

# 长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF） 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 30 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 2023 年 08 月 29 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 2023 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	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	10
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>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
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 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</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 .....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 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	151,298,273.88 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	张姗
	联系电话	010-86497608	0755-83077987
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
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	深圳市深南大道 7088 号招商银

	楼中建财富国际中心 3-5 层	行大厦
邮政编码	100029	518040
法定代表人	胡甲	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	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,400,132.25
本期利润	3,063,591.37
加权平均基金份额本期利润	0.0203
本期加权平均净值利润率	1.37%
本期基金份额净值增长率	1.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	66,277,908.05
期末可供分配基金份额利润	0.4381
期末基金资产净值	217,576,181.93
期末基金份额净值	1.438
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	84.25%

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	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	1.91%	0.81%	1.11%	0.83%	0.80%	-0.02%
过去三个月	-3.62%	0.77%	-4.87%	0.79%	1.25%	-0.02%
过去六个月	1.20%	0.78%	-0.66%	0.80%	1.86%	-0.02%
过去一年	-10.57%	0.92%	-13.55%	0.94%	2.98%	-0.02%
过去三年	15.64%	1.12%	-6.91%	1.14%	22.55%	-0.02%
自基金合同生效起至今	84.25%	1.33%	35.89%	1.32%	48.36%	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，本基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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（DBS）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 2023 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。	2019 年 10 月 9 日	-	14 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

2023 年上半年，A 股市场整体呈现震荡格局，板块分化剧烈并且行业轮动迅猛。去年底受到经济修复至常态的预期引导而快速反弹的消费相关板块走势乏力，缺乏宏观经济数据和政策力度的支持，居民超额储蓄的内部不平衡的结构和蕴含的低风险偏好依然未见起色。三架马车中的出口增速的中期展望亦显疲软，市场对政府投资及采购的发力和落地的预期较高，叠加一带一路大外交的破局，带动了大基建、信创、数据资产板块的行情持续发酵。随着三月份 chatgpt 新版本的推出，投资者对于技术革命的热情在多年沉寂后重被点燃，TMT 板块的未来预期被全面打开。二季度 A 股延续了一季度启动的重点板块行情，即红利低估性质的央国企价值重估走势和强成长预期的人工智能相关板块的突围。市场既追求远期的成长性，又不忘当下的分红安全性，这两者并存所带来杠铃型行情在一定程度上反应了对经济增长的不确定性的担忧。

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 1.438 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.20%，同期业绩比较基准收益率为-0.66%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0155%，年度化跟踪误差为 0.8972%。

#### 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 2023 年下半年，目前能观察到大国外交关系有解冻趋缓的态势并且市场对经济政策的预期开始增强，譬如促进新能源汽车、储能和电网建设的政策频频发力，管理层对于人工智能相关产业链高度重视并鼓励前瞻布局等。虽然下半年的国内经济可能还会处于夯实底部阶段，但库存去化开始进入后半程。我们预计美联储即便停止加息，但美国经济自然回落可能仍将美元的实际利率维持在显著的 1%-2%的水平到四季度，这对中美息差收窄和外资流入仍有一定压制作用，并且国内的风险偏好重新上升仍需等待政策的进一步发力。真正的重大机会或许来自供给侧的一定程度的调整出清配合需求侧的有力支持从而两者达到较为平衡的状态之时。柳暗花明总在峰回路转处，若干年后回头看这也许是国内经济迈向高质量发展、打开更广阔天地的转型途中一次短暂的波折。我们更需要耐心等待，在投资上转变追求短平快的心态，戒急用忍方能行稳致远。

#### 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 2023 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 66,277,908.05 元，其中，未分配利润已实现部分为 166,070,458.15 元，未分配利润未实现部分为-99,792,550.10 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合规守信、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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	14,270,760.72	14,153,187.50
结算备付金		30,380.15	144,340.16
存出保证金		4,657.52	59,140.03
交易性金融资产	6.4.7.2	203,478,512.44	208,657,140.73
其中：股票投资		203,463,117.12	208,581,906.27
基金投资		-	-
债券投资		15,395.32	75,234.46
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	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-

其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		109,353.44	155,028.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		217,893,664.27	223,168,836.59
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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		-	-
应付赎回款		45,820.35	210,175.00
应付管理人报酬		133,689.22	142,143.93
应付托管费		26,737.83	28,428.78
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	111,234.94	432,317.77
负债合计		317,482.34	813,065.48
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	151,298,273.88	156,454,690.75
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	66,277,908.05	65,901,080.36
净资产合计		217,576,181.93	222,355,771.11
负债和净资产总计		217,893,664.27	223,168,836.59

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.438 元，基金份额总额 151,298,273.88 份。

## 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
一、营业总收入		4,152,553.60	-23,200,720.55

1. 利息收入		25,026.00	25,405.55
其中：存款利息收入	6.4.7.13	25,026.00	25,405.55
债券利息收入		-	-
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）		3,423,281.56	-3,617,717.51
其中：股票投资收益	6.4.7.14	892,185.20	-5,511,120.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	21,376.19	141,491.90
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,509,720.17	1,751,910.82
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）	6.4.7.20	663,459.12	-19,845,051.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	40,786.92	236,642.52
<b>减：二、营业总支出</b>		1,088,962.23	1,073,706.21
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	831,028.69	815,887.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	166,205.70	163,177.50
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.26
8. 其他费用	6.4.7.23	91,727.84	94,640.54
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,063,591.37	-24,274,426.76
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”</b>		3,063,591.37	-24,274,426.76

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,063,591.37	-24,274,426.76

### 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	156,454,690.75	-	65,901,080.36	222,355,771.11
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）	156,454,690.75	-	65,901,080.36	222,355,771.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,156,416.87	-	376,827.69	-4,779,589.18
（一）、综合收益总额	-	-	3,063,591.37	3,063,591.37
（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）	-5,156,416.87	-	-2,686,763.68	-7,843,180.55
其中：1. 基金申购款	18,144,930.40	-	8,682,961.57	26,827,891.97
2. 基金赎回款	-23,301,347.27	-	-11,369,725.25	-34,671,072.52
（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)	151,298,273.88	-	66,277,908.05	217,576,181.93
项目	上年度可比期间 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

