

# 长盛同德主题增长混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>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	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同德主题增长混合型证券投资基金
基金简称	长盛同德主题混合
基金主代码	519039
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 10 月 25 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	497,134,284.79 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资目标是在确定促进中国经济持续增长的主题背景下，挖掘中国经济持续增长的动力之所在，选取具有高成长性和具备持续增长潜力的上市公司，分享中国经济高速增长成果；在严格控制投资风险的前提下，努力保持基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将沿着全球化、城镇化、消费升级、制度变革四大主题进行大类资产配置；根据企业获利能力、增长能力、资产回报率、资产管理能力等定量指标，结合公司治理结构状况等定性指标对行业内上市公司进行综合评价，动态地寻找行业与个股的最佳结合点。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金。风险低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金，属于较高风险、较高回报的基金产品。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁	秦一楠
	联系电话	010-86497608	010-66060069
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95599
传真		010-86497999	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100029	100031
法定代表人		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	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>

址	
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	17,815,539.47
本期利润	-103,965,159.67
加权平均基金份额本期利润	-0.2069
本期加权平均净值利润率	-10.07%
本期基金份额净值增长率	-8.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	633,622,615.46
期末可供分配基金份额利润	1.2746
期末基金资产净值	1,092,924,265.34
期末基金份额净值	2.1984
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	105.10%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

4、本基金由同德证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 10 月 25 日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	12.25%	1.38%	7.69%	0.86%	4.56%	0.52%

过去三个月	9.67%	1.59%	5.27%	1.15%	4.40%	0.44%
过去六个月	-8.41%	1.60%	-6.88%	1.16%	-1.53%	0.44%
过去一年	-6.43%	1.39%	-10.41%	1.00%	3.98%	0.39%
过去三年	66.43%	1.45%	17.45%	1.01%	48.98%	0.44%
自基金转型起至今	105.10%	1.39%	1.96%	1.32%	103.14%	0.07%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

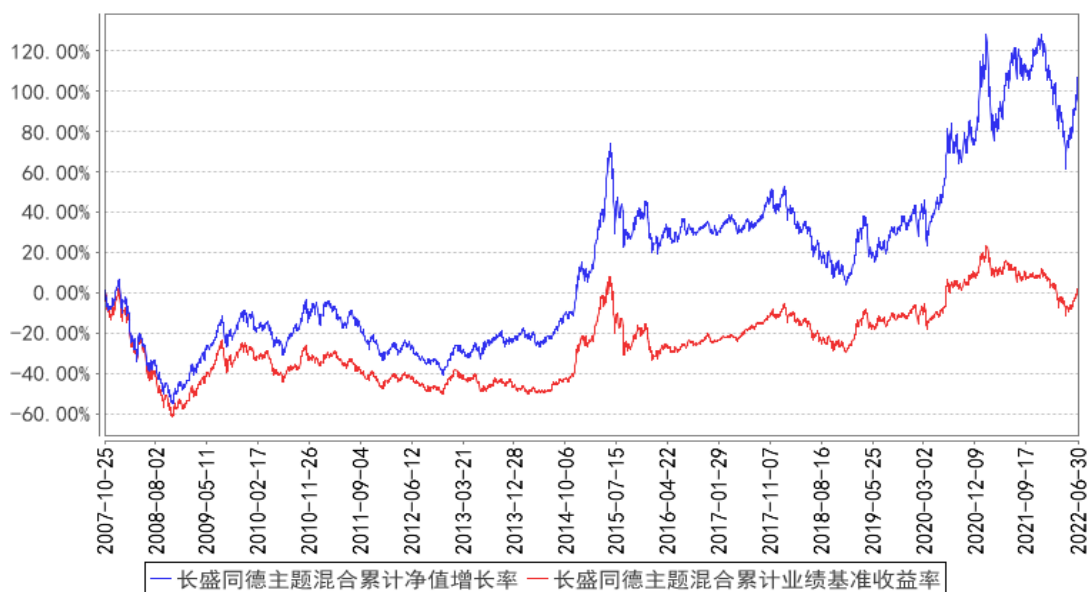
本基金的业绩比较基准为=沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%。

本基金为混合型基金，在综合比较目前市场上各主要指数的编制特点并考虑本基金股票组合的投资标的之后，选定沪深 300 指数作为本基金股票组合的业绩基准；债券组合的业绩基准则采用上证国债指数。

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 80%、20%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

长盛同德主题混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金由同德证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 10 月 25 日。

