-	1,398,119.82	1,398,119.82
利率敏感度缺口	9,753,914.69	-	227,265.60	146,276,080.45	156,257,260.74
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	16,946,147.35	-	-	-	16,946,147.35
存出保证金	63,821.98	-	-	-	63,821.98
交易性金融资产	-	-	257,638.80	275,812,063.07	276,069,701.87
应收证券清算款	-	-	-	668,811.91	668,811.91
应收利息	-	-	-	5,950.79	5,950.79

应收申购款	-	-	-	15,730.72	15,730.72
资产总计	17,009,969.33	-	257,638.80	276,502,556.49	293,770,164.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	203,586.57	203,586.57
应付管理人报酬	-	-	-	340,119.29	340,119.29
应付托管费	-	-	-	74,826.22	74,826.22
应付交易费用	-	-	-	139,173.58	139,173.58
应交税费	-	-	-	1.21	1.21
其他负债	-	-	-	1,287,806.01	1,287,806.01
负债总计	-	-	-	2,045,512.88	2,045,512.88
利率敏感度缺口	17,009,969.33	-	257,638.80	274,457,043.61	291,724,651.74

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 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 0.15% (2020 年 12 月 31 日：0.09%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以复制、跟踪中证 800 指数为原则，进行指数化长期投资，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金

资产净值的比例为 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	147,655,774.45	94.50	275,812,063.07	94.55
合计	147,655,774.45	94.50	275,812,063.07	94.55

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2021 年 12 月 31 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准 (附注 7.4.1) 上升 5%	7,957,596.32	14,089,788.70
2. 业绩比较基准 (附注 7.4.1) 下降 5%	-7,957,596.32	-14,089,788.70	

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 146,377,448.54 元，属于第二层次的余额为 245,749.81 元，属于第三层次

的余额为 1,259,841.70 元 (2020 年 12 月 31 日: 第一层次的余额为 270,536,829.02 元, 第二层次的余额为 5,532,872.85 元, 无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日,本基金持有的第三层次的交易性金融资产(均为交易所股票投资)的公允价值为 1,259,841.70 元 (2020 年 12 月 31 日: 无)。本基金本年度购买第三层次的交易性金融资产的金额为 378,884.61 元 (2020 年度: 无), 计入损益的第三层次的交易性金融资产公允价值变动或当期投资收益的金额为 880,957.09 元 (2020 年 12 月 31 日: 无)。

于 2021 年 12 月 31 日,本基金仍持有的第三层次的交易性金融资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失为 880,957.09 元。上述第三层次的交易性金融资产采用平均价格亚式期权模型作为估值技术进行估值,不可观察输入值为预期波动率,于公允价值之间为负相关关系(2020 年 12 月 31 日: 无)。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日,本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质,新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定, 并采用准则允许的实务简便方法, 调整期初所有者权益, 2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	147,655,774.45	93.66
	其中：股票	147,655,774.45	93.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	227,265.60	0.14
	其中：债券	227,265.60	0.14
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,746,598.73	6.18
8	其他各项资产	25,741.78	0.02
9	合计	157,655,380.56	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,749,854.80	1.12
B	采矿业	3,231,686.31	2.07
C	制造业	79,586,262.99	50.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,155,012.27	2.02
E	建筑业	2,968,292.57	1.90
F	批发和零售业	1,876,250.19	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	3,751,910.34	2.40
H	住宿和餐饮业	131,146.80	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,778,456.06	4.34
J	金融业	27,334,078.30	17.49
K	房地产业	3,076,203.38	1.97
L	租赁和商务服务业	2,111,829.20	1.35
M	科学研究和技术服务业	1,645,967.44	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	87,768.33	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	68,382.00	0.04
Q	卫生和社会工作	1,190,893.28	0.76
R	文化、体育和娱乐业	848,934.95	0.54
S	综合	317,272.41	0.20
	合计	139,910,201.62	89.54

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	74,903.28	0.05
C	制造业	5,584,847.13	3.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	122,725.00	0.08
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	71,310.40	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	209,782.47	0.13
H	住宿和餐饮业	4,616.64	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	702,572.97	0.45
J	金融业	324,055.68	0.21
K	房地产业	74,060.40	0.05
L	租赁和商务服务业	33,228.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	334,901.36	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	31,315.01	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,144.17	0.01
R	文化、体育和娱乐业	154,396.52	0.10
S	综合	-	-
	合计	7,745,572.83	4.96

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	3,503	7,181,150.00	4.60

2	600036	招商银行	71,216	3,468,931.36	2.22
3	601318	中国平安	60,018	3,025,507.38	1.94
4	000858	五粮液	10,998	2,448,814.68	1.57
5	000333	美的集团	27,038	1,995,674.78	1.28
6	601012	隆基股份	22,977	1,980,617.40	1.27
7	300059	东方财富	45,468	1,687,317.48	1.08
8	601166	兴业银行	79,171	1,507,415.84	0.96
9	600900	长江电力	61,920	1,405,584.00	0.90
10	002594	比亚迪	5,084	1,363,122.08	0.87
11	600887	伊利股份	31,634	1,311,545.64	0.84
12	002475	立讯精密	26,552	1,306,358.40	0.84
13	002415	海康威视	24,591	1,286,601.12	0.82
14	600276	恒瑞医药	24,202	1,227,283.42	0.79
15	600030	中信证券	45,934	1,213,116.94	0.78
16	601888	中国中免	5,512	1,209,387.92	0.77
17	603259	药明康德	10,168	1,205,721.44	0.77
18	000568	泸州老窖	4,134	1,049,498.58	0.67
19	603501	韦尔股份	3,300	1,025,541.00	0.66
20	000651	格力电器	25,923	959,928.69	0.61
21	300274	阳光电源	6,560	956,448.00	0.61
22	000725	京东方 A	177,907	898,430.35	0.57
23	600309	万华化学	8,479	856,379.00	0.55
24	600436	片仔癀	1,945	850,256.75	0.54
25	601398	工商银行	180,112	833,918.56	0.53
26	000002	万科 A	41,654	823,083.04	0.53
27	002142	宁波银行	21,366	817,890.48	0.52
28	002241	歌尔股份	14,854	803,601.40	0.51
29	600809	山西汾酒	2,434	768,608.52	0.49
30	600438	通威股份	17,000	764,320.00	0.49
31	000001	平安银行	45,779	754,437.92	0.48
32	603288	海天味业	7,152	751,746.72	0.48
33	600031	三一重工	32,829	748,501.20	0.48
34	300014	亿纬锂能	6,300	744,534.00	0.48
35	002714	牧原股份	13,895	741,437.20	0.47
36	600048	保利发展	46,424	725,607.12	0.46
37	002466	天齐锂业	6,761	723,427.00	0.46
38	600690	海尔智家	23,872	713,534.08	0.46
39	600406	国电南瑞	17,702	708,611.06	0.45
40	601899	紫金矿业	69,627	675,381.90	0.43

