

# 长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF） 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	6
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	7
<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	11
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	12
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	12
<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>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	52

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 .....	52
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 .....	52
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 .....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	长盛沪深 300 指数 (LOF)
场内简称	长盛沪深 300LOF
基金主代码	160807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 8 月 4 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	121,010,389.25 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010 年 9 月 6 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资,跟踪沪深 300 指数,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%,且年化跟踪误差小于 4%,以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金采用抽样复制指数的投资策略,综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性,通过抽样方式构建基金股票投资组合,并优化确定投资组合中的个股权重,以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%,且年化跟踪误差小于 4%的投资目标。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金是股票指数型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长盛基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁
	联系电话	010-86497608
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666、010-86497888	95555
传真	010-86497999	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100029	518040
法定代表人	高民和	缪建民

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,429,375.65
本期利润	-24,274,426.76
加权平均基金份额本期利润	-0.1721
本期加权平均净值利润率	-11.14%
本期基金份额净值增长率	-6.73%
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	73,518,450.54
期末可供分配基金份额利润	0.6075
期末基金资产净值	194,528,839.79
期末基金份额净值	1.608
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	106.03%

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。

## 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	9.91%	1.01%	9.13%	1.02%	0.78%	-0.01%
过去三个月	7.77%	1.35%	5.95%	1.36%	1.82%	-0.01%
过去六个月	-6.73%	1.36%	-8.69%	1.38%	1.96%	-0.02%
过去一年	-7.11%	1.16%	-13.35%	1.18%	6.24%	-0.02%
过去三年	53.86%	1.18%	16.90%	1.20%	36.96%	-0.02%
自基金合同生效起至今	106.03%	1.36%	57.18%	1.35%	48.85%	0.01%

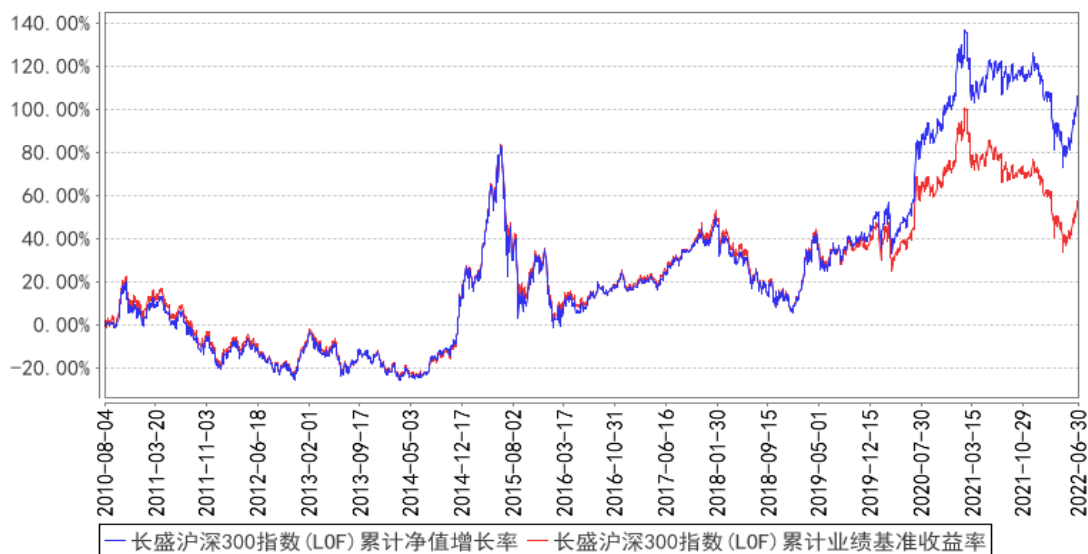
注：本基金业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

长盛沪深300指数(LOF)累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合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		
陈 亘 斯	本基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证金融地产指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛上证 50 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证全指证券公司指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛信息安全量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2019 年 10 月 9 日	-	13 年	陈亘斯先生，硕士。曾任 PineRiver 资产管理公司量化分析师，国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理，北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理。

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

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券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

2022 年上半年，股市和经济增长总体呈现先下再上的 V 型走势，波动较为剧烈。首先受到国内经济下行压力增大、有效信用扩张不及预期以及美国高通胀带来的美元持续升息的预期影响，A 股市场在一季度经历了较大幅度的下行，投资者明显转向红利价值类的风格股票避险。二季度初又受到国内疫情的反复和国际地缘冲突的突发影响，A 股整体进一步急剧下挫。随着市场潜在杠杆的出清和国内迅捷有力的货币政策支持下，社会融资见底反弹，流动性得到充分补充，低利率叠加下跌后的较低估值，使得 A 股市场的风险溢价率显现较好的吸引力，出现一轮快速反弹。进入二季度中期，疫情得到显著有效的控制，经济增长预期得到修复，进一步激发了投资者对于成长板块的偏好，使得反弹有力的持续到季度末。而随着上游大宗商品的高位回调，国内中游制造

业的成本压力缓解，重拾产业链竞争力，并促进了出口大幅回升，使得 A 股市场和国内经济的运行在一定程度下重回常态。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.608 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.73%，同期业绩比较基准收益率为-8.69%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0178%，年度化跟踪误差为 1.2897%。

#### 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 2022 年下半年，预计国内货币政策将继续保持对企业的积极的支持力度，财政政策将进一步敦促上半年各个项目的落地和实施，以期给实体经济带来新的增长点和长效的增长预期。此外随着疫情对经济的影响逐步消退，居民消费水平和基建开工活动有望从低点逐步恢复至常态水平，同时给 A 股的消费行业和基建相关行业带来一定机会。地产产业链经历多重冲击后，行业存在进一步出清并提高集中度的可能性，有望重拾供给侧改革的投资逻辑。此外，我们需要看到国内的社会融资结构中，企业部门的中长期贷款增长仍然较为疲软，经济自发扩张动能尚且不足。国际地缘政治冲突虽然暂未进一步发酵，大宗原材料价格有一定回调，但 CPI 向 PPI 靠拢在全球普遍发生，亦在国内有抬头之势，对国内的进一步大幅宽松政策实施形成掣肘，成长股的反弹也步入下半场。下半年呈现以业绩修复为主逻辑的结构性行情的概率更高，同时对股市的预期收益率也需要更加理性一些。

