

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金  
(LOF)  
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
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	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
7.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	63
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 .....	63
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>64</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
10.4 基金投资策略的改变 .....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
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 .....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
10.8 其他重大事件 .....	66
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
12.1 备查文件目录 .....	67
12.2 存放地点 .....	68
12.3 查阅方式 .....	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）
基金简称	长盛同庆中证 800 指数（LOF）
场内简称	长盛中证 800LOF
基金主代码	160806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 22 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	109,438,192.38 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交 易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 8 月 6 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁	王小飞
	联系电话	010-86497608	021-60637103
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	021-60637228
传真		010-86497999	021-60635778
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号	北京市西城区闹市口大街 1 号院

	楼中建财富国际中心 3-5 层	1 号楼
邮政编码	100029	100033
法定代表人	胡甲	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,363,176.19
本期利润	1,240,519.84
加权平均基金份额本期利润	0.0133
本期加权平均净值利润率	0.85%
本期基金份额净值增长率	1.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	59,169,134.33
期末可供分配基金份额利润	0.5407
期末基金资产净值	176,081,939.98
期末基金份额净值	1.609
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	17.26%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2015 年 5 月 22 日（即基金合同生效日）。

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	3.74%	0.58%	2.82%	0.59%	0.92%	-0.01%
过去三个月	2.16%	1.14%	1.17%	1.12%	0.99%	0.02%
过去六个月	1.77%	1.03%	0.89%	1.03%	0.88%	0.00%
过去一年	16.51%	1.36%	14.61%	1.38%	1.90%	-0.02%
过去三年	-4.57%	1.06%	-10.41%	1.08%	5.84%	-0.02%
自基金转型起至今	17.26%	1.35%	-22.33%	1.32%	39.59%	0.03%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

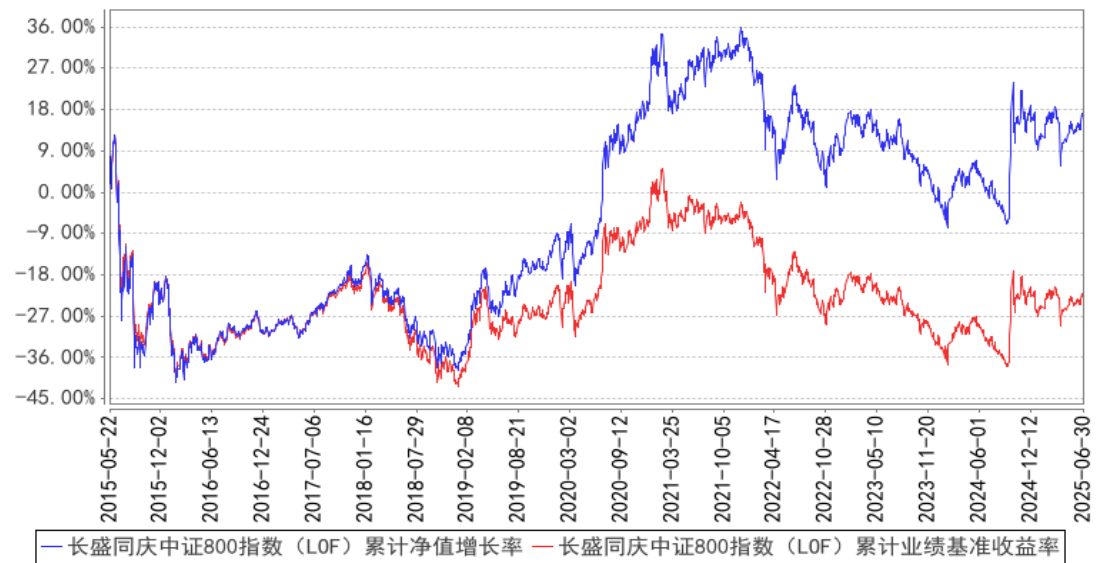
本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率（税后）}$

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

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

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

长盛同庆中证800指数（LOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2015 年 5 月 22

日（即基金合同生效日）。

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 3 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。长盛基金注册地为深圳，总部办公地位于北京，在北京、上海、成都等地设有分支机构，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（DBS Bank Ltd.）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 2025 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十三只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈亘斯	本基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛中证 A100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券	2019 年 5 月 30 日	-	16 年	陈亘斯先生，硕士。曾任 PineRiver 资产管理公司量化分析师，国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理，北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理。



投资基金 （LOF）基 金经理， 长盛同鑫 行业配置 混合型证 券投资基 金基金经 理，长盛 中证申万 一带一路 主题指数 证券投资 基 金 （LOF）基 金经理， 长盛中证 全指证券 公司指数 证券投资 基 金 （LOF）基 金经理， 长盛环球 景气行业 大盘精选 混合型证 券投资基 金基金经 理，长盛 战略新兴 产业灵活 配置混合 型证券投资 基金基金 经理， 长盛北证 50 成份指 数增强型 发起式证 券投资基 金基金经 理，长盛 中证红利 低 波 动				
---	--	--	--	--

	100 指数 型证券投 资基金基 金经理， 量化投资 部总经理 助理。				
--	---	--	--	--	--

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

2025 年上半年 A 股市场首先在年初经历了小幅快速调整后走出了逐步修复行情，尤其是春节前后由于 DeepSeek 大模型的新版本以及新一代人形机器人的发布和出圈，引发了市场对于科技成长类企业的热切关注和积极展望，尤其与新质生产力高度相关的部分细分行业如软件、互联网、自动化设备、生物科技等与港股市场的科技板块产生共振同步走高。随着节后资金面的回暖，市场交易氛围重新活跃，成交额相较春节前有所放大，带动了小市值和预期高成长风格的持续走强，而红利、低波动、低换手等防御型风格则在区间内窄幅震荡。其后 A 股市场在经历了二季度初期关税冲击后迅速修复并连续温和上涨，得益于政策的及时呵护以及投资者总体对国内的科技突破的前景保持了充分的信心。杠铃策略的红利和成长两端内部均有所变化，其中红利板块内以银行板块一马当先，尤其是业绩增速突出的地方性银行，显示出较强的经营韧性；而成长板块方面，不同于一季度领涨的人工智能、国产替代等偏向内循环的板块，面对关税压力仍能凭借自身产品优势而对外破局的创新药、电路板、光模块、军工等获得市场高度认同，部分成分股走势创出年内新高。但我们也注意到，成长板块的内部轮动十分显著，人气过高时需要评估其交易拥挤度和预期业绩的估值匹配度。此外，微盘股由于流动性的溢出效应而整体屡创历史新高，但其背后对资金净流入和动量效应的依赖过高而脱离了基本面估值体系，需要关注其急速调整的尾部风险。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.609 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.77%，同期业绩比较基准收益率为 0.89%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0074%，年度化跟踪误差为 1.0809%。

#### 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 2025 年下半年，在利率保持低位以及居民储蓄高企的背景下，A 股市场已在上半年逐步走出上行态势，对居民储蓄搬家的吸引力也随之提升，有望获得较为持续的增量资金入场。此外社会零售数据受益于以旧换新的补贴政策，同时服务业 CPI 也在持续回暖。经济内生活力在局部显现并扩散，叠加“反内卷”的新政策指引，国内经济格局处于供给驱动向需求拉动转换的关键时期。伴随着人工智能等新科技的协同作用，其间将可能自下而上涌现新的产业成长机会和投资范式。当然，在积极乐观之余，我们看到外部地缘环境仍存在不确定性，美国的关税政策的左右摇摆以及“大而美”法案的出台使得海外资金对于在美国本土和大中华地区之间的配置调整仍有可能一波三折。虽然美国的技术革新对企业增长预期的支撑仍表现出相当的韧性，但其居民的就业、消费等数据已有疲态，因此我们对于美联储在中期打开降息通道进而改善 A 股外部流动性的趋势抱有高度的信心，但未来几个月应当留意目前较为一致的乐观预期可能会产生短期分歧，从而催化市场出现明显的震荡，但总体市场逐步上台阶的中长期态势大概率会在偶发的调整后更加坚实。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人设有估值工作小组，负责制定、评估、复核和修订基金估值程序和技术，适时更新估值相关制度，指导并监督各类投资品种的估值程序，评估会计政策变更的影响，对证券投资基金估值方法进行最终决策等。估值工作小组由总经理担任组长，督察长担任副组长，小组成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可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，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的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

本报告期内，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	10,738,720.88	5,658,891.42
结算备付金		—	—
存出保证金		19,017.01	1,250.73
交易性金融资产	6.4.7.2	166,423,764.53	73,923,586.32
其中：股票投资		166,379,715.13	73,893,090.50
基金投资		—	—

债券投资		44,049.40	30,495.82
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		596.57	2,556.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		177,182,098.99	79,586,285.23
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		9,677.07	10,856.28
应付管理人报酬		142,684.96	67,303.80
应付托管费		28,536.99	13,460.76
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.67	0.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	919,259.32	968,027.70
负债合计		1,100,159.01	1,059,648.89
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	116,912,805.65	53,039,620.31
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	59,169,134.33	25,487,016.03
净资产合计		176,081,939.98	78,526,636.34
负债和净资产总计		177,182,098.99	79,586,285.23

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.609 元，基金份额总额 109,438,192.38

份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,158,625.30	168,604.18
1. 利息收入		18,204.36	9,644.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	18,204.36	9,644.26
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,251,702.03	216,903.48
其中：股票投资收益	6.4.7.14	415,642.89	-617,604.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	77.66	8,937.14
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,835,981.48	825,571.27
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	-122,656.35	-61,398.79
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	11,375.26	3,455.23
减：二、营业总支出		918,105.46	507,779.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	715,073.10	364,735.43
2. 托管费	6.4.10.2.2	143,014.62	72,946.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		0. 37	0. 04
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	60, 017. 37	70, 096. 82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 240, 519. 84	-339, 175. 10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 240, 519. 84	-339, 175. 10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1, 240, 519. 84	-339, 175. 10

