

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）证券投资基金
2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 21 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	65
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	65
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	65

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	66
§9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末上市基金前十名持有人	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	68
§10 开放式基金份额变动	69
§11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	73
§12 影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§13 备查文件目录	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）
基金简称	长盛同庆中证 800 指数（LOF）
场内简称	长盛同庆
基金主代码	160806
交易代码	160806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 22 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	255,127,274.93 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 8 月 6 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	田青
	联系电话	010-86497608	010-67595096
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666 010-86497888	010-67595096
传真		010-86497999	010-66275853
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

	心 3-5 层	
邮政编码	100029	100033
法定代表人	周兵	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	27,703,715.80	-1,732,712.98	4,367,883.47
本期利润	78,646,249.25	-33,002,879.96	23,577,895.28
加权平均基金份额本期利润	0.4024	-0.3312	0.2012
本期加权平均净值利润率	29.51%	-25.31%	15.06%
本期基金份额净值增长率	43.02%	-23.10%	16.43%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	97,386,589.13	4,252,861.92	39,339,222.22
期末可供分配基金份额利润	0.3817	0.0436	0.3781
期末基金资产净值	369,897,404.17	108,422,396.63	150,482,345.90
期末基金份额净值	1.450	1.112	1.446
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-11.35%	-38.02%	-19.40%

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.81%	0.69%	6.87%	0.71%	0.94%	-0.02%
过去六个月	13.19%	0.84%	6.63%	0.84%	6.56%	0.00%
过去一年	43.02%	1.17%	32.00%	1.20%	11.02%	-0.03%
过去三年	28.05%	1.06%	11.69%	1.08%	16.36%	-0.02%
自基金转型至今	-11.35%	1.56%	-22.74%	1.48%	11.39%	0.08%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

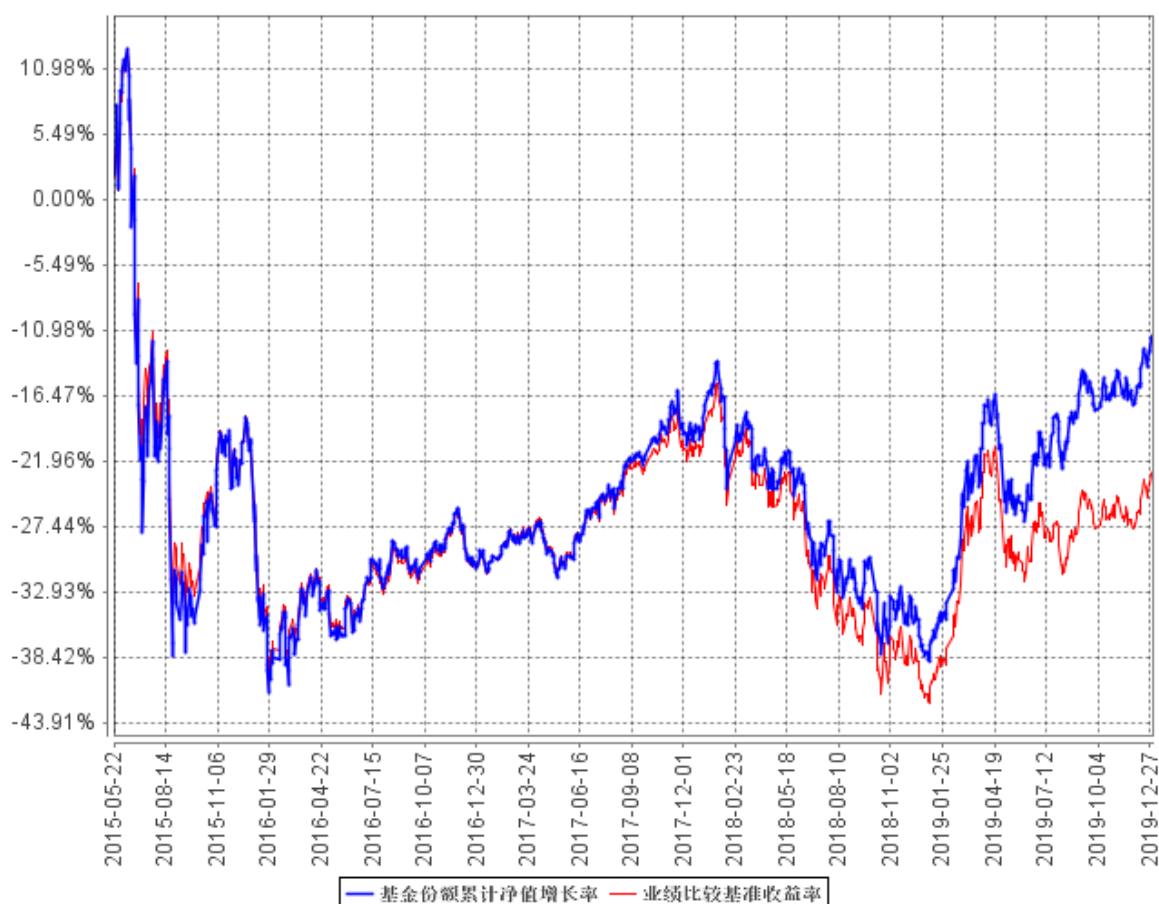
本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率（税后）}$

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

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

3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

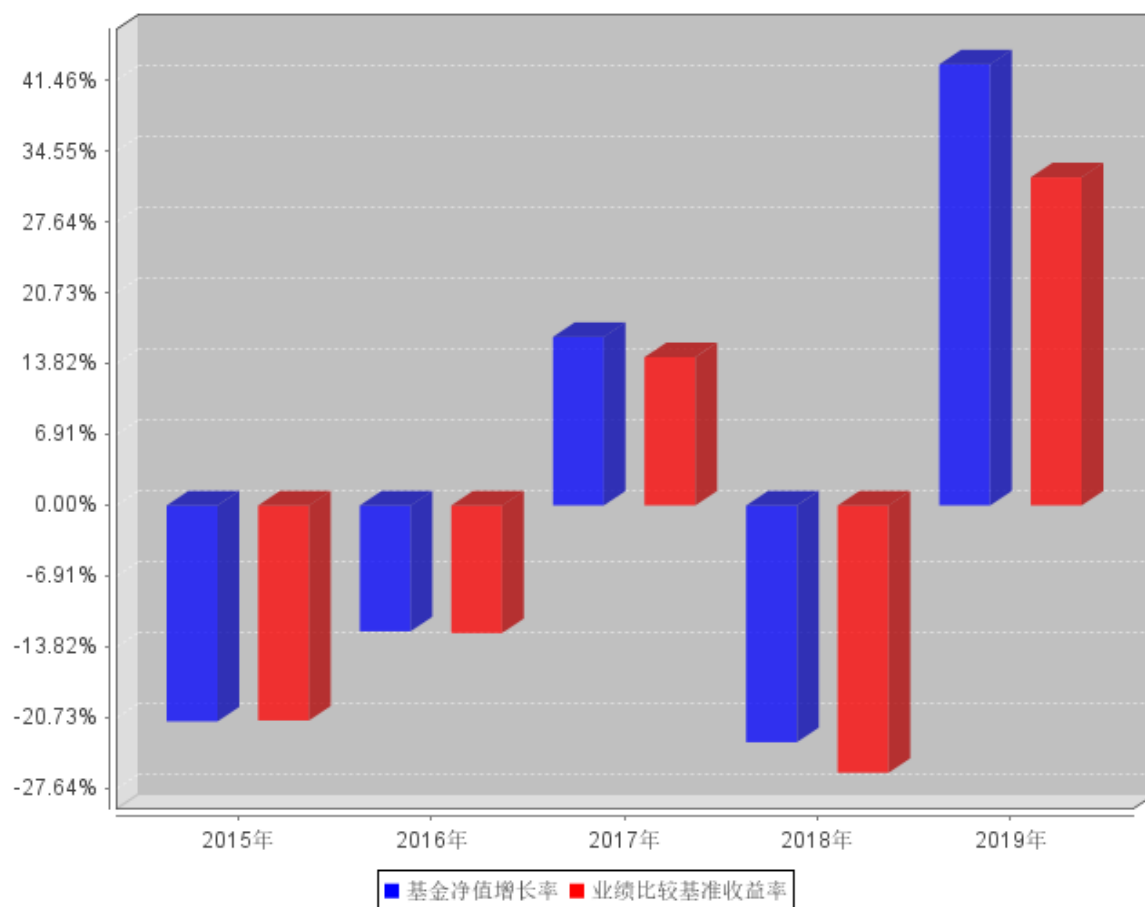


注：1、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为 2015 年 5 月 22 日。

2、按照本基金合同规定，本基金将在基金合同生效 3 个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。截止本报告期末本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，转型日（即基金合同生效日）为 2015 年 5 月 22 日。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2019	1.2760	30,494,008.87	116,175.31	30,610,184.18	
2018	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	
合计	1.2760	30,494,008.87	116,175.31	30,610,184.18	

§ 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，是国内最早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。截至 2019 年 12 月 31 日，基金管理人共管理六十只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

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，长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理。	2019 年 5 月 30 日	-	11 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”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基

金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。具体如下：

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

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

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

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司对该基金过去 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易