#### 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中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期末未实施利润分配。

本基金截至 2022 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 73,518,450.54 元，其中，未分配利润已实现部分为 136,573,026.23 元，未分配利润未实现部分为-63,054,575.69 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不

存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

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	12,504,761.14	19,352,259.17
结算备付金		57,536.70	23,104.64
存出保证金		35,996.49	61,330.77
交易性金融资产	6.4.7.2	181,635,364.15	303,908,940.64
其中：股票投资		181,610,362.29	303,360,127.29
基金投资		-	-
债券投资		25,001.86	548,813.35
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	-	-
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		40,689.91	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,234,860.61	389,874.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	2,239.76
资产总计		195,509,209.00	323,737,749.45
<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		-	2,047,310.33
应付赎回款		700,114.59	540,883.09
应付管理人报酬		112,650.17	184,809.25
应付托管费		22,530.03	36,961.88
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	145,074.42	264,384.93
负债合计		980,369.21	3,074,349.83
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	121,010,389.25	185,948,722.38
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	73,518,450.54	134,714,677.24
净资产合计		194,528,839.79	320,663,399.62
负债和净资产总计		195,509,209.00	323,737,749.45

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.608 元，基金份额总额 121,010,389.25 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：长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

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	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-23,200,720.55	16,374,153.96
1. 利息收入		25,405.55	38,619.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	25,405.55	38,545.93
债券利息收入		-	73.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收		-	-

入			
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,617,717.51	40,212,438.31
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,511,120.23	37,688,399.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	141,491.90	66,325.72
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	1,751,910.82	2,457,713.18
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	-19,845,051.11	-24,085,467.63
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	236,642.52	208,563.64
<b>减：二、营业总支出</b>		1,073,706.21	2,053,857.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	815,887.91	1,251,685.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	163,177.50	250,337.08
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		0.26	0.13
8. 其他费用	6.4.7.17	94,640.54	551,834.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-24,274,426.76	14,320,296.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-24,274,426.76	14,320,296.63
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-24,274,426.76	14,320,296.63

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：长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）

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、上期期末净资产(基金净值)	185,948,722.38	-	134,714,677.24	320,663,399.62
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)	185,948,722.38	-	134,714,677.24	320,663,399.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-64,938,333.13	-	-61,196,226.70	-126,134,559.83
（一）、综合收益总额	-	-	-24,274,426.76	-24,274,426.76
（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)	-64,938,333.13	-	-36,921,799.94	-101,860,133.07
其中：1. 基金申购款	55,768,838.39	-	30,764,976.41	86,533,814.80
2. 基金赎回款	-120,707,171.52	-	-67,686,776.35	-188,393,947.87
（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)	121,010,389.25	-	73,518,450.54	194,528,839.79
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)	220,620,424.75	-	146,846,072.53	367,466,497.28



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)	220,620,424.75	-	146,846,072.53	367,466,497.28
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-18,775,929.44	-	644,451.22	-18,131,478.22
(一)、综合收益总额	-	-	14,320,296.63	14,320,296.63
(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)	-18,775,929.44	-	-13,675,845.41	-32,451,774.85
其中：1. 基金申购款	91,281,298.15	-	65,433,448.54	156,714,746.69
2. 基金赎回款	-110,057,227.59	-	-79,109,293.95	-189,166,521.54
(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)	201,844,495.31	-	147,490,523.75	349,335,019.06

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

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) (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[2010]第 646 号《关于核准长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 募集的批复》核准，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》负责公开募集。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 898,648,405.80 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(2010)第 193 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》于 2010 年 8 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 898,915,869.33 份，其中认购资金利息折合 267,463.53 份基金份额。本基

金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2010]第 276 号文审核同意，本基金 112,932,582 份基金份额于 2010 年 9 月 6 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票资产投资比例不低于基金资产净值的 90%，其中，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%；保持不低于基金资产净值 5% 的现金以及到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+5\% \times$  一年期银行定期存款利率(税后)。本基金标的指数使用费由基金管理人长盛基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

#### 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》、《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》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。

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基金净值变动情况等有关信息。

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

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、应收利息和应收申购款，金额分别为 19,352,259.17 元、23,104.64 元、61,330.77 元、2,239.76 元和 389,874.47 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、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 19,354,429.42 元、23,116.08 元、61,361.13 元、0.00 元和 389,874.47 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 303,908,940.64 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 303,908,968.35 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 2,047,310.33 元、540,883.09 元、184,809.25 元、36,961.88 元、202,862.78 元和 1,522.15 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 2,047,310.33 元、540,883.09 元、184,809.25 元、36,961.88 元、202,862.78 元和 1,522.15 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对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	12,504,761.14
等于：本金	12,503,647.20
加：应计利息	1,113.94
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	12,504,761.14

#### 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	179,313,596.58	-	181,610,362.29	2,296,765.71
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	25,000.00	1.86	25,001.86
	银行间市场	-	-	-
	合计	25,000.00	1.86	25,001.86
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	179,338,596.58	1.86	181,635,364.15	2,296,765.71

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 6.4.7.5 其他资产

无。

#### 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	-
应付赎回费	2,244.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	51,139.61
其中：交易所市场	51,139.61
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
其他应付款_其他	2,430.00
合计	145,074.42

#### 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	185,948,722.38	185,948,722.38
本期申购	55,768,838.39	55,768,838.39
本期赎回（以“-”号填列）	-120,707,171.52	-120,707,171.52
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	121,010,389.25	121,010,389.25

