长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）
2022年年度报告

2022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：中国银行股份有限公司

送出日期：2023年3月31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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 30 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，安永华明会计师事务所（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 2022 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 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 8
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.9 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遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 审计报告 14
6.1 审计报告基本信息 14
6.2 审计报告的基本内容 14
§7 年度财务报表 16
7.1 资产负债表 16
7.2 利润表 18
7.3 净资产（基金净值）变动表 19
7.4 报表附注 22
§8 投资组合报告 49

8.1 期末基金资产组合情况 49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 50
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 51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 60
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 60
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 60
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 60
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 60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 60
8.12 投资组合报告附注 61

§9 基金份额持有人信息 61

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 61
9.2 期末上市基金前十名持有人 62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 62
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情况 62

§10 开放式基金份额变动 62

§11 重大事件揭示 63

11.1 基金份额持有人大会决议 63
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 63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 63
11.4 基金投资策略的改变 63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 63
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 63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 64
11.8 其他重大事件 67

§12 影响投资者决策的其他重要信息 68

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 68
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 68

§13 备查文件目录 69

13.1 备查文件目录 69
13.2 存放地点 69
13.3 查阅方式 69

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	长盛同智优势混合（LOF）
场内简称	长盛同智 LOF
基金主代码	160805
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 1 月 5 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	500,623,940.98 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	2007 年 2 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于业绩能够持续优势成长的成长型上市公司，所追求的投资目标是在尽可能地分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产增值和收益的最大化。
投资策略	本基金为混合型基金，根据对宏观经济、行业状况、公司成长性及资本市场的判断，综合评价各类资产的风险收益水平，对各类资产采取适度灵活的资产配置。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%＋上证国债指数收益率×30%＋一年定期存款利率×5%。
风险收益特征	本基金是较高预期收益—较高预期风险的产品，其预期收益与风险高于债券基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	许俊
	联系电话	010-86497608	010-66596688
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95566
传真		010-86497999	010-66594942
注册地址		深圳市福田中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100029	100818
法定代表人		高民和	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
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	2022年	2021年	2020年
本期已实现收益	-99,523,300.27	139,207,782.93	187,157,887.99
本期利润	-274,992,911.31	178,156,111.89	270,146,392.07
加权平均基金份额本期利润	-0.5208	0.3511	0.4496
本期加权平均净值利润率	-53.18%	24.82%	45.33%
本期基金份额净值增长率	-37.37%	32.64%	55.75%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	-105,496,244.31	173,402,709.22	117,691,361.89
期末可供分配基金份额利润	-0.2107	0.2603	0.2070
期末基金资产净值	395,127,696.67	839,548,055.78	686,316,990.95
期末基金份额净值	0.7893	1.2603	1.2070
3.1.3 累计期末指标	2022年末	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	134.03%	273.68%	181.73%

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

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

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

4、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 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	-9.20%	1.43%	1.37%	0.84%	-10.57%	0.59%
过去六个月	-22.81%	1.64%	-8.50%	0.72%	-14.31%	0.92%
过去一年	-37.37%	1.64%	-13.27%	0.83%	-24.10%	0.81%
过去三年	29.38%	1.88%	1.38%	0.84%	28.00%	1.04%
过去五年	21.99%	1.63%	6.65%	0.84%	15.34%	0.79%
自基金转型起至今	134.03%	1.53%	106.92%	1.09%	27.11%	0.44%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%＋上证国债指数收益率×30%＋一年定期存款利率×5%。

基准指数的构建考虑了三个原则：

1、公允性。选择市场认同度比较高的沪深 300 指数和上证国债指数作为计算的基础指数。

2、可比性。基金投资业绩受到资产配置比例限制的影响，本基金持有的股票投资占基金资产的比例范围为 30%－95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；债券投资占基金资产的比例范围为 0-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。根据基金在正常市场状况下的资产配置比例来确定加权计算的权数，使业绩比较更具有合理性。

3、再平衡。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 65%、30%、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

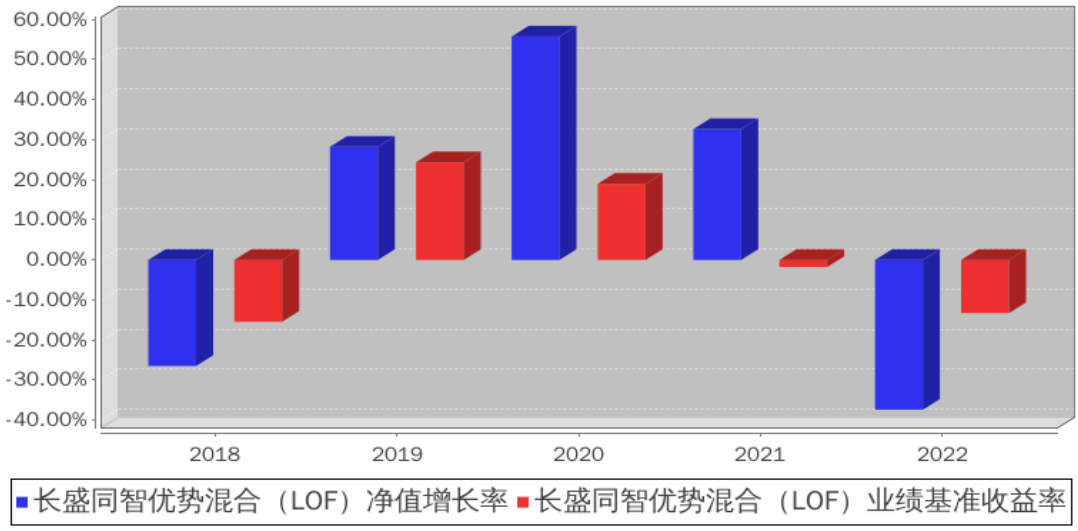
长盛同智优势混合（LOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注：1、本基金由同智证券投资基金转型而来，转型日为 2007 年 1 月 5 日。

2、按基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 过去五年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

长盛同智优势混合（LOF）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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

2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	3.5000	147,811,138.52	66,016,166.62	213,827,305.14	-
2020 年	0.5040	16,879,719.35	11,574,223.75	28,453,943.10	-
合计	4.0040	164,690,857.87	77,590,390.37	242,281,248.24	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内首批成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金总部办公地位于北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，并拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用融资担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基金的投资顾问。截至 2022 年 12 月 31 日，基金管理人共管理六十九只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孟棋	本基金基金经理，长盛创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛景气优选混合型证券投资基金基金经理，长盛先进制造六个月持有期混合型证券投资基金基金经理。	2020 年 10 月 23 日	-	13 年	孟棋先生，硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、光大永明资产管理公司研究员。 2014 年 5 月加入长盛基金管理有限公司，先后担任行业研究员、社保组合组合经理助理等。

