

长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末上市基金前十名持有人	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	55
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛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	493,318,394.08 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	本基金为主动管理的混合型基金，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。主要选股思路是采用自上而下的路径，投资策略上偏重选股能力的发挥。
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
	联系电话	010-86497608
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn
客户服务电话	400-888-2666、010-86497888	95566
传真	010-86497999	010-66594942
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	胡甲	葛海蛟

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-50,133,412.20
本期利润	-23,519,562.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0473
本期加权平均净值利润率	-5.90%
本期基金份额净值增长率	-6.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-127,729,726.10
期末可供分配基金份额利润	-0.2589
期末基金资产净值	365,588,667.98
期末基金份额净值	0.7411
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	119.74%

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

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

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
过去一个月	-1.79%	0.79%	0.90%	0.56%	-2.69%	0.23%
过去三个月	-11.37%	1.24%	-2.90%	0.54%	-8.47%	0.70%

过去六个月	-6.11%	1.19%	0.28%	0.55%	-6.39%	0.64%
过去一年	-27.53%	1.44%	-8.24%	0.64%	-19.29%	0.80%
过去三年	-6.65%	1.80%	-0.63%	0.78%	-6.02%	1.02%
自基金转型起至今	119.74%	1.52%	107.50%	1.08%	12.24%	0.44%

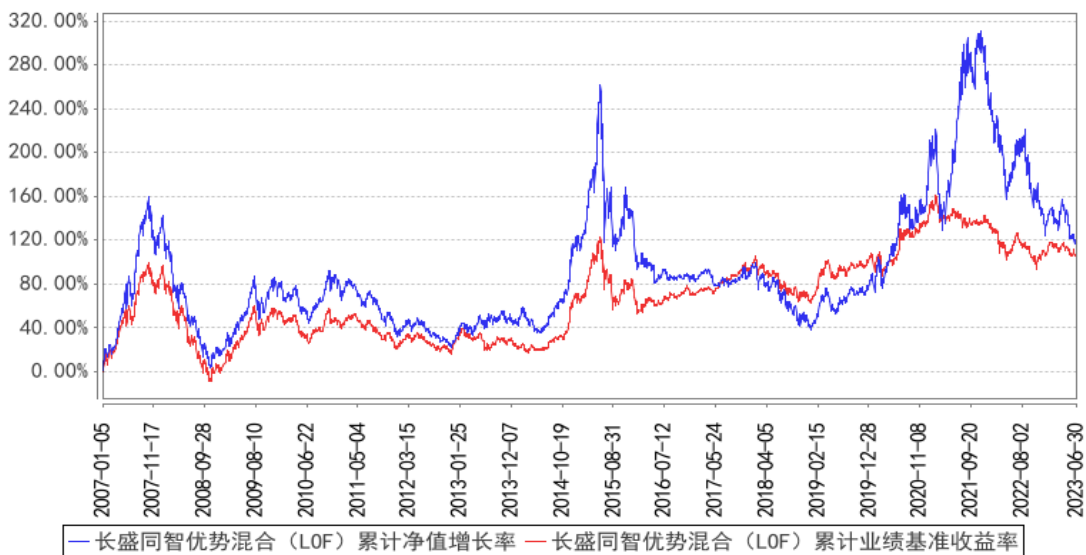
注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×65%+上证国债指数收益率×30%+一年定期存款利率×5%。

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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内首批成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金总部办公地位于北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，并拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行（DBS）有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用融资担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基金的投资顾问。截至 2023 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱文礼	本基金基金经理，长盛成长龙头混合型证券投资基金基金经理，长盛成长精选混合型证券投资基金基金经理。	2023 年 4 月 13 日	-	14 年	钱文礼先生，硕士。曾任平安证券，金元证券，国海证券研究员。2013 年 12 月加入长盛基金管理有限公司，曾任行业研究员，基金经理助理等职务。
孟棋	本基金基金经理。	2020 年 10 月 23 日	2023 年 4 月 13 日	14 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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

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

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

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

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内经济上下起伏较大，在一季度快速恢复，特别是消费迎来了疫情之后的爆发性增长。但是进入二季度后宏观经济明显走弱，工业利润和工业增加值双双走低，CPI 和 PPI 持续低迷，货币增速回落，制造业 PMI 回落到 50 以下，服务业 PMI 也见顶回落。3 月份之后消费逐月走弱，以房地产基建等为代表的传统经济领域回落尤为明显，新兴产业如新能源、高端装备等持续增长，国内经济转型持续推进。短期看经济整体增速不可能持续前期高增长，但是结构持续改善，质量明显提高。

本基金在一季度较多参与了与 AI 主题等相关的行业和公司，计算机、传媒等行业持仓较多。自 4 月份管理本基金以来对组合进行了较大幅度调整，大幅度减持了 AI 相关的行业和公司，目前 AI 众多业务和技术过于早期，盈利能力、商业模式都不够清晰，同时技术变化日新月异，未来大部分公司能否把握住正确的技术方向也有待观察。在经历了前期大幅度上涨后估值明显超过历史平均水平，基金大幅度减持了估值偏高的 AI 相关公司。新能源经过接近 1 年的下跌大部分公司估值已经处于较低水平，部分公司的长期竞争力十分明显，甚至从全球范围看也是首屈一指，我们重点增加了新能源领域中有长期壁垒和竞争优势，同时能够兼顾国内外两个市场的公司。上半年同样大幅回调的还有家电等消费型行业，即使在当前消费需求趋缓的情况下部分消费龙头凭借其突出的品牌和过硬的产品依然能够维持稳定增长，同时估值已近达到历史较低水平，我们较大幅度增加了业绩增速稳定，估值合理的空调等行业公司，希望获得盈利增长带来的股价回报。

未来 1-2 个季度本基金将重点投资的方向为：

一、海外出口相关的产业和公司

虽然国内出口在 4 月和 5 月份经历了短暂的回落，但是 6 月份我们实地调研了多家出口型企业，订单和销售明显好转，同时我们看到众多出口型企业三季度出口订单开始明显提升。在汇率下调，大宗原材料成本下降，海运费用大幅下跌后，我们看到国内产品的全球竞争优势正在越发明显，相关上市公司的盈利情况也迎来明显改善。

海外经济在经历了美国持续加息的冲击之后，消费和投资显示出了较强的韧性，外加对于通胀预期好转，工资持续上涨，库存不断出清，海外有望迎来库存回补。无论是从海外需求或者是国内产品竞争力的角度看，未来 1-2 个季度的出口都非常值得期待。

二、国内需求有韧性，同时能够参与内循环和外循环的行业和公司

在需求不振，消费增速放缓的情况下，寻找有增长的消费型行业进行投资，最为典型的家电和新能源汽车行业。根据发达经济体经验，即使经济在进入低速增长的阶段，空调依然能够保持

持续较高速度增长，从上半年的空调安装的数据来看，空调行业今年业绩持续增长较为有保障。家电和汽车是出口的重要组成部分，因此在维持国内稳定增长的同时也能够享受海外出口的复苏。同时大宗商品的价格回落也能够持续提升家电和汽车行业的毛利率。