2、按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内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 2022 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十只开放式基金，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		
郭堃	本基金基金经理 长盛同盛成长优选灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理 长盛制造精选混合型证券投资基金基金经理 长盛核心成长混合型证券投资基金基金经理 长盛优势企业精选混合型证券投资基金基金经理 公司副总经理。	2021 年 1 月 7 日	-	11 年	郭堃先生，硕士。曾任阳光资产管理股份有限公司新能源和家电行业分析师、制造业研究组组长，泓德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。



张 谊 然	本基金基金经理 长盛同益成长回报灵活配置混合型投资基金（LOF）基金经理 长盛同享灵活配置混合型证券投资基金基金经理 研究部行政负责人。	2021年7月15日	-	14年	张谊然女士，硕士。曾任中国国际金融股份有限公司基础研究员。2012年9月加入长盛基金管理有限公司。
-------	--	------------	---	-----	---

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

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

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

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

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

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问

题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年前四个月，受到俄乌冲突、疫情等多重影响，市场回调较大，尤其是成长类行业估值大幅收敛，四月底接近历史底部估值。5 月份开始，随着疫情缓解信号显现，叠加充裕的流动性，新能源为代表的高景气成长行业估值快速修复并延续至今。

组合在前四个月对仓位进行了一定控制，整体仓位相比 2021 年底下降 8-9 个点。4 月份市场悲观情绪演绎至极致，成长行业估值继续快速下降，我们组合停止降低仓位，并且通过增持部分成长股保持仓位的稳定，略有遗憾的是这个阶段没有更大幅度提高股票仓位。

组合结构上，我们今年以来一直更看好成长行业，整个上半年持仓相对较多的行业保持在新能源、医药、电子等。在四月份市场大幅下跌阶段，我们进一步增加了组合中高景气成长行业的比例。

#### 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 2.1984 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.41%，同期业绩比较基准收益率为-6.88%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度以及整个下半年，我们认为：1) 如果没有疫情的超预期扰动，经济将从二季度的底部逐渐修复，半年之内更倾向于投资端的恢复好于消费。2) 国内流动性短期内仍会保持宽松。3) 新能源、军工、汽车电子等高景气行业估值性价比相比 4 月底大幅降低，但个人认为处于合理范围上沿；医药、消费电子、通信等景气度较为平稳或边际下行行业仍处于历史估值偏低位置。

随着市场的快速反弹以及基于对下半年市场的判断，我们会让组合品种的估值搭配更为平衡，相对增加医药、tmt 等低位成长行业的权重；而新能源、军工等高景气成长行业则会更优化内部持股选择。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2022 年 6 月 30 日，期末可供分配收益为 633,622,615.46 元，其中：未分配收益已实现部分为 778,705,347.79 元，未分配收益未实现部分为-145,082,732.33 元。

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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——长盛基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛同德主题增长混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	84,707,990.79	78,206,708.25
结算备付金		163,213.27	9,105,447.85
存出保证金		103,259.26	95,852.54
交易性金融资产	6.4.7.2	864,075,713.24	1,079,533,243.96
其中：股票投资		863,641,944.55	1,079,533,243.96
基金投资		-	-
债券投资		433,768.69	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	65,000,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		153,415,778.96	53,731.32
应收股利		-	-
应收申购款		19,177.80	3,188.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	30,000.00	44,604.95
资产总计		1,102,515,133.32	1,232,042,777.07
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,188,679.10	4,928,855.15
应付赎回款		647,405.46	729,292.57
应付管理人报酬		1,274,373.46	1,556,319.87
应付托管费		212,395.57	259,386.64
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,071,947.74	4,071,945.72
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,196,066.65	1,379,990.28
负债合计		9,590,867.98	12,925,790.23
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	459,301,649.88	469,250,681.76
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	633,622,615.46	749,866,305.08
净资产合计		1,092,924,265.34	1,219,116,986.84
负债和净资产总计		1,102,515,133.32	1,232,042,777.07

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.1984 元，基金份额总额 497,134,284.79 份。

2、以下比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛同德主题增长混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-94,841,756.89	148,177,074.67
1. 利息收入		1,819,590.57	1,216,464.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,481,807.20	1,216,350.31
债券利息收入		-	113.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		337,783.37	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		25,111,251.22	168,032,588.06
其中：股票投资收益	6.4.7.10	19,383,520.46	160,880,480.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	186,397.89	1,569,401.16
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	5,541,332.87	5,582,706.45
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-121,780,699.14	-21,086,711.86
4. 汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.16	8,100.46	14,734.28
<b>减: 二、营业总支出</b>		<b>9,123,402.78</b>	<b>12,487,856.41</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,703,089.40	8,534,596.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,283,848.22	1,422,432.66
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		1.10	0.41
8. 其他费用	6.4.7.17	136,464.06	2,530,827.23
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-103,965,159.67</b>	<b>135,689,218.26</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-103,965,159.67</b>	<b>135,689,218.26</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-103,965,159.67</b>	<b>135,689,218.26</b>