41	601328	交通银行	145,470	670,616.70	0.43
42	600111	北方稀土	14,583	667,901.40	0.43
43	601919	中远海控	34,190	639,011.10	0.41
44	600837	海通证券	51,449	630,764.74	0.40
45	002460	赣锋锂业	4,200	599,970.00	0.38
46	601816	京沪高铁	123,200	595,056.00	0.38
47	002304	洋河股份	3,595	592,204.35	0.38
48	300124	汇川技术	8,602	590,097.20	0.38
49	002352	顺丰控股	8,500	585,820.00	0.37
50	002271	东方雨虹	10,950	576,846.00	0.37
51	601688	华泰证券	32,291	573,488.16	0.37
52	300015	爱尔眼科	13,556	573,147.68	0.37
53	002129	中环股份	13,576	566,798.00	0.36
54	300498	温氏股份	29,400	566,244.00	0.36
55	601601	中国太保	20,840	565,180.80	0.36
56	000063	中兴通讯	16,562	554,827.00	0.36
57	300142	沃森生物	9,800	550,760.00	0.35
58	603986	兆易创新	3,100	545,135.00	0.35
59	601668	中国建筑	108,799	543,995.00	0.35
60	601288	农业银行	184,467	542,332.98	0.35
61	002371	北方华创	1,559	541,004.18	0.35
62	002027	分众传媒	65,900	539,721.00	0.35
63	002230	科大讯飞	10,150	532,976.50	0.34
64	600000	浦发银行	62,425	532,485.25	0.34
65	600585	海螺水泥	13,151	529,985.30	0.34
66	601211	国泰君安	29,300	524,177.00	0.34
67	300122	智飞生物	4,200	523,320.00	0.33
68	000338	潍柴动力	29,106	520,706.34	0.33
69	000100	TCL 科技	80,315	495,543.55	0.32
70	603799	华友钴业	4,390	484,260.90	0.31
71	000776	广发证券	19,586	481,619.74	0.31
72	000661	长春高新	1,768	479,835.20	0.31
73	601088	中国神华	21,296	479,585.92	0.31
74	601766	中国中车	77,487	471,895.83	0.30
75	603806	福斯特	3,600	469,980.00	0.30
76	600104	上汽集团	22,566	465,536.58	0.30
77	601229	上海银行	64,069	456,811.97	0.29
78	002049	紫光国微	2,000	450,000.00	0.29
79	002821	凯莱英	1,000	435,000.00	0.28

80	600660	福耀玻璃	9,153	431,472.42	0.28
81	600016	民生银行	110,395	430,540.50	0.28
82	601169	北京银行	95,794	425,325.36	0.27
83	600050	中国联通	106,472	418,434.96	0.27
84	600019	宝钢股份	58,059	415,702.44	0.27
85	601988	中国银行	135,238	412,475.90	0.26
86	600570	恒生电子	6,628	411,930.20	0.26
87	600010	包钢股份	147,616	411,848.64	0.26
88	300347	泰格医药	3,170	405,126.00	0.26
89	601633	长城汽车	8,325	404,095.50	0.26
90	600745	闻泰科技	3,100	400,830.00	0.26
91	601669	中国电建	49,588	400,671.04	0.26
92	002311	海大集团	5,400	395,820.00	0.25
93	002709	天赐材料	3,440	394,396.00	0.25
94	600196	复星医药	7,974	390,247.56	0.25
95	601877	正泰电器	7,182	387,037.98	0.25
96	600588	用友网络	10,679	383,162.52	0.25
97	002410	广联达	5,941	380,105.18	0.24
98	300450	先导智能	5,100	379,287.00	0.24
99	600999	招商证券	21,300	375,945.00	0.24
100	002179	中航光电	3,703	372,373.68	0.24
101	600919	江苏银行	63,020	367,406.60	0.24
102	600028	中国石化	86,096	364,186.08	0.23
103	600893	航发动力	5,726	363,371.96	0.23
104	600958	东方证券	23,000	339,020.00	0.22
105	601818	光大银行	101,496	336,966.72	0.22
106	002493	荣盛石化	18,550	336,868.00	0.22
107	000768	中航西飞	9,091	331,821.50	0.21
108	601628	中国人寿	10,947	329,395.23	0.21
109	002001	新和成	10,300	320,536.00	0.21
110	601225	陕西煤业	25,992	317,102.40	0.20
111	600346	恒力石化	13,700	314,689.00	0.20
112	300408	三环集团	7,000	312,200.00	0.20
113	601857	中国石油	63,231	310,464.21	0.20
114	002008	大族激光	5,721	308,934.00	0.20
115	600426	华鲁恒升	9,739	304,830.70	0.20
116	002202	金风科技	18,461	304,052.67	0.19
117	600009	上海机场	6,504	303,671.76	0.19
118	002050	三花智控	11,978	303,043.40	0.19

119	601009	南京银行	33,601	301,064.96	0.19
120	300316	晶盛机电	4,300	298,850.00	0.19
121	600741	华域汽车	10,533	298,083.90	0.19
122	601390	中国中铁	51,299	297,021.21	0.19
123	600176	中国巨石	16,104	293,092.80	0.19
124	002236	大华股份	12,149	285,258.52	0.18
125	000166	申万宏源	55,151	282,373.12	0.18
126	600011	华能国际	28,700	278,103.00	0.18
127	601377	兴业证券	28,102	277,647.76	0.18
128	600522	中天科技	16,298	276,414.08	0.18
129	001979	招商蛇口	20,636	275,284.24	0.18
130	300413	芒果超媒	4,800	274,656.00	0.18
131	688111	金山办公	1,021	270,565.00	0.17
132	000625	长安汽车	17,768	269,895.92	0.17
133	600760	中航沈飞	3,940	268,077.60	0.17
134	601600	中国铝业	42,472	258,654.48	0.17
135	600132	重庆啤酒	1,700	257,244.00	0.16
136	600884	杉杉股份	7,691	252,034.07	0.16
137	002340	格林美	24,200	250,470.00	0.16
138	601989	中国重工	59,126	249,511.72	0.16
139	601006	大秦铁路	38,728	247,859.20	0.16
140	000977	浪潮信息	6,874	246,295.42	0.16
141	603369	今世缘	4,500	244,800.00	0.16
142	002555	三七互娱	8,900	240,478.00	0.15
143	600795	国电电力	75,753	240,137.01	0.15
144	603993	洛阳钼业	42,656	238,020.48	0.15
145	000963	华东医药	5,879	236,335.80	0.15
146	002268	卫士通	4,200	234,948.00	0.15
147	601186	中国铁建	29,951	233,617.80	0.15
148	601555	东吴证券	26,128	231,494.08	0.15
149	600885	宏发股份	3,100	231,384.00	0.15
150	000538	云南白药	2,211	231,381.15	0.15
151	600547	山东黄金	12,134	228,361.88	0.15
152	000009	中国宝安	15,739	227,113.77	0.15
153	600015	华夏银行	40,263	225,472.80	0.14
154	002812	恩捷股份	900	225,360.00	0.14
155	601336	新华保险	5,759	223,909.92	0.14
156	300285	国瓷材料	5,200	221,364.00	0.14
157	601868	中国能建	80,933	220,947.09	0.14

