

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF） 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 24 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12 投资组合报告附注.....	62
§8 基金份额持有人信息.....	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	65
§9 开放式基金份额变动.....	66
§10 重大事件揭示.....	67
10.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
10.4 基金投资策略的改变.....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8 其他重大事件.....	70
§11 备查文件目录.....	72

11.1 备查文件目录.....	72
11.2 存放地点.....	72
11.3 查阅方式.....	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）
基金简称	长盛同庆中证 800 指数（LOF）
场内简称	长盛同庆
基金主代码	160806
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	113,859,425.76 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 8 月 6 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪误差控制在 4%以内，以实现了对中证 800 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%的投资目标。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 800 指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金将在基金合同生效 3 个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。
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	叶金松	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、 010-62350088	010-67595096
传真		010-82255988	010-66275853
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100088	100033
法定代表人		周兵	王洪章

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》《上海证券报》《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,004,095.40
本期利润	10,151,949.42
加权平均基金份额本期利润	0.0808
本期加权平均净值利润率	6.35%
本期基金份额净值增长率	6.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	29,296,580.16
期末可供分配基金份额利润	0.2573
期末基金资产净值	150,909,473.59
期末基金份额净值	1.325
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-26.14%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.33%	0.60%	4.84%	0.60%	0.49%	0.00%
过去三个月	3.35%	0.61%	2.95%	0.62%	0.40%	-0.01%
过去六个月	6.68%	0.56%	6.64%	0.57%	0.04%	-0.01%
过去一年	11.16%	0.65%	10.89%	0.66%	0.27%	-0.01%
自基金转型 起至今	-26.14%	1.95%	-26.24%	1.80%	0.10%	0.15%

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% × 中证 800 指数收益率 + 5% × 一年期银行定期存款利率（税后）。

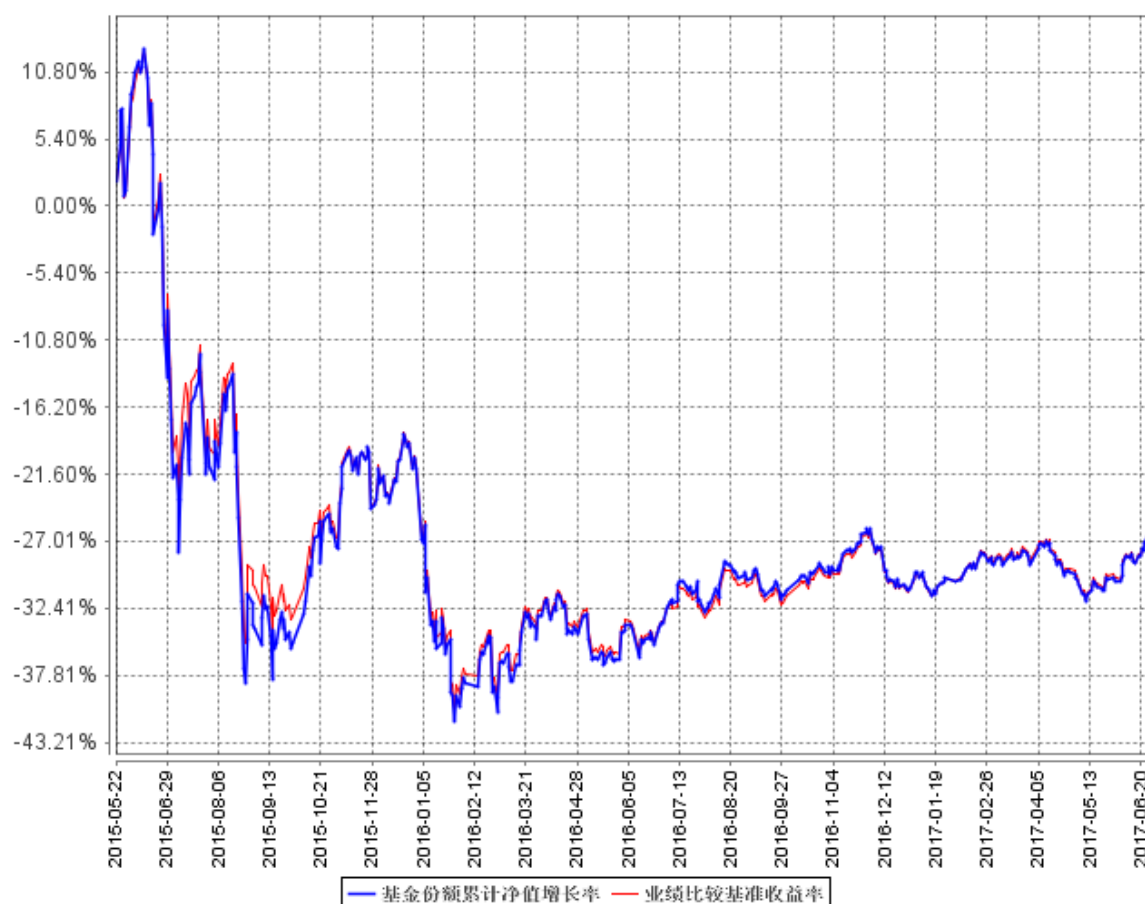
基准指数：中证 800 指数。

本基金的业绩比较基准中证 800 指数由中证指数有限公司构建和发布。具体的编制规则和再平衡过程请参见中证 800 指数指数编制细则。

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，业绩比较基准中证 800 指数、一年期银行定期存款每日按照 95%、5% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

2、按照本基金合同规定，本基金将在基金合同生效 3 个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四条（三）投资范围、（九）

投资限制的有关约定。截止本报告期末本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2017 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十二只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王超	本基金基金经理，长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资基金基金经理，长盛盛鑫灵活配置混合型	2015 年 5 月 22 日	-	10 年	王超先生，1981 年 9 月出生。中央财经大学硕士，CFA（特许金融分析师），FRM（金融风险管理师）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员等职务。

	证券投资基金基金经理，长盛盛平灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛医疗行业量化配置股票型证券投资基金基金经理。				
--	---	--	--	--	--

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

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）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、特定客户资产管理组合等。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，未发生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

在报告期内，我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略，尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响，将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.325 元，本报告期份额净值增长率为 6.68%，同期业绩比较基准收益率为 6.64%。报告期内，本基金日均跟踪偏离度绝对值为 0.04%，控制在 0.35% 之内；年化跟踪误差为 0.78%，控制在 4% 之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2017 年上半年的市场行情，虽然我们成功预测一季度会有“春季攻势”，应当灵活参与市场机会，并且认为一季度末有可能成为阶段高点，因为基本面因素将高位回落，应当保持谨慎。但是二季度开始的调整，白马股和“中小创”之间的分化还是大大超出我们的预料。监管机构之间的“监管收紧竞赛”是导致这一分化的催化剂，一方面，基金持仓集中的白马股成为抱团取暖的对象，股价屡创新高；另一方面，相对估值较高的“中小创”呈现出低位暴跌的态势，而不是大家之前普遍预期的重新回归成长的节奏。

展望未来的行情，外部因素对国内市场的影响似乎偏弱，二季度的联储加息和欧洲大选都没有对市场产生显著影响，未来外部的重要事件趋于平静，将不会对国内市场造成明显冲击。国内

的经济基本面将会继续维持回落态势，稳增长的压力逐步加大，金融监管趋严的竞赛是否会继续，流动性紧平衡的局面是否会维持，这些都将会影响整个市场的情绪。中长期趋势方面，监管机构打击投机炒作、鼓励价值投资的态度十分坚决，对白马股的长期价值投资有可能成为市场主流资金的操作模式。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任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《证券投资基金运作管理办法》的规定以及长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同第十八条中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。

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 截至 2017 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 29,296,580.16 元，其中，未分配利润已实现部分为 97,022,033.74 元，未分配利润未实现部分

为-67,725,453.58 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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: 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	11,915,786.49	9,529,578.74
结算备付金		-	-
存出保证金		3,515.18	11,155.53
交易性金融资产	6.4.7.2	137,235,123.62	154,667,631.27
其中: 股票投资		137,230,838.02	154,667,631.27
基金投资		-	-
债券投资		4,285.60	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,338,293.95	-
应收利息	6.4.7.5	2,368.92	2,252.35
应收股利		-	-
应收申购款		99.88	99.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		152,495,188.04	164,210,717.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		108,404.09	7,263.05
应付管理人报酬		124,479.49	143,607.56
应付托管费		27,385.48	31,593.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	19,419.11	16,463.29
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,306,026.28	1,347,564.15
负债合计		1,585,714.45	1,546,491.70
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	121,612,893.43	139,854,839.29
未分配利润	6.4.7.10	29,296,580.16	22,809,386.78
所有者权益合计		150,909,473.59	162,664,226.07
负债和所有者权益总计		152,495,188.04	164,210,717.77

注: 报告截止日 2017 年 6 月 30 日, 基金份额净值: 1.325 元, 基金份额总额 113,859,425.76 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: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		11,370,589.26	-39,330,975.60
1.利息收入		48,536.28	65,176.44
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	48,520.76	65,078.27
债券利息收入		15.52	98.17
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)		2,149,907.25	-633,048.10
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	1,051,786.80	-2,064,221.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,690.48	23,532.93
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,093,429.97	1,407,640.68
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.16	9,147,854.02	-38,804,568.67
4.汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	24,291.71	41,464.73
减: 二、费用		1,218,639.84	1,535,436.04

