

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）证券投资基金
2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§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	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17

6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
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.....	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12 投资组合报告附注.....	62
§8 基金份额持有人信息.....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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的情况.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	65
§10 重大事件揭示.....	66
10.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
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.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	70

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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§12 备查文件目录.....	71
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同庆中证 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	245,994,805.92 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，以实现对中国证 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	李申
	联系电话	010-86497608	021-60637102
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-86497888	021-60637111

传真	010-86497999	021-60635778
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心 3-5 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfund.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(2020 年 1 月 1 日 – 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	22,022,013.76
本期利润	19,562,429.24
加权平均基金份额本期利润	0.0733
本期加权平均净值利润率	5.25%
本期基金份额净值增长率	7.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	84,601,675.20
期末可供分配基金份额利润	0.3439
期末基金资产净值	347,332,792.77
期末基金份额净值	1.412
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-4.90%

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 6 月 30 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
过去一个月	8.57%	0.82%	7.48%	0.83%	1.09%	-0.01%
过去三个月	15.14%	0.85%	13.10%	0.88%	2.04%	-0.03%
过去六个月	7.27%	1.43%	3.85%	1.48%	3.42%	-0.05%
过去一年	21.42%	1.16%	10.74%	1.19%	10.68%	-0.03%
过去三年	28.76%	1.18%	8.77%	1.21%	19.99%	-0.03%
自基金转型起至今	-4.90%	1.55%	-19.77%	1.48%	14.87%	0.07%

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



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。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。

§ 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、私募资产管理、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 2020 年 6 月 30 日，基金管理人共管理六十三只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

2020 年一季度, 国内经历了新型冠状病毒的重大疫情的爆发, 社会经济活动急剧下降。二季度由于国家管控措施快速有力, 经济生产活动逐步恢复。然而, 国外疫情扩散势头始终未得到有效控制, 叠加主要产油国的减产协议破裂, 同期国际金融市场经历了二战以来前所未有的冲击。国内受益于货币和财政政策的快速应对, A 股在经历一季度两次急跌调整后得到快速修复、受益于国内市场和政策的行业逐步持续显现出超额收益。特别是直接受益于疫情的医药生物、医疗设备和用品等板块表现持续领先。伴随对支持经济的政策预期以及 PPI 下跌趋势得以扭转, 新基建相关的半导体、计算机和促进内需的食品饮料、商贸零售、休闲服务等表现也较为突出。在充裕的流动性和低利率水平影响下, A 股市场的风险溢价由高位逐步回落、市场估值有效提升、部分预期业绩高增长的公司形成“戴维斯双击”, 市场总体以结构性上涨为主。在多因子选股方面, 受益于国内流动性释放而表现最为突出的动量因子, 根据历史统计规律下半年大概率将逐步褪色。成长因子、财务质量因子和合理的利润增速与估值比值是我们持之以恒的因子选股依据。

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 1.412 元; 本报告期基金份额净值增长率为 7.27%, 业绩比较基准收益率为 3.85%。本报告期内日均跟踪误差为 0.1318%, 年度化跟踪误差为 2.0837%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度末长端利率出现快速上行, 股市风险溢价的下行空间相对去年底今年初的高位有所下降。对于已处于高估值的板块和行业形成一定压力。随着特别国债发行、财政政策到位、金融政策推动资金进入实体, PPI 大概率修复向上。走势落后的低估值、强周期和高股息股票的利润有望得到提振, 进而估值得到修复。价值股与成长股的估值差有望分阶段逐步收敛。

当前社会就业形势较为严峻, 政府有动力加速推进新基建和部分传统基建项目。尤其值得关注的是单位资本投入对应更多新增就业的行业, 如 5G 建设、轨道交通、环保水利等。流动性充裕的背景下, 大宗商品已出现整体性地反弹, 尤其是黄金价格持续上涨。我们将密切跟踪年底前通胀的变化以及汇率、利率的走势, 尤其是流动性的高增速可能扭转对高估值股票的冲击。此外, 美国大选前后国际形势的变化对于国内经济商贸政策和企业的供应链的影响的不确定性可能持续升高。以上的情形如若发生, 投资者需要及时跟踪不同资产类别的相对强弱变化而调整相应的配置策略。

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、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组, 负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验, 具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定, 本基金于 2020 年 3 月 24 日进行了利润分配, 分配金额为 16,500,335.54 元; 于 2020 年 6 月 17 日进行了利润分配, 分配金额为 16,996,848.62 元。

截至 2020 年 6 月 30 日, 期末可供分配利润为 84,601,675.20 元, 其中, 未分配利润已实现部分为 200,055,605.68 元, 未分配利润未实现部分为 -115,453,930.48 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。

本报告期内本基金进行了 2 次收益分配，分配金额为 33,497,184.16 元，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体: 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2020 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	21,588,321.51	24,513,502.70
结算备付金		-	104,322.01
存出保证金		31,730.76	30,727.63
交易性金融资产	6.4.7.2	327,714,086.06	346,962,131.59
其中: 股票投资		327,659,186.06	346,962,131.59
基金投资		-	-
债券投资		54,900.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		384,110.01	-
应收利息	6.4.7.5	4,873.51	6,086.69
应收股利		-	-
应收申购款		9,454.85	15,328.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		349,732,576.70	371,632,098.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债:			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		460,974.42	29,589.46
应付管理人报酬		270,567.03	311,626.00
应付托管费		59,524.71	68,557.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	255,548.06	37,273.21
应交税费		0.21	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,353,169.50	1,287,648.28
负债合计		2,399,783.93	1,734,694.66
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	262,731,117.57	272,510,815.04
未分配利润	6.4.7.10	84,601,675.20	97,386,589.13
所有者权益合计		347,332,792.77	369,897,404.17
负债和所有者权益总计		349,732,576.70	371,632,098.83

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.412 元，基金份额总额 245,994,805.92 份。

6.2 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		22,552,060.90	35,204,502.02
1.利息收入		91,848.14	62,068.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	91,843.76	62,016.09
债券利息收入		4.38	52.26
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）		24,818,086.83	4,366,803.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	21,685,183.57	1,669,778.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	37,806.04
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,132,903.26	2,659,219.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,459,584.52	30,749,261.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	101,710.45	26,368.00
减：二、费用		2,989,631.66	1,357,289.30

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,854,335.34	860,600.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	407,953.73	189,332.10
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	604,076.54	186,316.64
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	0.02
7. 其他费用	6.4.7.20	123,266.03	121,040.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,562,429.24	33,847,212.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,562,429.24	33,847,212.72

6.3 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）	272,510,815.04	97,386,589.13	369,897,404.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,562,429.24	19,562,429.24
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）	-9,779,697.47	1,149,840.99	-8,629,856.48
其中：1.基金申购款	74,007,586.58	25,434,612.83	99,442,199.41
2.基金赎回款	-83,787,284.05	-24,284,771.84	-108,072,055.89
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）	-	-33,497,184.16	-33,497,184.16
五、期末所有者权益（基金净值）	262,731,117.57	84,601,675.20	347,332,792.77
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	-	33,847,212.72	33,847,212.72
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）	130,051,911.40	35,487,476.22	165,539,387.62
其中：1.基金申购款	142,300,030.99	39,346,204.66	181,646,235.65
2.基金赎回款	-12,248,119.59	-3,858,728.44	-16,106,848.03
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）	-	-13,449,247.16	-13,449,247.16
五、期末所有者权益（基金净值）	234,221,446.11	60,138,303.70	294,359,749.81

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：

林培富	刁俊东	龚珉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛同庆中证 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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称

“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的的会计政策、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需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。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。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	21,588,321.51
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:	21,588,321.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	287,240,958.40	327,659,186.06	40,418,227.66
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	54,900.00	54,900.00
	银行间市场	-	-
	合计	54,900.00	54,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	287,295,858.40	327,714,086.06	40,418,227.66

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**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,856.07
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	-
应收债券利息	4.57
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	12.87

合计	4,873.51
----	----------

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	255,548.06
银行间市场应付交易费用	—
合计	255,548.06

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	1,348.41
应付证券出借违约金	—
其他	612,478.23
预提费用	239,342.86
合计	1,353,169.50