成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年一季度在流动性宽松以及 A 股市场整体估值处于历史低位的背景下，以社会融资数据大幅提升为契机，市场在短时间内快速上涨，完成风险溢价的修复。其后三个季度在中美贸易冲突加剧后又趋于缓和、以及对同业刚兑被打破的担忧下后又经历央行通过 LPR 机制变革呵护流动性，A 股市场先快速下跌后有一定的反弹，整体上呈现区间震荡行情，内部风格和行业板块有明显的轮换。投资者整体的风险偏好经历了快速上升至快速下降又逐渐修复的过程；体现在风格上，超额收益贡献主要来源由一季度的小盘成长股切换为二季度的大盘价值股，其后三四季度以创业板龙头为代表的中小盘成长股领先上涨。行业板块上，除了汽车行业外，中大盘蓝筹消费股全年稳健上涨，风险调整后收益率较佳；代表高科技发展方向和进口替代的电子元器件、计算机软件自三季度起继续保持上涨势头，持续受益于国家政策对该类行业自主发展的重视和市场的乐观预期；医药行业先扬后抑，三季度受益于自主研发创新和进口替代政策导向，但四季度受制于医保降价控费政策落地。

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 1.450 元；本报告期基金份额净值增长率为 43.02%，业绩比较基准收益率为 32.00%。本报告期内日均跟踪误差为 0.1260%，年度化跟踪误差为 1.9924%。

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 2020 年，随着财政政策的支持尤其是地方专项债的发行，实体经济增速有望在年中筑底回升。在去年底至今年初的期间内，在贸易战缓和、美联储降息以及国内央行降准的大环境下，国内的风险偏好和风险溢价有望得到进一步的修复，对股市的估值起到支撑作用。在鼓励国产替代和自主创新的大环境下，以半导体芯片为代表的高科技行业的增速预计继续超越传统行业，同时新能源汽车产业链有望在 2020 年大幅提升国际竞争力，逐步走向成熟。RCEP 预计在 2020 年签订，也将对 A 股上市公司的业绩增长提供了助力和友好的大环境。值得注意的是 2020 年二季度后的国际政治环境有潜在风险，中美贸易协定第一阶段的执行情况的回溯和美国大选初选后，美国国内矛盾可能后进一步向外转移释放，对压低包括原油在内的物价水平的供给侧和国际贸易流通存在不利因素，届时通胀有快速抬头的潜在风险，可能对市场的风险偏好和估值水平有明显的

压制作用，需要投资者保持密切关注。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

1、强调合规宣导与培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种形式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，深化员工合规理念，提高员工合规意识，改善员工合规工作技能，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、持续推动公司完善制度规章建设，扎实公司内控制度基础。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时督促业务部门调整相关业务制度与流程，保证公司制度规章的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司新订或修订了《公司信息披露管理规则》《公司信息披露管理流程》《公司转融通业务及风险管理办法》《营销策划中心舆情管理及媒体危机处理规定》《关于参加股东大会和对外行使表决权的工作指引》《公司公平交易细则》《长盛基金管理有限公司风险控制制度》《交易部可转换公司债券网下申购业务操作细则》《交易部上交所固定收益平台债券交易细则》《交易部深交所综合协议平台债券交易细则》《交易部网下新股申购业务管理细则》等多部制度或流程。

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

4、加强专项稽核与检查，严肃制度规章执行力，合理保障公司运营及受托资产投资运作合规。报告期内，公司监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核四十余项，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、产品开发、员工行为等。此外，根据业务发展需要、监管机构通报的业内问题，以及公司在日常监督中发现的问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，合理保障公司及受托资产合规、稳健运作。

5、积极参与新产品设计、新业务拓展工作，提供合规意见或建议。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断提

高内部监察工作的科学性和有效性, 努力防范各种风险, 保障公司、受托资产合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

4.7.1 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定, 本基金于 2019 年 6 月 20 日进行了利润分配, 分配金额为 13,449,247.16 元; 于 2019 年 9 月 11 日进行了利润分配, 分配金额为 17,160,937.02 元。

本基金截至截至 2019 年 12 月 31 日, 期末可供分配利润为 97,386,589.13 元, 其中, 未分配利润已实现部分为 217,948,753.15 元, 未分配利润未实现部分为-120,562,164.02 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

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金于 2019 年 6 月 20 日进行了利润分配,分配金额为 13,449,247.16 元;于 2019 年 9 月 11 日进行了利润分配,分配金额为 17,160,937.02 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第 22836 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)(以下简称“长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于长盛同庆中证 800 指数基金(LOF),并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)的基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督长盛同庆中证 800 指数基金(LOF)的财

	务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF) 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛同庆中证 800 指数基金 (LOF) 不能持续经营。 (五) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的

	内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛 竞	叶 尔 甸
会计师事务所的地址	中国 · 上海市	
审计报告日期	2020 年 4 月 17 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	24,513,502.70	11,659,812.87
结算备付金		104,322.01	-
存出保证金		30,727.63	3,241.89
交易性金融资产	7.4.7.2	346,962,131.59	98,320,603.44
其中：股票投资		346,962,131.59	98,302,594.54
基金投资		-	-
债券投资		-	18,008.90
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	6,086.69	2,306.85
应收股利		-	-
应收申购款		15,328.21	634.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		371,632,098.83	109,986,599.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		29,589.46	6,168.14
应付管理人报酬		311,626.00	94,979.88
应付托管费		68,557.71	20,895.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	37,273.21	4,601.84
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,287,648.28	1,437,557.85
负债合计		1,734,694.66	1,564,203.27
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	272,510,815.04	104,169,534.71
未分配利润	7.4.7.10	97,386,589.13	4,252,861.92
所有者权益合计		369,897,404.17	108,422,396.63
负债和所有者权益总计		371,632,098.83	109,986,599.90

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.450 元，基金份额总额 255,127,274.93 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		82,614,308.93	-30,967,421.08
1.利息收入		161,920.06	85,082.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	161,867.80	84,978.21
债券利息收入		52.26	104.64
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）		31,452,521.47	208,109.16
其中：股票投资收益	7.4.7.12	25,494,459.94	-2,224,616.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	37,806.04	28,151.40
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	5,920,255.49	2,404,574.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	50,942,533.45	-31,270,166.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	57,333.95	9,553.89
减：二、费用		3,968,059.68	2,035,458.88
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,642,608.43	1,304,878.76

2. 托管费	7.4.10.2.2	581,373.90	287,073.35
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	498,660.78	51,011.28
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.02	-
7. 其他费用	7.4.7.20	245,416.55	392,495.49
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		78,646,249.25	-33,002,879.96
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		78,646,249.25	-33,002,879.96

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	104,169,534.71	4,252,861.92	108,422,396.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	78,646,249.25	78,646,249.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	168,341,280.33	45,097,662.14	213,438,942.47
其中: 1. 基金申购款	199,337,831.43	54,702,134.56	254,039,965.99
2. 基金赎回款	-30,996,551.10	-9,604,472.42	-40,601,023.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-30,610,184.18	-30,610,184.18
五、期末所有者权益 (基金净值)	272,510,815.04	97,386,589.13	369,897,404.17
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基	111,143,123.68	39,339,222.22	150,482,345.90

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-33,002,879.96	-33,002,879.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-6,973,588.97	-2,083,480.34	-9,057,069.31
其中：1. 基金申购款	1,237,102.58	158,077.23	1,395,179.81
2. 基金赎回款	-8,210,691.55	-2,241,557.57	-10,452,249.12
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	104,169,534.71	4,252,861.92	108,422,396.63

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>林培富</u>	<u>刁俊东</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

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

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

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

7.4.2 会计报表的编制基础

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

布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	24,513,502.70	11,659,812.87
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	24,513,502.70	11,659,812.87

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
----	-------------------------

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		304,084,319.41	346,962,131.59	42,877,812.18
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		304,084,319.41	346,962,131.59	42,877,812.18
项目		上年度末 2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		106,367,324.71	98,302,594.54	-8,064,730.17
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	18,000.00	18,008.90	8.90
	银行间市场	-	-	-
	合计	18,000.00	18,008.90	8.90
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		106,385,324.71	98,320,603.44	-8,064,721.27

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	6,025.99	2,304.12
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-

应收结算备付金利息	46.90	-
应收债券利息	-	1.23
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	13.80	1.50
合计	6,086.69	2,306.85

7.4.7.6 其他资产

注：无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	37,273.21	4,601.84
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	37,273.21	4,601.84

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	111.49	21.06
应付证券出借违约金	-	-
其他	607,536.79	607,536.79
预提费用	180,000.00	330,000.00
合计	1,287,648.28	1,437,557.85

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	97,526,920.54	104,169,534.71
本期申购	186,622,373.34	199,337,831.43
本期赎回(以“-”号填列)	-29,022,018.95	-30,996,551.10
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-

本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	255,127,274.93	272,510,815.04

