

# 长盛成长价值证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。

报告期内，本基金自 2021 年 7 月 8 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额，并自该日起接受投资者对 C 类基金份额的申购和赎回。C 类基金份额代码：012715，简称：长盛成长价值混合 C。详情参阅本基金管理人于 2021 年 7 月 8 日披露的相关公告。

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.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<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.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	61
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.....	61

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 .....	61
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 .....	61
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
9.3 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 .....	63
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>64</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>65</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
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 .....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4 基金投资策略的改变 .....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
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 .....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8 其他重大事件 .....	67
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>70</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 .....	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	70
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>71</b>
13.1 备查文件目录 .....	71
13.2 存放地点 .....	71
13.3 查阅方式 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛成长价值证券投资基金	
基金简称	长盛成长价值混合	
基金主代码	080001	
交易代码	080001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2002 年 9 月 18 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	151,988,175.28 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛成长价值混合 A	长盛成长价值混合 C
下属分级基金的交易代码:	080001	012715
报告期末下属分级基金的份额总额	151,926,036.94 份	62,138.34 份

注:报告期内,本基金自 2021 年 7 月 8 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额,并自该日起接受投资者对 C 类基金份额的申购和赎回。C 类基金份额代码:012715,简称:长盛成长价值混合 C。详情参阅本基金管理人于 2021 年 7 月 8 日披露的相关公告。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为平衡型基金,通过管理人的积极管理,在控制风险的前提下挖掘价值、分享成长,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略为主动性投资,在战略性资产、战术性资产、股票和债券选择三个层面进行积极配置,力争获得超过投资基准的业绩回报。在资产配置方面,股票资产比例为 35%-75%,债券资产比例为 20%-60%,现金资产比例不低于 5%。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×75%+中证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金属平衡型基金,在承担适度风险的前提下,获得长期稳定的收益。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长盛基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁
	联系电话	010-86497608
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666	95599
	010-86497888	
传真	010-86497999	010-68121816
注册地址	深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	100029	100031
法定代表人	高民和	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	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、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
	长盛成长价值混合 A	长盛成长价值混合 C	长盛成长价值混合 A	长盛成长价值混合 A
本期已实现收益	45,708,289.96	5,347.24	82,438,963.90	14,138,000.53
本期利润	35,423,804.52	-3,290.81	89,211,967.98	81,305,071.38
加权平均基金份额本期利润	0.2190	-0.0558	0.4149	0.3079
本期加权平均净值利润率	12.76%	-3.09%	29.65%	28.31%
本期基金份额净值增长率	13.16%	3.83%	33.98%	33.29%
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	121,602,331.22	49,551.58	107,134,162.76	50,870,527.61
期末可供分配基金份额利润	0.8004	0.7974	0.5910	0.2086
期末基金资产净值	273,528,368.16	111,689.92	288,395,107.96	294,748,309.21
期末基金份额净值	1.8004	1.7974	1.5910	1.2090
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	1,249.60%	3.83%	1,092.63%	790.19%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛成长价值混合 A

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	1.34%	0.79%	1.88%	0.54%	-0.54%	0.25%
过去六个月	4.61%	1.13%	-0.84%	0.70%	5.45%	0.43%
过去一年	13.16%	1.26%	1.15%	0.81%	12.01%	0.45%
过去三年	102.08%	1.18%	51.92%	0.99%	50.16%	0.19%
过去五年	87.81%	1.05%	22.85%	0.94%	64.96%	0.11%
自基金合同生效起至今	1,249.60%	1.24%	245.49%	1.33%	1,004.11%	-0.09%

长盛成长价值混合 C

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	1.23%	0.79%	1.88%	0.54%	-0.65%	0.25%
自基金新增本类份额起至今	3.83%	1.10%	0.15%	0.69%	3.68%	0.41%

注：由于标普道琼斯指数有限公司停止计算标普中国 A 股综合指数行情数据，经履行适当程序，自 2020 年 9 月 14 日起，本基金业绩比较基准由“标普中国 A 股综合指数收益率×80%+中证国债指数收益率×20%”变更为“中证 800 指数收益率\*75%+中证国债指数收益率\*25%”。

1、中证 800 指数是由中证指数有限公司编制的，其成份股是由沪深 300 指数和中证 500 指数成份股一起构成，中证 800 指数综合反映沪深股票市场内大中小市值公司的整体状况，较好地反映了 A 股市场的总体趋势。

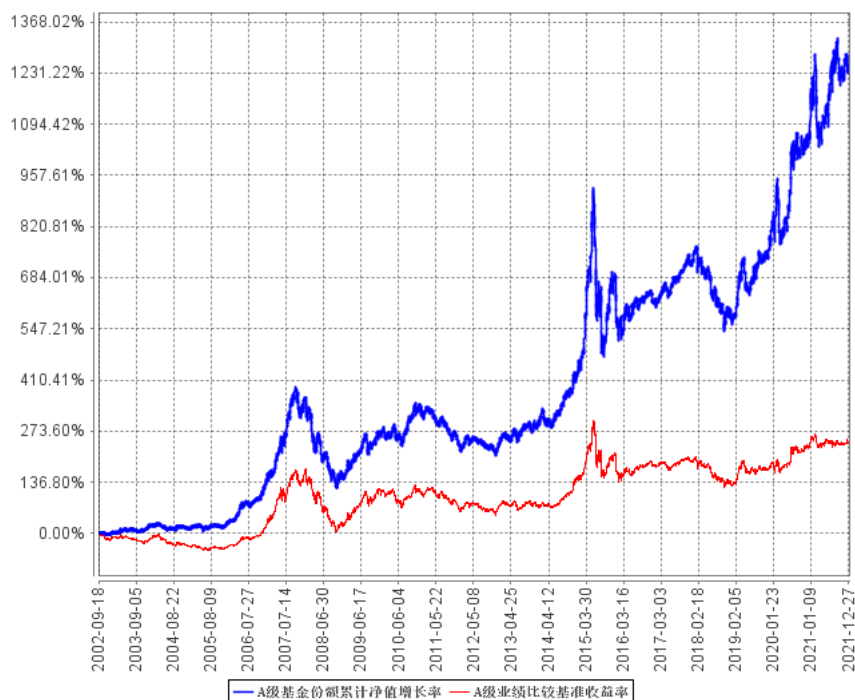
2、中证国债指数是中证指数证券公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数。

3、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 75%、25%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。