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：



胡甲

基金管理人负责人

刁俊东

主管会计工作负责人

龚珉

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%×沪深 300 指数收益率+5%×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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

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

## 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	14,270,760.72
等于：本金	14,269,473.68
加：应计利息	1,287.04
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	14,270,760.72

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	214,947,144.36	-	203,463,117.12	-11,484,027.24	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,000.00	4.62	15,395.32	2,390.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,000.00	4.62	15,395.32	2,390.70
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	214,960,144.36	4.62	203,478,512.44	-11,481,636.54	

#### 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 债权投资

无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

#### 6.4.7.8 其他资产

无。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	115.92
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	21,858.87
其中：交易所市场	21,858.87
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	111,234.94

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	156,454,690.75	156,454,690.75
本期申购	18,144,930.40	18,144,930.40
本期赎回（以“-”号填列）	-23,301,347.27	-23,301,347.27
本期末	151,298,273.88	151,298,273.88

注：1. 申购含转换入；赎回含转换出。

2. 截至 2023 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 2,737,106.00 份（2022 年 12 月 31 日：2,906,780.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 148,561,167.88 份（2022 年 12 月 31 日：153,547,910.75 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。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	169,234,150.63	-103,333,070.27	65,901,080.36
本期利润	2,400,132.25	663,459.12	3,063,591.37
本期基金份额交易产生的变动数	-5,563,824.73	2,877,061.05	-2,686,763.68
其中：基金申购款	19,684,141.38	-11,001,179.81	8,682,961.57
基金赎回款	-25,247,966.11	13,878,240.86	-11,369,725.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	166,070,458.15	-99,792,550.10	66,277,908.05

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	活期存款利息收入	24,493.12

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	161.74
其他	371.14
合计	25,026.00

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	892,185.20
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	892,185.20

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	23,151,928.96
减：卖出股票成本总额	22,199,141.88
减：交易费用	60,601.88
买卖股票差价收入	892,185.20

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	13.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	21,362.26
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	21,376.19

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	82,608.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	61,200.00
减：应计利息总额	43.41
减：交易费用	3.31
买卖债券差价收入	21,362.26

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,509,720.17
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,509,720.17

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	663,459.12
股票投资	675,068.78
债券投资	-11,609.66
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	663,459.12

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	40,762.02
基金转换费收入	24.90
合计	40,786.92

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。

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	2,467.69
合计	91,727.84

## 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
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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	19,987,012.90	56.86	124,766,538.71	58.94

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	57,616.76	69.75	798,865.90	90.41

## 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 2023年1月1日至2023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	18,613.38	56.86	13,731.00	62.82
关联方名称	上年度可比期间 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

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	831,028.69	815,887.91
其中：支付销售机构的客户维护费	204,184.34	208,353.25

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	166,205.70	163,177.50

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	14,270,760.72	24,493.12	12,504,761.14	23,529.00
合计	14,270,760.72	24,493.12	12,504,761.14	23,529.00

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（2023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
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	限售期锁定	9.60	9.93	3,767	36,163.20	37,406.31	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	限售期锁定	11.88	25.32	301	3,575.88	7,621.32	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	限售期锁定	18.88	20.03	114	2,152.32	2,283.42	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	限售期锁定	15.38	16.45	128	1,968.64	2,105.60	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	限售期锁定	44.48	42.55	41	1,823.68	1,744.55	-

		日									
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	限售期锁定	41.20	42.71	202	8,322.40	8,627.42		-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	限售期锁定	56.50	52.92	111	6,271.50	5,874.12		-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	1,628	42,034.96	42,034.96		-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	限售期锁定	25.82	25.82	181	4,673.42	4,673.42		-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	限售期锁定	50.00	30.71	255	12,750.00	7,831.05		-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	限售期锁定	44.18	25.36	242	7,643.14	6,137.12		-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	限售期锁定	25.25	19.83	343	8,660.75	6,801.69		-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	限售期锁定	32.29	55.59	176	5,683.04	9,783.84		-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	限售期锁定	13.06	23.16	642	8,384.52	14,868.72		-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	限售期锁定	131.11	53.20	102	8,915.48	5,426.40		-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	限售期锁定	14.81	13.74	502	7,434.62	6,897.48		-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	限售期锁定	32.60	32.24	174	5,672.40	5,609.76		-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	限售期锁定	73.45	46.64	93	6,830.85	4,337.52		-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	限售期锁定	17.55	17.23	368	6,458.40	6,340.64		-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	限售期锁定	23.77	42.86	271	6,441.67	11,615.06		-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	限售期锁定	71.88	92.81	94	6,756.72	8,724.14		-

301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	限售期 锁定	33.73	31.84	204	6,880.92	6,495.36	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	限售期 锁定	24.66	22.57	262	6,460.92	5,913.34	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	限售期 锁定	23.80	35.90	284	6,759.20	10,195.60	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	限售期 锁定	16.24	16.95	490	7,957.60	8,305.50	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	限售期 锁定	24.80	43.78	318	7,886.40	13,922.04	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	限售期 锁定	26.35	33.25	206	5,428.10	6,849.50	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	限售期 锁定	19.99	16.91	291	5,817.09	4,920.81	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	57.66	57.66	1,261	72,709.26	72,709.26	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	限售期 锁定	57.66	57.66	141	8,130.06	8,130.06	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	限售期 锁定	6.58	8.18	661	4,349.38	5,406.98	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	限售期 锁定	10.36	12.59	241	2,496.76	3,034.19	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	限售期 锁定	11.66	13.72	217	2,530.22	2,977.24	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	限售期 锁定	25.98	26.51	77	2,000.46	2,041.27	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	限售期 锁定	15.90	18.25	139	2,210.10	2,536.75	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	限售期 锁定	14.58	16.68	122	1,778.76	2,034.96	-
688249	晶合集	2023 年	6 个月	限售期	19.86	18.07	1,321	26,235.06	23,870.47	-