三、重点减持壁垒较低，市场较为单一的行业和公司

部分行业 and 公司的壁垒较低，同时市场较为单一，行业内公司出现内卷的情况，这类公司在未来经济增速趋缓的情况下盈利有急剧下滑的风险，对于这一类公司要坚定回避。

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 0.7411 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.11%，同期业绩比较基准收益率为 0.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年美联储加息逐步进入尾声，美国的固定资产投资特别是制造业固定资产投资高速增长，加息趋缓后消费有望逐步恢复。国内出口在下半年也有望扭转下滑趋势，在经历了去年 6-7 月份的高基数后，出口增速数据有望逐步转正。国内刺激内需的政策正逐步出台，国内消费有望逐步企稳回升。同时我们看到国内和海外库存都处在较低水平，下半年有可能出现国内外同时增加库存的情况。在经历了上半年的主题炒作以后进入报表兑现期，市场将更加重视业绩兑现情况，有业绩保障的相关个股有望在下半年取得良好收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同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 2023 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-127,729,726.10 元，其中：未分配利润已实现部分为 59,252,553.82 元，未分配利润未实现部分为-186,982,279.92 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	19,631,270.69	43,280,289.30
结算备付金		2,119,531.71	138,800.91
存出保证金		210,768.48	125,189.48
交易性金融资产	6.4.7.2	339,058,458.80	350,327,603.79
其中：股票投资		337,606,387.87	348,850,580.84
基金投资		-	-
债券投资		1,452,070.93	1,477,022.95
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		23,124,296.77	3,466,542.84
应收股利		-	-
应收申购款		64,488.07	16,181.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		384,208,814.52	397,354,607.72
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	-

应付清算款		14,638,318.49	980.00
应付赎回款		97,906.49	48,364.58
应付管理人报酬		457,464.08	511,551.73
应付托管费		76,244.02	85,258.61
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		305,932.19	305,938.10
应付利润		428,798.09	428,798.09
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,615,483.18	846,019.94
负债合计		18,620,146.54	2,226,911.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	493,318,394.08	500,623,940.98
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-127,729,726.10	-105,496,244.31
净资产合计		365,588,667.98	395,127,696.67
负债和净资产总计		384,208,814.52	397,354,607.72

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7411 元，基金份额总额 493,318,394.08 份。

6.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-19,938,176.52	-153,596,452.62
1. 利息收入		64,320.11	160,247.92
其中：存款利息收入	6.4.7.13	64,320.11	160,247.92
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-46,622,308.99	-59,358,534.92
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-49,427,157.07	-61,995,595.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	297,733.41	12,544.41

资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,507,114.67	2,624,516.30
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	26,613,850.14	-94,606,012.91
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	5,962.22	207,847.29
减：二、营业总支出		3,581,385.54	5,172,174.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,971,191.01	4,326,757.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	495,198.50	721,126.15
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		5.83	2.56
8. 其他费用	6.4.7.23	114,990.20	124,288.98
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-23,519,562.06	-158,768,627.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-23,519,562.06	-158,768,627.58
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-23,519,562.06	-158,768,627.58

6.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	500,623,940.98	-	-105,496,244.3	395,127,696.67

资产（基金净值）			1	
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）	500,623,940.98	-	-105,496,244.31	395,127,696.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-7,305,546.90	-	-22,233,481.79	-29,539,028.69
（一）、综合收益总额	-	-	-23,519,562.06	-23,519,562.06
（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）	-7,305,546.90	-	1,286,080.27	-6,019,466.63
其中：1. 基金申购款	6,831,593.15	-	-1,379,766.06	5,451,827.09
2. 基金赎回款	-14,137,140.05	-	2,665,846.33	-11,471,293.72
（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）	493,318,394.08	-	-127,729,726.10	365,588,667.98
项目	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	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	-	-	-	-

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）	-153,646,683.54	-	-161,801,337.26	-315,448,020.80
（一）、综合收益总额	-	-	-158,768,627.58	-158,768,627.58
（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）	-153,646,683.54	-	-3,032,709.68	-156,679,393.22
其中：1. 基金申购款	15,607,121.98	-	695,921.85	16,303,043.83
2. 基金赎回款	-169,253,805.52	-	-3,728,631.53	-172,982,437.05
（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）	512,498,663.02	-	11,601,371.96	524,100,034.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

胡甲

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%。

6.4.2 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 3 号《半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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	19,631,270.69
等于：本金	19,629,511.90
加：应计利息	1,758.79
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	19,631,270.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	333,603,400.65	-	337,606,387.87	4,002,987.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	49,578.57	1,452,070.93	-3,975.64
	银行间市场	-	-	-
	合计	49,578.57	1,452,070.93	-3,975.64
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	335,009,868.65	49,578.57	339,058,458.80	3,999,011.58

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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。

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 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	69.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,121,890.95
其中：交易所市场	2,121,890.95
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,260.15
其他	145,262.54
合计	2,615,483.18

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	500,623,940.98	500,623,940.98
本期申购	6,831,593.15	6,831,593.15

本期赎回（以“-”号填列）	-14,137,140.05	-14,137,140.05
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	493,318,394.08	493,318,394.08

注：申购含转换入，赎回含转换出。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	110,692,987.26	-216,189,231.57	-105,496,244.31
本期利润	-50,133,412.20	26,613,850.14	-23,519,562.06
本期基金份额交易产生的变动数	-1,307,021.24	2,593,101.51	1,286,080.27
其中：基金申购款	1,172,312.50	-2,552,078.56	-1,379,766.06
基金赎回款	-2,479,333.74	5,145,180.07	2,665,846.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,252,553.82	-186,982,279.92	-127,729,726.10

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	50,246.63
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	13,211.15
其他	862.33
合计	64,320.11

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-49,427,157.07
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	-49,427,157.07

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	1,786,321,437.08
减：卖出股票成本总额	1,830,678,536.00
减：交易费用	5,070,058.15
买卖股票差价收入	-49,427,157.07

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	8,929.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	288,803.53
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	297,733.41

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,236,621.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,946,000.00
减：应计利息总额	1,728.61
减：交易费用	89.44
买卖债券差价收入	288,803.53

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,507,114.67
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	2,507,114.67

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	26,613,850.14
股票投资	26,831,257.69
债券投资	-217,407.55
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	26,613,850.14

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,956.56
基金转换费收入	5.66
合计	5,962.22

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	7,130.05
账户维护费	18,000.00

其他	600.00
合计	114,990.20

6.4.7.24 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

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。

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,971,191.01	4,326,757.27
其中：支付销售机构的客户维护费	1,234,115.53	1,597,051.80

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基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	495,198.50	721,126.15

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	19,631,270.69	50,246.63	54,458,092.91	151,416.87

合计	19,631,270.69	50,246.63	54,458,092.91	151,416.87
----	---------------	-----------	---------------	------------