注: 以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示: 2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产 (基金净值) 变动表

会计主体: 长盛同德主题增长混合型证券投资基金

本报告期: 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期末净资产 (基金净值)	469,250,681.76	-	749,866,305.08	1,219,116,986.84
加: 会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	469,250,681.76	-	749,866,305.08	1,219,116,986.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-9,949,031.88	-	-116,243,689.62	-126,192,721.50
(一)、综合收益总额	-	-	-103,965,159.67	-103,965,159.67
(二)、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)	-9,949,031.88	-	-12,278,529.95	-22,227,561.83
其中:1.基金申购款	3,744,274.38	-	4,831,119.15	8,575,393.53
2.基金赎回款	-13,693,306.26	-	-17,109,649.10	-30,802,955.36
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	459,301,649.88	-	633,622,615.46	1,092,924,265.34
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	514,786,612.91	-	648,806,500.40	1,163,593,113.31
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	514,786,612.91	-	648,806,500.40	1,163,593,113.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-30,468,397.16	-	98,512,566.46	68,044,169.30
(一)、综合收益总额	-	-	135,689,218.26	135,689,218.26
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-30,468,397.16	-	-37,176,651.80	-67,645,048.96

（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	34,298,288.10	-	52,238,397.18	86,536,685.28
2. 基金赎回款	-64,766,685.26	-	-89,415,048.98	-154,181,734.24
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	484,318,215.75	-	747,319,066.86	1,231,637,282.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵

刁俊东

龚珉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长盛同德主题增长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据原同德证券投资基金(以下简称“基金同德”)基金份额持有人大会 2007 年 9 月 13 日审议通过的《关于同德证券投资基金转型有关事项的议案》并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

[2007]273 号《关于核准同德证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，由原基金同德转型而来。原基金同德为契约型封闭式基金，于上海证券交易所(以下简称“上交所”)交易上市，存续期限至 2007 年 11 月 30 日止。根据上交所上证债字[2007]73 号《关于终止同德证券投资基金上市的决定》同意，原基金同德于 2007 年 10 月 24 日进行终止上市权利登记。自 2007 年 10 月 25 日起，原基金同德终止上市，原基金同德更名为长盛同德主题增长股票型证券投资基金(以下简称“原同德股票型基金”)，《同德证券投资基金基金合同》失效的同时《长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金合同》生效。原同德股票型基金为契约型开放式，存续期限不定。

原基金同德于基金合同失效前日经审计的基金资产净值为 1,535,765,204.80 元，已于原同德股票型基金的基金合同生效日全部转为原同德股票型基金的基金资产净值。根据《长盛同德主题增长股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原同德证券投资基金基金份额转换结果的公告》，原同德股票型基金于 2007 年 11 月 21 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:2.865509874，并于 2007 年 11 月 22 日进行了份额变更登记。

原同德股票型基金于基金合同生效后自 2007 年 10 月 26 日至 2007 年 11 月 16 日止期间开放集中申购，共募集人民币 10,814,199,778.08 元，其中用于折合基金份额的集中申购资金利息共计 9,661,422.16 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第 150 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2007 年 11 月 21 日基金份额拆分后的基金份额净值 1.0000 元折合为 10,823,861,200.24 份基金份额，其中集中申购资金利息折合 9,661,422.16 份基金份额，并于 2007 年 11 月 22 日进行了份额确认登记。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，原同德股票型基金于 2015 年 7 月 23 日公告后更名为长盛同德主题增长混合型证券投资基金。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金合同》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，主要包括国内依法发行、上市 的股票、债券、短期金融工具、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。其中股票投资占基金资产净值的比例为 60-95%，债券投资占基金资产净值的比例为 0-40%，权证投资占基金资产净值的净值的比例为 0-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同德主题增长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。除下述会计政策外,本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

##### 以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.2 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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认

后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

#### 6.4.4.3 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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额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扣除相关交易费用及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。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《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”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 78,206,708.25 元、9,105,447.85 元、95,852.54 元、65,000,000.00 元、14,604.95 元、53,731.32 元、3,188.20 元和 30,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 78,244,197.35 元、9,109,545.25 元、95,895.64 元、64,972,975.35 元、0.00 元、53,731.32 元、3,188.20 元和 30,000.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,079,533,243.96 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,079,533,243.96 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,928,855.15 元、729,292.57 元、1,556,319.87 元、259,386.64 元、521,662.03 元和 749,328.25 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,928,855.15 元、729,292.57 元、