	成	4月24日		锁定							
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	限售期锁定	14.16	17.20	426	6,032.16	7,327.20		-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	限售期锁定	12.10	12.63	646	7,816.60	8,158.98		-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	限售期锁定	23.60	78.84	210	4,956.00	16,556.40		-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	限售期锁定	19.20	27.88	259	4,972.80	7,220.92		-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	限售期锁定	75.00	90.95	87	6,525.00	7,912.65		-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	限售期锁定	5.69	5.45	2,388	13,587.72	13,014.60		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	限售期锁定	11.10	17.24	884	9,812.40	15,240.16		-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	限售期锁定	33.99	29.83	164	5,574.36	4,892.12		-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	限售期锁定	39.99	38.64	229	9,157.71	8,848.56		-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	限售期锁定	35.00	54.75	145	5,075.00	7,938.75		-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	限售期锁定	21.17	24.18	325	6,880.25	7,858.50		-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	限售期锁定	12.68	25.35	462	5,858.16	11,711.70		-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	限售期锁定	125.80	118.08	57	7,170.60	6,730.56		-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	限售期锁定	11.18	16.26	551	6,160.18	8,959.26		-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,125	61,875.00	61,875.00		-
688603	天承科	2023年	6个月	限售期	55.00	55.00	126	6,930.00	6,930.00		-

	技	6月30日		锁定						
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	限售期锁定	125.88	89.31	64	8,056.32	5,715.84	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	限售期锁定	25.28	30.89	166	4,196.48	5,127.74	-

注：1、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。

2、本基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、本基金可作为特定投资者，参与上市公司公开或非公开发行股份认购。本基金可作为特定投资者所认购的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

4、本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。本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。

5、本基金可以通过网下发行获配的创业板股票。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，安排获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.40	6,400	42,061.38	44,608.00	-

#### 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 2023 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% (2022 年 12 月 31 日: 0.03%)。

#### 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 2023 年 6 月 30 日, 本基金所承担的全部金融负债的合同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 2023 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 2023 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 2023 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	14,269,473.68	-	-	1,287.04	14,270,760.72
结算备付金	30,366.55	-	-	13.60	30,380.15
存出保证金	4,655.42	-	-	2.10	4,657.52
交易性金融资产	-	-	15,390.70	203,463,121.74	203,478,512.44
应收申购款	-	-	-	109,353.44	109,353.44
资产总计	14,304,495.65	-	15,390.70	203,573,777.92	217,893,664.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	45,820.35	45,820.35

应付管理人报酬	-	-	-	133,689.22	133,689.22
应付托管费	-	-	-	26,737.83	26,737.83
其他负债	-	-	-	111,234.94	111,234.94
负债总计	-	-	-	317,482.34	317,482.34
利率敏感度缺口	14,304,495.65	-	15,390.70	203,256,295.58	217,576,181.93
上年度末 2022 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	14,151,751.36	-	-	1,436.14	14,153,187.50
结算备付金	144,268.77	-	-	71.39	144,340.16
存出保证金	59,110.77	-	-	29.26	59,140.03
交易性金融资产	-	23,362.56	51,837.80	208,581,940.37	208,657,140.73
应收申购款	-	-	-	155,028.17	155,028.17
资产总计	14,355,130.90	23,362.56	51,837.80	208,738,505.33	223,168,836.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	210,175.00	210,175.00
应付管理人报酬	-	-	-	142,143.93	142,143.93
应付托管费	-	-	-	28,428.78	28,428.78
其他负债	-	-	-	432,317.77	432,317.77
负债总计	-	-	-	813,065.48	813,065.48
利率敏感度缺口	14,355,130.90	23,362.56	51,837.80	207,925,439.85	222,355,771.11

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 2023 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%（2022 年 12 月 31 日：0.03%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	203,463,117.12	93.51	208,581,906.27	93.81
合计	203,463,117.12	93.51	208,581,906.27	93.81

#### 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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准（附注 6.4.1）上升 5%	10,598,386.03	10,886,420.70
	2. 业绩比较基准（附注 6.4.1）下降 5%	-10,598,386.03	-10,886,420.70

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	202,835,797.63	207,898,936.43
第二层次	240,960.70	135,702.84
第三层次	401,754.11	622,501.46
合计	203,478,512.44	208,657,140.73

#### 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 2023 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（2022 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	203,463,117.12	93.38
	其中：股票	203,463,117.12	93.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,395.32	0.01
	其中：债券	15,395.32	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	14,301,140.87	6.56
8	其他各项资产	114,010.96	0.05
9	合计	217,893,664.27	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	2,187,786.00	1.01
B	采矿业	8,245,188.70	3.79
C	制造业	113,511,995.15	52.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,343,829.76	2.92
E	建筑业	4,844,053.16	2.23
F	批发和零售业	588,433.23	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	6,206,592.67	2.85
H	住宿和餐饮业	148,190.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,118,021.24	4.65
J	金融业	36,126,891.86	16.60
K	房地产业	2,922,433.03	1.34
L	租赁和商务服务业	1,875,535.64	0.86
M	科学研究和技术服务业	1,939,180.85	0.89
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	-	-
Q	卫生和社会工作	1,149,780.05	0.53
R	文化、体育和娱乐业	259,996.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	196,467,907.34	90.30

### 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	978,177.77	0.45
C	制造业	4,536,005.75	2.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,406.31	0.02
E	建筑业	120,739.17	0.06
F	批发和零售业	143,599.60	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	236,005.51	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,480.26	0.03
J	金融业	476,661.40	0.22
K	房地产业	107,855.20	0.05
L	租赁和商务服务业	19,686.90	0.01
M	科学研究和技术服务业	30,174.85	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	11,198.01	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	125,020.00	0.06
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	108,199.05	0.05
S	综合	-	-
	合计	6,995,209.78	3.22