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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公司公平交易细则》，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、私募资产管理计划等，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，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。

公司对管理的不同投资组合过去 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原则及利益输送的行为。

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

2022 年是对应 2019 年-2021 年三年的转折之年，宏观环境发生了较大转折，股票市场也随之波动加大。首先是全球通胀加剧，俄乌战争更是助推了能源通胀趋势；其次国内疫情加剧，年底加速了政策转向，经济对冲工具包基建地产等刺激力度不断加大。对应在股票市场上，先是上游资源品表现较为亮眼，基建地产等经济刺激方向也震荡向上，成长赛道则波动较大，结构性行情突出。特别是四季度行情发生了较大转折，先是医药、计算机等弱周期成长方向边际向上，其次食品饮料、社会服务等疫后复苏方向预期改变明显。

本基金坚持长期成长，坚持制造业优质资产，坚持创新驱动风格为主，年初持有的新能源等先进制造资产在前四月的成长估值快速下降过程中防御不足，在五月以后的修复行情抓住了汽车、风光储等成长弹性行业，但是在下半年特别是八月份中旬之后的行情变化中应对不足，四季度较长时间处于低位的医药、计算机、食品饮料等行业反弹速度较快，组合有所均衡调整，增加了计算机、医药、社服、食品饮料等板块个股，但力度仍嫌不足。

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 0.7893 元；本报告期基金份额净值增长率为-37.37%，同期业绩比较基准收益率为-13.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年将延续 2022 年底以来的疫后复苏态势，全行业信心有所恢复，而政策端也将继续加大回暖力度，确保 2023 年全年经济任务的稳健复苏，这一复苏的态势将体现在全行业上，包括地产基建产业链以及线上及线下社会消费的方方面面。对应股票市场上，流动性环境将优于 2022 年，因此基本面的整体复苏叠加流动性的宽松，导致 2023 年的股票指数将是恢复性的一年。而在行业结构上，优先选择政策支持叠加国内外创新共振的中长期方向，特别是数字经济与信息技术。

风格上更为均衡，不仅是低估值周期及价值权重蓝筹的修复，更有新成长赛道及各种创新主题的演绎。本产品将根据产业基本面的变化和估值的合理性，坚持成长风格为主的同时，也将注意组合的均衡稳健。

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，本基金管理人遵循合规运作、保护基金投资者利益的原则，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、加强合规宣导与培训，持续推动公司合规文化建设。报告期内，监察稽核部通过外请专业机构、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，及时组织学习法律法规与监管文件，深化员工合规理念，提升员工合规工作技能。

2、持续完善公司制度规章体系建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时督促、提示业务部门进行相关制度、流程的新订、修订与完善，保证公司制度规章的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司除完成有关制度的新订、修订工作外，还要求业务部门就制度、流程变化内容与其他相关执行部门进行沟通，确保各相关部门对新订、修订内容的理解保持一致，保证制度、流程被严格执行。

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，防范非公平交易和利益输送。

4、加强专项稽核与检查力度，完善发现问题与改进情况的跟踪、落实机制，保障公司运营及受托资产投资运作合规。报告期内，公司监察稽核部开展定期、临时专项稽核，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、员工行为、信息技术等。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、参与新产品设计、新业务、新流程的合规论证工作，提供合规意见或建议，确保依法合规开展相关业务。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保护基金投资者的利益为宗旨，不断提高内部监察稽核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、公司业务运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

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

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

4.8 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，本基金本报告期未实施利润分配。

本基金截至2022年12月31日期末可供分配利润为-105,496,244.31元，其中：未分配利润已实现部分为110,692,987.26元，未分配利润未实现部分为-216,189,231.57元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛同智优势成长混合型证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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	安永华明（2023）审字第 60468688_A03 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	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。
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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。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。
其他信息	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估长盛同智优势成长混合型证券投资基金（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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督长盛同智优势成长混合型证券投资基金（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： （1）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。 （2）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。 （3）评价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。

	（4）对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智优势成长混合型证券投资基金（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智优势成长混合型证券投资基金（LOF）不能持续经营。 （5）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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	贺　　耀	王海彦
会计师事务所的地址	中国　　北京	
审计报告日期	2023 年 3 月 28 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	43,280,289.30	45,350,336.72
结算备付金		138,800.91	2,697,480.17
存出保证金		125,189.48	100,316.91
交易性金融资产	7.4.7.2	350,327,603.79	790,952,811.36
其中：股票投资		348,850,580.84	790,613,222.13
基金投资		-	-
债券投资		1,477,022.95	339,589.23
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		3,466,542.84	4,253,483.78
应收股利		-	-
应收申购款		16,181.40	80,703.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	7,265.66
资产总计		397,354,607.72	843,442,398.26
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2022年12月31日**	**上年度末 2021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		-	-
应付清算款		980.00	-
应付赎回款		48,364.58	204,026.79
应付管理人报酬		511,551.73	1,216,119.76
应付托管费		85,258.61	202,686.62
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		305,938.10	305,933.58
应付利润		428,798.09	428,798.09
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	846,019.94	1,536,777.64
负债合计		2,226,911.05	3,894,342.48
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	500,623,940.98	666,145,346.56
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-105,496,244.31	173,402,709.22
净资产合计		395,127,696.67	839,548,055.78
负债和净资产总计		397,354,607.72	843,442,398.26

注： 1、报告截止日2022年12月31日，基金份额净值0.7893元，基金份额总额500,623,940.98份。

2、以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在2022年年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在2022年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022年1月1日至2022年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
一、营业总收入		-265,629,199.95	196,141,461.42
1.利息收入		227,182.77	182,108.56
其中：存款利息收入	7.4.7.13	227,182.77	181,414.88
债券利息收入		-	693.68
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）		-90,616,673.65	156,845,090.27
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-93,512,309.47	154,299,261.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	13,593.13	294,399.36
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,882,042.69	2,251,429.39
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-175,469,611.04	38,948,328.96
4.汇兑收益（损失以		-	-

“-”号填列）			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	229,901.97	165,933.63
减：二、营业总支出		9,363,711.36	17,985,349.53
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	7,822,257.43	10,730,939.26
2．托管费	7.4.10.2.2	1,303,709.50	1,788,489.91
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7．税金及附加		6.33	2.63
8．其他费用	7.4.7.23	237,738.10	5,465,917.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-274,992,911.31	178,156,111.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-274,992,911.31	178,156,111.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-274,992,911.31	178,156,111.89

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	666,145,346.56	-	173,402,709.22	839,548,055.78
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	666,145,346.56	-	173,402,709.22	839,548,055.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-165,521,405.58	-	-278,898,953.53	-444,420,359.11
（一）、综合收益总额	-	-	-274,992,911.31	-274,992,911.31
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-165,521,405.58	-	-3,906,042.22	-169,427,447.80
其中：1.基金申购款	27,228,042.61	-	-302,904.44	26,925,138.17
2.基金赎回款	-192,749,448.19	-	-3,603,137.78	-196,352,585.97
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”	-	-	-	-