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	57.66	57.66	2,248	129,619.68	129,619.68	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	限售期锁定	9.60	9.93	3,767	36,163.20	37,406.31	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	限售期锁定	11.88	25.32	548	6,510.24	13,875.36	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	限售期锁定	18.88	20.03	114	2,152.32	2,283.42	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	限售期锁定	20.68	29.79	145	2,998.60	4,319.55	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	限售期锁定	15.38	16.45	177	2,722.26	2,911.65	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	限售期锁定	44.48	42.55	55	2,446.40	2,340.25	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	限售期锁定	41.20	42.71	262	10,794.40	11,190.02	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	限售期锁定	56.50	52.92	150	8,475.00	7,938.00	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	限售期锁定	50.00	30.71	459	22,950.00	14,095.89	-
301281	科源制	2023年3月	6个月	限售期	44.18	25.36	338	10,647.38	8,571.68	-

	药	月 28 日		锁定							
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	限售期 锁定	29.60	76.13	333	9,856.80	25,351.29	-	
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	6 个月	限售期 锁定	25.25	19.83	619	15,629.75	12,274.77	-	
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	限售期 锁定	13.06	23.16	642	8,384.52	14,868.72	-	
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	限售期 锁定	131.11	53.20	189	16,519.86	10,054.80	-	
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	限售期 锁定	14.81	13.74	896	13,269.76	12,311.04	-	
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	限售期 锁定	32.60	32.24	232	7,563.20	7,479.68	-	
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	限售期 锁定	73.45	46.64	166	12,192.70	7,742.24	-	
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	限售期 锁定	23.77	42.86	489	11,623.53	20,958.54	-	
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	限售期 锁定	71.88	92.81	134	9,631.92	12,436.54	-	
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	限售期 锁定	33.73	31.84	277	9,343.21	8,819.68	-	
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	限售期 锁定	23.80	35.90	408	9,710.40	14,647.20	-	
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	限售期 锁定	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-	
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	限售期 锁定	24.80	43.78	330	8,184.00	14,447.40	-	
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	限售期 锁定	26.35	33.25	229	6,034.15	7,614.25	-	
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	限售期 锁定	19.99	16.91	519	10,374.81	8,776.29	-	
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	限售期 锁定	57.66	57.66	250	14,415.00	14,415.00	-	
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	限售期 锁定	6.58	8.18	1,207	7,942.06	9,873.26	-	
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	限售期 锁定	10.36	12.59	433	4,485.88	5,451.47	-	
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	限售期 锁定	11.66	13.72	391	4,559.06	5,364.52	-	
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	限售期 锁定	25.98	26.51	141	3,663.18	3,737.91	-	
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	限售期 锁定	17.80	19.09	404	7,191.20	7,712.36	-	

688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	限售期锁定	19.86	18.07	2,456	48,776.16	44,379.92	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	限售期锁定	14.16	17.20	747	10,577.52	12,848.40	-
688352	硕中科技	2023年4月11日	6个月	限售期锁定	12.10	12.63	1,161	14,048.10	14,663.43	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	限售期锁定	23.60	78.84	389	9,180.40	30,668.76	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	限售期锁定	19.20	27.88	346	6,643.20	9,646.48	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	限售期锁定	75.00	90.95	161	12,075.00	14,642.95	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	限售期锁定	11.10	17.24	1,531	16,994.10	26,394.44	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	限售期锁定	33.99	29.83	299	10,163.01	8,919.17	-
688484	南芯科技	2023年3月28日	6个月	限售期锁定	39.99	38.64	417	16,675.83	16,112.88	-
688523	航天环宇	2023年5月26日	6个月	限售期锁定	21.86	25.43	472	10,317.92	12,002.96	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	限售期锁定	35.00	54.75	161	5,635.00	8,814.75	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	限售期锁定	21.17	24.18	587	12,426.79	14,193.66	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	限售期锁定	12.68	25.35	726	9,205.68	18,404.10	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	限售期锁定	125.80	118.08	107	13,460.60	12,634.56	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	限售期锁定	26.74	45.06	409	10,936.66	18,429.54	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	限售期锁定	11.18	16.26	959	10,721.62	15,593.34	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	限售期锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	限售期锁定	10.68	12.81	1,016	10,850.88	13,014.96	-
688623	双元科技	2023年5月31日	6个月	限售期锁定	125.88	89.31	111	13,972.68	9,913.41	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	限售期锁定	9.26	22.11	708	6,556.08	15,653.88	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	限售期锁定	25.28	30.89	292	7,381.76	9,019.88	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中

基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

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

4、本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。本基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

5、本基金可以通过网下发行获配的创业板股票。发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

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，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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.00%（2022 年 12 月 31 日：0.37%）。

6.4.13.3 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。

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 6.4.12 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 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,629,511.90	-	-	1,758.79	19,631,270.69
结算备付金	2,118,673.65	-	-	858.06	2,119,531.71
存出保证金	210,683.16	-	-	85.32	210,768.48
交易性金融资产	1,402,380.00	112.36	-	-337,655,966.44	339,058,458.80
应收申购款	-	-	-	64,488.07	64,488.07
应收清算款	-	-	-	-23,124,296.77	23,124,296.77
资产总计	23,361,248.71	112.36	-	-360,847,453.45	384,208,814.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	97,906.49	97,906.49
应付管理人报酬	-	-	-	457,464.08	457,464.08
应付托管费	-	-	-	76,244.02	76,244.02
应付清算款	-	-	-	-14,638,318.49	14,638,318.49
应付利润	-	-	-	428,798.09	428,798.09
应交税费	-	-	-	305,932.19	305,932.19
其他负债	-	-	-	-2,615,483.18	2,615,483.18
负债总计	-	-	-	-18,620,146.54	18,620,146.54
利率敏感度缺口	23,361,248.71	112.36	-	-342,227,306.91	365,588,667.98
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	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

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末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。

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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）

交易性金融资产—股票投资	337,606,387.87	92.35	348,850,580.84	88.29
合计	337,606,387.87	92.35	348,850,580.84	88.29

6.4.13.4.3.2 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。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	+5%	22,062,652.78	24,140,277.24
	-5%	-22,062,652.78	-24,140,277.24

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。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	336,730,256.10	348,575,148.82
第二层次	1,672,498.09	-
第三层次	655,704.61	1,752,454.97
合计	339,058,458.80	350,327,603.79

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	337,606,387.87	87.87
	其中：股票	337,606,387.87	87.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,452,070.93	0.38
	其中：债券	1,452,070.93	0.38
	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	21,750,802.40	5.66
8	其他各项资产	23,399,553.32	6.09
9	合计	384,208,814.52	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	55,283.20	0.02
C	制造业	317,364,521.24	86.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	156,308.30	0.04
E	建筑业	57,773.17	0.02
F	批发和零售业	332,519.60	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	80,205.59	0.02
H	住宿和餐饮业	117,119.70	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,871,616.49	2.15
J	金融业	150,367.28	0.04
K	房地产业	8,952,346.32	2.45
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	395,966.09	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	135,359.74	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,538.02	0.00
Q	卫生和社会工作	27,767.29	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,900,695.84	0.52
S	综合	-	-
	合计	337,606,387.87	92.35