### 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	6,589	11,141,999.00	5.12
2	300750	宁德时代	27,460	6,282,573.40	2.89
3	601318	中国平安	112,890	5,238,096.00	2.41
4	000858	五粮液	20,606	3,370,523.42	1.55
5	000333	美的集团	51,088	3,010,104.96	1.38
6	600900	长江电力	110,192	2,430,835.52	1.12
7	002594	比亚迪	9,303	2,402,685.81	1.10
8	601166	兴业银行	151,330	2,368,314.50	1.09

9	600276	恒瑞医药	45,586	2,183,569.40	1.00
10	601899	紫金矿业	178,101	2,025,008.37	0.93
11	600030	中信证券	101,440	2,006,483.20	0.92
12	600887	伊利股份	67,210	1,903,387.20	0.87
13	300059	东方财富	133,098	1,889,991.60	0.87
14	600028	中国石化	287,762	1,830,166.32	0.84
15	601012	隆基绿能	61,918	1,775,189.06	0.82
16	601398	工商银行	364,987	1,759,237.34	0.81
17	600309	万华化学	19,726	1,732,731.84	0.80
18	000651	格力电器	46,317	1,691,033.67	0.78
19	002475	立讯精密	51,064	1,657,026.80	0.76
20	601328	交通银行	285,381	1,655,209.80	0.76
21	002415	海康威视	49,596	1,642,123.56	0.75
22	000568	泸州老窖	7,757	1,625,634.49	0.75
23	000725	京东方 A	381,588	1,560,694.92	0.72
24	300760	迈瑞医疗	5,000	1,499,000.00	0.69
25	000063	中兴通讯	32,389	1,474,995.06	0.68
26	603259	药明康德	21,635	1,348,076.85	0.62
27	601816	京沪高铁	249,800	1,313,948.00	0.60
28	300274	阳光电源	11,000	1,282,930.00	0.59
29	002230	科大讯飞	18,859	1,281,657.64	0.59
30	601668	中国建筑	215,603	1,237,561.22	0.57
31	300124	汇川技术	19,236	1,235,143.56	0.57
32	002714	牧原股份	28,661	1,208,061.15	0.56
33	600941	中国移动	12,900	1,203,570.00	0.55
34	601288	农业银行	325,465	1,148,891.45	0.53
35	601888	中国中免	10,328	1,141,553.84	0.52
36	000938	紫光股份	35,821	1,140,898.85	0.52
37	002352	顺丰控股	25,200	1,136,268.00	0.52
38	002129	TCL 中环	33,625	1,116,350.00	0.51
39	000001	平安银行	98,679	1,108,165.17	0.51
40	600905	三峡能源	202,400	1,086,888.00	0.50
41	601088	中国神华	34,878	1,072,498.50	0.49
42	000792	盐湖股份	55,500	1,063,935.00	0.49
43	601138	工业富联	41,900	1,055,880.00	0.49
44	688981	中芯国际	20,848	1,053,240.96	0.48
45	600031	三一重工	62,533	1,039,923.79	0.48
46	002142	宁波银行	40,691	1,029,482.30	0.47
47	600016	民生银行	263,839	989,396.25	0.45
48	000002	万 科 A	69,947	980,656.94	0.45
49	300498	温氏股份	53,391	979,724.85	0.45
50	600406	国电南瑞	42,220	975,282.00	0.45
51	600048	保利发展	74,034	964,663.02	0.44



52	600438	通威股份	28,000	960,680.00	0.44
53	600111	北方稀土	39,570	948,888.60	0.44
54	600809	山西汾酒	5,100	943,857.00	0.43
55	600050	中国联通	195,948	940,550.40	0.43
56	601601	中国太保	36,166	939,592.68	0.43
57	600837	海通证券	101,694	937,618.68	0.43
58	601728	中国电信	166,000	934,580.00	0.43
59	688111	金山办公	1,956	923,662.32	0.42
60	300015	爱尔眼科	49,451	917,316.05	0.42
61	600690	海尔智家	39,015	916,072.20	0.42
62	601857	中国石油	121,065	904,355.55	0.42
63	600089	特变电工	40,427	901,117.83	0.41
64	600919	江苏银行	121,070	889,864.50	0.41
65	002371	北方华创	2,800	889,420.00	0.41
66	600436	片仔癀	3,100	887,716.00	0.41
67	603501	韦尔股份	8,910	873,536.40	0.40
68	600000	浦发银行	120,029	869,009.96	0.40
69	601988	中国银行	217,060	848,704.60	0.39
70	601766	中国中车	128,043	832,279.50	0.38
71	002304	洋河股份	6,297	827,110.95	0.38
72	603288	海天味业	17,032	797,949.20	0.37
73	601390	中国中铁	104,729	793,845.82	0.36
74	002466	天齐锂业	11,011	769,779.01	0.35
75	300014	亿纬锂能	12,600	762,300.00	0.35
76	603986	兆易创新	7,008	744,600.00	0.34
77	002027	分众传媒	107,780	733,981.80	0.34
78	601688	华泰证券	53,262	733,417.74	0.34
79	601818	光大银行	238,267	731,479.69	0.34
80	600150	中国船舶	22,200	730,602.00	0.34
81	601225	陕西煤业	39,917	726,090.23	0.33
82	601169	北京银行	155,852	721,594.76	0.33
83	002460	赣锋锂业	11,790	718,718.40	0.33
84	688012	中微公司	4,570	714,976.50	0.33
85	600104	上汽集团	50,243	711,943.31	0.33
86	002459	晶澳科技	16,960	707,232.00	0.33
87	600570	恒生电子	15,831	701,154.99	0.32
88	002050	三花智控	23,050	697,493.00	0.32
89	000338	潍柴动力	55,592	692,676.32	0.32
90	601985	中国核电	96,195	678,174.75	0.31
91	600745	闻泰科技	13,600	665,040.00	0.31
92	002049	紫光国微	7,080	660,210.00	0.30
93	000625	长安汽车	50,719	655,796.67	0.30
94	601211	国泰君安	46,300	647,737.00	0.30