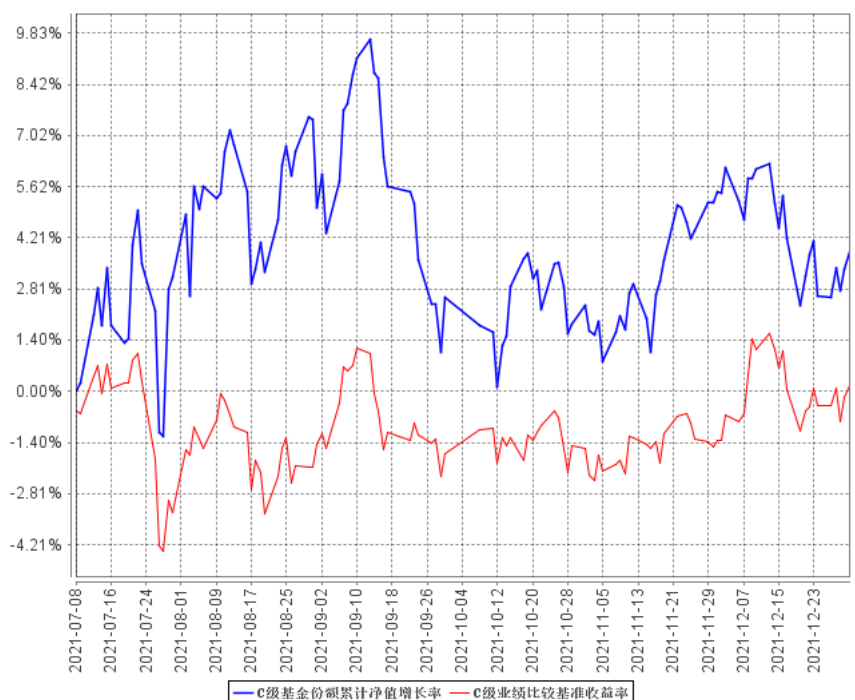


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级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

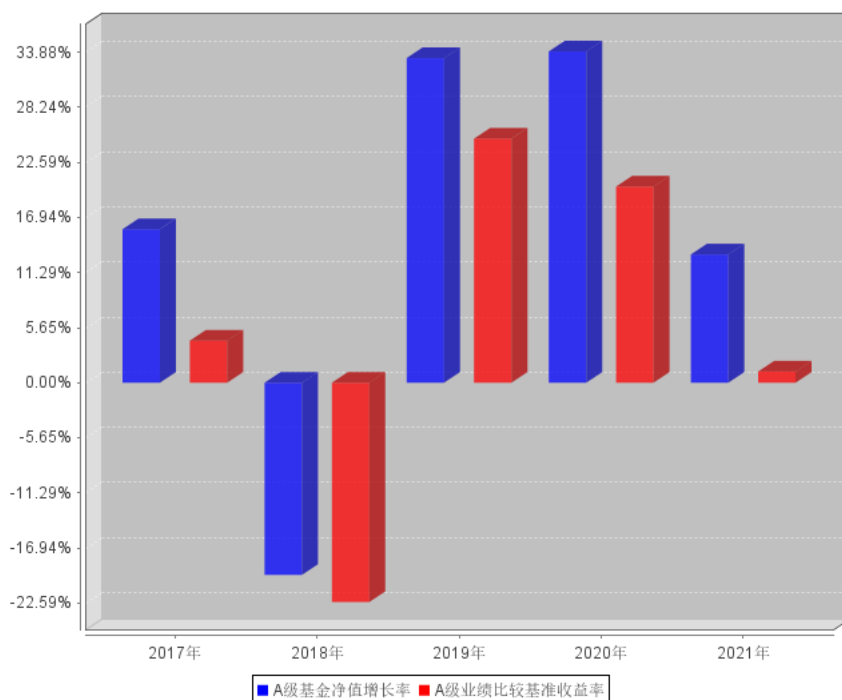


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

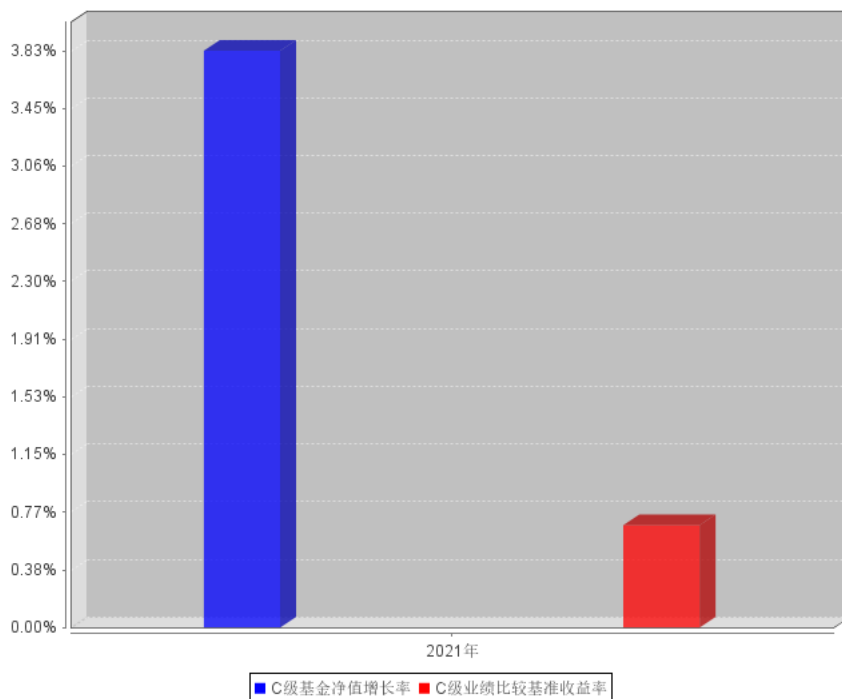


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级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



C级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



注：本基金自 2021 年 7 月 8 日起增设 C 类份额，当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长盛成长价值混合 A					
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	0.280	2,647,541.38	2,496,883.17	5,144,424.55	
2019	0.153	2,083,399.95	1,698,659.64	3,782,059.59	
合计	0.433	4,730,941.33	4,195,542.81	8,926,484.14	

单位：人民币元

长盛成长价值混合 C					
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	-	0.00	-	0.00	
合计	-	-	-	-	

## § 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		
王宁	本基金基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛动态精选证券投资基金基金经理，长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛多因子策略优选股票型证券投资基金基金经理，公司首席投资官。	2021 年 8 月 26 日	-	23 年	王宁先生，硕士。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，基金经理等职务。2005 年 8 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理、基金经理、权益投资部总监、总经理助理、副总经理等。
付海宁	本基金基金经理。	2020 年 10 月 23 日	2021 年 8 月 26 日	12 年	付海宁先生，硕士。曾任职于美国摩根士丹利、美银美林、标准普尔资产管理等公司。曾任前海开源基金管理有限公司基金经理，2019 年 12 月加入长盛基金管理有限公司。目前已离任。