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	255,127,274.93	272,510,815.04
本期申购	69,292,853.57	74,007,586.58
本期赎回(以“-”号填列)	-78,425,322.58	-83,787,284.05
- 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	245,994,805.92	262,731,117.57

注：1，申购含红利再投及转换入份额及金额；赎回含转换出份额及金额。

2，截至 2020 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 62,021,343.00 份(2019 年 12 月 31 日：68,763,845.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 183,973,462.92 份(2019 年

12 月 31 日：186,363,429.93 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。

6.4.7.10 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	217,948,753.15	-120,562,164.02	97,386,589.13
本期利润	22,022,013.76	-2,459,584.52	19,562,429.24
本期基金份额交易产生的变动数	-6,417,977.07	7,567,818.06	1,149,840.99
其中：基金申购款	59,502,378.04	-34,067,765.21	25,434,612.83
基金赎回款	-65,920,355.11	41,635,583.27	-24,284,771.84
本期已分配利润	-33,497,184.16	-	-33,497,184.16
本期末	200,055,605.68	-115,453,930.48	84,601,675.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	91,048.84
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	586.38
其他	208.54
合计	91,843.76

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	209,406,381.83
减：卖出股票成本总额	187,721,198.26
买卖股票差价收入	21,685,183.57

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,132,903.26
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	3,132,903.26

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,459,584.52
——股票投资	-2,459,584.52
——债券投资	-
——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	-2,459,584.52

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	101,680.70
转换费收入	29.75
合计	101,710.45

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。

6.4.7.19 交易费用

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	604,076.54
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中: 申购费	-
赎回费	-
合计	604,076.54

6.4.7.20 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
深交所上市年费	29,835.26
银行划款费用	3,923.17
合计	123,266.03

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金公司”)	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

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

无。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,854,335.34	860,600.30
其中：支付销售机构的客户维护费	41,787.81	42,259.17

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	407,953.73	189,332.10

注：支付基金托管人中国建设银行的基金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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 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**

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 5 月 22 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	7,142,857.14	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,142,857.14	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.9037%	-

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	21,588,321.51	91,048.84	16,879,397.03	55,643.71

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。

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

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	2020 年 6 月 17 日	2020 年 6 月 18 日	2020 年 6 月 17 日	0.6930	14,760,030.58	2,236,818.04	16,996,848.62	
2	2020 年 3 月 24 日	2020 年 3 月 25 日	2020 年 3 月 24 日	0.5960	14,666,470.14	1,833,865.40	16,500,335.54	
合计	—	—	—	1.2890	29,426,500.72	4,070,683.44	33,497,184.16	

6.4.12 期末（2020 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	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
688568	中科 星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未 上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	—
688377	迪威 尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股未 上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	—
688528	秦川 物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新股未 上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	—
688600	皖仪 科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股未 上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	—
300847	中船 汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股未 上市	6.94	6.94	1,420	9,854.80	9,854.80	—
300845	捷安 高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未 上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	—

300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688396	华润微	2020 年 2 月 14 日	2020 年 8 月 27 日	新股流通受限	12.80	41.60	28,156	360,396.80	1,171,289.60	-
688298	东方生物	2020 年 1 月 20 日	2020 年 8 月 5 日	新股流通受限	21.25	143.98	5,286	112,327.50	761,078.28	-
688200	华峰测控	2020 年 2 月 11 日	2020 年 8 月 18 日	新股流通受限	107.41	269.85	2,520	270,673.20	680,022.00	-
688181	八亿时空	2019 年 12 月 27 日	2020 年 7 月 6 日	新股流通受限	43.98	60.97	4,306	189,377.88	262,536.82	-
688555	泽达易盛	2020 年 6 月 12 日	2020 年 12 月 23 日	新股流通受限	19.49	73.25	3,004	58,547.96	220,043.00	-
002500	山西证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 10 日	配股未上市	5.00	6.54	8,278	41,390.00	54,138.12	-

金额单位：人民币元

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转 2	2020 年 6 月 12 日	2020 年 7 月 13 日	新债未上市	100.00	100.00	549	54,900.00	54,900.00	-

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。

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

002254	泰和新材	2020 年 6 月 29 日	重大事项停牌	13.60	2020 年 7 月 14 日	14.96	88	989.30	1,196.80	-
601880	大连港	2020 年 6 月 22 日	重大事项停牌	1.72	2020 年 7 月 8 日	1.89	31	64.10	53.32	-
002470	*ST 金正	2020 年 6 月 30 日	重大事项停牌	2.27	2020 年 7 月 1 日	2.16	16	67.85	36.32	-

注：本基金截至 2020 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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。

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 2020 年 6 月 30 日:本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.02% (2019 年 12 月 31 日,本基金未持有交易性债券投资)。

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 2020 年 06 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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该比例限制)。

本基金所持证券均在证券交易所上市,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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 2020 年 6 月 30 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 2020 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 2020 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	21,588,321.51	-	-	-	21,588,321.51
存出保证金	31,730.76	-	-	-	31,730.76
交易性金融资产	-	-	54,900.00	327,659,186.06	327,714,086.06
应收证券清算款	-	-	-	384,110.01	384,110.01
应收利息	-	-	-	4,873.51	4,873.51
应收申购款	-	-	-	9,454.85	9,454.85
资产总计	21,620,052.27	-	54,900.00	328,057,624.43	349,732,576.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	460,974.42	460,974.42
应付管理人报酬	-	-	-	270,567.03	270,567.03
应付托管费	-	-	-	59,524.71	59,524.71
应付交易费用	-	-	-	255,548.06	255,548.06
应交税费	-	-	-	0.21	0.21
其他负债	-	-	-	1,353,169.50	1,353,169.50
负债总计	-	-	-	2,399,783.93	2,399,783.93
利率敏感度缺口	21,620,052.27	-	54,900.00	325,657,840.50	347,332,792.77
上年度末 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

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 2020 年 6 月 30 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%。(2019 年 12 月 31 日：本基金未持有交易性债券投资)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	327,659,186.06	94.34	346,962,131.59	93.80
合计	327,659,186.06	94.34	346,962,131.59	93.80

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	16,519,185.83	17,596,901.72
	2. 业绩比较基准下降 5%	-16,519,185.83	-17,596,901.72

6.4.14 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 2020 年 6 月 30 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 323,984,817.13 元，属于第二层次的余额为 3,729,268.93 元，无属于第三

层次的余额。(2019 年 12 月 31 日: 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)。

(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:

项目	交易性金融资产					
	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	债券投资	权益工具 投资	合计	债券投资	权益工具 投资	合计
期初	-	-	-	-	208,509.88	208,509.88
购买	-	-	-	-		
出售	-	-	-	-	182,451.82	182,451.82
转入第三层次	-	-	-	-	-	-
转出第三层次	-	-	-	-	-	
当期利得或损失总额	-	-	-	-	74,345.22	74,345.22
计入损益的利得或损失	-	-	-	-	74,345.22	74,345.22
期末	-	-	-	-	100,403.28	100,403.28
期末仍持有的资产计入上半年度 损益的未实现利得或损失的变动 ——公允价值变动损益	-	-	-	-	-	-

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。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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(2019 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。

§ 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	327,659,186.06	93.69
	其中：股票	327,659,186.06	93.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	54,900.00	0.02
	其中：债券	54,900.00	0.02
	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	21,588,321.51	6.17
8	其他各项资产	430,169.13	0.12
9	合计	349,732,576.70	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,722,862.00	1.36
B	采矿业	6,826,772.28	1.97
C	制造业	163,013,202.32	46.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,226,445.07	1.79
E	建筑业	6,149,953.54	1.77
F	批发和零售业	6,035,027.14	1.74
G	交通运输、仓储和邮政业	7,735,282.05	2.23
H	住宿和餐饮业	159,229.50	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,784,208.90	5.70
J	金融业	75,839,258.20	21.83
K	房地产业	10,957,706.28	3.15
L	租赁和商务服务业	4,871,762.78	1.40
M	科学研究和技术服务业	2,252,948.00	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	277,728.04	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00