95	603019	中科曙光	12,320	627,088.00	0.29
96	601919	中远海控	66,500	625,100.00	0.29
97	000100	TCL 科技	157,989	622,476.66	0.29
98	601800	中国交建	56,433	615,684.03	0.28
99	601628	中国人寿	17,599	615,261.04	0.28
100	600585	海螺水泥	25,390	602,758.60	0.28
101	603799	华友钴业	13,101	601,466.91	0.28
102	600893	航发动力	14,141	597,598.66	0.27
103	601229	上海银行	102,651	590,243.25	0.27
104	600660	福耀玻璃	16,441	589,409.85	0.27
105	002179	中航光电	12,928	586,284.80	0.27
106	002271	东方雨虹	21,400	583,364.00	0.27
107	601989	中国重工	119,634	576,635.88	0.27
108	600009	上海机场	12,552	570,111.84	0.26
109	002555	三七互娱	16,302	568,613.76	0.26
110	601658	邮储银行	115,100	562,839.00	0.26
111	300782	卓胜微	5,820	562,386.60	0.26
112	300122	智飞生物	12,300	543,660.00	0.25
113	600999	招商证券	39,246	532,568.22	0.24
114	002812	恩捷股份	5,500	529,925.00	0.24
115	000977	浪潮信息	10,800	523,800.00	0.24
116	600958	东方证券	53,406	518,038.20	0.24
117	600019	宝钢股份	90,988	511,352.56	0.24
118	600760	中航沈飞	11,312	509,040.00	0.23
119	002709	天赐材料	12,300	506,637.00	0.23
120	688036	传音控股	3,427	503,769.00	0.23
121	600115	中国东航	105,109	500,318.84	0.23
122	688599	天合光能	11,520	490,867.20	0.23
123	300896	爱美客	1,100	489,445.00	0.22
124	300316	晶盛机电	6,900	489,210.00	0.22
125	600426	华鲁恒升	15,700	480,891.00	0.22
126	002236	大华股份	23,922	472,459.50	0.22
127	688008	澜起科技	8,145	467,685.90	0.21
128	002920	德赛西威	3,000	467,430.00	0.21
129	601186	中国铁建	47,395	466,840.75	0.21
130	000661	长春高新	3,400	463,420.00	0.21
131	600584	长电科技	14,700	458,199.00	0.21
132	000776	广发证券	31,065	456,966.15	0.21
133	601360	三六零	36,300	455,202.00	0.21
134	601600	中国铝业	82,897	455,104.53	0.21
135	601006	大秦铁路	60,916	452,605.88	0.21
136	002241	歌尔股份	25,204	447,371.00	0.21
137	600547	山东黄金	19,020	446,589.60	0.21

138	600588	用友网络	21,753	445,936.50	0.20
139	002410	广联达	13,580	441,214.20	0.20
140	002821	凯莱英	3,720	438,439.20	0.20
141	601377	兴业证券	71,449	437,267.88	0.20
142	601009	南京银行	54,604	436,832.00	0.20
143	300142	沃森生物	16,500	436,425.00	0.20
144	601939	建设银行	69,009	431,996.34	0.20
145	600011	华能国际	46,500	430,590.00	0.20
146	000166	申万宏源	92,630	427,950.60	0.20
147	688223	晶科能源	30,102	423,234.12	0.19
148	300450	先导智能	11,700	423,189.00	0.19
149	300408	三环集团	14,300	419,705.00	0.19
150	600085	同仁堂	7,275	418,749.00	0.19
151	600010	包钢股份	233,841	418,575.39	0.19
152	000425	徐工机械	61,226	414,500.02	0.19
153	000596	古井贡酒	1,673	413,866.74	0.19
154	605117	德业股份	2,760	412,758.00	0.19
155	001979	招商蛇口	31,669	412,647.07	0.19
156	002311	海大集团	8,800	412,192.00	0.19
157	601669	中国电建	71,673	411,403.02	0.19
158	603659	璞泰来	10,730	410,100.60	0.19
159	600196	复星医药	13,090	404,481.00	0.19
160	300033	同花顺	2,300	403,144.00	0.19
161	000963	华东医药	9,279	402,430.23	0.18
162	600886	国投电力	31,563	399,271.95	0.18
163	603993	洛阳钼业	74,705	398,177.65	0.18
164	000768	中航西飞	14,641	391,646.75	0.18
165	603392	万泰生物	5,825	388,935.25	0.18
166	000538	云南白药	7,327	384,520.96	0.18
167	600845	宝信软件	7,560	384,123.60	0.18
168	600600	青岛啤酒	3,700	383,431.00	0.18
169	002252	上海莱士	49,800	373,998.00	0.17
170	601689	拓普集团	4,600	371,220.00	0.17
171	300769	德方纳米	3,360	370,372.80	0.17
172	002493	荣盛石化	31,200	363,168.00	0.17
173	603260	合盛硅业	5,180	362,703.60	0.17
174	300347	泰格医药	5,600	361,424.00	0.17
175	600015	华夏银行	66,636	360,500.76	0.17
176	600926	杭州银行	30,620	359,785.00	0.17
177	600795	国电电力	93,828	359,361.24	0.17
178	601100	恒立液压	5,556	357,417.48	0.16
179	600176	中国巨石	24,690	349,610.40	0.16
180	600674	川投能源	23,166	348,648.30	0.16