158	000938	紫光股份	9,602	219,405.70	0.14
159	601100	恒立液压	2,656	217,260.80	0.14
160	600352	浙江龙盛	17,062	215,493.06	0.14
161	600298	安琪酵母	3,568	215,364.48	0.14
162	601658	邮储银行	42,226	215,352.60	0.14
163	002007	华兰生物	7,330	213,596.20	0.14
164	300601	康泰生物	2,167	213,536.18	0.14
165	601901	方正证券	27,204	213,279.36	0.14
166	601985	中国核电	25,588	212,380.40	0.14
167	000876	新希望	13,912	211,601.52	0.14
168	688396	华润微	3,243	209,497.80	0.13
169	300088	长信科技	15,720	208,761.60	0.13
170	002013	中航机电	11,419	207,597.42	0.13
171	600886	国投电力	17,978	206,207.66	0.13
172	000786	北新建材	5,724	205,090.92	0.13
173	000895	双汇发展	6,437	203,087.35	0.13
174	601916	浙商银行	58,000	203,000.00	0.13
175	002385	大北农	19,210	201,512.90	0.13
176	600763	通策医疗	1,000	199,000.00	0.13
177	601800	中国交建	23,167	198,772.86	0.13
178	603019	中科曙光	7,100	195,747.00	0.13
179	601117	中国化学	16,300	195,600.00	0.13
180	600383	金地集团	15,062	195,354.14	0.13
181	300433	蓝思科技	8,500	195,330.00	0.13
182	600926	杭州银行	15,200	194,864.00	0.12
183	300253	卫宁健康	11,548	193,544.48	0.12
184	000783	长江证券	25,294	190,716.76	0.12
185	300003	乐普医疗	8,400	190,092.00	0.12
186	002601	龙佰集团	6,600	188,694.00	0.12
187	000157	中联重科	26,235	188,104.95	0.12
188	601108	财通证券	16,700	185,704.00	0.12
189	688036	传音控股	1,179	184,985.10	0.12
190	002736	国信证券	16,100	184,828.00	0.12
191	002185	华天科技	14,500	184,295.00	0.12
192	601155	新城控股	6,200	180,606.00	0.12
193	600109	国金证券	15,892	180,056.36	0.12
194	600029	南方航空	26,382	179,661.42	0.11
195	600183	生益科技	7,609	179,191.95	0.11
196	601111	中国国航	19,624	179,167.12	0.11

197	603882	金域医学	1,600	178,192.00	0.11
198	603893	瑞芯微	1,300	177,970.00	0.11
199	603589	口子窖	2,500	177,175.00	0.11
200	000069	华侨城 A	25,141	176,992.64	0.11
201	601618	中国中冶	46,006	176,202.98	0.11
202	601838	成都银行	14,633	175,596.00	0.11
203	300595	欧普康视	3,060	175,552.20	0.11
204	000425	徐工机械	28,854	172,835.46	0.11
205	002138	顺络电子	4,500	171,810.00	0.11
206	601168	西部矿业	12,563	170,982.43	0.11
207	603899	晨光文具	2,600	167,726.00	0.11
208	000630	铜陵有色	47,923	166,772.04	0.11
209	600392	盛和资源	8,391	164,631.42	0.11
210	600516	方大炭素	15,171	164,150.22	0.11
211	002120	韵达股份	8,000	163,680.00	0.10
212	600085	同仁堂	3,634	163,457.32	0.10
213	600875	东方电气	7,500	160,650.00	0.10
214	002602	世纪华通	19,050	159,829.50	0.10
215	002223	鱼跃医疗	4,191	158,419.80	0.10
216	600989	宝丰能源	9,100	157,976.00	0.10
217	002353	杰瑞股份	3,938	157,520.00	0.10
218	603659	璞泰来	980	157,397.80	0.10
219	600362	江西铜业	7,035	157,091.55	0.10
220	601788	光大证券	10,500	156,765.00	0.10
221	601607	上海医药	7,837	155,721.19	0.10
222	000066	中国长城	10,985	155,547.60	0.10
223	600150	中国船舶	6,200	153,698.00	0.10
224	002080	中材科技	4,500	153,090.00	0.10
225	600143	金发科技	12,121	152,482.18	0.10
226	600115	中国东航	29,437	151,894.92	0.10
227	603486	科沃斯	1,000	150,950.00	0.10
228	603160	汇顶科技	1,400	150,878.00	0.10
229	300144	宋城演艺	10,500	150,360.00	0.10
230	603517	绝味食品	2,200	150,326.00	0.10
231	000988	华工科技	5,391	150,193.26	0.10
232	601689	拓普集团	2,800	148,400.00	0.09
233	000596	古井贡酒	608	148,352.00	0.09
234	002414	高德红外	6,098	147,632.58	0.09
235	000547	航天发展	8,813	147,177.10	0.09