6.3 净资产变动表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	53, 039, 620. 31	25, 487, 016. 03	78, 526, 636. 34
二、本期期初净资产	53, 039, 620. 31	25, 487, 016. 03	78, 526, 636. 34
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	63, 873, 185. 34	33, 682, 118. 30	97, 555, 303. 64
（一）、综合收益总额	-	1, 240, 519. 84	1, 240, 519. 84
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	63, 873, 185. 34	32, 441, 598. 46	96, 314, 783. 80
其中：1. 基金申购款	71, 114, 508. 19	35, 846, 567. 79	106, 961, 075. 98
2. 基金赎回款	-7, 241, 322. 85	-3, 404, 969. 33	-10, 646, 292. 18
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	116, 912, 805. 65	59, 169, 134. 33	176, 081, 939. 98
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		



	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	57,137,489.65	17,086,486.20	74,223,975.85
二、本期期初净资产	57,137,489.65	17,086,486.20	74,223,975.85
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-1,645,697.77	-848,404.99	-2,494,102.76
（一）、综合收益总额	-	-339,175.10	-339,175.10
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数 （净资产减少以“-”号填列）	-1,645,697.77	-509,229.89	-2,154,927.66
其中：1. 基金申购款	1,061,333.62	290,112.20	1,351,445.82
2. 基金赎回款	-2,707,031.39	-799,342.09	-3,506,373.48
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	55,491,791.88	16,238,081.21	71,729,873.09

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：

<u>胡甲</u>	<u>张壬午</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”)是由原长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。根据原《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》，原基金分级运作期为三年，分级运作期届满后转为上市开放式基金 (LOF)。根据深圳证券交易所深证上[2015]205 号《终止上市同意书》，原基金于 2015 年 5 月 20 日进行基金份额权益登记，于 2015 年 5 月 21 日终止上市。自 2015 年 5 月 22 日起，原基金分级运作期届满自动转为上市开放式基金 (LOF)，并更名为长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)。经向

中国证监会备案,《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)》于 2015 年 5 月 22 日正式生效,本基金为契约型开放式,存续期间不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

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

(税后)×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税

[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	10,738,720.88
等于：本金	10,737,765.80
加：应计利息	955.08
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	10,738,720.88

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		167,341,995.18	-	166,379,715.13	-962,280.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	42,021.97	131.80	44,049.40	1,895.63
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	42,021.97	131.80	44,049.40	1,895.63
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		167,384,017.15	131.80	166,423,764.53	-960,384.42

#### 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

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	35.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,179.30
其中：交易所市场	2,179.30
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	59,507.37
其他	607,536.79
合计	919,259.32

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	49,654,149.87	53,039,620.31
本期申购	66,563,163.71	71,114,508.19
本期赎回（以“-”号填列）	-6,779,121.20	-7,241,322.85
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	109,438,192.38	116,912,805.65

注：1、若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

2、截至 2025 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 34,775,130.00 份(2024 年 12 月 31 日：35,929,377.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 74,663,062.38 份(2024 年 12 月 31 日：13,724,772.87 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	90,331,868.86	-64,844,852.83	25,487,016.03
本期期初	90,331,868.86	-64,844,852.83	25,487,016.03
本期利润	1,363,176.19	-122,656.35	1,240,519.84
本期基金份额交易产生的变动数	108,702,457.23	-76,260,858.77	32,441,598.46
其中：基金申购款	121,031,270.07	-85,184,702.28	35,846,567.79
金赎回款	-12,328,812.84	8,923,843.51	-3,404,969.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	200,397,502.28	-141,228,367.95	59,169,134.33

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,945.77
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	236.17
其他	22.42
合计	18,204.36

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	415,642.89
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	415,642.89

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	8,443,779.50
减：卖出股票成本总额	7,995,991.39
减：交易费用	32,145.22
买卖股票差价收入	415,642.89

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	78.19
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-0.53
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	77.66

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	0.53



买卖债券差价收入	-0.53
----------	-------

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,835,981.48
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	1,835,981.48

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-122,656.35
股票投资	-122,806.11
债券投资	149.76
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	-122,656.35

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	11,374.48
基金转换费收入	0.78
合计	11,375.26

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	44,630.98
证券出借违约金	-
银行费用	510.00
合计	60,017.37

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

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

除以上情况外，无其他需要说明的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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
国元证券	-	-	720,499.00	16.52

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国元证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国元证券	681.51	16.52	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的研究服务。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	715,073.10	364,735.43
其中：应支付销售机构的客户维护费	103,857.94	60,380.88

应支付基金管理人的净管理费	611, 215. 16	304, 354. 55
---------------	--------------	--------------

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1. 00%的年管理费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times\text{年管理费率}/\text{当年天数}$$

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	143, 014. 62	72, 946. 99

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0. 20%的年托管费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times\text{年托管费率}/\text{当年天数}$$

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

无。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	10,738,720.88	17,945.77	5,667,141.95	9,630.04
合计	10,738,720.88	17,945.77	5,667,141.95	9,630.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行约定利率计息。

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（2025 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
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	限售期锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	限售期锁定	12.08	21.50	159	1,920.72	3,418.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	限售期锁定	89.60	152.21	42	3,763.20	6,392.82	-
301595	太力	2025 年 5 月	6 个月	限售期锁定	17.05	35.86	196	3,341.80	7,028.56	-

	科技	12 日		定						
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	限售期锁定	33.06	53.69	116	3,834.96	6,228.04	-
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	限售期锁定	12.80	54.21	277	3,545.60	15,016.17	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	限售期锁定	26.50	35.16	95	2,517.50	3,340.20	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	限售期锁定	46.50	42.99	85	3,952.50	3,654.15	-
603382	海阳科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	限售期锁定	11.50	28.45	105	1,207.50	2,987.25	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	限售期锁定	19.88	49.62	57	1,133.16	2,828.34	-
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	限售期锁定	22.77	44.55	203	4,622.31	9,043.65	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	限售期锁定	47.27	156.28	150	7,090.50	23,442.00	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

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

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

6 个月。本基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

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

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均

以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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，因而信用风险不重大。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。



本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,737,765.80	-	-	955.08	10,738,720.88
存出保证金	19,015.30	-	-	1.71	19,017.01
交易性金融资产	-	43,917.60	-	166,379,846.93	166,423,764.53
应收申购款	-	-	-	596.57	596.57
资产总计	10,756,781.10	43,917.60	-	166,381,400.29	177,182,098.99
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,677.07	9,677.07
应付管理人报酬	-	-	-	142,684.96	142,684.96
应付托管费	-	-	-	28,536.99	28,536.99
应交税费	-	-	-	0.67	0.67

其他负债	-	-	-	919,259.32	919,259.32
负债总计	-	-	-	1,100,159.01	1,100,159.01
利率敏感度缺口	10,756,781.10	43,917.60	-	165,281,241.28	176,081,939.98
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,658,340.53	-	-	550.89	5,658,891.42
存出保证金	1,250.13	-	-	0.60	1,250.73
交易性金融资产	-	30,445.87	-	73,893,140.45	73,923,586.32
应收申购款	-	-	-	2,556.76	2,556.76
资产总计	5,659,590.66	30,445.87	-	73,896,248.70	79,586,285.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,856.28	10,856.28
应付管理人报酬	-	-	-	67,303.80	67,303.80
应付托管费	-	-	-	13,460.76	13,460.76
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	968,027.70	968,027.70
负债总计	-	-	-	1,059,648.89	1,059,648.89
利率敏感度缺口	5,659,590.66	30,445.87	-	72,836,599.81	78,526,636.34

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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

本基金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，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	166,379,715.13	94.49	73,893,090.50	94.10
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	166,379,715.13	94.49	73,893,090.50	94.10

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	8,702,905.35	3,845,467.05
	2. 业绩比较基准下降 5%	-8,702,905.35	-3,845,467.05

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	166,324,999.31	73,847,776.32
第二层次	15,385.54	75,810.00
第三层次	83,379.68	—
合计	166,423,764.53	73,923,586.32

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的证券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。
--

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。
---

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	166,379,715.13	93.90
	其中：股票	166,379,715.13	93.90
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	44,049.40	0.02
	其中：债券	44,049.40	0.02

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,738,720.88	6.06
8	其他各项资产	19,613.58	0.01
9	合计	177,182,098.99	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,246,591.95	0.71
B	采矿业	7,475,224.43	4.25
C	制造业	84,293,613.17	47.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,112,695.15	3.47
E	建筑业	2,676,589.12	1.52
F	批发和零售业	1,273,569.29	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	4,944,863.66	2.81
H	住宿和餐饮业	107,550.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,399,251.37	5.34
J	金融业	33,654,066.97	19.11
K	房地产业	1,532,006.74	0.87
L	租赁和商务服务业	1,506,703.52	0.86
M	科学研究和技术服务业	1,759,609.24	1.00
N	水利、环境和公共设施管理业	189,745.50	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	72,828.00	0.04
Q	卫生和社会工作	491,692.80	0.28
R	文化、体育和娱乐业	685,302.78	0.39
S	综合	104,123.39	0.06
	合计	157,526,027.08	89.46

**7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	83,725.00	0.05
B	采矿业	150,018.00	0.09
C	制造业	6,724,462.74	3.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,357.00	0.07
E	建筑业	27,927.06	0.02
F	批发和零售业	160,349.89	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	107,712.00	0.06
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,047,611.07	0.59
J	金融业	—	—
K	房地产业	137,726.98	0.08
L	租赁和商务服务业	71,632.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	8,243.76	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	96,996.55	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	115,926.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	8,853,688.05	5.03

**7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

**7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细****7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,403	4,796,596.56	2.72
2	300750	宁德时代	14,140	3,566,390.80	2.03
3	601318	中国平安	55,818	3,096,782.64	1.76
4	600036	招商银行	64,316	2,955,320.20	1.68
5	600900	长江电力	81,220	2,447,970.80	1.39
6	000333	美的集团	24,738	1,786,083.60	1.01