号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	500,623,940.98	-	-105,496,244.31	395,127,696.67
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	568,625,629.06	-	117,691,361.89	686,316,990.95
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	568,625,629.06	-	117,691,361.89	686,316,990.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	97,519,717.50	-	55,711,347.33	153,231,064.83
（一）、综合收益总额	-	-	178,156,111.89	178,156,111.89
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	97,519,717.50	-	91,382,540.58	188,902,258.08

（净值减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	285,914,890.01	-	158,273,769.91	444,188,659.92
2.基金赎回款	-188,395,172.51	-	-66,891,229.33	-255,286,401.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-213,827,305.14	-213,827,305.14
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	666,145,346.56	-	173,402,709.22	839,548,055.78

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：

胡甲	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2006]260 号文《关于核准同智证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》的核准，由封闭式基金同智证券投资基金转型而成，自 2007

年1月5日起，《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。本基金于2007年1月22日（“转换基准日”）的基金净值为人民币955,116,003.53元，于2007年1月23日（“转换日”）折合基金份额955,116,000.00份。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券，权证以及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具。其中，股票投资占基金资产的比例范围为30%-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为0%-3%；债券投资占基金资产的比例范围为0%-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在5%以上，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将不低于 80%的股票资产投资于具有较大成长潜力的上市公司的股票。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民

币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2)金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当

于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同

资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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)不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3)股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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，但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。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

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)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)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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，

适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 45,350,336.72 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 5,892.53 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 45,356,229.25 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,697,480.17 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,213.90 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,698,694.07 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 100,316.91 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 45.10 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 100,362.01 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 80,703.66 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 80,703.66 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,265.66 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 5,892.53 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币

1,213.90元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币45.10元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币114.13元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币790,952,811.36元，自应收利息转入的重分类金额为人民币114.13元。经上述重分类后，交易性金融资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币790,952,925.49元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

7.4.6.2　增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金

融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3　企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

7.4.6.4　个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息

所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	43,280,289.30	45,350,336.72
等于：本金	43,275,897.61	45,350,336.72
加：应计利息	4,391.69	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	43,280,289.30	45,350,336.72

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		371,678,851.31	-	348,850,580.84	-22,828,270.47
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,262,100.00	1,491.04	1,477,022.95	213,431.91
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,262,100.00	1,491.04	1,477,022.95	213,431.91
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		372,940,951.31	1,491.04	350,327,603.79	-22,614,838.56
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		637,860,938.88	-	790,613,222.13	152,752,283.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	237,100.00	-	339,589.23	102,489.23
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	237,100.00	-	339,589.23	102,489.23
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		638,098,038.88	-	790,952,811.36	152,854,772.48

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 债权投资

无。

7.4.7.6 其他债权投资

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	7,265.66
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	7,265.66

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	92.26	207.56
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	251,665.14	1,062,307.54
其中：交易所市场	251,665.14	1,062,307.54
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	199,000.00	79,000.00
其他	145,262.54	145,262.54
合计	846,019.94	1,536,777.64

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	666,145,346.56	666,145,346.56
本期申购	27,228,042.61	27,228,042.61
本期赎回（以“-”号填列）	-192,749,448.19	-192,749,448.19
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	500,623,940.98	500,623,940.98

注：申购含转换入，赎回含转换出。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	281,009,362.10	-107,606,652.88	173,402,709.22
本期利润	-99,523,300.27	-175,469,611.04	-274,992,911.31
本期基金份额交易产生的变动数	-70,793,074.57	66,887,032.35	-3,906,042.22
其中：基金申购款	9,439,083.00	-9,741,987.44	-302,904.44
基金赎回款	-80,232,157.57	76,629,019.79	-3,603,137.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	110,692,987.26	-216,189,231.57	-105,496,244.31

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	210,803.17	152,923.05
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	14,047.44	25,502.64
其他	2,332.16	2,989.19
合计	227,182.77	181,414.88

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-93,512,309.47	154,299,261.52
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-93,512,309.47	154,299,261.52

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,392,750,207.06	1,860,929,051.35
减：卖出股票成本总额	1,482,439,156.46	1,706,629,789.83

减：交易费用	3,823,360.07	-
买卖股票差价收入	-93,512,309.47	154,299,261.52

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,761.03	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,832.10	294,399.36
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	13,593.13	294,399.36

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	90,952.70	1,100,835.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	79,000.00	804,500.00
减：应计利息总额	120.51	1,936.21
减：交易费用	0.09	-
买卖债券差价收入	11,832.10	294,399.36

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,882,042.69	2,251,429.39

其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,882,042.69	2,251,429.39

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-175,469,611.04	38,948,328.96
股票投资	-175,580,553.72	39,384,828.01
债券投资	110,942.68	-436,499.05
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2.衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-175,469,611.04	38,948,328.96

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	213,702.98	165,385.41
基金转换费收入	16,198.99	548.22
合计	229,901.97	165,933.63

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
交易费用	-	5,166,652.69
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	10,538.10	12,065.04

账户维护费	36,000.00	36,000.00
上市年费	-	60,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	237,738.10	5,465,917.73

7.4.7.24 分部报告

无。

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

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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（“星展银行”）	基金管理人的股东
安徽省信用融资担保集团有限公司	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（“长盛创富”）	基金管理人的全资子公司

注：以下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

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,822,257.43	10,730,939.26
其中：支付销售机构的客户维护费	3,049,066.63	4,229,486.24

注：基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,303,709.50	1,788,489.91

注：基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

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

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

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

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

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国银行	43,280,289.30	210,803.17	45,350,336.72	152,923.05
合计	43,280,289.30	210,803.17	45,350,336.72	152,923.05

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

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

7.4.12 期末（2022 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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	6 个月	限售期锁定	38.46	25.28	566	21,768.36	14,308.48	-
301152	天力锂能	2022 年 8 月 19 日	6 个月	限售期锁定	57.00	46.63	356	20,292.00	16,600.28	-
301161	唯万密封	2022 年 9 月 6 日	6 个月	限售期锁定	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301171	易点天下	2022 年 8 月 10 日	6 个月	限售期锁定	18.18	17.72	804	14,616.72	14,246.88	-
301231	荣信文化	2022 年 8 月 31 日	6 个月	限售期锁定	25.49	20.39	275	7,009.75	5,607.25	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	限售期锁定	41.52	34.28	158	6,560.16	5,416.24	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	限售期锁定	33.65	69.58	575	19,348.75	40,008.50	-