P	教育	335,775.00	0.10
Q	卫生和社会工作	3,867,843.70	1.11
R	文化、体育和娱乐业	2,530,444.69	0.73
S	综合	579,200.12	0.17
	合计	322,165,649.61	92.75

7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	497.05	0.00
B	采矿业	786.66	0.00
C	制造业	4,503,030.08	1.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,095.09	0.00
E	建筑业	499.00	0.00
F	批发和零售业	1,428.77	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	360.96	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	970,729.75	0.28
J	金融业	-	-
K	房地产业	953.67	0.00
L	租赁和商务服务业	939.52	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	412.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	803.90	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,493,536.45	1.58

7.2.3 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。

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	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	193,587	13,822,111.80	3.98

2	600519	贵州茅台	9,003	13,170,308.64	3.79
3	600036	招商银行	184,416	6,218,507.52	1.79
4	600276	恒瑞医药	66,308	6,120,228.40	1.76
5	000858	五粮液	34,598	5,920,409.76	1.70
6	000651	格力电器	85,923	4,860,664.11	1.40
7	000333	美的集团	69,038	4,127,782.02	1.19
8	002475	立讯精密	73,852	3,792,300.20	1.09
9	600030	中信证券	152,334	3,672,772.74	1.06
10	601166	兴业银行	222,871	3,516,904.38	1.01
11	600887	伊利股份	108,334	3,372,437.42	0.97
12	000002	万科 A	121,654	3,180,035.56	0.92
13	601398	工商银行	626,712	3,121,025.76	0.90
14	600900	长江电力	147,220	2,788,346.80	0.80
15	601888	中国中免	17,412	2,681,970.36	0.77
16	601328	交通银行	491,270	2,520,215.10	0.73
17	300059	东方财富	115,257	2,328,191.40	0.67
18	600585	海螺水泥	42,815	2,265,341.65	0.65
19	000725	京东方 A	484,307	2,261,713.69	0.65
20	600000	浦发银行	209,825	2,219,948.50	0.64
21	000661	长春高新	5,068	2,206,100.40	0.64
22	002714	牧原股份	26,768	2,194,976.00	0.63
23	600016	民生银行	380,495	2,157,406.65	0.62
24	603288	海天味业	17,340	2,157,096.00	0.62
25	002415	海康威视	66,891	2,030,141.85	0.58
26	601688	华泰证券	105,291	1,979,470.80	0.57
27	000063	中兴通讯	48,262	1,936,754.06	0.56
28	601012	隆基股份	47,241	1,924,125.93	0.55
29	600048	保利地产	128,024	1,892,194.72	0.54
30	600837	海通证券	144,749	1,820,942.42	0.52
31	000001	平安银行	140,779	1,801,971.20	0.52
32	601668	中国建筑	375,199	1,789,699.23	0.52
33	603259	药明康德	18,440	1,781,304.00	0.51
34	300498	温氏股份	79,800	1,739,640.00	0.50
35	601288	农业银行	513,867	1,736,870.46	0.50
36	600031	三一重工	90,129	1,690,820.04	0.49
37	600570	恒生电子	14,934	1,608,391.80	0.46
38	300015	爱尔眼科	35,998	1,564,113.10	0.45
39	601601	中国太保	56,240	1,532,540.00	0.44
40	000100	TCL 科技	241,915	1,499,873.00	0.43

41	601229	上海银行	177,860	1,476,238.00	0.43
42	300142	沃森生物	27,500	1,439,900.00	0.41
43	002142	宁波银行	53,724	1,411,329.48	0.41
44	600309	万华化学	28,079	1,403,669.21	0.40
45	601211	国泰君安	80,700	1,392,882.00	0.40
46	603986	兆易创新	5,900	1,391,869.00	0.40
47	601988	中国银行	376,938	1,311,744.24	0.38
48	601169	北京银行	264,694	1,297,000.60	0.37
49	002352	顺丰控股	23,700	1,296,390.00	0.37
50	600588	用友网络	29,079	1,282,383.90	0.37
51	600009	上海机场	17,204	1,239,892.28	0.36
52	601766	中国中车	217,487	1,211,402.59	0.35
53	600690	海尔智家	67,672	1,197,794.40	0.34
54	000568	泸州老窖	13,134	1,196,770.08	0.34
55	002241	歌尔股份	40,654	1,193,601.44	0.34
56	000338	潍柴动力	85,706	1,175,886.32	0.34
57	002594	比亚迪	16,184	1,162,011.20	0.33
58	300122	智飞生物	11,400	1,141,710.00	0.33
59	002304	洋河股份	10,795	1,134,986.30	0.33
60	002410	广联达	16,141	1,125,027.70	0.32
61	000876	新希望	37,712	1,123,817.60	0.32
62	600999	招商证券	51,169	1,123,159.55	0.32
63	600703	三安光电	43,758	1,093,950.00	0.31
64	601899	紫金矿业	245,827	1,081,638.80	0.31
65	600104	上汽集团	62,666	1,064,695.34	0.31
66	002555	三七互娱	22,700	1,062,360.00	0.31
67	002230	科大讯飞	27,550	1,031,196.50	0.30
68	002027	分众传媒	183,700	1,023,209.00	0.29
69	601818	光大银行	284,796	1,019,569.68	0.29
70	600745	闻泰科技	8,000	1,007,600.00	0.29
71	002007	华兰生物	19,530	978,648.30	0.28
72	300601	康泰生物	6,000	972,960.00	0.28
73	300347	泰格医药	9,370	954,615.60	0.27
74	600919	江苏银行	165,200	936,684.00	0.27
75	600028	中国石化	239,296	935,647.36	0.27
76	001979	招商蛇口	56,636	931,095.84	0.27
77	600436	片仔癀	5,345	909,986.25	0.26
78	000538	云南白药	9,111	854,702.91	0.25
79	600547	山东黄金	23,224	850,462.88	0.24

80	601088	中国神华	58,996	847,182.56	0.24
81	600406	国电南瑞	41,335	837,033.75	0.24
82	300413	芒果超媒	12,700	828,040.00	0.24
83	000895	双汇发展	17,837	822,107.33	0.24
84	300003	乐普医疗	22,300	814,396.00	0.23
85	000166	申万宏源	161,251	814,317.55	0.23
86	601628	中国人寿	29,747	809,415.87	0.23
87	600050	中国联通	166,472	805,724.48	0.23
88	002271	东方雨虹	19,700	800,411.00	0.23
89	600438	通威股份	46,000	799,480.00	0.23
90	300014	亿纬锂能	16,500	789,525.00	0.23
91	601009	南京银行	107,401	787,249.33	0.23
92	000938	紫光股份	18,244	784,127.12	0.23
93	002129	中环股份	34,876	783,314.96	0.23
94	002371	北方华创	4,459	762,087.69	0.22
95	601006	大秦铁路	106,328	748,549.12	0.22
96	000776	广发证券	52,977	748,035.24	0.22
97	300136	信维通信	13,900	736,978.00	0.21
98	603160	汇顶科技	3,300	735,570.00	0.21
99	002460	赣锋锂业	13,700	733,909.00	0.21
100	601390	中国中铁	145,699	731,408.98	0.21
101	600196	复星医药	21,574	730,279.90	0.21
102	601857	中国石油	173,731	727,932.89	0.21
103	600019	宝钢股份	159,359	726,677.04	0.21
104	603019	中科曙光	18,600	714,240.00	0.21
105	000977	浪潮信息	18,074	708,139.32	0.20
106	002044	美年健康	49,100	707,531.00	0.20
107	300124	汇川技术	18,535	704,144.65	0.20
108	002050	三花智控	32,078	702,508.20	0.20
109	300253	卫宁健康	30,348	696,183.12	0.20
110	601186	中国铁建	82,251	689,263.38	0.20
111	002602	世纪华通	44,592	682,703.52	0.20
112	600809	山西汾酒	4,653	674,685.00	0.19
113	600015	华夏银行	110,063	673,585.56	0.19
114	002001	新和成	23,100	672,210.00	0.19
115	002311	海大集团	14,100	671,019.00	0.19
116	002624	完美世界	11,600	668,624.00	0.19
117	601336	新华保险	14,959	662,384.52	0.19
118	300433	蓝思科技	23,500	658,940.00	0.19

