

长城中证医药卫生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：长城基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 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	7
§ 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	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46

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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金	
基金简称	长城中证医药卫生指数增强	
基金主代码	014205	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 6 月 1 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	55,584,966.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	长城中证医药卫生指数增强 A	长城中证医药卫生指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	014205	014206
报告期末下属分级 基金的份额总额	15,450,839.58 份	40,134,126.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	以增强指数化投资方法跟踪标的指数，在严格控制与标的指数偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。
投资策略	1、资产配置策略本基金为增强型指数基金，以跟踪标的指数为主，在一般情况下保持相对稳定的股票投资比例，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，在有效控制基金跟踪误差的前提下，对基金资产进行合理配置。2、股票投资策略本基金基于基金管理人量化投资研究平台的研究成果，采用量化多因子股票模型进行投资。多因子模型基于 A 股上市公司的历史数据，借助数量化的技术手段，寻找对股票收益有预测性的指标作为因子，通过回溯研究各个因子的历史表现，寻找收益稳定、互补性强的因子对股票进行综合评分，根据评分结果精选各个行业的优质股票构成组合。多因子模型的因子来源主要包括基本面因子、市场交易型因子、预期性因子等。3、债券投资策略本基金将根据“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，重点参考基金的流动性管理需要，运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、骑乘策略等多种积极管理策略，选取收益稳定、流动性较好的债券进行配置。4、可转换债券和可交换债券投资策略本基金将对可转换债券、可交换债券对应的基础股票进行深入分析与研究，重点选择有较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转换债券、可交换债券，并在对应可转换债券、可交换债券估值合理的前

	<p>提下进行投资。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面推测、并通过实地调研等方式确认上市公司对转股价的修正和转股意愿。5、股指期货、国债期货、股票期权投资策略本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的参与股指期货、国债期货、股票期权的投资。6、资产支持证券投资策略本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用定价模型，评估其内在价值。7、融资业务策略在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，以提高投资效率及进行风险管理。利用融资买入证券作为组合流动性管理工具，提高基金的资金使用效率，以融入资金满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。8、转融通证券出借业务策略为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务</p>
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担因港股市场投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	长城基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君
	联系电话	0755-29279005
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn
客户服务电话	400-8868-666	95559
传真	0755-29279000	021-62701216
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	518046	200336
法定代表人	王军	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 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)	
	长城中证医药卫生指数增强 A	长城中证医药卫生指数增强 C
本期已实现收益	826, 159. 67	922, 772. 47
本期利润	-281, 505. 59	262, 697. 13
加权平均基金份额本期利润	-0. 0152	0. 0118
本期加权平均净值利润率	-1. 51%	1. 17%
本期基金份额净值增长率	-6. 40%	-6. 55%
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	-1, 188, 902. 75	-3, 206, 655. 77
期末可供分配基金份额利润	-0. 0769	-0. 0799
期末基金资产净值	14, 261, 936. 83	36, 927, 471. 15
期末基金份额净值	0. 9231	0. 9201
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	-7. 69%	-7. 99%

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上述基金业绩指标不包括持有人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“期末可供分配利润”的计算方法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。