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

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

注：本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

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

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年全年从成长价值和中小盘不同的分类组合形成的六类资产看，以新能源、电力设备为代表的成长性股票全年表现强势，价值性分类中红利类型股票脱颖而出，消费以及医药等机构长期持仓行业股票分别在 2021 年上半年和下半年由盛转弱，逐渐呈现逐级回落的状态。在疫情不断反复的情况下，消费服务类型的股票，持续跑输市场各类指数。

2021 年成长价值组合根据基金合同分类的成长价值分类，以及宏观市场的阶段性表现，组合前三季度整体对于成长类行业股票呈现偏重配置状态，2021 年四季度在宏观稳增长保供给的基调下，逐渐调整组合成长和价值的配置比例，向保增长情况预期表现强势的价值周期反转型品种调整。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛成长价值混合 A 基金份额净值为 1.8004 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.16%，同期业绩比较基准收益率为 1.15%；截至本报告期末长盛成长价值混合 C 基金份额净值为 1.7974 元，本报告期（2021 年 7 月 8 日至 12 月 31 日）基金份额净值增长率为 3.83%，同期业绩比较基准收益率为 0.15%。

## 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 年宏观面临的环境分为内部外部两条线索：外部全球流动性在通货膨胀环境下，收缩的力度和幅度的预期，对全球资本市场各类资产的影响；国内保增长和供给的措施下，信用释放对资产价格和品种估值的影响，以及地缘政治波动对全球资产价格的脉冲影响等。

成长价值基金将根据各类因素对成长价值和风格的影响调整组合，阶段性继续增加与保增长相关的低估值价值型行业品种在组合的比重，为持有人获得长期持续的回报。

#### 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。

#### 4.8 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 121,651,882.80 元，其中：长盛成长价值混合 A 期末可供分配利润为 121,602,331.22 元（长盛成长价值混合 A 的未分配利润已实现部分为 313,304,307.53 元，未分配利润未实现部分为 -191,701,976.31 元），长盛成长价值混合 C 期末可供分配利润为 49,551.58 元（长盛成长价值混合 C 的未分配利润已实现部分为 127,954.44 元，未分配利润未实现部分为 -78,402.86 元）。



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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——长盛基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

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

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

## § 6 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 20943 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	长盛成长价值证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了长盛成长价值证券投资基金(以下简称“长盛成长价值基金”)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,公允反映了长盛成长价值基金 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。</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,我们独立于长盛成长价值基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>长盛成长价值基金的基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估长盛成长价值基金的持续经营能力,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成长价值基金、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成长价值基金的财务报告过程。</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</p>

	<p>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，就可能导致对长盛成长价值基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛成长价值基金不能持续经营。</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：长盛成长价值证券投资基金

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	42,357,451.84	22,022,428.08
结算备付金		198,662.21	612,533.32
存出保证金		35,307.77	139,222.69
交易性金融资产	7.4.7.2	231,091,129.97	274,541,623.57
其中：股票投资		172,166,639.27	209,519,636.17
基金投资		-	-
债券投资		58,924,490.70	65,021,987.40
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	644,267.12	780,535.96
应收股利		-	-
应收申购款		116,199.16	11,483.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		274,443,018.07	298,107,827.20
<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		-	8,060,947.81
应付赎回款		120,035.31	838,403.02
应付管理人报酬		353,275.26	362,049.18
应付托管费		58,879.16	60,341.54
应付销售服务费		44.06	-
应付交易费用	7.4.7.7	38,895.67	276,471.72
应交税费		2,600.00	2,602.12
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	229,230.53	111,903.85
负债合计		802,959.99	9,712,719.24
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	151,988,175.28	181,260,945.20
未分配利润	7.4.7.10	121,651,882.80	107,134,162.76
所有者权益合计		273,640,058.08	288,395,107.96
负债和所有者权益总计		274,443,018.07	298,107,827.20

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，长盛成长价值混合 A 基金份额净值 1.8004 元，基金份额总额 151,926,036.94 份；长盛成长价值混合 C 基金份额净值 1.7974 元，基金份额总额 62,138.34 份。长盛成长价值混合份额总额合计为 151,988,175.28 份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛成长价值证券投资基金

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>		42,488,115.71	97,385,479.09
1.利息收入		2,339,385.50	2,876,883.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	377,255.12	362,603.65
债券利息收入		1,956,162.35	2,510,613.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,968.03	3,667.11
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		50,351,334.82	87,551,316.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	42,486,064.94	87,858,725.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	5,892,034.88	-3,406,095.50
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	1,973,235.00	3,098,685.70
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-10,293,123.49	6,773,004.08
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	90,518.88	184,274.96

列)			
<b>减：二、费用</b>		7,067,602.00	8,173,511.11
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,172,275.37	4,511,976.92
2. 托管费	7.4.10.2.2	695,379.25	751,996.18
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	212.07	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,221,083.37	2,690,811.08
5. 利息支出		765,888.38	-
其中：卖出回购金融资产支出		765,888.38	-
6. 税金及附加		216.93	1.34
7. 其他费用	7.4.7.20	212,546.63	218,725.59
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		35,420,513.71	89,211,967.98
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		35,420,513.71	89,211,967.98

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛成长价值证券投资基金

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）	181,260,945.20	107,134,162.76	288,395,107.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	35,420,513.71	35,420,513.71
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）	-29,272,769.92	-20,902,793.67	-50,175,563.59
其中：1. 基金申购款	11,959,719.00	8,506,040.84	20,465,759.84
2. 基金赎回款	-41,232,488.92	-29,408,834.51	-70,641,323.43
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）	151,988,175.28	121,651,882.80	273,640,058.08

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（基金净值）	243,877,781.60	50,870,527.61	294,748,309.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	89,211,967.98	89,211,967.98
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）	-62,616,836.40	-27,803,908.28	-90,420,744.68
其中：1. 基金申购款	32,748,349.76	11,992,637.73	44,740,987.49
2. 基金赎回款	-95,365,186.16	-39,796,546.01	-135,161,732.17
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）	-	-5,144,424.55	-5,144,424.55
五、期末所有者权益（基金净值）	181,260,945.20	107,134,162.76	288,395,107.96

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

长盛成长价值证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2002]第 57 号《关于同意长盛成长价值证券投资基金设立的批复》核准，由长盛基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《长盛成长价值证券投资基金基金契约》（后更名为《长盛成长价值证券投资基金基金合同》）发起，并于 2002 年 9 月 18 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,166,886,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第 95 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《关于长盛成长价值证券投资基金增加 C 类份额、增加侧袋机制、调整基金份额净值计



算精度并修改基金合同等法律文件的公告》以及更新的《长盛成长价值证券投资基金基金合同》的有关规定，自 2021 年 7 月 8 日起，本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置基金代码，并且分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛成长价值证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在股票资产中，本基金投资于成长类股票和价值类股票。本基金投资组合中股票资产比例为 35%-75%，债券资产比例为 20%-60%，现金资产比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金持有的成长类股票和价值类股票资产的比例均不低于股票资产的 30%，不高于股票资产的 70%；投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%；在交易日买入权证的总金额不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×75%+中证国债指数收益率×25%。