注：1：申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

2：截至 2019 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 68,763,845.00 份(2018 年 12 月 31 日：81,652,696.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 186,363,429.93 份(2018 年 12 月 31 日：15,874,224.54 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	84,335,391.56	-80,082,529.64	4,252,861.92
本期利润	27,703,715.80	50,942,533.45	78,646,249.25
本期基金份额交易产生的变动数	136,519,829.97	-91,422,167.83	45,097,662.14
其中：基金申购款	161,419,038.73	-106,716,904.17	54,702,134.56
基金赎回款	-24,899,208.76	15,294,736.34	-9,604,472.42
本期已分配利润	-30,610,184.18	-	-30,610,184.18
本期末	217,948,753.15	-120,562,164.02	97,386,589.13

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
活期存款利息收入	153,933.03	84,850.95
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	3,010.61	80.60
其他	4,924.16	46.66
合计	161,867.80	84,978.21

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
卖出股票成交总额	86,616,557.34	20,887,414.32

减：卖出股票成本总额	61,122,097.40	23,112,030.62
买卖股票差价收入	25,494,459.94	-2,224,616.30

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	37,806.04	28,151.40
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	37,806.04	28,151.40

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	196,959.77	291,614.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	159,100.00	263,300.00
减：应收利息总额	53.73	162.90
买卖债券差价收入	37,806.04	28,151.40

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,920,255.49	2,404,574.06
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,920,255.49	2,404,574.06

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
1. 交易性金融资产	50,942,533.45	-31,270,166.98
——股票投资	50,942,542.35	-31,265,318.34
——债券投资	-8.90	-4,848.64
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	50,942,533.45	-31,270,166.98

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
基金赎回费收入	57,330.66	9,545.64
基金转换费收入	3.29	8.25
合计	57,333.95	9,553.89

注：1. 本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率为赎回金额的 0.50%，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，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
交易所市场交易费用	498,660.78	51,011.28
银行间市场交易费用	-	-
合计	498,660.78	51,011.28

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	270,000.00
证券出借违约金	-	-
深交所上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款费用	5,416.55	2,495.49
合计	245,416.55	392,495.49

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2020 年 3 月 24 日宣告 2020 年度第 1 次分红，向截至 2020 年 3 月 16 日止在本基金注册登记机构登记在册的全体持有人，基金份额按每 10 份基金份额派发红利 0.5960 元。

7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

注：无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,642,608.43	1,304,878.76
其中：支付销售机构的客户维护费	90,695.58	87,129.75

注：支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至 2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	581,373.90	287,073.35

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：无。

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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	24,513,502.70	153,933.03	11,659,812.87	84,850.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2019 年 9 月 11 日	2019 年 9 月 12 日	2019 年 9 月 11 日	0.6640	17,097,227.04	63,709.98	17,160,937.02	
2	2019 年 6 月 20 日	2019 年 6 月 21 日	2019 年 6 月 20 日	0.6120	13,396,781.83	52,465.33	13,449,247.16	
合计	-	-	-	1.2760	30,494,008.87	116,175.31	30,610,184.18	

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601658	邮储银行	2019 年 12 月 2 日	2020 年 6 月 10 日	新股流通受限	5.50	5.72	265,526	1,460,393.00	1,518,808.72	-
688001	华兴源创	2019 年 7 月 1 日	2020 年 1 月 22 日	新股流通受限	24.26	41.46	21,494	521,444.44	891,141.24	-
688099	晶晨	2019 年 7 月	2020 年 2 月	新股流	38.50	52.25	15,597	600,484.50	814,943.25	-

	股份	月 31 日	月 10 日	通受限						
688363	华熙生物	2019 年 10 月 28 日	2020 年 5 月 6 日	新股流通受限	47.79	79.20	9,800	468,342.00	776,160.00	-
688166	博瑞医药	2019 年 10 月 29 日	2020 年 5 月 8 日	新股流通受限	12.71	30.03	8,041	102,201.11	241,471.23	-
688268	华特气体	2019 年 12 月 19 日	2020 年 6 月 29 日	新股流通受限	22.16	42.16	5,216	115,586.56	219,906.56	-
688181	八亿时空	2019 年 12 月 27 日	2020 年 7 月 5 日	新股流通受限	43.98	43.98	4,306	189,377.88	189,377.88	-
002466	天齐锂业	2019 年 11 月 26 日	2020 年 1 月 3 日	配股未上市	8.75	30.18	5,206	45,552.50	157,117.08	-
688288	鸿泉物联	2019 年 10 月 29 日	2020 年 5 月 6 日	新股流通受限	24.99	28.80	3,429	85,690.71	98,755.20	-
688081	兴图新科	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 6 日	新股未上市	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

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。

2、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

603799	华友钴业	2019 年 12 月 31 日	重要事项未公告	39.39	2020 年 1 月 2 日	40.43	12,490	280,947.56	491,981.10	-
--------	------	------------------	---------	-------	----------------	-------	--------	------------	------------	---

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金无债券投资(2018 年 12 月 31 日: 本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.02%)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有流动性受限的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 2019 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2019 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	24,513,502.70	-	-	-	24,513,502.70
结算备付金	104,322.01	-	-	-	104,322.01
存出保证金	30,727.63	-	-	-	30,727.63
交易性金融资产	-	-	-	346,962,131.59	346,962,131.59
应收利息	-	-	-	6,086.69	6,086.69
应收申购款	-	-	-	15,328.21	15,328.21
资产总计	24,648,552.34	-	-	346,983,546.49	371,632,098.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,589.46	29,589.46
应付管理人报酬	-	-	-	311,626.00	311,626.00
应付托管费	-	-	-	68,557.71	68,557.71
应付交易费用	-	-	-	37,273.21	37,273.21
其他负债	-	-	-	1,287,648.28	1,287,648.28
负债总计	-	-	-	1,734,694.66	1,734,694.66
利率敏感度缺口	24,648,552.34	-	-	345,248,851.83	369,897,404.17
上年度末 2018 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	11,659,812.87	-	-	-	11,659,812.87
存出保证金	3,241.89	-	-	-	3,241.89
交易性金融资产	-	-	18,008.90	98,302,594.54	98,320,603.44
应收利息	-	-	-	2,306.85	2,306.85
应收申购款	-	-	-	634.85	634.85
资产总计	11,663,054.76	-	18,008.90	98,305,536.24	109,986,599.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,168.14	6,168.14
应付管理人报酬	-	-	-	94,979.88	94,979.88
应付托管费	-	-	-	20,895.56	20,895.56
应付交易费用	-	-	-	4,601.84	4,601.84

其他负债	-	-	-	1,437,557.85	1,437,557.85
负债总计	-	-	-	1,564,203.27	1,564,203.27
利率敏感度缺口	11,663,054.76	-	18,008.90	96,741,332.97	108,422,396.63

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资 (2018 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2018 年 12 月 31 日：同)

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0—3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2019 年 12 月 31 日		2018 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	346,962,131.59	93.80	98,302,594.54	90.67
合计	346,962,131.59	93.80	98,302,594.54	90.67

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2019 年 12 月 31 日)	上年度末(2018 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	17,596,901.72	5,404,491.09
	2. 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-17,596,901.72	-5,404,491.09

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 341,466,945.16 元,属于第二层次的余额为 5,495,186.43 元,无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日:属于第一层次的余额为 96,778,678.35 元,属于第二层次的余额为 1,333,415.21 元,属于第三层次的余额为 208,509.88 元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下:

	交易性金融资产		
	债券投资	权益工具投资	合计
2019 年 1 月 1 日		208,509.88	208,509.88
购买	-	-	-
出售	-	-182,821.20	-182,821.20
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-98,786.48	-98,786.48
当期利得或损失总额	-	73,097.80	73,097.80
计入损益的利得或损失	-	73,097.80	73,097.80
2019 年 12 月 31 日	-	-	-

2019 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2019 年年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益

	交易性金融资产		
	债券投资	权益工具投资	合计
2018 年 1 月 1 日		83,674.00	83,674.00
购买	-	-	-
出售	-	-97,571.50	-97,571.50
转入第三层次	-	208,509.88	208,509.88
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	13,897.50	13,897.50
计入损益的利得或损失	-	13,897.50	13,897.50
2018 年 12 月 31 日	-	208,509.88	208,509.88

2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2018 年年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益

-230,581.27 -230,581.27

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下:

	2018 年 12 月 31 日公允价值	估值技术	名称	不可观察输入值	
				范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资	208,509.88	市场法	市净率	1.2-2.6	正向

产—股票投资	流动性折扣	26%-30%	反向
--------	-------	---------	----

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	346,962,131.59	93.36
	其中：股票	346,962,131.59	93.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	24,617,824.71	6.62
8	其他各项资产	52,142.53	0.01
9	合计	371,632,098.83	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,832,625.60	0.50
B	采矿业	9,793,649.72	2.65
C	制造业	149,414,477.79	40.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,031,193.01	2.17
E	建筑业	8,173,085.87	2.21
F	批发和零售业	6,517,844.91	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	9,080,875.25	2.46
H	住宿和餐饮业	136,027.98	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,972,190.80	3.51
J	金融业	101,174,415.34	27.35
K	房地产业	17,906,387.47	4.84
L	租赁和商务服务业	4,230,511.66	1.14
M	科学研究和技术服务业	159,954.64	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	638,502.60	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	1,985,089.00	0.54
R	文化、体育和娱乐业	1,614,835.63	0.44
S	综合	1,038,828.48	0.28
	合计	334,700,495.75	90.49