236	000636	风华高科	4,936	147,092.80	0.09
237	002841	视源股份	1,800	146,520.00	0.09
238	002916	深南电路	1,200	146,184.00	0.09
239	601138	工业富联	12,200	145,424.00	0.09
240	600233	圆通速递	8,700	145,116.00	0.09
241	600529	山东药玻	3,300	144,870.00	0.09
242	300033	同花顺	1,000	144,580.00	0.09
243	600418	江淮汽车	8,300	144,420.00	0.09
244	000739	普洛药业	4,100	143,869.00	0.09
245	601799	星宇股份	700	142,975.00	0.09
246	300058	蓝色光标	13,251	142,183.23	0.09
247	000998	隆平高科	6,100	141,886.00	0.09
248	600061	国投资本	17,252	141,811.44	0.09
249	002044	美年健康	17,900	140,515.00	0.09
250	600705	中航产融	35,360	140,379.20	0.09
251	600079	人福医药	6,230	140,299.60	0.09
252	600487	亨通光电	9,260	140,011.20	0.09
253	600845	宝信软件	2,300	139,909.00	0.09
254	002507	涪陵榨菜	3,700	139,860.00	0.09
255	600256	广汇能源	21,248	138,961.92	0.09
256	600739	辽宁成大	7,012	136,874.24	0.09
257	688012	中微公司	1,074	135,968.40	0.09
258	600862	中航高科	3,800	135,888.00	0.09
259	600584	长电科技	4,355	135,092.10	0.09
260	002624	完美世界	6,650	135,061.50	0.09
261	002557	洽洽食品	2,200	134,992.00	0.09
262	002030	达安基因	6,701	134,422.06	0.09
263	300418	昆仑万维	5,800	134,270.00	0.09
264	600549	厦门钨业	5,910	133,743.30	0.09
265	002028	思源电气	2,717	133,703.57	0.09
266	600600	青岛啤酒	1,350	133,650.00	0.09
267	601360	三六零	10,500	133,560.00	0.09
268	600039	四川路桥	11,091	133,535.64	0.09
269	000960	锡业股份	6,810	132,999.30	0.09
270	002465	海格通信	12,134	132,503.28	0.08
271	300136	信维通信	5,200	131,664.00	0.08
272	601966	玲珑轮胎	3,600	131,580.00	0.08
273	600754	锦江酒店	2,238	131,146.80	0.08
274	600332	白云山	3,800	129,960.00	0.08

275	600161	天坛生物	4,432	128,350.72	0.08
276	600637	东方明珠	13,565	128,189.25	0.08
277	002422	科伦药业	6,700	126,831.00	0.08
278	603444	吉比特	300	126,555.00	0.08
279	600177	雅戈尔	18,284	125,976.76	0.08
280	002439	启明星辰	4,400	125,532.00	0.08
281	002195	二三四五	53,543	125,290.62	0.08
282	600018	上港集团	22,861	125,278.28	0.08
283	603605	珀莱雅	600	124,986.00	0.08
284	000703	恒逸石化	11,707	124,328.34	0.08
285	300037	新宙邦	1,100	124,300.00	0.08
286	603833	欧派家居	840	123,900.00	0.08
287	600201	生物股份	7,469	122,118.15	0.08
288	002508	老板电器	3,339	120,270.78	0.08
289	000400	许继电气	4,600	120,060.00	0.08
290	000623	吉林敖东	6,455	119,223.85	0.08
291	600879	航天电子	14,448	119,051.52	0.08
292	600642	申能股份	16,135	118,914.95	0.08
293	300296	利亚德	11,600	118,900.00	0.08
294	002078	太阳纸业	10,325	118,634.25	0.08
295	600486	扬农化工	900	118,080.00	0.08
296	002603	以岭药业	6,020	117,992.00	0.08
297	601128	常熟银行	17,700	116,997.00	0.07
298	601216	君正集团	22,208	116,147.84	0.07
299	600160	巨化股份	8,969	115,789.79	0.07
300	600118	中国卫星	4,196	113,921.40	0.07
301	600027	华电国际	21,200	113,420.00	0.07
302	601878	浙商证券	8,600	113,348.00	0.07
303	002797	第一创业	15,420	112,874.40	0.07
304	603707	健友股份	2,678	112,476.00	0.07
305	603338	浙江鼎力	1,400	112,364.00	0.07
306	600699	均胜电子	5,100	112,047.00	0.07
307	300558	贝达药业	1,400	111,762.00	0.07
308	600733	北汽蓝谷	11,080	111,021.60	0.07
309	603939	益丰药房	2,010	110,771.10	0.07
310	600038	中直股份	1,375	110,412.50	0.07
311	000629	攀钢钒钛	28,000	108,920.00	0.07
312	601997	贵阳银行	16,700	108,717.00	0.07
313	601198	东兴证券	9,300	108,159.00	0.07

314	600606	绿地控股	24,885	108,000.90	0.07
315	002131	利欧股份	43,803	107,755.38	0.07
316	300251	光线传媒	8,314	106,834.90	0.07
317	600859	王府井	3,954	106,758.00	0.07
318	600521	华海药业	4,900	106,134.00	0.07
319	600170	上海建工	29,096	104,745.60	0.07
320	003816	中国广核	33,400	104,542.00	0.07
321	002056	横店东磁	5,536	104,464.32	0.07
322	600655	豫园股份	10,089	103,916.70	0.07
323	601611	中国核建	10,400	103,688.00	0.07
324	000513	丽珠集团	2,572	103,420.12	0.07
325	600166	福田汽车	30,056	103,392.64	0.07
326	601238	广汽集团	6,800	103,292.00	0.07
327	600153	建发股份	11,364	103,071.48	0.07
328	000750	国海证券	24,971	102,630.81	0.07
329	000012	南玻 A	10,300	102,279.00	0.07
330	601021	春秋航空	1,800	102,240.00	0.07
331	600489	中金黄金	12,413	102,158.99	0.07
332	600867	通化东宝	9,300	101,928.00	0.07
333	601933	永辉超市	25,125	101,756.25	0.07
334	300529	健帆生物	1,900	101,270.00	0.06
335	300009	安科生物	7,720	101,054.80	0.06
336	600171	上海贝岭	3,920	100,587.20	0.06
337	600497	驰宏锌锗	20,100	100,299.00	0.06
338	002384	东山精密	3,700	100,270.00	0.06
339	600271	航天信息	7,476	100,103.64	0.06
340	300244	迪安诊断	2,980	100,038.60	0.06
341	002212	天融信	5,200	99,684.00	0.06
342	002221	东华能源	7,914	99,637.26	0.06
343	601881	中国银河	8,900	99,591.00	0.06
344	603156	养元饮品	3,500	99,435.00	0.06
345	002152	广电运通	8,350	99,365.00	0.06
346	000975	银泰黄金	11,245	98,731.10	0.06
347	600008	首创环保	28,835	98,327.35	0.06
348	600580	卧龙电驱	5,348	97,814.92	0.06
349	600704	物产中大	16,515	97,768.80	0.06
350	300628	亿联网络	1,200	97,740.00	0.06
351	002572	索菲亚	4,402	97,724.40	0.06
352	600535	天士力	6,162	97,667.70	0.06