301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	限售期锁定	13.28	11.60	819	10,876.32	9,500.40	-
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	限售期锁定	32.69	87.85	475	15,527.75	41,728.75	-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	限售期锁定	25.68	28.38	210	5,392.80	5,959.80	-
301273	瑞晨环保	2022年10月11日	6个月	限售期锁定	37.89	37.85	277	10,495.53	10,484.45	-
301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月	限售期锁定	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	限售期锁定	44.09	35.80	330	14,549.70	11,814.00	-
301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月	限售期锁定	18.19	14.94	1,042	18,953.98	15,567.48	-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	限售期锁定	8.48	14.31	1,015	8,607.20	14,524.65	-
301300	远翔新材	2022年8月9日	6个月	限售期锁定	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	限售期锁定	43.23	42.17	255	11,023.65	10,753.35	-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	限售期锁定	39.00	24.44	228	8,892.00	5,572.32	-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	限售期锁定	13.88	16.56	832	11,548.16	13,777.92	-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	限售期锁定	25.25	29.46	247	6,236.75	7,276.62	-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	限售期锁定	7.60	17.67	359	2,728.40	6,343.53	-
301318	维海德	2022年8月3	6个月	限售期锁定	64.68	41.73	206	13,324.08	8,596.38	-

		日								
301319	唯特偶	2022 年 9 月 22 日	6 个月	限售期锁定	47.75	53.38	115	5,491.25	6,138.70	-
301327	华宝新能	2022 年 9 月 8 日	6 个月	限售期锁定	237.50	176.97	206	48,925.00	36,455.82	-
301328	维峰电子	2022 年 8 月 30 日	6 个月	限售期锁定	78.80	76.95	191	15,050.80	14,697.45	-
301339	通行宝	2022 年 9 月 2 日	6 个月	限售期锁定	18.78	15.58	897	16,845.66	13,975.26	-
301349	信德新材	2022 年 8 月 30 日	6 个月	限售期锁定	138.88	103.44	108	14,999.04	11,171.52	-
301363	美好医疗	2022 年 9 月 28 日	6 个月	限售期锁定	30.66	38.22	445	13,643.70	17,007.90	-
301368	丰立智能	2022 年 12 月 7 日	6 个月	限售期锁定	22.33	18.81	337	7,525.21	6,338.97	-
301391	卡莱特	2022 年 11 月 24 日	6 个月	限售期锁定	96.00	81.67	198	19,008.00	16,170.66	-
301398	星源卓镁	2022 年 12 月 8 日	6 个月	限售期锁定	34.40	29.36	255	8,772.00	7,486.80	-
688041	海光信息	2022 年 8 月 5 日	6 个月	限售期锁定	36.00	39.10	10,407	374,652.00	406,913.70	-
688143	长盈通	2022 年 12 月 1 日	6 个月	限售期锁定	35.67	44.48	1,938	69,128.46	86,202.24	-
688372	伟测科技	2022 年 10 月 19 日	6 个月	限售期锁定	61.49	88.60	2,090	128,514.10	185,174.00	-
688428	诺诚健华	2022 年 9 月 14 日	6 个月	限售期锁定	11.03	12.83	51,894	572,390.82	665,800.02	-

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

售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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，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，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。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

于 2022 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和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.37%（2021 年 12 月 31 日：0.04%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。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资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	43,275,897.61	-	-	4,391.69	43,280,289.30
结算备付金	138,738.51	-	-	62.40	138,800.91
存出保证金	125,133.18	-	-	56.30	125,189.48
交易性金融资产	-	172,186.71	1,303,345.20	348,852,071.88	350,327,603.79
应收申购款	-	-	-	16,181.40	16,181.40
应收清算款	-	-	-	3,466,542.84	3,466,542.84
资产总计	43,539,769.30	172,186.71	1,303,345.20	352,339,306.51	397,354,607.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	48,364.58	48,364.58
应付管理人报酬	-	-	-	511,551.73	511,551.73
应付托管费	-	-	-	85,258.61	85,258.61
应付清算款	-	-	-	980.00	980.00
应付利润	-	-	-	428,798.09	428,798.09
应交税费	-	-	-	305,938.10	305,938.10
其他负债	-	-	-	846,019.94	846,019.94
负债总计	-	-	-	2,226,911.05	2,226,911.05
利率敏感度缺口	43,539,769.30	172,186.71	1,303,345.20	350,112,395.46	395,127,696.67
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	45,350,336.72	-	-	-	45,350,336.72
结算备付金	2,697,480.17	-	-	-	2,697,480.17
存出保证金	100,316.91	-	-	-	100,316.91
交易性金融资产	-	199,569.63	140,019.60	790,613,222.13	790,952,811.36
应收清算款	-	-	-	4,253,483.78	4,253,483.78
应收申购款	-	-	-	80,703.66	80,703.66
其他资产	-	-	-	7,265.66	7,265.66
资产总计	48,148,133.80	199,569.63	140,019.60	794,954,675.23	843,442,398.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	204,026.79	204,026.79

应付管理人报酬	-	-	-	1,216,119.76	1,216,119.76
应付托管费	-	-	-	202,686.62	202,686.62
应交税费	-	-	-	305,933.58	305,933.58
应付利润	-	-	-	428,798.09	428,798.09
其他负债	-	-	-	1,536,777.64	1,536,777.64
负债总计	-	-	-	3,894,342.48	3,894,342.48
利率敏感度缺口	48,148,133.80	199,569.63	140,019.60	791,060,332.75	839,548,055.78

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进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

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

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	348,850,580.84	88.29	790,613,222.13	94.17
合计	348,850,580.84	88.29	790,613,222.13	94.17

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；

	Beta 系数是根据组合在过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末 （2021 年 12 月 31 日 ）
分析	+5%	24,140,277.24	80,337,956.99
	-5%	-24,140,277.24	-80,337,956.99

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	348,575,148.82	789,052,044.29
第二层次	-	80,953.93
第三层次	1,752,454.97	1,819,813.14
合计	350,327,603.79	790,952,811.36

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,819,813.14	1,819,813.14
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,907,264.20	1,907,264.20
转出第三层次	-	1,833,724.64	1,833,724.64
当期利得或损失总额	-	-140,897.73	-140,897.73
其中：计入损益的利得或损失	-	-140,897.73	-140,897.73
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,752,454.97	1,752,454.97
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	207,423.86	207,423.86
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,350,504.70	1,350,504.70
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	469,308.44	469,308.44
其中：计入损益的利得或损失	-	469,308.44	469,308.44
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,819,813.14	1,819,813.14
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未	-	469,308.44	469,308.44

实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,752,454.97	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.190909-0.879166	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,819,813.14	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.260952-1.122072	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2023年3月28日经本基金的基金管理人批准。