3.2 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

长城中证医药卫生指数增强 A

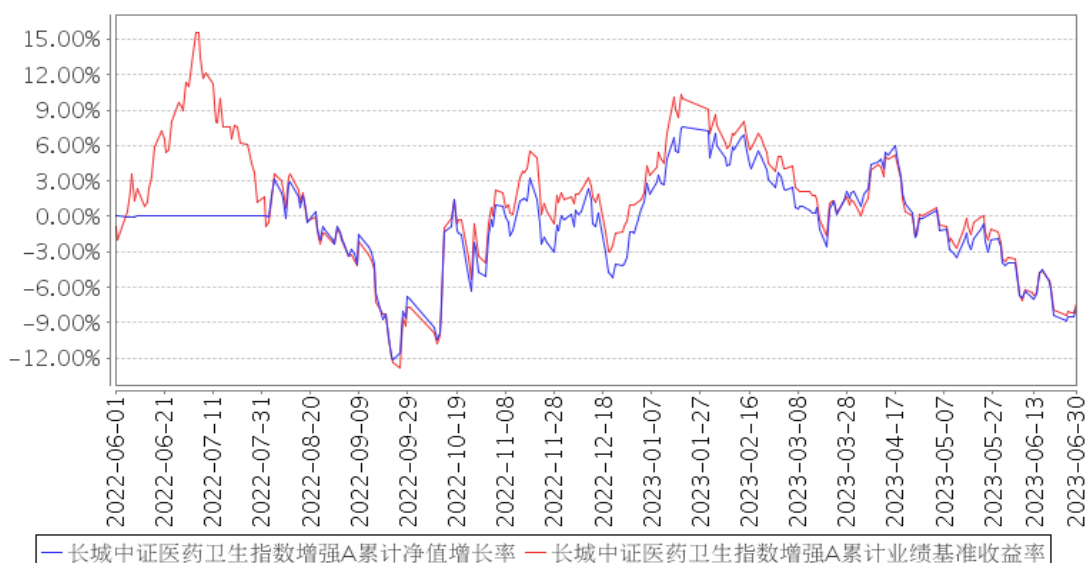
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.95%	0.93%	-3.82%	0.92%	-0.13%	0.01%
过去三个月	-9.62%	0.99%	-8.39%	0.98%	-1.23%	0.01%
过去六个月	-6.40%	1.03%	-8.16%	1.02%	1.76%	0.01%
过去一年	-7.72%	1.29%	-16.79%	1.37%	9.07%	-0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-7.69%	1.24%	-7.31%	1.38%	-0.38%	-0.14%

长城中证医药卫生指数增强 C

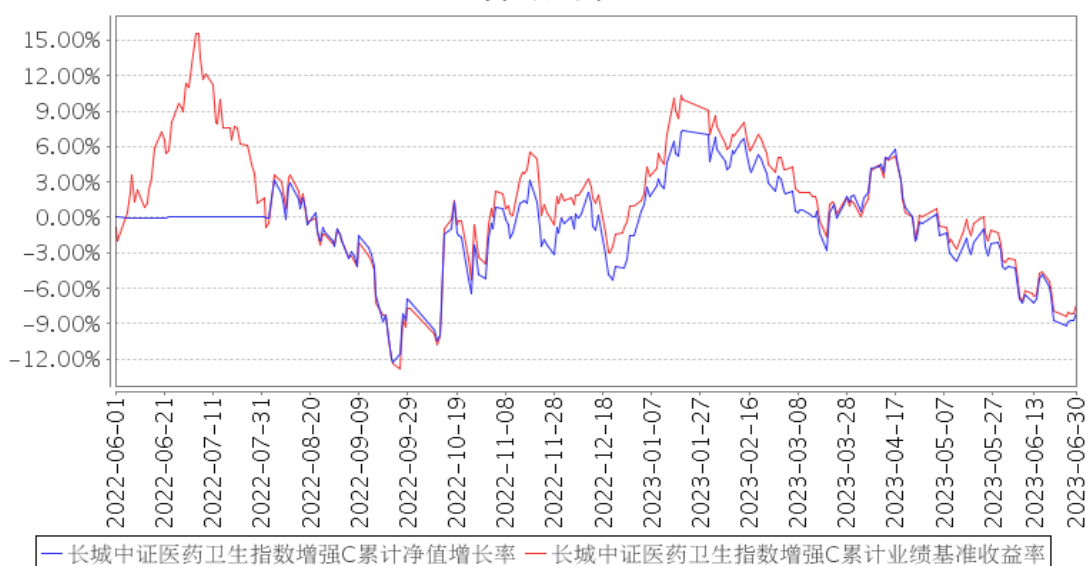
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.99%	0.93%	-3.82%	0.92%	-0.17%	0.01%
过去三个月	-9.69%	0.99%	-8.39%	0.98%	-1.30%	0.01%
过去六个月	-6.55%	1.03%	-8.16%	1.02%	1.61%	0.01%
过去一年	-8.00%	1.29%	-16.79%	1.37%	8.79%	-0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-7.99%	1.24%	-7.31%	1.38%	-0.68%	-0.14%

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

长城中证医药卫生指数增强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



长城中证医药卫生指数增强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：①基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司管理的基金有：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城悦享增利债券型证券投资基金、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证券投资基金、长城短债债券型证券投资基金、长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城

嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城量化小盘股票型证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、长城价值优选混合型证券投资基金、长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城恒泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金、长城中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城均衡优选混合型证券投资基金、长城品质成长混合型证券投资基金、长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金、长城稳利纯债债券型证券投资基金、长城价值成长六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选稳进六个月持有期混合型证券投资基金、长城消费 30 股票型证券投资基金、长城中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、长城医药科技六个月持有期混合型证券投资基金、长城悦享回报债券型证券投资基金、长城竞争优势六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添利一年持有期混合型证券投资基金、长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金、长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金、长城健康消费混合型证券投资基金、长城恒利纯债债券型证券投资基金、长城大健康混合型证券投资基金、长城价值领航混合型证券投资基金、长城信利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城新能源股票型发起式证券投资基金、长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金、长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金、长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金、长城瑞利纯债债券型证券投资基金、长城产业成长混合型证券投资基金、长城鑫享 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、长城产业趋势混合型证券投资基金、长城远见成长混合型证券投资基金、长城聚利纯债债券型证券投资基金、长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长城永利债券型证券投资基金、长城数字经济混合型证券投资基金、长城鑫利 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、长城产业臻选混合型证券投资基金、长城鼎利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）、长城创新成长混合型证券投资基金。

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		
雷俊	公司总经理助理、量化与指数投资部	2022 年 6 月 1 日	-	15 年	男，中国籍，硕士。2008 年 7 月-2017 年 11 月曾就职于南方基金管理有限公司，历任研究员、基金经理。2017 年 11 月加入长城基金管理有限公司，现任公司总经理

	总经理、 本基金的 基金经 理、兼任 投资经理				助理、量化与指数投资部总经理、基金经理兼投资经理。自 2019 年 5 月至 2021 年 10 月任“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2018 年 11 月至今任“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”、“长城久泰沪深 300 指数证券投资基金”基金经理，自 2019 年 1 月至今任“长城创业板指数增强型发起式证券投资基金”基金经理，自 2019 年 5 月至今任“长城量化精选股票型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 1 月至今任“长城量化小盘股票型证券投资基金”、“长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 4 月至今任“长城基金-量化 1 号单一资产管理计划”投资经理，自 2022 年 6 月至今任“长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金”基金经理。
--	-------------------------------------	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从从业人员的相关规定。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
雷俊	公募基金	7	3,488,796,006.93	2014 年 12 月 23 日
	私募资产管理计划	1	191,503,516.90	2021 年 4 月 7 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	3,680,299,523.83	-

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了《证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在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，本基金管理人严格执行了相关法律法规和公司制度的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，

并对基金经理兼任投资经理的组合执行更长周期的交易价差分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金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% 的现象。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年市场先扬后抑，多数大型宽基指数表现不佳，中证 500、中证 1000 为代表的中小指数略有正收益。市场行业主题投资波动很大，以人工智能为代表的 TMT 产业链较受市场关注，基础算力、光模块、软件传媒等相关个股波动率过高；资金面看，外资一季度后无明显增量净流入，内资存量博弈性较强，市场总体赚钱效应不佳；消费板块受经济复苏动能较弱影响，普遍表现不佳；医药行业内部分化较大，中药相关的表现较好，CXO 医疗服务等受经济复苏和全球外包影响表现不佳。

报告期内，组合以量化策略为主，基于长城基金量化投资研究平台的研究成果，上半年对于中小市值股票加大了价量因子的研究权重，通过深度学习等神经网络方法广泛挖掘市场有效因子，并充分利用人工智能等算法进行多因子组合，寻找对股票收益有预测性的指标作为因子；组合主体以成分股内投资为主，行业、风格上基本相对业绩基准偏离较小，根据基准指数的特点严格控制行业偏离以及个股偏离，并在综合考虑预期风险和收益水平基础上进行组合权重优化，力争有效跟踪基准指数的同时获取超额收益；总体上看，风格上利用了上半年低估值、低波动、小市值因子超额收益更好的优势，获得了稳健的超额收益回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城中证医药卫生指数增强 A 的基金份额净值为 0.9231 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.40%，同期业绩比较基准收益率为-8.16%；截至本报告期末长城中证医药卫生指数增强 C 的基金份额净值为 0.9201 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.55%，同期业绩比较基准收益率为-8.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A 股总体估值仍然处在过去十年中枢以下位置，下行风险预计较小，从大类资产比较的角度，权益市场已经进入价值区间；宏观上看，经济复苏偏弱带来的问题已经充分反映在股价上，进一步的利空事件较为有限，当前的政策环境积极正面，随着下半年一系列企业、民生政策落地，经