181	000157	中联重科	51,308	346,329.00	0.16
182	000733	振华科技	3,600	345,060.00	0.16
183	002180	纳思达	10,000	342,500.00	0.16
184	000301	东方盛虹	28,600	338,052.00	0.16
185	603369	今世缘	6,400	337,920.00	0.16
186	600029	南方航空	55,858	336,823.74	0.15
187	601066	中信建投	13,700	331,540.00	0.15
188	601111	中国国航	40,096	330,391.04	0.15
189	601995	中金公司	9,300	330,336.00	0.15
190	601633	长城汽车	13,080	329,223.60	0.15
191	601788	光大证券	20,647	328,080.83	0.15
192	601868	中国能建	137,000	320,580.00	0.15
193	300496	中科创达	3,300	317,955.00	0.15
194	601336	新华保险	8,574	315,265.98	0.14
195	601877	正泰电器	11,400	315,210.00	0.14
196	600346	恒力石化	21,940	314,400.20	0.14
197	601117	中国化学	37,700	312,156.00	0.14
198	002074	国轩高科	11,300	312,106.00	0.14
199	600741	华域汽车	16,829	310,663.34	0.14
200	002202	金风科技	29,182	309,912.84	0.14
201	002756	永兴材料	4,940	309,293.40	0.14
202	300454	深信服	2,700	305,775.00	0.14
203	002001	新和成	19,688	303,195.20	0.14
204	688303	大全能源	7,486	302,808.70	0.14
205	601618	中国中冶	75,186	298,488.42	0.14
206	002841	视源股份	4,400	294,096.00	0.14
207	600989	宝丰能源	23,200	292,552.00	0.13
208	600188	兖矿能源	9,744	291,540.48	0.13
209	688126	沪硅产业	13,800	288,420.00	0.13
210	300661	圣邦股份	3,510	288,276.30	0.13
211	688396	华润微	5,478	287,101.98	0.13
212	601901	方正证券	43,604	285,170.16	0.13
213	603806	福斯特	7,664	285,024.16	0.13
214	601838	成都银行	22,900	279,609.00	0.13
215	000876	新希望	23,814	278,147.52	0.13
216	601615	明阳智能	16,000	270,080.00	0.12
217	600460	士兰微	8,900	269,403.00	0.12
218	000895	双汇发展	10,947	268,092.03	0.12
219	002648	卫星化学	17,780	265,988.80	0.12
220	000786	北新建材	10,800	264,708.00	0.12
221	300207	欣旺达	16,100	262,752.00	0.12
222	600039	四川路桥	26,740	262,319.40	0.12
223	002007	华兰生物	11,665	261,412.65	0.12

224	300413	芒果超媒	7,600	259,996.00	0.12
225	003816	中国广核	83,200	258,752.00	0.12
226	002736	国信证券	29,609	258,486.57	0.12
227	600233	圆通速递	17,500	254,800.00	0.12
228	600732	爱旭股份	8,260	253,995.00	0.12
229	002601	龙佰集团	15,200	250,800.00	0.12
230	300999	金龙鱼	6,200	247,938.00	0.11
231	300919	中伟股份	4,100	247,025.00	0.11
232	300433	蓝思科技	21,000	246,960.00	0.11
233	300751	迈为股份	1,440	243,907.20	0.11
234	601238	广汽集团	22,840	237,992.80	0.11
235	600383	金地集团	32,540	234,613.40	0.11
236	600763	通策医疗	2,400	232,464.00	0.11
237	600332	白云山	7,263	231,544.44	0.11
238	600132	重庆啤酒	2,500	230,400.00	0.11
239	601021	春秋航空	4,000	229,880.00	0.11
240	300759	康龙化成	6,000	229,680.00	0.11
241	300223	北京君正	2,600	229,606.00	0.11
242	600219	南山铝业	73,600	222,272.00	0.10
243	300763	锦浪科技	2,100	218,610.00	0.10
244	688363	华熙生物	2,405	214,429.80	0.10
245	601865	福莱特	5,300	204,103.00	0.09
246	600362	江西铜业	10,707	203,218.86	0.09
247	601878	浙商证券	20,500	202,540.00	0.09
248	600918	中泰证券	29,300	202,463.00	0.09
249	000723	美锦能源	26,500	199,810.00	0.09
250	601319	中国人保	33,700	196,808.00	0.09
251	603290	斯达半导	900	193,680.00	0.09
252	601998	中信银行	32,288	193,082.24	0.09
253	000069	华侨城 A	43,199	190,075.60	0.09
254	600061	国投资本	26,416	188,081.92	0.09
255	000877	天山股份	23,000	187,220.00	0.09
256	603486	科沃斯	2,400	186,648.00	0.09
257	601607	上海医药	8,300	186,003.00	0.09
258	300628	亿联网络	5,300	185,871.00	0.09
259	601799	星宇股份	1,500	185,400.00	0.09
260	603833	欧派家居	1,920	183,936.00	0.08
261	002938	鹏鼎控股	7,500	182,175.00	0.08
262	600803	新奥股份	9,400	178,412.00	0.08
263	688005	容百科技	3,302	178,374.04	0.08
264	000408	藏格矿业	7,900	178,303.00	0.08
265	300601	康泰生物	7,000	177,730.00	0.08
266	600183	生益科技	12,500	177,500.00	0.08

267	603899	晨光股份	3,900	174,096.00	0.08
268	600884	杉杉股份	11,400	172,596.00	0.08
269	000708	中信特钢	10,700	169,488.00	0.08
270	600018	上港集团	31,873	167,333.25	0.08
271	002916	深南电路	2,220	167,321.40	0.08
272	603185	弘元绿能	2,200	164,010.00	0.08
273	601898	中煤能源	19,300	162,892.00	0.07
274	601881	中国银河	13,700	159,057.00	0.07
275	600875	东方电气	8,300	154,795.00	0.07
276	000983	山西焦煤	16,900	153,790.00	0.07
277	601216	君正集团	36,508	149,682.80	0.07
278	600754	锦江酒店	3,500	148,190.00	0.07
279	688561	奇安信	2,843	147,295.83	0.07
280	002120	韵达股份	15,393	147,157.08	0.07
281	002064	华峰化学	21,300	146,118.00	0.07
282	002414	高德红外	18,715	145,415.55	0.07
283	601699	潞安环能	8,900	145,248.00	0.07
284	601872	招商轮船	24,500	141,855.00	0.07
285	601155	新城控股	9,700	139,777.00	0.06
286	600025	华能水电	19,200	136,896.00	0.06
287	000617	中油资本	18,600	134,478.00	0.06
288	600606	绿地控股	45,518	125,174.50	0.06
289	300957	贝泰妮	1,400	124,432.00	0.06
290	603195	公牛集团	1,232	118,345.92	0.05
291	688065	凯赛生物	1,890	117,671.40	0.05
292	688187	时代电气	2,567	107,454.62	0.05
293	601698	中国卫通	4,600	91,448.00	0.04
294	601808	中海油服	6,400	88,832.00	0.04
295	605499	东鹏饮料	500	86,450.00	0.04
296	000800	一汽解放	10,100	84,537.00	0.04
297	300979	华利集团	1,700	82,858.00	0.04
298	601236	红塔证券	10,230	76,213.50	0.04
299	001289	龙源电力	1,600	36,000.00	0.02