§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	348,850,580.84	87.79

	其中：股票	348,850,580.84	87.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,477,022.95	0.37
	其中：债券	1,477,022.95	0.37
	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	43,419,090.21	10.93
8	其他各项资产	3,607,913.72	0.91
9	合计	397,354,607.72	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	299,112,097.21	75.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	138,769.48	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	170,274.25	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	103,233.49	0.03
H	住宿和餐饮业	150,574.80	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,903,350.78	5.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	14,138,818.60	3.58
L	租赁和商务服务业	12,961,800.00	3.28
M	科学研究和技术服务业	805,440.11	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	237,870.90	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,114.36	0.00
Q	卫生和社会工作	42,510.90	0.01
R	文化、体育和娱乐业	75,725.96	0.02
S	综合	-	-
	合计	348,850,580.84	88.29

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601012	隆基绿能	511,624	21,621,230.24	5.47
2	002459	晶澳科技	268,800	16,152,192.00	4.09
3	300750	宁德时代	39,178	15,413,408.76	3.90
4	002594	比亚迪	57,999	14,904,003.03	3.77
5	688111	金山办公	51,800	13,700,582.00	3.47
6	601888	中国中免	60,000	12,961,800.00	3.28
7	603596	伯特利	160,000	12,768,000.00	3.23
8	300760	迈瑞医疗	39,800	12,575,606.00	3.18
9	300724	捷佳伟创	108,000	12,314,160.00	3.12
10	002531	天顺风能	800,000	12,104,000.00	3.06
11	688223	晶科能源	800,000	11,720,000.00	2.97
12	300395	菲利华	199,973	10,998,515.00	2.78
13	688599	天合光能	168,000	10,711,680.00	2.71
14	600519	贵州茅台	6,000	10,362,000.00	2.62
15	000002	万　　科A	560,000	10,192,000.00	2.58
16	000519	中兵红箭	518,000	10,173,520.00	2.57
17	300776	帝尔激光	80,013	10,081,638.00	2.55
18	601689	拓普集团	168,993	9,899,609.94	2.51
19	603985	恒润股份	369,910	9,136,777.00	2.31
20	600132	重庆啤酒	69,927	8,907,301.26	2.25
21	002475	立讯精密	268,000	8,509,000.00	2.15
22	300443	金雷股份	188,000	7,572,640.00	1.92
23	300751	迈为股份	18,000	7,413,120.00	1.88
24	002466	天齐锂业	88,000	6,951,120.00	1.76
25	002179	中航光电	116,300	6,717,488.00	1.70
26	300073	当升科技	118,000	6,655,200.00	1.68
27	600438	通威股份	160,000	6,172,800.00	1.56
28	603606	东方电缆	88,000	5,969,040.00	1.51
29	002371	北方华创	26,000	5,857,800.00	1.48
30	600536	中国软件	99,990	5,832,416.70	1.48
31	002472	双环传动	180,000	4,581,000.00	1.16
32	688082	盛美上海	51,800	4,138,820.00	1.05
33	600048	保利发展	260,000	3,933,800.00	1.00
34	002508	老板电器	88,000	2,442,880.00	0.62
35	603658	安图生物	36,000	2,226,600.00	0.56
36	688428	诺诚健华	51,894	665,800.02	0.17
37	688271	联影医疗	2,872	508,286.56	0.13

38	688041	海光信息	10,407	406,913.70	0.10
39	688558	国盛智科	8,488	297,674.16	0.08
40	688131	皓元医药	2,737	296,636.06	0.08
41	688351	微电生理	10,489	277,643.83	0.07
42	301018	申菱环境	7,811	267,526.75	0.07
43	688711	宏微科技	2,611	242,300.80	0.06
44	688789	宏华数科	1,400	241,682.00	0.06
45	688276	百克生物	3,486	240,917.46	0.06
46	301168	通灵股份	3,281	237,445.97	0.06
47	688151	华强科技	12,238	233,378.66	0.06
48	688114	华大智造	1,929	214,331.19	0.05
49	688432	有研硅	15,514	205,405.36	0.05
50	688677	海泰新光	1,768	199,784.00	0.05
51	300507	苏奥传感	35,229	195,873.24	0.05
52	688061	灿瑞科技	2,052	191,554.20	0.05
53	688231	隆达股份	5,223	186,565.56	0.05
54	688308	欧科亿	2,457	185,503.50	0.05
55	688372	伟测科技	2,090	185,174.00	0.05
56	301363	美好医疗	4,447	184,731.72	0.05
57	688317	之江生物	5,494	183,499.60	0.05
58	301216	万凯新材	6,343	181,917.24	0.05
59	688560	明冠新材	3,832	177,421.60	0.04
60	688353	华盛锂电	2,669	172,737.68	0.04
61	688503	聚和材料	1,146	170,880.06	0.04
62	688362	甬矽电子	7,779	169,504.41	0.04
63	301391	卡莱特	1,976	168,189.66	0.04
64	301039	中集车辆	20,640	164,500.80	0.04
65	688237	超卓航科	2,891	161,664.72	0.04
66	300421	力星股份	14,000	161,560.00	0.04
67	688147	微导纳米	6,293	157,828.44	0.04
68	688084	晶品特装	1,875	155,025.00	0.04
69	301297	富乐德	10,147	151,595.97	0.04
70	301073	君亭酒店	2,148	150,574.80	0.04
71	301339	通行宝	8,967	147,695.16	0.04
72	301311	昆船智能	8,320	146,540.16	0.04
73	300925	法本信息	10,197	132,051.15	0.03
74	688699	明微电子	2,766	126,931.74	0.03
75	301189	奥尼电子	4,345	124,180.10	0.03
76	301290	东星医疗	3,291	122,644.23	0.03
77	688247	宣泰医药	7,155	119,846.25	0.03
78	301349	信德新材	1,078	118,317.72	0.03
79	688265	南模生物	2,374	116,326.00	0.03
80	688273	麦澜德	3,568	116,316.80	0.03