353	600369	西南证券	18,292	96,764.68	0.06
354	000301	东方盛虹	5,000	96,700.00	0.06
355	000999	华润三九	2,824	96,693.76	0.06
356	601066	中信建投	3,300	96,525.00	0.06
357	600066	宇通客车	8,734	96,248.68	0.06
358	300618	寒锐钴业	1,200	96,216.00	0.06
359	300024	机器人	8,496	94,900.32	0.06
360	000970	中科三环	5,910	94,855.50	0.06
361	300026	红日药业	12,000	93,960.00	0.06
362	601998	中信银行	20,284	93,712.08	0.06
363	600315	上海家化	2,300	92,943.00	0.06
364	002673	西部证券	11,500	92,805.00	0.06
365	300212	易华录	2,620	92,617.00	0.06
366	300115	长盈精密	4,652	92,295.68	0.06
367	000878	云南铜业	6,900	92,253.00	0.06
368	600801	华新水泥	4,743	91,539.90	0.06
369	002156	通富微电	4,700	91,321.00	0.06
370	000997	新大陆	5,028	91,107.36	0.06
371	002250	联化科技	5,046	90,676.62	0.06
372	600673	东阳光	10,153	90,158.64	0.06
373	002739	万达电影	5,800	89,784.00	0.06
374	300315	掌趣科技	18,400	89,424.00	0.06
375	688008	澜起科技	1,064	89,237.68	0.06
376	000027	深圳能源	10,949	88,686.90	0.06
377	600021	上海电力	6,914	88,637.48	0.06
378	002019	亿帆医药	5,000	88,100.00	0.06
379	300070	碧水源	12,207	87,768.33	0.06
380	300017	网宿科技	13,095	87,605.55	0.06
381	603927	中科软	3,200	87,552.00	0.06
382	002153	石基信息	3,042	87,427.08	0.06
383	000050	深天马 A	6,700	87,234.00	0.06
384	600415	小商品城	17,973	87,169.05	0.06
385	600498	烽火通信	4,845	87,113.10	0.06
386	002500	山西证券	13,172	86,935.20	0.06
387	300182	捷成股份	13,700	86,721.00	0.06
388	600482	中国动力	4,390	86,483.00	0.06
389	300357	我武生物	1,500	85,950.00	0.06
390	002273	水晶光电	4,914	85,454.46	0.05
391	002926	华西证券	8,600	84,710.00	0.05

392	002252	上海莱士	12,400	84,568.00	0.05
393	601162	天风证券	20,800	84,240.00	0.05
394	000039	中集集团	4,900	84,084.00	0.05
395	600208	新湖中宝	28,087	83,699.26	0.05
396	600155	华创阳安	8,400	83,664.00	0.05
397	688099	晶晨股份	641	83,458.20	0.05
398	600909	华安证券	15,320	82,881.20	0.05
399	000686	东北证券	9,382	82,373.96	0.05
400	603858	步长制药	3,900	82,251.00	0.05
401	002203	海亮股份	6,600	82,038.00	0.05
402	002294	信立泰	3,000	81,960.00	0.05
403	002939	长城证券	6,300	81,585.00	0.05
404	002157	正邦科技	8,400	81,144.00	0.05
405	002032	苏泊尔	1,300	80,912.00	0.05
406	002831	裕同科技	2,400	80,856.00	0.05
407	300146	汤臣倍健	2,986	80,502.56	0.05
408	600839	四川长虹	24,200	80,102.00	0.05
409	603885	吉祥航空	4,500	79,875.00	0.05
410	600895	张江高科	5,289	79,652.34	0.05
411	600718	东软集团	5,859	79,448.04	0.05
412	600390	五矿资本	14,900	79,268.00	0.05
413	300482	万孚生物	2,010	79,153.80	0.05
414	600297	广汇汽车	29,600	79,032.00	0.05
415	600216	浙江医药	4,609	78,721.72	0.05
416	002127	南极电商	11,400	78,660.00	0.05
417	601005	重庆钢铁	37,600	78,584.00	0.05
418	000581	威孚高科	3,644	78,491.76	0.05
419	600728	佳都科技	9,400	78,302.00	0.05
420	000060	中金岭南	15,804	77,597.64	0.05
421	000729	燕京啤酒	9,100	77,077.00	0.05
422	601636	旗滨集团	4,500	76,950.00	0.05
423	002670	国盛金控	8,000	76,800.00	0.05
424	002004	华邦健康	10,547	76,360.28	0.05
425	600380	健康元	5,900	75,756.00	0.05
426	000021	深科技	4,763	75,445.92	0.05
427	000598	兴蓉环境	11,895	75,176.40	0.05
428	601179	中国西电	13,500	74,925.00	0.05
429	002690	美亚光电	2,000	74,920.00	0.05
430	002373	千方科技	5,000	74,750.00	0.05

431	600536	中国软件	1,486	74,195.98	0.05
432	600060	海信视像	5,473	73,611.85	0.05
433	600998	九州通	5,000	73,600.00	0.05
434	600848	上海临港	4,940	73,457.80	0.05
435	300630	普利制药	1,331	73,258.24	0.05
436	000401	冀东水泥	6,099	72,944.04	0.05
437	600528	中铁工业	8,876	72,871.96	0.05
438	600827	百联股份	5,376	71,662.08	0.05
439	300168	万达信息	5,500	71,610.00	0.05
440	002958	青农商行	18,500	71,410.00	0.05
441	601231	环旭电子	4,400	70,664.00	0.05
442	002511	中顺洁柔	4,200	70,182.00	0.04
443	002075	沙钢股份	12,000	69,960.00	0.04
444	600563	法拉电子	300	69,720.00	0.04
445	002281	光迅科技	2,982	69,450.78	0.04
446	000690	宝新能源	11,661	69,033.12	0.04
447	600967	内蒙一机	5,768	68,927.60	0.04
448	600511	国药股份	2,185	68,893.05	0.04
449	000877	天山股份	4,492	68,772.52	0.04
450	002607	中公教育	8,700	68,382.00	0.04
451	600325	华发股份	11,336	68,242.72	0.04
452	600567	山鹰国际	20,700	68,103.00	0.04
453	000709	河钢股份	27,647	68,011.62	0.04
454	000778	新兴铸管	15,682	67,903.06	0.04
455	600820	隧道股份	12,500	67,250.00	0.04
456	300001	特锐德	2,700	67,149.00	0.04
457	002174	游族网络	4,400	67,056.00	0.04
458	600667	太极实业	8,200	66,256.00	0.04
459	002396	星网锐捷	2,800	65,996.00	0.04
460	000800	一汽解放	6,400	65,856.00	0.04
461	002024	苏宁易购	15,982	65,845.84	0.04
462	600811	东方集团	21,708	65,341.08	0.04
463	601319	中国人保	13,900	65,330.00	0.04
464	603883	老百姓	1,320	65,181.60	0.04
465	600755	厦门国贸	9,040	65,178.40	0.04
466	000723	美锦能源	4,000	64,920.00	0.04
467	600598	北大荒	4,400	64,064.00	0.04
468	600282	南钢股份	17,200	63,640.00	0.04
469	300166	东方国信	5,800	62,640.00	0.04