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	793,089.63	1,009,710.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	174,479.65	222,136.30
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	55,949.80	112,326.72
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	195,120.76	191,262.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,151,949.42	-40,866,411.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,151,949.42	-40,866,411.64

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	139,854,839.29	22,809,386.78	162,664,226.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,151,949.42	10,151,949.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-18,241,945.86	-3,664,756.04	-21,906,701.90
其中：1.基金申购款	164,335.19	31,851.59	196,186.78
2.基金赎回款	-18,406,281.05	-3,696,607.63	-22,102,888.68
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	121,612,893.43	29,296,580.16	150,909,473.59
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	192,259,011.42	62,657,640.32	254,916,651.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-40,866,411.64	-40,866,411.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-30,379,410.79	-3,060,763.93	-33,440,174.72
其中：1.基金申购款	803,304.89	63,541.87	866,846.76
2.基金赎回款	-31,182,715.68	-3,124,305.80	-34,307,021.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	161,879,600.63	18,730,464.75	180,610,065.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

林培富	刁俊东	龚珉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投

资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，

金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	11,915,786.49
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	11,915,786.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	124,087,835.70	137,230,838.02	13,143,002.32
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	4,000.00	4,285.60
	银行间市场	—	—
	合计	4,000.00	4,285.60
资产支持证券	—	—	—

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	124,091,835.70	137,235,123.62	13,143,287.92

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,364.88
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	2.60
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.44
合计	2,368.92

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	19,419.11
银行间市场应付交易费用	-
合计	19,419.11

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	176.99
其他	612,450.79
预提费用	193,398.50
合计	1,306,026.28

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	130,942,005.42	139,854,839.29
本期申购	153,907.98	164,335.19
本期赎回(以“-”号填列)	-17,236,487.64	-18,406,281.05
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	113,859,425.76	121,612,893.43

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	110,457,232.67	-87,647,845.89	22,809,386.78
本期利润	1,004,095.40	9,147,854.02	10,151,949.42
本期基金份额交易产生的变动数	-14,439,294.33	10,774,538.29	-3,664,756.04
其中：基金申购款	129,539.01	-97,687.42	31,851.59
基金赎回款	-14,568,833.34	10,872,225.71	-3,696,607.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	97,022,033.74	-67,725,453.58	29,296,580.16

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	48,408.92
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	67.71
其他	44.13
合计	48,520.76

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	28,104,723.39
减：卖出股票成本总额	27,052,936.59
买卖股票差价收入	1,051,786.80

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	4,690.48
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	4,690.48

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	138,703.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	134,000.00
减：应收利息总额	12.92
买卖债券差价收入	4,690.48

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期末未取得衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,093,429.97
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,093,429.97

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	9,147,854.02
——股票投资	9,147,568.42
——债券投资	285.60
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	9,147,854.02

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	24,291.71
转换费收入	-
合计	24,291.71

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率固定为 0.50%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	55,949.80
银行间市场交易费用	-
合计	55,949.80

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	133,892.94
深交所上市年费	29,752.78
银行划款费用	1,722.26
合计	195,120.76

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**

本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需作披露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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------	--

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	793,089.63	1,009,710.35
其中:支付销售机构的客户维护费	55,482.71	58,143.88

注:支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	174,479.65	222,136.30

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金管理人于本报告期及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

6.4.10.5 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	11,915,786.49	48,408.92	18,828,270.10	64,571.18

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2017 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**

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单 价	复牌日期	复牌 开盘单 价	数量 (股)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	重大事 项停牌	6.85	2017 年 8 月 21 日	8.22	95,572	469,309.74	654,668.20	-
601989	中国重工	2017 年 5 月 31 日	重大事 项停牌	6.46	-	-	94,526	1,056,900.56	610,637.96	-
601088	中国神华	2017 年 6 月 5 日	重大事 项停牌	22.29	-	-	21,296	363,658.51	474,687.84	-
600795	国电电力	2017 年 6 月 5 日	重大事 项停牌	3.60	-	-	124,953	524,446.66	449,830.80	-
000100	TCL 集团	2017 年 4 月 21 日	重大事 项停牌	3.48	2017 年 7 月 26 日	3.72	90,115	236,456.33	313,600.20	-
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大事 项停牌	28.62	-	-	10,700	791,230.19	306,234.00	-
600100	同方股份	2017 年 4 月 21 日	重大事 项停牌	14.38	-	-	19,125	222,208.02	275,017.50	-
601727	上海电气	2017 年 6 月 22	重大事 项停牌	7.57	2017 年 7 月 3	7.54	35,468	298,376.30	268,492.76	-

		日			日						
002252	上海莱士	2017 年 4 月 21 日	重大事 项停牌	20.34	-	-	10,891	99,069.19	221,522.94	-	
601919	中远海控	2017 年 5 月 17 日	重大事 项停牌	5.41	2017 年 7 月 26 日	5.89	40,600	518,085.39	219,646.00	-	
000656	金科股份	2017 年 5 月 5 日	重大事 项停牌	6.54	2017 年 7 月 5 日	5.92	32,771	165,115.63	214,322.34	-	
600485	信威集团	2016 年 12 月 26 日	重大事 项停牌	14.59	-	-	13,921	296,006.55	203,107.39	-	
000503	海虹控股	2017 年 5 月 11 日	重大事 项停牌	24.93	-	-	8,076	251,772.77	201,334.68	-	
600643	爱建集团	2017 年 4 月 17 日	重大事 项停牌	14.98	2017 年 8 月 2 日	16.48	11,661	120,453.78	174,681.78	-	
300088	长信科技	2016 年 9 月 12 日	重大事 项停牌	15.75	2017 年 8 月 9 日	14.50	10,510	79,984.90	165,532.50	-	
600654	*ST 中安	2017 年 6 月 7 日	重大事 项停牌	13.48	-	-	11,549	122,302.62	155,680.52	-	
000887	中鼎股份	2017 年 4 月 27 日	重大事 项停牌	22.09	2017 年 7 月 14 日	19.88	6,977	123,878.95	154,121.93	-	
002129	中环股份	2016 年 4 月 25 日	重大事 项停牌	10.22	-	-	14,776	139,606.23	151,010.72	-	
600673	东阳光科	2016 年 11 月 15 日	重大事 项停牌	7.29	-	-	20,653	132,464.84	150,560.37	-	
002168	深圳惠程	2017 年 1 月 23 日	重大事 项停牌	16.99	-	-	8,600	151,406.47	146,114.00	-	
002049	紫光国芯	2017 年 2 月 20 日	重大事 项停牌	31.51	2017 年 7 月 17 日	27.74	4,500	255,406.66	141,795.00	-	
600655	豫园商城	2016 年 12 月 20 日	重大事 项停牌	11.32	-	-	12,210	140,628.69	138,217.20	-	

002426	胜利精密	2017 年 1 月 16 日	重大事 项停牌	7.68	-	-	16,400	158,588.00	125,952.00	-
601872	招商轮船	2017 年 5 月 2 日	重大事 项停牌	5.19	-	-	22,700	160,903.24	117,813.00	-
002013	中航机电	2017 年 5 月 12 日	重大事 项停牌	10.33	2017 年 8 月 2 日	11.36	10,813	97,205.33	111,698.29	-
600277	亿利洁能	2017 年 3 月 6 日	重大事 项停牌	7.83	-	-	11,900	70,924.00	93,177.00	-
002399	海普瑞	2017 年 4 月 28 日	重大事 项停牌	20.23	-	-	4,201	67,749.67	84,986.23	-
600545	新疆城建	2017 年 6 月 22 日	重大事 项停牌	11.96	2017 年 7 月 3 日	12.44	7,100	92,436.06	84,916.00	-
600959	江苏有线	2017 年 6 月 19 日	重大事 项停牌	10.57	-	-	7,960	126,317.28	84,137.20	-
601717	郑煤机	2017 年 4 月 24 日	重大事 项停牌	7.79	-	-	10,446	90,129.92	81,374.34	-
600666	奥瑞德	2017 年 4 月 27 日	重大事 项停牌	17.93	-	-	4,480	96,152.00	80,326.40	-
300291	华录百纳	2017 年 4 月 19 日	重大事 项停牌	20.02	-	-	4,000	178,794.71	80,080.00	-
002025	航天电器	2016 年 9 月 12 日	重大事 项停牌	23.65	2017 年 7 月 4 日	22.46	3,343	59,433.32	79,061.95	-
002642	荣之联	2017 年 4 月 10 日	重大事 项停牌	25.06	2017 年 7 月 7 日	22.54	3,150	154,087.59	78,939.00	-
000061	农产品	2017 年 6 月 28 日	重大事 项停牌	9.06	-	-	8,380	86,945.27	75,922.80	-
300134	大富科技	2017 年 2 月 9 日	重大事 项停牌	23.36	-	-	3,216	86,856.76	75,125.76	-
601608	中信重工	2017 年	重大事	5.28	2017 年	5.26	14,011	68,309.49	73,978.08	-