81	688456	有研粉材	3,396	115,464.00	0.03
82	688257	新锐股份	2,899	113,292.92	0.03
83	605499	东鹏饮料	632	112,432.80	0.03
84	688496	清越科技	12,000	108,960.00	0.03
85	688667	菱电电控	1,191	103,640.82	0.03
86	688103	国力股份	1,595	102,622.30	0.03
87	688251	井松智能	3,392	100,844.16	0.03
88	301265	华新环保	8,181	99,390.42	0.03
89	688698	伟创电气	4,751	98,393.21	0.02
90	301193	家联科技	2,970	98,336.70	0.02
91	688636	智明达	918	96,867.36	0.02
92	688236	春立医疗	4,052	96,478.12	0.02
93	688173	希荻微	4,236	96,284.28	0.02
94	688601	力芯微	1,644	92,705.16	0.02
95	688355	明志科技	2,710	91,950.30	0.02
96	301181	标榜股份	2,564	91,688.64	0.02
97	301196	唯科科技	2,705	90,833.90	0.02
98	688121	卓然股份	3,681	89,963.64	0.02
99	688618	三旺通信	1,117	89,248.30	0.02
100	301136	招标股份	7,172	89,076.24	0.02
101	688049	炬芯科技	3,260	88,183.00	0.02
102	688661	和林微纳	1,452	87,555.60	0.02
103	688252	天德钰	5,201	87,220.77	0.02
104	688143	长盈通	1,938	86,202.24	0.02
105	688228	开普云	2,718	85,888.80	0.02
106	301026	浩通科技	2,027	85,134.00	0.02
107	688737	中自科技	2,186	82,674.52	0.02
108	688227	品高股份	4,164	81,739.32	0.02
109	688160	步科股份	2,771	80,414.42	0.02
110	301313	凡拓数创	2,464	79,706.01	0.02
111	300930	屹通新材	3,220	77,666.40	0.02
112	300926	博俊科技	3,584	74,654.72	0.02
113	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.02
114	301285	鸿日达	5,643	73,945.48	0.02
115	688455	科捷智能	5,277	71,819.97	0.02
116	001270	铖昌科技	568	69,296.00	0.02
117	300912	凯龙高科	5,117	69,130.67	0.02
118	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.02
119	688365	光云科技	8,249	65,167.10	0.02
120	300927	江天化学	3,893	64,078.78	0.02
121	301270	汉仪股份	2,095	62,886.80	0.02
122	688195	腾景科技	2,693	61,561.98	0.02
123	688799	华纳药厂	1,917	61,018.11	0.02

124	688611	杭州柯林	1,400	60,704.00	0.02
125	688619	罗普特	5,856	60,551.04	0.02
126	301158	德石股份	3,783	59,960.55	0.02
127	300814	中富电路	3,280	59,236.80	0.01
128	688113	联测科技	1,415	59,019.65	0.01
129	688013	天臣医疗	3,022	58,596.58	0.01
130	300957	贝泰妮	392	58,502.08	0.01
131	688669	聚石化学	2,681	57,480.64	0.01
132	688571	杭华股份	8,200	57,318.00	0.01
133	301309	万得凯	2,271	56,688.18	0.01
134	300922	天秦装备	4,008	54,989.76	0.01
135	001269	欧晶科技	546	54,185.04	0.01
136	301055	张小泉	3,541	53,894.02	0.01
137	603939	益丰药房	832	53,114.88	0.01
138	301038	深水规院	3,458	51,109.24	0.01
139	688480	赛恩斯	2,302	50,920.24	0.01
140	688319	欧林生物	3,412	47,324.44	0.01
141	301056	森赫股份	5,716	43,498.76	0.01
142	001330	博纳影业	3,564	42,696.72	0.01
143	688255	凯尔达	1,648	42,370.08	0.01
144	301153	中科江南	398	42,363.12	0.01
145	688511	天微电子	1,490	42,345.80	0.01
146	688350	富淼科技	2,552	41,954.88	0.01
147	301269	华大九天	475	41,728.75	0.01
148	301041	金百泽	2,150	41,129.50	0.01
149	688616	西力科技	3,918	40,982.28	0.01
150	301062	上海艾录	5,225	40,755.00	0.01
151	688191	智洋创新	3,203	40,614.04	0.01
152	300136	信维通信	2,443	40,333.93	0.01
153	688316	青云科技	1,428	40,326.72	0.01
154	300961	深水海纳	3,936	40,304.64	0.01
155	300919	中伟股份	610	40,022.10	0.01
156	301239	普瑞眼科	575	40,008.50	0.01
157	300948	冠中生态	3,230	39,793.60	0.01
158	688622	禾信仪器	1,204	39,130.00	0.01
159	300920	润阳科技	2,503	38,871.59	0.01
160	300979	华利集团	661	37,749.71	0.01
161	688117	圣诺生物	1,672	37,151.84	0.01
162	301072	中捷精工	1,802	36,941.00	0.01
163	688109	品茗科技	1,301	36,818.30	0.01
164	301029	怡合达	555	36,485.70	0.01
165	301327	华宝新能	206	36,455.82	0.01
166	300861	美畅股份	738	36,280.08	0.01

167	688607	康众医疗	1,890	35,815.50	0.01
168	301177	迪阿股份	568	35,772.64	0.01
169	301068	大地海洋	1,436	35,268.16	0.01
170	600955	维远股份	1,694	35,184.38	0.01
171	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.01
172	300973	立高食品	360	34,624.80	0.01
173	301238	瑞泰新材	1,513	34,027.37	0.01
174	301211	亨迪药业	967	33,506.55	0.01
175	001258	立新能源	3,188	33,346.48	0.01
176	300995	奇德新材	1,909	33,044.79	0.01
177	601156	东航物流	2,090	31,893.40	0.01
178	605090	九丰能源	1,526	31,511.90	0.01
179	688395	正弦电气	1,627	29,383.62	0.01
180	301217	铜冠铜箔	2,348	29,091.72	0.01
181	601022	宁波远洋	1,983	26,770.50	0.01
182	688092	爱科科技	1,137	26,401.14	0.01
183	605077	华康股份	865	26,244.10	0.01
184	605337	李子园	1,103	25,843.29	0.01
185	605377	华旺科技	1,050	25,767.00	0.01
186	003029	吉大正元	716	25,246.16	0.01
187	001213	中铁特货	5,818	25,133.76	0.01
188	301215	中汽股份	4,743	24,521.31	0.01
189	688681	科汇股份	1,899	24,231.24	0.01
190	301101	明月镜片	371	23,380.42	0.01
191	601921	浙版传媒	3,154	23,339.60	0.01
192	603171	税友股份	637	23,186.80	0.01
193	300887	谱尼测试	680	22,174.80	0.01
194	301263	泰恩康	682	22,165.00	0.01
195	603255	鼎际得	488	21,911.20	0.01
196	605167	利柏特	2,471	20,805.82	0.01
197	301286	侨源股份	784	19,372.64	0.00
198	301120	新特电气	1,032	19,205.52	0.00
199	001323	慕思股份	573	18,977.76	0.00
200	605186	健麾信息	626	18,842.60	0.00
201	301096	百诚医药	272	18,580.32	0.00
202	603206	嘉环科技	1,210	18,500.90	0.00
203	003028	振邦智能	432	18,234.72	0.00
204	301201	诚达药业	353	17,932.40	0.00
205	605080	浙江自然	374	17,652.80	0.00
206	301087	可孚医疗	476	17,364.48	0.00
207	300893	松原股份	621	16,704.90	0.00
208	603235	天新药业	572	16,656.64	0.00
209	301152	天力锂能	356	16,600.28	0.00