7.2.2 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。

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

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	000651	格力电器	475,900	17,375,109.00	4.75
2	000858	五粮液	94,800	15,506,436.00	4.24
3	002466	天齐锂业	221,700	15,499,047.00	4.24
4	603338	浙江鼎力	259,300	14,523,393.00	3.97
5	600600	青岛啤酒	125,516	13,007,223.08	3.56
6	300866	安克创新	145,700	12,748,750.00	3.49
7	002011	盾安环境	918,100	12,697,323.00	3.47
8	002050	三花智控	402,900	12,191,754.00	3.33
9	300750	宁德时代	50,300	11,508,137.00	3.15
10	600690	海尔智家	482,200	11,322,056.00	3.10
11	603833	欧派家居	113,600	10,882,880.00	2.98
12	603180	金牌厨柜	301,100	10,092,872.00	2.76
13	002008	大族激光	366,800	9,610,160.00	2.63

14	002249	大洋电机	1,647,700	9,391,890.00	2.57
15	688305	科德数控	91,752	9,199,055.52	2.52
16	002304	洋河股份	69,000	9,063,150.00	2.48
17	300124	汇川技术	124,996	8,025,993.16	2.20
18	688577	浙海德曼	165,598	7,879,152.84	2.16
19	603737	三棵树	105,520	6,903,118.40	1.89
20	603208	江山欧派	182,840	6,659,032.80	1.82
21	603197	保隆科技	115,300	6,255,025.00	1.71
22	002248	华东数控	622,500	6,069,375.00	1.66
23	600933	爱柯迪	251,700	5,862,093.00	1.60
24	002937	兴瑞科技	238,100	5,857,260.00	1.60
25	300146	汤臣倍健	239,800	5,750,404.00	1.57
26	000002	万科 A	386,200	5,414,524.00	1.48
27	603818	曲美家居	952,200	5,141,880.00	1.41
28	688333	铂力特	36,191	3,826,836.34	1.05
29	601065	江盐集团	279,230	3,749,695.18	1.03
30	603378	亚士创能	407,700	3,714,147.00	1.02
31	601155	新城控股	244,700	3,526,127.00	0.96
32	688019	安集科技	19,158	3,157,813.14	0.86
33	688291	金橙子	97,959	3,101,381.94	0.85
34	603129	春风动力	17,700	2,865,630.00	0.78
35	688188	柏楚电子	14,819	2,794,270.64	0.76
36	300161	华中数控	51,400	2,750,928.00	0.75
37	688700	东威科技	26,655	2,658,303.15	0.73
38	688361	中科飞测	26,672	2,212,420.59	0.61
39	000795	英洛华	263,800	1,999,604.00	0.55
40	002790	瑞尔特	201,614	1,935,494.40	0.53
41	300729	乐歌股份	104,400	1,862,496.00	0.51
42	603809	豪能股份	165,400	1,857,442.00	0.51
43	002690	美亚光电	71,700	1,846,275.00	0.51
44	603758	秦安股份	173,400	1,844,976.00	0.50
45	002705	新宝股份	101,200	1,824,636.00	0.50
46	600885	宏发股份	57,200	1,821,820.00	0.50
47	300144	宋城演艺	146,000	1,810,400.00	0.50
48	301056	森赫股份	104,916	961,030.56	0.26
49	002906	华阳集团	28,100	960,739.00	0.26
50	002254	泰和新材	38,700	946,989.00	0.26
51	002444	巨星科技	41,800	914,584.00	0.25
52	688503	聚和材料	6,390	623,025.00	0.17
53	688348	昱能科技	3,034	569,876.22	0.16
54	600835	上海机电	27,200	467,296.00	0.13
55	688372	伟测科技	2,090	320,083.50	0.09
56	688472	阿特斯	15,302	279,230.00	0.08

57	301039	中集车辆	20,640	273,067.20	0.07
58	301311	昆船智能	8,320	245,273.60	0.07
59	688496	清越科技	12,000	238,560.00	0.07
60	301391	卡莱特	1,976	231,527.92	0.06
61	688160	步科股份	2,771	231,378.50	0.06
62	301358	湖南裕能	4,884	214,382.49	0.06
63	301168	通灵股份	3,281	204,406.30	0.06
64	300421	力星股份	16,800	200,592.00	0.05
65	688698	伟创电气	4,751	189,944.98	0.05
66	688484	南芯科技	4,166	170,571.68	0.05
67	688114	华大智造	1,929	166,974.24	0.05
68	688084	晶品特装	1,875	162,881.25	0.04
69	688061	灿瑞科技	3,057	161,501.31	0.04
70	301216	万凯新材	9,514	158,217.82	0.04
71	301320	豪江智能	6,416	157,255.56	0.04
72	688352	颀中科技	11,608	155,071.11	0.04
73	688458	美芯晟	1,604	153,416.26	0.04
74	301408	华人健康	8,784	152,129.85	0.04
75	301419	阿莱德	3,292	150,788.26	0.04
76	688231	隆达股份	5,223	149,012.19	0.04
77	300926	博俊科技	6,451	147,340.84	0.04
78	300925	法本信息	10,197	144,083.61	0.04
79	301486	致尚科技	2,498	144,034.68	0.04
80	688195	腾景科技	2,693	143,886.99	0.04
81	301246	宏源药业	4,589	143,530.09	0.04
82	688353	华盛锂电	3,870	143,112.60	0.04
83	688228	开普云	2,718	139,596.48	0.04
84	688237	超卓航科	2,891	139,577.48	0.04
85	688699	明微电子	2,766	139,185.12	0.04
86	301360	荣旗科技	1,340	138,198.22	0.04
87	688121	卓然股份	3,681	137,669.40	0.04
88	301189	奥尼电子	4,345	132,913.55	0.04
89	688273	麦澜德	3,568	132,051.68	0.04
90	688317	之江生物	5,494	130,207.80	0.04
91	688581	安杰思	1,062	129,612.51	0.04
92	301332	德尔玛	8,954	127,459.86	0.03
93	688049	炬芯科技	3,260	119,968.00	0.03
94	301141	中科磁业	2,617	119,755.52	0.03
95	688365	光云科技	8,249	118,950.58	0.03
96	301073	君亭酒店	3,222	117,119.70	0.03
97	688601	力芯微	2,450	115,395.00	0.03
98	301270	汉仪股份	2,095	114,407.95	0.03
99	600581	八一钢铁	28,200	114,210.00	0.03