		4 月 19 日	项停牌		7 月 26 日					
002122	天马股份	2017 年 4 月 24 日	重大事 项停牌	10.30	2017 年 7 月 24 日	11.15	6,724	54,460.82	69,257.20	-
002505	大康农业	2017 年 3 月 13 日	重大事 项停牌	3.50	-	-	18,916	70,144.14	66,206.00	-
002128	露天煤业	2017 年 3 月 17 日	重大事 项停牌	8.70	2017 年 8 月 14 日	9.57	7,506	67,679.98	65,302.20	-
002358	森源电气	2017 年 5 月 12 日	重大事 项停牌	17.02	2017 年 7 月 12 日	16.68	3,576	70,671.86	60,863.52	-
300085	银之杰	2017 年 6 月 30 日	重大事 项停牌	18.50	2017 年 7 月 7 日	18.88	3,221	164,868.46	59,588.50	-
600289	亿阳信通	2017 年 5 月 10 日	重大事 项停牌	10.94	2017 年 8 月 18 日	12.03	5,086	65,468.69	55,640.84	-
000099	中信海直	2017 年 5 月 4 日	重大事 项停牌	11.26	-	-	4,864	74,494.10	54,768.64	-
002681	奋达科技	2017 年 6 月 22 日	重大事 项停牌	12.59	2017 年 7 月 3 日	12.70	4,160	86,978.66	52,374.40	-
600657	信达地产	2017 年 2 月 20 日	重大事 项停牌	5.76	2017 年 8 月 10 日	6.19	8,767	63,183.62	50,497.92	-
600460	士兰微	2017 年 5 月 12 日	重大事 项停牌	6.07	2017 年 8 月 15 日	6.68	8,261	58,743.55	50,144.27	-
000693	*ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重大事 项停牌	13.88	-	-	3,507	75,126.69	48,677.16	-
601001	大同煤业	2017 年 6 月 22 日	重大事 项停牌	5.25	2017 年 7 月 21 日	5.78	8,557	78,113.56	44,924.25	-
600468	百利电气	2017 年 5 月 16 日	重大事 项停牌	6.50	-	-	3,681	40,772.35	23,926.50	-
600636	*ST 爱富	2016 年 5 月 9 日	重大事 项停牌	14.34	2017 年 8 月 4 日	14.55	1	15.53	14.34	-

		日			日					
--	--	---	--	--	---	--	--	--	--	--

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.0028% (2016 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.00%)

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	4,285.60	-
未评级	-	-
合计	4,285.60	-

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市,因此除附注 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,其余均能以合理的价格适时变现。

于 2017 年 6 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2017 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	11,915,786.49	-	-	-	11,915,786.49
存出保证金	3,515.18	-	-	-	3,515.18
交易性金融资产	4,285.60	-	-	137,230,838.02	137,235,123.62
应收证券清算款	-	-	-	3,338,293.95	3,338,293.95
应收利息	-	-	-	2,368.92	2,368.92
应收申购款	-	-	-	99.88	99.88
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,923,587.27	-	-	140,571,600.77	152,495,188.04

负债					
应付赎回款	-	-	-	108,404.09	108,404.09
应付管理人报酬	-	-	-	124,479.49	124,479.49
应付托管费	-	-	-	27,385.48	27,385.48
应付交易费用	-	-	-	19,419.11	19,419.11
其他负债	-	-	-	1,306,026.28	1,306,026.28
负债总计	-	-	-	1,585,714.45	1,585,714.45
利率敏感度缺口	11,923,587.27	-	-	138,985,886.32	150,909,473.59
上年度末 2016 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	9,529,578.74	-	-	-	9,529,578.74
存出保证金	11,155.53	-	-	-	11,155.53
交易性金融资产	-	-	-	154,667,631.27	154,667,631.27
应收利息	-	-	-	2,252.35	2,252.35
应收申购款	-	-	-	99.88	99.88
资产总计	9,540,734.27	-	-	154,669,983.50	164,210,717.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,263.05	7,263.05
应付管理人报酬	-	-	-	143,607.56	143,607.56
应付托管费	-	-	-	31,593.65	31,593.65
应付交易费用	-	-	-	16,463.29	16,463.29
其他负债	-	-	-	1,347,564.15	1,347,564.15
负债总计	-	-	-	1,546,491.70	1,546,491.70
利率敏感度缺口	9,540,734.27	-	-	153,123,491.80	162,664,226.07

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

注：本基金于本报告期末持有交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.0028%（2016 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.00%），因此市场利率的变动对于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。

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

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

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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	137,230,838.02	90.94	154,667,631.27	95.08
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	137,230,838.02	90.94	154,667,631.27	95.08

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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	7,331,182.23	8,542,221.06

	业绩比较基准下降 5%	-7,331,182.23	-8,542,221.06
--	-------------	---------------	---------------

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 129,414,633.20 元，属于第二层次的余额为 7,820,490.42 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 148,246,795.26 元，第二层次 6,420,836.01 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	137,230,838.02	89.99
	其中：股票	137,230,838.02	89.99
2	固定收益投资	4,285.60	0.00
	其中：债券	4,285.60	0.00
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	11,915,786.49	7.81
7	其他各项资产	3,344,277.93	2.19
8	合计	152,495,188.04	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	723,440.61	0.48
B	采矿业	4,766,707.91	3.16
C	制造业	57,935,047.16	38.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,928,122.99	2.60
E	建筑业	5,525,310.61	3.66
F	批发和零售业	4,400,809.52	2.92
G	交通运输、仓储和邮政业	3,826,333.20	2.54
H	住宿和餐饮业	57,939.80	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,757,910.20	4.48
J	金融业	34,683,714.78	22.98
K	房地产业	8,546,781.19	5.66
L	租赁和商务服务业	1,462,584.21	0.97
M	科学研究和技术服务业	116,353.64	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	1,315,810.53	0.87
O	居民服务、修理和其他服务业	—	0.00
P	教育	—	0.00

Q	卫生和社会工作	109,480.80	0.07
R	文化、体育和娱乐业	1,597,120.24	1.06
S	综合	493,862.38	0.33
	合计	136,247,329.77	90.28

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	48,677.16	0.03
C	制造业	719,562.07	0.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	215,269.02	0.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	983,508.25	0.65

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	105,287	5,223,288.07	3.46
2	000002	万科A	110,354	2,755,539.38	1.83

3	600519	贵州茅台	5,291	2,496,558.35	1.65
4	000651	格力电器	60,423	2,487,614.91	1.65
5	600036	招商银行	100,416	2,400,946.56	1.59
6	601166	兴业银行	130,471	2,199,741.06	1.46
7	000333	美的集团	43,668	1,879,470.72	1.25
8	600016	民生银行	224,396	1,844,535.12	1.22
9	601398	工商银行	323,312	1,697,388.00	1.12
10	601328	交通银行	267,470	1,647,615.20	1.09
11	601668	中国建筑	143,885	1,392,806.80	0.92
12	600000	浦发银行	109,125	1,380,431.25	0.91
13	600030	中信证券	77,534	1,319,628.68	0.87
14	601288	农业银行	373,367	1,314,251.84	0.87
15	600887	伊利股份	59,134	1,276,703.06	0.85
16	600837	海通证券	79,249	1,176,847.65	0.78
17	601211	国泰君安	56,900	1,167,019.00	0.77
18	601169	北京银行	126,162	1,156,905.54	0.77
19	000858	五 粮 液	18,898	1,051,862.68	0.70
20	601601	中国太保	30,840	1,044,550.80	0.69
21	600104	上汽集团	32,566	1,011,174.30	0.67
22	600900	长江电力	64,820	996,931.60	0.66
23	000725	京东方 A	232,607	967,645.12	0.64
24	601766	中国中车	87,787	888,404.44	0.59
25	002415	海康威视	27,391	884,729.30	0.59
26	600276	恒瑞医药	17,190	869,642.10	0.58
27	601988	中国银行	205,438	760,120.60	0.50
28	600048	保利地产	70,124	699,136.28	0.46
29	600518	康美药业	30,444	661,852.56	0.44
30	600050	中国联通	95,572	654,668.20	0.43
31	000001	平安银行	67,079	629,871.81	0.42
32	601390	中国中铁	72,599	629,433.33	0.42
33	601818	光大银行	155,196	628,543.80	0.42
34	601989	中国重工	94,526	610,637.96	0.40
35	600028	中国石化	102,196	606,022.28	0.40
36	601688	华泰证券	32,691	585,168.90	0.39
37	002450	康得新	25,902	583,313.04	0.39
38	000538	云南白药	6,211	582,902.35	0.39
39	600015	华夏银行	62,863	579,596.86	0.38
40	000063	中兴通讯	23,662	561,735.88	0.37
41	002304	洋河股份	6,395	555,149.95	0.37