210	603211	晋拓股份	1,286	16,152.16	0.00
211	301127	天源环保	1,685	16,091.75	0.00
212	001216	华瓷股份	1,177	16,066.05	0.00
213	003020	立方制药	486	15,697.80	0.00
214	301296	新巨丰	1,042	15,567.48	0.00
215	605368	蓝天燃气	1,204	14,869.40	0.00
216	603759	海天股份	1,656	14,837.76	0.00
217	003019	宸展光电	690	14,703.90	0.00
218	301328	维峰电子	191	14,697.45	0.00
219	605099	共创草坪	624	14,476.80	0.00
220	605268	王力安防	1,642	14,449.60	0.00
221	300986	志特新材	370	14,337.50	0.00
222	605169	洪通燃气	1,292	14,315.36	0.00
223	301139	元道通信	566	14,308.48	0.00
224	301171	易点天下	804	14,246.88	0.00
225	605183	确成股份	741	13,997.49	0.00
226	003030	祖名股份	480	13,977.60	0.00
227	301219	腾远钴业	202	13,923.86	0.00
228	605151	西上海	722	13,681.90	0.00
229	003033	征和工业	301	13,364.40	0.00
230	301100	风光股份	599	13,273.84	0.00
231	603130	云中马	480	13,176.00	0.00
232	300917	特发服务	476	13,018.60	0.00
233	001317	三羊马	300	12,840.00	0.00
234	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
235	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00
236	605136	丽人丽妆	867	12,120.66	0.00
237	605179	一鸣食品	939	11,962.86	0.00
238	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.00
239	001299	美能能源	576	11,635.20	0.00
240	301166	优宁维	253	11,569.69	0.00
241	605500	森林包装	1,128	11,302.56	0.00
242	301179	泽宇智能	295	11,260.15	0.00
243	603151	邦基科技	535	11,256.40	0.00
244	300891	惠云钛业	1,143	11,007.09	0.00
245	301221	光庭信息	280	10,894.80	0.00
246	605277	新亚电子	705	10,842.90	0.00
247	301306	西测测试	255	10,753.35	0.00
248	603213	镇洋发展	799	10,562.78	0.00
249	301273	瑞晨环保	277	10,484.45	0.00
250	300895	铜牛信息	374	10,371.02	0.00
251	301190	善水科技	575	10,338.50	0.00
252	605228	神通科技	1,217	10,320.16	0.00

253	605028	世茂能源	615	10,313.55	0.00
254	300884	狄耐克	1,049	10,301.18	0.00
255	001212	中旗新材	401	10,277.63	0.00
256	605058	澳弘电子	548	10,220.20	0.00
257	605300	佳禾食品	576	10,189.44	0.00
258	003032	传智教育	586	10,114.36	0.00
259	605599	菜百股份	980	9,976.40	0.00
260	605566	福莱蕙特	435	9,952.80	0.00
261	605319	无锡振华	764	9,878.52	0.00
262	301126	达嘉维康	662	9,857.18	0.00
263	603182	嘉华股份	546	9,778.86	0.00
264	003015	日久光电	1,128	9,689.52	0.00
265	003018	金富科技	1,027	9,643.53	0.00
266	605005	合兴股份	634	9,624.12	0.00
267	301298	东利机械	634	9,605.10	0.00
268	300993	玉马遮阳	738	9,594.00	0.00
269	301108	洁雅股份	280	9,452.80	0.00
270	300881	盛德鑫泰	291	9,338.19	0.00
271	001229	魅视科技	347	9,313.48	0.00
272	001207	联科科技	682	9,241.10	0.00
273	301259	艾布鲁	483	9,177.00	0.00
274	001219	青岛食品	354	9,126.12	0.00
275	301125	腾亚精工	370	8,913.30	0.00
276	603280	南方路机	363	8,893.50	0.00
277	300882	万胜智能	572	8,602.88	0.00
278	301318	维海德	206	8,596.38	0.00
279	605299	舒华体育	738	8,560.80	0.00
280	605258	协和电子	340	8,544.20	0.00
281	300994	久祺股份	420	8,282.40	0.00
282	301198	喜悦智行	341	8,265.84	0.00
283	003000	劲仔食品	684	8,064.36	0.00
284	001231	农心科技	355	8,037.20	0.00
285	003004	声迅股份	306	8,020.26	0.00
286	301199	迈赫股份	402	8,003.82	0.00
287	001210	金房节能	311	7,939.83	0.00
288	300879	大叶股份	466	7,894.04	0.00
289	605180	华生科技	499	7,789.39	0.00
290	605138	盛泰集团	723	7,779.48	0.00
291	001296	长江材料	403	7,745.66	0.00
292	001234	泰慕士	333	7,675.65	0.00
293	603272	联翔股份	443	7,646.18	0.00
294	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
295	301398	星源卓镁	255	7,486.80	0.00

296	301021	英诺激光	290	7,479.10	0.00
297	003041	真爱美家	419	7,374.40	0.00
298	605069	正和生态	790	7,347.00	0.00
299	605033	美邦股份	423	7,241.76	0.00
300	603048	浙江黎明	464	6,927.52	0.00
301	301138	华研精机	285	6,774.45	0.00
302	300978	东箭科技	593	6,617.88	0.00
303	001202	炬申股份	459	6,595.83	0.00
304	301028	东亚机械	733	6,545.69	0.00
305	301316	慧博云通	359	6,343.53	0.00
306	301368	丰立智能	337	6,338.97	0.00
307	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
308	300985	致远新能	295	6,177.30	0.00
309	301319	唯特偶	115	6,138.70	0.00
310	300889	爱克股份	479	6,131.20	0.00
311	001209	洪兴股份	450	6,102.00	0.00
312	301231	荣信文化	275	5,607.25	0.00
313	300963	中洲特材	368	5,586.24	0.00
314	301182	凯旺科技	294	5,533.08	0.00
315	301233	盛帮股份	158	5,416.24	0.00
316	300958	建工修复	300	5,106.00	0.00
317	002409	雅克科技	100	5,037.00	0.00
318	301081	严牌股份	403	4,650.62	0.00
319	300943	春晖智控	383	4,622.81	0.00
320	301083	百胜智能	416	4,592.64	0.00
321	301020	密封科技	263	4,389.47	0.00
322	301025	读客文化	403	4,082.39	0.00
323	300960	通业科技	234	3,987.36	0.00
324	301027	华蓝集团	286	3,861.00	0.00
325	301037	保立佳	213	3,422.91	0.00
326	603882	金域医学	32	2,502.40	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	000002	万　　科A	36,016,286.95	4.29
2	600519	贵州茅台	24,943,457.00	2.97
3	000792	盐湖股份	24,119,666.66	2.87
4	002466	天齐锂业	23,673,372.74	2.82
5	688126	沪硅产业	21,558,435.86	2.57
6	603063	禾望电气	21,184,117.54	2.52
7	601888	中国中免	21,000,503.30	2.50