7	601166	兴业银行	76,371	1,782,499.14	1.01
8	601899	紫金矿业	87,027	1,697,026.50	0.96
9	002594	比亚迪	4,884	1,621,048.44	0.92
10	300059	东方财富	64,794	1,498,685.22	0.85
11	600030	中信证券	54,124	1,494,904.88	0.85
12	601398	工商银行	188,412	1,430,047.08	0.81
13	600276	恒瑞医药	24,002	1,245,703.80	0.71
14	000858	五粮液	10,198	1,212,542.20	0.69
15	603259	药明康德	16,668	1,159,259.40	0.66
16	601328	交通银行	141,970	1,135,760.00	0.65
17	600919	江苏银行	93,920	1,121,404.80	0.64
18	000651	格力电器	23,823	1,070,129.16	0.61
19	601816	京沪高铁	178,500	1,026,375.00	0.58
20	601288	农业银行	167,467	984,705.96	0.56
21	688981	中芯国际	10,964	966,695.88	0.55
22	002475	立讯精密	25,952	900,274.88	0.51
23	300308	中际旭创	6,120	892,663.20	0.51
24	600887	伊利股份	31,834	887,531.92	0.50
25	600000	浦发银行	63,325	878,951.00	0.50
26	601211	国泰海通	45,534	872,431.44	0.50
27	300124	汇川技术	12,802	826,625.14	0.47
28	300760	迈瑞医疗	3,500	786,625.00	0.45
29	002352	顺丰控股	16,000	780,160.00	0.44
30	688256	寒武纪	1,286	773,529.00	0.44
31	000725	京东方 A	193,607	772,491.93	0.44
32	603019	中科曙光	10,700	753,280.00	0.43
33	601088	中国神华	18,396	745,773.84	0.42
34	601601	中国太保	18,440	691,684.40	0.39
35	002371	北方华创	1,559	689,405.39	0.39
36	688041	海光信息	4,873	688,506.17	0.39
37	601988	中国银行	117,938	662,811.56	0.38
38	601668	中国建筑	114,499	660,659.23	0.38
39	300502	新易盛	5,040	640,180.80	0.36
40	601728	中国电信	81,100	628,525.00	0.36
41	600016	民生银行	131,595	625,076.25	0.35
42	002714	牧原股份	14,795	621,537.95	0.35
43	300274	阳光电源	9,084	615,622.68	0.35
44	000001	平安银行	50,079	604,453.53	0.34
45	603501	豪威集团	4,610	588,466.50	0.33
46	000063	中兴通讯	18,062	586,834.38	0.33
47	600050	中国联通	109,872	586,716.48	0.33
48	601169	北京银行	85,594	584,607.02	0.33
49	002142	宁波银行	21,266	581,837.76	0.33

50	600660	福耀玻璃	10,153	578,822.53	0.33
51	601857	中国石油	66,931	572,260.05	0.32
52	002415	海康威视	20,391	565,442.43	0.32
53	600690	海尔智家	22,772	564,290.16	0.32
54	600031	三一重工	31,229	560,560.55	0.32
55	600309	万华化学	10,279	557,738.54	0.32
56	601229	上海银行	52,469	556,696.09	0.32
57	688008	澜起科技	6,786	556,452.00	0.32
58	601012	隆基绿能	36,948	554,958.96	0.32
59	000100	TCL 科技	128,127	554,789.91	0.32
60	601688	华泰证券	30,791	548,387.71	0.31
61	603986	兆易创新	4,300	544,079.00	0.31
62	600941	中国移动	4,800	540,240.00	0.31
63	002230	科大讯飞	11,150	533,862.00	0.30
64	600406	国电南瑞	23,736	531,923.76	0.30
65	000792	盐湖股份	30,700	524,356.00	0.30
66	600028	中国石化	92,596	522,241.44	0.30
67	600809	山西汾酒	2,934	517,528.26	0.29
68	601138	工业富联	24,200	517,396.00	0.29
69	000568	泸州老窖	4,534	514,155.60	0.29
70	601919	中远海控	33,790	508,201.60	0.29
71	601766	中国中车	71,987	506,788.48	0.29
72	601127	赛力斯	3,700	496,984.00	0.28
73	300498	温氏股份	28,900	493,612.00	0.28
74	688111	金山办公	1,715	480,285.75	0.27
75	688012	中微公司	2,628	479,084.40	0.27
76	000338	潍柴动力	31,006	476,872.28	0.27
77	601225	陕西煤业	24,392	469,302.08	0.27
78	600104	上汽集团	28,866	463,299.30	0.26
79	002027	分众传媒	62,000	452,600.00	0.26
80	600905	三峡能源	104,100	443,466.00	0.25
81	601985	中国核电	47,288	440,724.16	0.25
82	600150	中国船舶	13,300	432,782.00	0.25
83	601818	光大银行	103,196	428,263.40	0.24
84	300476	胜宏科技	3,000	403,140.00	0.23
85	600999	招商证券	22,800	401,052.00	0.23
86	601628	中国人寿	9,647	397,359.93	0.23
87	000425	徐工机械	50,854	395,135.58	0.22
88	002463	沪电股份	9,161	390,075.38	0.22
89	601006	大秦铁路	58,728	387,604.80	0.22
90	603288	海天味业	9,940	386,765.40	0.22
91	605499	东鹏饮料	1,190	373,719.50	0.21
92	603993	洛阳钼业	44,256	372,635.52	0.21



93	002179	中航光电	9,189	370,868.04	0.21
94	600760	中航沈飞	6,316	370,243.92	0.21
95	600436	片仔癀	1,845	369,018.45	0.21
96	601838	成都银行	18,133	364,473.30	0.21
97	600089	特变电工	30,394	362,600.42	0.21
98	000625	长安汽车	28,398	362,358.48	0.21
99	601888	中国中免	5,912	360,454.64	0.20
100	000538	云南白药	6,395	356,777.05	0.20
101	601009	南京银行	30,601	355,583.62	0.20
102	300033	同花顺	1,300	354,913.00	0.20
103	600048	保利发展	43,624	353,354.40	0.20
104	600111	北方稀土	14,083	350,666.70	0.20
105	600938	中国海油	13,402	349,926.22	0.20
106	600926	杭州银行	20,800	349,856.00	0.20
107	601390	中国中铁	61,899	347,253.39	0.20
108	002422	科伦药业	9,600	344,832.00	0.20
109	600019	宝钢股份	52,059	343,068.81	0.19
110	600547	山东黄金	10,734	342,736.62	0.19
111	601600	中国铝业	47,472	334,202.88	0.19
112	600584	长电科技	9,855	332,014.95	0.19
113	600415	小商品城	15,873	328,253.64	0.19
114	300015	爱尔眼科	26,085	325,540.80	0.18
115	002241	歌尔股份	13,954	325,407.28	0.18
116	601658	邮储银行	58,826	321,778.22	0.18
117	600958	东方证券	32,740	316,923.20	0.18
118	300014	亿纬锂能	6,900	316,089.00	0.18
119	600893	航发动力	8,026	309,322.04	0.18
120	600570	恒生电子	9,146	306,756.84	0.17
121	600585	海螺水泥	14,251	305,968.97	0.17
122	000977	浪潮信息	5,974	303,957.12	0.17
123	002050	三花智控	11,478	302,789.64	0.17
124	601989	中国重工	65,126	302,184.64	0.17
125	600009	上海机场	9,504	301,942.08	0.17
126	601336	新华保险	5,159	301,801.50	0.17
127	000938	紫光股份	12,302	295,124.98	0.17
128	603799	华友钴业	7,707	285,313.14	0.16
129	601901	方正证券	36,004	284,791.64	0.16
130	688036	传音控股	3,552	283,094.40	0.16
131	000988	华工科技	5,991	281,636.91	0.16
132	002311	海大集团	4,800	281,232.00	0.16
133	600015	华夏银行	35,263	278,930.33	0.16
134	000776	广发证券	16,486	277,129.66	0.16
135	600886	国投电力	18,678	275,313.72	0.16

136	000166	申万宏源	54,651	274,348.02	0.16
137	600438	通威股份	16,200	271,350.00	0.15
138	600988	赤峰黄金	10,900	271,192.00	0.15
139	002074	国轩高科	8,300	269,418.00	0.15
140	600795	国电电力	55,453	268,392.52	0.15
141	601360	三六零	26,000	265,200.00	0.15
142	002028	思源电气	3,617	263,715.47	0.15
143	002049	紫光国微	4,000	263,440.00	0.15
144	601916	浙商银行	75,500	255,945.00	0.15
145	300433	蓝思科技	11,400	254,220.00	0.14
146	600489	中金黄金	17,313	253,289.19	0.14
147	601377	兴业证券	40,063	247,989.97	0.14
148	000002	万科 A	38,554	247,516.68	0.14
149	300408	三环集团	7,400	247,160.00	0.14
150	000408	藏格矿业	5,700	243,219.00	0.14
151	001979	招商蛇口	27,636	242,367.72	0.14
152	601669	中国电建	48,988	238,571.56	0.14
153	601995	中金公司	6,600	233,376.00	0.13
154	002304	洋河股份	3,595	232,057.25	0.13
155	688271	联影医疗	1,815	231,848.10	0.13
156	600160	巨化股份	7,969	228,550.92	0.13
157	600010	包钢股份	127,216	227,716.64	0.13
158	601100	恒立液压	3,156	227,232.00	0.13
159	601162	天风证券	45,700	225,301.00	0.13
160	002340	格林美	35,400	224,790.00	0.13
161	300207	欣旺达	11,200	224,672.00	0.13
162	600115	中国东航	55,737	224,620.11	0.13
163	603369	今世缘	5,700	221,901.00	0.13
164	601319	中国人保	25,300	220,363.00	0.13
165	601111	中国国航	27,824	219,531.36	0.12
166	601881	中国银河	12,700	217,805.00	0.12
167	002648	卫星化学	12,546	217,422.18	0.12
168	600183	生益科技	7,209	217,351.35	0.12
169	002252	上海莱士	31,400	215,718.00	0.12
170	002465	海格通信	15,334	213,755.96	0.12
171	000807	云铝股份	13,300	212,534.00	0.12
172	300251	光线传媒	10,414	211,091.78	0.12
173	002460	赣锋锂业	6,240	210,724.80	0.12
174	000768	中航西飞	7,691	210,271.94	0.12
175	601186	中国铁建	26,251	210,270.51	0.12
176	600157	永泰能源	156,300	209,442.00	0.12
177	000963	华东医药	5,179	209,024.44	0.12
178	601788	光大证券	11,600	208,568.00	0.12