济有望进一步好转。

医药自 2021 年以来的筑底行情持续时间和空间较为充分,但行业的总体投资机会仍然较依赖于经济复苏的节奏,投资机会上预期仍然还是以中小市值股票的广度策略为主,深度学习与人工智能等新的算法对于中小市值选股因子仍有较大的潜力空间,有利于在均衡行业配置的基础上在抓住阶段性的价差投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术,导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的,则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人成立了受托资产估值委员会,为基金估值业务的最高决策机构,由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成,公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验,具有良好的专业能力,并能在相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员,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,向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议,但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议,由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金自 2023 年 01 月 31 日起至 2023 年 04 月 06 日止连续 47 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元,自 2023 年 04 月 14 日起至 2023 年 06 月 27 日止连续 48 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。

§ 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，基金托管人在长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，长城基金管理有限公司在长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由长城基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城中证医药卫生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	1,962,760.62	2,766,654.03
结算备付金		22.52	82.16
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	49,394,870.19	62,483,556.35
其中：股票投资		48,478,689.18	61,577,115.80
基金投资		-	-
债券投资		916,181.01	906,440.55
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,568.14	13,801.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		51,365,221.47	65,264,094.05
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		-	-
应付赎回款		2,453.95	77,799.71
应付管理人报酬		27,198.50	56,217.73
应付托管费		5,439.69	11,243.55
应付销售服务费		4,581.57	9,967.82
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	136,139.78	78,000.11
负债合计		175,813.49	233,228.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	55,584,966.50	66,005,018.49
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-4,395,558.52	-974,153.36
净资产合计		51,189,407.98	65,030,865.13
负债和净资产总计		51,365,221.47	65,264,094.05

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 55,584,966.50 份，其中长城中证医药卫生指数增强 A 基金份额总额 15,450,839.58 份，基金份额净值 0.9231 元；长城中证医药卫生指数增强 C 基金份额总额 40,134,126.92 份，基金份额净值 0.9201 元。

6.2 利润表

会计主体：长城中证医药卫生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 6 月 1 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		319,343.73	385,507.25
1. 利息收入		3,239.02	385,507.25
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,239.02	183,867.98
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		-	201,639.27
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,008,801.53	-
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,633,987.73	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	8,390.46	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	366,423.34	-
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	-1,767,740.60	-
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	75,043.78	-
减：二、营业总支出		338,152.19	358,032.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	204,868.53	240,300.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	40,973.73	48,060.19
3. 销售服务费		33,496.37	60,511.78
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	58,813.56	9,159.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-18,808.46	27,474.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-18,808.46	27,474.64
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-18,808.46	27,474.64

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长城中证医药卫生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)	66,005,018.49	-	-974,153.36	65,030,865.13
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基金净值)	66,005,018.49	-	-974,153.36	65,030,865.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-10,420,051.99	-	-3,421,405.16	-13,841,457.15
(一)、综合收益总额	-	-	-18,808.46	-18,808.46
(二)、本期基	-10,420,051.99	-	-3,402,596.70	-13,822,648.69

金份额 交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	40,195,679.51	-	-1,525,183.22	38,670,496.29
2 .基金赎回款	-50,615,731.50	-	-1,877,413.48	-52,493,144.98
(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、本期末净资产(基金净值)	55,584,966.50	-	-4,395,558.52	51,189,407.98
项目	上年度可比期间 2022年6月1日(基金合同生效日)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)	-	-	-	-
加:会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	302,464,240.09	-	-	302,464,240.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	27,474.64	27,474.64
(一)、综合收益总额	-	-	27,474.64	27,474.64
(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)	-	-	-	-
其中:1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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、本期末净资产(基金净值)	302,464,240.09	-	27,474.64	302,491,714.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王军</u>	<u>邱春杨</u>	<u>赵永强</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2021]3446号《关于准予长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金注册的批复》核准,由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《长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 302,415,425.77 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2022)验字第 60737541-H04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 6 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 302,464,240.09 份基金份额,其中认购资金利息折合 48,814.32 份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(“交通银行”)。

根据《长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将

分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持债券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权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相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%；其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产(基金净值)变动情况等有关信息。

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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	1,962,760.62
等于：本金	1,962,657.82
加：应计利息	102.80
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,962,760.62

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	50,863,202.29	-	48,478,689.18	-2,384,513.11
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	16,271.01	916,181.01	-837.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	16,271.01	916,181.01	-837.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	51,763,949.29	16,271.01	49,394,870.19	-2,385,350.11

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

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：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

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

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

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：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