#### 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》、《长盛成长价值证券投资基金基金合同》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、托管费和销售服务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

本基金同一类别的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，但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。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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，

解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	42,357,451.84	22,022,428.08
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：	42,357,451.84	22,022,428.08

### 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	151,282,991.50	172,166,639.27	20,883,647.77	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	58,572,206.80	58,924,490.70	352,283.90
	银行间市场	-	-	-
	合计	58,572,206.80	58,924,490.70	352,283.90
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	209,855,198.30	231,091,129.97	21,235,931.67	
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	177,763,432.98	209,519,636.17	31,756,203.19	
贵金属投资-金交所	-	-	-	

黄金合约				
债券	交易所市场	65,249,135.43	65,021,987.40	-227,148.03
	银行间市场	-	-	-
	合计	65,249,135.43	65,021,987.40	-227,148.03
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		243,012,568.41	274,541,623.57	31,529,055.16

#### 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。

#### 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	9,563.72	8,087.49
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	89.40	275.70
应收债券利息	634,598.10	772,110.07
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	15.90	62.70
合计	644,267.12	780,535.96

#### 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	38,895.67	276,271.72
银行间市场应付交易费用	-	200.00
合计	38,895.67	276,471.72

## 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	-	-
应付赎回费	482.28	3,155.60
应付证券出借违约金	-	-
其他	44,248.25	44,248.25
预提费用	184,500.00	64,500.00
合计	229,230.53	111,903.85

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛成长价值混合 A		
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	181,260,945.20	181,260,945.20
本期申购	11,791,395.24	11,791,395.24
本期赎回（以“-”号填列）	-41,126,303.50	-41,126,303.50
- 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	151,926,036.94	151,926,036.94

金额单位：人民币元

长盛成长价值混合 C		
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	-	-
本期申购	168,323.76	168,323.76
本期赎回（以“-”号填列）	-106,185.42	-106,185.42
- 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	62,138.34	62,138.34

注：申购含转换入；赎回含转换出。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长盛成长价值混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	323,284,025.75	-216,149,862.99	107,134,162.76
本期利润	45,708,289.96	-10,284,485.44	35,423,804.52
本期基金份额交易产生的变动数	-55,688,008.18	34,732,372.12	-20,955,636.06
其中：基金申购款	22,772,535.76	-14,403,736.79	8,368,798.97
基金赎回款	-78,460,543.94	49,136,108.91	-29,324,435.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	313,304,307.53	-191,701,976.31	121,602,331.22

单位：人民币元

长盛成长价值混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	5,347.24	-8,638.05	-3,290.81
本期基金份额交易产生的变动数	122,607.20	-69,764.81	52,842.39
其中：基金申购款	338,164.03	-200,922.16	137,241.87
基金赎回款	-215,556.83	131,157.35	-84,399.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	127,954.44	-78,402.86	49,551.58

#### 7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
活期存款利息收入	356,561.15	350,836.85
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	19,316.77	9,879.79
其他	1,377.20	1,887.01
合计	377,255.12	362,603.65

**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 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
卖出股票成交总额	416,148,300.59	897,738,497.56
减：卖出股票成本总额	373,662,235.65	809,879,771.60
买卖股票差价收入	42,486,064.94	87,858,725.96

**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	5,892,034.88	-3,406,095.50
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	5,892,034.88	-3,406,095.50

**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	268,198,389.78	142,319,452.14
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	260,535,180.27	142,432,809.30
减：应收利息总额	1,771,174.63	3,292,738.34
买卖债券差价收入	5,892,034.88	-3,406,095.50

**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	1,973,235.00	3,098,685.70
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	1,973,235.00	3,098,685.70

#### 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	-10,293,123.49	6,773,004.08
——股票投资	-10,872,555.42	6,904,332.11
——债券投资	579,431.93	-131,328.03
——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	-10,293,123.49	6,773,004.08

#### 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	87,629.40	179,991.96
基金转换费收入	2,889.48	4,283.00
合计	90,518.88	184,274.96

注：1. 本基金的赎回费率为赎回金额的 0.5%，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，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	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
交易所市场交易费用	1,221,083.37	2,690,411.08
银行间市场交易费用	-	400.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,221,083.37	2,690,811.08

#### 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	-	-
银行费用	14,546.63	15,725.59
律师费用	-	5,000.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	212,546.63	218,725.59

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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	147,733,778.11	19.85%	374,048,686.81	22.31%

###### 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	131,987,567.94	27.23%	128,831,678.18	72.60%

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

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	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
国元证券	626,400,000.00	34.60%	11,500,000.00	100.00%

###### 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	137,584.19	19.85%	24,822.01	63.82%
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	348,348.27	22.31%	49,136.36	17.79%

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	4,172,275.37	4,511,976.92
其中：支付销售机构的客户维护费	1,582,816.09	925,959.43

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 1.5% 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 × 1.5% ÷ 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	695,379.25	751,996.18

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% ÷ 当年天数。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

注：无。

**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**

注：无。

**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
中国农业银行	42,357,451.84	356,561.15	22,022,428.08	350,836.85

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

**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	7,172	75,449.44	75,449.44	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	1,167	8,122.32	14,517.48	-
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	-
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	-
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	-
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	733	3,892.23	9,888.17	-
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	462	6,532.68	41,459.88	-
688303	大全能源	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	限售期锁定	21.49	60.40	6,977	149,935.73	421,410.80	-
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	-
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	-
688296	和达科技	2021 年 7 月 19 日	2022 年 1 月 27 日	限售期锁定	12.46	49.64	2,173	27,075.58	107,867.72	-
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	357	7,868.28	20,074.11	-
688071	华依科技	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	限售期锁定	13.73	61.06	1,101	15,116.73	67,227.06	-
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	205	4,792.90	6,109.00	-
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	-
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	-
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 16 日	限售期锁定	4.57	20.90	444	2,029.08	9,279.60	-
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	-
688385	复旦微电	2021 年 7 月 27 日	2022 年 2 月 7 日	限售期锁定	6.23	48.49	8,986	55,982.78	435,731.14	-
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	-
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	420	4,998.00	19,076.40	-
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	-
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	-
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	843	3,481.59	10,916.85	-
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	限售期锁定	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
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	144	8,732.16	33,778.08	-
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	196	3,790.64	6,444.48	-
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	-
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	-
688187	时代电气	2021 年 8 月 30 日	2022 年 3 月 7 日	限售期锁定	31.38	76.63	4,684	146,983.92	358,934.92	-