119	601989	中国重工	163,126	652,504.00	0.19
120	002127	南极电商	30,700	649,919.00	0.19
121	601933	永辉超市	68,425	641,826.50	0.18
122	603501	韦尔股份	3,100	626,045.00	0.18
123	002456	欧菲光	33,755	620,754.45	0.18
124	002236	大华股份	32,265	619,810.65	0.18
125	002821	凯莱英	2,500	607,500.00	0.17
126	600958	东方证券	64,000	607,360.00	0.17
127	000157	中联重科	92,735	596,286.05	0.17
128	600352	浙江龙盛	46,562	595,527.98	0.17
129	600183	生益科技	20,309	594,444.43	0.17
130	600741	华域汽车	28,233	586,964.07	0.17
131	002024	苏宁易购	66,582	583,924.14	0.17
132	601377	兴业证券	83,802	574,043.70	0.17
133	600201	生物股份	20,169	561,504.96	0.16
134	600383	金地集团	40,362	552,959.40	0.16
135	002008	大族激光	15,221	547,194.95	0.16
136	002463	沪电股份	21,555	538,443.90	0.16
137	601138	工业富联	35,500	537,825.00	0.15
138	000860	顺鑫农业	9,311	530,540.78	0.15
139	002185	华天科技	39,200	530,376.00	0.15
140	600346	恒力石化	37,800	529,200.00	0.15
141	600660	福耀玻璃	25,053	522,856.11	0.15
142	601901	方正证券	73,604	521,116.32	0.15
143	600739	辽宁成大	27,312	517,016.16	0.15
144	601225	陕西煤业	71,492	515,457.32	0.15
145	300408	三环集团	18,600	515,220.00	0.15
146	002120	韵达股份	20,700	506,115.00	0.15
147	300033	同花顺	3,800	505,704.00	0.15
148	601877	正泰电器	19,182	505,445.70	0.15
149	300558	贝达药业	3,600	503,928.00	0.15
150	601155	新城控股	16,100	502,964.00	0.14
151	600522	中天科技	43,898	502,632.10	0.14
152	002736	国信证券	44,000	497,200.00	0.14
153	000425	徐工机械	84,054	496,759.14	0.14
154	600109	国金证券	43,292	493,961.72	0.14
155	600529	山东药玻	8,500	493,000.00	0.14
156	002439	启明星辰	11,700	492,219.00	0.14
157	002202	金风科技	49,361	492,129.17	0.14

158	600340	华夏幸福	21,522	491,992.92	0.14
159	300088	长信科技	43,620	488,544.00	0.14
160	300144	宋城演艺	28,100	486,130.00	0.14
161	002385	大北农	52,510	478,366.10	0.14
162	603799	华友钴业	12,290	477,589.40	0.14
163	601669	中国电建	136,788	473,286.48	0.14
164	300012	华测检测	23,800	470,288.00	0.14
165	002841	视源股份	4,700	467,744.00	0.13
166	000783	长江证券	69,194	466,367.56	0.13
167	002131	利欧股份	120,803	466,299.58	0.13
168	601788	光大证券	29,000	465,740.00	0.13
169	603993	洛阳钼业	126,356	463,726.52	0.13
170	601800	中国交建	63,067	462,911.78	0.13
171	300285	国瓷材料	13,800	462,438.00	0.13
172	600079	人福医药	16,930	460,834.60	0.13
173	601108	财通证券	44,900	460,225.00	0.13
174	601985	中国核电	111,388	455,576.92	0.13
175	601555	东吴证券	55,498	452,863.68	0.13
176	600089	特变电工	66,388	449,446.76	0.13
177	603369	今世缘	11,200	445,648.00	0.13
178	600867	通化东宝	25,500	444,465.00	0.13
179	000069	华侨城 A	73,341	444,446.46	0.13
180	600521	华海药业	13,000	441,090.00	0.13
181	600010	宝钢股份	407,616	440,225.28	0.13
182	000768	中航飞机	24,791	439,792.34	0.13
183	603444	吉比特	800	439,208.00	0.13
184	600298	安琪酵母	8,868	438,788.64	0.13
185	002465	海格通信	32,934	426,165.96	0.12
186	600143	金发科技	32,221	424,350.57	0.12
187	600161	天坛生物	9,310	422,022.30	0.12
188	002916	深南电路	2,500	418,800.00	0.12
189	002493	荣盛石化	33,800	415,740.00	0.12
190	000066	中国长城	31,385	414,282.00	0.12
191	600606	绿地控股	65,300	403,554.00	0.12
192	002179	中航光电	9,803	402,021.03	0.12
193	600487	亨通光电	24,480	401,716.80	0.12
194	600029	南方航空	76,882	397,479.94	0.11
195	000963	华东医药	15,679	396,678.70	0.11
196	002075	沙钢股份	31,600	395,000.00	0.11

197	002223	鱼跃医疗	10,791	392,792.40	0.11
198	000009	中国宝安	46,139	392,642.89	0.11
199	002157	正邦科技	22,400	391,552.00	0.11
200	600795	国电电力	210,853	390,078.05	0.11
201	300496	中科创达	5,000	388,500.00	0.11
202	601099	太平洋	121,900	386,423.00	0.11
203	002212	南洋股份	14,500	385,410.00	0.11
204	300482	万孚生物	3,700	384,800.00	0.11
205	600061	国投资本	30,200	384,446.00	0.11
206	000625	长安汽车	34,906	383,966.00	0.11
207	603517	绝味食品	5,400	381,996.00	0.11
208	600886	国投电力	48,578	381,823.08	0.11
209	600705	中航资本	96,360	381,585.60	0.11
210	601607	上海医药	20,637	379,308.06	0.11
211	600893	航发动力	16,126	378,638.48	0.11
212	002074	国轩高科	14,100	378,444.00	0.11
213	600926	杭州银行	42,400	378,208.00	0.11
214	002422	科伦药业	18,000	378,000.00	0.11
215	601100	恒立液压	4,700	376,940.00	0.11
216	000636	风华高科	12,836	374,682.84	0.11
217	300595	欧普康视	5,400	374,436.00	0.11
218	603658	安图生物	2,300	373,612.00	0.11
219	002273	水晶光电	21,793	373,532.02	0.11
220	300207	欣旺达	19,600	370,440.00	0.11
221	601128	常熟银行	49,000	367,990.00	0.11
222	603882	金域医学	4,100	366,950.00	0.11
223	300418	昆仑万维	14,700	366,912.00	0.11
224	002466	天齐锂业	15,861	364,009.95	0.10
225	600111	北方稀土	38,983	363,321.56	0.10
226	600498	烽火通信	12,545	362,675.95	0.10
227	300315	掌趣科技	49,300	361,369.00	0.10
228	601162	天风证券	59,600	361,176.00	0.10
229	603899	晨光文具	6,600	360,360.00	0.10
230	600426	华鲁恒升	20,338	359,575.84	0.10
231	601066	中信建投	9,100	358,358.00	0.10
232	002507	涪陵榨菜	9,900	356,499.00	0.10
233	600637	东方明珠	36,657	353,740.05	0.10
234	601111	中国国航	53,424	353,132.64	0.10
235	000988	华工科技	14,391	351,572.13	0.10