1,556,319.87 元、259,386.64 元、521,662.03 元和 749,328.25 元。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，



其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	84,707,990.79
等于：本金	84,616,264.58
加：应计利息	91,726.21
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	84,707,990.79

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	788,263,394.96	-	863,641,944.55	75,378,549.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	416,000.00	97.19	433,768.69	17,671.50
交易所市场				

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	416,000.00	97.19	433,768.69	17,671.50
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		788,679,394.96	97.19	864,075,713.24	75,396,221.09

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

##### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	30,000.00
待摊费用	-
合计	30,000.00

##### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	29.01
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	326,384.56
其中：交易所市场	326,384.56
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	118,095.94
其他	251,557.14
合计	1,196,066.65

##### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	507,902,865.56	469,250,681.76
本期申购	4,052,669.85	3,744,274.38
本期赎回（以“-”号填列）	-14,821,250.62	-13,693,306.26
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	497,134,284.79	459,301,649.88

注：申购含转换入，赎回含转换出。

#### 6.4.7.8 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
本期期初	777,843,068.71	-27,976,763.63	749,866,305.08
本期利润	17,815,539.47	-121,780,699.14	-103,965,159.67
本期基金份额交易产生的变动数	-16,953,260.39	4,674,730.44	-12,278,529.95
其中：基金申购款	6,303,349.18	-1,472,230.03	4,831,119.15
基金赎回款	-23,256,609.57	6,146,960.47	-17,109,649.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	778,705,347.79	-145,082,732.33	633,622,615.46

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	1,449,412.06
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	31,530.22	
其他	864.92	
合计	1,481,807.20	

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	股票投资收益——买卖股票差价收入	19,383,520.46
股票投资收益——赎回差价收入	-	
股票投资收益——申购差价收入	-	

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	19,383,520.46

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	460,501,992.79
减：卖出股票成本总额	439,970,743.91
减：交易费用	1,147,728.42
买卖股票差价收入	19,383,520.46

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	276.77
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	186,121.12
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	186,397.89

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	903,310.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	717,000.00
减：应计利息总额	188.58
减：交易费用	0.60
买卖债券差价收入	186,121.12

#### 6.4.7.12 贵金属投资收益

##### 6.4.7.12.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.13 衍生工具收益

无。

## 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,541,332.87
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,541,332.87

## 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-121,780,699.14
股票投资	-121,798,370.64
债券投资	17,671.50
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-121,780,699.14

## 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	7,987.28
基金转换费收入	113.18
合计	8,100.46

注：1、本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；对于持续持有期长于 7 日（含）的投资者收取赎回费的 25% 归入基金财产。

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。

## 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	8,768.12
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	136,464.06

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
国元证券	-	-	20,048,916.36	1.24

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国元证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
国元证券	18,671.49	1.43	18,671.49	7.47

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

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

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,703,089.40	8,534,596.11
其中：支付销售机构的客户维护费	2,877,643.01	3,401,758.36

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$
**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,283,848.22	1,422,432.66

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

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

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

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

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	84,707,990.79	1,449,412.06	200,319,077.69	1,195,050.53
合计	84,707,990.79	1,449,412.06	200,319,077.69	1,195,050.53

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

无。



## 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	限售期锁定	52.37	48.40	249	13,040.13	12,051.60	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	限售期锁定	42.50	32.03	507	16,575.00	16,239.21	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	限售期锁定	11.40	20.44	577	6,577.80	11,793.88	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	限售期锁定	13.73	16.01	1,032	14,169.36	16,522.32	-
301125	腾亚精工	2022年5月27日	6个月	限售期锁定	22.49	29.48	327	7,354.23	9,639.96	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	限售期锁定	22.55	37.67	237	5,344.35	8,927.79	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	限售期锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	限售期锁定	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	限售期锁定	33.68	46.70	398	13,404.64	18,586.60	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	限售期锁定	15.64	20.34	379	5,927.56	7,708.86	-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	限售期锁定	40.25	30.56	257	10,344.25	7,853.92	-