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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	限售期锁定	5.17	44.15	539	2,786.63	23,796.85	-
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	-
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	-
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	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	限售期锁定	5.77	15.34	756	4,362.12	11,597.04	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	限售期锁定	11.92	29.17	140	1,668.80	4,083.80	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	限售期锁定	12.95	18.33	403	5,218.85	7,386.99	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	限售期锁定	9.08	15.23	416	3,777.28	6,335.68	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	限售期锁定	93.09	75.43	137	12,753.33	10,333.91	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	限售期锁定	10.45	12.19	950	9,927.50	11,580.50	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	限售期锁定	19.11	69.92	220	4,204.20	15,382.40	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	限售期锁定	33.16	24.99	266	8,820.56	6,647.34	-
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	限售期锁定	36.50	31.42	302	11,023.00	9,488.84	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	限售期锁定	58.08	50.21	139	8,073.12	6,979.19	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	限售期锁定	36.31	35.50	191	6,935.21	6,780.50	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	限售期锁定	10.07	19.07	1,214	12,224.98	23,150.98	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	限售期锁定	13.00	23.25	647	8,411.00	15,042.75	-
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	限售期锁定	12.36	26.38	307	3,794.52	8,098.66	-
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	限售期锁定	12.20	28.34	654	7,978.80	18,534.36	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	限售期锁定	11.88	25.59	578	6,866.64	14,791.02	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	限售期锁定	14.33	34.23	286	4,098.38	9,789.78	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	限售期锁定	21.76	34.24	262	5,701.12	8,970.88	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	限售期锁定	57.27	56.01	124	7,101.48	6,945.24	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	限售期锁定	10.48	43.93	379	3,971.92	16,649.47	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	限售期锁定	12.37	21.35	662	8,188.94	14,133.70	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	限售期锁定	29.28	33.50	278	8,139.84	9,313.00	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	限售期锁定	43.99	52.42	149	6,554.51	7,810.58	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	限售期锁定	30.73	30.08	268	8,235.64	8,061.44	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	限售期锁定	39.08	54.86	204	7,972.32	11,191.44	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	限售期锁定	116.88	122.05	146	17,064.48	17,819.30	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	限售期锁定	26.17	53.55	285	7,458.45	15,261.75	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	限售期锁定	26.91	50.43	345	9,283.95	17,398.35	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	限售期锁定	27.81	34.57	318	8,843.58	10,993.26	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	限售期锁定	79.60	80.15	89	7,084.40	7,133.35	-
688248	南网科技	2021年12月14日	2022年6月22日	限售期锁定	12.24	21.78	8,276	101,298.24	180,251.28	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	限售期锁定	25.80	35.13	469	12,100.20	16,475.97	-

301221	光庭信息	2021 年 12 月 15 日	2022 年 6 月 22 日	限售期锁定	69.89	90.93	144	10,064.16	13,093.92	-
301182	凯旺科技	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 23 日	限售期锁定	27.12	33.34	294	7,973.28	9,801.96	-
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	限售期锁定	27.85	28.36	308	8,577.80	8,734.88	-
301166	优宁维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	限售期锁定	86.06	95.89	110	9,466.60	10,547.90	-
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	174	11,515.32	9,940.62	-
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	968	11,645.04	18,595.28	-

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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的

主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	49,910,470.50	20,028,845.20
合计	49,910,470.50	20,028,845.20

注：未评级部分为国债。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	5,531,066.00
未评级	9,014,020.20	39,462,076.20
合计	9,014,020.20	44,993,142.20

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 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	42,357,451.84	-	-	-	42,357,451.84
结算备付金	198,662.21	-	-	-	198,662.21
存出保证金	35,307.77	-	-	-	35,307.77
交易性金融资产	49,910,470.50	-	9,014,020.20	172,166,639.27	231,091,129.97
应收利息	-	-	-	644,267.12	644,267.12
应收申购款	-	-	-	116,199.16	116,199.16
资产总计	92,501,892.32	-	9,014,020.20	172,927,105.55	274,443,018.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	120,035.31	120,035.31
应付管理人报酬	-	-	-	353,275.26	353,275.26
应付托管费	-	-	-	58,879.16	58,879.16
应付销售服务费	-	-	-	44.06	44.06
应付交易费用	-	-	-	38,895.67	38,895.67
应交税费	-	-	-	2,600.00	2,600.00
其他负债	-	-	-	229,230.53	229,230.53
负债总计	-	-	-	802,959.99	802,959.99
利率敏感度缺口	92,501,892.32	-	9,014,020.20	172,124,145.56	273,640,058.08
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	22,022,428.08	-	-	-	22,022,428.08
结算备付金	612,533.32	-	-	-	612,533.32
存出保证金	139,222.69	-	-	-	139,222.69
交易性金融资产	59,490,921.40	-	5,531,066.00	209,519,636.17	274,541,623.57
应收利息	-	-	-	780,535.96	780,535.96
应收申购款	-	-	-	11,483.58	11,483.58
资产总计	82,265,105.49	-	5,531,066.00	210,311,655.71	298,107,827.20
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,060,947.81	8,060,947.81
应付赎回款	-	-	-	838,403.02	838,403.02
应付管理人报酬	-	-	-	362,049.18	362,049.18
应付托管费	-	-	-	60,341.54	60,341.54
应付交易费用	-	-	-	276,471.72	276,471.72
应交税费	-	-	-	2,602.12	2,602.12
其他负债	-	-	-	111,903.85	111,903.85
负债总计	-	-	-	9,712,719.24	9,712,719.24
利率敏感度缺口	82,265,105.49	-	5,531,066.00	200,598,936.47	288,395,107.96

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	1、市场利率下降 25 个基点	73,033.25	171,705.35
	2、市场利率上升 25 个基点	-73,033.25	-171,705.35

#### 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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产比例为基金总资产的 35%-75%，债券资产比例为 20%-60%。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	172,166,639.27	62.92	209,519,636.17	72.65
合计	172,166,639.27	62.92	209,519,636.17	72.65

#### 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%	17,695,203.89	15,028,870.68
2. 业绩比较基准（附注 7.4.1）下降 5%	-17,695,203.89	-15,028,870.68	

#### 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 167,991,147.88 元，属于第二层次的余额为 59,005,444.63 元，属于第三层次的余额为 4,094,537.46 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 206,543,902.62 元，第二层次 67,997,720.95 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 4,094,537.46 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 2,702,922.94 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 1,391,614.52 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 1,391,614.52 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》,公募基金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	172,166,639.27	62.73
	其中：股票	172,166,639.27	62.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	58,924,490.70	21.47
	其中：债券	58,924,490.70	21.47
	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	42,556,114.05	15.51
8	其他各项资产	795,774.05	0.29
9	合计	274,443,018.07	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	20,332.12	0.01
B	采矿业	7,699,047.00	2.81
C	制造业	132,010,741.26	48.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	46,704.38	0.02
F	批发和零售业	308,447.18	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,952,436.08	0.71
H	住宿和餐饮业	1,436,947.80	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,052,058.05	2.21
J	金融业	11,889,589.35	4.34
K	房地产业	6,022,239.00	2.20
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,381,288.16	1.60
N	水利、环境和公共设施管理业	311,640.24	0.11
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	17,024.48	0.01
S	综合	-	-
	合计	172,166,639.27	62.92