179	002195	岩山科技	37,043	208,552.09	0.12
180	601021	春秋航空	3,700	205,905.00	0.12
181	002797	第一创业	29,020	205,461.60	0.12
182	000661	长春高新	2,068	205,104.24	0.12
183	002558	巨人网络	8,700	204,885.00	0.12
184	002273	水晶光电	10,114	201,976.58	0.11
185	600039	四川路桥	20,387	201,831.30	0.11
186	600839	四川长虹	20,700	201,204.00	0.11
187	002466	天齐锂业	6,261	200,602.44	0.11
188	000157	中联重科	27,435	198,355.05	0.11
189	002736	国信证券	17,200	198,144.00	0.11
190	600460	士兰微	7,961	197,592.02	0.11
191	600066	宇通客车	7,934	197,239.24	0.11
192	601555	东吴证券	22,528	197,120.00	0.11
193	300782	卓胜微	2,760	196,981.20	0.11
194	600989	宝丰能源	12,200	196,908.00	0.11
195	002601	龙佰集团	12,100	196,141.00	0.11
196	000630	铜陵有色	58,723	196,134.82	0.11
197	600674	川投能源	12,218	195,976.72	0.11
198	300896	爱美客	1,120	195,787.20	0.11
199	300002	神州泰岳	16,535	195,113.00	0.11
200	601077	渝农商行	27,200	194,208.00	0.11
201	601878	浙商证券	17,800	194,198.00	0.11
202	300339	润和软件	3,800	193,154.00	0.11
203	600196	复星医药	7,674	192,540.66	0.11
204	002966	苏州银行	21,800	191,404.00	0.11
205	300394	天孚通信	2,380	190,019.20	0.11
206	600426	华鲁恒升	8,739	189,374.13	0.11
207	600879	航天电子	17,848	186,868.56	0.11
208	000975	山金国际	9,845	186,464.30	0.11
209	002001	新 和 成	8,760	186,325.20	0.11
210	600029	南方航空	31,482	185,743.80	0.11
211	002517	恺英网络	9,500	183,445.00	0.10
212	600487	亨通光电	11,960	182,988.00	0.10
213	601066	中信建投	7,600	182,780.00	0.10
214	603893	瑞芯微	1,200	182,232.00	0.10
215	002916	深南电路	1,690	182,198.90	0.10
216	300058	蓝色光标	27,651	181,390.56	0.10
217	601689	拓普集团	3,815	180,258.75	0.10
218	601800	中国交建	20,267	180,173.63	0.10
219	601058	赛轮轮胎	13,700	179,744.00	0.10
220	601168	西部矿业	10,663	177,325.69	0.10
221	600011	华能国际	24,800	177,072.00	0.10

222	002281	光迅科技	3,582	176,664.24	0.10
223	300418	昆仑万维	5,200	174,876.00	0.10
224	600161	天坛生物	9,087	174,379.53	0.10
225	002920	德赛西威	1,700	173,621.00	0.10
226	688521	芯原股份	1,794	173,121.00	0.10
227	600346	恒力石化	12,100	172,546.00	0.10
228	300661	圣邦股份	2,353	171,227.81	0.10
229	300347	泰格医药	3,170	169,024.40	0.10
230	600873	梅花生物	15,800	168,902.00	0.10
231	600188	兖矿能源	13,870	168,797.90	0.10
232	002236	大华股份	10,549	167,518.12	0.10
233	600741	华域汽车	9,433	166,492.45	0.09
234	600372	中航机载	13,800	166,428.00	0.09
235	688396	华润微	3,495	164,824.20	0.09
236	300759	康龙化成	6,700	164,418.00	0.09
237	601868	中国能建	73,233	163,309.59	0.09
238	600143	金发科技	15,821	163,114.51	0.09
239	003816	中国广核	44,700	162,708.00	0.09
240	688777	中控技术	3,604	161,855.64	0.09
241	600885	宏发股份	7,252	161,792.12	0.09
242	601633	长城汽车	7,525	161,637.00	0.09
243	600219	南山铝业	42,200	161,626.00	0.09
244	002294	信立泰	3,400	160,922.00	0.09
245	002202	金风科技	15,661	160,525.25	0.09
246	600588	用友网络	11,979	160,159.23	0.09
247	000895	双汇发展	6,537	159,568.17	0.09
248	603392	万泰生物	2,604	158,844.00	0.09
249	601117	中国化学	20,700	158,769.00	0.09
250	600536	中国软件	3,392	158,643.84	0.09
251	301236	软通动力	2,900	158,456.00	0.09
252	600176	中国巨石	13,804	157,365.60	0.09
253	000066	中国长城	10,600	156,880.00	0.09
254	300450	先导智能	6,300	156,555.00	0.09
255	688169	石头科技	997	156,080.35	0.09
256	600352	浙江龙盛	15,162	154,045.92	0.09
257	600096	云天化	7,000	153,790.00	0.09
258	002156	通富微电	6,000	153,720.00	0.09
259	002493	荣盛石化	18,550	153,594.00	0.09
260	601108	财通证券	19,310	152,742.10	0.09
261	000301	东方盛虹	18,300	152,439.00	0.09
262	601877	正泰电器	6,682	151,480.94	0.09
263	688002	睿创微纳	2,166	151,013.52	0.09
264	600362	江西铜业	6,435	150,772.05	0.09

265	603659	璞泰来	8,002	150,277.56	0.09
266	000997	新大陆	4,628	149,854.64	0.09
267	600482	中国动力	6,490	149,724.30	0.09
268	000786	北新建材	5,624	148,923.52	0.08
269	601615	明阳智能	12,900	148,221.00	0.08
270	605117	德业股份	2,778	146,289.48	0.08
271	600085	同仁堂	4,034	145,466.04	0.08
272	300017	网宿科技	13,495	144,666.40	0.08
273	000729	燕京啤酒	11,100	143,523.00	0.08
274	000933	神火股份	8,600	143,104.00	0.08
275	300803	指南针	1,770	142,768.20	0.08
276	002185	华天科技	14,100	142,410.00	0.08
277	600600	青岛啤酒	2,050	142,393.00	0.08
278	002180	纳思达	6,200	142,228.00	0.08
279	002595	豪迈科技	2,400	142,128.00	0.08
280	688099	晶晨股份	1,992	141,451.92	0.08
281	300316	晶盛机电	5,200	141,180.00	0.08
282	002129	TCL 中环	18,370	141,081.60	0.08
283	000783	长江证券	20,294	140,637.42	0.08
284	002065	东华软件	14,572	139,891.20	0.08
285	600079	人福医药	6,630	139,097.40	0.08
286	002414	高德红外	13,568	139,072.00	0.08
287	000878	云南铜业	10,900	138,648.00	0.08
288	600153	建发股份	13,364	138,584.68	0.08
289	300003	乐普医疗	10,000	137,800.00	0.08
290	002078	太阳纸业	10,225	137,628.50	0.08
291	688213	思特威	1,344	137,383.68	0.08
292	600580	卧龙电驱	6,898	136,373.46	0.08
293	002850	科达利	1,200	135,804.00	0.08
294	601128	常熟银行	18,414	135,711.18	0.08
295	600862	中航高科	5,200	135,616.00	0.08
296	600109	国金证券	15,392	134,987.84	0.08
297	300001	特锐德	5,600	134,232.00	0.08
298	688223	晶科能源	25,847	134,145.93	0.08
299	002709	天赐材料	7,380	133,725.60	0.08
300	300496	中科创达	2,300	131,606.00	0.07
301	002459	晶澳科技	13,176	131,496.48	0.07
302	000623	吉林敖东	7,755	131,447.25	0.07
303	300699	光威复材	4,140	131,113.80	0.07
304	000423	东阿阿胶	2,500	130,750.00	0.07
305	000750	国海证券	31,471	129,660.52	0.07
306	000876	新希望	13,812	129,556.56	0.07
307	601099	太平洋	32,800	128,904.00	0.07