42	000776	广发证券	29,477	508,478.25	0.34
43	001979	招商蛇口	23,736	507,000.96	0.34
44	600019	宝钢股份	73,659	494,251.89	0.33
45	600999	招商证券	28,669	493,680.18	0.33
46	601006	大秦铁路	58,028	486,854.92	0.32
47	601088	中国神华	21,296	474,687.84	0.31
48	600690	青岛海尔	30,072	452,583.60	0.30
49	600795	国电电力	124,953	449,830.80	0.30
50	600585	海螺水泥	19,715	448,121.95	0.30
51	601628	中国人寿	16,347	441,042.06	0.29
52	601336	新华保险	8,234	423,227.60	0.28
53	002024	苏宁云商	36,782	413,797.50	0.27
54	601901	方正证券	41,204	409,155.72	0.27
55	300296	利亚德	21,700	407,960.00	0.27
56	600703	三安光电	20,558	404,992.60	0.27
57	000423	东阿阿胶	5,617	403,806.13	0.27
58	601009	南京银行	35,429	397,159.09	0.26
59	600309	万华化学	13,478	386,009.92	0.26
60	601186	中国铁建	31,951	384,370.53	0.25
61	600009	上海机场	9,904	369,518.24	0.24
62	601857	中国石油	47,831	367,820.39	0.24
63	600660	福耀玻璃	14,098	367,111.92	0.24
64	002230	科大讯飞	9,200	367,080.00	0.24
65	002142	宁波银行	19,018	367,047.40	0.24
66	000568	泸州老窖	7,254	366,907.32	0.24
67	600958	东方证券	26,300	365,833.00	0.24
68	601611	中国核建	30,200	361,494.00	0.24
69	002241	歌尔股份	18,654	359,649.12	0.24
70	600196	复星医药	11,474	355,579.26	0.24
71	601985	中国核电	45,488	355,261.28	0.24
72	000166	申万宏源	62,151	348,045.60	0.23
73	601377	兴业证券	46,502	345,509.86	0.23
74	002456	欧菲光	18,755	340,778.35	0.23
75	300072	三聚环保	9,176	339,970.80	0.23
76	601607	上海医药	11,637	336,076.56	0.22
77	002236	大华股份	14,565	332,227.65	0.22
78	000069	华侨城 A	32,441	326,356.46	0.22
79	002466	天齐锂业	6,000	326,100.00	0.22
80	002736	国信证券	24,500	324,625.00	0.22

81	002594	比亚迪	6,484	323,875.80	0.21
82	000625	长安汽车	22,406	323,094.52	0.21
83	601899	紫金矿业	93,427	320,454.61	0.21
84	600340	华夏幸福	9,522	319,748.76	0.21
85	000338	潍柴动力	24,153	318,819.60	0.21
86	000783	长江证券	33,294	315,294.18	0.21
87	601669	中国电建	39,688	314,328.96	0.21
88	300266	兴源环境	10,212	313,712.64	0.21
89	000100	TCL 集团	90,115	313,600.20	0.21
90	300059	东方财富	25,806	310,188.12	0.21
91	600741	华域汽车	12,733	308,647.92	0.20
92	600637	东方明珠	14,190	307,497.30	0.20
93	300104	乐视网	10,700	306,234.00	0.20
94	600089	特变电工	29,588	305,644.04	0.20
95	601888	中国国旅	10,044	302,726.16	0.20
96	600031	三一重工	36,929	300,232.77	0.20
97	600068	葛洲坝	26,654	299,590.96	0.20
98	600029	南方航空	34,382	299,123.40	0.20
99	002008	大族激光	8,621	298,631.44	0.20
100	300070	碧水源	15,907	296,665.55	0.20
101	600066	宇通客车	13,334	292,947.98	0.19
102	600010	宝钢股份	131,916	288,896.04	0.19
103	002475	立讯精密	9,795	286,405.80	0.19
104	600406	国电南瑞	16,191	285,771.15	0.19
105	601933	永辉超市	40,325	285,501.00	0.19
106	000839	中信国安	27,715	276,872.85	0.18
107	600100	同方股份	19,125	275,017.50	0.18
108	600535	天士力	6,587	273,623.98	0.18
109	601099	太平洋	67,254	270,361.08	0.18
110	601727	上海电气	35,468	268,492.76	0.18
111	000963	华东医药	5,344	265,596.80	0.18
112	600886	国投电力	33,078	261,316.20	0.17
113	002739	万达电影	5,100	259,947.00	0.17
114	600338	西藏珠峰	6,800	258,332.00	0.17
115	600383	金地集团	22,162	254,198.14	0.17
116	002673	西部证券	17,839	253,670.58	0.17
117	600816	安信信托	18,647	253,412.73	0.17
118	000938	紫光股份	4,100	250,592.00	0.17
119	600487	亨通光电	8,900	249,645.00	0.17

120	300124	汇川技术	9,735	248,631.90	0.16
121	601111	中国国航	25,324	246,909.00	0.16
122	002202	金风科技	15,824	244,797.28	0.16
123	600705	中航资本	43,260	244,419.00	0.16
124	000895	双汇发展	10,237	243,128.75	0.16
125	601600	中国铝业	53,672	242,597.44	0.16
126	600570	恒生电子	5,176	241,615.68	0.16
127	600111	北方稀土	21,283	241,136.39	0.16
128	600739	辽宁成大	13,212	238,212.36	0.16
129	002572	索菲亚	5,802	237,882.00	0.16
130	601555	东吴证券	21,060	236,503.80	0.16
131	601800	中国交建	14,867	236,236.63	0.16
132	600271	航天信息	11,376	234,800.64	0.16
133	601618	中国中冶	46,806	234,498.06	0.16
134	600115	东方航空	33,437	227,371.60	0.15
135	000623	吉林敖东	9,755	223,291.95	0.15
136	600201	生物股份	6,252	222,383.64	0.15
137	600893	航发动力	8,126	221,839.80	0.15
138	002252	上海莱士	10,891	221,522.94	0.15
139	601919	中远海控	40,600	219,646.00	0.15
140	300024	机器人	11,196	218,322.00	0.14
141	600023	浙能电力	39,961	218,187.06	0.14
142	000661	长春高新	1,684	217,421.24	0.14
143	600547	山东黄金	7,460	215,817.80	0.14
144	600352	浙江龙盛	22,562	215,015.86	0.14
145	600177	雅戈尔	21,217	214,716.04	0.14
146	000656	金科股份	32,771	214,322.34	0.14
147	601018	宁波港	37,851	213,858.15	0.14
148	600109	国金证券	18,192	213,210.24	0.14
149	600674	川投能源	21,618	212,288.76	0.14
150	002310	东方园林	12,650	211,508.00	0.14
151	002508	老板电器	4,839	210,399.72	0.14
152	600436	片仔癀	3,445	210,282.80	0.14
153	000768	中航飞机	11,291	208,206.04	0.14
154	600085	同仁堂	5,934	207,452.64	0.14
155	000793	华闻传媒	20,495	207,409.40	0.14
156	600153	建发股份	15,864	205,121.52	0.14
157	600804	鹏博士	11,512	204,338.00	0.14
158	000806	银河生物	15,100	203,850.00	0.14

159	600485	信威集团	13,921	203,107.39	0.13
160	600018	上港集团	31,861	201,998.74	0.13
161	600208	新湖中宝	44,787	201,541.50	0.13
162	000503	海虹控股	8,076	201,334.68	0.13
163	002065	东华软件	9,086	197,983.94	0.13
164	600682	南京新百	5,300	195,570.00	0.13
165	000413	东旭光电	17,389	195,104.58	0.13
166	600522	中天科技	16,098	193,980.90	0.13
167	002465	海格通信	18,034	193,685.16	0.13
168	000540	中天金融	27,827	193,397.65	0.13
169	000157	中联重科	43,035	193,227.15	0.13
170	600415	小商品城	26,673	193,112.52	0.13
171	603993	洛阳钼业	38,156	193,069.36	0.13
172	002271	东方雨虹	5,186	192,400.60	0.13
173	600663	陆家嘴	7,945	187,819.80	0.12
174	601998	中信银行	29,784	187,341.36	0.12
175	600606	绿地控股	23,800	186,116.00	0.12
176	600221	海航控股	57,508	185,175.76	0.12
177	000630	铜陵有色	65,123	184,949.32	0.12
178	000826	启迪桑德	5,257	184,625.84	0.12
179	000709	河钢股份	44,047	184,556.93	0.12
180	601012	隆基股份	10,681	182,645.10	0.12
181	300017	网宿科技	15,059	181,762.13	0.12
182	300315	掌趣科技	22,200	181,152.00	0.12
183	002007	华兰生物	4,918	179,507.00	0.12
184	600079	人福医药	9,130	179,130.60	0.12
185	601168	西部矿业	23,163	178,123.47	0.12
186	600061	国投安信	11,400	177,270.00	0.12
187	600584	长电科技	10,955	175,827.75	0.12
188	000066	中国长城	19,485	175,559.85	0.12
189	002405	四维图新	8,864	175,152.64	0.12
190	600643	爱建集团	11,661	174,681.78	0.12
191	002081	金螳螂	15,842	173,945.16	0.12
192	601788	光大证券	11,600	173,188.00	0.11
193	600118	中国卫星	6,196	172,496.64	0.11
194	601198	东兴证券	10,000	172,400.00	0.11
195	000009	中国宝安	21,299	172,308.91	0.11
196	000402	金融街	14,696	172,237.12	0.11
197	600489	中金黄金	17,113	171,643.39	0.11