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	354,343.39	0.10
B	采矿业	251,530.05	0.07
C	制造业	7,083,860.73	1.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	307,787.50	0.08
F	批发和零售业	405,748.50	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	122,189.76	0.03
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,472,741.21	0.40
J	金融业	1,518,808.72	0.41
K	房地产业	380,368.77	0.10
L	租赁和商务服务业	128,216.24	0.04
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	138,792.72	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	97,248.25	0.03
S	综合	—	—
	合计	12,261,635.84	3.32

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	252,987	21,620,269.02	5.84
2	600519	贵州茅台	13,003	15,382,549.00	4.16
3	600036	招商银行	240,416	9,034,833.28	2.44
4	000651	格力电器	121,523	7,969,478.34	2.15

5	601166	兴业银行	311,271	6,163,165.80	1.67
6	000858	五 粮 液	45,598	6,064,989.98	1.64
7	600276	恒瑞医药	64,440	5,639,788.80	1.52
8	000002	万 科 A	174,954	5,630,019.72	1.52
9	600030	中信证券	185,134	4,683,890.20	1.27
10	601398	工商银行	770,112	4,528,258.56	1.22
11	600887	伊利股份	141,234	4,369,779.96	1.18
12	600016	民生银行	641,995	4,050,988.45	1.10
13	000333	美的集团	65,638	3,823,413.50	1.03
14	601328	交通银行	637,870	3,591,208.10	0.97
15	601288	农业银行	888,467	3,278,443.23	0.89
16	600000	浦发银行	260,025	3,216,509.25	0.87
17	002415	海康威视	90,091	2,949,579.34	0.80
18	600837	海通证券	189,449	2,928,881.54	0.79
19	600900	长江电力	156,320	2,873,161.60	0.78
20	601601	中国太保	74,540	2,820,593.60	0.76
21	600048	保利地产	170,324	2,755,842.32	0.75
22	601668	中国建筑	481,399	2,705,462.38	0.73
23	600585	海螺水泥	48,215	2,642,182.00	0.71
24	601211	国泰君安	139,000	2,570,110.00	0.69
25	000725	京东方 A	564,007	2,560,591.78	0.69
26	002475	立讯精密	61,472	2,243,728.00	0.61
27	000001	平安银行	135,979	2,236,854.55	0.60
28	601888	中国国旅	24,512	2,180,342.40	0.59
29	601169	北京银行	367,994	2,090,205.92	0.57
30	000063	中兴通讯	58,162	2,058,353.18	0.56
31	600009	上海机场	24,504	1,929,690.00	0.52
32	600309	万华化学	34,079	1,914,217.43	0.52
33	600104	上汽集团	79,866	1,904,804.10	0.51
34	603288	海天味业	17,600	1,892,176.00	0.51
35	000338	潍柴动力	117,906	1,872,347.28	0.51
36	000661	长春高新	4,184	1,870,248.00	0.51
37	601988	中国银行	499,338	1,842,557.22	0.50
38	002714	牧原股份	20,640	1,832,625.60	0.50
39	600690	海尔智家	93,272	1,818,804.00	0.49
40	002304	洋河股份	15,895	1,756,397.50	0.47
41	002142	宁波银行	60,224	1,695,305.60	0.46
42	601818	光大银行	377,296	1,663,875.36	0.45
43	600383	金地集团	112,362	1,629,249.00	0.44

44	601688	华泰证券	79,191	1,608,369.21	0.43
45	600031	三一重工	90,629	1,545,224.45	0.42
46	601766	中国中车	214,187	1,529,295.18	0.41
47	601229	上海银行	156,860	1,488,601.40	0.40
48	300059	东方财富	90,964	1,434,502.28	0.39
49	601628	中国人寿	40,247	1,403,412.89	0.38
50	600050	中国联通	232,572	1,369,849.08	0.37
51	600570	恒生电子	16,849	1,309,672.77	0.35
52	600999	招商证券	70,269	1,285,220.01	0.35
53	600028	中国石化	248,896	1,271,858.56	0.34
54	601989	中国重工	242,526	1,270,836.24	0.34
55	000568	泸州老窖	14,354	1,244,204.72	0.34
56	000538	云南白药	13,911	1,244,060.73	0.34
57	600019	宝钢股份	215,559	1,237,308.66	0.33
58	002230	科大讯飞	34,050	1,174,044.00	0.32
59	600015	华夏银行	153,063	1,173,993.21	0.32
60	601006	大秦铁路	142,728	1,171,796.88	0.32
61	001979	招商蛇口	58,236	1,157,149.32	0.31
62	000776	广发证券	72,277	1,096,442.09	0.30
63	600919	江苏银行	151,300	1,095,412.00	0.30
64	601390	中国中铁	178,999	1,063,254.06	0.29
65	601899	紫金矿业	229,327	1,052,610.93	0.28
66	300015	爱尔眼科	26,560	1,050,713.60	0.28
67	601009	南京银行	119,801	1,050,654.77	0.28
68	002027	分众传媒	165,100	1,033,526.00	0.28
69	000876	新希望	50,912	1,015,694.40	0.27
70	601012	隆基股份	40,041	994,218.03	0.27
71	000100	TCL 集团	218,915	978,550.05	0.26
72	601336	新华保险	19,859	976,069.85	0.26
73	600436	片仔癀	8,845	971,800.15	0.26
74	601088	中国神华	52,596	959,877.00	0.26
75	600703	三安光电	51,758	950,276.88	0.26
76	002024	苏宁易购	90,282	912,751.02	0.25
77	600588	用友网络	32,076	910,958.40	0.25
78	002241	歌尔股份	45,454	905,443.68	0.24
79	601225	陕西煤业	99,392	893,534.08	0.24
80	601901	方正证券	102,104	885,241.68	0.24
81	600547	山东黄金	26,324	858,688.88	0.23
82	600406	国电南瑞	40,135	850,059.30	0.23

83	300142	沃森生物	26,100	846,684.00	0.23
84	002008	大族激光	21,121	844,840.00	0.23
85	600660	福耀玻璃	34,398	825,208.02	0.22
86	600741	华域汽车	31,233	811,745.67	0.22
87	601377	兴业证券	114,402	809,966.16	0.22
88	601186	中国铁建	79,351	804,619.14	0.22
89	600352	浙江龙盛	54,762	792,406.14	0.21
90	000166	申万宏源	151,251	774,405.12	0.21
91	300003	乐普医疗	23,100	764,148.00	0.21
92	600196	复星医药	28,574	760,068.40	0.21
93	300136	信维通信	16,700	757,846.00	0.20
94	002594	比亚迪	15,884	757,190.28	0.20
95	002736	国信证券	60,100	754,255.00	0.20
96	601933	永辉超市	99,425	749,664.50	0.20
97	002044	美年健康	50,000	744,500.00	0.20
98	600886	国投电力	80,978	743,378.04	0.20
99	000066	中国长城	47,285	735,754.60	0.20
100	000895	双汇发展	25,137	729,727.11	0.20
101	002202	金风科技	60,161	718,923.95	0.19
102	300124	汇川技术	23,235	711,920.40	0.19
103	002236	大华股份	35,565	707,032.20	0.19
104	002456	欧菲光	45,255	705,978.00	0.19
105	000157	中联重科	104,635	698,961.80	0.19
106	600795	国电电力	296,853	694,636.02	0.19
107	600958	东方证券	64,400	692,944.00	0.19
108	601857	中国石油	117,431	684,622.73	0.19
109	002466	天齐锂业	22,061	665,800.98	0.18
110	600340	华夏幸福	23,022	660,731.40	0.18
111	600809	山西汾酒	7,353	659,564.10	0.18
112	000938	紫光股份	20,444	646,030.40	0.17
113	600271	航天信息	27,676	641,252.92	0.17
114	000069	华侨城 A	79,441	618,845.39	0.17
115	002007	华兰生物	17,577	617,831.55	0.17
116	000656	金科股份	79,871	613,409.28	0.17
117	300296	利亚德	79,800	612,066.00	0.17
118	600029	南方航空	84,182	604,426.76	0.16
119	601111	中国国航	62,124	601,981.56	0.16
120	600536	中国软件	8,386	601,192.34	0.16
121	002460	赣锋锂业	17,100	595,593.00	0.16