470	600597	光明乳业	4,312	62,610.24	0.04
471	600572	康恩贝	12,467	62,335.00	0.04
472	002368	太极股份	2,245	61,827.30	0.04
473	600446	金证股份	4,300	61,576.00	0.04
474	001914	招商积余	3,000	60,780.00	0.04
475	601992	金隅集团	21,200	60,208.00	0.04
476	601118	海南橡胶	11,300	59,664.00	0.04
477	000656	金科股份	13,271	59,454.08	0.04
478	002938	鹏鼎控股	1,400	59,402.00	0.04
479	600037	歌华有线	6,800	59,024.00	0.04
480	601615	明阳智能	2,200	57,420.00	0.04
481	002429	兆驰股份	11,800	57,348.00	0.04
482	002180	纳思达	1,200	57,312.00	0.04
483	300133	华策影视	8,465	57,308.05	0.04
484	002110	三钢闽光	8,300	56,440.00	0.04
485	600026	中远海能	9,438	55,872.96	0.04
486	600167	联美控股	6,200	55,862.00	0.04
487	000089	深圳机场	7,600	55,632.00	0.04
488	603000	人民网	3,830	55,228.60	0.04
489	600064	南京高科	5,894	55,049.96	0.04
490	000807	云铝股份	4,900	54,733.00	0.04
491	000415	渤海租赁	18,800	54,708.00	0.04
492	688002	睿创微纳	694	54,527.58	0.03
493	002081	金螳螂	8,942	54,367.36	0.03
494	002065	东华软件	6,872	53,601.60	0.03
495	603658	安图生物	960	52,857.60	0.03
496	000488	晨鸣纸业	7,300	52,852.00	0.03
497	603233	大参林	1,240	52,216.40	0.03
498	300271	华宇软件	4,100	52,070.00	0.03
499	002233	塔牌集团	4,913	51,979.54	0.03
500	002387	维信诺	5,600	51,968.00	0.03
501	603228	景旺电子	1,500	51,795.00	0.03
502	000402	金融街	9,100	51,506.00	0.03
503	002242	九阳股份	2,217	51,434.40	0.03
504	000961	中南建设	12,175	50,404.50	0.03
505	601077	渝农商行	12,800	49,280.00	0.03
506	002146	荣盛发展	11,274	49,041.90	0.03
507	002382	蓝帆医疗	3,000	48,870.00	0.03
508	000090	天健集团	8,307	48,762.09	0.03

509	002124	天邦股份	7,440	47,913.60	0.03
510	002085	万丰奥威	8,700	47,763.00	0.03
511	600959	江苏有线	14,460	47,573.40	0.03
512	002458	益生股份	4,200	47,502.00	0.03
513	600808	马钢股份	12,800	47,232.00	0.03
514	601098	中南传媒	4,900	46,893.00	0.03
515	002399	海普瑞	2,701	46,187.10	0.03
516	600126	杭钢股份	9,000	46,170.00	0.03
517	601975	招商南油	22,600	45,426.00	0.03
518	300308	中际旭创	1,000	42,500.00	0.03
519	300699	光威复材	500	42,240.00	0.03
520	000158	常山北明	6,100	42,212.00	0.03
521	000062	深圳华强	2,400	41,352.00	0.03
522	002468	申通快递	4,500	40,905.00	0.03
523	000028	国药一致	1,100	40,678.00	0.03
524	002600	领益智造	5,300	39,008.00	0.02
525	002444	巨星科技	1,200	36,612.00	0.02
526	000156	华数传媒	4,300	36,378.00	0.02
527	000031	大悦城	9,700	36,181.00	0.02
528	300676	华大基因	400	35,120.00	0.02
529	000830	鲁西化工	2,100	32,046.00	0.02
530	000671	阳光城	10,532	31,806.64	0.02
531	000932	华菱钢铁	6,200	31,682.00	0.02
532	688009	中国通号	6,296	31,354.08	0.02
533	000046	泛海控股	16,500	31,020.00	0.02
534	603392	万泰生物	140	31,010.00	0.02
535	000708	中信特钢	1,400	28,672.00	0.02
536	688088	虹软科技	630	27,757.80	0.02
537	300223	北京君正	200	26,800.00	0.02
538	600872	中炬高新	700	26,579.00	0.02
539	600717	天津港	6,182	25,902.58	0.02
540	600316	洪都航空	600	23,436.00	0.01
541	002092	中泰化学	2,400	22,896.00	0.01
542	000825	太钢不锈	3,200	22,528.00	0.01
543	688321	微芯生物	638	22,336.38	0.01
544	603868	飞科电器	500	21,710.00	0.01
545	603983	丸美股份	600	19,122.00	0.01
546	601866	中远海发	5,700	18,525.00	0.01
547	688126	沪硅产业	714	18,435.48	0.01

548	603195	公牛集团	100	16,730.00	0.01
549	601990	南京证券	1,600	15,856.00	0.01
550	601236	红塔证券	1,300	15,496.00	0.01
551	601717	郑煤机	1,300	15,067.00	0.01
552	600970	中材国际	1,300	14,859.00	0.01
553	600737	中粮糖业	1,400	13,160.00	0.01
554	600141	兴发集团	300	11,364.00	0.01
555	601872	招商轮船	2,760	11,316.00	0.01
556	600918	中泰证券	1,000	9,970.00	0.01
557	601456	国联证券	700	9,779.00	0.01
558	601577	长沙银行	1,200	9,372.00	0.01
559	300677	英科医疗	150	8,676.00	0.01
560	600988	赤峰黄金	500	7,450.00	0.00
561	603638	艾迪精密	220	7,022.40	0.00
562	600409	三友化工	500	4,350.00	0.00