236	300357	我武生物	5,600	348,600.00	0.10
237	603939	益丰药房	3,800	345,800.00	0.10
238	600176	中国巨石	37,564	343,710.60	0.10
239	002340	格林美	68,500	340,445.00	0.10
240	600115	东方航空	80,137	338,178.14	0.10
241	002603	以岭药业	10,800	336,852.00	0.10
242	002601	龙蟠佰利	18,200	336,700.00	0.10
243	002607	中公教育	12,100	335,775.00	0.10
244	000975	银泰黄金	21,332	334,485.76	0.10
245	002414	高德红外	11,356	332,503.68	0.10
246	600011	华能国际	78,700	332,114.00	0.10
247	601360	三六零	18,100	331,411.00	0.10
248	601727	上海电气	65,368	329,454.72	0.09
249	600233	圆通速递	22,600	329,056.00	0.09
250	300168	万达信息	14,900	328,843.00	0.09
251	601816	京沪高铁	52,700	328,321.00	0.09
252	300628	亿联网络	4,800	327,648.00	0.09
253	300271	华宇软件	11,600	327,236.00	0.09
254	600118	中国卫星	10,596	326,674.68	0.09
255	600332	白云山	10,100	326,533.00	0.09
256	300212	易华录	5,800	324,800.00	0.09
257	600271	航天信息	19,976	324,410.24	0.09
258	601600	中国铝业	116,972	322,842.72	0.09
259	000786	北新建材	15,124	322,594.92	0.09
260	600885	宏发股份	8,000	320,960.00	0.09
261	601618	中国中冶	127,706	320,542.06	0.09
262	000513	丽珠集团	6,672	320,322.72	0.09
263	002373	千方科技	13,300	319,067.00	0.09
264	601799	星宇股份	2,500	317,500.00	0.09
265	002353	杰瑞股份	10,238	317,378.00	0.09
266	600859	王府井	6,954	316,754.70	0.09
267	000596	古井贡酒	2,108	316,705.92	0.09
268	600699	均胜电子	13,300	316,673.00	0.09
269	000547	航天发展	23,013	314,587.71	0.09
270	600132	重庆啤酒	4,300	313,900.00	0.09
271	003816	中国广核	105,500	312,280.00	0.09
272	000656	金科股份	38,171	311,475.36	0.09
273	002156	通富微电	12,400	310,620.00	0.09
274	600221	海航控股	205,808	308,712.00	0.09

275	601838	成都银行	38,733	308,314.68	0.09
276	002252	上海莱士	36,200	306,252.00	0.09
277	300009	安科生物	17,100	306,090.00	0.09
278	002019	亿帆医药	13,300	305,501.00	0.09
279	300024	机器人	22,296	304,786.32	0.09
280	600489	中金黄金	33,213	303,566.82	0.09
281	002797	第一创业	43,820	303,234.40	0.09
282	002030	达安基因	11,026	300,789.28	0.09
283	000703	恒逸石化	32,907	300,440.91	0.09
284	601919	中远海控	86,500	300,155.00	0.09
285	600177	雅戈尔	49,684	296,116.64	0.09
286	300017	网宿科技	34,859	295,952.91	0.09
287	000750	国海证券	68,187	295,931.58	0.09
288	000961	中南建设	33,175	295,257.50	0.09
289	603858	步长制药	10,200	294,270.00	0.08
290	600068	葛洲坝	49,454	294,251.30	0.08
291	002557	洽洽食品	5,400	292,626.00	0.08
292	600066	宇通客车	23,734	289,554.80	0.08
293	002174	游族网络	11,100	289,488.00	0.08
294	002250	联化科技	13,246	288,762.80	0.08
295	601997	贵阳银行	40,300	288,548.00	0.08
296	600801	华新水泥	12,143	287,910.53	0.08
297	002195	二三四五	102,343	287,583.83	0.08
298	600315	上海家化	6,000	287,400.00	0.08
299	000021	深科技	13,163	287,348.29	0.08
300	002138	顺络电子	11,500	286,925.00	0.08
301	300316	晶盛机电	11,500	284,510.00	0.08
302	603233	大参林	3,500	284,270.00	0.08
303	600390	五矿资本	40,200	283,812.00	0.08
304	600895	张江高科	13,889	282,918.93	0.08
305	600380	健康元	17,400	282,576.00	0.08
306	601998	中信银行	54,784	282,137.60	0.08
307	600004	白云机场	18,500	281,940.00	0.08
308	000050	深天马 A	18,300	281,088.00	0.08
309	002152	广电运通	21,550	278,857.00	0.08
310	300058	蓝色光标	35,651	278,077.80	0.08
311	002572	索菲亚	11,402	275,586.34	0.08
312	300070	碧水源	33,907	275,324.84	0.08
313	000998	隆平高科	16,500	274,725.00	0.08

314	300244	迪安诊断	7,780	274,634.00	0.08
315	600486	扬农化工	3,300	272,250.00	0.08
316	600845	宝信软件	4,600	271,768.00	0.08
317	000401	冀东水泥	16,899	271,059.96	0.08
318	601198	东兴证券	24,700	269,230.00	0.08
319	600410	华胜天成	19,696	267,865.60	0.08
320	600667	太极实业	22,600	267,132.00	0.08
321	600085	同仁堂	9,834	266,698.08	0.08
322	603833	欧派家居	2,300	266,570.00	0.08
323	603338	浙江鼎力	3,500	265,195.00	0.08
324	601881	中国银河	23,100	264,957.00	0.08
325	002078	太阳纸业	27,825	264,894.00	0.08
326	600037	歌华有线	17,400	264,480.00	0.08
327	600535	天士力	16,262	263,769.64	0.08
328	300274	阳光电源	18,260	262,761.40	0.08
329	002508	老板电器	8,439	262,537.29	0.08
330	000623	吉林敖东	16,655	261,983.15	0.08
331	600155	华创阳安	21,800	261,382.00	0.08
332	600018	上港集团	62,161	261,076.20	0.08
333	002511	中顺洁柔	11,700	260,910.00	0.08
334	600219	南山铝业	128,200	260,246.00	0.07
335	600642	申能股份	43,900	259,449.00	0.07
336	002382	蓝帆医疗	8,600	258,946.00	0.07
337	002396	星网锐捷	7,300	257,909.00	0.07
338	600516	方大炭素	40,871	256,669.88	0.07
339	601231	环旭电子	11,700	255,528.00	0.07
340	002673	西部证券	31,300	255,408.00	0.07
341	002013	中航机电	32,219	254,530.10	0.07
342	000630	铜陵有色	131,823	254,418.39	0.07
343	601233	桐昆股份	19,800	252,648.00	0.07
344	002690	美亚光电	4,800	252,480.00	0.07
345	601018	宁波港	70,651	252,224.07	0.07
346	603707	健友股份	3,900	251,823.00	0.07
347	002146	荣盛发展	31,074	251,699.40	0.07
348	600126	杭钢股份	24,200	251,680.00	0.07
349	600879	航天电子	38,948	250,825.12	0.07
350	002926	华西证券	23,500	249,805.00	0.07
351	600998	九州通	13,400	249,508.00	0.07
352	600362	江西铜业	18,535	249,481.10	0.07

353	600153	建发股份	30,464	246,758.40	0.07
354	600655	豫园股份	27,810	246,396.60	0.07
355	600760	中航沈飞	7,500	246,150.00	0.07
356	601319	中国人保	38,100	245,364.00	0.07
357	000739	普洛药业	10,500	244,545.00	0.07
358	600170	上海建工	79,596	244,359.72	0.07
359	300010	立思辰	12,400	242,668.00	0.07
360	601117	中国化学	44,100	241,668.00	0.07
361	600884	杉杉股份	20,391	240,409.89	0.07
362	002281	光迅科技	7,282	239,286.52	0.07
363	600415	小商品城	48,673	237,037.51	0.07
364	603659	璞泰来	2,300	236,946.00	0.07
365	601878	浙商证券	23,800	235,858.00	0.07
366	600167	联美控股	16,400	235,176.00	0.07
367	600811	东方集团	53,108	234,737.36	0.07
368	002500	山西证券	35,872	234,602.88	0.07
369	001914	招商积余	7,600	233,548.00	0.07
370	600216	浙江医药	12,109	233,219.34	0.07
371	002773	康弘药业	4,700	233,120.00	0.07
372	601021	春秋航空	6,600	232,584.00	0.07
373	600369	西南证券	50,492	231,758.28	0.07
374	600297	广汇汽车	72,500	231,275.00	0.07
375	600804	鹏博士	25,612	229,995.76	0.07
376	600848	上海临港	10,700	229,729.00	0.07
377	300251	光线传媒	21,014	229,262.74	0.07
378	600208	新湖中宝	76,887	229,123.26	0.07
379	600728	佳都科技	25,100	228,661.00	0.07
380	002739	万达电影	14,900	227,523.00	0.07
381	002938	鹏鼎控股	4,500	225,270.00	0.06
382	002268	卫士通	10,500	224,070.00	0.06
383	300001	特锐德	10,700	224,058.00	0.06
384	300115	长盈精密	9,793	223,770.05	0.06
385	002028	思源电气	10,917	223,361.82	0.06
386	002294	信立泰	7,500	222,450.00	0.06
387	002153	石基信息	5,687	221,963.61	0.06
388	600909	华安证券	32,400	221,292.00	0.06
389	002958	青农商行	49,700	220,171.00	0.06
390	601658	邮储银行	48,026	219,478.82	0.06
391	600511	国药股份	5,385	219,007.95	0.06