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.11
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	17,356.09
预提信息披露费	39,671.58
其他应付款	79,112.00
合计	136,139.78

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城中证医药卫生指数增强 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	27,037,855.42	27,037,855.42
本期申购	1,631,486.69	1,631,486.69

本期赎回（以“-”号填列）	-13,218,502.53	-13,218,502.53
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	15,450,839.58	15,450,839.58

长城中证医药卫生指数增强 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	38,967,163.07	38,967,163.07
本期申购	38,564,192.82	38,564,192.82
本期赎回（以“-”号填列）	-37,397,228.97	-37,397,228.97
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	40,134,126.92	40,134,126.92

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城中证医药卫生指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,625.11	-381,025.57	-372,400.46
本期利润	826,159.67	-1,107,665.26	-281,505.59
本期基金份额交易产生的变动数	-314,148.76	-220,847.94	-534,996.70
其中：基金申购款	56,531.77	5,261.97	61,793.74
基金赎回款	-370,680.53	-226,109.91	-596,790.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	520,636.02	-1,709,538.77	-1,188,902.75

长城中证医药卫生指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-52,948.24	-548,804.66	-601,752.90
本期利润	922,772.47	-660,075.34	262,697.13
本期基金份额交易产生的变动数	352,232.98	-3,219,832.98	-2,867,600.00
其中：基金申购款	1,224,543.90	-2,811,520.86	-1,586,976.96
基金赎回款	-872,310.92	-408,312.12	-1,280,623.04

本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,222,057.21	-4,428,712.98	-3,206,655.77

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		
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			-0.01
其他			-
合计			3,239.02

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		
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			1,633,987.73

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		
减：卖出股票成本总额			100,718,293.94
减：交易费用			275,517.54
买卖股票差价收入			1,633,987.73

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：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		
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券			-

到期兑付) 差价收入	
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	8,390.46

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

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

注：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

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：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

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：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

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	366,423.34
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	366,423.34

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	-1,767,740.60
股票投资	-1,769,090.60
债券投资	1,350.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,767,740.60

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	75,043.78
合计	75,043.78

6.4.7.22 信用减值损失

注：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	17,356.09

信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	1,785.89
合计	58,813.56

6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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

本基金本报告期无与对本基金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
长城基金管理有限公司（“长城基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	204,868.53	240,300.95
其中：支付销售机构的客户维护费	79,235.82	5,124.66

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	40,973.73	48,060.19

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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	本期
--------------	----

名称	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		
	长城中证医药卫生指数 增强 A	长城中证医药卫生指数 增强 C	合计
长城基金管理有限公司	-	16.72	16.72
长城证券	-	787.55	787.55
交通银行	-	1,967.84	1,967.84
合计	-	2,772.11	2,772.11
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 6 月 1 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城中证医药卫生指数 增强 A	长城中证医药卫生指数 增强 C	合计
长城基金管理有限公司	-	4.08	4.08
长城证券	-	3,421.23	3,421.23
交通银行	-	812.39	812.39
合计	-	4,237.70	4,237.70

注：基金销售服务费每日计提，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年费率为 0.30%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间未运用固有资金投资于本基金份额，于本期末及上年度可比期末亦未持有本基金份额。

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

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于本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6月1日（基金合同生效日）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
交通银行	699,563.07	1,209.67	78,845.82	15,063.73

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

本基金于资产负债表日后、本财务报表批准报出日之前的利润分配情况，请参阅本财务报表

6.4.8.2 资产负债表日后事项。

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

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止，本基金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为人民币 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止,本基金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为人民币 0.00 元,无质押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中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。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的,由风险控制委员会,投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部,以及相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券市值的 10%。

本公司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基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行,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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

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基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内

部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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	1,962,760.62	-	-	-	-	-	1,962,760.62
结算备付金	22.52	-	-	-	-	-	22.52
交易性金融资产	916,181.01	-	-	-	-	48,478,689.18	49,394,870.19
应收申购款	-	-	-	-	-	7,568.14	7,568.14
资产总计	2,878,964.15	-	-	-	-	48,486,257.32	51,365,221.47