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600703	三安光电	15,558	584,358.48	0.37
2	600089	特变电工	24,588	520,527.96	0.33
3	688789	宏华数科	1,237	319,455.25	0.20
4	300207	欣旺达	7,200	303,552.00	0.19
5	300496	中科创达	2,000	276,840.00	0.18
6	002074	国轩高科	5,300	271,625.00	0.17
7	300012	华测检测	9,800	263,326.00	0.17
8	600460	士兰微	4,761	258,046.20	0.17
9	000799	酒鬼酒	1,200	255,000.00	0.16
10	300862	蓝盾光电	7,343	252,746.06	0.16
11	600219	南山铝业	45,600	214,776.00	0.14
12	002920	德赛西威	1,300	183,963.00	0.12
13	600779	水井坊	1,400	167,986.00	0.11
14	688793	倍轻松	1,454	147,450.14	0.09
15	002463	沪电股份	8,861	146,915.38	0.09
16	601233	桐昆股份	6,900	146,142.00	0.09
17	601099	太平洋	43,800	143,664.00	0.09
18	002648	卫星化学	3,240	129,697.20	0.08
19	688076	诺泰生物	3,084	127,461.72	0.08

20	600674	川投能源	9,818	122,725.00	0.08
21	002456	欧菲光	12,555	121,783.50	0.08
22	601018	宁波港	29,451	116,920.47	0.07
23	601727	上海电气	22,568	109,680.48	0.07
24	688103	国力股份	1,595	105,381.65	0.07
25	600004	白云机场	7,700	92,862.00	0.06
26	000860	顺鑫农业	2,311	88,233.98	0.06
27	600273	嘉化能源	7,500	86,775.00	0.06
28	002625	光启技术	3,600	86,436.00	0.06
29	300002	神州泰岳	13,135	83,144.55	0.05
30	600583	海油工程	16,248	74,903.28	0.05
31	600977	中国电影	5,800	74,298.00	0.05
32	000681	视觉中国	3,000	71,700.00	0.05
33	688787	海天瑞声	817	71,324.10	0.05
34	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.04
35	600881	亚泰集团	21,231	69,000.75	0.04
36	688767	博拓生物	1,012	67,166.44	0.04
37	601127	小康股份	1,100	65,505.00	0.04
38	688049	炬芯科技	1,123	65,190.15	0.04
39	002807	江阴银行	16,100	61,985.00	0.04
40	600804	鹏博士	9,612	59,594.40	0.04
41	688272	富吉瑞	1,263	55,016.28	0.04
42	002317	众生药业	4,282	51,769.38	0.03
43	600410	华胜天成	7,396	50,070.92	0.03
44	000627	天茂集团	14,700	48,657.00	0.03
45	002217	合力泰	13,900	48,511.00	0.03
46	002558	巨人网络	4,000	47,880.00	0.03
47	603888	新华网	2,000	47,520.00	0.03
48	301136	招标股份	4,491	47,245.32	0.03
49	603816	顾家家居	600	46,296.00	0.03
50	300113	顺网科技	2,800	45,668.00	0.03
51	000078	海王生物	12,500	44,125.00	0.03
52	688226	威腾电气	2,693	42,414.75	0.03
53	002773	康弘药业	2,000	40,700.00	0.03
54	603737	三棵树	280	38,962.00	0.02
55	600094	大名城	10,600	37,524.00	0.02
56	600340	华夏幸福	10,149	36,536.40	0.02
57	603345	安井食品	200	34,156.00	0.02
58	000061	农产品	5,200	33,228.00	0.02

59	301029	怡合达	359	32,216.66	0.02
60	301069	凯盛新材	539	23,796.85	0.02
61	300010	豆神教育	4,900	20,531.00	0.01
62	301018	申菱环境	782	20,347.64	0.01
63	000008	神州高铁	6,200	18,228.00	0.01
64	301060	兰卫医学	587	18,144.17	0.01
65	301050	雷电微力	77	18,061.89	0.01
66	300994	久祺股份	328	14,897.76	0.01
67	301046	能辉科技	290	14,198.40	0.01
68	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.01
69	301017	漱玉平民	555	13,186.80	0.01
70	301020	密封科技	421	12,789.98	0.01
71	301026	浩通科技	203	12,715.92	0.01
72	301013	利和兴	471	12,104.70	0.01
73	301021	英诺激光	290	12,003.10	0.01
74	301035	润丰股份	199	11,189.77	0.01
75	301048	金鹰重工	826	10,696.70	0.01
76	301127	天源环保	549	10,546.29	0.01
77	301039	中集车辆	764	9,504.16	0.01
78	301028	东亚机械	697	9,402.53	0.01
79	300774	倍杰特	444	9,279.60	0.01
80	301040	中环海陆	241	9,256.81	0.01
81	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.01
82	301025	读客文化	403	8,398.52	0.01
83	300814	中富电路	328	7,806.40	0.00
84	301055	张小泉	355	7,699.95	0.00
85	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
86	301033	迈普医学	108	6,472.44	0.00
87	301032	新柴股份	513	6,407.37	0.00
88	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
89	301041	金百泽	215	6,058.70	0.00
90	301072	中捷精工	181	6,041.78	0.00
91	301049	超越科技	181	5,951.28	0.00
92	301189	奥尼电子	97	5,541.61	0.00
93	300854	中兰环保	203	5,537.84	0.00
94	301063	海锅股份	153	5,527.89	0.00
95	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
96	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
97	301059	金三江	259	4,996.11	0.00

98	301036	双乐股份	164	4,887.20	0.00
99	301027	华蓝集团	286	4,750.46	0.00
100	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
101	301037	保立佳	193	4,664.81	0.00
102	301073	君亭酒店	144	4,616.64	0.00
103	301057	汇隆新材	218	4,144.18	0.00
104	301068	大地海洋	144	4,083.84	0.00
105	605377	华旺科技	140	2,511.60	0.00
106	600267	海正药业	17	237.83	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	2,005,434.00	0.69
2	601318	中国平安	1,674,910.00	0.57
3	000333	美的集团	1,439,661.88	0.49
4	600036	招商银行	1,426,258.00	0.49
5	000858	五粮液	1,363,330.00	0.47
6	601816	京沪高铁	998,461.00	0.34
7	000001	平安银行	752,420.00	0.26
8	600276	恒瑞医药	677,197.00	0.23
9	603501	韦尔股份	665,208.00	0.23
10	300059	东方财富	629,993.28	0.22
11	688111	金山办公	604,344.63	0.21
12	000651	格力电器	559,284.00	0.19
13	601166	兴业银行	530,896.00	0.18
14	300450	先导智能	530,892.00	0.18
15	600900	长江电力	510,749.00	0.18
16	002049	紫光国微	507,922.00	0.17
17	601888	中国中免	507,860.00	0.17
18	000799	酒鬼酒	500,949.00	0.17
19	600887	伊利股份	476,260.00	0.16
20	002415	海康威视	475,436.00	0.16