100	688456	有研粉材	3,396	113,664.12	0.03
101	605499	东鹏饮料	632	109,272.80	0.03
102	688257	新锐股份	4,059	107,604.09	0.03
103	688560	明冠新材	3,832	106,491.28	0.03
104	688252	天德钰	5,201	105,528.29	0.03
105	301290	东星医疗	3,291	105,476.55	0.03
106	301313	凡拓数创	2,464	104,301.12	0.03
107	688251	井松智能	3,392	103,456.00	0.03
108	688227	品高股份	4,164	103,392.12	0.03
109	688661	和林微纳	1,452	102,075.60	0.03
110	301181	标榜股份	3,333	100,289.97	0.03
111	688429	时创能源	3,452	99,565.18	0.03
112	688236	春立医疗	4,052	99,274.00	0.03
113	301136	招标股份	7,172	98,399.84	0.03
114	688173	希荻微	4,236	96,919.68	0.03
115	688103	国力股份	1,595	95,556.45	0.03
116	301265	华新环保	8,181	95,063.22	0.03
117	688143	长盈通	2,519	94,966.30	0.03
118	688631	莱斯信息	2,918	94,522.44	0.03
119	301439	泓淋电力	5,185	92,017.73	0.03
120	301196	唯科科技	2,705	91,834.75	0.03
121	688247	宣泰医药	7,155	91,226.25	0.02
122	301373	凌玮科技	2,764	89,373.61	0.02
123	688667	菱电电控	1,191	88,884.33	0.02
124	688265	南模生物	2,374	88,835.08	0.02
125	300339	润和软件	3,700	88,652.00	0.02
126	301281	科源制药	3,368	88,503.08	0.02
127	688619	罗普特	5,856	88,015.68	0.02
128	688737	中自科技	2,186	85,232.14	0.02
129	688611	杭州柯林	1,960	83,986.00	0.02
130	301193	家联科技	4,752	83,302.56	0.02
131	688355	明志科技	2,710	82,438.20	0.02
132	603135	中重科技	4,036	81,805.16	0.02
133	301285	鸿日达	5,643	81,767.07	0.02
134	301349	信德新材	1,617	81,076.38	0.02
135	300930	屹通新材	3,220	80,339.00	0.02
136	601059	信达证券	5,628	80,255.28	0.02
137	688307	中润光学	2,455	80,253.95	0.02
138	300922	天秦装备	4,008	80,119.92	0.02
139	300814	中富电路	3,280	79,015.20	0.02
140	688255	凯尔达	2,309	78,182.74	0.02
141	688799	华纳药厂	1,917	77,868.54	0.02
142	688455	科捷智能	5,277	77,202.51	0.02

143	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
144	688636	智明达	1,368	75,240.00	0.02
145	002475	立讯精密	2,300	74,635.00	0.02
146	688319	欧林生物	3,412	73,801.56	0.02
147	301026	浩通科技	2,027	72,404.44	0.02
148	688013	天臣医疗	3,022	71,651.62	0.02
149	301041	金百泽	2,150	71,208.00	0.02
150	688316	青云科技	1,428	70,900.20	0.02
151	300033	同花顺	400	70,112.00	0.02
152	001270	铖昌科技	795	69,403.50	0.02
153	688113	联测科技	1,415	67,750.20	0.02
154	688117	圣诺生物	2,341	67,654.90	0.02
155	688571	杭华股份	10,660	67,264.60	0.02
156	301158	德石股份	3,783	65,483.73	0.02
157	300927	江天化学	3,893	63,728.41	0.02
158	688111	金山办公	134	63,277.48	0.02
159	688669	聚石化学	3,485	63,183.05	0.02
160	301038	深水规院	3,458	62,555.22	0.02
161	301309	万得凯	2,271	62,543.34	0.02
162	688191	智洋创新	3,203	59,159.41	0.02
163	601133	柏诚股份	3,906	57,773.17	0.02
164	600487	亨通光电	3,900	57,174.00	0.02
165	600570	恒生电子	1,290	57,134.10	0.02
166	301062	上海艾录	5,225	55,332.75	0.02
167	600925	苏能股份	8,960	55,283.20	0.02
168	301153	中科江南	717	53,746.32	0.01
169	688616	西力科技	3,918	51,835.14	0.01
170	688511	天微电子	1,490	50,809.00	0.01
171	301055	张小泉	3,541	50,388.43	0.01
172	300136	信维通信	2,443	49,055.44	0.01
173	688109	品茗科技	1,886	48,847.40	0.01
174	300948	冠中生态	3,230	48,805.30	0.01
175	600633	浙数文化	3,000	48,630.00	0.01
176	301068	大地海洋	1,436	48,263.96	0.01
177	001328	登康口腔	1,445	46,946.55	0.01
178	301072	中捷精工	1,802	45,140.10	0.01
179	688249	晶合集成	2,456	44,379.92	0.01
180	688350	富淼科技	2,552	43,358.48	0.01
181	688395	正弦电气	1,627	43,261.93	0.01
182	603939	益丰药房	1,165	43,105.00	0.01
183	300920	润阳科技	2,503	43,076.63	0.01
184	688622	禾信仪器	1,204	42,742.00	0.01
185	300961	深水海纳	3,936	42,390.72	0.01

186	603125	常青科技	1,404	39,670.26	0.01
187	300995	奇德新材	1,909	38,943.60	0.01
188	001286	陕西能源	3,767	37,406.31	0.01
189	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.01
190	001311	多利科技	649	37,272.07	0.01
191	300919	中伟股份	610	36,752.50	0.01
192	688607	康众医疗	1,890	36,136.80	0.01
193	600536	中国软件	767	35,956.96	0.01
194	605090	九丰能源	1,526	34,075.58	0.01
195	688092	爱科科技	1,137	33,962.19	0.01
196	301217	铜冠铜箔	2,348	33,412.04	0.01
197	688107	安路科技	600	33,234.00	0.01
198	001330	博纳影业	3,564	33,073.92	0.01
199	600955	维远股份	1,694	32,914.42	0.01
200	300979	华利集团	661	32,217.14	0.01
201	300861	美畅股份	738	32,007.06	0.01
202	301238	瑞泰新材	1,513	30,774.42	0.01
203	688681	科汇股份	1,899	30,687.84	0.01
204	001360	南矿集团	1,762	30,443.10	0.01
205	001258	立新能源	3,188	30,254.12	0.01
206	301029	怡合达	666	29,756.88	0.01
207	301215	中汽股份	4,743	29,738.61	0.01
208	301211	亨迪药业	1,160	28,884.00	0.01
209	601921	浙版传媒	3,154	27,408.26	0.01
210	601156	东航物流	2,090	27,170.00	0.01
211	300887	谱尼测试	680	26,914.40	0.01
212	605337	李子园	1,434	26,213.52	0.01
213	001213	中铁特货	5,818	25,657.38	0.01
214	301263	泰恩康	1,228	25,640.64	0.01
215	603171	税友股份	637	25,467.26	0.01
216	301293	三博脑科	333	25,351.29	0.01
217	001367	海森药业	549	24,856.77	0.01
218	603255	鼎际得	488	24,770.88	0.01
219	300973	立高食品	360	24,631.20	0.01
220	605167	利柏特	2,471	23,919.28	0.01
221	603211	晋拓股份	1,286	23,636.68	0.01
222	301120	新特电气	1,548	23,560.56	0.01
223	301087	可孚医疗	476	23,466.80	0.01
224	003020	立方制药	632	23,390.32	0.01
225	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.01
226	003029	吉大正元	716	23,234.20	0.01
227	301286	侨源股份	784	23,128.00	0.01
228	605077	华康股份	865	22,905.20	0.01