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,453.95	2,453.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	27,198.50	27,198.50
应付托管费	-	-	-	-	-	5,439.69	5,439.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,581.57	4,581.57
其他负债	-	-	-	-	-	136,139.78	136,139.78
负债总计	-	-	-	-	-	175,813.49	175,813.49
利率敏感度缺口	2,878,964.15	-	-	-	-	-	-
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	2,766,654.03	-	-	-	-	-	2,766,654.03
结算备付金	82.16	-	-	-	-	-	82.16
交易性金融资产	-	-906,440.55	-	-	-	-61,577,115.80	62,483,556.35
应收申购款	-	-	-	-	-	13,801.51	13,801.51
资产总计	2,766,736.19	-906,440.55	-	-	-	-61,590,917.31	65,264,094.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	77,799.71	77,799.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	56,217.73	56,217.73
应付托管费	-	-	-	-	-	11,243.55	11,243.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,967.82	9,967.82
其他负债	-	-	-	-	-	78,000.11	78,000.11
负债总计	-	-	-	-	-	233,228.92	233,228.92
利率敏感度缺口	2,766,736.19	-906,440.55	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时		
	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）
分析	市场利率上升 25 个基点	-106.49	-1,219.56
	市场利率下降 25 个基点	106.52	1,222.85

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

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，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%；其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金于本期末及上年度末面临的整体其他价格风险列示如下：

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	48,478,689.18	94.70	61,577,115.80	94.69
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	916,181.01	1.79	906,440.55	1.39
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	49,394,870.19	96.49	62,483,556.35	96.08

注：“交易性金融资产—债券投资”含资产支持证券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时		
	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）
分析	沪深 300 指数上升 5%	1,742,566.48	2,655,205.23
	沪深 300 指数下降 5%	-1,742,566.48	-2,655,205.23

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

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	48,478,689.18	61,577,115.80
第二层次	916,181.01	906,440.55
第三层次	-	-
合计	49,394,870.19	62,483,556.35

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

无。

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

注：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	48,478,689.18	94.38
	其中：股票	48,478,689.18	94.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	916,181.01	1.78
	其中：债券	916,181.01	1.78
	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	1,962,783.14	3.82
8	其他各项资产	7,568.14	0.01
9	合计	51,365,221.47	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	31,571,126.04	61.68
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	2,344,823.31	4.58
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	-	-
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	5,681,018.00	11.10
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	3,489,750.55	6.82
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	43,086,717.90	84.17

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,039,800.53	9.85
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	212,776.00	0.42
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	-	-
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	139,394.75	0.27

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	5,391,971.28	10.53

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：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	603259	药明康德	63,000	3,925,530.00	7.67
2	600276	恒瑞医药	64,000	3,065,600.00	5.99
3	300760	迈瑞医疗	10,017	3,003,096.60	5.87
4	002422	科伦药业	98,600	2,926,448.00	5.72
5	600566	济川药业	89,900	2,610,696.00	5.10
6	300896	爱美客	5,800	2,580,710.00	5.04
7	000538	云南白药	47,482	2,491,855.36	4.87
8	300529	健帆生物	96,400	2,234,552.00	4.37
9	300015	爱尔眼科	108,401	2,010,838.55	3.93
10	300601	康泰生物	74,500	1,891,555.00	3.70
11	300347	泰格医药	27,200	1,755,488.00	3.43
12	300595	欧普康视	50,600	1,527,614.00	2.98
13	002294	信立泰	44,800	1,397,312.00	2.73
14	300122	智飞生物	31,100	1,374,620.00	2.69
15	603882	金域医学	14,200	1,072,100.00	2.09
16	600867	通化东宝	97,200	1,014,768.00	1.98
17	000963	华东医药	23,163	1,004,579.31	1.96
18	600332	白云山	29,500	940,460.00	1.84
19	600511	国药股份	21,000	815,850.00	1.59
20	688185	康希诺	9,982	813,533.00	1.59
21	688289	圣湘生物	41,027	690,894.68	1.35
22	600436	片仔癀	2,400	687,264.00	1.34
23	600329	达仁堂	12,600	565,614.00	1.10
24	603658	安图生物	10,900	563,857.00	1.10
25	601607	上海医药	23,400	524,394.00	1.02