301196	唯科科技	2022年 1月4日	6个月	限售期 锁定	64.08	37.50	271	17,365.68	10,162.50	-
301201	诚达药业	2022年 1月12日	6个月	限售期 锁定	72.69	71.48	353	25,659.57	25,232.44	-
301207	华兰疫苗	2022年 2月10日	6个月	限售期 锁定	56.88	56.40	569	32,364.72	32,091.60	-
301215	中汽股份	2022年 2月28日	6个月	限售期 锁定	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022年 3月21日	6个月	限售期 锁定	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301217	铜冠铜箔	2022年 1月20日	6个月	限售期 锁定	17.27	14.82	3,450	59,581.50	51,129.00	-
301219	腾远钴业	2022年 3月10日	6个月	限售期 锁定	173.98	87.83	367	35,491.92	32,233.61	-
301233	盛帮股份	2022年 6月24日	1个月内(含)	新股未 上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022年 6月24日	6个月	限售期 锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301238	瑞泰新材	2022年 6月10日	6个月	限售期 锁定	19.18	35.45	3,033	58,172.94	107,519.85	-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	1个月内(含)	新股未 上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	6个月	限售期 锁定	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301256	华融化学	2022年 3月14日	6个月	限售期 锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301259	艾布鲁	2022年 4月18日	6个月	限售期 锁定	18.39	25.84	483	8,882.37	12,480.72	-
301263	泰恩康	2022年 3月22日	6个月	限售期 锁定	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-

		日								
301286	侨源股份	2022年 6月6日	6个月	限售期 锁定	16.91	21.57	784	13,257.44	16,910.88	-
301298	东利机械	2022年 5月27日	6个月	限售期 锁定	12.68	23.59	634	8,039.12	14,956.06	-
600938	中国海油	2022年 4月14日	6个月	限售期 锁定	10.80	16.16	84,004	907,243.20	1,357,504.64	-
688047	龙芯中科	2022年 6月17日	6个月	限售期 锁定	60.06	86.25	8,345	501,200.70	719,756.25	-
688225	亚信安全	2022年 1月26日	6个月	限售期 锁定	30.51	20.95	5,534	168,842.34	115,937.30	-
688237	超卓航科	2022年 6月24日	1个月 内(含)	新股未 上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688267	中触媒	2022年 2月9日	6个月	限售期 锁定	41.90	31.86	3,390	142,041.00	108,005.40	-
688337	普源精电	2022年 3月30日	6个月	限售期 锁定	60.88	53.72	6,563	399,555.44	352,564.36	-
688400	凌云光	2022年 6月27日	1个月 内(含)	新股未 上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
127064	杭氧转债	2022年 5月19日	1-6个月(含)	配债未上市	100.00	100.02	3,650	365,000.00	365,068.80	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

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

低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，属于风险程度较高的投资品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金，高于货币型基金与债券型基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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。

于 2022 年 6 月 30 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 0.04%（2021 年 12 月 31 日：无）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品

种比例以及组合在短时间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）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合上述要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	84,616,264.58	-	-	91,726.21	84,707,990.79
结算备付金	163,147.21	-	-	66.06	163,213.27
存出保证金	103,217.41	-	-	41.85	103,259.26
交易性金融资产	433,671.50	-	-	863,642,041.74	864,075,713.24
应收申购款	-	-	-	19,177.80	19,177.80
应收清算款	-	-	-	153,415,778.96	153,415,778.96
其他资产	-	-	-	30,000.00	30,000.00
资产总计	85,316,300.70	-	-	1,017,198,832.62	1,102,515,133.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	647,405.46	647,405.46
应付管理人报酬	-	-	-	1,274,373.46	1,274,373.46
应付托管费	-	-	-	212,395.57	212,395.57
应付清算款	-	-	-	2,188,679.10	2,188,679.10
应交税费	-	-	-	4,071,947.74	4,071,947.74
其他负债	-	-	-	1,196,066.65	1,196,066.65
负债总计	-	-	-	9,590,867.98	9,590,867.98
利率敏感度缺口	85,316,300.70	-	-	-1,007,607,964.64	1,092,924,265.34
上年度末 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	78,206,708.25	-	-	-	78,206,708.25
结算备付金	9,105,447.85	-	-	-	9,105,447.85
存出保证金	95,852.54	-	-	-	95,852.54
交易性金融资产	-	-	-	-1,079,533,243.96	1,079,533,243.96
买入返售金融资产	65,000,000.00	-	-	-	65,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	53,731.32	53,731.32
应收申购款	-	-	-	3,188.20	3,188.20
其他资产	-	-	-	44,604.95	44,604.95
资产总计	152,408,008.64	-	-	-1,079,634,768.43	1,232,042,777.07
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,928,855.15	4,928,855.15
应付赎回款	-	-	-	729,292.57	729,292.57