308	300413	芒果超媒	5,900	128,738.00	0.07
309	600369	西南证券	29,592	128,725.20	0.07
310	002670	国盛金控	8,500	127,925.00	0.07
311	002223	鱼跃医疗	3,591	127,839.60	0.07
312	600233	圆通速递	9,900	127,611.00	0.07
313	300122	智飞生物	6,500	127,335.00	0.07
314	300073	当升科技	2,900	127,223.00	0.07
315	601618	中国中冶	42,606	126,965.88	0.07
316	002138	顺络电子	4,500	126,540.00	0.07
317	601607	上海医药	7,037	125,821.56	0.07
318	600895	张江高科	4,889	125,647.30	0.07
319	600298	安琪酵母	3,568	125,486.56	0.07
320	600845	宝信软件	5,298	125,138.76	0.07
321	601198	东兴证券	11,200	124,880.00	0.07
322	600171	上海贝岭	3,620	123,985.00	0.07
323	301269	华大九天	1,000	123,880.00	0.07
324	002673	西部证券	15,700	123,716.00	0.07
325	002624	完美世界	8,150	123,635.50	0.07
326	001965	招商公路	10,300	123,600.00	0.07
327	603596	伯特利	2,340	123,294.60	0.07
328	300395	菲利华	2,400	122,640.00	0.07
329	300454	深信服	1,300	122,434.00	0.07
330	300024	机器人	7,096	121,909.28	0.07
331	002821	凯莱英	1,380	121,785.00	0.07
332	002938	鹏鼎控股	3,800	121,714.00	0.07
333	300136	信维通信	5,400	120,960.00	0.07
334	000596	古井贡酒	908	120,900.20	0.07
335	603160	汇顶科技	1,700	120,751.00	0.07
336	002532	天山铝业	14,500	120,495.00	0.07
337	600515	海南机场	34,000	120,360.00	0.07
338	688126	沪硅产业	6,428	120,332.16	0.07
339	002353	杰瑞股份	3,438	120,330.00	0.07
340	002958	青农商行	33,300	120,213.00	0.07
341	002008	大族激光	4,921	119,924.77	0.07
342	688122	西部超导	2,285	118,545.80	0.07
343	603260	合盛硅业	2,500	118,500.00	0.07
344	688506	百利天恒	400	118,448.00	0.07
345	000519	中兵红箭	5,400	118,206.00	0.07
346	600549	厦门钨业	5,610	117,361.20	0.07
347	603228	景旺电子	2,800	117,152.00	0.07
348	300628	亿联网络	3,360	116,793.60	0.07
349	002926	华西证券	13,000	116,220.00	0.07
350	601872	招商轮船	18,560	116,185.60	0.07

351	601997	贵阳银行	18,600	116,064.00	0.07
352	300558	贝达药业	2,000	115,900.00	0.07
353	000831	中国稀土	3,200	115,584.00	0.07
354	000009	中国宝安	12,939	114,898.32	0.07
355	600765	中航重机	6,800	114,784.00	0.07
356	000893	亚钾国际	3,800	114,532.00	0.07
357	601696	中银证券	10,700	114,383.00	0.06
358	600497	驰宏锌锗	21,600	114,264.00	0.06
359	002841	视源股份	3,300	114,180.00	0.06
360	000738	航发控制	5,500	114,125.00	0.06
361	600177	雅戈尔	15,584	113,763.20	0.06
362	000039	中集集团	14,450	113,577.00	0.06
363	600332	白云山	4,300	113,348.00	0.06
364	600392	盛和资源	8,591	113,143.47	0.06
365	603296	华勤技术	1,400	112,952.00	0.06
366	688617	惠泰医疗	380	112,860.00	0.06
367	002436	兴森科技	8,500	112,540.00	0.06
368	601799	星宇股份	900	112,500.00	0.06
369	600061	国投资本	14,952	112,439.04	0.06
370	002739	万达电影	9,800	112,014.00	0.06
371	002155	湖南黄金	6,240	111,384.00	0.06
372	603486	科沃斯	1,900	110,637.00	0.06
373	002472	双环传动	3,300	110,517.00	0.06
374	600132	重庆啤酒	2,000	110,200.00	0.06
375	601238	广汽集团	14,700	110,103.00	0.06
376	600027	华电国际	20,100	109,947.00	0.06
377	300012	华测检测	9,400	109,886.00	0.06
378	601898	中煤能源	10,000	109,400.00	0.06
379	002738	中矿资源	3,400	109,344.00	0.06
380	601216	君正集团	19,808	109,340.16	0.06
381	300285	国瓷材料	6,300	109,305.00	0.06
382	002385	大北农	27,010	109,120.40	0.06
383	300724	捷佳伟创	2,000	108,600.00	0.06
384	603606	东方电缆	2,100	108,591.00	0.06
385	600998	九州通	21,029	108,089.06	0.06
386	600060	海信视像	4,673	107,572.46	0.06
387	002444	巨星科技	4,200	107,142.00	0.06
388	600023	浙能电力	20,200	107,060.00	0.06
389	600008	首创环保	35,435	107,013.70	0.06
390	601933	永辉超市	21,800	106,820.00	0.06
391	600529	山东药玻	4,800	106,272.00	0.06
392	000021	深科技	5,663	106,124.62	0.06
393	300054	鼎龙股份	3,700	106,116.00	0.06

394	300115	长盈精密	4,952	105,972.80	0.06
395	300142	沃森生物	9,600	105,600.00	0.06
396	302132	中航成飞	1,200	105,528.00	0.06
397	300037	新宙邦	2,980	104,896.00	0.06
398	600918	中泰证券	16,300	104,809.00	0.06
399	300383	光环新网	7,300	104,390.00	0.06
400	002203	海亮股份	10,100	104,232.00	0.06
401	600673	东阳光	8,953	104,123.39	0.06
402	600038	中直股份	2,675	103,816.75	0.06
403	300223	北京君正	1,500	103,800.00	0.06
404	603806	福斯特	7,994	103,602.24	0.06
405	600208	衢州发展	34,987	103,561.52	0.06
406	000703	恒逸石化	17,607	103,529.16	0.06
407	300765	新诺威	2,000	103,380.00	0.06
408	601577	长沙银行	10,400	103,376.00	0.06
409	300999	金龙鱼	3,500	103,355.00	0.06
410	688469	芯联集成	21,589	102,979.53	0.06
411	600699	均胜电子	5,900	102,896.00	0.06
412	601233	桐昆股份	9,700	102,820.00	0.06
413	600118	中国卫星	3,596	102,737.72	0.06
414	688047	龙芯中科	770	102,710.30	0.06
415	688072	拓荆科技	668	102,678.28	0.06
416	601179	中国西电	16,700	102,538.00	0.06
417	600583	海油工程	18,748	102,364.08	0.06
418	600875	东方电气	6,100	102,114.00	0.06
419	002410	广联达	7,597	101,875.77	0.06
420	000999	华润三九	3,250	101,660.00	0.06
421	601665	齐鲁银行	16,000	101,120.00	0.06
422	601990	南京证券	12,500	101,000.00	0.06
423	600521	华海药业	5,400	100,602.00	0.06
424	688578	艾力斯	1,080	100,483.20	0.06
425	000733	振华科技	2,000	100,100.00	0.06
426	000426	兴业银锡	6,300	99,540.00	0.06
427	603605	珀莱雅	1,200	99,348.00	0.06
428	300604	长川科技	2,200	98,802.00	0.06
429	600516	方大炭素	21,271	98,697.44	0.06
430	600141	兴发集团	4,800	98,544.00	0.06
431	002085	万丰奥威	6,200	98,518.00	0.06
432	002056	横店东磁	6,936	98,144.40	0.06
433	600909	华安证券	16,820	98,060.60	0.06
434	000636	风华高科	7,136	98,048.64	0.06
435	000400	许继电气	4,500	97,965.00	0.06
436	002007	华兰生物	6,230	97,624.10	0.06



437	300763	锦浪科技	1,700	97,563.00	0.06
438	603939	益丰药房	3,981	97,415.07	0.06
439	600018	上港集团	16,961	96,847.31	0.06
440	002152	广电运通	7,150	96,096.00	0.05
441	688385	复旦微电	1,942	95,682.34	0.05
442	600498	烽火通信	4,545	95,581.35	0.05
443	000932	华菱钢铁	21,700	95,480.00	0.05
444	000629	钒钛股份	37,200	95,232.00	0.05
445	600486	扬农化工	1,640	95,120.00	0.05
446	002683	广东宏大	2,800	95,032.00	0.05
447	603195	公牛集团	1,967	94,907.75	0.05
448	000617	中油资本	13,000	94,900.00	0.05
449	300474	景嘉微	1,300	94,900.00	0.05
450	600398	海澜之家	13,600	94,656.00	0.05
451	688599	天合光能	6,512	94,619.36	0.05
452	600704	物产中大	17,915	94,412.05	0.05
453	688525	佰维存储	1,392	93,820.80	0.05
454	600435	北方导航	6,000	93,540.00	0.05
455	600867	通化东宝	11,400	93,480.00	0.05
456	603927	中科软	4,820	93,218.80	0.05
457	002439	启明星辰	5,800	92,742.00	0.05
458	600803	新奥股份	4,900	92,610.00	0.05
459	600155	华创云信	13,300	92,568.00	0.05
460	600859	王府井	6,654	92,424.06	0.05
461	688120	华海清科	541	91,266.70	0.05
462	688180	君实生物	2,684	91,202.32	0.05
463	300748	金力永磁	3,800	90,592.00	0.05
464	600348	华阳股份	13,450	89,577.00	0.05
465	601966	玲珑轮胎	6,100	89,487.00	0.05
466	000513	丽珠集团	2,472	89,090.88	0.05
467	600021	上海电力	10,114	88,902.06	0.05
468	000960	锡业股份	5,810	88,893.00	0.05
469	600637	东方明珠	11,865	88,631.55	0.05
470	000050	深天马 A	10,400	88,608.00	0.05
471	603087	甘李药业	1,600	87,648.00	0.05
472	603885	吉祥航空	6,500	87,555.00	0.05
473	002409	雅克科技	1,600	87,504.00	0.05
474	600563	法拉电子	800	87,272.00	0.05
475	002773	康弘药业	3,000	86,910.00	0.05
476	603129	春风动力	400	86,600.00	0.05
477	000034	神州数码	2,300	86,572.00	0.05
478	300601	康泰生物	5,667	86,081.73	0.05
479	601059	信达证券	5,000	85,500.00	0.05