### 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	26,002	471,156.24	0.22
2	600352	浙江龙盛	36,712	343,257.20	0.16
3	600489	中金黄金	31,501	325,405.33	0.15
4	300003	乐普医疗	13,600	307,496.00	0.14
5	600161	天坛生物	11,260	305,709.00	0.14
6	000066	中国长城	21,500	297,345.00	0.14
7	002568	百润股份	7,680	279,168.00	0.13

8	601916	浙商银行	92,300	243,672.00	0.11
9	688428	诺诚健华	20,503	236,809.65	0.11
10	300866	安克创新	2,400	210,000.00	0.10
11	600066	宇通客车	13,798	203,382.52	0.09
12	600177	雅戈尔	28,552	180,163.12	0.08
13	000703	恒逸石化	24,520	166,245.60	0.08
14	603160	汇顶科技	3,300	152,625.00	0.07
15	600867	通化东宝	13,800	144,072.00	0.07
16	600516	方大炭素	21,856	135,507.20	0.06
17	002791	坚朗五金	2,000	129,420.00	0.06
18	601018	宁波港	37,309	126,477.51	0.06
19	002607	中公教育	26,600	125,020.00	0.06
20	600583	海油工程	21,232	124,207.20	0.06
21	603087	甘李药业	3,200	123,200.00	0.06
22	600038	中直股份	2,924	116,433.68	0.05
23	600655	豫园股份	16,961	116,352.46	0.05
24	600170	上海建工	42,422	114,115.18	0.05
25	601997	贵阳银行	21,740	112,178.40	0.05
26	688076	诺泰生物	3,133	111,472.14	0.05
27	600977	中国电影	7,701	108,199.05	0.05
28	600208	新湖中宝	43,490	107,855.20	0.05
29	000709	河钢股份	40,475	91,473.50	0.04
30	600398	海澜之家	12,900	88,752.00	0.04
31	600372	中航电子	5,662	85,949.16	0.04
32	301486	致尚科技	1,402	80,839.32	0.04
33	601825	沪农商行	13,900	75,755.00	0.03
34	688119	中钢洛耐	13,542	75,564.36	0.03
35	688351	微电生理	3,785	73,693.95	0.03
36	601992	金隅集团	32,100	69,978.00	0.03
37	688603	天承科技	1,251	68,805.00	0.03
38	002468	申通快递	6,000	64,920.00	0.03
39	600968	海油发展	18,700	57,409.00	0.03
40	688448	磁谷科技	1,615	55,281.45	0.03
41	301202	朗威股份	1,809	46,708.38	0.02
42	600928	西安银行	12,800	45,056.00	0.02
43	601298	青岛港	6,400	44,608.00	0.02
44	688236	春立医疗	1,678	41,111.00	0.02
45	001286	陕西能源	3,767	37,406.31	0.02
46	601212	白银有色	12,900	35,088.00	0.02
47	688249	晶合集成	1,321	23,870.47	0.01
48	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
49	601828	美凯龙	4,110	19,686.90	0.01
50	688361	中科飞测	210	16,556.40	0.01

51	688472	阿特斯	884	15,240.16	0.01
52	301320	豪江智能	642	14,868.72	0.01
53	301419	阿莱德	318	13,922.04	0.01
54	688080	映翰通	280	13,692.00	0.01
55	688469	中芯集成	2,388	13,014.60	0.01
56	688562	航天软件	462	11,711.70	0.01
57	301358	湖南裕能	271	11,615.06	0.01
58	688078	龙软科技	200	10,310.00	0.00
59	301382	蜂助手	284	10,195.60	0.00
60	301315	威士顿	176	9,783.84	0.00
61	688593	新相微	551	8,959.26	0.00
62	688484	南芯科技	229	8,848.56	0.00
63	301360	荣旗科技	94	8,724.14	0.00
64	301141	中科磁业	202	8,627.42	0.00
65	301408	华人健康	490	8,305.50	0.00
66	688352	颀中科技	646	8,158.98	0.00
67	688535	华海诚科	145	7,938.75	0.00
68	688458	美芯晟	87	7,912.65	0.00
69	688552	航天南湖	325	7,858.50	0.00
70	301246	宏源药业	255	7,831.05	0.00
71	001287	中电港	301	7,621.32	0.00
72	688334	西高院	426	7,327.20	0.00
73	688429	时创能源	259	7,220.92	0.00
74	301332	德尔玛	502	6,897.48	0.00
75	301428	世纪恒通	206	6,849.50	0.00
76	301305	朗坤环境	343	6,801.69	0.00
77	688581	安杰思	57	6,730.56	0.00
78	301373	凌玮科技	204	6,495.36	0.00
79	301355	南王科技	368	6,340.64	0.00
80	301281	科源制药	242	6,137.12	0.00
81	301376	致欧科技	262	5,913.34	0.00
82	301157	华塑科技	111	5,874.12	0.00
83	688623	二元科技	64	5,715.84	0.00
84	301337	亚华电子	174	5,609.76	0.00
85	301322	绿通科技	102	5,426.40	0.00
86	601061	中信金属	661	5,406.98	0.00
87	688631	莱斯信息	166	5,127.74	0.00
88	301439	泓淋电力	291	4,920.81	0.00
89	688479	友车科技	164	4,892.12	0.00
90	688480	赛恩斯	142	4,396.32	0.00
91	301345	涛涛车业	93	4,337.52	0.00
92	605133	嵘泰股份	100	3,476.00	0.00
93	601065	江盐集团	241	3,034.19	0.00