198	000876	新 希 望	20,812	171,074.64	0.11
199	000060	中金岭南	15,203	170,273.60	0.11
200	601155	新城控股	9,100	168,714.00	0.11
201	300027	华谊兄弟	20,595	166,613.55	0.11
202	600008	首创股份	25,296	166,447.68	0.11
203	000960	锡业股份	12,200	166,042.00	0.11
204	300088	长信科技	10,510	165,532.50	0.11
205	600219	南山铝业	48,748	165,255.72	0.11
206	600332	白云山	5,600	162,624.00	0.11
207	601633	长城汽车	12,025	159,812.25	0.11
208	600150	中国船舶	6,965	159,289.55	0.11
209	600718	东软集团	10,159	157,972.45	0.10
210	600369	西南证券	28,092	157,596.12	0.10
211	600549	厦门钨业	7,300	156,877.00	0.10
212	000425	徐工机械	41,654	156,202.50	0.10
213	000997	新 大 陆	6,828	154,927.32	0.10
214	000559	万向钱潮	14,456	153,522.72	0.10
215	600820	隧道股份	15,200	153,520.00	0.10
216	600161	天坛生物	3,952	153,377.12	0.10
217	600525	长园集团	11,259	153,009.81	0.10
218	002340	格林美	25,000	151,250.00	0.10
219	600673	东阳光科	20,653	150,560.37	0.10
220	601333	广深铁路	33,196	150,045.92	0.10
221	002797	第一创业	15,920	146,623.20	0.10
222	000998	隆平高科	6,625	145,882.50	0.10
223	600516	方大炭素	10,246	145,698.12	0.10
224	600649	城投控股	13,831	145,363.81	0.10
225	000778	新兴铸管	21,682	145,269.40	0.10
226	600879	航天电子	16,448	144,577.92	0.10
227	000686	东北证券	14,282	143,534.10	0.10
228	600688	上海石化	21,651	143,113.11	0.09
229	600388	龙净环保	9,200	142,876.00	0.09
230	600362	江西铜业	8,435	142,214.10	0.09
231	002049	紫光国芯	4,500	141,795.00	0.09
232	000983	西山煤电	16,150	141,635.50	0.09
233	000786	北新建材	8,924	141,356.16	0.09
234	000039	中集集团	7,809	140,796.27	0.09
235	300115	长盈精密	4,793	139,859.74	0.09
236	601225	陕西煤业	19,656	138,967.92	0.09

237	600158	中体产业	8,117	138,800.70	0.09
238	600655	豫园商城	12,210	138,217.20	0.09
239	000028	国药一致	1,703	137,772.70	0.09
240	000999	华润三九	4,324	137,287.00	0.09
241	002092	中泰化学	10,775	136,842.50	0.09
242	600498	烽火通信	5,345	135,495.75	0.09
243	000050	深天马 A	6,579	135,330.03	0.09
244	600583	海油工程	21,648	135,083.52	0.09
245	002179	中航光电	4,325	134,896.75	0.09
246	600895	张江高科	7,989	134,854.32	0.09
247	600373	中文传媒	5,727	134,641.77	0.09
248	600426	华鲁恒升	11,438	134,282.12	0.09
249	600266	北京城建	9,200	133,768.00	0.09
250	600521	华海药业	6,356	133,730.24	0.09
251	601718	际华集团	15,143	133,106.97	0.09
252	600588	用友网络	7,739	132,491.68	0.09
253	600839	四川长虹	36,395	131,749.90	0.09
254	300144	宋城演艺	6,311	131,710.57	0.09
255	600056	中国医药	5,062	131,358.90	0.09
256	002146	荣盛发展	13,274	131,014.38	0.09
257	600157	永泰能源	36,691	130,986.87	0.09
258	000581	威孚高科	5,044	130,639.60	0.09
259	002223	鱼跃医疗	5,491	130,026.88	0.09
260	600176	中国巨石	11,803	129,596.94	0.09
261	600376	首开股份	11,309	129,374.96	0.09
262	000917	电广传媒	11,438	129,249.40	0.09
263	002410	广联达	6,841	128,610.80	0.09
264	002050	三花智控	7,866	128,373.12	0.09
265	600827	百联股份	7,876	127,985.00	0.08
266	600138	中青旅	6,067	127,771.02	0.08
267	600256	广汇能源	30,860	127,760.40	0.08
268	002385	大北农	20,310	127,749.90	0.08
269	002573	清新环境	6,728	126,620.96	0.08
270	600260	凯乐科技	4,990	126,446.60	0.08
271	600511	国药股份	3,485	126,296.40	0.08
272	600170	上海建工	32,996	126,044.72	0.08
273	002426	胜利精密	16,400	125,952.00	0.08
274	600704	物产中大	17,215	125,497.35	0.08
275	002038	双鹭药业	4,296	125,228.40	0.08

276	601216	君正集团	25,508	124,734.12	0.08
277	000970	中科三环	8,410	124,299.80	0.08
278	000750	国海证券	22,475	123,612.50	0.08
279	600060	海信电器	8,085	122,649.45	0.08
280	002714	牧原股份	4,500	122,490.00	0.08
281	000415	渤海金控	18,199	122,479.27	0.08
282	600038	中直股份	2,675	122,434.75	0.08
283	002051	中工国际	5,894	122,182.62	0.08
284	600074	保千里	9,500	121,695.00	0.08
285	300113	顺网科技	4,500	121,050.00	0.08
286	600633	浙数文化	6,242	120,595.44	0.08
287	000792	盐湖股份	11,536	120,551.20	0.08
288	000513	丽珠集团	1,743	118,698.30	0.08
289	300168	万达信息	8,100	117,855.00	0.08
290	601872	招商轮船	22,700	117,813.00	0.08
291	300055	万邦达	6,400	117,760.00	0.08
292	002470	金正大	15,616	117,588.48	0.08
293	002217	合力泰	11,900	117,572.00	0.08
294	600978	宜华生活	11,697	117,554.85	0.08
295	600699	均胜电子	3,659	117,417.31	0.08
296	002030	达安基因	5,371	117,034.09	0.08
297	000488	晨鸣纸业	8,999	116,087.10	0.08
298	600298	安琪酵母	4,468	115,587.16	0.08
299	600759	洲际油气	18,979	115,012.74	0.08
300	000418	小天鹅 A	2,453	114,775.87	0.08
301	000400	许继电气	6,345	113,956.20	0.08
302	600021	上海电力	9,414	113,815.26	0.08
303	000566	海南海药	8,572	113,664.72	0.08
304	002001	新 和 成	5,853	113,606.73	0.08
305	002311	海大集团	6,180	112,908.60	0.07
306	600143	金发科技	18,721	112,887.63	0.07
307	601866	中远海发	31,153	112,150.80	0.07
308	000878	云南铜业	8,500	112,115.00	0.07
309	002500	山西证券	11,694	112,028.52	0.07
310	002013	中航机电	10,813	111,698.29	0.07
311	002004	华邦健康	14,247	111,554.01	0.07
312	600503	华丽家族	16,100	111,251.00	0.07
313	600600	青岛啤酒	3,150	110,565.00	0.07
314	002183	怡 亚 通	12,800	110,464.00	0.07

315	600160	巨化股份	9,138	109,930.14	0.07
316	300058	蓝色光标	14,051	109,878.82	0.07
317	300244	迪安诊断	3,480	109,480.80	0.07
318	000401	冀东水泥	7,099	109,253.61	0.07
319	600435	北方导航	7,624	109,099.44	0.07
320	002400	省广股份	13,564	108,918.92	0.07
321	600872	中炬高新	5,856	107,164.80	0.07
322	000930	中粮生化	9,938	107,131.64	0.07
323	600717	天津港	8,500	106,165.00	0.07
324	600500	中化国际	11,100	106,116.00	0.07
325	600809	山西汾酒	3,053	105,908.57	0.07
326	600635	大众公用	19,412	105,795.40	0.07
327	000977	浪潮信息	6,100	105,652.00	0.07
328	002635	安洁科技	2,897	104,929.34	0.07
329	002018	华信国际	15,300	104,805.00	0.07
330	000697	炼石有色	5,098	104,356.06	0.07
331	600755	厦门国贸	11,440	104,332.80	0.07
332	002439	启明星辰	5,600	104,160.00	0.07
333	600325	华发股份	12,436	103,840.60	0.07
334	002152	广电运通	12,450	103,459.50	0.07
335	600482	中国动力	4,090	103,436.10	0.07
336	002273	水晶光电	4,971	102,551.73	0.07
337	000547	航天发展	9,813	102,545.85	0.07
338	600808	马钢股份	28,800	101,952.00	0.07
339	600037	歌华有线	7,000	101,920.00	0.07
340	300146	汤臣倍健	7,386	101,483.64	0.07
341	600062	华润双鹤	3,697	101,408.71	0.07
342	600594	益佰制药	6,600	100,716.00	0.07
343	600122	宏图高科	9,057	100,532.70	0.07
344	300002	神州泰岳	11,935	99,537.90	0.07
345	000598	兴蓉环境	17,695	99,445.90	0.07
346	600737	中粮糖业	10,500	99,120.00	0.07
347	600874	创业环保	5,053	98,887.21	0.07
348	000979	中弘股份	37,565	98,420.30	0.07
349	600528	中铁工业	6,876	98,258.04	0.07
350	002048	宁波华翔	4,698	98,000.28	0.06
351	000825	太钢不锈	22,490	97,831.50	0.06
352	002074	国轩高科	3,100	97,805.00	0.06
353	000078	海王生物	16,185	97,595.55	0.06

354	002027	分众传媒	7,000	96,320.00	0.06
355	601699	潞安环能	12,307	96,240.74	0.06
356	002195	二三四五	13,450	96,167.50	0.06
357	000988	华工科技	6,591	96,162.69	0.06
358	600884	杉杉股份	5,828	95,987.16	0.06
359	000738	航发控制	4,900	95,893.00	0.06
360	603019	中科曙光	3,400	95,676.00	0.06
361	600312	平高电气	6,938	95,328.12	0.06
362	600967	内蒙一机	6,968	94,973.84	0.06
363	600446	金证股份	5,400	94,932.00	0.06
364	600409	三友化工	9,399	94,647.93	0.06
365	002078	太阳纸业	12,825	94,263.75	0.06
366	601021	春秋航空	2,800	94,164.00	0.06
367	000671	阳光城	16,132	93,888.24	0.06
368	600277	亿利洁能	11,900	93,177.00	0.06
369	600372	中航电子	5,350	92,929.50	0.06
370	600499	科达洁能	11,666	92,628.04	0.06
371	600183	生益科技	7,503	92,587.02	0.06
372	600240	华业资本	10,200	92,412.00	0.06
373	600811	东方集团	14,083	91,821.16	0.06
374	600687	刚泰控股	7,100	91,448.00	0.06
375	600881	亚泰集团	17,931	91,089.48	0.06
376	600026	中远海能	13,738	91,082.94	0.06
377	601880	大连港	30,731	90,963.76	0.06
378	002292	奥飞娱乐	5,378	90,888.20	0.06
379	600970	中材国际	10,443	90,749.67	0.06
380	002701	奥瑞金	14,144	90,380.16	0.06
381	601000	唐山港	17,256	90,076.32	0.06
382	600120	浙江东方	3,350	90,048.00	0.06
383	600166	福田汽车	31,656	89,903.04	0.06
384	600863	内蒙华电	29,851	89,851.51	0.06
385	002221	东华能源	8,214	89,614.74	0.06
386	002131	利欧股份	27,100	89,159.00	0.06
387	000012	南玻A	9,472	88,373.76	0.06
388	000049	德赛电池	1,703	88,232.43	0.06
389	002028	思源电气	5,517	87,940.98	0.06
390	002250	联化科技	6,146	87,887.80	0.06
391	600787	中储股份	11,086	87,690.26	0.06
392	002589	瑞康医药	5,682	87,502.80	0.06

393	002191	劲嘉股份	9,316	87,197.76	0.06
394	002640	跨境通	4,100	87,125.00	0.06
395	002602	世纪华通	2,400	87,024.00	0.06
396	000600	建投能源	7,086	86,945.22	0.06
397	002424	贵州百灵	4,600	86,756.00	0.06
398	600614	鹏起科技	7,852	86,372.00	0.06
399	600572	康恩贝	12,467	86,271.64	0.06
400	000006	深振业 A	9,770	86,073.70	0.06
401	600094	大名城	11,200	85,904.00	0.06
402	600664	哈药股份	14,783	85,889.23	0.06
403	002384	东山精密	3,476	85,857.20	0.06
404	600064	南京高科	5,671	85,632.10	0.06
405	000816	智慧农业	11,421	84,972.24	0.06
406	300274	阳光电源	7,660	84,949.40	0.06
407	600545	新疆城建	7,100	84,916.00	0.06
408	002665	首航节能	11,758	84,657.60	0.06
409	600151	航天机电	10,281	84,612.63	0.06
410	000860	顺鑫农业	4,224	84,522.24	0.06
411	002366	台海核电	1,800	84,438.00	0.06
412	600478	科力远	9,778	84,188.58	0.06
413	600959	江苏有线	7,960	84,137.20	0.06
414	002281	光迅科技	3,782	84,036.04	0.06
415	600410	华胜天成	9,296	82,362.56	0.05
416	002266	浙富控股	16,865	82,301.20	0.05
417	002603	以岭药业	4,700	82,062.00	0.05
418	600017	日照港	18,223	82,003.50	0.05
419	000685	中山公用	7,485	81,960.75	0.05
420	000596	古井贡酒	1,608	81,927.60	0.05
421	000758	中色股份	11,676	81,848.76	0.05
422	000690	宝新能源	13,661	81,692.78	0.05
423	002153	石基信息	3,587	81,532.51	0.05
424	603766	隆鑫通用	11,188	81,448.64	0.05
425	600380	健康元	8,967	81,420.36	0.05
426	601717	郑煤机	10,446	81,374.34	0.05
427	000031	中粮地产	10,793	81,271.29	0.05
428	000727	华东科技	28,700	81,221.00	0.05
429	600348	阳泉煤业	11,967	81,136.26	0.05
430	600125	铁龙物流	9,046	81,052.16	0.05
431	600563	法拉电子	1,638	80,933.58	0.05

432	002308	威创股份	6,200	80,910.00	0.05
433	300253	卫宁健康	10,345	80,794.45	0.05
434	000712	锦龙股份	4,907	80,327.59	0.05
435	002022	科华生物	4,619	80,232.03	0.05
436	002408	齐翔腾达	7,229	80,097.32	0.05
437	300291	华录百纳	4,000	80,080.00	0.05
438	000877	天山股份	6,292	79,719.64	0.05
439	002353	杰瑞股份	5,038	79,701.16	0.05
440	000027	深圳能源	11,841	79,689.93	0.05
441	002440	闰土股份	5,212	79,535.12	0.05
442	600597	光明乳业	6,212	79,203.00	0.05
443	002642	荣之联	3,150	78,939.00	0.05
444	600557	康缘药业	4,747	78,847.67	0.05
445	600565	迪马股份	14,200	78,242.00	0.05
446	300133	华策影视	6,965	78,008.00	0.05
447	002002	鸿达兴业	9,959	77,978.97	0.05
448	000501	鄂武商 A	4,217	77,845.82	0.05
449	002431	棕榈股份	7,030	77,470.60	0.05
450	002268	卫 士 通	4,600	77,372.00	0.05
451	600648	外高桥	4,161	77,061.72	0.05
452	601928	凤凰传媒	7,890	77,006.40	0.05
453	600685	中船防务	2,800	76,664.00	0.05
454	600645	中源协和	3,548	76,033.64	0.05
455	000061	农 产 品	8,380	75,922.80	0.05
456	300257	开山股份	3,600	75,888.00	0.05
457	000975	银泰资源	5,994	75,704.22	0.05
458	600086	东方金钰	7,000	75,670.00	0.05
459	000939	凯迪生态	14,836	75,663.60	0.05
460	603000	人民网	5,730	75,464.10	0.05
461	300251	光线传媒	9,214	75,462.66	0.05
462	600835	上海机电	3,568	75,427.52	0.05
463	300134	大富科技	3,216	75,125.76	0.05
464	600582	天地科技	16,300	74,817.00	0.05
465	601929	吉视传媒	21,604	74,749.84	0.05
466	600993	马应龙	3,428	74,661.84	0.05
467	600200	江苏吴中	5,642	74,474.40	0.05
468	002444	巨星科技	4,769	74,301.02	0.05
469	000961	中南建设	11,375	74,165.00	0.05
470	601608	中信重工	14,011	73,978.08	0.05

471	002342	巨力索具	7,330	73,813.10	0.05
472	600267	海正药业	6,317	73,782.56	0.05
473	600694	大商股份	1,890	73,653.30	0.05
474	600039	四川路桥	17,691	73,594.56	0.05
475	000718	苏宁环球	12,549	73,537.14	0.05
476	600187	国中水务	14,560	73,528.00	0.05
477	600198	大唐电信	5,751	73,440.27	0.05
478	600416	湘电股份	5,357	73,390.90	0.05
479	600316	洪都航空	4,559	73,263.13	0.05
480	600270	外运发展	3,869	73,240.17	0.05
481	600392	盛和资源	5,547	73,164.93	0.05
482	002299	圣农发展	4,901	72,877.87	0.05
483	002489	浙江永强	11,380	72,604.40	0.05
484	000926	福星股份	5,950	72,590.00	0.05
485	600282	南钢股份	19,400	71,974.00	0.05
486	000829	天音控股	6,664	71,971.20	0.05
487	000830	鲁西化工	10,384	71,649.60	0.05
488	002422	科伦药业	4,322	71,399.44	0.05
489	002396	星网锐捷	3,649	70,608.15	0.05
490	300199	翰宇药业	4,600	70,564.00	0.05
491	600729	重庆百货	2,625	70,455.00	0.05
492	300001	特锐德	4,200	70,392.00	0.05
493	300026	红日药业	14,900	70,179.00	0.05
494	000528	柳 工	8,114	70,104.96	0.05
495	600750	江中药业	2,017	70,090.75	0.05
496	600366	宁波韵升	3,969	70,013.16	0.05
497	000156	华数传媒	4,692	69,957.72	0.05
498	601958	金钼股份	9,752	69,921.84	0.05
499	002477	雏鹰农牧	15,723	69,652.89	0.05
500	000587	金洲慈航	4,656	69,374.40	0.05
501	002122	天马股份	6,724	69,257.20	0.05
502	600611	大众交通	12,496	68,977.92	0.05
503	600259	广晟有色	1,766	68,944.64	0.05
504	600765	中航重机	4,999	68,886.22	0.05
505	600859	王府井	4,254	68,702.10	0.05
506	002672	东江环保	4,045	68,320.05	0.05
507	000519	中兵红箭	5,405	68,103.00	0.05
508	000090	天健集团	6,135	68,098.50	0.05
509	000563	陕国投 A	13,150	67,985.50	0.05

510	601118	海南橡胶	11,948	67,864.64	0.04
511	000667	美好置业	20,430	67,623.30	0.04
512	002155	湖南黄金	7,000	66,990.00	0.04
513	002354	天神娱乐	3,109	66,843.50	0.04
514	000777	中核科技	3,334	66,546.64	0.04
515	600216	浙江医药	6,709	66,486.19	0.04
516	002056	横店东磁	8,836	66,270.00	0.04
517	002505	大康农业	18,916	66,206.00	0.04
518	000062	深圳华强	2,484	65,900.52	0.04
519	600108	亚盛集团	15,270	65,813.70	0.04
520	601311	骆驼股份	4,642	65,730.72	0.04
521	002285	世联行	8,195	65,723.90	0.04
522	002368	太极股份	2,361	65,376.09	0.04
523	002437	誉衡药业	8,976	65,345.28	0.04
524	002128	露天煤业	7,506	65,302.20	0.04
525	002242	九阳股份	3,317	65,245.39	0.04
526	000612	焦作万方	8,101	65,213.05	0.04
527	600422	昆药集团	5,744	65,136.96	0.04
528	002244	滨江集团	9,364	64,798.88	0.04
529	000937	冀中能源	10,587	64,792.44	0.04
530	300010	立思辰	5,000	64,750.00	0.04
531	300273	和佳股份	5,279	64,192.64	0.04
532	600098	广州发展	8,100	64,071.00	0.04
533	000021	深科技	7,463	64,032.54	0.04
534	002011	盾安环境	5,640	64,014.00	0.04
535	600073	上海梅林	6,700	63,985.00	0.04
536	000158	常山股份	4,000	63,200.00	0.04
537	000592	平潭发展	11,438	63,137.76	0.04
538	600536	中国软件	3,286	62,959.76	0.04
539	000543	皖能电力	10,788	62,894.04	0.04
540	600169	太原重工	16,288	62,871.68	0.04
541	000669	金鸿能源	3,446	62,475.98	0.04
542	000762	西藏矿业	4,388	62,177.96	0.04
543	600770	综艺股份	8,265	61,987.50	0.04
544	000848	承德露露	6,201	61,885.98	0.04
545	002190	成飞集成	2,308	61,854.40	0.04
546	600651	飞乐音响	7,268	61,559.96	0.04
547	000703	恒逸石化	4,319	61,502.56	0.04
548	600284	浦东建设	5,720	61,318.40	0.04

549	000897	津滨发展	13,024	61,212.80	0.04
550	603188	亚邦股份	3,500	61,040.00	0.04
551	002254	泰和新材	4,588	61,020.40	0.04
552	002358	森源电气	3,576	60,863.52	0.04
553	000616	海航投资	14,100	60,630.00	0.04
554	002375	亚厦股份	6,793	60,525.63	0.04
555	002699	美盛文化	4,380	60,444.00	0.04
556	000008	神州高铁	8,300	60,424.00	0.04
557	002503	搜于特	8,492	59,698.76	0.04
558	601678	滨化股份	8,572	59,575.40	0.04
559	600871	石化油服	17,800	59,452.00	0.04
560	600171	上海贝岭	5,820	59,189.40	0.04
561	002479	富春环保	4,964	59,071.60	0.04
562	000572	海马汽车	11,417	59,025.89	0.04
563	002390	信邦制药	6,757	58,853.47	0.04
564	603883	老百姓	1,200	58,380.00	0.04
565	000726	鲁 泰 A	4,920	58,351.20	0.04
566	002277	友阿股份	9,028	58,230.60	0.04
567	000636	风华高科	6,836	58,174.36	0.04
568	002276	万马股份	5,749	58,007.41	0.04
569	002482	广田集团	6,450	57,985.50	0.04
570	600754	锦江股份	2,138	57,939.80	0.04
571	600496	精工钢构	11,935	57,646.05	0.04
572	600587	新华医疗	3,226	57,358.28	0.04
573	002073	软控股份	6,727	57,044.96	0.04
574	002317	众生药业	4,582	56,908.44	0.04
575	000541	佛山照明	6,245	56,891.95	0.04
576	600058	五矿发展	4,554	56,515.14	0.04
577	002325	洪涛股份	7,732	56,443.60	0.04
578	000652	泰达股份	10,621	56,291.30	0.04
579	002261	拓维信息	4,800	56,208.00	0.04
580	600053	九鼎投资	1,600	55,936.00	0.04
581	600289	亿阳信通	5,086	55,640.84	0.04
582	600894	广日股份	4,676	55,363.84	0.04
583	300287	飞利信	6,000	55,080.00	0.04
584	000426	兴业矿业	6,100	55,022.00	0.04
585	000099	中信海直	4,864	54,768.64	0.04
586	002373	千方科技	4,000	54,560.00	0.04
587	600639	浦东金桥	2,996	54,287.52	0.04

588	601233	桐昆股份	3,905	54,123.30	0.04
589	600628	新世界	4,655	53,765.25	0.04
590	001696	宗申动力	7,082	53,610.74	0.04
591	600428	中远海特	8,600	53,492.00	0.04
592	002428	云南锗业	5,004	53,442.72	0.04
593	000680	山推股份	9,800	53,410.00	0.04
594	300043	星辉娱乐	6,500	53,365.00	0.04
595	002063	远光软件	5,105	53,194.10	0.04
596	600188	兖州煤业	4,345	53,182.80	0.04
597	002681	奋达科技	4,160	52,374.40	0.03
598	002657	中科金财	1,806	52,355.94	0.03
599	000810	创维数字	4,300	52,159.00	0.03
600	600880	博瑞传播	7,955	51,946.15	0.03
601	601777	力帆股份	6,455	51,898.20	0.03
602	600517	置信电气	6,765	51,211.05	0.03
603	300202	聚龙股份	3,096	51,145.92	0.03
604	002106	莱宝高科	5,046	51,115.98	0.03
605	300147	香雪制药	4,952	50,857.04	0.03
606	600790	轻纺城	7,440	50,666.40	0.03
607	600720	祁连山	6,467	50,636.61	0.03
608	600657	信达地产	8,767	50,497.92	0.03
609	600395	盘江股份	6,886	50,474.38	0.03
610	603077	和邦生物	9,901	50,396.09	0.03
611	600805	悦达投资	6,835	50,237.25	0.03
612	600460	士兰微	8,261	50,144.27	0.03
613	601886	江河集团	4,860	49,815.00	0.03
614	002345	潮宏基	4,582	49,806.34	0.03
615	600736	苏州高新	7,038	49,758.66	0.03
616	600640	号百控股	2,937	49,635.30	0.03
617	002041	登海种业	3,737	49,515.25	0.03
618	000552	靖远煤电	13,864	49,494.48	0.03
619	600220	江苏阳光	14,355	49,237.65	0.03
620	002344	海宁皮城	5,864	48,788.48	0.03
621	002064	华峰氨纶	10,122	48,788.04	0.03
622	600801	华新水泥	5,102	48,622.06	0.03
623	603328	依顿电子	3,434	48,591.10	0.03
624	002332	仙琚制药	5,648	48,572.80	0.03
625	600586	金晶科技	9,900	48,411.00	0.03
626	300039	上海凯宝	6,619	48,120.13	0.03

627	600458	时代新材	4,200	48,090.00	0.03
628	002414	高德红外	2,622	47,982.60	0.03
629	600481	双良节能	8,944	47,492.64	0.03
630	600006	东风汽车	8,118	47,490.30	0.03
631	002269	美邦服饰	12,720	47,445.60	0.03
632	600195	中牧股份	2,420	46,923.80	0.03
633	600059	古越龙山	5,070	46,897.50	0.03
634	002371	北方华创	1,959	46,859.28	0.03
635	600280	中央商场	5,904	46,818.72	0.03
636	002463	沪电股份	10,255	46,660.25	0.03
637	002005	德豪润达	9,753	46,521.81	0.03
638	600329	中新药业	2,558	46,325.38	0.03
639	600596	新安股份	5,478	46,289.10	0.03
640	600757	长江传媒	6,192	46,254.24	0.03
641	000969	安泰科技	5,282	46,111.86	0.03
642	000417	合肥百货	5,546	45,754.50	0.03
643	002663	普邦股份	8,400	45,612.00	0.03
644	002118	紫鑫药业	6,600	45,078.00	0.03
645	601001	大同煤业	8,557	44,924.25	0.03
646	600300	维维股份	8,378	44,738.52	0.03
647	600580	卧龙电气	6,548	44,657.36	0.03
648	600022	山东钢铁	21,630	44,557.80	0.03
649	600292	远达环保	4,086	44,047.08	0.03
650	600537	亿晶光电	8,838	44,013.24	0.03
651	002233	塔牌集团	3,613	43,970.21	0.03
652	603169	兰石重装	3,600	43,740.00	0.03
653	601002	晋亿实业	5,033	43,535.45	0.03
654	600826	兰生股份	2,376	43,005.60	0.03
655	600831	广电网络	4,315	42,934.25	0.03
656	002251	步步高	3,459	42,857.01	0.03
657	002727	一心堂	2,290	42,136.00	0.03
658	600141	兴发集团	3,398	42,033.26	0.03
659	600869	智慧能源	6,234	41,954.82	0.03
660	600748	上实发展	5,762	41,486.40	0.03
661	000620	新华联	5,828	41,437.08	0.03
662	600971	恒源煤电	5,083	41,324.79	0.03
663	603355	莱克电气	700	41,139.00	0.03
664	002093	国脉科技	4,642	40,849.60	0.03
665	600743	华远地产	9,663	40,777.86	0.03