注：1. 申购含转换入；赎回含转换出。

2. 截至 2022 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 2,853,844.00 份（2021 年 12 月 31 日：1,827,665.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 118,156,545.25 份（2021 年 12 月 31 日：184,121,057.38 份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 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	217,090,242.50	-82,375,565.26	134,714,677.24
本期利润	-4,429,375.65	-19,845,051.11	-24,274,426.76
本期基金份额交易产生的变动数	-76,087,840.62	39,166,040.68	-36,921,799.94
其中：基金申购款	64,239,803.42	-33,474,827.01	30,764,976.41
基金赎回款	-140,327,644.04	72,640,867.69	-67,686,776.35

本期已分配利润	-	-	-
本期末	136,573,026.23	-63,054,575.69	73,518,450.54

#### 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	23,529.00
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	1,422.35
其他	454.20
合计	25,405.55

#### 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	-5,511,120.23
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	-5,511,120.23

##### 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	156,630,935.36
减：卖出股票成本总额	161,762,093.60
减：交易费用	379,961.99
买卖股票差价收入	-5,511,120.23

#### 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	115.31
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	141,376.59
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	141,491.90

#### 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	883,623.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	742,100.00
减：应计利息总额	143.18
减：交易费用	4.11
买卖债券差价收入	141,376.59

#### 6.4.7.12 贵金属投资收益

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	1,751,910.82
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	1,751,910.82

#### 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	-19,845,051.11
股票投资	-19,822,337.76
债券投资	-22,713.35
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	-19,845,051.11

#### 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	157,717.42
基金转换费收入	78,925.10
合计	236,642.52

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

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

#### 6.4.7.17 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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	5,380.39
合计	94,640.54

#### 6.4.7.18 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公	基金管理人、基金销售机构

司”)	
招商银行股份有限公司 (“招商银行”)	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	124,766,538.71	58.94	153,463,564.09	60.55

###### 6.4.10.1.2 债券交易

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	798,865.90	90.41	255,261.20	51.68

###### 6.4.10.1.3 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	116,193.97	58.94	29,227.75	57.15
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	142,920.92	60.55	71,407.36	65.50

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。债券及权证交易不计佣金。

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

## 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	815,887.91	1,251,685.46
其中：支付销售机构的客户维护费	208,353.25	191,782.79

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 0.75% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.75\% \div \text{当年天数}。$$

### 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	163,177.50	250,337.08

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

### 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固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固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
招商银行	12,504,761.14	23,529.00	20,478,807.70	37,355.77
合计	12,504,761.14	23,529.00	20,478,807.70	37,355.77

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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
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	2,034	78,227.64	78,227.64	-
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	1,347	55,927.44	55,927.44	-
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	2,154	72,482.10	72,482.10	-
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	1,735	71,603.45	71,603.45	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	3,255	71,382.15	71,382.15	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	限售期锁定	38.46	38.46	226	8,691.96	8,691.96	-

		日									
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	限售期锁定	41.52	41.52	150	6,228.00	6,228.00		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	限售期锁定	33.65	33.65	240	8,076.00	8,076.00		-
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	限售期锁定	52.37	48.4	209	10,945.33	10,115.60		-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	限售期锁定	42.5	32.03	277	9,052.50	8,872.31		-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	限售期锁定	11.4	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	791	10,860.43	12,663.91		-
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	592	9,099.04	9,466.08		-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	限售期锁定	33.68	46.7	189	6,365.52	8,826.30		-
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	246	9,901.50	7,517.76		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	限售期锁定	64.08	37.5	103	6,600.24	3,862.50		-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	限售期锁定	72.69	71.48	192	13,956.48	13,724.16		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	限售期锁定	56.88	56.4	184	10,465.92	10,377.60		-
301215	中汽	2022年	6个月	限售期	3.8	6.39	3,188	12,114.40	20,371.32		-



	股份	2月28日		锁定							
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	限售期锁定	35.68	29.84	271	9,669.28	8,086.64		-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	限售期锁定	17.27	14.82	937	16,181.99	13,886.34		-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	限售期锁定	173.98	87.83	86	8,351.04	7,553.38		-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	限售期锁定	8.05	10.08	1,119	9,007.95	11,279.52		-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月	限售期锁定	18.39	25.84	416	7,650.24	10,749.44		-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	限售期锁定	19.93	31.38	405	8,071.65	12,708.90		-
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	限售期锁定	10.8	16.16	42,002	453,621.60	678,752.32		-
688119	中钢洛耐	2022年5月27日	6个月	限售期锁定	5.06	8.22	13,542	68,522.52	111,315.24		-
688223	晶科能源	2022年1月19日	6个月	限售期锁定	5	14.46	31,027	155,135.00	448,650.42		-

## 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
113060	浙 22 转债	2022年6月15日	1个月内(含)	配债未上市	100.00	100.01	250	25,000.00	25,001.86	-

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

本基金为抽样复制的指数型基金，采用抽样复制指数的投资策略，跟踪沪深 300 指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，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 0.01% (2021 年 12 月 31 日：0.17%)。

#### 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上述比例限制）。

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	12,503,647.20	-	-	1,113.94	12,504,761.14
结算备付金	57,510.80	-	-	25.90	57,536.70
存出保证金	35,980.29	-	-	16.20	35,996.49
交易性金融资产	25,000.00	-	-	181,610,364.15	181,635,364.15
应收申购款	-	-	-	1,234,860.61	1,234,860.61
应收清算款	-	-	-	40,689.91	40,689.91
<b>资产总计</b>	<b>12,622,138.29</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>182,887,070.71</b>	<b>195,509,209.00</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	700,114.59	700,114.59
应付管理人报酬	-	-	-	112,650.17	112,650.17
应付托管费	-	-	-	22,530.03	22,530.03
其他负债	-	-	-	145,074.42	145,074.42
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>980,369.21</b>	<b>980,369.21</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>12,622,138.29</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-181,906,701.50</b>	<b>194,528,839.79</b>
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
<b>资产</b>					
银行存款	19,352,259.17	-	-	-	19,352,259.17
结算备付金	23,104.64	-	-	-	23,104.64
存出保证金	61,330.77	-	-	-	61,330.77
交易性金融资产	-	-	548,813.35	303,360,127.29	303,908,940.64
应收申购款	-	-	-	389,874.47	389,874.47
其他资产	-	-	-	2,239.76	2,239.76
<b>资产总计</b>	<b>19,436,694.58</b>	<b>-</b>	<b>548,813.35</b>	<b>303,752,241.52</b>	<b>323,737,749.45</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	2,047,310.33	2,047,310.33
应付赎回款	-	-	-	540,883.09	540,883.09
应付管理人报酬	-	-	-	184,809.25	184,809.25
应付托管费	-	-	-	36,961.88	36,961.88
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	264,384.93	264,384.93
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,074,349.83</b>	<b>3,074,349.83</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>19,436,694.58</b>	<b>-</b>	<b>548,813.35</b>	<b>300,677,891.69</b>	<b>320,663,399.62</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%（2021 年 12 月 31 日：0.17%），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。