480	600535	天士力	5,462	85,480.30	0.05
481	000708	中信特钢	7,200	84,672.00	0.05
482	300442	润泽科技	1,700	84,201.00	0.05
483	000983	山西焦煤	13,100	83,840.00	0.05
484	688052	纳芯微	480	83,755.20	0.05
485	603979	金诚信	1,800	83,592.00	0.05
486	002939	长城证券	9,900	82,962.00	0.05
487	300144	宋城演艺	9,700	82,935.00	0.05
488	002025	航天电器	1,600	82,256.00	0.05
489	002120	韵达股份	12,200	81,740.00	0.05
490	600820	隧道股份	13,400	81,740.00	0.05
491	002600	领益智造	9,500	81,605.00	0.05
492	600170	上海建工	33,996	81,250.44	0.05
493	600655	豫园股份	14,589	80,968.95	0.05
494	300212	易华录	3,720	80,947.20	0.05
495	300070	碧水源	17,907	80,581.50	0.05
496	002261	拓维信息	2,600	80,470.00	0.05
497	603345	安井食品	1,000	80,420.00	0.05
498	600499	科达制造	8,200	80,360.00	0.05
499	002432	九安医疗	2,200	80,146.00	0.05
500	603589	口子窖	2,300	80,040.00	0.05
501	601098	中南传媒	6,100	80,032.00	0.05
502	603179	新泉股份	1,700	79,849.00	0.05
503	300832	新产业	1,400	79,408.00	0.05
504	600025	华能水电	8,300	79,265.00	0.05
505	002429	兆驰股份	17,900	78,402.00	0.04
506	600004	白云机场	8,600	78,260.00	0.04
507	600390	五矿资本	13,400	78,122.00	0.04
508	688249	晶合集成	3,854	78,120.58	0.04
509	600166	福田汽车	28,756	77,928.76	0.04
510	688361	中科飞测	922	77,623.18	0.04
511	002044	美年健康	15,000	77,100.00	0.04
512	002500	山西证券	13,172	76,924.48	0.04
513	600282	南钢股份	18,300	76,860.00	0.04
514	601155	新城控股	5,600	76,608.00	0.04
515	603858	步长制药	4,700	76,328.00	0.04
516	601699	潞安环能	7,200	75,960.00	0.04
517	600848	上海临港	8,340	75,643.80	0.04
518	603833	欧派家居	1,340	75,643.00	0.04
519	002064	华峰化学	11,400	75,354.00	0.04
520	600959	江苏有线	21,860	75,198.40	0.04
521	002831	裕同科技	3,200	74,944.00	0.04
522	002318	久立特材	3,200	74,848.00	0.04

523	601717	中创智领	4,500	74,790.00	0.04
524	601236	红塔证券	8,800	74,536.00	0.04
525	600325	华发股份	15,236	74,199.32	0.04
526	002080	中材科技	3,800	74,100.00	0.04
527	300146	汤臣倍健	6,586	74,026.64	0.04
528	600977	中国电影	6,900	73,968.00	0.04
529	600380	健康元	6,700	73,901.00	0.04
530	688188	柏楚电子	560	73,729.60	0.04
531	603658	安图生物	1,960	73,500.00	0.04
532	603816	顾家家居	2,880	73,497.60	0.04
533	002508	老板电器	3,839	72,979.39	0.04
534	000060	中金岭南	15,904	72,840.32	0.04
535	002607	中公教育	23,800	72,828.00	0.04
536	000598	兴蓉环境	10,095	72,784.95	0.04
537	600511	国药股份	2,485	72,462.60	0.04
538	601611	中国核建	7,800	71,682.00	0.04
539	600316	洪都航空	1,900	71,630.00	0.04
540	000709	河钢股份	33,047	71,381.52	0.04
541	600026	中远海能	6,900	71,277.00	0.04
542	600126	杭钢股份	7,900	71,100.00	0.04
543	300677	英科医疗	2,980	70,566.40	0.04
544	600739	辽宁成大	6,412	70,532.00	0.04
545	688187	时代电气	1,652	70,457.80	0.04
546	300487	蓝晓科技	1,400	70,420.00	0.04
547	600737	中粮糖业	7,400	69,930.00	0.04
548	605358	立昂微	3,000	69,900.00	0.04
549	603000	人民网	3,430	69,320.30	0.04
550	600528	中铁工业	9,376	69,194.88	0.04
551	002568	百润股份	2,700	69,147.00	0.04
552	601000	唐山港	17,000	69,020.00	0.04
553	600808	马钢股份	19,900	68,655.00	0.04
554	301358	湖南裕能	2,200	68,618.00	0.04
555	300390	天华新能	3,590	68,461.30	0.04
556	688472	阿特斯	7,459	68,249.85	0.04
557	300595	欧普康视	4,460	68,104.20	0.04
558	688009	中国通号	13,222	67,961.08	0.04
559	600901	江苏金租	11,200	67,872.00	0.04
560	601991	大唐发电	21,400	67,838.00	0.04
561	300919	中伟股份	2,060	67,732.80	0.04
562	603156	养元饮品	3,200	67,712.00	0.04
563	002653	海思科	1,600	67,552.00	0.04
564	002572	索菲亚	4,802	67,276.02	0.04
565	000739	普洛药业	4,800	67,200.00	0.04

566	002756	永兴材料	2,110	66,992.50	0.04
567	000887	中鼎股份	3,800	66,842.00	0.04
568	600801	华新水泥	5,643	66,813.12	0.04
569	603899	晨光股份	2,300	66,677.00	0.04
570	000683	博源化工	13,900	66,581.00	0.04
571	601118	海南橡胶	14,100	66,552.00	0.04
572	603338	浙江鼎力	1,400	66,360.00	0.04
573	600763	通策医疗	1,600	66,048.00	0.04
574	688017	绿的谐波	528	65,941.92	0.04
575	688303	大全能源	3,092	65,921.44	0.04
576	603077	和邦生物	37,600	65,800.00	0.04
577	688065	凯赛生物	1,388	65,374.80	0.04
578	601666	平煤股份	8,800	65,208.00	0.04
579	600598	北大荒	4,500	64,890.00	0.04
580	688114	华大智造	1,000	64,830.00	0.04
581	300676	华大基因	1,300	64,701.00	0.04
582	601880	辽港股份	43,000	64,500.00	0.04
583	000723	美锦能源	14,900	64,368.00	0.04
584	002507	涪陵榨菜	4,990	63,822.10	0.04
585	600271	航天信息	6,876	63,534.24	0.04
586	603290	斯达半导	780	63,390.60	0.04
587	603568	伟明环保	3,300	62,964.00	0.04
588	300529	健帆生物	2,900	62,553.00	0.04
589	603233	大参林	3,825	62,347.50	0.04
590	000591	太阳能	14,200	62,338.00	0.04
591	000027	深圳能源	9,749	62,198.62	0.04
592	600863	内蒙华电	15,000	61,650.00	0.04
593	600312	平高电气	4,000	61,560.00	0.03
594	603737	三棵树	1,669	61,502.65	0.03
595	601698	中国卫通	3,000	61,410.00	0.03
596	601016	节能风电	21,110	61,007.90	0.03
597	000830	鲁西化工	5,900	60,770.00	0.03
598	300567	精测电子	1,000	60,610.00	0.03
599	002262	恩华药业	2,900	60,262.00	0.03
600	002984	森麒麟	3,200	60,000.00	0.03
601	601958	金钼股份	5,400	59,076.00	0.03
602	000987	越秀资本	8,600	58,996.00	0.03
603	601456	国联民生	5,700	58,995.00	0.03
604	002153	石基信息	6,807	58,948.62	0.03
605	002244	滨江集团	6,000	58,500.00	0.03
606	688538	和辉光电	24,840	58,125.60	0.03
607	600566	济川药业	2,200	57,926.00	0.03
608	603379	三美股份	1,200	57,744.00	0.03

609	300888	稳健医疗	1,400	57,540.00	0.03
610	600582	天地科技	9,600	57,504.00	0.03
611	002299	圣农发展	4,000	57,160.00	0.03
612	300751	迈为股份	820	57,039.20	0.03
613	600872	中炬高新	3,000	57,000.00	0.03
614	000921	海信家电	2,200	56,540.00	0.03
615	688220	翱捷科技	722	56,532.60	0.03
616	002603	以岭药业	4,000	56,400.00	0.03
617	688278	特宝生物	782	56,390.02	0.03
618	601865	福莱特	3,700	56,277.00	0.03
619	600816	建元信托	19,000	56,050.00	0.03
620	601136	首创证券	2,800	55,664.00	0.03
621	601231	环旭电子	3,800	55,594.00	0.03
622	600606	绿地控股	33,893	55,245.59	0.03
623	601156	东航物流	4,200	54,978.00	0.03
624	002372	伟星新材	5,300	54,908.00	0.03
625	000800	一汽解放	8,000	54,880.00	0.03
626	688772	珠海冠宇	3,826	54,673.54	0.03
627	603298	杭叉集团	2,600	54,470.00	0.03
628	600685	中船防务	2,000	54,380.00	0.03
629	002430	杭氧股份	2,800	54,376.00	0.03
630	600378	昊华科技	2,000	54,140.00	0.03
631	600754	锦江酒店	2,400	53,856.00	0.03
632	002423	中粮资本	4,400	53,812.00	0.03
633	600258	首旅酒店	3,800	53,694.00	0.03
634	000403	派林生物	2,960	53,664.80	0.03
635	600329	达仁堂	1,600	53,376.00	0.03
636	000958	电投产融	7,800	53,352.00	0.03
637	601636	旗滨集团	10,600	53,106.00	0.03
638	600707	彩虹股份	8,200	52,972.00	0.03
639	000563	陕国投 A	14,800	52,836.00	0.03
640	301308	江波龙	600	52,494.00	0.03
641	600546	山煤国际	6,000	52,380.00	0.03
642	600970	中材国际	6,100	52,338.00	0.03
643	600483	福能股份	5,400	52,056.00	0.03
644	688297	中无人机	972	51,904.80	0.03
645	600884	杉杉股份	5,400	51,084.00	0.03
646	603688	石英股份	1,450	51,069.00	0.03
647	000155	川能动力	5,200	51,064.00	0.03
648	000883	湖北能源	11,200	50,512.00	0.03
649	600906	财达证券	7,400	50,468.00	0.03
650	600517	国网英大	9,800	49,980.00	0.03
651	600131	国网信通	2,800	49,560.00	0.03