122	000963	华东医药	24,279	591,922.02	0.16
123	002311	海大集团	16,400	590,400.00	0.16
124	600584	长电科技	26,755	588,074.90	0.16
125	000783	长江证券	81,694	583,295.16	0.16
126	002410	广联达	16,741	568,859.18	0.15
127	000786	北新建材	22,224	565,600.80	0.15
128	002463	沪电股份	25,455	565,355.55	0.15
129	600426	华鲁恒升	28,438	565,063.06	0.15
130	600111	北方稀土	51,983	563,495.72	0.15
131	600183	生益科技	26,909	562,936.28	0.15
132	601985	中国核电	110,788	553,940.00	0.15
133	000425	徐工机械	100,754	551,124.38	0.15
134	000625	长安汽车	54,606	547,698.18	0.15
135	002179	中航光电	14,003	546,957.18	0.15
136	000596	古井贡酒	4,008	544,767.36	0.15
137	600673	东阳光	53,053	543,262.72	0.15
138	601607	上海医药	29,137	535,246.69	0.14
139	600201	生物股份	28,469	532,939.68	0.14
140	601611	中国核建	73,900	526,907.00	0.14
141	601919	中远海控	99,700	525,419.00	0.14
142	601877	正泰电器	19,582	524,797.60	0.14
143	600674	川投能源	53,218	524,197.30	0.14
144	300088	长信科技	50,720	520,894.40	0.14
145	601555	东吴证券	51,360	513,086.40	0.14
146	600705	中航资本	105,560	511,966.00	0.14
147	601600	中国铝业	144,172	510,368.88	0.14
148	600011	华能国际	91,100	508,338.00	0.14
149	600177	雅戈尔	72,784	507,304.48	0.14
150	600487	亨通光电	30,880	502,108.80	0.14
151	600332	白云山	14,100	502,101.00	0.14
152	600739	辽宁成大	32,512	495,157.76	0.13
153	300408	三环集团	22,100	492,388.00	0.13
154	603799	华友钴业	12,490	491,981.10	0.13
155	300122	智飞生物	9,800	486,668.00	0.13
156	000423	东阿阿胶	13,717	485,170.29	0.13
157	300144	宋城演艺	15,611	482,536.01	0.13
158	002465	海格通信	44,534	482,303.22	0.13
159	600089	特变电工	72,488	482,045.20	0.13
160	002353	杰瑞股份	13,038	481,884.48	0.13

161	002049	紫光国微	9,400	477,896.00	0.13
162	600115	东方航空	81,937	476,053.97	0.13
163	002439	启明星辰	14,000	473,200.00	0.13
164	600066	宇通客车	32,834	467,884.50	0.13
165	600801	华新水泥	17,643	466,304.49	0.13
166	002493	荣盛石化	37,100	459,669.00	0.12
167	601872	招商轮船	55,500	458,430.00	0.12
168	600516	方大炭素	37,651	457,836.16	0.12
169	002065	东华软件	44,272	456,887.04	0.12
170	002422	科伦药业	19,300	453,357.00	0.12
171	002129	中环股份	38,376	453,220.56	0.12
172	601998	中信银行	72,384	446,609.28	0.12
173	600018	上港集团	77,361	446,372.97	0.12
174	600161	天坛生物	15,810	441,731.40	0.12
175	002050	三花智控	25,406	440,285.98	0.12
176	600068	葛洲坝	64,754	432,556.72	0.12
177	000768	中航飞机	26,391	432,284.58	0.12
178	600061	国投资本	28,400	429,976.00	0.12
179	601727	上海电气	86,068	428,618.64	0.12
180	600637	东方明珠	45,257	423,605.52	0.11
181	600010	宝钢股份	320,716	423,345.12	0.11
182	600208	新湖中宝	111,887	422,932.86	0.11
183	600085	同仁堂	14,934	420,840.12	0.11
184	002371	北方华创	4,759	418,792.00	0.11
185	600109	国金证券	44,992	418,425.60	0.11
186	601669	中国电建	96,188	417,455.92	0.11
187	002508	老板电器	12,239	413,800.59	0.11
188	600100	同方股份	46,325	406,270.25	0.11
189	600606	绿地控股	58,100	403,795.00	0.11
190	603993	洛阳钼业	92,556	403,544.16	0.11
191	000623	吉林敖东	23,655	391,017.15	0.11
192	600583	海油工程	52,848	390,018.24	0.11
193	600867	通化东宝	30,800	389,620.00	0.11
194	002352	顺丰控股	10,400	386,776.00	0.10
195	000009	中国宝安	62,239	385,259.41	0.10
196	600023	浙能电力	96,661	382,777.56	0.10
197	300024	机器人	27,296	382,144.00	0.10
198	300253	卫宁健康	25,445	381,166.10	0.10
199	600176	中国巨石	34,664	377,837.60	0.10

200	601168	西部矿业	56,863	376,433.06	0.10
201	600893	航发动力	17,226	373,459.68	0.10
202	601788	光大证券	28,400	372,040.00	0.10
203	000630	铜陵有色	158,223	368,659.59	0.10
204	002153	石基信息	9,287	362,193.00	0.10
205	600498	烽火通信	13,145	360,830.25	0.10
206	600362	江西铜业	21,135	357,815.55	0.10
207	600369	西南证券	68,292	354,435.48	0.10
208	600535	天士力	22,962	354,074.04	0.10
209	600489	中金黄金	41,713	353,726.24	0.10
210	601018	宁波港	92,151	350,173.80	0.09
211	600298	安琪酵母	11,368	348,656.56	0.09
212	002081	金螳螂	39,442	347,878.44	0.09
213	600153	建发股份	38,564	346,690.36	0.09
214	300017	网宿科技	36,259	345,548.27	0.09
215	601800	中国交建	37,567	344,113.72	0.09
216	000671	阳光城	39,732	337,722.00	0.09
217	000999	华润三九	10,624	336,568.32	0.09
218	300315	掌趣科技	54,100	333,797.00	0.09
219	600143	金发科技	45,621	332,120.88	0.09
220	002273	水晶光电	20,493	331,166.88	0.09
221	000686	东北证券	35,482	329,982.60	0.09
222	600522	中天科技	39,598	328,663.40	0.09
223	000988	华工科技	16,191	328,515.39	0.09
224	600256	广汇能源	98,548	326,193.88	0.09
225	002797	第一创业	39,020	323,085.60	0.09
226	600118	中国卫星	15,096	322,601.52	0.09
227	601198	东兴证券	24,500	321,930.00	0.09
228	002146	荣盛发展	32,674	321,185.42	0.09
229	000513	丽珠集团	9,472	319,206.40	0.09
230	601618	中国中冶	113,806	318,656.80	0.09
231	600460	士兰微	20,261	313,437.67	0.08
232	000960	锡业股份	29,900	312,156.00	0.08
233	000401	冀东水泥	18,299	311,265.99	0.08
234	002078	太阳纸业	31,125	306,270.00	0.08
235	002384	东山精密	13,114	303,589.10	0.08
236	600549	厦门钨业	23,210	302,658.40	0.08
237	600079	人福医药	22,330	301,678.30	0.08
238	600895	张江高科	19,689	301,438.59	0.08

239	000975	银泰黄金	22,132	301,216.52	0.08
240	600338	西藏珠峰	23,980	299,750.00	0.08
241	600038	中直股份	6,275	299,380.25	0.08
242	002340	格林美	61,100	297,557.00	0.08
243	300070	碧水源	39,007	296,453.20	0.08
244	000750	国海证券	55,375	295,702.50	0.08
245	601021	春秋航空	6,700	294,063.00	0.08
246	002152	广电运通	30,550	293,585.50	0.08
247	002572	索菲亚	14,002	293,341.90	0.08
248	002268	卫 士 通	11,300	291,427.00	0.08
249	000878	云南铜业	21,300	290,958.00	0.08
250	000961	中南建设	27,575	290,916.25	0.08
251	300113	顺网科技	11,300	290,297.00	0.08
252	603000	人民网	14,630	289,527.70	0.08
253	000402	金 融 街	35,596	289,039.52	0.08
254	000413	东旭光电	85,100	285,936.00	0.08
255	002281	光迅科技	9,582	285,351.96	0.08
256	600170	上海建工	80,296	284,247.84	0.08
257	600989	宝丰能源	29,756	282,979.56	0.08
258	600643	爱建集团	29,061	278,985.60	0.08
259	000709	河钢股份	107,247	276,697.26	0.07
260	600718	东软集团	24,359	276,474.65	0.07
261	002013	中航机电	39,519	274,261.86	0.07
262	002223	鱼跃医疗	13,191	268,041.12	0.07
263	000830	鲁西化工	25,484	267,836.84	0.07
264	000997	新 大 陆	16,628	264,052.64	0.07
265	300251	光线传媒	22,314	263,305.20	0.07
266	002191	劲嘉股份	23,016	262,612.56	0.07
267	601633	长城汽车	29,625	262,181.25	0.07
268	002250	联化科技	15,146	259,450.98	0.07
269	601838	成都银行	28,533	258,794.31	0.07
270	600221	海航控股	147,808	255,707.84	0.07
271	600415	小商品城	65,273	252,606.51	0.07
272	000636	风华高科	16,936	252,177.04	0.07
273	601333	广深铁路	82,196	251,519.76	0.07
274	000547	航天发展	24,413	249,500.86	0.07
275	600655	豫园股份	31,610	247,822.40	0.07
276	002385	大北农	49,610	247,057.80	0.07
277	600816	安信信托	55,236	245,247.84	0.07