8	600438	通威股份	20,683,202.17	2.46
9	688599	天合光能	19,884,202.88	2.37
10	002594	比亚迪	18,644,925.05	2.22
11	002460	赣锋锂业	18,414,823.00	2.19
12	300443	金雷股份	18,100,823.16	2.16
13	002756	永兴材料	17,855,664.00	2.13
14	002531	天顺风能	17,758,000.00	2.12
15	300666	江丰电子	17,638,538.48	2.10
16	600132	重庆啤酒	17,180,802.88	2.05
17	300438	鹏辉能源	17,076,403.00	2.03
18	603520	司太立	17,044,495.00	2.03
19	002459	晶澳科技	16,946,339.44	2.02
20	600030	中信证券	16,801,889.00	2.00

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	300750	宁德时代	46,308,809.00	5.52
2	002466	天齐锂业	43,796,127.50	5.22
3	300274	阳光电源	35,907,521.82	4.28
4	002812	恩捷股份	33,234,630.98	3.96
5	002459	晶澳科技	31,767,339.60	3.78
6	600519	贵州茅台	30,525,417.25	3.64
7	601012	隆基绿能	30,355,173.34	3.62
8	603259	药明康德	29,882,901.40	3.56
9	002709	天赐材料	25,055,244.54	2.98
10	000792	盐湖股份	23,602,101.00	2.81
11	000002	万　　科 A	23,307,431.03	2.78
12	601633	长城汽车	22,919,875.00	2.73
13	603806	福斯特	20,871,093.80	2.49
14	300666	江丰电子	19,277,359.81	2.30
15	600660	福耀玻璃	18,758,133.00	2.23
16	688126	沪硅产业	17,927,009.73	2.14
17	300440	运达科技	17,749,733.00	2.11
18	002460	赣锋锂业	17,619,269.00	2.10
19	002475	立讯精密	17,307,082.71	2.06
20	603063	禾望电气	17,011,174.96	2.03
21	300014	亿纬锂能	16,956,656.25	2.02

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	1,216,257,068.89
卖出股票收入（成交）总额	1,392,750,207.06

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

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）	1,477,022.95	0.37
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,477,022.95	0.37

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

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	113053	隆 22 转债	7,230	826,448.62	0.21
2	113061	拓普转债	3,810	478,326.29	0.12
3	128136	立讯转债	1,581	172,248.04	0.04

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 只债券。

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

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

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	125,189.48
2	应收清算款	3,466,542.84
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,181.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,607,913.72

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113053	隆 22 转债	826,448.62	0.21
2	128136	立讯转债	172,248.04	0.04

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	户均持有的	持有人结构

（户）	基金份额	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（%）
26,014	19,244.40	17,794,172.92	3.55	482,829,768.06	96.45

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	黄晓峰	709,737.00	1.81
2	方涛	691,838.00	1.76
3	高兆明	577,298.00	1.47
4	陈克明	387,000.00	0.98
5	陈秀云	377,587.00	0.96
6	高德荣	322,700.00	0.82
7	包钢	299,019.00	0.76
8	李萍	244,469.00	0.62
9	王远芳	233,303.00	0.59
10	林月清	211,000.00	0.54

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	128.64	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（2007 年 1 月 5 日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	666,145,346.56
本报告期基金总申购份额	27,228,042.61
减：本报告期基金总赎回份额	192,749,448.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	500,623,940.98

§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

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

11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期内应支付该会计师事务所的报酬为 70,000.00 元。已连续为本基金服务 22 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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 7 月 19 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	对子公司管控不严格
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	不适用

其他	-

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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(%)	
安信证券	2	1,077,223,212.25	41.57	787,764.43	36.32	-
中信建投	2	498,706,744.35	19.25	464,444.97	21.41	-
东兴证券	1	379,229,494.51	14.64	353,176.51	16.28	-
长城证券	1	236,332,283.15	9.12	220,096.23	10.15	-
东方财富证券	2	138,439,284.41	5.34	101,241.30	4.67	-
国信证券	1	124,135,364.19	4.79	115,607.24	5.33	-
国泰君安	1	70,091,181.73	2.70	64,067.51	2.95	-
东北证券	2	36,340,830.33	1.40	33,842.81	1.56	-
长江证券	2	30,721,721.49	1.19	28,600.87	1.32	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
星展证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	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(%)
安信证券	471,952.70	39.50	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	723,000.00	60.50	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
星展证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

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、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	长江证券	北京	1
2	中银国际证券	深圳	1

（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	中信证券	深圳	1

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于终止部分基金销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 01 月 01 日
2	长盛基金管理有限公司关于增加东方财富证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投、转换及费率优惠业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 01 月 14 日
3	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 01 月 22 日
4	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行同业易管家平台为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 01 月 27 日
5	长盛基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资北交所上市股票的风险提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 02 月 28 日
6	长盛基金管理有限公司关于增加申万宏源西部证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投和转换业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 03 月 04 日
7	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加广发证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 03 月 25 日
8	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）2021 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 03 月 31 日
9	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 04 月 22 日
10	长盛基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 05 月 31 日
11	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加陆享基金等三家基金销售公司并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 06 月 13 日
12	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加华安证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 06 月 20 日
13	长盛基金管理有限公司关于旗下基金	中国证监会指定披露媒	2022 年 06 月 22 日

	参加申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司费率优惠活动的公告	介	
14	长盛基金管理有限公司关于部分基金增加代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 08 日
15	长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 07 月 20 日
16	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2022 年 08 月 08 日
17	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年中期报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 08 月 27 日
18	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加中泰证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 09 月 28 日
19	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加攀赢基金为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	中国证监会指定披露媒介	2022 年 10 月 19 日
20	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加兴业银行银银平台为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 10 月 25 日
21	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）2022 年第 3 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 10 月 26 日
22	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加国新证券费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 11 月 09 日
23	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加平安银行为代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 12 月 09 日
24	长盛基金管理有限公司关于增加华宝证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投业务与转换业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2022 年 12 月 22 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

本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据公司第八届董事会相关会议决议，选举胡甲先生担任公司董事长，同时代行公司总经理职务，代行总经理职务期限不超 6 个月；高民和先生不再担任公司董事长，周兵先生不再担任公司总经理职务。公司已按规定向相关监管机构报备并进行公告。本次高管变更属于公司管理层正常变动，符合《中华人民共和国公司法》《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人

员及从业人员监督管理办法》《长盛基金管理有限公司章程》的有关规定，对公司经营管理及基金份额持有人的合法权益无实质性影响。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）相关批准文件；

2、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、《长盛同智优势成长混合型证券投资基金（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的办公地址和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司

2023 年 3 月 31 日