652	688561	奇安信	1,452	49,338.96	0.03
653	688301	奕瑞科技	560	49,061.60	0.03
654	000559	万向钱潮	6,400	48,960.00	0.03
655	601001	晋控煤业	4,000	48,880.00	0.03
656	688234	天岳先进	826	48,362.30	0.03
657	688082	盛美上海	422	48,082.68	0.03
658	601918	新集能源	7,400	47,804.00	0.03
659	600764	中国海防	1,400	47,600.00	0.03
660	300979	华利集团	900	47,313.00	0.03
661	601808	中海油服	3,400	46,784.00	0.03
662	300373	扬杰科技	900	46,710.00	0.03
663	000825	太钢不锈	13,000	46,670.00	0.03
664	000032	深桑达 A	2,300	46,529.00	0.03
665	002266	浙富控股	15,000	46,200.00	0.03
666	600871	石化油服	23,600	46,020.00	0.03
667	603728	鸣志电器	800	45,976.00	0.03
668	603707	健友股份	4,111	45,837.65	0.03
669	688778	厦钨新能	808	45,183.36	0.03
670	600995	南网储能	4,600	44,988.00	0.03
671	601568	北元集团	10,800	44,820.00	0.03
672	603529	爱玛科技	1,300	44,720.00	0.03
673	601212	白银有色	14,200	44,446.00	0.03
674	601106	中国一重	15,800	44,240.00	0.03
675	300573	兴齐眼药	840	43,503.60	0.02
676	600056	中国医药	4,200	43,428.00	0.02
677	600578	京能电力	9,600	43,104.00	0.02
678	003031	中瓷电子	800	42,568.00	0.02
679	000785	居然智家	13,800	42,090.00	0.02
680	000967	盈峰环境	6,000	41,700.00	0.02
681	601399	国机重装	13,800	41,400.00	0.02
682	600373	中文传媒	4,000	41,080.00	0.02
683	603225	新凤鸣	3,800	40,470.00	0.02
684	601928	凤凰传媒	3,600	40,212.00	0.02
685	600968	海油发展	9,800	39,984.00	0.02
686	688387	信科移动	6,915	39,069.75	0.02
687	603650	彤程新材	1,200	38,580.00	0.02
688	301301	川宁生物	3,200	38,528.00	0.02
689	601608	中信重工	8,800	38,456.00	0.02
690	688520	神州细胞	642	38,423.70	0.02
691	601598	中国外运	7,600	37,468.00	0.02
692	600062	华润双鹤	2,000	37,320.00	0.02
693	600377	宁沪高速	2,400	36,816.00	0.02
694	688363	华熙生物	702	36,047.70	0.02

695	601965	中国汽研	2,000	35,500.00	0.02
696	600925	苏能股份	6,600	34,518.00	0.02
697	301165	锐捷网络	560	34,417.60	0.02
698	601866	中远海发	13,900	34,333.00	0.02
699	688281	华秦科技	560	33,885.60	0.02
700	600663	陆家嘴	3,800	33,668.00	0.02
701	688425	铁建重工	8,088	32,999.04	0.02
702	003022	联泓新科	2,000	31,660.00	0.02
703	001286	陕西能源	3,600	31,320.00	0.02
704	600098	广州发展	5,000	31,250.00	0.02
705	003035	南网能源	6,800	31,212.00	0.02
706	600688	上海石化	10,600	30,210.00	0.02
707	600612	老凤祥	600	29,850.00	0.02
708	688349	三一重能	1,178	29,379.32	0.02
709	000937	冀中能源	5,000	28,750.00	0.02
710	688563	航材股份	504	28,541.52	0.02
711	601019	山东出版	3,000	28,410.00	0.02
712	300140	节能环保	4,400	27,148.00	0.02
713	600095	湘财股份	2,700	27,081.00	0.02
714	000537	中绿电	3,200	26,752.00	0.02
715	601139	深圳燃气	4,200	26,712.00	0.02
716	300957	贝泰妮	600	26,532.00	0.02
717	000898	鞍钢股份	11,400	26,448.00	0.02
718	002608	江苏国信	3,600	26,388.00	0.01
719	600720	中交设计	3,400	26,282.00	0.01
720	600339	中油工程	8,000	26,160.00	0.01
721	600032	浙江新能	3,400	25,704.00	0.01
722	688248	南网科技	814	25,608.44	0.01
723	603556	海兴电力	1,000	25,470.00	0.01
724	000959	首钢股份	7,400	25,160.00	0.01
725	600928	西安银行	6,400	25,088.00	0.01
726	600295	鄂尔多斯	2,800	24,388.00	0.01
727	600361	创新新材	6,000	23,940.00	0.01
728	688475	萤石网络	756	23,829.12	0.01
729	601228	广州港	7,200	23,256.00	0.01
730	301267	华夏眼科	1,200	23,004.00	0.01
731	688172	燕东微	1,152	22,648.32	0.01
732	603786	科博达	400	22,164.00	0.01
733	301498	乖宝宠物	200	21,874.00	0.01
734	603868	飞科电器	600	21,522.00	0.01
735	600927	永安期货	1,400	20,734.00	0.01
736	600007	中国国贸	1,000	20,580.00	0.01
737	601061	中信金属	2,600	20,566.00	0.01

738	002563	森马服饰	3,800	19,988.00	0.01
739	688032	禾迈股份	200	19,972.00	0.01
740	603826	坤彩科技	1,000	19,570.00	0.01
741	600299	安迪苏	2,000	19,300.00	0.01
742	000539	粤电力 A	4,200	19,068.00	0.01
743	688375	国博电子	310	18,603.10	0.01
744	002945	华林证券	1,200	17,244.00	0.01
745	601858	中国科传	800	15,560.00	0.01
746	688819	天能股份	527	14,629.52	0.01
747	601825	沪农商行	1,400	13,580.00	0.01
748	601158	重庆水务	2,800	12,992.00	0.01
749	001289	龙源电力	800	12,944.00	0.01
750	688153	唯捷创芯	414	12,838.14	0.01
751	600956	新天绿能	1,400	10,808.00	0.01
752	688295	中复神鹰	476	9,900.80	0.01
753	603341	龙旗科技	200	8,126.00	0.00
754	002851	麦格米特	100	5,014.00	0.00
755	002130	沃尔核材	200	4,764.00	0.00
756	300458	全志科技	100	3,969.00	0.00
757	000528	柳 工	400	3,844.00	0.00
758	300627	华测导航	100	3,500.00	0.00
759	000415	渤海租赁	1,000	3,330.00	0.00
760	300346	南大光电	100	3,164.00	0.00
761	600562	国睿科技	100	3,149.00	0.00
762	300623	捷捷微电	100	2,980.00	0.00
763	002837	英维克	100	2,971.00	0.00
764	605589	圣泉集团	100	2,775.00	0.00
765	000062	深圳华强	100	2,686.00	0.00
766	002312	川发龙蟒	200	2,296.00	0.00
767	001696	宗申动力	100	2,245.00	0.00
768	000429	粤高速 A	100	1,333.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300866	安克创新	8,240	936,064.00	0.53
2	600418	江淮汽车	10,600	424,954.00	0.24
3	002625	光启技术	9,800	391,804.00	0.22
4	300862	蓝盾光电	13,520	358,009.60	0.20
5	002384	东山精密	7,900	298,383.00	0.17
6	600703	三安光电	21,558	267,750.36	0.15
7	688076	ST 诺泰	6,362	236,793.64	0.13
8	002555	三七互娱	11,800	204,022.00	0.12
9	002456	欧菲光	17,055	202,101.75	0.11



10	600745	闻泰科技	4,700	157,591.00	0.09
11	688306	均普智能	14,851	146,133.84	0.08
12	002128	电投能源	6,500	128,570.00	0.07
13	002271	东方雨虹	11,450	122,858.50	0.07
14	600642	申能股份	13,835	118,981.00	0.07
15	600967	内蒙一机	5,368	103,870.80	0.06
16	300253	卫宁健康	9,648	102,268.80	0.06
17	002407	多氟多	8,280	100,933.20	0.06
18	688400	凌云光	3,634	100,189.38	0.06
19	688480	赛恩斯	3,017	96,996.55	0.06
20	002268	电科网安	5,000	91,450.00	0.05
21	603444	吉比特	300	90,585.00	0.05
22	600779	水井坊	2,100	89,544.00	0.05
23	002317	众生药业	5,882	88,288.82	0.05
24	600273	嘉化能源	10,400	87,984.00	0.05
25	000681	视觉中国	4,300	86,602.00	0.05
26	688409	富创精密	1,523	83,780.23	0.05
27	000998	隆平高科	8,500	83,725.00	0.05
28	000799	酒鬼酒	1,900	83,581.00	0.05
29	002368	太极股份	3,545	83,023.90	0.05
30	002373	千方科技	8,900	82,770.00	0.05
31	300088	长信科技	13,720	81,771.20	0.05
32	601567	三星医疗	3,600	80,712.00	0.05
33	002019	亿帆医药	6,200	80,538.00	0.05
34	688496	清越科技	8,551	79,524.30	0.05
35	300009	安科生物	9,320	78,008.40	0.04
36	688005	容百科技	3,455	77,115.60	0.04
37	300113	顺网科技	3,800	75,088.00	0.04
38	600755	厦门国贸	11,840	71,632.00	0.04
39	000778	新兴铸管	19,182	71,357.04	0.04
40	002497	雅化集团	6,200	70,680.00	0.04
41	603882	金域医学	2,400	68,544.00	0.04
42	300296	利亚德	11,100	67,710.00	0.04
43	600416	湘电股份	5,000	67,200.00	0.04
44	000970	中科三环	5,697	67,053.69	0.04
45	603888	新华网	2,800	67,032.00	0.04
46	002240	盛新锂能	5,200	66,976.00	0.04
47	600383	金地集团	17,662	66,938.98	0.04
48	603883	老百姓	3,165	66,496.65	0.04
49	002487	大金重工	2,000	65,800.00	0.04
50	002221	东华能源	6,714	64,857.24	0.04
51	688536	思瑞浦	446	61,869.12	0.04
52	688390	固德威	1,387	60,265.15	0.03