278	000983	西山煤电	39,850	244,280.50	0.07
279	600325	华发股份	30,836	241,445.88	0.07
280	600879	航天电子	40,048	239,487.04	0.06
281	000060	中金岭南	55,604	239,097.20	0.06
282	002500	山西证券	28,594	237,044.26	0.06
283	600511	国药股份	8,685	237,013.65	0.06
284	300027	华谊兄弟	50,495	233,791.85	0.06
285	000581	威孚高科	12,244	233,248.20	0.06
286	600260	凯乐科技	17,166	232,942.62	0.06
287	600171	上海贝岭	14,720	231,840.00	0.06
288	002368	太极股份	5,861	228,110.12	0.06
289	000021	深科技	18,463	224,879.34	0.06
290	600064	南京高科	22,794	222,241.50	0.06
291	000039	中集集团	22,591	221,843.62	0.06
292	600820	隧道股份	36,700	221,668.00	0.06
293	000970	中科三环	20,610	221,557.50	0.06
294	600266	城建发展	27,320	221,292.00	0.06
295	600060	海信视像	20,373	221,047.05	0.06
296	002038	双鹭药业	16,794	220,841.10	0.06
297	000778	新兴铸管	52,882	220,517.94	0.06
298	600388	龙净环保	22,500	219,375.00	0.06
299	600704	物产中大	41,715	219,003.75	0.06
300	600376	首开股份	27,409	218,449.73	0.06
301	600737	中粮糖业	25,800	218,268.00	0.06
302	600216	浙江医药	16,209	216,390.15	0.06
303	000703	恒逸石化	15,467	215,300.64	0.06
304	600026	中远海能	33,738	215,248.44	0.06
305	600808	马钢股份	70,000	214,900.00	0.06
306	002242	九阳股份	8,517	214,287.72	0.06
307	300115	长盈精密	11,993	213,355.47	0.06
308	002440	闰土股份	19,018	213,001.60	0.06
309	000031	大悦城	29,093	208,887.74	0.06
310	600755	厦门国贸	28,340	208,015.60	0.06
311	601216	君正集团	65,508	205,040.04	0.06
312	600563	法拉电子	4,138	204,624.10	0.06
313	600008	首创股份	61,996	203,966.84	0.06
314	002414	高德红外	9,633	202,293.00	0.05
315	600482	中国动力	10,090	201,800.00	0.05
316	000598	兴蓉环境	43,495	201,381.85	0.05

317	600863	内蒙华电	72,351	198,965.25	0.05
318	600158	中体产业	19,717	197,761.51	0.05
319	601866	中远海发	76,353	197,754.27	0.05
320	002131	利欧股份	66,403	197,216.91	0.05
321	300058	蓝色光标	34,551	195,213.15	0.05
322	600373	中文传媒	14,327	194,990.47	0.05
323	600649	城投控股	34,031	194,657.32	0.05
324	002399	海普瑞	9,901	193,168.51	0.05
325	600729	重庆百货	6,425	191,786.25	0.05
326	600580	卧龙电驱	15,948	191,694.96	0.05
327	600500	中化国际	36,110	191,383.00	0.05
328	002373	千方科技	10,600	191,224.00	0.05
329	000559	万向钱潮	35,556	190,935.72	0.05
330	600884	杉杉股份	14,128	190,869.28	0.05
331	000028	国药一致	4,203	190,648.08	0.05
332	600597	光明乳业	15,012	190,502.28	0.05
333	300244	迪安诊断	8,580	189,875.40	0.05
334	601958	金钼股份	23,652	189,452.52	0.05
335	002028	思源电气	13,717	188,883.09	0.05
336	000690	宝新能源	33,361	188,489.65	0.05
337	600410	华胜天成	18,196	187,600.76	0.05
338	600372	中航电子	13,150	187,256.00	0.05
339	600572	康恩贝	30,267	186,142.05	0.05
340	600138	中青旅	14,667	184,804.20	0.05
341	300072	三聚环保	29,089	183,842.48	0.05
342	000563	陕国投A	41,435	183,557.05	0.05
343	000712	锦龙股份	12,007	182,506.40	0.05
344	600967	内蒙一机	17,168	182,495.84	0.05
345	600021	上海电力	22,514	181,237.70	0.05
346	000877	天山股份	15,292	181,210.20	0.05
347	000027	深圳能源	29,141	180,965.61	0.05
348	002048	宁波华翔	11,598	179,305.08	0.05
349	002092	中泰化学	26,375	179,086.25	0.05
350	002004	华邦健康	36,247	179,060.18	0.05
351	000528	柳 工	25,768	178,829.92	0.05
352	002195	二三四五	55,343	178,757.89	0.05
353	600970	中材国际	25,643	178,731.71	0.05
354	300001	特锐德	10,400	178,672.00	0.05
355	002056	横店东磁	21,736	178,235.20	0.05

356	600648	外高桥	10,261	178,233.57	0.05
357	600120	浙江东方	20,406	178,144.38	0.05
358	600557	康缘药业	12,047	177,572.78	0.05
359	000930	中粮科技	26,838	177,130.80	0.05
360	000826	启迪环境	19,180	176,072.40	0.05
361	600062	华润双鹤	13,165	171,803.25	0.05
362	600827	百联股份	19,076	171,302.48	0.05
363	002266	浙富控股	41,465	170,835.80	0.05
364	002602	世纪华通	14,892	170,215.56	0.05
365	600804	鹏博士	27,812	170,209.44	0.05
366	002030	达安基因	14,778	169,947.00	0.05
367	600056	中国医药	12,962	169,154.10	0.05
368	000415	渤海租赁	44,199	167,956.20	0.05
369	601717	郑煤机	25,846	167,223.62	0.05
370	000012	南玻A	33,295	166,807.95	0.05
371	600528	中铁工业	14,476	166,474.00	0.05
372	600348	阳泉煤业	29,767	164,611.51	0.04
373	000400	许继电气	15,245	164,188.65	0.04
374	601236	红塔证券	9,789	164,161.53	0.04
375	600282	南钢股份	47,400	163,530.00	0.04
376	600392	盛和资源	17,891	162,271.37	0.04
377	002128	露天煤业	18,606	161,127.96	0.04
378	600166	福田汽车	77,056	161,047.04	0.04
379	600094	大名城	27,400	160,290.00	0.04
380	600645	中源协和	9,448	159,954.64	0.04
381	600717	天津港	25,340	159,135.20	0.04
382	300274	阳光电源	15,060	158,581.80	0.04
383	002221	东华能源	20,414	158,412.64	0.04
384	000887	中鼎股份	17,477	158,166.85	0.04
385	000738	航发控制	12,000	156,840.00	0.04
386	600435	北方导航	18,524	154,119.68	0.04
387	600037	歌华有线	17,100	154,071.00	0.04
388	601880	大连港	75,331	152,921.93	0.04
389	600664	哈药股份	40,083	151,914.57	0.04
390	600259	广晟有色	4,366	151,805.82	0.04
391	600811	东方集团	45,108	151,562.88	0.04
392	000685	中山公用	18,385	151,492.40	0.04
393	002701	奥瑞金	34,244	151,016.04	0.04
394	600859	王府井	10,754	150,448.46	0.04

395	002603	以岭药业	12,000	149,160.00	0.04
396	601928	凤凰传媒	19,590	149,079.90	0.04
397	000078	海王生物	39,920	148,901.60	0.04
398	002074	国轩高科	10,100	146,955.00	0.04
399	600835	上海机电	8,868	146,942.76	0.04
400	600633	浙数文化	16,042	146,784.30	0.04
401	600409	三友化工	23,099	145,985.68	0.04
402	000727	华东科技	69,400	145,046.00	0.04
403	600039	四川路桥	43,091	144,785.76	0.04
404	600316	洪都航空	11,059	144,098.77	0.04
405	601000	唐山港	54,623	142,019.80	0.04
406	600881	亚泰集团	44,131	140,777.89	0.04
407	600787	中储股份	26,986	140,597.06	0.04
408	002155	湖南黄金	17,800	140,442.00	0.04
409	000006	深振业 A	26,070	139,735.20	0.04
410	601678	滨化股份	27,334	139,676.74	0.04
411	002051	中工国际	14,294	138,937.68	0.04
412	600754	锦江酒店	4,738	136,027.98	0.04
413	600640	号百控股	5,237	135,166.97	0.04
414	600125	铁龙物流	22,346	133,629.08	0.04
415	600565	迪马股份	36,700	131,386.00	0.04
416	600098	广州发展	20,000	130,800.00	0.04
417	002183	怡 亚 通	30,900	130,089.00	0.04
418	600073	上海梅林	16,300	129,911.00	0.04
419	600017	日照港	44,523	129,561.93	0.04
420	600759	洲际油气	46,679	129,300.83	0.03
421	601608	中信重工	34,611	128,752.92	0.03
422	002444	巨星科技	11,969	128,547.06	0.03
423	002408	齐翔腾达	17,929	128,192.35	0.03
424	300026	红日药业	36,400	127,764.00	0.03
425	600582	天地科技	39,400	125,686.00	0.03
426	000758	中色股份	28,676	125,600.88	0.03
427	300010	立思辰	9,700	125,227.00	0.03
428	000156	华数传媒	11,892	124,152.48	0.03
429	600499	科达洁能	28,666	124,123.78	0.03
430	600694	大商股份	4,490	122,981.10	0.03
431	000090	天健集团	23,031	122,064.30	0.03
432	600188	兖州煤业	11,445	120,859.20	0.03
433	000543	皖能电力	25,988	120,584.32	0.03