应付管理人报酬	-	-	-	1,556,319.87	1,556,319.87
应付托管费	-	-	-	259,386.64	259,386.64
应交税费	-	-	-	4,071,945.72	4,071,945.72
其他负债	-	-	-	1,379,990.28	1,379,990.28
负债总计	-	-	-	12,925,790.23	12,925,790.23
利率敏感度缺口	152,408,008.64	-	-	-1,066,708,978.20	1,219,116,986.84

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日本基金持有交易性债券投资比例为 0.04%（2021 年 12 月 31 日：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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投资比例为基金资产净值的 60-95%，债券、现金及其它短期金融工具为 0-40%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	863,641,944.55	79.02	1,079,533,243.96	88.55
合计	863,641,944.55	79.02	1,079,533,243.96	88.55

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外(附注 6.4.1)的其他市场变量保持不变		
	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(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)
分析	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	61,859,961.52	81,974,614.83
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-61,859,961.52	-81,974,614.83

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	859,647,956.59	1,076,046,274.66
第二层次	1,248,064.13	80,953.93
第三层次	3,179,692.52	3,406,015.37
合计	864,075,713.24	1,079,533,243.96

**6.4.14.2.2 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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	863,641,944.55	78.33
	其中：股票	863,641,944.55	78.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	433,768.69	0.04
	其中：债券	433,768.69	0.04
	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	84,871,204.06	7.70
8	其他各项资产	153,568,216.02	13.93
9	合计	1,102,515,133.32	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	21,398,333.20	1.96
B	采矿业	1,357,504.64	0.12
C	制造业	769,354,258.53	70.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,401.16	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	370,148.16	0.03
J	金融业	38,521,891.30	3.52
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	32,396,301.08	2.96
N	水利、环境和公共设施管理业	12,480.72	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,625.76	0.02
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	863,641,944.55	79.02

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603606	东方电缆	806,142	61,750,477.20	5.65
2	601012	隆基绿能	644,293	42,929,242.59	3.93
3	300395	菲利华	920,751	41,433,795.00	3.79
4	002597	金禾实业	909,900	39,425,967.00	3.61
5	603596	伯特利	489,020	39,209,623.60	3.59
6	002142	宁波银行	1,075,730	38,521,891.30	3.52
7	600519	贵州茅台	17,395	35,572,775.00	3.25
8	603916	苏博特	1,369,645	34,912,251.05	3.19

9	002709	天赐材料	560,288	34,771,473.28	3.18
10	300760	迈瑞医疗	107,200	33,575,040.00	3.07
11	603187	海容冷链	877,749	32,081,725.95	2.94
12	688733	壹石通	428,730	31,464,494.70	2.88
13	688116	天奈科技	184,770	31,314,819.60	2.87
14	002460	赣锋锂业	195,008	28,997,689.60	2.65
15	002415	海康威视	785,220	28,424,964.00	2.60
16	603259	药明康德	252,209	26,227,213.91	2.40
17	600132	重庆啤酒	178,100	26,109,460.00	2.39
18	002475	立讯精密	709,979	23,990,190.41	2.20
19	300394	天孚通信	847,500	22,941,825.00	2.10
20	002714	牧原股份	387,160	21,398,333.20	1.96
21	300633	开立医疗	660,555	19,836,466.65	1.81
22	688187	时代电气	267,300	17,371,827.00	1.59
23	002179	中航光电	270,760	17,144,523.20	1.57
24	300628	亿联网络	186,817	14,226,114.55	1.30
25	300866	安克创新	212,366	14,084,113.12	1.29
26	603501	韦尔股份	72,300	12,510,069.00	1.14
27	605305	中际联合	222,870	10,791,365.40	0.99
28	688180	君实生物	133,700	10,072,958.00	0.92
29	002430	杭氧股份	315,700	9,868,782.00	0.90
30	601890	亚星锚链	1,223,735	9,447,234.20	0.86
31	600309	万华化学	87,176	8,455,200.24	0.77
32	688105	诺唯赞	72,306	6,138,779.40	0.56
33	603345	安井食品	31,400	5,271,118.00	0.48
34	603517	绝味食品	65,700	3,798,774.00	0.35
35	600600	青岛啤酒	35,300	3,668,376.00	0.34
36	000568	泸州老窖	13,400	3,303,636.00	0.30
37	002465	海格通信	300,500	2,731,545.00	0.25
38	600809	山西汾酒	7,700	2,500,960.00	0.23
39	000596	古井贡酒	9,600	2,396,736.00	0.22
40	600887	伊利股份	60,200	2,344,790.00	0.21
41	002557	洽洽食品	38,205	2,175,010.65	0.20
42	600702	舍得酒业	8,500	1,733,915.00	0.16
43	688063	派能科技	5,499	1,716,787.80	0.16
44	600938	中国海油	84,004	1,357,504.64	0.12
45	603288	海天味业	13,520	1,221,667.20	0.11
46	688047	龙芯中科	8,345	719,756.25	0.07
47	688518	联赢激光	14,111	479,632.89	0.04
48	688337	普源精电	6,563	352,564.36	0.03
49	301238	瑞泰新材	9,033	333,299.85	0.03
50	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.03