本基金采用抽样复制指数的投资策略，股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例占基金资产净值的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 80%。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	181,610,362.29	93.36	303,360,127.29	94.60
合计	181,610,362.29	93.36	303,360,127.29	94.60

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
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	9,488,587.69	15,722,407.06

	(附注 6.4.1) 上升 5%		
	2. 业绩比较基准 (附注 6.4.1) 下降 5%	-9,488,587.69	-15,722,407.06

#### 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	179,800,533.28	301,053,295.92
第二层次	397,620.60	539,953.93
第三层次	1,437,210.27	2,315,690.79
合计	181,635,364.15	303,908,940.64

###### 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，确定相关股票和债券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	181,610,362.29	92.89
	其中: 股票	181,610,362.29	92.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	25,001.86	0.01
	其中: 债券	25,001.86	0.01
	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	12,562,297.84	6.43
8	其他各项资产	1,311,547.01	0.67
9	合计	195,509,209.00	100.00

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合****7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合**

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	2,156,697.86	1.11
B	采矿业	5,048,657.61	2.60
C	制造业	107,242,867.30	55.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,444,180.72	2.28
E	建筑业	3,767,454.63	1.94
F	批发和零售业	465,931.64	0.24
G	交通运输、仓储和	4,797,780.96	2.47



	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	5,569,613.87	2.86
J	金融业	31,969,354.32	16.43
K	房地产业	3,395,563.92	1.75
L	租赁和商务服务业	2,468,124.44	1.27
M	科学研究和技术服务业	2,758,165.65	1.42
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	92,640.00	0.05
Q	卫生和社会工作	1,595,916.33	0.82
R	文化、体育和娱乐业	210,168.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	175,983,117.25	90.47

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	899,146.12	0.46
C	制造业	2,959,954.91	1.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	248,722.72	0.13
E	建筑业	210,421.66	0.11
F	批发和零售业	12,708.90	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	405,252.10	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	105,639.90	0.05
J	金融业	279,979.40	0.14
K	房地产业	195,932.40	0.10
L	租赁和商务服务业	38,844.60	0.02
M	科学研究和技术服务业	20,371.32	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	21,679.10	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	89,430.41	0.05
R	文化、体育和娱乐业	139,161.50	0.07
S	综合	-	-
	合计	5,627,245.04	2.89

### 7.2.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	5,489	11,225,005.00	5.77
2	300750	宁德时代	12,300	6,568,200.00	3.38
3	601318	中国平安	94,290	4,402,400.10	2.26
4	601012	隆基绿能	51,718	3,445,970.34	1.77
5	000858	五粮液	16,806	3,393,635.58	1.74
6	002594	比亚迪	7,803	2,602,222.47	1.34
7	000333	美的集团	42,488	2,565,850.32	1.32
8	601166	兴业银行	126,030	2,507,997.00	1.29
9	300059	东方财富	91,182	2,316,022.80	1.19
10	600900	长江电力	93,992	2,173,095.04	1.12
11	601888	中国中免	8,028	1,869,962.04	0.96
12	603259	药明康德	17,835	1,854,661.65	0.95
13	600030	中信证券	80,940	1,753,160.40	0.90
14	600887	伊利股份	44,410	1,729,769.50	0.89
15	000568	泸州老窖	6,357	1,567,254.78	0.81
16	601398	工商银行	306,087	1,460,034.99	0.75
17	002475	立讯精密	42,364	1,431,479.56	0.74
18	600438	通威股份	23,700	1,418,682.00	0.73
19	002415	海康威视	38,696	1,400,795.20	0.72
20	600276	恒瑞医药	37,586	1,394,064.74	0.72
21	600809	山西汾酒	4,100	1,331,680.00	0.68
22	000651	格力电器	38,917	1,312,281.24	0.67
23	600309	万华化学	13,326	1,292,488.74	0.66
24	300760	迈瑞医疗	4,100	1,284,120.00	0.66
25	000001	平安银行	85,479	1,280,475.42	0.66
26	002714	牧原股份	22,461	1,241,419.47	0.64
27	000725	京东方 A	314,788	1,240,264.72	0.64
28	002142	宁波银行	34,591	1,238,703.71	0.64