434	601718	际华集团	36,943	120,434.18	0.03
435	000848	承德露露	15,201	119,631.87	0.03
436	000062	深圳华强	8,097	115,301.28	0.03
437	600545	卓郎智能	18,400	111,688.00	0.03
438	600312	平高电气	17,238	111,357.48	0.03
439	600160	巨化股份	15,269	111,158.32	0.03
440	002470	金正大	41,716	110,964.56	0.03
441	600770	综艺股份	20,465	110,306.35	0.03
442	002317	众生药业	8,482	107,721.40	0.03
443	002573	清新环境	16,628	107,250.60	0.03
444	002118	紫鑫药业	17,000	106,080.00	0.03
445	600195	中牧股份	9,067	104,723.85	0.03
446	600478	科力远	23,678	104,183.20	0.03
447	603766	隆鑫通用	27,588	102,903.24	0.03
448	002002	鸿达兴业	24,159	100,501.44	0.03
449	000501	鄂武商 A	7,517	99,825.76	0.03
450	002064	华峰氨纶	15,622	97,637.50	0.03
451	300133	华策影视	13,165	97,421.00	0.03
452	300134	大富科技	6,316	97,392.72	0.03
453	002665	首航高科	28,758	96,626.88	0.03
454	300002	神州泰岳	29,135	94,980.10	0.03
455	002672	东江环保	10,345	93,105.00	0.03
456	600765	中航重机	8,799	90,013.77	0.02
457	600466	蓝光发展	11,980	88,292.60	0.02
458	000718	苏宁环球	23,049	88,047.18	0.02
459	000600	建投能源	17,786	86,973.54	0.02
460	000061	农产品	15,380	85,974.20	0.02
461	600748	上实发展	14,462	85,904.28	0.02
462	002635	安洁科技	5,097	84,966.99	0.02
463	002233	塔牌集团	6,713	84,583.80	0.02
464	002244	滨江集团	17,064	83,954.88	0.02
465	002589	瑞康医药	10,582	81,375.58	0.02
466	600277	亿利洁能	17,200	78,432.00	0.02
467	600141	兴发集团	7,438	76,462.64	0.02
468	000519	中兵红箭	9,805	74,714.10	0.02
469	600639	浦东金桥	5,496	74,196.00	0.02
470	002426	胜利精密	31,100	73,396.00	0.02
471	300257	开山股份	6,600	71,808.00	0.02
472	002375	亚厦股份	12,193	70,719.40	0.02

473	000937	冀中能源	19,287	70,590.42	0.02
474	603328	依顿电子	6,234	70,568.88	0.02
475	600757	长江传媒	11,292	69,558.72	0.02
476	601001	大同煤业	15,757	69,330.80	0.02
477	600058	五矿发展	8,554	68,603.08	0.02
478	600874	创业环保	9,453	67,967.07	0.02
479	600006	东风汽车	14,818	67,866.44	0.02
480	002390	信邦制药	12,857	67,499.25	0.02
481	002093	国脉科技	8,342	67,236.52	0.02
482	000158	常山北明	9,800	66,836.00	0.02
483	600329	中新药业	4,458	61,787.88	0.02
484	600657	信达地产	15,467	61,713.33	0.02
485	603568	伟明环保	2,560	58,726.40	0.02
486	002505	大康农业	33,016	57,778.00	0.02
487	600428	中远海特	15,400	57,596.00	0.02
488	002681	奋达科技	10,195	56,888.10	0.02
489	600959	江苏有线	14,060	55,958.80	0.02
490	002285	世联行	14,895	55,856.25	0.02
491	600869	智慧能源	11,334	55,536.60	0.02
492	002640	跨境通	7,100	54,812.00	0.01
493	600022	山东钢铁	37,930	54,239.90	0.01
494	000426	兴业矿业	10,900	54,173.00	0.01
495	000008	神州高铁	14,900	54,087.00	0.01
496	002482	广田集团	11,650	51,027.00	0.01
497	300199	翰宇药业	8,300	48,140.00	0.01
498	002358	森源电气	6,876	48,063.24	0.01
499	002366	台海核电	6,600	45,936.00	0.01
500	002437	誉衡药业	14,276	43,256.28	0.01
501	002249	大洋电机	10,600	40,916.00	0.01
502	002503	搜于特	13,792	32,962.88	0.01
503	600335	国机汽车	5,618	32,584.40	0.01
504	603198	迎驾贡酒	1,600	31,872.00	0.01
505	600917	重庆燃气	3,201	23,239.26	0.01
506	601016	节能风电	6,100	14,701.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净
----	------	------	--------	------	--------

					值比例 (%)
1	601658	邮储银行	265,526	1,518,808.72	0.41
2	688001	华兴源创	21,494	891,141.24	0.24
3	688099	晶晨股份	15,597	814,943.25	0.22
4	688363	华熙生物	9,800	776,160.00	0.21
5	000860	顺鑫农业	13,411	706,491.48	0.19
6	300673	佩蒂股份	19,100	532,699.00	0.14
7	600600	青岛啤酒	7,950	405,450.00	0.11
8	000503	国新健康	21,076	360,821.12	0.10
9	300146	汤臣倍健	18,286	297,878.94	0.08
10	002299	圣农发展	12,101	291,392.08	0.08
11	688166	博瑞医药	8,041	241,471.23	0.07
12	000839	中信国安	67,915	240,419.10	0.06
13	688268	华特气体	5,216	219,906.56	0.06
14	600688	上海石化	52,751	204,146.37	0.06
15	600872	中炬高新	4,956	195,018.60	0.05
16	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.05
17	000049	德赛电池	4,303	175,304.22	0.05
18	600525	长园集团	27,759	164,610.87	0.04
19	002310	东方园林	31,050	155,871.00	0.04
20	600267	海正药业	15,717	155,755.47	0.04
21	600993	马应龙	8,403	146,968.47	0.04
22	000667	美好置业	49,830	136,035.90	0.04
23	300266	兴源环境	37,668	132,214.68	0.04
24	600503	华丽家族	40,400	128,472.00	0.03
25	600611	大众交通	30,096	122,189.76	0.03
26	002254	泰和新材	11,488	120,049.60	0.03
27	600157	永泰能源	83,891	119,964.13	0.03
28	600151	航天机电	24,881	117,935.94	0.03
29	600750	江中药业	8,730	109,386.90	0.03
30	601311	骆驼股份	11,042	103,573.96	0.03
31	688288	鸿泉物联	3,429	98,755.20	0.03
32	002332	仙琚制药	9,948	98,186.76	0.03
33	002276	万马股份	10,749	89,324.19	0.02
34	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.02
35	600366	宁波韵升	13,104	87,272.64	0.02
36	002489	浙江永强	20,580	86,230.20	0.02
37	002400	省广集团	24,764	81,721.20	0.02
38	300055	万邦达	11,800	78,706.00	0.02

39	002955	鸿合科技	1,308	77,839.08	0.02
40	000829	天音控股	12,264	76,895.28	0.02
41	000926	福星股份	11,250	73,125.00	0.02
42	600169	太原重工	29,888	69,639.04	0.02
43	600971	恒源煤电	11,360	67,932.80	0.02
44	600416	湘电股份	9,457	67,522.98	0.02
45	000969	安泰科技	9,582	63,816.12	0.02
46	000552	靖远煤电	24,664	63,633.12	0.02
47	002041	登海种业	6,537	62,951.31	0.02
48	300202	聚龙股份	5,396	60,165.40	0.02
49	600594	益佰制药	11,700	58,266.00	0.02
50	000541	佛山照明	11,810	57,869.00	0.02
51	000612	焦作万方	13,301	57,460.32	0.02
52	002251	步步高	6,159	56,046.90	0.02
53	002277	友阿股份	16,428	54,376.68	0.01
54	600458	时代新材	7,600	53,580.00	0.01
55	002699	美盛文化	7,875	53,156.25	0.01
56	002308	威创股份	10,900	50,358.00	0.01
57	002344	海宁皮城	10,664	46,495.04	0.01
58	300291	华录百纳	7,300	44,092.00	0.01
59	002663	普邦股份	14,700	42,924.00	0.01
60	600122	宏图高科	16,157	42,816.05	0.01
61	600743	华远地产	17,163	42,735.87	0.01
62	300287	飞利信	10,700	41,088.00	0.01
63	603169	兰石重装	6,400	37,376.00	0.01
64	600184	光电股份	3,256	36,923.04	0.01
65	600086	东方金钰	12,900	35,733.00	0.01
66	601777	力帆股份	11,455	35,281.40	0.01
67	002588	史丹利	8,868	34,673.88	0.01
68	002345	潮宏基	8,482	34,182.46	0.01
69	002431	棕榈股份	9,930	30,286.50	0.01
70	600618	氯碱化工	4,054	29,959.06	0.01
71	600280	中央商场	10,304	28,645.12	0.01
72	000587	金洲慈航	14,712	26,775.84	0.01
73	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
74	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
75	002354	天神娱乐	5,409	15,469.74	0.00
76	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00
77	688299	长阳科技	100	1,729.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	15,992,531.60	14.75
2	600519	贵州茅台	8,894,015.60	8.20
3	600036	招商银行	6,449,627.00	5.95
4	000651	格力电器	4,676,617.69	4.31
5	601166	兴业银行	4,489,617.00	4.14
6	000858	五粮液	3,808,973.86	3.51
7	601398	工商银行	3,396,685.00	3.13
8	600887	伊利股份	3,387,851.00	3.12
9	600276	恒瑞医药	3,280,891.79	3.03
10	600030	中信证券	3,114,663.00	2.87
11	600016	民生银行	3,090,614.00	2.85
12	601328	交通银行	2,976,486.00	2.75
13	000002	万科A	2,898,286.00	2.67
14	601288	农业银行	2,531,669.00	2.34
15	600000	浦发银行	2,326,285.11	2.15
16	601668	中国建筑	2,176,342.45	2.01
17	600900	长江电力	2,088,030.11	1.93
18	601658	邮储银行	2,086,271.00	1.92
19	601601	中国太保	2,009,676.00	1.85
20	002415	海康威视	1,976,796.52	1.82