392	600674	川投能源	23,618	218,938.86	0.06
393	600779	水井坊	3,500	218,470.00	0.06
394	300002	神州泰岳	35,035	216,866.65	0.06
395	600038	中直股份	5,275	216,644.25	0.06
396	000581	威孚高科	10,444	215,981.92	0.06
397	600325	华发股份	30,336	214,172.16	0.06
398	000686	东北证券	25,082	211,942.90	0.06
399	600528	中铁工业	23,876	210,586.32	0.06
400	603883	老百姓	2,100	210,084.00	0.06
401	002387	维信诺	14,700	209,916.00	0.06
402	000997	新大陆	13,128	209,785.44	0.06
403	600446	金证股份	10,800	209,520.00	0.06
404	600418	江淮汽车	23,700	209,271.00	0.06
405	601689	拓普集团	7,500	209,250.00	0.06
406	601611	中国核建	33,700	208,266.00	0.06
407	600827	百联股份	14,376	207,733.20	0.06
408	600460	士兰微	14,061	206,415.48	0.06
409	002032	苏泊尔	2,900	205,900.00	0.06
410	002939	长城证券	16,700	205,744.00	0.06
411	002242	九阳股份	5,517	205,618.59	0.06
412	000999	华润三九	7,024	205,030.56	0.06
413	600598	北大荒	12,700	204,470.00	0.06
414	600959	江苏有线	53,660	201,761.60	0.06
415	600733	北汽蓝谷	31,180	200,487.40	0.06
416	002317	众生药业	11,682	200,463.12	0.06
417	600027	华电国际	58,300	199,386.00	0.06
418	603605	珀莱雅	1,100	198,022.00	0.06
419	601168	西部矿业	34,063	197,565.40	0.06
420	603000	人民网	9,930	196,911.90	0.06
421	600256	广汇能源	72,848	196,689.60	0.06
422	603156	养元饮品	9,100	195,650.00	0.06
423	002368	太极股份	4,461	194,901.09	0.06
424	603806	福斯特	3,900	194,649.00	0.06
425	600260	凯乐科技	14,366	194,228.32	0.06
426	000878	云南铜业	18,200	193,102.00	0.06
427	000564	供销大集	43,000	193,070.00	0.06
428	300296	利亚德	31,800	193,026.00	0.06
429	600704	物产中大	45,315	190,776.15	0.05
430	600820	隧道股份	33,700	190,405.00	0.05

431	002670	国盛金控	20,800	190,320.00	0.05
432	002558	巨人网络	10,900	189,660.00	0.05
433	600839	四川长虹	66,000	189,420.00	0.05
434	002081	金螳螂	24,042	188,970.12	0.05
435	300113	顺网科技	7,400	187,960.00	0.05
436	600497	驰宏锌锗	54,600	187,824.00	0.05
437	300166	东方国信	15,100	187,391.00	0.05
438	002124	天邦股份	14,500	186,325.00	0.05
439	600673	东阳光	26,953	186,245.23	0.05
440	002080	中材科技	12,000	186,000.00	0.05
441	000671	阳光城	29,332	185,964.88	0.05
442	300630	普利制药	2,500	184,875.00	0.05
443	002920	德赛西威	3,000	183,990.00	0.05
444	000627	天茂集团	35,300	183,913.00	0.05
445	600008	首创股份	60,996	183,597.96	0.05
446	600572	康恩贝	33,367	183,518.50	0.05
447	601992	金隅集团	59,700	182,682.00	0.05
448	600482	中国动力	11,590	181,963.00	0.05
449	002221	东华能源	20,614	181,197.06	0.05
450	002468	申通快递	11,000	180,510.00	0.05
451	600583	海油工程	39,548	179,943.40	0.05
452	300618	寒锐钴业	2,900	179,858.00	0.05
453	000158	常山北明	17,200	179,568.00	0.05
454	600718	东软集团	15,559	178,928.50	0.05
455	600549	厦门钨业	15,110	178,902.40	0.05
456	300026	红日药业	32,300	178,296.00	0.05
457	603866	桃李面包	3,500	178,115.00	0.05
458	601179	中国西电	36,700	177,628.00	0.05
459	000800	一汽解放	16,500	177,210.00	0.05
460	600875	东方电气	19,900	176,115.00	0.05
461	600977	中国电影	13,400	175,942.00	0.05
462	600171	上海贝岭	10,120	175,885.60	0.05
463	002217	合力泰	33,400	175,350.00	0.05
464	601966	玲珑轮胎	8,600	173,720.00	0.05
465	002831	裕同科技	6,300	173,313.00	0.05
466	600021	上海电力	23,414	173,263.60	0.05
467	000729	燕京啤酒	25,200	172,620.00	0.05
468	600060	海信视像	14,073	170,986.95	0.05
469	000877	天山股份	11,292	170,509.20	0.05

470	600567	山鹰纸业	57,500	169,625.00	0.05
471	600094	大名城	28,500	169,575.00	0.05
472	600862	中航高科	10,000	169,200.00	0.05
473	600881	亚泰集团	58,131	169,161.21	0.05
474	002399	海普瑞	6,701	167,793.04	0.05
475	601633	长城汽车	21,725	167,717.00	0.05
476	600160	巨化股份	24,169	166,524.41	0.05
477	000060	中金岭南	44,704	166,298.88	0.05
478	002056	横店东磁	14,736	165,780.00	0.05
479	002709	天赐材料	4,900	165,571.00	0.05
480	600597	光明乳业	10,912	162,152.32	0.05
481	603228	景旺电子	4,600	161,874.00	0.05
482	000090	天健集团	23,407	161,742.37	0.05
483	600026	中远海能	24,838	160,453.48	0.05
484	002429	兆驰股份	32,400	160,380.00	0.05
485	002458	益生股份	10,500	160,335.00	0.05
486	300133	华策影视	21,965	159,246.25	0.05
487	600754	锦江酒店	5,738	159,229.50	0.05
488	600580	卧龙电驱	13,948	156,775.52	0.05
489	600967	内蒙一机	15,068	156,556.52	0.05
490	600273	嘉化能源	17,900	156,446.00	0.05
491	601005	重庆钢铁	104,900	156,301.00	0.05
492	600392	盛和资源	21,991	155,036.55	0.04
493	000709	河钢股份	75,947	154,931.88	0.04
494	002648	卫星石化	9,500	154,565.00	0.04
495	000629	攀钢钒钛	76,800	154,368.00	0.04
496	002233	塔牌集团	12,813	154,140.39	0.04
497	600282	南钢股份	47,600	153,748.00	0.04
498	601216	君正集团	60,408	153,436.32	0.04
499	601916	浙商银行	38,900	153,266.00	0.04
500	000960	锡业股份	17,900	153,224.00	0.04
501	002203	海亮股份	17,500	153,125.00	0.04
502	600755	厦门国贸	23,140	152,724.00	0.04
503	002004	华邦健康	28,347	152,506.86	0.04
504	002807	江阴银行	38,800	152,484.00	0.04
505	002085	万丰奥威	23,500	152,280.00	0.04
506	600039	四川路桥	39,791	152,001.62	0.04
507	600064	南京高科	15,494	150,601.68	0.04
508	601238	广汽集团	16,600	149,400.00	0.04