### 8.2.2 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。

### 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

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	300274	阳光电源	96,400	14,055,120.00	5.14
2	002466	天齐锂业	67,600	7,233,200.00	2.64
3	600048	保利发展	385,300	6,022,239.00	2.20
4	600563	法拉电子	22,200	5,159,280.00	1.89
5	600309	万华化学	47,700	4,817,700.00	1.76
6	002832	比音勒芬	172,787	4,397,429.15	1.61
7	688981	中芯国际	80,111	4,245,081.89	1.55
8	000983	山西焦煤	485,500	4,015,085.00	1.47
9	600406	国电南瑞	98,880	3,958,166.40	1.45
10	000933	神火股份	429,100	3,900,519.00	1.43
11	601636	旗滨集团	224,766	3,843,498.60	1.40
12	603986	兆易创新	21,420	3,766,707.00	1.38
13	002460	赣锋锂业	26,082	3,725,813.70	1.36
14	000807	云铝股份	306,300	3,421,371.00	1.25
15	300395	菲利华	51,200	3,365,888.00	1.23
16	600919	江苏银行	533,129	3,108,142.07	1.14
17	002709	天赐材料	26,900	3,084,085.00	1.13
18	002594	比亚迪	10,900	2,922,508.00	1.07
19	002142	宁波银行	72,600	2,779,128.00	1.02
20	002179	中航光电	27,300	2,745,288.00	1.00
21	600893	航发动力	42,900	2,722,434.00	0.99
22	600019	宝钢股份	359,100	2,571,156.00	0.94
23	603113	金能科技	154,400	2,516,720.00	0.92
24	603005	晶方科技	44,280	2,439,385.20	0.89
25	000725	京东方 A	466,800	2,357,340.00	0.86
26	300124	汇川技术	33,900	2,325,540.00	0.85
27	600885	宏发股份	30,500	2,276,520.00	0.83

28	603993	洛阳钼业	407,900	2,276,082.00	0.83
29	600036	招商银行	46,160	2,248,453.60	0.82
30	002821	凯莱英	5,100	2,218,500.00	0.81
31	600690	海尔智家	72,800	2,175,992.00	0.80
32	603501	韦尔股份	7,000	2,175,390.00	0.79
33	688396	华润微	33,661	2,174,500.60	0.79
34	002572	索菲亚	95,700	2,124,540.00	0.78
35	300073	当升科技	23,400	2,032,758.00	0.74
36	000001	平安银行	123,200	2,030,336.00	0.74
37	300750	宁德时代	3,300	1,940,400.00	0.71
38	600438	通威股份	42,600	1,915,296.00	0.70
39	002352	顺丰控股	26,400	1,819,488.00	0.66
40	300037	新宙邦	15,600	1,762,800.00	0.64
41	600216	浙江医药	100,000	1,708,000.00	0.62
42	000729	燕京啤酒	200,000	1,694,000.00	0.62
43	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.61
44	600926	杭州银行	129,000	1,653,780.00	0.60
45	300633	开立医疗	50,900	1,625,237.00	0.59
46	300782	卓胜微	4,960	1,620,928.00	0.59
47	000932	华菱钢铁	296,860	1,516,954.60	0.55
48	600219	南山铝业	319,000	1,502,490.00	0.55
49	000596	古井贡酒	6,000	1,464,000.00	0.54
50	600258	首旅酒店	54,700	1,429,311.00	0.52
51	601225	陕西煤业	115,400	1,407,880.00	0.51
52	600521	华海药业	62,300	1,349,418.00	0.49
53	603259	药明康德	10,920	1,294,893.60	0.47
54	002415	海康威视	24,300	1,271,376.00	0.46
55	601233	桐昆股份	59,600	1,262,328.00	0.46
56	300012	华测检测	40,900	1,098,983.00	0.40
57	600507	方大特钢	136,200	1,062,360.00	0.39
58	300415	伊之密	46,300	983,412.00	0.36
59	002304	洋河股份	5,900	971,907.00	0.36
60	002791	坚朗五金	4,500	817,155.00	0.30
61	300759	康龙化成	5,200	734,604.00	0.27
62	300347	泰格医药	5,100	651,780.00	0.24
63	688385	复旦微电	8,986	435,731.14	0.16
64	688303	大全能源	6,977	421,410.80	0.15
65	688187	时代电气	4,684	358,934.92	0.13
66	301050	雷电微力	1,431	347,561.55	0.13

67	688733	壹石通	3,409	271,901.84	0.10
68	301069	凯盛新材	5,386	260,185.04	0.10
69	688772	珠海冠宇	5,299	257,796.35	0.09
70	688776	国光电气	1,205	235,493.15	0.09
71	688711	宏微科技	1,865	231,092.15	0.08
72	688190	云路股份	1,836	217,529.28	0.08
73	300994	久祺股份	4,195	198,841.90	0.07
74	301127	天源环保	9,672	194,154.96	0.07
75	301180	万祥科技	6,536	191,994.54	0.07
76	301177	迪阿股份	1,452	184,046.98	0.07
77	688248	南网科技	8,276	180,251.28	0.07
78	688667	菱电电控	969	166,813.35	0.06
79	301185	鸥玛软件	5,776	153,629.60	0.06
80	301046	能辉科技	2,891	146,069.10	0.05
81	688110	东芯股份	3,231	145,976.58	0.05
82	688676	金盘科技	3,750	122,437.50	0.04
83	301168	通灵股份	2,034	121,101.24	0.04
84	301100	风光股份	3,179	116,993.31	0.04
85	688257	新锐股份	1,691	111,944.20	0.04
86	688296	和达科技	2,173	107,867.72	0.04
87	301087	可孚医疗	1,369	107,551.03	0.04
88	688227	品高股份	3,279	105,190.32	0.04
89	301133	金钟股份	2,860	104,178.36	0.04
90	301189	奥尼电子	1,738	103,811.90	0.04
91	688091	上海谊众	2,272	101,967.36	0.04
92	301091	深城交	3,013	98,843.40	0.04
93	688697	纽威数控	5,837	98,295.08	0.04
94	601111	中国国航	10,700	97,691.00	0.04
95	301199	迈赫股份	2,773	97,012.25	0.04
96	688739	成大生物	1,173	89,300.49	0.03
97	688786	悦安新材	1,513	85,650.93	0.03
98	688265	南模生物	1,187	83,149.35	0.03
99	600955	维远股份	1,694	77,297.22	0.03
100	688211	中科微至	1,012	75,900.00	0.03
101	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.03
102	688236	春立医疗	2,701	73,980.39	0.03
103	301108	洁雅股份	1,232	73,613.60	0.03
104	301092	争光股份	1,909	73,456.08	0.03
105	301093	华兰股份	1,389	72,229.19	0.03