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	3,466,679.00	3.20
2	688008	澜起科技	2,527,595.25	2.33
3	688111	金山办公	1,934,988.00	1.78
4	688012	中微公司	1,875,908.06	1.73
5	688188	柏楚电子	1,702,799.00	1.57
6	600519	贵州茅台	1,689,427.00	1.56
7	688321	微芯生物	1,666,000.00	1.54

8	688006	杭可科技	1,553,195.09	1.43
9	688388	嘉元科技	1,394,165.74	1.29
10	600036	招商银行	1,360,921.00	1.26
11	688003	天准科技	1,318,377.48	1.22
12	688029	南微医学	1,237,652.44	1.14
13	688036	传音控股	1,222,498.00	1.13
14	688088	虹软科技	1,166,896.10	1.08
15	688007	光峰科技	1,118,227.57	1.03
16	000651	格力电器	1,088,986.00	1.00
17	688016	心脉医疗	943,292.00	0.87
18	601166	兴业银行	919,363.00	0.85
19	688018	乐鑫科技	854,697.68	0.79
20	688020	方邦股份	826,328.04	0.76

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	258,893,092.10
卖出股票收入（成交）总额	86,616,557.34

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

(1) 兴业银行

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股兴业银行。

2019 年 8 月 19 日，交易商协会自律处分信息显示，兴业银行作为北京粮食集团有限责任公司（以下简称“京粮集团”）相关债务融资工具的主承销商，在债务融资工具存续期间未能对京粮集团资产无偿划转重大事项进行有效监测，及时督导京粮集团进行存续期重大事项披露，也未及时召开持有人会议，依据相关自律规定，给予兴业银行诫勉谈话处分，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

对以上事件，本基金判断，兴业银行作为大型全国性股份制银行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。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。

(2) 招商银行

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股招商银行。

2019 年 7 月 2 日，招商银行和平安银行在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09% 的异常利率交易，经自查，为交易员操作失误所致，全国银行间同业拆借中心现对平安银行和招商银行进行通报批评，要求两家机构加强风险控制和内部管理，并依据《银行间本币市场交易员管理办法（试行）》（中汇交发〔2014〕196 号），暂停平安银行和招商银行相关交易员的银行间本币市场交易员资格 1 年。对以上事件，本基金判断，招商银行作为大型全国性股份制银行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

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

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	30,727.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,086.69
5	应收申购款	15,328.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,142.53

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期可转换债券(可交换债券)。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601658	邮储银行	1,518,808.72	0.41	新股锁定流通受限
2	688001	华兴源创	891,141.24	0.24	新股锁定流通受限
3	688099	晶晨股份	814,943.25	0.22	新股锁定流通受限
4	688363	华熙生物	776,160.00	0.21	新股锁定流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,845	37,272.06	181,242,447.35	71.04%	73,884,827.58	28.96%

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	工银瑞信基金公司—农行—中国农业银行离退休人员福利负债	4,805,376.00	6.99%
2	中国工商银行股份有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限	4,603,371.00	6.69%
3	中国工商银行股份有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限	3,728,891.00	5.42%
4	余栋腾	2,392,881.00	3.48%
5	王飞舟	1,677,417.00	2.44%
6	恒生电子股份有限公司	1,164,532.00	1.69%
7	靳宁卿	990,000.00	1.44%
8	中国银行股份有限公司企业年金计划—中国农业银行	949,200.00	1.38%
9	纪伟才	938,029.00	1.36%
10	于成福	932,390.00	1.36%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.80	0.0000%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 22 日）基金份额总额	542,268,490.78
本报告期期初基金份额总额	97,526,920.54
本报告期基金总申购份额	186,622,373.34
减:本报告期基金总赎回份额	29,022,018.95
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	255,127,274.93

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司 2019 年第一次临时股东会议决议，同意钱力不再担任公司第七届董事会董事，选举严琛担任公司第七届董事会董事。该董事人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

因个人原因，杨思乐向公司申请辞去副总经理职务，根据公司第七届董事会第十二次会议决议，杨思乐不再担任公司副总经理职务。该公司高级管理人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

根据公司第七届董事会第十三次会议决议，聘任张壬午担任首席信息官。该公司高级管理人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

根据公司 2019 年第二次临时股东会议决议，同意严琛不再担任公司第七届董事会董事，选举江娅担任公司第七届董事会董事。该董事人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

11.2.2 基金经理变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2019 年 5 月 30 日起，陈亘斯同志担任长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理。自 2019 年 5 月 31 日起，王超同志不再担任长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

审计服务 11 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	1	113,499,290.35	35.11%	105,683.00	35.12%	—
海通证券	1	112,981,165.02	34.96%	105,215.26	34.96%	—
光大证券	1	89,771,504.59	27.77%	83,606.13	27.78%	—
兴业证券	1	5,334,186.56	1.65%	4,968.20	1.65%	—
东兴证券	1	1,577,586.06	0.49%	1,469.67	0.49%	—
华泰证券	1	70,052.30	0.02%	—	—	—
中金证券	1	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源	1	—	—	—	—	—
东北证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	—

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	44,129.70	13.05%	—	—	—	—
海通证券	1,015.40	0.30%	—	—	—	—
光大证券	151,814.67	44.91%	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
东兴证券	19,000.00	5.62%	—	—	—	—
华泰证券	122,100.00	36.12%	—	—	—	—

中金证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

（1）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

（2）资金雄厚，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 and 研究服务评价结果而定；

（3）研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

（4）试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

（5）本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

（6）交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

（1）本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况:

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	国泰君安	上海	1

11.8 其他重大事件

除上述事项外, 均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下:

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同	《上海证券报》及本公司网站	2019 年 12 月 9 日
2	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议	同上	2019 年 12 月 9 日
3	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新)	同上	2019 年 12 月 9 日
4	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书 (更新) 摘要	同上	2019 年 12 月 9 日
5	关于修改长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同等法律文件的公告	同上	2019 年 12 月 9 日
6	长盛基金管理有限公司关于 增加中信期货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	同上	2019 年 11 月 11 日
7	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2019 年第 3 季度报告	同上	2019 年 10 月 23 日
8	长盛基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司销售旗下部分基金并开通定投和转换业务 及参加费率优惠活动的公告	同上	2019 年 10 月 21 日
9	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	同上	2019 年 9 月 20 日
10	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 收益分配公告	同上	2019 年 9 月 9 日
11	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	同上	2019 年 9 月 5 日
12	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2019 年半年度报告	同上	2019 年 8 月 27 日
13	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2019 年半年度报告 摘要	同上	2019 年 8 月 27 日
14	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 2019 年第 2 季度报告	同上	2019 年 7 月 18 日
15	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	同上	2019 年 7 月 9 日

16	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书（更新）摘要	同上	2019 年 7 月 5 日
17	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书（更新）	同上	2019 年 7 月 5 日
18	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加 中国银行定投申购优惠活动的公告	同上	2019 年 6 月 27 日
19	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	同上	2019 年 6 月 26 日
20	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	同上	2019 年 6 月 22 日
21	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）收益分配公告	同上	2019 年 6 月 17 日
22	长盛基金管理有限公司关于高级管理人员（首席信息官）变更的公告	同上	2019 年 6 月 15 日
23	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	同上	2019 年 6 月 11 日
24	长盛基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2019 年 6 月 1 日
25	长盛基金管理有限公司关于调整长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理的公告	同上	2019 年 6 月 1 日
26	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2019 年第 1 季度报告	同上	2019 年 4 月 22 日
27	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2018 年度报告 - 摘要	同上	2019 年 3 月 29 日
28	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2018 年度报告	同上	2019 年 3 月 29 日
29	长盛基金管理有限公司关于中投证券开通旗下部分开放式 基金基金定投业务并推出申购（含定投）费率优惠活动的公告	同上	2019 年 3 月 29 日
30	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2018 年第 4 季度报告	同上	2019 年 1 月 19 日
31	长盛基金管理有限公司关于增加腾安基金销售（深圳）有限公司为旗下部分基金销售机构并推出定投业务 和参加费率优惠活动的公告	同上	2019 年 1 月 11 日
32	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书（更新）	同上	2019 年 1 月 4 日
33	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书（更新）摘要	同上	2019 年 1 月 4 日
34	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行基金交易优惠活动的公告	同上	2019 年 1 月 2 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190508~20191231	0.00	74,045,259.81	0.00	74,045,259.81	29.02%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况, 当该基金份额持有人大量赎回本基金时, 可能导致的风险包括: 巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对, 保护中小投资者利益。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/或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

2020 年 4 月 21 日