229	301101	明月镜片	557	22,853.71	0.01
230	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
231	301177	迪阿股份	568	21,828.24	0.01
232	603206	嘉环科技	1,210	20,872.50	0.01
233	601022	宁波远洋	1,983	20,603.37	0.01
234	300413	芒果超媒	600	20,526.00	0.01
235	001323	慕思股份	573	19,459.08	0.01
236	605377	华旺科技	1,050	18,952.50	0.01
237	300850	新强联	500	18,690.00	0.01
238	688582	芯动联科	409	18,429.54	0.01
239	688562	航天软件	726	18,404.10	0.01
240	603235	天新药业	572	17,937.92	0.00
241	301179	泽宇智能	531	17,894.70	0.00
242	001324	长青科技	848	17,822.20	0.00
243	301171	易点天下	804	17,768.40	0.00
244	301296	新巨丰	1,042	17,588.96	0.00
245	603173	福斯达	588	17,316.60	0.00
246	605268	王力安防	1,642	16,797.66	0.00
247	301127	天源环保	1,685	16,529.85	0.00
248	301096	百诚医药	272	16,485.92	0.00
249	301139	元道通信	566	16,351.74	0.00
250	301328	维峰电子	287	16,341.78	0.00
251	300882	万胜智能	572	16,233.36	0.00
252	605368	蓝天燃气	1,685	16,125.45	0.00
253	300893	松原股份	621	15,978.33	0.00
254	301152	天力锂能	356	15,898.96	0.00
255	605080	浙江自然	524	15,709.52	0.00
256	688629	华丰科技	708	15,653.88	0.00
257	688593	新相微	959	15,593.34	0.00
258	003019	宸展光电	759	15,559.50	0.00
259	001216	华瓷股份	1,177	15,489.32	0.00
260	603759	海天股份	1,656	15,168.96	0.00
261	301382	蜂助手	408	14,647.20	0.00
262	301201	诚达药业	353	14,543.60	0.00
263	603190	亚通精工	470	14,382.00	0.00
264	688552	航天南湖	587	14,193.66	0.00
265	300884	狄耐克	1,049	13,888.76	0.00
266	001287	中电港	548	13,875.36	0.00
267	300895	铜牛信息	411	13,727.40	0.00
268	605183	确成股份	741	13,412.10	0.00
269	605169	洪通燃气	1,292	13,268.84	0.00
270	688620	安凯微	1,016	13,014.96	0.00
271	605599	菜百股份	980	12,945.80	0.00

272	688334	西高院	747	12,848.40	0.00
273	301199	迈赫股份	402	12,799.68	0.00
274	605300	佳禾食品	576	12,522.24	0.00
275	301100	风光股份	599	12,375.34	0.00
276	605058	澳弘电子	548	12,302.60	0.00
277	301305	朗坤环境	619	12,274.77	0.00
278	605319	无锡振华	764	12,124.68	0.00
279	688523	航天环宇	472	12,002.96	0.00
280	605500	森林包装	1,579	11,779.34	0.00
281	300917	特发服务	476	11,695.32	0.00
282	003030	祖名股份	480	11,587.20	0.00
283	001207	联科科技	682	11,403.04	0.00
284	301125	腾亚精工	370	11,307.20	0.00
285	300993	玉马遮阳	959	10,980.55	0.00
286	603130	云中马	480	10,900.80	0.00
287	301166	优宁维	253	10,863.82	0.00
288	301190	善水科技	575	10,804.25	0.00
289	003015	日久光电	1,128	10,682.16	0.00
290	300881	盛德鑫泰	320	10,544.00	0.00
291	300891	惠云钛业	1,143	10,447.02	0.00
292	301298	东利机械	634	10,416.62	0.00
293	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00
294	301138	华研精机	285	10,368.30	0.00
295	300986	志特新材	370	10,360.00	0.00
296	605179	一鸣食品	939	10,216.32	0.00
297	301108	洁雅股份	280	10,136.00	0.00
298	301322	绿通科技	189	10,054.80	0.00
299	605136	丽人丽妆	867	9,996.51	0.00
300	003018	金富科技	1,027	9,931.09	0.00
301	688623	双元科技	111	9,913.41	0.00
302	301306	西测测试	255	9,906.75	0.00
303	601061	中信金属	1,207	9,873.26	0.00
304	301083	百胜智能	416	9,734.40	0.00
305	001300	三柏硕	763	9,690.10	0.00
306	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
307	603213	镇洋发展	799	9,532.07	0.00
308	001299	美能能源	576	9,394.56	0.00
309	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
310	603280	南方路机	363	8,922.54	0.00
311	688479	友车科技	299	8,919.17	0.00
312	301126	达嘉维康	662	8,870.80	0.00
313	300879	大叶股份	466	8,867.98	0.00
314	688535	华海诚科	161	8,814.75	0.00

315	001256	炜冈科技	474	8,721.60	0.00
316	301273	瑞晨环保	277	8,686.72	0.00
317	603065	宿迁联盛	581	8,656.90	0.00
318	003000	劲仔食品	684	8,611.56	0.00
319	003032	传智教育	586	8,538.02	0.00
320	301259	艾布鲁	628	8,446.60	0.00
321	603182	嘉华股份	546	8,255.52	0.00
322	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
323	301028	东亚机械	733	8,172.95	0.00
324	300985	致远新能	295	8,171.50	0.00
325	300978	东箭科技	593	8,082.59	0.00
326	605180	华生科技	649	8,028.13	0.00
327	001209	洪兴股份	450	8,014.50	0.00
328	301161	唯万密封	346	7,996.06	0.00
329	301157	华塑科技	150	7,938.00	0.00
330	300963	中洲特材	552	7,832.88	0.00
331	300994	久祺股份	504	7,781.76	0.00
332	301345	涛涛车业	166	7,742.24	0.00
333	301428	世纪恒通	229	7,614.25	0.00
334	301021	英诺激光	290	7,580.60	0.00
335	301337	亚华电子	232	7,479.68	0.00
336	603048	浙江黎明	464	7,470.40	0.00
337	300889	爱克股份	479	7,170.63	0.00
338	605069	正和生态	790	6,912.50	0.00
339	001202	炬申股份	459	6,774.84	0.00
340	301182	凯旺科技	294	6,753.18	0.00
341	301198	喜悦智行	443	6,724.74	0.00
342	300943	春晖智控	383	6,495.68	0.00
343	301020	密封科技	263	5,946.43	0.00
344	301081	严牌股份	484	4,815.80	0.00
345	688515	裕太微	24	4,119.84	0.00
346	688271	联影医疗	29	4,002.29	0.00
347	301027	华蓝集团	286	3,514.94	0.00
348	301233	盛帮股份	58	2,509.66	0.00
349	603882	金域医学	32	2,416.00	0.00
350	603282	亚光股份	57	1,967.07	0.00
351	001229	魅视科技	47	1,565.10	0.00
352	003028	振邦智能	32	1,337.92	0.00
353	001231	农心科技	55	1,308.45	0.00
354	001368	通达创智	51	1,296.42	0.00
355	001219	青岛食品	70	1,276.80	0.00
356	605258	协和电子	40	1,039.20	0.00
357	301319	唯特偶	15	897.75	0.00