51	300896	爱美客	403	241,804.03	0.02
52	688077	大地熊	2,829	238,512.99	0.02
53	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02
54	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.02
55	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.01
56	688225	亚信安全	5,534	115,937.30	0.01
57	688267	中触媒	3,390	108,005.40	0.01
58	688678	福立旺	4,198	106,503.26	0.01
59	605376	博迁新材	1,421	82,844.30	0.01
60	300919	中伟股份	610	75,579.00	0.01
61	300979	华利集团	925	67,599.00	0.01
62	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
63	300920	润阳科技	2,503	53,464.08	0.00
64	301217	铜冠铜箔	3,450	51,129.00	0.00
65	300973	立高食品	360	37,422.00	0.00
66	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
67	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
68	301219	腾远钴业	367	32,233.61	0.00
69	301207	华兰疫苗	569	32,091.60	0.00
70	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
71	301201	诚达药业	353	25,232.44	0.00
72	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
73	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
74	301153	中科江南	398	18,586.60	0.00
75	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
76	600570	恒生电子	420	18,286.80	0.00
77	301286	侨源股份	784	16,910.88	0.00
78	301120	新特电气	1,032	16,522.32	0.00
79	301103	何氏眼科	507	16,239.21	0.00
80	301298	东利机械	634	14,956.06	0.00
81	301190	善水科技	575	13,644.75	0.00
82	301259	艾布鲁	483	12,480.72	0.00
83	301097	天益医疗	249	12,051.60	0.00
84	301116	益客食品	577	11,793.88	0.00
85	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
86	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
87	301196	唯科科技	271	10,162.50	0.00
88	301125	腾亚精工	327	9,639.96	0.00
89	301130	西点药业	237	8,927.79	0.00
90	301181	标榜股份	257	7,853.92	0.00
91	301158	德石股份	379	7,708.86	0.00
92	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002714	牧原股份	27,623,958.00	2.27
2	300394	天孚通信	22,922,861.16	1.88
3	300633	开立医疗	21,595,183.42	1.77
4	688733	壹石通	19,963,398.43	1.64
5	002179	中航光电	15,416,889.20	1.26
6	688187	时代电气	14,302,717.44	1.17
7	300628	亿联网络	13,655,499.06	1.12
8	603606	东方电缆	13,525,205.14	1.11
9	002810	山东赫达	13,242,656.52	1.09
10	688105	诺唯赞	10,740,565.85	0.88
11	002709	天赐材料	10,543,250.00	0.86
12	688180	君实生物	10,201,438.13	0.84
13	601890	亚星锚链	9,192,802.40	0.75
14	002430	杭氧股份	9,175,449.20	0.75
15	002791	坚朗五金	8,415,200.00	0.69
16	002475	立讯精密	8,224,634.18	0.67
17	601012	隆基绿能	6,856,818.00	0.56
18	688029	南微医学	6,608,053.63	0.54
19	300760	迈瑞医疗	6,429,309.00	0.53
20	002415	海康威视	6,284,638.00	0.52

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	37,659,287.80	3.09
2	000858	五粮液	35,634,357.40	2.92
3	002709	天赐材料	31,979,391.46	2.62
4	688299	长阳科技	26,554,894.46	2.18
5	603596	伯特利	21,768,315.96	1.79
6	002791	坚朗五金	21,768,233.00	1.79
7	300496	中科创达	21,731,943.69	1.78
8	300015	爱尔眼科	16,454,575.88	1.35
9	603606	东方电缆	16,273,184.00	1.33
10	300274	阳光电源	15,964,859.94	1.31
11	601012	隆基绿能	14,338,686.20	1.18
12	603338	浙江鼎力	13,770,429.00	1.13
13	300782	卓胜微	12,997,404.40	1.07
14	002508	老板电器	12,396,473.70	1.02