26	300003	乐普医疗	21,400	483,854.00	0.95
27	600763	通策医疗	4,200	406,812.00	0.79
28	002821	凯莱英	3,340	393,652.40	0.77
29	000661	长春高新	1,600	218,080.00	0.43
30	600079	人福医药	3,500	94,290.00	0.18
31	300009	安科生物	80	800.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688366	昊海生科	3,285	276,662.70	0.54
2	688389	普门科技	10,716	251,718.84	0.49
3	300636	同和药业	20,200	247,652.00	0.48
4	002793	罗欣药业	44,900	242,011.00	0.47
5	002020	京新药业	18,700	239,734.00	0.47
6	688363	华熙生物	2,647	236,006.52	0.46
7	688670	金迪克	4,900	230,692.00	0.45
8	600479	千金药业	20,100	226,728.00	0.44
9	603896	寿仙谷	5,000	221,500.00	0.43
10	688278	特宝生物	4,124	181,084.84	0.35
11	002826	易明医药	14,100	155,241.00	0.30
12	688799	华纳药厂	3,800	154,356.00	0.30
13	002898	赛隆药业	13,600	153,952.00	0.30
14	605177	东亚药业	6,200	152,768.00	0.30
15	300206	理邦仪器	10,100	152,308.00	0.30
16	600272	开开实业	16,800	151,704.00	0.30
17	688026	洁特生物	8,300	151,641.00	0.30
18	605369	拱东医疗	2,700	151,308.00	0.30
19	000919	金陵药业	19,200	150,144.00	0.29
20	000534	万泽股份	8,800	147,576.00	0.29
21	603087	甘李药业	3,800	146,300.00	0.29
22	600420	国药现代	12,900	145,641.00	0.28
23	300294	博雅生物	4,000	145,120.00	0.28
24	688677	海泰新光	2,535	143,835.90	0.28
25	300439	美康生物	12,700	143,637.00	0.28
26	688277	天智航	7,725	142,449.00	0.28
27	300326	凯利泰	21,900	142,350.00	0.28
28	688607	康众医疗	7,400	141,488.00	0.28
29	688131	皓元医药	2,400	136,752.00	0.27
30	002424	贵州百灵	11,500	103,270.00	0.20
31	301015	百洋医药	2,200	61,072.00	0.12
32	002166	莱茵生物	4,300	36,550.00	0.07
33	002675	东诚药业	1,300	19,123.00	0.04
34	688161	威高骨科	99	4,287.69	0.01

35	688202	美迪西	31	2,642.75	0.01
36	688180	君实生物	64	2,466.56	0.00
37	688468	科美诊断	16	152.00	0.00
38	300016	北陆药业	7	46.48	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	300896	爱美客	4,990,264.00	7.67
2	300015	爱尔眼科	4,723,573.00	7.26
3	688185	康希诺	3,787,599.97	5.82
4	300601	康泰生物	3,635,152.00	5.59
5	300529	健帆生物	3,539,006.00	5.44
6	603259	药明康德	3,286,512.00	5.05
7	600566	济川药业	3,036,333.00	4.67
8	603882	金域医学	2,969,753.00	4.57
9	002821	凯莱英	2,616,921.00	4.02
10	000538	云南白药	2,580,806.24	3.97
11	688363	华熙生物	2,414,001.79	3.71
12	000661	长春高新	2,133,870.00	3.28
13	000963	华东医药	2,110,675.00	3.25
14	002422	科伦药业	2,108,635.00	3.24
15	300347	泰格医药	2,099,131.00	3.23
16	300760	迈瑞医疗	1,983,233.00	3.05
17	300595	欧普康视	1,823,518.00	2.80
18	603127	昭衍新药	1,718,836.00	2.64
19	600276	恒瑞医药	1,709,852.00	2.63
20	688289	圣湘生物	1,704,605.23	2.62
21	300122	智飞生物	1,590,242.50	2.45
22	002107	沃华医药	1,452,650.00	2.23
23	002773	康弘药业	1,407,998.00	2.17
24	600535	天士力	1,347,522.00	2.07

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	002252	上海莱士	3,876,157.00	5.96
2	600535	天士力	3,825,188.03	5.88
3	300015	爱尔眼科	3,534,929.00	5.44
4	600998	九州通	3,466,350.00	5.33