509	000970	中科三环	15,210	148,753.80	0.04
510	601118	海南橡胶	30,600	148,716.00	0.04
511	600166	福田汽车	82,356	148,240.80	0.04
512	601975	招商南油	61,900	147,941.00	0.04
513	000598	兴蓉环境	31,995	147,177.00	0.04
514	000690	宝新能源	31,161	147,079.92	0.04
515	300182	捷成股份	36,800	146,832.00	0.04
516	000778	新兴铸管	42,782	146,742.26	0.04
517	002110	三钢闽光	21,900	145,854.00	0.04
518	000681	视觉中国	7,500	139,650.00	0.04
519	600808	马钢股份	53,400	137,772.00	0.04
520	601098	中南传媒	12,800	135,424.00	0.04
521	600717	天津港	16,168	71,462.56	0.02
522	600694	大商股份	90	2,159.10	0.00
523	600259	广晟有色	66	1,980.00	0.00
524	603568	伟明环保	78	1,809.60	0.00
525	600639	浦东金桥	96	1,534.08	0.00
526	002048	宁波华翔	98	1,513.12	0.00
527	000062	深圳华强	97	1,410.38	0.00
528	600645	中源协和	48	1,356.00	0.00
529	002038	双鹭药业	94	1,204.14	0.00
530	600835	上海机电	68	1,151.24	0.00
531	600195	中牧股份	67	1,087.41	0.00
532	600765	中航重机	99	1,011.78	0.00
533	600329	中新药业	58	1,004.56	0.00
534	000156	华数传媒	92	996.36	0.00
535	002375	亚厦股份	93	950.46	0.00
536	600316	洪都航空	59	932.20	0.00
537	600056	中国医药	62	877.30	0.00
538	600648	外高桥	61	862.54	0.00
539	600062	华润双鹤	65	859.30	0.00
540	600338	西藏珠峰	80	800.00	0.00
541	600729	重庆百货	25	780.50	0.00
542	600640	号百控股	37	738.15	0.00
543	600372	中航电子	50	666.00	0.00
544	600138	中青旅	67	661.29	0.00
545	000685	中山公用	85	654.50	0.00
546	600557	康缘药业	47	654.24	0.00
547	000402	金融街	96	637.44	0.00

548	000830	鲁西化工	84	626.64	0.00
549	601928	凤凰传媒	90	612.00	0.00
550	000887	中鼎股份	77	604.45	0.00
551	000400	许继电气	45	594.00	0.00
552	000826	启迪环境	80	593.60	0.00
553	000061	农产品	80	592.80	0.00
554	600643	爱建集团	61	484.95	0.00
555	000012	南玻 A	95	476.90	0.00
556	600757	长江传媒	92	468.28	0.00
557	600409	三友化工	99	461.34	0.00
558	002589	瑞康医药	82	439.52	0.00
559	000600	建投能源	86	437.74	0.00
560	600466	蓝光发展	80	431.20	0.00
561	000528	柳工	68	429.08	0.00
562	600633	浙数文化	42	410.76	0.00
563	600188	兖州煤业	45	394.20	0.00
564	300072	三聚环保	89	380.92	0.00
565	600787	中储股份	86	377.54	0.00
566	002093	国脉科技	42	371.70	0.00
567	600478	科力远	78	367.38	0.00
568	000848	承德露露	51	357.00	0.00
569	000543	皖能电力	88	353.76	0.00
570	600874	创业环保	53	351.92	0.00
571	603766	隆鑫通用	88	340.56	0.00
572	600141	兴发集团	38	340.10	0.00
573	600058	五矿发展	54	326.16	0.00
574	601958	金钼股份	52	321.36	0.00
575	600373	中文传媒	27	318.06	0.00
576	000758	中色股份	76	317.68	0.00
577	600748	上实发展	62	316.82	0.00
578	600770	综艺股份	65	312.00	0.00
579	000415	渤海租赁	99	295.02	0.00
580	600348	阳泉煤业	67	282.74	0.00
581	600312	平高电气	38	281.96	0.00
582	600657	信达地产	67	276.04	0.00
583	002244	滨江集团	64	273.28	0.00
584	000559	万向钱潮	56	271.04	0.00
585	601717	郑煤机	46	270.94	0.00
586	002285	世联行	95	265.05	0.00

587	000937	冀中能源	87	262.74	0.00
588	002390	信邦制药	57	259.92	0.00
589	000930	中粮科技	38	259.54	0.00
590	002503	搜于特	92	258.52	0.00
591	600125	铁龙物流	46	256.68	0.00
592	600664	哈药股份	83	255.64	0.00
593	002266	浙富控股	65	251.55	0.00
594	000983	西山煤电	65	243.75	0.00
595	000027	深圳能源	49	227.36	0.00
596	600970	中材国际	43	227.04	0.00
597	300134	大富科技	16	223.68	0.00
598	601333	广深铁路	96	216.00	0.00
599	002002	鸿达兴业	59	212.99	0.00
600	002701	奥瑞金	44	184.36	0.00
601	600649	城投控股	31	184.14	0.00
602	600435	北方导航	24	181.44	0.00
603	002408	齐翔腾达	29	180.09	0.00
604	002440	闰土股份	18	164.52	0.00
605	000718	苏宁环球	49	151.41	0.00
606	601678	滨化股份	34	144.16	0.00
607	601718	际华集团	43	142.76	0.00
608	002191	劲嘉股份	16	142.56	0.00
609	002665	首航高科	58	141.52	0.00
610	600158	中体产业	17	139.06	0.00
611	600869	智慧能源	34	136.00	0.00
612	000563	陕国投 A	35	129.85	0.00
613	600863	内蒙华电	51	125.46	0.00
614	600266	城建发展	24	121.68	0.00
615	002064	华峰氨纶	22	111.54	0.00
616	601866	中远海发	53	97.52	0.00
617	000712	锦龙股份	7	87.50	0.00
618	000078	海王生物	20	83.80	0.00
619	600335	国机汽车	18	83.16	0.00
620	600006	东风汽车	18	72.54	0.00
621	002092	中泰化学	14	63.42	0.00
622	600120	浙江东方	9	61.83	0.00
623	600017	日照港	23	57.27	0.00
624	601880	大连港	31	53.32	0.00
625	600376	首开股份	9	52.74	0.00

626	601000	唐山港	23	51.29	0.00
627	600500	中化国际	10	50.60	0.00
628	000519	中兵红箭	5	47.10	0.00
629	002128	露天煤业	6	46.50	0.00
630	600022	山东钢铁	30	38.70	0.00
631	601608	中信重工	11	37.62	0.00
632	002470	*ST 金正	16	36.32	0.00
633	002505	大康农业	16	36.00	0.00
634	000031	大悦城	3	15.27	0.00
635	600917	重庆燃气	1	7.14	0.00

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	占基金资产净值比例（%）
1	688396	华润微	28,156	1,171,289.60	0.34
2	688298	东方生物	5,286	761,078.28	0.22
3	688200	华峰测控	2,520	680,022.00	0.20
4	600584	长电科技	12,255	383,213.85	0.11
5	300673	佩蒂股份	8,800	342,144.00	0.10
6	600536	中国软件	3,886	307,771.20	0.09
7	600600	青岛啤酒	3,650	279,225.00	0.08
8	688181	八亿时空	4,306	262,536.82	0.08
9	002065	东华软件	20,072	251,301.44	0.07
10	688555	泽达易盛	3,004	220,043.00	0.06
11	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.05
12	300146	汤臣倍健	8,486	167,089.34	0.05
13	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.04
14	603087	甘李药业	947	94,984.10	0.03
15	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.03
16	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
17	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
18	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
19	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
20	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
21	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
22	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
23	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