106	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.03
107	301072	中捷精工	1,802	67,720.83	0.02
108	688071	华依科技	1,101	67,227.06	0.02
109	301049	超越科技	1,954	67,165.80	0.02
110	688737	中自科技	1,076	62,956.76	0.02
111	688707	振华新材	1,171	58,994.98	0.02
112	301029	怡合达	462	41,459.88	0.02
113	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.02
114	300957	贝泰妮	194	37,302.32	0.01
115	001213	中铁特货	5,818	35,257.08	0.01
116	300953	震裕科技	240	31,336.80	0.01
117	300973	立高食品	237	31,302.96	0.01
118	300979	华利集团	333	29,653.65	0.01
119	688121	卓然股份	713	27,414.85	0.01
120	605555	德昌股份	655	26,724.00	0.01
121	688767	博拓生物	376	26,282.40	0.01
122	001217	华尔泰	1,239	23,925.09	0.01
123	688103	国力股份	335	23,339.45	0.01
124	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.01
125	301149	隆华新材	1,214	23,150.98	0.01
126	301018	申菱环境	782	20,347.64	0.01
127	301035	润丰股份	357	20,074.11	0.01
128	001216	华瓷股份	1,177	19,667.67	0.01
129	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.01
130	603213	镇洋发展	799	18,504.84	0.01
131	301060	兰卫医学	587	18,144.17	0.01
132	301101	明月镜片	345	17,398.35	0.01
133	300986	志特新材	264	16,898.64	0.01
134	301111	粤万年青	379	16,649.47	0.01
135	301211	亨迪药业	469	16,475.97	0.01
136	300614	百川畅银	329	15,792.00	0.01
137	300981	中红医疗	193	15,428.42	0.01
138	301089	拓新药业	220	15,382.40	0.01
139	001218	丽臣实业	350	15,267.00	0.01
140	301138	华研精机	285	15,261.75	0.01
141	301188	力诺特玻	647	15,042.75	0.01
142	301039	中集车辆	1,167	14,517.48	0.01
143	301126	达嘉维康	662	14,133.70	0.01
144	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.01



145	300985	致远新能	280	13,725.60	0.01
146	300967	晓鸣股份	507	13,516.62	0.00
147	603048	浙江黎明	464	13,456.00	0.00
148	605567	春雪食品	629	13,397.70	0.00
149	301009	可靠股份	721	13,302.45	0.00
150	605599	菜百股份	980	13,190.80	0.00
151	301017	漱玉平民	555	13,186.80	0.00
152	301221	光庭信息	144	13,093.92	0.00
153	301020	密封科技	421	12,789.98	0.00
154	301026	浩通科技	203	12,715.92	0.00
155	301063	海锅股份	324	12,231.09	0.00
156	300996	普联软件	386	12,193.74	0.00
157	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00
158	301021	英诺激光	290	12,003.10	0.00
159	300993	玉马遮阳	410	11,771.10	0.00
160	688622	禾信仪器	196	11,750.20	0.00
161	300987	川网传媒	301	11,678.80	0.00
162	301078	孩子王	756	11,597.04	0.00
163	301090	华润材料	950	11,580.50	0.00
164	605033	美邦股份	423	11,298.33	0.00
165	301048	金鹰重工	843	10,916.85	0.00
166	301002	崧盛股份	201	10,813.80	0.00
167	300978	东箭科技	593	10,709.58	0.00
168	301166	优宁维	110	10,547.90	0.00
169	301011	华立科技	175	10,535.00	0.00
170	603219	富佳股份	528	10,449.12	0.00
171	301068	大地海洋	336	9,964.80	0.00
172	301028	东亚机械	733	9,888.17	0.00
173	301098	金埔园林	369	9,853.26	0.00
174	301182	凯旺科技	294	9,801.96	0.00
175	301055	张小泉	441	9,655.59	0.00
176	300774	倍杰特	444	9,279.60	0.00
177	301040	中环海陆	241	9,256.81	0.00
178	300950	德固特	219	9,143.25	0.00
179	300854	中兰环保	326	9,126.98	0.00
180	301198	喜悦智行	262	8,970.88	0.00
181	301062	上海艾录	525	8,932.29	0.00
182	605598	上海港湾	553	8,809.29	0.00
183	301190	善水科技	308	8,734.88	0.00

184	605138	盛泰集团	723	8,733.84	0.00
185	605577	龙版传媒	588	8,625.96	0.00
186	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
187	301025	读客文化	403	8,398.52	0.00
188	300991	创益通	254	8,359.14	0.00
189	001219	青岛食品	272	8,323.20	0.00
190	300958	建工修复	300	8,103.00	0.00
191	301193	家联科技	268	8,061.44	0.00
192	300961	深水海纳	394	8,017.90	0.00
193	301056	森赫股份	716	8,003.80	0.00
194	301179	泽宇智能	149	7,810.58	0.00
195	300814	中富电路	328	7,806.40	0.00
196	301073	君亭酒店	232	7,636.80	0.00
197	301081	严牌股份	403	7,386.99	0.00
198	301057	汇隆新材	373	7,220.93	0.00
199	301096	百诚医药	89	7,133.35	0.00
200	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
201	300963	中洲特材	283	6,888.22	0.00
202	300972	万辰生物	430	6,815.50	0.00
203	301088	戎美股份	266	6,647.34	0.00
204	301033	迈普医学	108	6,472.44	0.00
205	301032	新柴股份	513	6,407.37	0.00
206	301004	嘉益股份	312	6,389.76	0.00
207	301083	百胜智能	416	6,335.68	0.00
208	301036	双乐股份	205	6,109.00	0.00
209	301041	金百泽	215	6,058.70	0.00
210	300960	通业科技	234	5,833.62	0.00
211	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
212	301059	金三江	281	5,449.09	0.00
213	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
214	300995	奇德新材	191	5,292.61	0.00
215	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
216	300992	泰福泵业	200	4,950.00	0.00
217	301027	华蓝集团	286	4,750.46	0.00
218	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
219	301037	保立佳	193	4,664.81	0.00
220	301079	邵阳液压	140	4,083.80	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	300274	阳光电源	10,434,642.00	3.62
2	300896	爱美客	8,573,585.60	2.97
3	600048	保利发展	8,486,071.52	2.94
4	601636	旗滨集团	7,905,551.68	2.74
5	603882	金域医学	7,602,350.00	2.64
6	002612	朗姿股份	7,219,202.00	2.50
7	600900	长江电力	7,054,622.00	2.45
8	000933	神火股份	6,295,315.00	2.18
9	601899	紫金矿业	6,024,704.46	2.09
10	601601	中国太保	5,988,662.00	2.08
11	601939	建设银行	5,855,490.00	2.03
12	603259	药明康德	5,717,299.00	1.98
13	601398	工商银行	5,218,947.00	1.81
14	600919	江苏银行	5,218,095.41	1.81
15	002832	比音勒芬	4,772,830.93	1.65
16	300438	鹏辉能源	4,770,776.54	1.65
17	603185	上机数控	4,591,845.00	1.59
18	601919	中远海控	4,565,125.10	1.58
19	600438	通威股份	4,559,136.00	1.58
20	002415	海康威视	4,463,005.00	1.55