94	601133	柏诚股份	217	2,977.24	0.00
95	603137	恒尚节能	139	2,536.75	0.00
96	001324	长青科技	114	2,283.42	0.00
97	001360	南矿集团	128	2,105.60	0.00
98	603125	常青科技	77	2,041.27	0.00
99	603172	万丰股份	122	2,034.96	0.00
100	001367	海森药业	41	1,744.55	0.00
101	605303	园林股份	100	1,110.00	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	600028	中国石化	942,588.00	0.42
2	600941	中国移动	679,273.00	0.31
3	600519	贵州茅台	677,799.00	0.30
4	600905	三峡能源	578,880.00	0.26
5	000938	紫光股份	448,850.00	0.20
6	600111	北方稀土	369,369.00	0.17
7	001286	陕西能源	361,603.20	0.16
8	601728	中国电信	327,199.00	0.15
9	605117	德业股份	274,253.00	0.12
10	601899	紫金矿业	271,127.00	0.12
11	300769	德方纳米	268,445.00	0.12
12	688303	大全能源	266,034.09	0.12
13	600745	闻泰科技	263,366.00	0.12
14	688249	晶合集成	262,231.44	0.12
15	002756	永兴材料	251,634.00	0.11
16	601818	光大银行	247,147.00	0.11
17	600115	中国东航	243,787.00	0.11
18	300782	卓胜微	240,170.00	0.11
19	002180	纳思达	239,852.00	0.11
20	600732	爱旭股份	227,281.00	0.10

### 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	1,720,521.00	0.77
2	600519	贵州茅台	1,384,380.00	0.62
3	600887	伊利股份	546,273.00	0.25
4	600309	万华化学	526,151.00	0.24
5	002602	世纪华通	445,326.43	0.20

6	002352	顺丰控股	436,222.00	0.20
7	002129	TCL 中环	399,452.00	0.18
8	000792	盐湖股份	389,851.00	0.18
9	601816	京沪高铁	355,920.00	0.16
10	300896	爱美客	355,655.00	0.16
11	688515	裕太微	341,900.00	0.15
12	001286	陕西能源	339,000.00	0.15
13	688169	石头科技	319,996.14	0.14
14	603882	金域医学	236,547.00	0.11
15	002008	大族激光	236,356.00	0.11
16	688249	晶合集成	231,878.03	0.10
17	002600	领益智造	202,506.00	0.09
18	000895	双汇发展	196,991.00	0.09
19	002594	比亚迪	183,579.00	0.08
20	600900	长江电力	179,005.00	0.08

#### 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	16,405,283.95
卖出股票收入（成交）总额	23,151,928.96

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）	15,395.32	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,395.32	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	127085	韵达转债	130	15,395.32	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。

## 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：

2022 年 10 月 28 日，银保监罚决字（2022）50 号显示，兴业银行股份有限公司理财业务存在老产品规模在部分时点出现反弹等 5 项违法违规事实，被处罚款 450 万元。2022 年 11 月 4 日，银保监罚决字（2022）41 号显示，兴业银行股份有限公司存在债券承销业务严重违反审慎经营规则的违法违规事实，被处罚款 150 万元。2023 年 1 月 18 日，中国银行间市场交易商协会自律处分信息显示，兴业银行股份有限公司存在低价包销多期债务融资工具，影响了市场正常秩序等 2 项违法违规事实，被处警告，责令整改。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	4,657.52
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	109,353.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	114,010.96

#### 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

本基金本报告期末积极投资前五名股票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 (%)
11,567	13,080.17	36,573,817.81	24.17	114,724,456.07	75.83

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 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	22.67
2	鲍建平	110,167.00	4.02
3	柳楠	100,000.00	3.65
4	张睿珈	74,700.00	2.73
5	吴卫菊	69,732.00	2.55

6	杨凯	61,400.00	2.24
7	缪晏	60,000.00	2.19
8	李泽华	51,000.00	1.86
9	李丽	49,600.00	1.81
10	陈思颖	46,000.00	1.68

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	198,136.73	0.1310

### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 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	156,454,690.75
本报告期基金总申购份额	18,144,930.40
减：本报告期基金总赎回份额	23,301,347.27
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	151,298,273.88

## § 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

根据公司第八届董事会相关会议决议，选举胡甲先生担任公司董事长，同时代行公司总经理职务，代行总经理职务期限不超 6 个月；高民和先生不再担任公司董事长，周兵先生不再担任公司总经理职务。公司已按规定向相关监管机构报备并进行公告。

#### 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为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

## 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 5 月 11 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改，整改措施主要包括完善内部制度、优化管控流程等
其他	-

## 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 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 (%)	
国元证券	1	19,987,012.90	56.86	18,613.38	56.86	-
招商证券	1	15,164,774.91	43.14	14,123.25	43.14	-

## 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	57,616.76	69.75	-	-	-	-
招商证券	24,992.22	30.25	-	-	-	-

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) 资历雄厚，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部分基金增加代销机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 17 日
2	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 20 日
3	长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 20 日
4	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	2023 年 2 月 3 日
5	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)	中国证监会指定披露媒介	2023 年 2 月 3 日
6	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加华瑞保险为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 8 日
7	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 15 日
8	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 15 日
9	长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
10	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2022 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
11	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销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
12	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 17 日
13	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 22 日
14	长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 22 日
15	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 5 月 5 日
16	长盛基金管理有限公司关于增加东方证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投业务与转换业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 6 月 2 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

2023 年 8 月 30 日