53	002032	苏 泊 尔	1,100	57,629.00	0.03
54	002557	洽洽食品	2,600	56,212.00	0.03
55	600718	东软集团	5,759	56,150.25	0.03
56	000581	威孚高科	2,944	55,759.36	0.03
57	000860	顺鑫农业	3,411	53,041.05	0.03
58	002690	美亚光电	3,110	52,465.70	0.03
59	688331	荣昌生物	852	51,546.00	0.03
60	002468	申通快递	4,800	51,312.00	0.03
61	002250	联化科技	4,546	50,006.00	0.03
62	300118	东方日升	5,000	47,900.00	0.03
63	300244	迪安诊断	3,180	47,382.00	0.03
64	300618	寒锐钴业	1,300	46,436.00	0.03
65	603456	九洲药业	3,000	45,630.00	0.03
66	600315	上海家化	2,100	44,247.00	0.03
67	600732	爱旭股份	3,360	44,016.00	0.02
68	300568	星源材质	3,400	43,112.00	0.02
69	300026	红日药业	11,000	40,590.00	0.02
70	603185	弘元绿能	2,678	39,768.30	0.02
71	000156	华数传媒	5,000	39,700.00	0.02
72	300357	我武生物	1,900	39,216.00	0.02
73	600129	太极集团	1,800	38,358.00	0.02
74	000012	南 玻 A	8,300	38,346.00	0.02
75	603517	绝味食品	2,500	38,125.00	0.02
76	000401	冀东水泥	8,499	37,225.62	0.02
77	002531	天顺风能	5,200	37,128.00	0.02
78	601992	金隅集团	24,400	37,088.00	0.02
79	600597	光明乳业	4,312	36,263.92	0.02
80	600350	山东高速	3,200	34,112.00	0.02
81	603712	七一二	1,600	33,616.00	0.02
82	600399	抚顺特钢	6,400	33,408.00	0.02
83	600500	中化国际	8,600	32,938.00	0.02
84	002511	中顺洁柔	4,800	32,256.00	0.02
85	001914	招商积余	2,500	30,925.00	0.02
86	300769	德方纳米	880	29,057.60	0.02
87	002867	周大生	2,200	28,996.00	0.02
88	002081	金 螳 螂	8,142	27,927.06	0.02
89	688516	奥特维	756	25,129.44	0.01
90	002110	三钢闽光	7,000	24,570.00	0.01
91	688775	影石创新	150	23,442.00	0.01
92	603056	德邦股份	1,400	22,288.00	0.01
93	002192	融捷股份	700	21,448.00	0.01
94	000031	大悦城	7,700	20,405.00	0.01
95	000402	金 融 街	6,900	19,458.00	0.01

96	000877	天山股份	4,192	19,450.88	0.01
97	001388	信通电子	937	15,385.54	0.01
98	301678	新恒汇	277	15,016.17	0.01
99	688276	百克生物	596	12,516.00	0.01
100	002326	永太科技	800	10,296.00	0.01
101	603267	鸿远电子	200	10,054.00	0.01
102	688755	汉邦科技	203	9,043.65	0.01
103	300363	博腾股份	500	8,540.00	0.00
104	603127	昭衍新药	392	8,243.76	0.00
105	300682	朗新集团	300	7,050.00	0.00
106	301595	太力科技	196	7,028.56	0.00
107	301590	优优绿能	42	6,392.82	0.00
108	301636	泽润新能	116	6,228.04	0.00
109	002249	大洋电机	800	5,264.00	0.00
110	603638	艾迪精密	220	3,847.80	0.00
111	603049	中策橡胶	85	3,654.15	0.00
112	001390	古麒绒材	159	3,418.50	0.00
113	603014	威高血净	95	3,340.20	0.00
114	600782	新钢股份	900	3,186.00	0.00
115	603382	海阳科技	105	2,987.25	0.00
116	603400	华之杰	57	2,828.34	0.00
117	300438	鹏辉能源	100	2,761.00	0.00
118	603218	日月股份	200	2,538.00	0.00
119	600409	三友化工	500	2,430.00	0.00
120	601778	晶科科技	800	2,376.00	0.00
121	603866	桃李面包	400	2,160.00	0.00
122	002791	坚朗五金	100	2,140.00	0.00
123	605377	华旺科技	235	2,070.35	0.00
124	300861	美畅股份	100	2,033.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,809,229.00	3.58
2	300750	宁德时代	2,162,367.00	2.75
3	600900	长江电力	1,660,841.00	2.12
4	601318	中国平安	1,616,319.00	2.06
5	600036	招商银行	1,576,746.00	2.01
6	000333	美的集团	1,028,691.00	1.31
7	002594	比亚迪	1,013,245.00	1.29
8	601166	兴业银行	931,426.00	1.19
9	300059	东方财富	900,099.00	1.15
10	600030	中信证券	880,368.00	1.12

11	601899	紫金矿业	817,170.00	1.04
12	603259	药明康德	774,236.00	0.99
13	000858	五 粮 液	763,436.00	0.97
14	601816	京沪高铁	747,675.00	0.95
15	601398	工商银行	726,572.00	0.93
16	600276	恒瑞医药	674,062.00	0.86
17	002475	立讯精密	657,218.00	0.84
18	601211	国泰海通	648,617.92	0.83
19	600919	江苏银行	647,496.00	0.82
20	688256	寒武纪	639,415.47	0.81

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	604,118.00	0.77
2	300750	宁德时代	398,851.86	0.51
3	601318	中国平安	371,357.00	0.47
4	600036	招商银行	331,596.00	0.42
5	600837	海通证券	324,235.92	0.41
6	600900	长江电力	298,118.00	0.38
7	688775	影石创新	245,154.00	0.31
8	000333	美的集团	219,372.00	0.28
9	601166	兴业银行	210,329.00	0.27
10	601998	中信银行	197,792.24	0.25
11	601899	紫金矿业	185,315.00	0.24
12	002594	比亚迪	178,657.00	0.23
13	601398	工商银行	165,109.00	0.21
14	600030	中信证券	163,336.00	0.21
15	300059	东方财富	159,128.00	0.20
16	601328	交通银行	155,607.00	0.20
17	600276	恒瑞医药	152,115.00	0.19
18	000858	五 粮 液	149,457.00	0.19
19	600919	江苏银行	129,648.00	0.17
20	603259	药明康德	129,277.00	0.16

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	100,605,422.13
卖出股票收入（成交）总额	8,443,779.50

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	44,049.40	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,049.40	0.03

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	127089	晶澳转债	247	25,956.02	0.01
2	127073	天赐转债	102	11,725.18	0.01
3	127085	韵达转债	58	6,368.20	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述 3 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

一、招商银行：

2024 年 8 月 26 日，招商银行信用卡中心因“隐瞒与保险合同有关的重要情况”，被责令改正，处罚款人民币 5 万元，没收违法所得 7,610.24 元。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

二、兴业银行：

2024 年 7 月 25 日，闽金罚决字（2024）12 号显示，兴业银行股份有限公司存在未严格按照公布的收费价目名录收费等 3 项违法违规事实，被处罚款 190 万元。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

除上述事项外，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	19,017.01
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	596.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,613.58

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	127089	晶澳转债	25,956.02	0.01
2	127073	天赐转债	11,725.18	0.01
3	127085	韵达转债	6,368.20	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票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 （%）
6,552	16,703.02	62,004,708.76	56.66	47,433,483.62	43.34

注：以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	王飞舟	1,677,417.00	4.82
2	靳宁卿	980,400.00	2.82
3	纪伟才	938,029.00	2.70
4	于成福	932,390.00	2.68
5	于君	711,529.00	2.05
6	李坚	500,000.00	1.44
7	于延年	499,916.00	1.44
8	符王莹月	466,006.00	1.34
9	肖诚	437,235.00	1.26
10	袁湘芸	366,133.00	1.05

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	19,048.59	0.0174

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、基金投资和研部	0

门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 22 日） 基金份额总额	542,268,490.78
本报告期期初基金份额总额	49,654,149.87
本报告期基金总申购份额	66,563,163.71
减：本报告期基金总赎回份额	6,779,121.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	109,438,192.38

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本报告期内本基金管理人的高级管理人员未发生重大人事变动。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期内本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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容诚会计师事务所（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

本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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 (%)	
长江证券	1	65,138,060.38	60.30	12,761.21	60.30	—
光大证券	1	39,436,029.78	36.51	7,725.66	36.51	—
东北证券	1	3,443,921.97	3.19	674.59	3.19	—
国泰海通	1	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
华西证券	1	—	—	—	—	—
银河证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	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 (%)
长江证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	13,345.65	100.00	—	—	—	—

东北证 券	-	-	-	-	-	-
国泰海 通	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-

注：1、交易单元的选择标准

（1）具备监管机构规定的相关资质、财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力较强。

（2）具有较强的研究服务能力、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。

（3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要。

2、交易单元的选择程序：

（1）基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

（2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。

3、本报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

（1）报告期内，本基金新增租用：无。

（2）报告期内，本基金停止租用：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2024 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 22 日
2	长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 22 日
3	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书（更新）	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网	2025 年 1 月 27 日

		站	
4	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 27 日
5	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行费率优惠活动的公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 3 日
6	长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 29 日
7	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2024 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 29 日
8	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2025 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 22 日
9	长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 1 季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20250227~20250630	-	43,585,927.77	-	43,585,927.77	39.83
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)相关批准文件；

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

## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

## 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日