29	000002	万 科 A	58,647	1,202,263.50	0.62
30	002129	TCL 中环	19,800	1,166,022.00	0.60
31	002812	恩捷股份	4,600	1,152,070.00	0.59
32	601328	交通银行	228,681	1,138,831.38	0.59
33	601899	紫金矿业	121,201	1,130,805.33	0.58
34	002466	天齐锂业	9,011	1,124,572.80	0.58
35	000792	盐湖股份	37,400	1,120,504.00	0.58
36	603288	海天味业	12,100	1,093,356.00	0.56
37	600048	保利发展	61,634	1,076,129.64	0.55
38	300124	汇川技术	16,236	1,069,465.32	0.55
39	603799	华友钴业	11,001	1,051,915.62	0.54
40	300015	爱尔眼科	23,429	1,048,916.33	0.54
41	002460	赣锋锂业	6,850	1,018,595.00	0.52
42	600031	三一重工	52,259	996,056.54	0.51
43	600436	片仔癀	2,700	963,171.00	0.50
44	601088	中国神华	28,578	951,647.40	0.49
45	601668	中国建筑	178,803	951,231.96	0.49
46	300014	亿纬锂能	9,700	945,750.00	0.49
47	002352	顺丰控股	16,800	937,608.00	0.48
48	600089	特变电工	33,427	915,565.53	0.47
49	300498	温氏股份	42,991	915,278.39	0.47
50	002304	洋河股份	4,997	915,200.55	0.47
51	600690	海尔智家	32,615	895,607.90	0.46
52	300274	阳光电源	9,000	884,250.00	0.45
53	601816	京沪高铁	171,700	861,934.00	0.44
54	002271	东方雨虹	16,700	859,549.00	0.44
55	601288	农业银行	278,465	840,964.30	0.43
56	600837	海通证券	84,694	830,848.14	0.43
57	600000	浦发银行	102,529	821,257.29	0.42
58	600016	民生银行	218,739	813,709.08	0.42
59	603986	兆易创新	5,608	797,513.68	0.41
60	603501	韦尔股份	4,600	795,938.00	0.41
61	600406	国电南瑞	28,783	777,141.00	0.40
62	688981	中芯国际	16,941	765,224.97	0.39
63	000625	长安汽车	43,619	755,481.08	0.39
64	601919	中远海控	53,700	746,430.00	0.38
65	600919	江苏银行	103,470	736,706.40	0.38
66	300122	智飞生物	6,600	732,666.00	0.38
67	600104	上汽集团	40,843	727,413.83	0.37
68	600585	海螺水泥	20,590	726,415.20	0.37
69	002709	天赐材料	11,600	719,896.00	0.37
70	000063	中兴通讯	27,989	714,559.17	0.37

71	601688	华泰证券	49,762	706,620.40	0.36
72	601225	陕西煤业	33,317	705,654.06	0.36
73	002049	紫光国微	3,700	701,964.00	0.36
74	601601	中国太保	29,666	698,040.98	0.36
75	002241	歌尔股份	20,504	688,934.40	0.35
76	002230	科大讯飞	16,259	670,195.98	0.34
77	300142	沃森生物	13,800	667,782.00	0.34
78	002371	北方华创	2,300	637,376.00	0.33
79	000661	长春高新	2,700	630,234.00	0.32
80	600111	北方稀土	17,870	628,309.20	0.32
81	002459	晶澳科技	7,700	607,530.00	0.31
82	300450	先导智能	9,500	600,210.00	0.31
83	601211	国泰君安	39,400	598,880.00	0.31
84	002027	分众传媒	88,880	598,162.40	0.31
85	000338	潍柴动力	47,492	592,225.24	0.30
86	601169	北京银行	130,252	591,344.08	0.30
87	601988	中国银行	180,760	589,277.60	0.30
88	000100	TCL 科技	122,635	587,421.65	0.30
89	688599	天合光能	8,957	584,444.25	0.30
90	601985	中国核电	82,095	563,171.70	0.29
91	600745	闻泰科技	6,600	561,726.00	0.29
92	601229	上海银行	85,651	561,014.05	0.29
93	600660	福耀玻璃	13,341	557,787.21	0.29
94	601390	中国中铁	90,829	557,690.06	0.29
95	601766	中国中车	106,743	555,063.60	0.29
96	600050	中国联通	159,548	552,036.08	0.28
97	601800	中国交建	56,433	523,698.24	0.27
98	603659	璞泰来	6,100	514,840.00	0.26
99	601669	中国电建	64,773	509,763.51	0.26
100	300347	泰格医药	4,400	503,580.00	0.26
101	601658	邮储银行	93,300	502,887.00	0.26
102	600893	航发动力	10,941	497,924.91	0.26
103	000776	广发证券	25,065	468,715.50	0.24
104	600028	中国石化	114,762	468,228.96	0.24
105	600019	宝钢股份	77,388	465,875.76	0.24
106	600905	三峡能源	73,600	462,944.00	0.24
107	600196	复星医药	10,490	462,504.10	0.24
108	600010	包钢股份	196,241	461,166.35	0.24
109	600999	招商证券	31,746	457,459.86	0.24
110	600009	上海机场	8,052	456,548.40	0.23
111	002410	广联达	8,300	451,852.00	0.23
112	601628	中国人寿	14,499	450,628.92	0.23

113	601857	中国石油	83,665	443,424.50	0.23
114	601009	南京银行	42,404	441,849.68	0.23
115	600958	东方证券	43,206	441,133.26	0.23
116	600570	恒生电子	10,101	439,797.54	0.23
117	601818	光大银行	144,867	436,049.67	0.22
118	000895	双汇发展	14,847	435,017.10	0.22
119	002179	中航光电	6,860	434,375.20	0.22
120	002311	海大集团	7,100	426,071.00	0.22
121	002050	三花智控	15,450	424,566.00	0.22
122	300896	爱美客	700	420,007.00	0.22
123	600760	中航沈飞	6,780	409,851.00	0.21
124	600346	恒力石化	18,240	405,657.60	0.21
125	002493	荣盛石化	26,200	403,218.00	0.21
126	300759	康龙化成	4,200	399,924.00	0.21
127	601633	长城汽车	10,680	395,587.20	0.20
128	002074	国轩高科	8,500	387,600.00	0.20
129	600926	杭州银行	25,520	382,289.60	0.20
130	300661	圣邦股份	2,100	382,242.00	0.20
131	300496	中科创达	2,900	378,392.00	0.19
132	000538	云南白药	6,227	376,048.53	0.19
133	002821	凯莱英	1,300	375,700.00	0.19
134	600460	士兰微	7,200	374,400.00	0.19
135	300316	晶盛机电	5,500	371,745.00	0.19
136	300782	卓胜微	2,720	367,200.00	0.19
137	600176	中国巨石	20,990	365,435.90	0.19
138	001979	招商蛇口	27,169	364,879.67	0.19
139	000768	中航西飞	12,041	364,721.89	0.19
140	002001	新和成	15,888	362,405.28	0.19
141	601989	中国重工	96,734	358,883.14	0.18
142	688012	中微公司	3,072	358,656.00	0.18
143	600426	华鲁恒升	12,200	356,240.00	0.18
144	002920	德赛西威	2,400	355,200.00	0.18
145	002202	金风科技	23,682	350,493.60	0.18
146	601939	建设银行	57,709	349,716.54	0.18
147	000596	古井贡酒	1,400	349,524.00	0.18
148	600763	通策医疗	2,000	348,880.00	0.18
149	603993	洛阳钼业	60,505	346,693.65	0.18
150	000963	华东医药	7,579	342,267.64	0.18
151	601006	大秦铁路	51,116	336,854.44	0.17
152	601138	工业富联	34,100	335,544.00	0.17
153	600600	青岛啤酒	3,200	332,544.00	0.17
154	000166	申万宏源	77,430	332,174.70	0.17

155	600584	长电科技	12,300	332,100.00	0.17
156	601877	正泰电器	9,200	329,176.00	0.17
157	600588	用友网络	15,053	326,800.63	0.17
158	300207	欣旺达	10,300	325,480.00	0.17
159	600029	南方航空	44,458	324,987.98	0.17
160	688111	金山办公	1,643	323,868.16	0.17
161	601377	兴业证券	45,730	322,396.50	0.17
162	600383	金地集团	23,840	320,409.60	0.16
163	601600	中国铝业	66,997	318,235.75	0.16
164	600085	同仁堂	5,975	315,958.00	0.16
165	600741	华域汽车	13,729	315,767.00	0.16
166	601186	中国铁建	39,795	314,380.50	0.16
167	688005	容百科技	2,393	309,749.92	0.16
168	601838	成都银行	18,600	308,388.00	0.16
169	601066	中信建投	10,600	306,446.00	0.16
170	603806	福斯特	4,660	305,323.20	0.16
171	601111	中国国航	26,096	302,974.56	0.16
172	000876	新希望	19,514	298,564.20	0.15
173	300408	三环集团	9,900	297,990.00	0.15
174	000786	北新建材	8,600	297,732.00	0.15
175	603019	中科曙光	10,220	296,584.40	0.15
176	601117	中国化学	31,500	296,415.00	0.15
177	600150	中国船舶	15,600	296,088.00	0.15
178	600188	兖矿能源	7,444	293,889.12	0.15
179	601238	广汽集团	19,240	293,217.60	0.15
180	600132	重庆啤酒	2,000	293,200.00	0.15
181	600547	山东黄金	15,520	288,051.20	0.15
182	600795	国电电力	73,428	287,103.48	0.15
183	003816	中国广核	102,400	286,720.00	0.15
184	601100	恒立液压	4,556	281,196.32	0.14
185	600015	华夏银行	53,236	277,359.56	0.14
186	300763	锦浪科技	1,300	276,900.00	0.14
187	600989	宝丰能源	18,800	275,420.00	0.14
188	600886	国投电力	25,563	268,411.50	0.14
189	601788	光大证券	16,947	267,084.72	0.14
190	002648	卫星化学	10,300	266,255.00	0.14
191	600115	中国东航	48,309	265,216.41	0.14
192	603369	今世缘	5,200	265,200.00	0.14
193	600011	华能国际	37,600	264,704.00	0.14
194	300999	金龙鱼	4,900	264,698.00	0.14
195	601868	中国能建	111,300	263,781.00	0.14
196	000157	中联重科	42,708	263,081.28	0.14

197	000301	东方盛虹	15,400	260,414.00	0.13
198	300595	欧普康视	4,500	257,355.00	0.13
199	002236	大华股份	15,522	254,871.24	0.13
200	300601	康泰生物	5,600	253,008.00	0.13
201	000425	徐工机械	46,926	252,931.14	0.13
202	688396	华润微	4,263	251,815.41	0.13
203	002601	龙佰集团	12,500	250,625.00	0.13
204	603185	上机数控	1,600	249,584.00	0.13
205	002008	大族激光	7,400	245,162.00	0.13
206	002736	国信证券	25,509	244,121.13	0.13
207	603486	科沃斯	2,000	243,780.00	0.13
208	601901	方正证券	36,104	242,257.84	0.12
209	000938	紫光股份	12,421	240,967.40	0.12
210	002555	三七互娱	11,202	237,818.46	0.12
211	300628	亿联网络	3,100	236,065.00	0.12
212	600352	浙江龙盛	22,912	233,244.16	0.12
213	603290	斯达半导	600	231,540.00	0.12
214	000977	浪潮信息	8,700	230,376.00	0.12
215	600941	中国移动	3,800	229,900.00	0.12
216	603833	欧派家居	1,520	229,033.60	0.12
217	000069	华侨城 A	35,199	228,441.51	0.12
218	601916	浙商银行	68,400	227,088.00	0.12
219	688008	澜起科技	3,719	225,297.02	0.12
220	601995	中金公司	5,000	222,450.00	0.11
221	603260	合盛硅业	1,880	221,764.80	0.11
222	601336	新华保险	6,874	221,274.06	0.11
223	603392	万泰生物	1,418	220,215.40	0.11
224	601618	中国中冶	62,786	219,751.00	0.11
225	600219	南山铝业	59,200	218,448.00	0.11
226	600845	宝信软件	4,000	218,400.00	0.11
227	300454	深信服	2,100	217,938.00	0.11
228	002120	韵达股份	12,593	214,836.58	0.11
229	300529	健帆生物	4,200	213,738.00	0.11
230	688126	沪硅产业	9,217	211,806.66	0.11
231	002841	视源股份	2,800	210,896.00	0.11
232	300413	芒果超媒	6,300	210,168.00	0.11
233	601360	三六零	24,600	209,592.00	0.11
234	002007	华兰生物	9,065	206,682.00	0.11
235	002252	上海莱士	34,800	206,364.00	0.11
236	601799	星宇股份	1,200	205,200.00	0.11
237	601155	新城控股	8,000	203,440.00	0.10
238	300003	乐普医疗	10,900	202,413.00	0.10

239	603882	金域医学	2,400	198,120.00	0.10
240	000703	恒逸石化	18,820	197,798.20	0.10
241	300751	迈为股份	400	196,360.00	0.10
242	600332	白云山	6,163	194,689.17	0.10
243	601021	春秋航空	3,300	192,555.00	0.10
244	688036	传音控股	2,137	190,684.51	0.10
245	002602	世纪华通	39,301	189,430.82	0.10
246	601878	浙商证券	16,600	188,908.00	0.10
247	300433	蓝思科技	16,900	187,083.00	0.10
248	300919	中伟股份	1,500	185,850.00	0.10
249	603899	晨光股份	3,300	185,064.00	0.10
250	600489	中金黄金	25,001	184,757.39	0.09
251	002938	鹏鼎控股	6,100	184,281.00	0.09
252	600918	中泰证券	23,900	182,835.00	0.09
253	000066	中国长城	16,600	179,612.00	0.09
254	300033	同花顺	1,800	173,070.00	0.09
255	601728	中国电信	45,700	170,461.00	0.09
256	300223	北京君正	1,600	170,000.00	0.09
257	601865	福莱特	4,400	167,640.00	0.09
258	000708	中信特钢	8,300	167,245.00	0.09
259	601898	中煤能源	15,700	162,966.00	0.08
260	600362	江西铜业	9,107	162,377.81	0.08
261	600183	生益科技	9,500	161,405.00	0.08
262	002916	深南电路	1,720	161,181.20	0.08
263	600018	上港集团	27,073	157,835.59	0.08
264	300957	贝泰妮	700	152,271.00	0.08
265	600061	国投资本	22,516	143,201.76	0.07
266	002791	坚朗五金	1,100	142,692.00	0.07
267	601216	君正集团	29,008	141,559.04	0.07
268	002414	高德红外	10,996	141,518.52	0.07
269	600161	天坛生物	5,800	140,824.00	0.07
270	601319	中国人保	27,700	140,162.00	0.07
271	002568	百润股份	4,480	134,579.20	0.07
272	688561	奇安信	2,404	134,143.20	0.07
273	000408	藏格矿业	4,000	131,760.00	0.07
274	600606	绿地控股	33,016	130,743.36	0.07
275	601966	玲珑轮胎	5,000	126,850.00	0.07
276	601998	中信银行	26,288	124,868.00	0.06
277	600655	豫园股份	13,100	123,664.00	0.06
278	002600	领益智造	24,200	121,484.00	0.06
279	603160	汇顶科技	1,900	117,667.00	0.06
280	600025	华能水电	15,700	109,743.00	0.06



281	688065	凯赛生物	980	109,564.00	0.06
282	002064	华峰化学	12,800	108,032.00	0.06
283	603195	公牛集团	700	107,037.00	0.06
284	601881	中国银河	10,800	104,436.00	0.05
285	688169	石头科技	155	95,588.50	0.05
286	688363	华熙生物	662	94,123.16	0.05
287	300866	安克创新	1,400	92,848.00	0.05
288	002607	中公教育	16,000	92,640.00	0.05
289	603087	甘李药业	1,800	86,346.00	0.04
290	002032	苏泊尔	1,400	78,876.00	0.04
291	601808	中海油服	5,200	72,540.00	0.04
292	601236	红塔证券	7,930	72,400.90	0.04
293	605499	东鹏饮料	400	68,344.00	0.04
294	000800	一汽解放	7,000	65,380.00	0.03
295	000877	天山股份	5,000	61,500.00	0.03
296	300979	华利集团	800	58,464.00	0.03
297	601825	沪农商行	8,200	51,414.00	0.03
298	601698	中国卫通	3,700	41,847.00	0.02
299	001289	龙源电力	1,300	28,288.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600938	中国海油	42,002	678,752.32	0.35
2	688223	晶科能源	31,027	448,650.42	0.23
3	600177	雅戈尔	46,152	305,987.76	0.16
4	600516	方大炭素	35,456	269,465.60	0.14
5	600674	川投能源	20,866	248,722.72	0.13
6	601018	宁波港	60,709	236,765.10	0.12
7	600867	通化东宝	22,100	228,514.00	0.12
8	600170	上海建工	69,022	209,136.66	0.11
9	601997	贵阳银行	35,240	204,744.40	0.11
10	600038	中直股份	4,424	199,964.80	0.10
11	600208	新潮中宝	70,990	195,932.40	0.10
12	600066	宇通客车	22,098	191,147.70	0.10
13	600372	中航电子	8,862	171,834.18	0.09
14	000709	河钢股份	65,975	149,103.50	0.08
15	601992	金隅集团	52,000	144,040.00	0.07
16	600583	海油工程	34,332	142,477.80	0.07
17	600977	中国电影	12,101	139,161.50	0.07
18	688076	诺泰生物	4,984	128,985.92	0.07
19	002468	申通快递	9,500	113,240.00	0.06

20	688119	中钢洛耐	13,542	111,315.24	0.06
21	600398	海澜之家	20,800	98,800.00	0.05
22	301139	元道通信	2,260	86,919.60	0.04
23	301239	普瑞眼科	2,394	80,558.10	0.04
24	600968	海油发展	30,200	77,916.00	0.04
25	600928	西安银行	20,500	75,235.00	0.04
26	688237	超卓航科	1,735	71,603.45	0.04
27	688400	凌云光	3,255	71,382.15	0.04
28	301233	盛帮股份	1,497	62,155.44	0.03
29	601212	白银有色	20,800	57,408.00	0.03
30	601298	青岛港	10,100	55,247.00	0.03
31	688236	春立医疗	2,736	54,172.80	0.03
32	601828	美凯龙	6,410	38,844.60	0.02
33	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
34	301215	中汽股份	3,188	20,371.32	0.01
35	301217	铜冠铜箔	937	13,886.34	0.01
36	301201	诚达药业	192	13,724.16	0.01
37	301263	泰恩康	405	12,708.90	0.01
38	301120	新特电气	791	12,663.91	0.01
39	301116	益客食品	577	11,793.88	0.01
40	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
41	301256	华融化学	1,119	11,279.52	0.01
42	301127	天源环保	982	10,929.66	0.01
43	301259	艾布鲁	416	10,749.44	0.01
44	301207	华兰疫苗	184	10,377.60	0.01
45	301097	天益医疗	209	10,115.60	0.01
46	688078	龙软科技	200	9,894.00	0.01
47	301137	哈焊华通	592	9,466.08	0.00
48	301130	西点药业	237	8,927.79	0.00
49	301103	何氏眼科	277	8,872.31	0.00
50	301153	中科江南	189	8,826.30	0.00
51	301216	万凯新材	271	8,086.64	0.00
52	688080	映翰通	200	8,018.00	0.00
53	301158	德石股份	379	7,708.86	0.00
54	301219	腾远钴业	86	7,553.38	0.00
55	301181	标榜股份	246	7,517.76	0.00
56	301196	唯科科技	103	3,862.50	0.00
57	605133	嵘泰股份	100	2,288.00	0.00
58	605303	园林股份	100	1,285.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601012	隆基绿能	3,814,813.60	1.19
2	600887	伊利股份	1,970,989.00	0.61
3	600519	贵州茅台	1,965,695.00	0.61
4	000001	平安银行	1,839,204.00	0.57
5	601318	中国平安	1,426,161.00	0.44
6	300124	汇川技术	1,323,046.00	0.41
7	600309	万华化学	1,247,607.00	0.39
8	601398	工商银行	1,220,511.00	0.38
9	000792	盐湖股份	1,176,805.00	0.37
10	300750	宁德时代	1,170,986.00	0.37
11	300059	东方财富	1,007,238.00	0.31
12	600438	通威股份	991,336.00	0.31
13	000858	五粮液	861,546.00	0.27
14	601816	京沪高铁	839,169.00	0.26
15	601166	兴业银行	837,456.00	0.26
16	002304	洋河股份	837,264.00	0.26
17	600016	民生银行	829,000.00	0.26
18	000333	美的集团	780,941.70	0.24
19	600938	中国海油	648,021.60	0.20
20	600919	江苏银行	641,548.00	0.20

### 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	600519	贵州茅台	6,909,522.00	2.15
2	601012	隆基绿能	6,388,680.40	1.99
3	300750	宁德时代	5,823,087.00	1.82
4	601318	中国平安	3,863,270.00	1.20
5	600887	伊利股份	3,313,709.00	1.03
6	000001	平安银行	2,809,295.00	0.88
7	000858	五粮液	2,428,630.00	0.76
8	600309	万华化学	2,246,920.85	0.70
9	601398	工商银行	2,225,125.00	0.69
10	601166	兴业银行	2,202,679.00	0.69
11	000333	美的集团	2,193,728.00	0.68
12	300124	汇川技术	2,053,374.00	0.64
13	300059	东方财富	1,801,275.00	0.56
14	002594	比亚迪	1,757,749.08	0.55

15	600438	通威股份	1,742,190.00	0.54
16	601899	紫金矿业	1,738,816.00	0.54
17	002304	洋河股份	1,452,477.00	0.45
18	601816	京沪高铁	1,434,012.00	0.45
19	600016	民生银行	1,431,571.00	0.45
20	300760	迈瑞医疗	1,424,838.00	0.44

#### 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	59,834,666.36
卖出股票收入（成交）总额	156,630,935.36

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）	25,001.86	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,001.86	0.01

#### 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	113060	浙 22 转债	250	25,001.86	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述一只债券。

#### 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投资。

#### 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

兴业银行：

2021 年 8 月 20 日，银罚字〔2021〕26 号显示，兴业银行股份有限公司存在违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定等违法违规事实，被处罚款 5 万元。2022 年 3 月 25 日，银保监罚决字〔2022〕22 号显示，兴业银行股份有限公司存在漏报贸易融资业务 EAST 数据等 14 项违法违规事实，被处罚款 350 万元。对以上事件，本基金判断，兴业银行股份有限公司经营较为稳健，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。

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

### 7.12.2 基金投资的前十名股票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	35,996.49
2	应收清算款	40,689.91
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,234,860.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,311,547.01

#### 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

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600938	中国海油	678,752.32	0.35	限售期锁定
2	688223	晶科能源	448,650.42	0.23	限售期锁定

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
10,526	11,496.33	21,362,896.18	17.65	99,647,493.07	82.35

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	管玉良	620,396.00	21.74
2	鲍建平	110,167.00	3.86
3	柳楠	100,000.00	3.5
4	林秀	99,100.00	3.47
5	倪俊	95,928.00	3.36
6	张睿珈	74,700.00	2.62
7	吴卫菊	69,732.00	2.44
8	李兴光	67,400.00	2.36
9	缪晏	60,000.00	2.1
10	李勇枝	51,751.00	1.81

注：注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	163,017.13	0.1347

**8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

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 (2010 年 8 月 4 日) 基 金份额总额	898,915,869.33
本报告期期初基金份额总额	185,948,722.38
本报告期基金总申购份额	55,768,838.39
减：本报告期基金总赎回份额	120,707,171.52
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	121,010,389.25

**§ 10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动****10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况**

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**

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

**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

本报告期内本基金投资策略没有改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员没有受稽查或处罚等情况。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国元证券	1	124,766,538.71	58.94	116,193.97	58.94	-
招商证券	1	86,916,569.95	41.06	80,946.04	41.06	-

##### 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 (%)
国元证券	798,865.90	90.41	-	-	-	-
招商证券	84,757.98	9.59	-	-	-	-

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: 无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况: 无。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于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
2	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
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	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 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	长盛沪深 300 指数证券投资基金	中国证监会指定披露媒介	2022 年 2 月 21 日

	(LOF) 招募说明书 (更新)	介	
7	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要 (更新)	中国证监会指定披露媒介	2022 年 2 月 21 日
8	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
9	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
10	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
11	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
12	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2021 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 3 月 31 日
13	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
14	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 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
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	中国证监会指定披露媒介	2022 年 6 月 13 日
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
20	长盛基金管理有限公司关于增加天风证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 6 月 23 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、长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 相关批准文件；
- 2、《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 3、《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 4、《长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 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