5	000739	普洛药业	3,236,089.30	4.98
6	000538	云南白药	3,041,653.60	4.68
7	300595	欧普康视	2,667,087.00	4.10
8	300832	新产业	2,633,156.89	4.05
9	603658	安图生物	2,590,147.00	3.98
10	600566	济川药业	2,571,545.00	3.95
11	601607	上海医药	2,488,675.00	3.83
12	688185	康希诺	2,438,420.96	3.75
13	688687	凯因科技	2,399,224.20	3.69
14	600380	健康元	2,348,375.00	3.61
15	600329	达仁堂	2,288,839.59	3.52
16	300896	爱美客	2,266,475.00	3.49
17	000999	华润三九	2,205,083.00	3.39
18	600276	恒瑞医药	2,091,555.00	3.22
19	688363	华熙生物	2,057,663.09	3.16
20	603882	金域医学	2,026,152.00	3.12
21	600422	昆药集团	1,992,200.00	3.06
22	600285	羚锐制药	1,944,926.00	2.99
23	002821	凯莱英	1,910,306.00	2.94
24	600511	国药股份	1,893,722.00	2.91
25	600572	康恩贝	1,834,191.00	2.82
26	002294	信立泰	1,804,314.00	2.77
27	600867	通化东宝	1,774,041.00	2.73
28	603368	柳药集团	1,748,867.00	2.69
29	300601	康泰生物	1,593,765.00	2.45
30	300760	迈瑞医疗	1,582,010.00	2.43
31	000661	长春高新	1,519,274.00	2.34
32	002107	沃华医药	1,486,988.00	2.29
33	002773	康弘药业	1,457,153.00	2.24
34	603127	昭衍新药	1,440,345.40	2.21
35	603259	药明康德	1,407,117.00	2.16

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	89,388,957.92
卖出股票收入（成交）总额	102,627,799.21

注：买入股票成本和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	916,181.01	1.79
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	916,181.01	1.79

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	019679	22 国债 14	9,000	916,181.01	1.79

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：无。

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：无。

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：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可以参与股指期货交易，但必须根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金将根据对现货和期货市场的分析，采取多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在风险可控的前提下，本着谨慎原则参与国债期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,568.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,568.14

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

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：无。

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

注：无。

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

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 (%)
长城中证医药卫生指数增强 A	801	19,289.44	-	-	15,450,839.58	100.00
长城中证医药卫生指数增强 C	1,518	26,438.82	22,239,824.56	55.41	17,894,302.36	44.59
合计	2,319	23,969.37	22,239,824.56	40.01	33,345,141.94	59.99

注：上述机构/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	长城中证医药卫生指数增强 A	39,901.84	0.2583
	长城中证医药卫生指数增强 C	-	-
	合计	39,901.84	0.0718

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

8.3 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

项目	份额级别	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	长城中证医药卫生指数增强 A	0
	长城中证医药卫生指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长城中证医药卫生指数增强 A	0
	长城中证医药卫生指数增强 C	0
	合计	0

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城中证医药卫生指数增强 A	长城中证医药卫生指数增强 C
基金合同生效日 (2022 年 6 月 1 日) 基金份额总额	48,574,342.06	253,889,898.03
本报告期期初基金份额总额	27,037,855.42	38,967,163.07
本报告期基金总申购份额	1,631,486.69	38,564,192.82
减：本报告期基金总赎回份额	13,218,502.53	37,397,228.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,450,839.58	40,134,126.92

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、基金管理人重大人事变动：

自 2023 年 2 月 6 日起，张勇先生担任公司副总经理。

自 2023 年 4 月 10 日起，何小乐女士担任公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内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

本基金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

本基金本报告期投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

在本报告期内，为本基金提供审计服务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）。

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

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	2	191,912,162.18	100.00	157,776.63	100.00	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化，截止本报告期末共计 2 个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 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；
- (5) 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基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金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、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。

基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

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(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 1 月 19 日
2	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 2 月 6 日
3	关于长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 3 月 15 日
4	关于长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 3 月 29 日
5	关于长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 6 日
6	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 10 日
7	关于长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 1 日
8	关于长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 15 日
9	关于长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金基金资产净值连续低于 5000 万元的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 6 月 21 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)

		间区间					
机构	1	20230407-20230413, 20230628-20230630	-	34,663,686.84	12,733,862.28	21,929,824.56	39.4528

产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

1、流动性风险

本基金在短期内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，从而可能会面临一定的流动性风险；

2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

若持有基金份额比例达到或超过 20% 的单一投资者大额赎回引发了巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期支付赎回款项；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、基金净值波动风险

大额赎回会导致管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的需要，可能使基金资产净值受到不利影响；另一方面，由于基金净值估值四舍五入法或赎回费收入归基金资产的影响，大额赎回可能导致基金净值出现较大波动；

4、投资受限风险

大额赎回后若基金资产规模过小，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；

5、基金合同终止或转型风险

大额赎回可能会导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，根据基金合同的约定，将面临合同终止财产清算或转型风险。

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

- (一) 中国证监会准予长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件 营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件 营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn