

景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基
金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57

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	57
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	57
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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.3 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	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城中证 500 指数增强	
场内简称	无	
基金主代码	006682	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 25 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	964,351,919.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	006682	016935
报告期末下属分级基金的份额总额	962,531,190.76 份	1,820,728.78 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制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不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>4、权证、股指期货投资策略</p> <p>本基金可投资权证、股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。</p> <p>本基金对权证的分析判断主要从市场环境、时机、权证定价、市场供求、发行人资质、交易冲击等方面综合考量，运用权证定价模型</p>

	<p>计算权证当前的合理价格。本基金适时选择具有相对优势的权证并制定相应的投资计划。</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>5、中小企业私募债券的投资策略</p> <p>对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金将加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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		景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66596688
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008888606	95566
传真		0755-22381339	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		李进	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)	
	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	-49,398,310.51	-85,652.35
本期利润	-2,013,936.81	-25,742.60
加权平均基金份额本期利润	-0.0018	-0.0158
本期加权平均净值利润率	-0.13%	-1.13%
本期基金份额净值增长率	-1.09%	-1.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	344,095,615.53	645,337.15
期末可供分配基金份额利润	0.3575	0.3544
期末基金资产净值	1,306,626,806.29	2,466,065.93
期末基金份额净值	1.3574	1.3544
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	35.74%	-5.31%

注：1、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。

2、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。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

4、上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。

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

景顺长城中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④

	率①	准差②		④		
过去一个月	0.51%	0.82%	-0.77%	0.89%	1.28%	-0.07%
过去三个月	-4.48%	0.77%	-5.10%	0.78%	0.62%	-0.01%
过去六个月	-1.09%	0.76%	2.20%	0.75%	-3.29%	0.01%
过去一年	-12.04%	0.93%	-6.65%	0.91%	-5.39%	0.02%
过去三年	23.78%	1.16%	2.48%	1.13%	21.30%	0.03%
自基金合同生效起至今	35.74%	1.25%	6.89%	1.24%	28.85%	0.01%

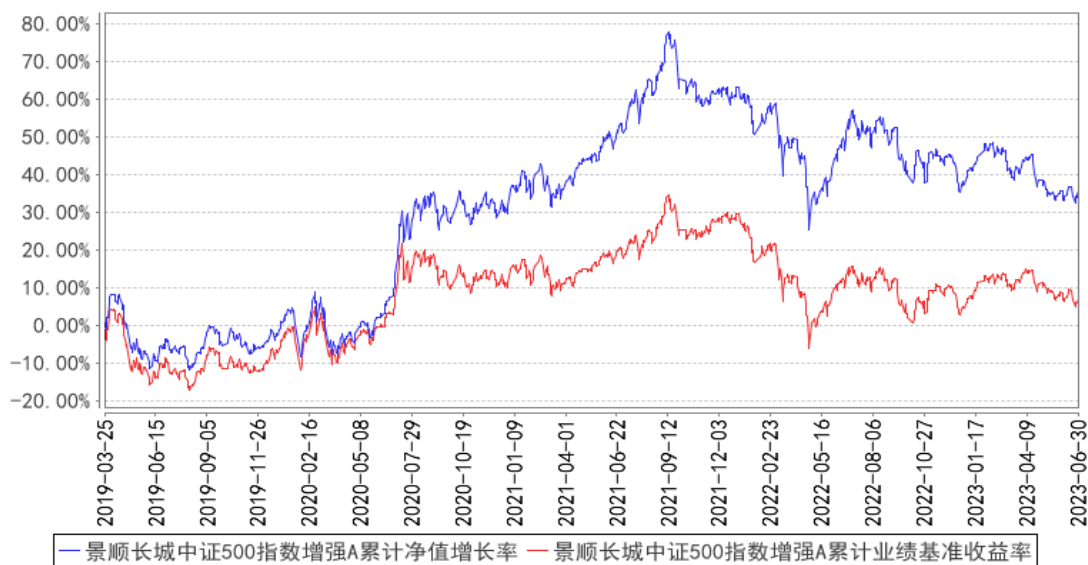
景顺长城中证500指数增强C

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	0.48%	0.82%	-0.77%	0.89%	1.25%	-0.07%
过去三个月	-4.57%	0.77%	-5.10%	0.78%	0.53%	-0.01%
过去六个月	-1.28%	0.76%	2.20%	0.75%	-3.48%	0.01%
自基金合同生效起至今	-5.31%	0.81%	0.61%	0.80%	-5.92%	0.01%

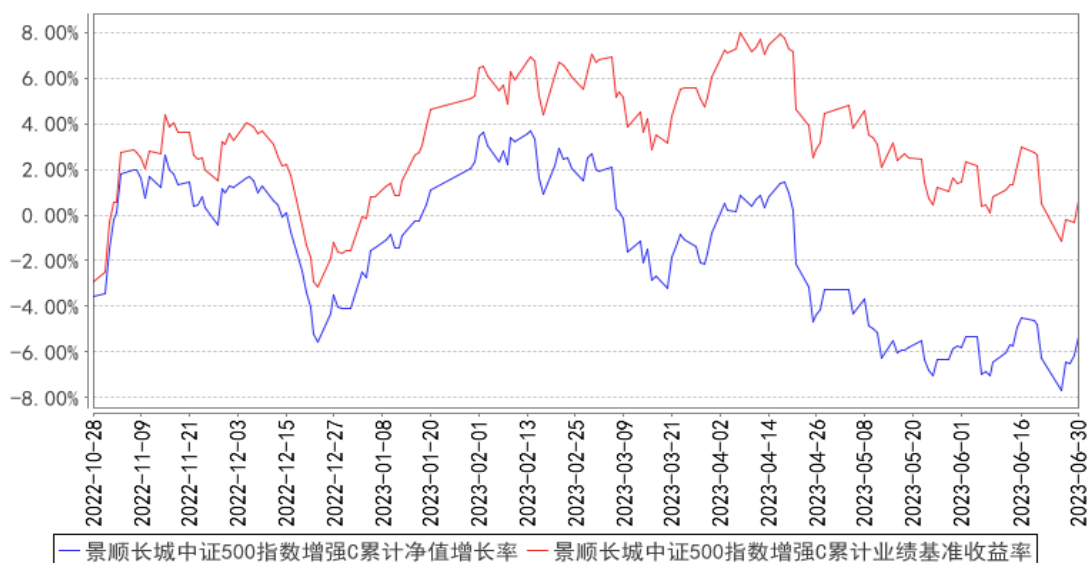
注：本基金于2022年10月27日增设C类份额，并于2022年10月28日开始对C类份额进行估值。

3.2.2 自基金合同生效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

景顺长城中证500指数增强A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



景顺长城中证500指数增强C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：基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2019 年 3 月 25 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2022 年 10 月 27 日起增设 C 类基金份额。

3.3 其他指标

无。

§ 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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6 月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2023 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 175 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配

置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

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		
黎海威	本基金的基金经理	2019年3月25日	-	20年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，自2013年10月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有20年证券、基金行业从业经验。
徐喻军	本基金的基金经理	2019年3月25日	-	13年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012年3月加入本公司，担任量化及ETF投资部ETF专员，自2014年4月起担任量化及指数投资部基金经理。具有13年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、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。

4.1.3 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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，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% 的交易共有 17 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2023 年上半年，国内经济整体呈现出弱复苏的态势，服务业的复苏较为明显，制造业和地产的复苏仍需观察，权益市场的表现也反映了较弱的经济和基本面预期。从国内来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 49.2、48.8、49.0，今年前 5 个月工业增加值累计同比增长 3.6%，其中 5 月份工业增加值当月同比增长 3.5%，经济复苏的节奏出现放缓的迹象。6 月 PPI 同比下降 5.4%，环比下降 0.8%；CPI 同比持平，环比下降 0.2%，通胀依旧温和。6 月 M2 同比增长 11.3%，M1 同比增速 3.1%，流动性充裕；6 月末外汇储备 3.19 万亿美元，汇率短期承压。整体而言，国内货币政策总体保持稳健，流动性充裕，宏观环境总体温和，经济依然是弱复苏的态势。上半年 A 股市场呈现出先涨后跌的态势，风格上来看，价值风格优于成长风格。综合来看，上半年上证指数上涨 3.65%、沪深 300 指数下跌 0.75%，创业板指数下跌 5.61%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年上半年，景顺长城中证 500 指数增强 A 份额净值增长率为-1.09%，业绩比较基准收益率为 2.20%。

2023 年上半年，景顺长城中证 500 指数增强 C 份额净值增长率为-1.28%，业绩比较基准收益率为 2.20%。

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 2023 年下半年，海外方面，通胀大概率继续回落，美联储的货币政策依然是市场关注的热点，但其对国内资本市场的边际影响明显降低。国内方面，“稳增长”政策有望加快落地，或可对经济形成一定支撑，下半年货币政策预期维持宽松，预期流动性保持合理充裕。长期来看，改

革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

本基金是以中证 500 指数为基准的指数增强基金，我们的投资组合主要以基本面量化选股为主，风格上维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生持续稳定的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	82,742,210.24	99,276,082.62
结算备付金		8,520,918.96	18,116,993.84
存出保证金		1,873,148.27	1,069,210.85
交易性金融资产	6.4.7.2	1,222,237,655.64	1,594,850,044.43
其中：股票投资		1,222,021,837.67	1,594,850,044.43
基金投资		-	-
债券投资		215,817.97	-

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		288,172.93	175,795.29
应收股利		-	-
应收申购款		621,284.05	812,851.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,316,283,390.09	1,714,300,978.13
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	14.47
应付赎回款		571,150.22	2,126,745.21
应付管理人报酬		1,291,864.33	1,702,474.89
应付托管费		215,310.71	283,745.82
应付销售服务费		788.06	34.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.64	0.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	5,111,403.91	8,501,989.34
负债合计		7,190,517.87	12,615,005.03
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	964,351,919.54	1,239,871,872.18
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	344,740,952.68	461,814,100.92
净资产合计		1,309,092,872.22	1,701,685,973.10
负债和净资产总计		1,316,283,390.09	1,714,300,978.13

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.3574 元，景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 C 类基金份额净值人民币 1.3544

元，基金份额总额 964,351,919.54 份，其中景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额 962,531,190.76 份；景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 C 类基金份额 1,820,728.78 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		9,062,725.78	-46,877,188.52
1. 利息收入		259,102.48	298,702.65
其中：存款利息收入	6.4.7.13	259,102.48	298,702.65
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-39,227,246.01	-170,308,112.45
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-55,604,173.25	-188,439,742.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	629,549.58	225,543.04
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	-188,977.68	-304,957.80
股利收益	6.4.7.19	15,936,355.34	18,211,044.91
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	47,444,283.45	120,981,111.24
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	586,585.86	2,151,110.04
减：二、营业总支出		11,102,405.19	11,213,909.15

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,302,573.17	9,396,418.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,550,428.86	1,566,069.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,610.37	-
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		908.91	0.26
8. 其他费用	6.4.7.23	243,883.88	251,420.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,039,679.41	-58,091,097.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,039,679.41	-58,091,097.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,039,679.41	-58,091,097.67

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,239,871,872.18	-	461,814,100.92	1,701,685,973.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,239,871,872.18	-	461,814,100.92	1,701,685,973.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-275,519,952.64	-	-117,073,148.24	-392,593,100.88
（一）、综合收益总额	-	-	-2,039,679.41	-2,039,679.41
（二）、本期基金份额交易产生的	-275,519,952.64	-	-115,033,468.83	-390,553,421.47

基金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)				
其中: 1. 基金申 购款	60,457,397.49	-	24,830,943.87	85,288,341.36
2. 基金赎 回款	-335,977,350.13	-	-139,864,412.70	-475,841,762.83
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的基 金净值变动(净 值减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产(基金净值)	964,351,919.54	-	344,740,952.68	1,309,092,872.22
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收 益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产(基金净值)	866,145,776.72	-	547,468,846.68	1,413,614,623.40
加: 会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产(基金净值)	866,145,776.72	-	547,468,846.68	1,413,614,623.40
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	372,309,608.38	-	125,273,725.87	497,583,334.25
(一)、综合收益 总额	-	-	-58,091,097.67	-58,091,097.67
(二)、本期基金 份额交易产生的 基金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)	372,309,608.38	-	183,364,823.54	555,674,431.92
其中: 1. 基金申 购款	915,056,348.09	-	420,468,768.46	1,335,525,116.55

2. 基金赎回款	-542,746,739.71	-	-237,103,944.92	-779,850,684.63
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,238,455,385.10	-	672,742,572.55	1,911,197,957.65

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：

康乐

吴建军

邵媛媛

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

景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1897 号文《关于准予景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集。基金合同于 2019 年 3 月 25 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,507,912,000.78 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 967,567.93 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,508,879,568.71 元，折合 1,508,879,568.71 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的约定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2022 年 10 月 27 日起对景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销

售服务费；C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款，以及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）。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%-95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2023 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管

理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；

持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	82,742,210.24
等于：本金	82,735,152.34
加：应计利息	7,057.90
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 个月（含）-3 个月	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	82,742,210.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,253,362,065.72	-	1,222,021,837.67	-31,340,228.05	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	215,800.00	17.97	215,817.97	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	215,800.00	17.97	215,817.97	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,253,577,865.72	17.97	1,222,237,655.64	-31,340,228.05	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	13,178,520.00	-	-	
其中：股指期货投资	13,178,520.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	13,178,520.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2307	中证 500 指数期货 2307	6.00	7,188,960.00	54,600.00
IC2309	中证 500 指数期货 2309	5.00	5,970,000.00	-74,160.00
合计				-19,560.00
减：可抵销期货暂收款				-19,560.00
净额				-

注：（1）衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

（2）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末的买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	871.96
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,948,101.47
其中：交易所市场	4,948,101.47
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	106,616.24
应付指数使用费	55,814.24
合计	5,111,403.91

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城中证 500 指数增强 A

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,239,748,206.90	1,239,748,206.90
本期申购	56,396,197.07	56,396,197.07
本期赎回 (以“-”号填列)	-333,613,213.21	-333,613,213.21
本期末	962,531,190.76	962,531,190.76

景顺长城中证 500 指数增强 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	123,665.28	123,665.28
本期申购	4,061,200.42	4,061,200.42
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,364,136.92	-2,364,136.92
本期末	1,820,728.78	1,820,728.78

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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

景顺长城中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	645,226,221.91	-183,458,120.81	461,768,101.10
本期利润	-49,398,310.51	47,384,373.70	-2,013,936.81
本期基金份额交易产生的变动数	-141,680,329.37	26,021,780.61	-115,658,548.76
其中：基金申购款	28,917,031.02	-5,759,987.98	23,157,043.04
基金赎回款	-170,597,360.39	31,781,768.59	-138,815,591.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	454,147,582.03	-110,051,966.50	344,095,615.53

景顺长城中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	64,300.77	-18,300.95	45,999.82
本期利润	-85,652.35	59,909.75	-25,742.60
本期基金份额交易产生的变动数	874,843.29	-249,763.36	625,079.93
其中：基金申购款	2,096,402.64	-422,501.81	1,673,900.83
基金赎回款	-1,221,559.35	172,738.45	-1,048,820.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	853,491.71	-208,154.56	645,337.15

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	163,479.83
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	93,556.12
其他	2,066.53
合计	259,102.48

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-55,604,173.25
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	-55,604,173.25

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	5,952,133,093.59
减：卖出股票成本总额	5,990,157,245.94
减：交易费用	17,580,020.90
买卖股票差价收入	-55,604,173.25

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	416.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	629,132.60
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	629,549.58
----	------------

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,257,634.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,628,000.00
减：应计利息总额	411.59
减：交易费用	90.33
买卖债券差价收入	629,132.60

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-188,977.68

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	15,936,355.34
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	15,936,355.34

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	47,216,422.03
股票投资	47,216,422.03
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	227,861.42
权证投资	-
期货投资	227,861.42
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	47,444,283.45

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	451,663.99
基金转换费收入	134,921.87
合计	586,585.86

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	47,108.87
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	12,877.56
指数使用费	124,034.23
存托服务费	355.85
合计	243,883.88

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

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要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，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	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 (%)
长城证券	602,092,893.06	5.23	26,249,632.24	0.19

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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 (%)
长城证券	560,729.96	5.23	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 (%)

长城证券	24,447.57	0.19	24,447.57	0.32
------	-----------	------	-----------	------

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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证券投资研究成果和市场信息服务。

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,302,573.17	9,396,418.53
其中：支付销售机构的客户维护费	2,521,275.32	2,167,201.52

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,550,428.86	1,566,069.79

注：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C	合计

景顺长城基金管理有限公司	-	7.27	7.27
中国银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	7.27	7.27

注：1、基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

2、本基金于 2022 年 10 月 27 日起增加景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金的 C 类基金份额，原有基金份额全部自动划归为本基金 A 类基金份额。

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

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 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	82,742,210.24	163,479.83	114,660,710.40	197,779.38

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

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

本基金本报告期无利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-

		月 8 日		通受限						
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月以上	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	1-6 个月 (含)	新股流通受限	-	53.24	131	-	6,974.44	转增股
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023 年 2 月	6 个月	新股流	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-

		月 1 日		通受限						
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	顾中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-

688435	英方软件	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股流通受限	38.66	73.03	2,728	105,464.48	199,225.84	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	2,869	108,677.72	84,606.81	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	5,767	64,013.70	98,269.68	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	二元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127086	恒邦转债	2023 年 6	1 个月内	新债未	100.00	100.01	2,158	215,800.00	215,817.97	-

		月 12 日	(含)	上市						
--	--	--------	-----	----	--	--	--	--	--	--

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
601298	青岛港	2023 年 6 月 28 日	重大事项停牌	6.97	2023 年 7 月 3 日	7.40	267,900	1,894,301.89	1,867,263.00	-

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

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用

风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.02%（上年度末：0.00%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合持仓集中度指标、流通受限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%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内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%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

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因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	82,742,210.24	-	-	-	-	-	82,742,210.24
结算备付金	8,520,918.96	-	-	-	-	-	8,520,918.96
存出保证金	294,073.07	-	-	-	-	1,579,075.20	1,873,148.27

交易性金融资产	-	-	-	-	-	215,817.97	1,222,021,837.67	1,222,237,655.64
应收申购款	-	-	-	-	-	-	621,284.05	621,284.05
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	288,172.93	288,172.93
资产总计	91,557,202.27	-	-	-	-	215,817.97	1,224,510,369.85	1,316,283,390.09
负债								
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	571,150.22	571,150.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	1,291,864.33	1,291,864.33
应付托管费	-	-	-	-	-	-	215,310.71	215,310.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	788.06	788.06
应交税费	-	-	-	-	-	-	0.64	0.64
其他负债	-	-	-	-	-	-	5,111,403.91	5,111,403.91
负债总计	-	-	-	-	-	-	7,190,517.87	7,190,517.87
利率敏感度缺口	91,557,202.27	-	-	-	-	215,817.97	-	-
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上		不计息	合计
资产								
银行存款	99,276,082.62	-	-	-	-	-	-	99,276,082.62
结算备付金	18,116,993.84	-	-	-	-	-	-	18,116,993.84
存出保证金	255,894.85	-	-	-	-	-	813,316.00	1,069,210.85
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,594,850,044.43	1,594,850,044.43	1,594,850,044.43
应收申购款	-	-	-	-	-	-	812,851.10	812,851.10
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	175,795.29	175,795.29
资产总计	117,648,971.31	-	-	-	-	1,596,652,006.82	1,714,300,978.13	1,714,300,978.13
负债								
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	2,126,745.21	2,126,745.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	1,702,474.89	1,702,474.89
应付托管费	-	-	-	-	-	-	283,745.82	283,745.82
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	14.47	14.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	34.85	34.85
应交税费	-	-	-	-	-	-	0.45	0.45
其他负债	-	-	-	-	-	-	8,501,989.34	8,501,989.34
负债总计	-	-	-	-	-	-	12,615,005.03	12,615,005.03
利率敏感度缺口	117,648,971.31	-	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.02%（上年度末：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（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,222,021,837.67	93.35	1,594,850,044.43	93.72
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	1,222,021,837.67	93.35	1,594,850,044.43	93.72

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注：6.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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 (2023年6月30日)	上年度末 (2022年12月31日)
	沪深 300 指数上升 5%	48,820,073.56	51,041,913.02
	沪深 300 指数下降 5%	-48,820,073.56	-51,041,913.02

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,217,911,061.47	1,587,787,824.17
第二层次	2,737,764.87	4,766,260.59
第三层次	1,588,829.30	2,295,959.67
合计	1,222,237,655.64	1,594,850,044.43

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	1,222,021,837.67	92.84
	其中：股票	1,222,021,837.67	92.84

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	215,817.97	0.02
	其中：债券	215,817.97	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	91,263,129.20	6.93
8	其他各项资产	2,782,605.25	0.21
9	合计	1,316,283,390.09	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	6,391,885.00	0.49
B	采矿业	56,093,265.75	4.28
C	制造业	608,091,794.26	46.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,697,786.20	3.57
E	建筑业	6,872,336.00	0.52
F	批发和零售业	15,937,794.46	1.22
G	交通运输、仓储和邮政业	18,199,220.00	1.39
H	住宿和餐饮业	10,183,730.00	0.78
I	信息传输、软件和信息技术服务业	101,215,277.20	7.73
J	金融业	88,946,851.36	6.79
K	房地产业	8,218,157.00	0.63
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	12,438,503.60	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	2,507,988.00	0.19
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	14,894,986.00	1.14
S	综合	2,158,674.00	0.16
	合计	998,848,248.83	76.30

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	2,882,680.00	0.22
B	采矿业	11,411,621.64	0.87
C	制造业	141,809,632.55	10.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	35,447.47	0.00

	业		
E	建筑业	14,831,443.65	1.13
F	批发和零售业	4,071,119.45	0.31
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	7,408,964.66	0.57
J	金融业	17,705,210.00	1.35
K	房地产业	6,872,997.00	0.53
L	租赁和商务服务业	4,450,077.00	0.34
M	科学研究和技术服务业	2,021,346.56	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	6,302,420.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,895,866.00	0.14
S	综合	1,450,980.00	0.11
	合计	223,173,588.84	17.05

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	002422	科伦药业	558,527	16,577,081.36	1.27
2	600161	天坛生物	534,474	14,510,969.10	1.11
3	002223	鱼跃医疗	398,100	14,327,619.00	1.09
4	000783	长江证券	2,450,700	14,214,060.00	1.09
5	600642	申能股份	1,985,080	13,875,709.20	1.06
6	600998	九州通	1,261,412	13,093,456.56	1.00
7	600985	淮北矿业	1,103,683	12,714,428.16	0.97
8	600879	航天电子	1,490,400	12,653,496.00	0.97
9	688002	睿创微纳	280,890	12,583,872.00	0.96
10	600582	天地科技	2,135,100	12,447,633.00	0.95
11	002249	大洋电机	2,170,337	12,370,920.90	0.94
12	600637	东方明珠	1,576,800	12,330,576.00	0.94
13	603688	石英股份	106,201	12,089,921.84	0.92
14	600863	内蒙华电	2,907,200	12,064,880.00	0.92
15	601717	郑煤机	948,610	11,810,194.50	0.90
16	600580	卧龙电驱	804,400	11,752,284.00	0.90
17	600096	云天化	687,400	11,733,918.00	0.90
18	002384	东山精密	449,000	11,629,100.00	0.89

19	600109	国金证券	1,332,000	11,548,440.00	0.88
20	002745	木林森	1,253,500	11,532,200.00	0.88
21	000997	新大陆	603,700	11,409,930.00	0.87
22	000591	太阳能	1,677,900	11,376,162.00	0.87
23	601000	唐山港	3,211,400	11,336,242.00	0.87
24	002600	领益智造	1,622,000	11,208,020.00	0.86
25	002056	横店东磁	613,400	11,170,014.00	0.85
26	600497	驰宏锌锗	2,198,366	11,035,797.32	0.84
27	002507	涪陵榨菜	596,240	10,917,154.40	0.83
28	600901	江苏金租	2,623,076	10,833,303.88	0.83
29	600481	双良节能	773,520	10,813,809.60	0.83
30	002065	东华软件	1,527,200	10,782,032.00	0.82
31	603160	汇顶科技	231,800	10,720,750.00	0.82
32	002131	利欧股份	4,583,700	10,542,510.00	0.81
33	601233	桐昆股份	793,700	10,516,525.00	0.80
34	600909	华安证券	2,214,710	10,342,695.70	0.79
35	002518	科士达	255,100	10,206,551.00	0.78
36	600258	首旅酒店	537,400	10,183,730.00	0.78
37	601958	金钼股份	910,700	10,154,305.00	0.78
38	600038	中直股份	249,382	9,930,391.24	0.76
39	002373	千方科技	724,900	9,887,636.00	0.76
40	603225	新凤鸣	868,100	9,592,505.00	0.73
41	002429	兆驰股份	1,711,600	9,413,800.00	0.72
42	000739	普洛药业	510,206	9,051,054.44	0.69
43	600498	烽火通信	439,100	8,944,467.00	0.68
44	600487	亨通光电	608,300	8,917,678.00	0.68
45	000630	铜陵有色	3,071,500	8,876,635.00	0.68
46	000513	丽珠集团	223,600	8,700,276.00	0.66
47	601555	东吴证券	1,253,462	8,699,026.28	0.66
48	002739	万达电影	674,500	8,458,230.00	0.65
49	688390	固德威	50,400	8,409,744.00	0.64
50	002625	光启技术	545,700	8,327,382.00	0.64
51	300003	乐普医疗	356,600	8,062,726.00	0.62
52	600699	均胜电子	438,700	7,738,668.00	0.59
53	002273	水晶光电	644,339	7,693,407.66	0.59
54	300146	汤臣倍健	315,800	7,572,884.00	0.58
55	600143	金发科技	861,200	7,518,276.00	0.57
56	002966	苏州银行	1,146,250	7,507,937.50	0.57
57	600489	中金黄金	704,419	7,276,648.27	0.56
58	000012	南玻 A	1,186,424	7,071,087.04	0.54
59	603156	养元饮品	285,000	7,039,500.00	0.54
60	688777	中控技术	111,892	7,024,579.76	0.54
61	600566	济川药业	240,400	6,981,216.00	0.53

62	600271	航天信息	508,900	6,966,841.00	0.53
63	688099	晶晨股份	80,429	6,781,773.28	0.52
64	300012	华测检测	341,200	6,653,400.00	0.51
65	601168	西部矿业	627,900	6,599,229.00	0.50
66	300308	中际旭创	44,100	6,502,545.00	0.50
67	002025	航天电器	101,700	6,488,460.00	0.50
68	600066	宇通客车	428,900	6,321,986.00	0.48
69	600166	福田汽车	1,846,300	6,277,420.00	0.48
70	688256	寒武纪	30,400	5,715,200.00	0.44
71	000623	吉林敖东	325,804	5,225,896.16	0.40
72	600535	天士力	358,560	5,202,705.60	0.40
73	002439	启明星辰	174,300	5,187,168.00	0.40
74	300009	安科生物	483,167	4,831,670.00	0.37
75	000878	云南铜业	420,500	4,646,525.00	0.35
76	600667	太极实业	636,500	4,620,990.00	0.35
77	000636	风华高科	300,350	4,607,369.00	0.35
78	600418	江淮汽车	355,500	4,475,745.00	0.34
79	300861	美畅股份	102,400	4,441,088.00	0.34
80	600718	东软集团	404,800	4,315,168.00	0.33
81	688208	道通科技	141,725	4,295,684.75	0.33
82	688029	南微医学	51,374	4,190,063.44	0.32
83	600060	海信视像	164,900	4,081,275.00	0.31
84	688188	柏楚电子	20,966	3,953,348.96	0.30
85	601128	常熟银行	570,800	3,892,856.00	0.30
86	600598	北大荒	286,000	3,812,380.00	0.29
87	603127	昭衍新药	92,904	3,799,773.60	0.29
88	301029	怡合达	83,440	3,728,099.20	0.28
89	300604	长川科技	72,896	3,461,831.04	0.26
90	002531	天顺风能	219,900	3,349,077.00	0.26
91	688200	华峰测控	21,712	3,321,936.00	0.25
92	601108	财通证券	446,400	3,231,936.00	0.25
93	000400	许继电气	136,100	3,137,105.00	0.24
94	600398	海澜之家	452,400	3,112,512.00	0.24
95	603517	绝味食品	74,200	2,756,530.00	0.21
96	300395	菲利华	55,800	2,745,360.00	0.21
97	002299	圣农发展	134,700	2,579,505.00	0.20
98	002465	海格通信	246,000	2,543,640.00	0.19
99	300136	信维通信	126,300	2,536,104.00	0.19
100	689009	九号公司	68,133	2,510,701.05	0.19
101	603589	口子窖	48,600	2,398,410.00	0.18
102	601577	长沙银行	304,500	2,362,920.00	0.18
103	600704	物产中大	477,400	2,358,356.00	0.18
104	300383	光环新网	219,000	2,354,250.00	0.18

105	688009	中国通号	399,900	2,319,420.00	0.18
106	688536	思瑞浦	10,500	2,289,000.00	0.17
107	002138	顺络电子	95,700	2,288,187.00	0.17
108	002926	华西证券	273,700	2,274,447.00	0.17
109	600329	达仁堂	50,200	2,253,478.00	0.17
110	600820	隧道股份	374,600	2,251,346.00	0.17
111	002028	思源电气	48,100	2,247,232.00	0.17
112	002092	中泰化学	347,900	2,243,955.00	0.17
113	600536	中国软件	47,740	2,238,051.20	0.17
114	600373	中文传媒	166,800	2,221,776.00	0.17
115	000975	银泰黄金	189,400	2,215,980.00	0.17
116	688072	拓荆科技	5,200	2,215,044.00	0.17
117	688116	天奈科技	48,300	2,209,725.00	0.17
118	002444	巨星科技	100,800	2,205,504.00	0.17
119	600390	五矿资本	408,200	2,196,116.00	0.17
120	600378	昊华科技	58,300	2,194,412.00	0.17
121	601231	环旭电子	145,800	2,181,168.00	0.17
122	600673	东阳光	299,400	2,158,674.00	0.16
123	000050	深天马 A	233,400	2,142,612.00	0.16
124	603456	九洲药业	77,500	2,121,950.00	0.16
125	600399	抚顺特钢	207,200	2,113,440.00	0.16
126	002326	永太科技	138,200	2,113,078.00	0.16
127	600848	上海临港	175,400	2,096,030.00	0.16
128	600131	国网信通	103,800	2,095,722.00	0.16
129	000778	新兴铸管	504,500	2,058,360.00	0.16
130	688107	安路科技	37,100	2,054,969.00	0.16
131	002568	百润股份	56,400	2,050,140.00	0.16
132	600967	内蒙一机	199,500	2,014,950.00	0.15
133	000987	越秀资本	315,300	2,002,155.00	0.15
134	000156	华数传媒	230,100	2,001,870.00	0.15
135	600663	陆家嘴	202,600	1,999,662.00	0.15
136	600895	张江高科	143,600	1,998,912.00	0.15
137	603529	爱玛科技	61,900	1,994,418.00	0.15
138	002423	中粮资本	246,500	1,972,000.00	0.15
139	000559	万向钱潮	361,200	1,968,540.00	0.15
140	002266	浙富控股	468,600	1,935,318.00	0.15
141	002925	盈趣科技	99,500	1,930,300.00	0.15
142	002203	海亮股份	159,500	1,915,595.00	0.15
143	600195	中牧股份	163,500	1,909,680.00	0.15
144	688185	康希诺	23,100	1,882,650.00	0.14
145	601298	青岛港	267,900	1,867,263.00	0.14
146	601158	重庆水务	333,700	1,855,372.00	0.14
147	001203	大中矿业	166,800	1,853,148.00	0.14

148	001872	招商港口	105,900	1,828,893.00	0.14
149	688105	诺唯赞	59,700	1,820,253.00	0.14
150	600597	光明乳业	173,800	1,807,520.00	0.14
151	002867	周大生	101,100	1,797,558.00	0.14
152	601139	深圳燃气	245,700	1,791,153.00	0.14
153	000869	张裕 A	58,400	1,790,544.00	0.14
154	000958	电投产融	411,400	1,781,362.00	0.14
155	600928	西安银行	503,100	1,770,912.00	0.14
156	000598	兴蓉环境	316,400	1,718,052.00	0.13
157	600027	华电国际	247,300	1,654,437.00	0.13
158	601598	中国外运	350,400	1,632,864.00	0.12
159	603026	胜华新材	26,500	1,570,125.00	0.12
160	688295	中复神鹰	42,800	1,569,904.00	0.12
161	688779	长远锂科	138,500	1,560,895.00	0.12
162	601098	中南传媒	132,900	1,541,640.00	0.12
163	688276	百克生物	24,600	1,539,960.00	0.12
164	600062	华润双鹤	85,800	1,494,636.00	0.11
165	603267	鸿远电子	21,900	1,430,070.00	0.11
166	000537	广宇发展	121,500	1,417,905.00	0.11
167	000883	湖北能源	306,900	1,399,464.00	0.11
168	000932	华菱钢铁	292,300	1,394,271.00	0.11
169	688082	盛美上海	12,300	1,357,920.00	0.10
170	000066	中国长城	96,700	1,337,361.00	0.10
171	002156	通富微电	58,500	1,322,100.00	0.10
172	600528	中铁工业	132,300	1,307,124.00	0.10
173	601997	贵阳银行	253,000	1,305,480.00	0.10
174	600177	雅戈尔	204,900	1,292,919.00	0.10
175	688516	奥特维	6,800	1,281,120.00	0.10
176	603355	莱克电气	49,500	1,257,795.00	0.10
177	002500	山西证券	219,300	1,223,694.00	0.09
178	600517	国网英大	209,200	1,192,440.00	0.09
179	002985	北摩高科	26,900	1,186,828.00	0.09
180	603893	瑞芯微	16,200	1,180,170.00	0.09
181	002153	石基信息	81,770	1,144,780.00	0.09
182	600707	彩虹股份	239,800	1,141,448.00	0.09
183	002572	索菲亚	64,600	1,125,332.00	0.09
184	603228	景旺电子	43,300	1,110,645.00	0.08
185	002250	联化科技	105,100	1,099,346.00	0.08
186	000581	威孚高科	69,600	1,096,200.00	0.08
187	002468	申通快递	100,700	1,089,574.00	0.08
188	300866	安克创新	12,400	1,085,000.00	0.08
189	688521	芯原股份	14,800	1,064,416.00	0.08
190	601869	长飞光纤	28,600	1,058,486.00	0.08

191	603866	桃李面包	103,632	1,048,755.84	0.08
192	300558	贝达药业	21,800	1,047,054.00	0.08
193	603379	三美股份	44,400	1,043,844.00	0.08
194	002185	华天科技	109,600	1,008,320.00	0.08
195	002155	湖南黄金	80,900	986,980.00	0.08
196	300438	鹏辉能源	20,500	984,820.00	0.08
197	600167	联美控股	138,100	962,557.00	0.07
198	300363	博腾股份	32,100	949,839.00	0.07
199	600259	广晟有色	25,900	936,026.00	0.07
200	600862	中航高科	36,800	931,408.00	0.07
201	000060	中金岭南	189,650	900,837.50	0.07
202	600968	海油发展	289,200	887,844.00	0.07
203	002152	广电运通	73,000	855,560.00	0.07
204	002268	电科网安	28,900	805,443.00	0.06
205	688385	复旦微电	14,100	706,410.00	0.05
206	000031	大悦城	192,800	705,648.00	0.05
207	300482	万孚生物	26,200	697,706.00	0.05
208	002690	美亚光电	26,700	687,525.00	0.05
209	300251	光线传媒	83,000	671,470.00	0.05
210	002430	杭氧股份	17,600	604,736.00	0.05
211	000967	盈峰环境	113,400	572,670.00	0.04
212	300699	光威复材	18,300	564,555.00	0.04
213	002128	电投能源	42,700	564,494.00	0.04
214	601969	海南矿业	84,100	553,378.00	0.04
215	603826	坤彩科技	10,200	510,000.00	0.04
216	600141	兴发集团	21,600	479,952.00	0.04
217	688772	珠海冠宇	23,500	473,525.00	0.04
218	300257	开山股份	30,100	456,617.00	0.03
219	603885	吉祥航空	28,800	444,384.00	0.03
220	600623	华谊集团	69,000	429,870.00	0.03
221	603218	日月股份	21,500	408,285.00	0.03
222	000960	锡业股份	24,900	387,195.00	0.03
223	688567	孚能科技	16,200	349,758.00	0.03
224	603927	中科软	8,800	339,328.00	0.03
225	600511	国药股份	8,600	334,110.00	0.03
226	000728	国元证券	49,000	319,480.00	0.02
227	002683	广东宏大	10,700	315,008.00	0.02
228	601636	旗滨集团	36,100	311,182.00	0.02
229	300682	朗新科技	12,700	295,656.00	0.02
230	002673	西部证券	43,400	275,590.00	0.02
231	603444	吉比特	400	196,444.00	0.02
232	600160	巨化股份	14,200	195,676.00	0.01
233	600556	天下秀	26,300	186,467.00	0.01

234	002195	二三四五	57,800	167,042.00	0.01
235	688248	南网科技	4,300	165,077.00	0.01
236	605358	立昂微	4,000	146,920.00	0.01
237	600546	山煤国际	9,900	143,253.00	0.01
238	300418	昆仑万维	2,700	108,756.00	0.01
239	600765	中航重机	4,100	108,691.00	0.01
240	000988	华工科技	2,500	95,025.00	0.01
241	002901	大博医疗	3,000	93,240.00	0.01
242	603737	三棵树	1,400	91,588.00	0.01
243	002340	格林美	10,600	73,246.00	0.01
244	300776	帝尔激光	720	46,728.00	0.00
245	600153	建发股份	790	8,618.90	0.00
246	688006	杭可科技	280	8,531.60	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	601618	中国中冶	2,225,100	8,833,647.00	0.67
2	601377	兴业证券	1,438,200	8,801,784.00	0.67
3	600919	江苏银行	1,106,000	8,129,100.00	0.62
4	600256	广汇能源	1,016,100	6,970,446.00	0.53
5	600064	南京高科	973,100	6,432,191.00	0.49
6	000338	潍柴动力	506,400	6,309,744.00	0.48
7	002402	和而泰	341,100	5,791,878.00	0.44
8	600089	特变电工	253,900	5,659,431.00	0.43
9	301219	腾远钴业	137,234	5,127,062.24	0.39
10	300537	广信材料	290,500	4,746,770.00	0.36
11	002033	丽江股份	431,000	4,689,280.00	0.36
12	603878	武进不锈	544,411	4,600,272.95	0.35
13	603290	斯达半导	20,300	4,368,560.00	0.33
14	603639	海利尔	238,600	4,275,712.00	0.33
15	000928	中钢国际	417,770	4,031,480.50	0.31
16	002270	华明装备	304,000	3,328,800.00	0.25
17	603027	千禾味业	153,400	3,239,808.00	0.25
18	600438	通威股份	91,656	3,144,717.36	0.24
19	688386	泛亚微透	71,200	2,990,400.00	0.23
20	002768	国恩股份	120,944	2,925,635.36	0.22
21	300511	雪榕生物	379,300	2,882,680.00	0.22
22	688560	明冠新材	102,200	2,840,138.00	0.22
23	002027	分众传媒	378,000	2,574,180.00	0.20
24	688123	聚辰股份	47,276	2,539,666.72	0.19
25	601003	柳钢股份	553,800	2,237,352.00	0.17
26	000733	振华科技	23,200	2,223,720.00	0.17
27	002570	贝因美	518,400	2,208,384.00	0.17

28	000906	浙商中拓	246,945	2,202,749.40	0.17
29	600508	上海能源	137,873	2,023,975.64	0.15
30	002852	道道全	150,600	1,947,258.00	0.15
31	002483	润邦股份	330,100	1,914,580.00	0.15
32	601686	友发集团	279,000	1,908,360.00	0.15
33	300777	中简科技	39,700	1,876,222.00	0.14
34	002283	天润工业	289,800	1,860,516.00	0.14
35	002478	常宝股份	236,800	1,764,160.00	0.13
36	600458	时代新材	143,000	1,714,570.00	0.13
37	600478	科力远	234,100	1,671,474.00	0.13
38	603212	赛伍技术	80,200	1,668,962.00	0.13
39	002815	崇达技术	133,300	1,659,585.00	0.13
40	300696	爱乐达	67,000	1,648,200.00	0.13
41	603663	三祥新材	110,200	1,647,490.00	0.13
42	000048	京基智农	84,200	1,643,584.00	0.13
43	600966	博汇纸业	274,300	1,623,856.00	0.12
44	002885	京泉华	74,220	1,620,964.80	0.12
45	002549	凯美特气	139,600	1,605,400.00	0.12
46	002829	星网宇达	36,100	1,585,873.00	0.12
47	688425	铁建重工	328,100	1,578,161.00	0.12
48	002997	瑞鹄模具	52,000	1,545,960.00	0.12
49	688348	昱能科技	8,200	1,540,206.00	0.12
50	300121	阳谷华泰	153,000	1,461,150.00	0.11
51	603068	博通集成	50,800	1,453,896.00	0.11
52	603018	华设集团	164,500	1,439,375.00	0.11
53	000759	中百集团	314,800	1,419,748.00	0.11
54	000425	徐工机械	202,100	1,368,217.00	0.10
55	002540	亚太科技	236,700	1,368,126.00	0.10
56	000541	佛山照明	218,800	1,249,348.00	0.10
57	000157	中联重科	178,000	1,201,500.00	0.09
58	600603	广汇物流	164,000	1,141,440.00	0.09
59	001696	宗申动力	154,500	1,093,860.00	0.08
60	600273	嘉化能源	115,800	1,090,836.00	0.08
61	000688	国城矿业	71,500	1,084,655.00	0.08
62	002237	恒邦股份	98,400	1,071,576.00	0.08
63	300869	康泰医学	46,100	1,058,456.00	0.08
64	300691	联合光电	57,100	1,006,102.00	0.08
65	000058	深赛格	161,900	1,000,542.00	0.08
66	688508	芯朋微	17,200	997,428.00	0.08
67	601019	山东出版	108,200	992,194.00	0.08
68	300504	天邑股份	47,800	959,346.00	0.07
69	688707	振华新材	30,900	951,411.00	0.07
70	300763	锦浪科技	9,100	947,310.00	0.07

71	300379	东方通	46,000	946,220.00	0.07
72	300035	中科电气	78,500	943,570.00	0.07
73	002049	紫光国微	10,000	932,500.00	0.07
74	002150	通润装备	54,600	927,654.00	0.07
75	600547	山东黄金	39,400	925,112.00	0.07
76	300860	锋尚文化	16,300	903,672.00	0.07
77	600750	江中药业	40,000	877,200.00	0.07
78	600183	生益科技	61,300	870,460.00	0.07
79	600446	金证股份	59,100	859,314.00	0.07
80	688080	映翰通	17,392	850,468.80	0.06
81	688186	广大特材	25,500	829,515.00	0.06
82	600570	恒生电子	18,430	816,264.70	0.06
83	600502	安徽建工	152,300	804,144.00	0.06
84	002737	葵花药业	31,800	774,012.00	0.06
85	002651	利君股份	96,200	747,474.00	0.06
86	688063	派能科技	3,500	693,875.00	0.05
87	300613	富瀚微	11,800	669,532.00	0.05
88	300183	东软载波	39,500	652,145.00	0.05
89	002467	二六三	129,200	642,124.00	0.05
90	603757	大元泵业	21,400	638,576.00	0.05
91	003028	振邦智能	14,800	618,788.00	0.05
92	002860	星帅尔	45,400	611,992.00	0.05
93	002707	众信旅游	75,900	571,527.00	0.04
94	002949	华阳国际	39,914	567,577.08	0.04
95	002588	史丹利	92,000	559,360.00	0.04
96	600537	亿晶光电	67,800	517,992.00	0.04
97	300993	玉马遮阳	43,830	501,853.50	0.04
98	601998	中信银行	83,000	496,340.00	0.04
99	300661	圣邦股份	5,980	491,137.40	0.04
100	002129	TCL 中环	13,900	461,480.00	0.04
101	002916	深南电路	5,900	444,683.00	0.03
102	002060	粤水电	65,500	430,990.00	0.03
103	002449	国星光电	48,400	430,276.00	0.03
104	000603	盛达资源	33,700	407,433.00	0.03
105	002975	博杰股份	8,900	388,396.00	0.03
106	000301	东方盛虹	32,700	386,514.00	0.03
107	600050	中国联通	80,300	385,440.00	0.03
108	601615	明阳智能	22,300	376,424.00	0.03
109	600039	四川路桥	37,800	370,818.00	0.03
110	002020	京新药业	28,500	365,370.00	0.03
111	002941	新疆交建	22,600	349,848.00	0.03
112	600185	格力地产	50,900	349,174.00	0.03
113	688018	乐鑫科技	2,685	348,566.70	0.03

114	300871	回盛生物	21,035	346,656.80	0.03
115	000045	深纺织 A	31,000	341,000.00	0.03
116	002438	江苏神通	29,600	339,808.00	0.03
117	600817	宇通重工	30,000	335,700.00	0.03
118	600212	绿能慧充	33,000	309,540.00	0.02
119	002655	共达电声	23,500	305,265.00	0.02
120	688148	芳源股份	25,015	305,183.00	0.02
121	300835	龙磁科技	9,600	301,248.00	0.02
122	300223	北京君正	3,200	282,592.00	0.02
123	688733	壹石通	9,000	278,640.00	0.02
124	601601	中国太保	10,700	277,986.00	0.02
125	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
126	601888	中国中免	2,400	265,272.00	0.02
127	000951	中国重汽	15,500	261,175.00	0.02
128	300151	昌红科技	13,900	251,590.00	0.02
129	688561	奇安信	4,400	227,964.00	0.02
130	688206	概伦电子	8,100	227,124.00	0.02
131	002933	新兴装备	7,700	226,149.00	0.02
132	605268	王力安防	22,000	225,060.00	0.02
133	002636	金安国纪	23,500	216,905.00	0.02
134	603708	家家悦	17,200	215,688.00	0.02
135	688221	前沿生物	20,100	214,266.00	0.02
136	600590	泰豪科技	29,300	208,909.00	0.02
137	688435	英方软件	2,728	199,225.84	0.02
138	688680	海优新材	1,600	194,912.00	0.01
139	688180	君实生物	4,900	188,846.00	0.01
140	605377	华旺科技	10,400	187,720.00	0.01
141	603612	索通发展	10,800	187,164.00	0.01
142	002943	宇晶股份	5,600	178,640.00	0.01
143	688578	艾力斯	6,200	167,090.00	0.01
144	002441	众业达	13,900	158,460.00	0.01
145	300352	北信源	26,900	135,576.00	0.01
146	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.01
147	002544	普天科技	5,500	125,950.00	0.01
148	603378	亚士创能	13,600	123,896.00	0.01
149	301327	华宝新能	1,540	121,829.40	0.01
150	688008	澜起科技	2,100	120,582.00	0.01
151	688630	芯碁微装	1,400	117,628.00	0.01
152	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
153	002212	天融信	11,800	114,460.00	0.01
154	688120	华海清科	447	112,666.35	0.01
155	603239	浙江仙通	6,800	110,636.00	0.01
156	688472	阿特斯	5,767	98,269.68	0.01

157	002371	北方华创	300	95,295.00	0.01
158	688596	正帆科技	2,200	95,260.00	0.01
159	300567	精测电子	1,000	95,150.00	0.01
160	688012	中微公司	600	93,870.00	0.01
161	300260	新莱应材	2,340	92,476.80	0.01
162	002158	汉钟精机	3,700	92,352.00	0.01
163	600641	万业企业	4,800	91,632.00	0.01
164	603690	至纯科技	2,620	91,280.80	0.01
165	300820	英杰电气	1,100	90,618.00	0.01
166	300666	江丰电子	1,300	88,348.00	0.01
167	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.01
168	688443	智翔金泰	2,869	84,606.81	0.01
169	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
170	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
171	688037	芯源微	444	75,901.80	0.01
172	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.01
173	000881	中广核技	9,000	74,070.00	0.01
174	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
175	603919	金徽酒	2,400	56,352.00	0.00
176	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
177	300951	博硕科技	900	49,167.00	0.00
178	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
179	300648	星云股份	1,400	45,052.00	0.00
180	002695	煌上煌	4,000	42,760.00	0.00
181	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
182	000524	岭南控股	3,600	38,556.00	0.00
183	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
184	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
185	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
186	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
187	688556	高测股份	556	29,545.84	0.00
188	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
189	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
190	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
191	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
192	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
193	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
194	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
195	000969	安泰科技	2,300	21,781.00	0.00
196	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
197	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
198	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
199	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00

200	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
201	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
202	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
203	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
204	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
205	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
206	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
207	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
208	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
209	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
210	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
211	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
212	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
213	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
214	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
215	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
216	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
217	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
218	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
219	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
220	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
221	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
222	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
223	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
224	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
225	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
226	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
227	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
228	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
229	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
230	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
231	688439	振华风光	65	7,138.30	0.00
232	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
233	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
234	688711	宏微科技	110	6,417.40	0.00
235	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
236	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
237	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
238	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
239	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
240	001367	海森药业	55	2,171.40	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	300017	网宿科技	69,177,572.89	4.07
2	600985	淮北矿业	59,479,447.38	3.50
3	600258	首旅酒店	55,072,911.73	3.24
4	600535	天士力	54,006,043.20	3.17
5	000513	丽珠集团	51,294,154.53	3.01
6	600298	安琪酵母	48,564,535.04	2.85
7	002353	杰瑞股份	46,125,936.92	2.71
8	601168	西部矿业	45,605,909.00	2.68
9	002249	大洋电机	44,624,571.77	2.62
10	002506	协鑫集成	44,530,609.00	2.62
11	000932	华菱钢铁	43,796,517.00	2.57
12	600566	济川药业	43,664,563.88	2.57
13	600064	南京高科	42,817,085.20	2.52
14	601000	唐山港	41,678,763.00	2.45
15	603290	斯达半导	41,026,718.47	2.41
16	600863	内蒙华电	40,792,343.00	2.40
17	002056	横店东磁	39,567,727.00	2.33
18	600563	法拉电子	38,947,034.44	2.29
19	600808	马钢股份	38,894,636.00	2.29
20	600352	浙江龙盛	37,878,953.25	2.23
21	600820	隧道股份	37,538,317.30	2.21
22	000060	中金岭南	37,183,083.00	2.19
23	002416	爱施德	35,502,683.84	2.09
24	002080	中材科技	35,468,044.00	2.08
25	600968	海油发展	35,150,015.00	2.07
26	002625	光启技术	34,969,202.65	2.05
27	601958	金钼股份	34,922,744.00	2.05
28	600153	建发股份	34,461,738.08	2.03
29	002048	宁波华翔	34,448,978.95	2.02
30	000591	太阳能	34,424,527.00	2.02

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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	300017	网宿科技	76,314,747.92	4.48
2	000513	丽珠集团	62,618,666.09	3.68
3	600298	安琪酵母	60,981,705.28	3.58
4	600563	法拉电子	53,835,636.80	3.16

5	600535	天士力	53,779,875.54	3.16
6	600064	南京高科	53,026,694.60	3.12
7	601555	东吴证券	48,641,407.01	2.86
8	002506	协鑫集成	47,610,571.48	2.80
9	600153	建发股份	47,545,877.96	2.79
10	002353	杰瑞股份	46,446,848.53	2.73
11	002048	宁波华翔	46,096,186.87	2.71
12	600863	内蒙华电	45,787,182.17	2.69
13	601128	常熟银行	44,883,803.00	2.64
14	601108	财通证券	43,667,915.93	2.57
15	601991	大唐发电	43,498,083.00	2.56
16	600567	山鹰国际	43,432,631.75	2.55
17	603688	石英股份	43,334,054.30	2.55
18	002409	雅克科技	42,861,793.32	2.52
19	600985	淮北矿业	42,844,413.88	2.52
20	600967	内蒙一机	42,629,411.00	2.51
21	600549	厦门钨业	42,186,360.80	2.48
22	688289	圣湘生物	42,078,895.15	2.47
23	601168	西部矿业	41,390,948.38	2.43
24	000932	华菱钢铁	40,795,498.00	2.40
25	600258	首旅酒店	40,702,010.37	2.39
26	002738	中矿资源	40,622,374.31	2.39
27	600380	健康元	40,538,392.66	2.38
28	603026	胜华新材	39,365,529.06	2.31
29	600998	九州通	38,572,629.00	2.27
30	600160	巨化股份	38,555,310.80	2.27
31	600808	马钢股份	38,436,674.00	2.26
32	000729	燕京啤酒	38,337,750.14	2.25
33	600901	江苏金租	37,766,201.50	2.22
34	002192	融捷股份	37,420,422.00	2.20
35	002497	雅化集团	36,790,722.00	2.16
36	600566	济川药业	36,511,663.00	2.15
37	300308	中际旭创	36,207,903.21	2.13
38	300390	天华新能	35,889,972.00	2.11
39	600820	隧道股份	35,741,917.18	2.10
40	300009	安科生物	35,519,605.80	2.09
41	000060	中金岭南	34,893,570.00	2.05
42	600352	浙江龙盛	34,890,920.56	2.05
43	600699	均胜电子	34,759,024.99	2.04
44	603290	斯达半导	34,637,520.10	2.04
45	600598	北大荒	34,594,757.22	2.03
46	600728	佳都科技	34,326,084.16	2.02
47	600968	海油发展	34,221,081.00	2.01

48	002416	爱施德	34,116,543.60	2.00
----	--------	-----	---------------	------

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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	5,570,112,617.15
卖出股票收入（成交）总额	5,952,133,093.59

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

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）	215,817.97	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	215,817.97	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127086	恒邦转债	2,158	215,817.97	0.02

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成

本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

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

江苏鱼跃医疗设备股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到镇江市市场监督管理局的处罚。

江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	1,873,148.27
2	应收清算款	288,172.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	621,284.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,782,605.25

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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的情况。

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的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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

份额级别	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 (%)
景顺长城中证 500 指数增强 A	70,284	13,694.88	509,313,712.30	52.91	453,217,478.46	47.09
景顺长城中证 500 指数增强 C	209	8,711.62	367,098.09	20.16	1,453,630.69	79.84
合计	70,493	13,680.11	509,680,810.39	52.85	454,671,109.15	47.15

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	景顺长城中证 500 指数增强 A	17,337.65	0.001801
	景顺长城中证 500 指数增强 C	92.77	0.005095
	合计	17,430.42	0.001807

8.3 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

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2019 年 3 月 25 日）基金份额总额	1,508,879,568.71	-
本报告期期初基金份额总额	1,239,748,206.90	123,665.28
本报告期基金总申购份额	56,396,197.07	4,061,200.42
减：本报告期基金总赎回份额	333,613,213.21	2,364,136.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	962,531,190.76	1,820,728.78

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，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

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内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，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券股份有限公司	1	2,127,164,697.78	18.48	1,981,054.90	18.49	-
国盛证券有限责任公司	1	1,289,286,396.25	11.20	1,200,714.16	11.20	-
德邦证券股份有限公司	1	1,086,107,279.14	9.44	1,011,485.54	9.44	本期报告新增 1 个
浙商证券股份有限公司	1	962,065,982.60	8.36	895,983.31	8.36	-
东方证券股份有限公司	2	892,826,718.56	7.76	831,492.37	7.76	-
广发证券股份有限公司	2	817,777,405.50	7.11	761,603.18	7.11	-
海通证券股份有限公司	2	787,579,511.05	6.84	733,476.19	6.84	-
中泰证券股份有限公司	1	709,465,103.14	6.17	660,727.84	6.17	-
华西证券股份有限公司	1	670,990,260.34	5.83	624,894.87	5.83	-
长城证券股份有限公司	3	602,092,893.06	5.23	560,729.96	5.23	-
中信建投证券股份有限公司	2	519,386,460.68	4.51	483,710.48	4.51	-
华宝证券股份有限公司	2	415,453,489.58	3.61	386,905.42	3.61	本期报告新增 2 个
信达证券股份	1	321,342,274.25	2.79	299,266.69	2.79	-

有限公司						
招商证券股份 有限公司	2	306,071,912.62	2.66	285,043.29	2.66	-
东吴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
华泰证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1,721,698.21	76.26	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	535,936.31	23.74	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日

2	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
3	关于景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金新增瑞银基金销售为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 6 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 25 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
8	关于景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金新增华龙证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
9	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
10	关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司银银平台“机构投资交易平台”为销售平台并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国元证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 8 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 18 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
15	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 22 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 6 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2023 年 5 月 13 日

	停机维护的公告	网站	
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 27 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 10 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 14 日
22	关于旗下部分基金新增杭州银行股份有限公司杭 e 家平台为销售平台并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 16 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 17 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 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	20230101-20230630	360,894,987.15	0.00	6,572,274.09	354,322,713.06	36.74

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;
(5) 基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;
(6) 大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止和化解上述风险,最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前,请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》;
- 3、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》;
- 4、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》;
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日