666	603698	航天工程	1,600	40,320.00	0.03
667	002249	大洋电机	6,100	40,138.00	0.03
668	002309	中利集团	3,208	40,132.08	0.03
669	600251	冠农股份	5,010	39,929.70	0.03
670	002551	尚荣医疗	2,445	39,437.85	0.03
671	002588	史丹利	5,068	38,972.92	0.03
672	600466	蓝光发展	4,500	38,835.00	0.03
673	600335	国机汽车	3,218	38,487.28	0.03
674	600773	西藏城投	3,424	37,903.68	0.03
675	600551	时代出版	2,346	37,043.34	0.02
676	002392	北京利尔	6,129	36,344.97	0.02
677	603806	福斯特	1,100	35,211.00	0.02
678	603589	口子窖	900	34,911.00	0.02
679	600776	东方通信	4,961	33,635.58	0.02
680	002646	青青稞酒	1,917	33,470.82	0.02
681	600184	光电股份	1,756	32,942.56	0.02
682	603005	晶方科技	1,169	32,720.31	0.02
683	002315	焦点科技	1,288	32,122.72	0.02
684	603001	奥康国际	1,703	31,999.37	0.02
685	603567	珍宝岛	1,800	30,294.00	0.02
686	002194	武汉凡谷	3,106	27,488.10	0.02
687	600618	氯碱化工	2,354	25,140.72	0.02
688	603568	伟明环保	1,100	23,782.00	0.02
689	600751	天海投资	3,900	22,191.00	0.01
690	603198	迎驾贡酒	1,000	19,030.00	0.01
691	603025	大豪科技	700	18,480.00	0.01
692	600917	重庆燃气	1,801	16,983.43	0.01
693	601016	节能风电	4,100	15,088.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600654	*ST 中安	11,549	155,680.52	0.10
2	000887	中鼎股份	6,977	154,121.93	0.10
3	002129	中环股份	14,776	151,010.72	0.10
4	002168	深圳惠程	8,600	146,114.00	0.10
5	002399	海普瑞	4,201	84,986.23	0.06
6	600666	奥瑞德	4,480	80,326.40	0.05

7	002025	航天电器	3,343	79,061.95	0.05
8	300085	银之杰	3,221	59,588.50	0.04
9	000693	*ST 华泽	3,507	48,677.16	0.03
10	600468	百利电气	3,681	23,926.50	0.02
11	600636	*ST 爱富	1	14.34	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	600019	宝钢股份	176,225.00	0.11
2	000066	长城电脑	143,655.16	0.09
3	601200	上海环境	88,865.46	0.05
4	600089	特变电工	30,995.91	0.02
5	002673	西部证券	28,833.39	0.02
6	002673	西部证券	28,833.39	0.02

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	601318	中国平安	908,595.24	0.56
2	000002	万 科 A	493,447.72	0.30
3	601166	兴业银行	441,426.16	0.27
4	600036	招商银行	417,616.04	0.26
5	000651	格力电器	404,772.88	0.25
6	600016	民生银行	398,853.12	0.25
7	601328	交通银行	339,065.18	0.21
8	600519	贵州茅台	331,296.00	0.20
9	601398	工商银行	329,880.94	0.20
10	000333	美的集团	310,893.00	0.19
11	601668	中国建筑	289,294.45	0.18
12	600000	浦发银行	282,531.20	0.17
13	600030	中信证券	264,854.00	0.16
14	601288	农业银行	263,452.18	0.16
15	600867	通化东宝	252,749.68	0.16
16	600837	海通证券	247,282.50	0.15
17	002085	万丰奥威	240,382.20	0.15

18	600887	伊利股份	232,853.00	0.14
19	300003	乐普医疗	229,476.00	0.14
20	601211	国泰君安	223,867.00	0.14

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	468,574.92
卖出股票收入（成交）总额	28,104,723.39

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）	4,285.60	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,285.60	0.00

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	113012	骆驼转债	40	4,285.60	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述 1 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金跟踪的标的指数为中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股民生银行。根据 2016 年 9 月 14 日民生银行公告《民生银行：关于中国民生银行股份有限公司非公开发行优先股申请文件反馈意见的回复报告》中提到加银资管被证券监管部门和交易所采取监管措施、监管关注及整改情况：2016 年 5 月 17 日，中国证监会向加银资管下发行政监管措施决定书（〔2016〕49 号）《关于对民生加银资产管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，对加银资管部分资产管理计划较高比例投资于非标资产，但却每周开放申购赎回，违反《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》相关规定的行为，采取责令改正、并暂停办理加银资管特定客户资产管理计划备案 3 个月的行政监管措施。2016 年 7 月 25 日，中国证券投资基金业协会向加银资管下发纪律处分决定书（中基协处分〔2016〕5 号），对加银资管部分资产管理计划违规开展资金池业务，违反中国证监会《关于进一步加强基金管理公司及其子公司从事特定客户资产管理业务风险管理的通知》和《证券期货经营机构落实资产管理业务“八条底线”禁止行为细则（2015 年 3 月版）》相关规定的行为，采取暂停受理加银资管资产管理计划备案 6 个月，并责令清理资金池业务的行政监管

措施。上述纪律处分与前述中国证监会暂停受理加银资管特定客户资产管理计划备案 3 个月的行政监管措施合并执行。加银资管针对上述事项, 经过与监管部门沟通, 已经采取整改措施, 目前正在整改过程中, 待整改完成后将对整改情况做出书面汇报。” 本基金做出如下说明: 民生银行是中国最优秀的银行之一, 基本面良好。基于相关研究, 本基金判断, 加银资管受监管部门整改措施对民生银行影响极小。今后, 我们将继续加强与该公司的沟通, 密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述情况外, 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查, 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, 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	3,515.18
2	应收证券清算款	3,338,293.95
3	应收股利	-
4	应收利息	2,368.92
5	应收申购款	99.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,344,277.93

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: 本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600654	*ST 中安	155,680.52	0.10	重大事项停牌

2	000887	中鼎股份	154,121.93	0.10	重大事项停牌
3	002129	中环股份	151,010.72	0.10	重大事项停牌
4	002168	深圳惠程	146,114.00	0.10	重大事项停牌
5	002399	海普瑞	84,986.23	0.06	重大事项停牌

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
8,167	13,941.40	16,750,569.41	14.71%	97,108,856.35	85.29%

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	工银瑞信基金公司—农行—中国农业银行离退休人员福利负债	4,805,376.00	5.08%
2	中国工商银行股份有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	4,603,371.00	4.87%
3	中国工商银行股份有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	3,728,891.00	3.94%
4	余栋腾	2,392,881.00	2.53%
5	王飞舟	1,677,417.00	1.77%
6	余元华	1,500,000.00	1.59%
7	陈军达	1,298,592.00	1.37%
8	恒生电子股份有限公司	1,164,532.00	1.23%
9	靳宁卿	1,029,900.00	1.09%
10	纪伟才	961,227.00	1.02%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 22 日）基金份额总额	542,268,490.78
本报告期期初基金份额总额	130,942,005.42
本报告期基金总申购份额	153,907.98
减:本报告期基金总赎回份额	17,236,487.64
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	113,859,425.76

§ 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

由于任期届满，高新不再担任公司董事长，周放生不再担任公司独立董事。根据公司 2016 年度股东会议决议，选举林培富为公司董事，选举张良庆为公司独立董事；根据公司第七届董事会第一次会议决议，选举周兵担任公司董事长；根据公司第七届董事会第二次会议决议，聘任林培富担任公司总经理，周兵不再担任公司总经理，同时林培富不再担任公司副总经理。以上公司高级管理人员变更，已于 2017 年 3 月 30 日向中国证监会北京监管局报备。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内本基金托管人的高级管理人员无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	17,487,722.46	63.01%	16,257.47	63.03%	-
东北证券	1	10,268,084.61	36.99%	9,535.60	36.97%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	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
长江证券	276,703.40	100.00%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-

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,并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向,并提供相关研究报告;

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定;

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

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

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

（6）交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.8 其他重大事件

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

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司旗下部分基金增加基煜销售并开通基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站	2017 年 6 月 29 日
2	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）招募说明书摘要	同上	2017 年 6 月 29 日
3	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（lof）招募说明书（更新）	同上	2017 年 6 月 29 日
4	长盛基金管理有限公司关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》和《上海证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示公告	同上	2017 年 4 月 27 日
5	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2017 年第 1 季度报告	同上	2017 年 4 月 22 日
6	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	同上	2017 年 4 月 22 日
7	长盛基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加广发证券申购（含定投）费率优惠活动的公告	同上	2017 年 4 月 10 日
8	长盛基金管理有限公司高级管理人员董事长变更的公告	同上	2017 年 3 月 28 日
9	长盛基金管理有限公司高级管理人员副总经理变更的公告	同上	2017 年 3 月 28 日
10	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	同上	2017 年 3 月 28 日
11	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2016 年度报告	同上	2017 年 3 月 27 日
12	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）2016 年度报告 摘要	同上	2017 年 3 月 27 日
13	长盛基金管理有限公司关于增加肯特瑞财富为旗下基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	同上	2017 年 3 月 24 日
14	长盛基金管理有限公司关于增加蛋卷基金为旗下基金销售机构并	同上	2017 年 3 月 21 日

	参加费率优惠活动的公告		
15	长盛基金管理有限公司关于增加 济安财富为旗下部分基金销售机 构及参加费率优惠活动的公告	同上	2017 年 3 月 21 日
16	长盛基金管理有限公司关于增加 北京乐融多源投资咨询有限公司 为旗下部分基金代销机构并开通 定投业务及转换业务的公告	同上	2017 年 3 月 21 日
17	长盛基金管理有限公司关于旗下 基金参加交通银行手机银行渠道 基金申购及定期定额投资手续费 率优惠活动的公告	同上	2017 年 2 月 23 日
18	长盛同庆中证 800 指数型证券投资 基金（LOF）2016 年第 4 季度报告	同上	2017 年 1 月 21 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

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

11.2 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场所。

11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2017 年 8 月 24 日