15	300850	新强联	10,743,548.90	0.88
16	688116	天奈科技	10,647,862.10	0.87
17	600519	贵州茅台	9,978,912.00	0.82
18	002810	山东赫达	9,845,326.68	0.81
19	002036	联创电子	9,841,528.00	0.81
20	688065	凯赛生物	7,681,166.72	0.63

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	345,877,815.14
卖出股票收入（成交）总额	460,501,992.79

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	433,768.69	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	433,768.69	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127064	杭氧转债	3,650	365,068.80	0.03
2	113641	华友转债	510	68,699.89	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述两只债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

宁波银行：

2021年7月21日，甬银处罚字（2021）2号显示，宁波银行股份有限公司存在违规为存款人多头开立银行结算账户等6项违法违规事实，被处警告，并处罚款286.2万元。2021年8月6日，甬银保监罚决字（2021）57号显示，宁波银行股份有限公司存在贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储等6项违法违规事实，被处罚款275万元。2021年12月31日，甬银保监罚决字（2021）81号显示，宁波银行股份有限公司存在信用卡业务管理不到位的违法违规事实，被处罚款30万元。2022年4月18日，甬银保监罚决字（2022）28号显示，宁波银行股份有限公司存在信贷资金违规流入房地产领域等违法违规事实，被处罚款220万元；甬银保监罚决字（2022）30号显示，宁波银行股份有限公司存在代理保险销售不规范等违法违规事实，被处罚款30万元。2022年4月23日，甬银保监罚决字（2022）35号显示，宁波银行股份有限公司存在薪酬管理不到位等违法违规事实，被处罚款270万元。2022年5月27日，甬银保监罚决字（2022）44号显示，宁波银行股份有限公司存在非标投资业务管理不审慎等违法违规事实，被处罚款290万元。对以上事件，本基金判断，宁波银行股份有限公司经营稳健，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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。



## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	103,259.26
2	应收清算款	153,415,778.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	19,177.80
6	其他应收款	30,000.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	153,568,216.02

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
28,327	17,549.84	79,815,017.06	16.06	417,319,267.73	83.94

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	83,748.83	0.0168

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 10 月 25 日） 基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	507,902,865.56
本报告期基金总申购份额	4,052,669.85
减：本报告期基金总赎回份额	14,821,250.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	497,134,284.79

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

自 2022 年 4 月 1 日起实施的《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》明确将公司财务负责人纳入高级管理人员序列。本报告期内，公司按照法规规定完成了公司财务负责人刁俊东同志在监管机构的任职备案，以及在中国证券投资基金业协会的登记。

#### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期内本基金基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
首创证券	1	365,110,649.02	45.87	267,006.97	44.53	-
西部证券	2	160,776,926.53	20.20	117,576.64	19.61	-
天风证券	2	121,817,766.40	15.30	89,085.40	14.86	-
中泰证券	2	60,362,183.07	7.58	44,143.07	7.36	-
光大证券	1	40,993,351.26	5.15	38,178.29	6.37	-
国泰君安	2	35,937,532.27	4.51	33,467.18	5.58	-
华福证券	1	10,963,300.82	1.38	10,210.64	1.70	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	-

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
首创证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	903,310.30	100.00	550,000,000.00	22.21	-	-
天风证券	-	-	150,000,000.00	6.06	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	1,476,000,000.00	59.61	-	-
华福证券	-	-	300,000,000.00	12.12	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-

注：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、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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	中信证券	北京	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于终止部分基金销售机构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	2022 年 1 月 1 日
2	长盛基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具准则的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 1 日
3	长盛基金管理有限公司关于增加东方财富证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投、转换及费率优惠业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 14 日
4	长盛同德主题增长混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 22 日
5	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 1 月 22 日
6	长盛基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北交所上市股票的风险提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 2 月 28 日
7	长盛基金管理有限公司关于增加申万宏源西部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	2022 年 3 月 4 日
8	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加广发证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 25 日
9	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 31 日
10	长盛同德主题增长混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 31 日
11	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 4 月 22 日
12	长盛同德主题增长混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 4 月 22 日
13	长盛同德主题增长混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2022 年 5 月 20 日
14	长盛同德主题增长混合型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	2022 年 5 月 20 日
15	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加宁波银行为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 5 月 27 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	2022 年 5 月 31 日
17	长盛基金管理有限公司关于旗下基金	中国证监会指定披露媒介	2022 年 6 月 13 日

	增加陆享基金等三家基金销售公司并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	介	
18	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加华安证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 6 月 20 日
19	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 6 月 22 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2022 年 8 月 27 日