24	688299	长阳科技	100	2,869.00	0.00
25	300842	帝科股份	55	2,239.60	0.00
26	002254	泰和新材	88	1,196.80	0.00
27	300202	聚龙股份	96	1,032.00	0.00
28	000503	国新健康	76	846.64	0.00
29	002251	步步高	59	824.82	0.00
30	002332	仙琚制药	48	808.32	0.00
31	300824	北鼎股份	54	740.34	0.00
32	600750	江中药业	56	707.84	0.00
33	002400	省广集团	64	671.36	0.00
34	000423	东阿阿胶	17	608.77	0.00
35	600184	光电股份	56	539.84	0.00
36	000006	深振业 A	70	476.70	0.00
37	002041	登海种业	37	468.05	0.00
38	002699	美盛文化	75	455.25	0.00
39	002384	东山精密	14	419.30	0.00
40	000829	天音控股	64	419.20	0.00
41	002672	东江环保	45	405.45	0.00
42	600151	航天机电	81	391.23	0.00
43	600618	氯碱化工	54	383.40	0.00
44	601311	骆驼股份	42	381.36	0.00
45	002358	森源电气	76	379.24	0.00
46	600611	大众交通	96	360.96	0.00
47	002276	万马股份	49	349.86	0.00
48	300027	华谊兄弟	95	348.65	0.00
49	002489	浙江永强	80	318.40	0.00
50	002588	史丹利	68	286.96	0.00
51	600525	长园集团	59	286.15	0.00
52	600971	恒源煤电	60	274.20	0.00
53	002345	潮宏基	82	273.06	0.00
54	600499	科达洁能	66	271.92	0.00
55	002344	海宁皮城	64	268.16	0.00
56	000926	福星股份	50	262.50	0.00
57	300266	兴源环境	79	259.12	0.00
58	601777	力帆股份	55	246.95	0.00
59	002437	誉衡药业	76	245.48	0.00
60	600267	海正药业	17	243.95	0.00
61	002310	东方园林	50	241.50	0.00
62	601001	大同煤业	57	223.44	0.00

63	600023	浙能电力	61	214.11	0.00
64	600100	同方股份	25	182.25	0.00
65	600688	上海石化	51	177.48	0.00
66	600169	太原重工	88	168.08	0.00
67	002482	广田集团	50	167.50	0.00
68	002573	清新环境	28	152.88	0.00
69	000049	德赛电池	3	147.03	0.00
70	600759	洲际油气	79	146.94	0.00
71	000552	靖远煤电	64	142.08	0.00
72	600743	华远地产	63	131.67	0.00
73	600157	永泰能源	91	114.66	0.00
74	002277	友阿股份	28	112.00	0.00
75	002431	棕榈股份	30	90.00	0.00
76	000667	美好置业	30	82.80	0.00
77	600993	马应龙	3	72.75	0.00
78	000969	安泰科技	11	72.60	0.00
79	000541	佛山照明	10	51.70	0.00
80	000839	中信国安	15	35.70	0.00
81	002299	圣农发展	1	29.00	0.00
82	600366	宁波韵升	4	22.80	0.00
83	000612	焦作万方	1	5.21	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	601318	中国平安	5,150,378.00	1.39
2	600519	贵州茅台	4,309,148.00	1.16
3	600036	招商银行	2,194,707.00	0.59
4	000651	格力电器	2,028,497.00	0.55
5	000858	五粮液	1,837,246.00	0.50
6	300498	温氏股份	1,724,467.80	0.47
7	603259	药明康德	1,654,823.80	0.45
8	000333	美的集团	1,583,602.00	0.43
9	600276	恒瑞医药	1,569,779.00	0.42
10	601166	兴业银行	1,414,160.00	0.38
11	603986	兆易创新	1,363,347.00	0.37

12	000002	万科 A	1,349,262.00	0.36
13	600887	伊利股份	1,194,133.00	0.32
14	600030	中信证券	1,164,268.00	0.31
15	601398	工商银行	1,097,029.00	0.30
16	601688	华泰证券	1,038,418.00	0.28
17	600016	民生银行	979,449.00	0.26
18	600745	闻泰科技	962,177.00	0.26
19	002555	三七互娱	953,027.00	0.26
20	300601	康泰生物	928,687.98	0.25

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	10,196,125.00	2.76
2	601318	中国平安	8,961,358.00	2.42
3	600036	招商银行	3,960,371.00	1.07
4	000651	格力电器	3,883,124.55	1.05
5	000858	五粮液	3,553,147.00	0.96
6	601166	兴业银行	2,712,536.00	0.73
7	000002	万科 A	2,625,366.00	0.71
8	600276	恒瑞医药	2,558,856.00	0.69
9	600016	民生银行	2,434,610.00	0.66
10	600887	伊利股份	2,068,827.00	0.56
11	000661	长春高新	2,049,050.00	0.55
12	601288	农业银行	2,042,275.00	0.55
13	600030	中信证券	1,875,015.00	0.51
14	601398	工商银行	1,771,268.00	0.48
15	601328	交通银行	1,598,789.00	0.43
16	601211	国泰君安	1,554,759.00	0.42
17	601888	中国中免	1,498,355.00	0.41
18	002415	海康威视	1,371,773.26	0.37
19	600383	金地集团	1,340,262.00	0.36
20	000333	美的集团	1,336,332.00	0.36

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	170,877,837.25
卖出股票收入（成交）总额	209,406,381.83

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）	54,900.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	54,900.00	0.02

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	128112	歌尔转 2	549	54,900.00	0.02

注：本基金本报告期末仅持有 1 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 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。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

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。

根据全国银行间同业拆借中心 2019 年 7 月 8 日公布的《全国银行间同业拆借中心关于通报批评平安银行和招商银行的公告》，2019 年 7 月 2 日，平安银行和招商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。经两家银行自查，为交易员操作失误所致。全国银行间同业拆借中心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，本基金做出如下说明：

招商银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，公司高度重视内部控制建设，并围绕内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督等方面不断加强和完善内部控制机制。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切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。

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	31,730.76
2	应收证券清算款	384,110.01
3	应收股利	-
4	应收利息	4,873.51
5	应收申购款	9,454.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	430,169.13

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（可交换债券）。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688396	华润微	1,171,289.60	0.34	新股流通受限
2	688298	东方生物	761,078.28	0.22	新股流通受限
3	688200	华峰测控	680,022.00	0.20	新股流通受限

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
6,542	37,602.39	178,167,197.92	72.43%	67,827,608.00	27.57%

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	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公司	4,000,000.00	6.45%
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公司	3,728,891.00	6.01%
3	余栋腾	2,000,000.00	3.22%
4	王飞舟	1,677,417.00	2.70%
5	靳宁卿	980,000.00	1.58%
6	纪伟才	938,029.00	1.51%
7	于成福	932,390.00	1.50%
8	陈美辰	761,556.00	1.23%
9	于君	711,529.00	1.15%
10	李坚	538,128.00	0.87%

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	0.80	0.0000%

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

§ 9 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	255,127,274.93
本报告期基金总申购份额	69,292,853.57
减:本报告期基金总赎回份额	78,425,322.58
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	245,994,805.92

§ 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

本报告期本基金管理人的高级管理人员无重大人事变动。

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

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期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

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华西证券	1	124,098,836.01	33.45%	90,755.67	28.32%	—
长江证券	1	119,968,460.99	32.34%	111,725.44	34.86%	—
海通证券	1	109,467,812.04	29.51%	101,831.07	31.78%	—
兴业证券	1	11,702,885.17	3.15%	10,898.93	3.40%	—
光大证券	1	5,646,282.35	1.52%	5,258.04	1.64%	—
华泰证券	1	95,379.00	0.03%	—	—	—

招商证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华西证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	54,900.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-

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) 资力雄厚，信誉良好。

- (3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。
- (5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；
- (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；
- (3) 研究发展部、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：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	华西证券	深圳	1

- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛同庆中证 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	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 6 月 18 日
2	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）收益分配公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 6 月 15 日
3	长盛同庆中证 800 指数型证券投资	上海证券报、本公司网站、中	2020 年 6 月 11 日

	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	国证监会基金电子披露网站	
4	长盛基金管理有限公司关于取消旗下部分开放式基金在中信证券（华南）申购费率优惠的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 28 日
5	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2020 年第 1 季度报告	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 22 日
6	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	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 21 日
7	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	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 27 日
8	长盛基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 25 日
9	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）收益分配公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 20 日
10	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	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 17 日
11	关于长盛基金管理有限公司直销柜台开展旗下部分基金费率优惠活动的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 16 日
12	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2019 年第 4 季度报告	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 18 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

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	20200101~20200630	74,045,259.81	-	-	74,045,259.81	30.10%
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF) 相关批准文件；
- 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。

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

2020 年 8 月 29 日