358	605566	福莱蒾特	35	805.00	0.00
359	001234	泰慕士	33	752.40	0.00
360	603272	联翔股份	43	729.28	0.00
361	300960	通业科技	34	708.22	0.00
362	001366	播恩集团	45	693.90	0.00
363	001333	光华股份	26	653.38	0.00
364	301327	华宝新能	8	632.88	0.00
365	603073	彩蝶实业	30	625.80	0.00
366	603151	邦基科技	35	571.90	0.00
367	605005	合兴股份	34	538.22	0.00
368	605099	共创草坪	24	535.92	0.00
369	605033	美邦股份	23	430.10	0.00
370	605151	西上海	22	400.40	0.00
371	003041	真爱美家	23	364.78	0.00
372	301300	远翔新材	11	347.60	0.00
373	001314	亿道信息	8	338.24	0.00
374	605028	世茂能源	15	322.50	0.00
375	301318	维海德	9	301.95	0.00
376	001210	金房能源	13	291.98	0.00
377	301037	保立佳	13	231.66	0.00
378	605138	盛泰集团	23	200.56	0.00
379	003004	声迅股份	6	173.22	0.00
380	605228	神通科技	17	162.69	0.00
381	605277	新亚电子	7	113.12	0.00
382	301219	腾远钴业	3	112.08	0.00
383	001296	长江材料	3	63.03	0.00
384	301025	读客文化	3	36.66	0.00
385	003033	征和工业	1	35.10	0.00
386	001212	中旗新材	1	24.69	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	000858	五粮液	43,614,066.32	11.04
2	002466	天齐锂业	28,731,595.00	7.27
3	300274	阳光电源	22,494,329.90	5.69
4	601668	中国建筑	19,728,093.00	4.99
5	603180	金牌厨柜	19,143,213.20	4.84
6	002129	TCL 中环	19,082,076.50	4.83
7	601818	光大银行	18,256,517.00	4.62
8	002415	海康威视	18,199,771.00	4.61
9	601628	中国人寿	17,662,183.00	4.47

10	603369	今世缘	17,537,995.00	4.44
11	601601	中国太保	17,526,666.00	4.44
12	601398	工商银行	17,523,550.00	4.43
13	600570	恒生电子	17,307,770.20	4.38
14	000651	格力电器	16,880,666.00	4.27
15	601611	中国核建	16,833,374.36	4.26
16	002192	融捷股份	16,807,821.00	4.25
17	688088	虹软科技	16,775,687.98	4.25
18	600633	浙数文化	16,749,357.00	4.24
19	601985	中国核电	16,739,483.00	4.24
20	002475	立讯精密	16,736,792.37	4.24
21	601186	中国铁建	16,597,917.66	4.20
22	601800	中国交建	15,988,034.00	4.05
23	601117	中国化学	15,820,486.05	4.00
24	601390	中国中铁	15,756,101.00	3.99
25	002568	百润股份	15,363,040.96	3.89
26	600050	中国联通	15,350,000.00	3.88
27	603688	石英股份	15,256,831.00	3.86
28	688343	云天励飞	15,038,124.60	3.81
29	002594	比亚迪	14,878,220.00	3.77
30	601766	中国中车	14,605,547.18	3.70
31	300866	安克创新	14,548,953.00	3.68
32	601939	建设银行	14,516,134.00	3.67
33	688047	龙芯中科	14,362,524.02	3.63
34	600900	长江电力	14,327,674.00	3.63
35	000938	紫光股份	14,250,422.48	3.61
36	600703	三安光电	14,197,737.00	3.59
37	603338	浙江鼎力	14,179,588.00	3.59
38	688348	昱能科技	14,080,892.37	3.56
39	000066	中国长城	13,828,585.00	3.50
40	600132	重庆啤酒	13,770,321.00	3.49
41	688305	科德数控	13,666,508.78	3.46
42	002605	姚记科技	13,380,305.00	3.39
43	603019	中科曙光	13,360,563.81	3.38
44	601658	邮储银行	13,292,017.00	3.36
45	600559	老白干酒	13,115,364.00	3.32
46	300750	宁德时代	13,073,844.20	3.31
47	300443	金雷股份	12,909,958.00	3.27
48	600600	青岛啤酒	12,847,103.20	3.25
49	300634	彩讯股份	12,835,695.00	3.25
50	601991	大唐发电	12,778,030.00	3.23
51	300674	宇信科技	12,727,895.47	3.22
52	002011	盾安环境	12,448,269.92	3.15

53	002304	洋河股份	12,355,622.00	3.13
54	600933	爱柯迪	12,334,851.00	3.12
55	600016	民生银行	12,228,083.05	3.09
56	600886	国投电力	12,051,146.99	3.05
57	601688	华泰证券	11,688,058.00	2.96
58	688425	铁建重工	11,624,319.85	2.94
59	603833	欧派家居	11,597,295.00	2.94
60	002531	天顺风能	11,543,564.00	2.92
61	300763	锦浪科技	11,513,320.55	2.91
62	601318	中国平安	11,498,379.00	2.91
63	600690	海尔智家	11,205,856.00	2.84
64	300339	润和软件	11,080,892.00	2.80
65	603589	口子窖	10,947,202.00	2.77
66	600029	南方航空	10,693,535.00	2.71
67	600585	海螺水泥	10,648,372.00	2.69
68	300496	中科创达	10,506,503.19	2.66
69	300413	芒果超媒	10,341,782.00	2.62
70	002050	三花智控	10,323,664.00	2.61
71	601377	兴业证券	10,275,561.30	2.60
72	000568	泸州老窖	10,263,717.00	2.60
73	300394	天孚通信	10,088,466.00	2.55
74	601319	中国人保	9,898,779.00	2.51
75	601618	中国中冶	9,812,024.75	2.48
76	300556	丝路视觉	9,704,895.00	2.46
77	600487	亨通光电	9,666,275.20	2.45
78	601336	新华保险	9,596,060.00	2.43
79	002008	大族激光	9,578,710.00	2.42
80	002508	老板电器	9,514,630.95	2.41
81	600702	舍得酒业	9,353,828.00	2.37
82	002249	大洋电机	9,259,385.00	2.34
83	000063	中兴通讯	9,154,214.00	2.32
84	600845	宝信软件	8,853,224.00	2.24
85	600519	贵州茅台	8,792,568.00	2.23
86	603259	药明康德	8,592,865.36	2.17
87	000830	鲁西化工	8,575,006.00	2.17
88	000596	古井贡酒	8,494,487.00	2.15
89	002268	电科网安	8,400,339.00	2.13
90	300280	紫天科技	8,369,241.00	2.12

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	002594	比亚迪	30,121,429.03	7.62