### 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	601899	紫金矿业	13,309,812.42	4.62
2	601012	隆基股份	13,133,805.65	4.55
3	601919	中远海控	13,087,851.00	4.54
4	600809	山西汾酒	12,109,154.67	4.20
5	600426	华鲁恒升	10,075,791.30	3.49
6	300896	爱美客	8,319,604.05	2.88
7	603882	金域医学	8,309,885.72	2.88

8	601318	中国平安	7,892,958.20	2.74
9	300438	鹏辉能源	7,455,605.32	2.59
10	601015	陕西黑猫	7,019,961.00	2.43
11	600900	长江电力	6,970,134.00	2.42
12	600309	万华化学	6,881,595.60	2.39
13	603128	华贸物流	6,523,080.45	2.26
14	000157	中联重科	6,224,464.00	2.16
15	601939	建设银行	5,957,630.00	2.07
16	000001	平安银行	5,647,163.00	1.96
17	600741	华域汽车	5,547,320.00	1.92
18	300750	宁德时代	5,513,116.00	1.91
19	601677	明泰铝业	5,296,194.00	1.84
20	000725	京东方 A	5,283,382.00	1.83

#### 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	347,181,794.17
卖出股票收入（成交）总额	416,148,300.59

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	49,910,470.50	18.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,014,020.20	3.29
	其中：政策性金融债	9,014,020.20	3.29
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	58,924,490.70	21.53

**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	019664	21 国债 16	167,570	16,763,702.80	6.13
2	019658	21 国债 10	167,680	16,742,848.00	6.12
3	019654	21 国债 06	163,990	16,403,919.70	5.99
4	018009	国开 1803	77,580	9,014,020.20	3.29

**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**

国开 1803：

2021 年 1 月 8 日，银保监会银保监罚决字（2020）67 号显示，国家开发银行存在为违规的政

府购买服务项目提供融资等 24 项违法违规事实，对其处以罚款 4880 万元。对以上事件，本基金判断，国家开发银行经营稳健，上述处罚对公司影响可控。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

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

### 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	35,307.77
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	644,267.12
5	应收申购款	116,199.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	795,774.05

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券（可交换债券）。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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

份额级别	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
长盛成长价值混合 A	16,934	8,971.66	3,046,190.18	2.01%	148,879,846.76	97.99%
长盛成长价值混合 C	223	278.65	0.00	0.00%	62,138.34	100.00%
合计	17,157	8,858.67	3,046,190.18	2.00%	148,941,985.10	98.00%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	长盛成长价值混合 A	48,379.67	0.0318%
	长盛成长价值混合 C	0.00	0.0000%
	合计	48,379.67	0.0318%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

### 9.3 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	份额级别	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	长盛成长价值混合 A	0
	长盛成长价值混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛成长价值混合 A	0
	长盛成长价值混合 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛成长价值混合 A	长盛成长价值混合 C
基金合同生效日（2002年9月18日）基金份额总额	3,166,886,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	181,260,945.20	-
本报告期基金总申购份额	11,791,395.24	168,323.76
减:本报告期基金总赎回份额	41,126,303.50	106,185.42
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	151,926,036.94	62,138.34



## § 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, 聘任吴达同志为任公司副总经理。

#### 11.2.2 基金经理的变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意, 自 2021 年 8 月 26 日起, 王宁同志担任长盛成长价值证券投资基金基金经理, 付海宁不再担任长盛成长价值证券投资基金基金经理。

#### 11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2021 年 5 月, 中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2021 年 8 月, 中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

### 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

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙), 本报告期内本基金未更换会计师事务所, 本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 60,000.00 元, 已连续为本基金提供审计服务 20 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	253,245,486.79	34.02%	235,847.26	34.02%	-
上海证券	1	177,651,063.10	23.87%	165,447.63	23.87%	-
国元证券	1	147,733,778.11	19.85%	137,584.19	19.85%	-
银河证券	1	104,673,877.18	14.06%	97,482.68	14.06%	-
中信建投	1	49,247,596.25	6.62%	45,864.58	6.62%	-
东北证券	1	11,805,214.69	1.59%	10,994.39	1.59%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	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
广发证券	154,543,253.62	31.88%	687,200,000.00	37.96%	-	-
上海证券	78,472,865.47	16.19%	496,600,000.00	27.43%	-	-
国元证券	131,987,567.94	27.23%	626,400,000.00	34.60%	-	-
银河证券	85,778,489.80	17.70%	-	-	-	-
中信建投	33,928,720.85	7.00%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

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) 财力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定。

- (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旗下基金增加百信银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2021年12月27日
2	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
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	中国证监会指定披露媒介	2021年12月14日
4	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
5	长盛基金管理有限公司旗下全部	中国证监会指定披露媒介	2021年10月27日

	基金 2021 年 3 季度报告提示性公告		
6	长盛成长价值证券投资基金 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
7	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
8	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
9	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加泰信财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 9 月 30 日
10	长盛成长价值证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 31 日
11	长盛成长价值证券投资基金（长盛成长价值混合 C 份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 31 日
12	长盛成长价值证券投资基金（长盛成长价值混合 A 份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 31 日
13	长盛基金管理有限公司关于调整长盛成长价值证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 28 日
14	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
15	长盛成长价值证券投资基金 2021 年中期报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 28 日
16	长盛基金管理有限公司关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司销售旗下部分基金并开通定投及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 8 月 17 日
17	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
18	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
19	长盛成长价值证券投资基金 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
20	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
21	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

22	长盛成长价值证券投资基金托管协议	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 8 日
23	长盛成长价值证券投资基金基金合同	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 8 日
24	关于长盛成长价值证券投资基金增加 C 类份额、增加侧袋机制、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 7 月 8 日
25	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
26	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
27	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
28	长盛成长价值证券投资基金 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
29	长盛成长价值证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定披露媒介	2021 年 4 月 20 日
30	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏江南农村商业银行作为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 4 月 9 日
31	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
32	长盛成长价值证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2021 年 3 月 31 日
33	长盛成长价值证券投资基金 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
34	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

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。

### 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、长盛成长价值证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛成长价值证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛成长价值证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛成长价值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。

### 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