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	7,459,764.52	2.56
2	601318	中国平安	6,995,638.70	2.40
3	000858	五粮液	5,033,312.00	1.73
4	600036	招商银行	4,288,755.00	1.47
5	600276	恒瑞医药	3,443,238.60	1.18
6	000333	美的集团	3,429,890.26	1.18
7	000651	格力电器	2,474,628.00	0.85
8	600887	伊利股份	2,465,248.00	0.85
9	601888	中国中免	2,397,073.00	0.82
10	601012	隆基股份	2,367,778.80	0.81
11	300059	东方财富	2,275,321.00	0.78
12	601166	兴业银行	2,200,129.00	0.75
13	600030	中信证券	2,167,920.00	0.74
14	002594	比亚迪	1,974,261.00	0.68
15	002415	海康威视	1,916,289.00	0.66
16	000001	平安银行	1,906,039.00	0.65
17	002475	立讯精密	1,701,999.00	0.58
18	603288	海天味业	1,582,744.00	0.54
19	601398	工商银行	1,569,882.00	0.54
20	000002	万科 A	1,561,729.00	0.54

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	60,080,593.48
卖出股票收入（成交）总额	213,319,003.54

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债 (可交换债)	227,265.60	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	227,265.60	0.15

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113052	兴业转债	1,910	191,000.00	0.12
2	127049	希望转 2	256	34,265.60	0.02
3	113634	珀莱转债	20	2,000.00	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 只债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

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

基金投资的前十名股票, 均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,315.96
2	应收证券清算款	6,376.46
3	应收股利	-
4	应收利息	967.46
5	应收申购款	11,081.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,741.78

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: 本基金本报告期末未持有处于转股期可转换债券 (可交换债券)。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: 本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688789	宏华数科	319,455.25	0.20	限售期锁定

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,043	14,101.36	32,965,627.57	38.69%	52,248,913.51	61.31%

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	中国工商银行股份有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	3,728,891.00	8.50%
2	王飞舟	1,677,417.00	3.83%
3	靳宁卿	980,300.00	2.24%
4	纪伟才	938,029.00	2.14%
5	于成福	932,390.00	2.13%
6	于君	711,529.00	1.62%
7	于延年	499,916.00	1.14%
8	陈雁金	466,006.00	1.06%
9	符王莹月	466,006.00	1.06%
10	肖诚	437,235.00	1.00%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	6.73	0.0000%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关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

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2015年5月22日）基金份额总额	542,268,490.78
本报告期期初基金份额总额	172,510,529.46
本报告期基金总申购份额	24,147,776.61
减:本报告期基金总赎回份额	111,443,764.99
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	85,214,541.08

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

2021 年 6 月 6 日, 根据我公司第八届董事会第一次会议决议, 会议选举高民和先生担任公司董事长, 周兵先生不再担任公司董事长; 根据第八届董事会第二次会议决议, 同意聘任周兵先生为公司总经理, 林培富先生不再担任公司总经理, 聘任郭堃同志为公司副总经理, 王宁先生不再担任公司副总经理职务。

2021 年 7 月 12 日, 根据公司第八届董事会第三次会议决议, 聘任吴达同志为公司副总经理。

#### 11.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 11.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动情况。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙), 本报告期内本基金未更换会计师事务所。本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元, 已连续提供审计服务 13 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	
中金证券	1	109,133,067.74	41.43%	101,636.40	41.43%	-
兴业证券	1	103,325,322.82	39.23%	96,227.30	39.23%	-
银河证券	1	18,793,531.69	7.13%	17,502.54	7.13%	-
东兴证券	1	15,347,027.28	5.83%	14,292.89	5.83%	-
海通证券	1	8,858,554.38	3.36%	8,249.23	3.36%	-
华泰证券	1	5,560,330.83	2.11%	5,178.30	2.11%	-
长江证券	1	1,722,377.90	0.65%	1,604.09	0.65%	-
东北证券	1	665,920.60	0.25%	620.21	0.25%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
中金证券	8,149.80	1.63%	-	-	-	-
兴业证券	15,094.89	3.02%	-	-	-	-
银河证券	124,205.80	24.88%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	248,534.00	49.78%	-	-	-	-
华泰证券	103,293.46	20.69%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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: 无。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于瑞银证券有限责任公司终止办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2021年12月22日
2	长盛基金管理有限公司关于工商银行快捷支付渠道升级上线的公告	中国证监会指定披露媒介	2021年11月26日

	告		
3	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 10 月 27 日
4	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年第 3 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 10 月 27 日
5	长盛基金管理有限公司关于暂停使用工行快捷服务办理直销网上交易部分业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 10 月 26 日
6	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加意才基金为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	中国证监会指定披露媒介	2021 年 10 月 12 日
7	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 28 日
8	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年中期报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 28 日
9	长盛基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 21 日
10	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 12 日
11	长盛基金管理有限公司高级管理人员副总经理变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 27 日
12	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加招商证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 26 日
13	长盛基金管理有限公司高级管理人员董事长变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 22 日
14	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年第 2 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 21 日
15	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 21 日
16	长盛基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 17 日
17	长盛基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司销售旗下部分基金并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 13 日
18	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 30 日
19	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要 (更	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 30 日

	新)		
20	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	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 29 日
21	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 18 日
22	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	中国证监会指定披露媒介	2021 年 6 月 10 日
23	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	中国证监会指定披露媒介	2021 年 4 月 22 日
24	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 4 月 22 日
25	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	中国证监会指定披露媒介	2021 年 3 月 31 日
26	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2020 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 3 月 31 日
27	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同	中国证监会指定披露媒介	2021 年 3 月 30 日
28	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议	中国证监会指定披露媒介	2021 年 3 月 30 日
29	关于旗下指数基金根据《侧袋机制指引》及《指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 3 月 30 日
30	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 1 月 22 日
31	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 1 月 22 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101~20210125	42,071,810.69	0.00	42,071,810.69	0.00	0.00%
	2	20210126~20210704	21,873,067.38	0.00	11,500,000.00	10,373,067.38	12.17%
	3	20210705~20211231	0.00	18,495,067.82	0.00	18,495,067.82	21.70%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）相关批准文件；
- 2、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/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

2022 年 3 月 31 日