2	688111	金山办公	29,372,184.73	7.43
3	000858	五粮液	24,049,686.00	6.09
4	002475	立讯精密	23,245,657.00	5.88
5	002531	天顺风能	22,369,464.85	5.66
6	600633	浙数文化	22,276,752.15	5.64
7	600132	重庆啤酒	21,963,935.94	5.56
8	300274	阳光电源	21,678,338.00	5.49
9	601012	隆基绿能	21,365,318.69	5.41
10	300443	金雷股份	20,528,829.00	5.20
11	688088	虹软科技	19,776,728.65	5.01
12	300634	彩讯股份	18,865,143.00	4.77
13	600519	贵州茅台	18,818,003.58	4.76
14	601668	中国建筑	18,416,573.00	4.66
15	603019	中科曙光	17,992,158.80	4.55
16	603369	今世缘	17,970,252.99	4.55
17	002466	天齐锂业	17,914,278.00	4.53
18	601628	中国人寿	17,857,583.00	4.52
19	601818	光大银行	17,794,983.00	4.50
20	601398	工商银行	17,657,640.00	4.47
21	600570	恒生电子	17,612,756.80	4.46
22	300724	捷佳伟创	17,565,253.97	4.45
23	688047	龙芯中科	17,561,846.09	4.44
24	300750	宁德时代	17,464,770.90	4.42
25	002129	TCL 中环	17,349,224.00	4.39
26	601601	中国太保	17,243,447.00	4.36
27	002605	姚记科技	17,237,761.00	4.36
28	002459	晶澳科技	17,179,151.20	4.35
29	601985	中国核电	16,765,175.00	4.24
30	603985	恒润股份	16,428,145.56	4.16
31	300394	天孚通信	16,418,033.00	4.16
32	002415	海康威视	16,184,988.00	4.10
33	601611	中国核建	15,884,101.04	4.02
34	000066	中国长城	15,546,996.00	3.93
35	000938	紫光股份	15,295,397.80	3.87
36	600900	长江电力	14,989,109.00	3.79
37	601186	中国铁建	14,899,350.00	3.77
38	002192	融捷股份	14,832,164.36	3.75
39	601939	建设银行	14,748,071.00	3.73
40	002568	百润股份	14,349,368.30	3.63
41	601390	中国中铁	14,279,445.00	3.61
42	600050	中国联通	14,069,434.00	3.56
43	601800	中国交建	13,935,693.00	3.53
44	601766	中国中车	13,828,701.60	3.50

45	300674	宇信科技	13,776,639.00	3.49
46	600703	三安光电	13,198,822.00	3.34
47	601658	邮储银行	13,188,567.00	3.34
48	002371	北方华创	12,900,453.00	3.26
49	688343	云天励飞	12,846,066.75	3.25
50	601117	中国化学	12,771,174.39	3.23
51	603688	石英股份	12,578,890.14	3.18
52	601991	大唐发电	12,544,908.00	3.17
53	300760	迈瑞医疗	12,537,436.00	3.17
54	600559	老白干酒	12,271,399.00	3.11
55	000002	万 科 A	11,948,146.00	3.02
56	603596	伯特利	11,925,511.00	3.02
57	600886	国投电力	11,789,032.00	2.98
58	688348	昱能科技	11,495,431.50	2.91
59	688599	天合光能	11,415,261.38	2.89
60	600016	民生银行	11,368,849.25	2.88
61	002508	老板电器	11,336,081.00	2.87
62	601888	中国中免	11,256,836.00	2.85
63	300763	锦浪科技	11,068,190.05	2.80
64	688223	晶科能源	11,064,583.87	2.80
65	600029	南方航空	10,951,162.00	2.77
66	603589	口子窖	10,782,301.00	2.73
67	688425	铁建重工	10,688,074.88	2.70
68	600585	海螺水泥	10,661,426.64	2.70
69	601688	华泰证券	10,657,397.00	2.70
70	601689	拓普集团	10,565,075.00	2.67
71	601318	中国平安	10,556,191.00	2.67
72	000519	中兵红箭	10,292,160.00	2.60
73	300776	帝尔激光	10,261,487.00	2.60
74	601319	中国人保	10,166,543.00	2.57
75	000568	泸州老窖	10,151,481.00	2.57
76	300395	菲利华	10,104,632.50	2.56
77	600048	保利发展	10,040,965.00	2.54
78	601336	新华保险	9,757,105.00	2.47
79	300413	芒果超媒	9,625,425.46	2.44
80	300496	中科创达	9,437,667.00	2.39
81	601618	中国中冶	9,354,418.00	2.37
82	300556	丝路视觉	9,322,012.00	2.36
83	601377	兴业证券	9,229,887.00	2.34
84	300339	润和软件	9,160,664.00	2.32
85	002268	电科网安	9,007,799.48	2.28
86	600845	宝信软件	8,786,008.00	2.22
87	301236	软通动力	8,712,611.04	2.21

88	600487	亨通光电	8,608,448.00	2.18
89	600702	舍得酒业	8,518,952.00	2.16
90	000063	中兴通讯	8,518,216.00	2.16
91	000830	鲁西化工	8,184,365.00	2.07
92	300280	紫天科技	8,131,945.00	2.06
93	603180	金牌厨柜	7,953,123.00	2.01

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	1,792,603,085.34
卖出股票收入（成交）总额	1,786,321,437.08

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	1,451,958.41	0.40
	其中：政策性金融债	1,451,958.41	0.40
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）	112.52	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,452,070.93	0.40

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	018008	国开 1802	14,000	1,451,958.41	0.40
2	128136	立讯转债	1	112.52	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述 2 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	210,768.48
2	应收清算款	23,124,296.77
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	64,488.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,399,553.32

7.12.4 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	128136	立讯转债	112.52	0.00

7.12.5 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。

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 (%)
25,417	19,408.99	17,794,172.92	3.61	475,524,221.16	96.39

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	黄晓峰	709,737.00	1.83
2	方涛	691,838.00	1.79
3	高兆明	577,298.00	1.49
4	陈秀云	391,493.00	1.01
5	陈克明	387,000.00	1.00
6	高德荣	322,700.00	0.83
7	李萍	244,469.00	0.63
8	王远芳	233,303.00	0.60
9	李广华	210,191.00	0.54
10	任结云	200,036.00	0.52

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	128.64	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 (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	500,623,940.98

本报告期基金总申购份额	6,831,593.15
减：本报告期基金总赎回份额	14,137,140.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	493,318,394.08

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

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

10.2.2 基金经理变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2023 年 4 月 13 日起，钱文礼同志担任长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理；自 2023 年 4 月 13 日起，孟棋同志不再担任长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 5 月 11 日

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	1,475,784,986.27	41.31	1,079,236.05	35.97	-
招商证券	1	677,754,279.05	18.97	631,194.95	21.04	-
中信建投	2	418,353,332.94	11.71	389,613.97	12.99	-
长江证券	2	414,318,546.96	11.60	385,859.14	12.86	-
东兴证券	1	222,595,594.28	6.23	207,304.10	6.91	-
国新证券	1	205,579,192.80	5.75	191,456.65	6.38	-
兴业证券	1	137,747,472.35	3.86	100,735.46	3.36	-
光大证券	2	20,283,332.00	0.57	14,833.39	0.49	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

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(%)
安信证券	2,890,843.21	66.81	-	-	-	-
招商证券	173,373.02	4.01	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,262,773.35	29.18	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
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、本基金租用证券公司的北京交易单元为共用交易单元。

4、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	国海证券	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	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 20 日
2	长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 20 日
3	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加华瑞保险为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 8 日
4	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 15 日
5	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 15 日
6	长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
7	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）2022 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
8	长盛基金管理有限公司关于终止部分基金销售机构办理旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
9	长盛基金管理有限公司关于调整长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 14 日
10	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	2023 年 4 月 17 日
11	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 17 日
12	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 17 日
13	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 22 日
14	长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 22 日

15	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 5 月 5 日
16	长盛基金管理有限公司关于部分基金增加代销机构的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 6 月 16 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、长盛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。

12.2 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。

12.3 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 8 月 30 日