

# 长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 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。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 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	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	56
8.3 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 .....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	71
8.6 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 .....	72
8.7 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 .....	72
8.8 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 .....	72
8.9 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 .....	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	73
8.12 投资组合报告附注 .....	73
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	75
9.3 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 .....	75
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	75
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>75</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>76</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	76
11.2 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 .....	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	77
11.4 基金投资策略的改变 .....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	77
11.8 其他重大事件 .....	80
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>81</b>
12.1 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 .....	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>82</b>
13.1 备查文件目录 .....	82
13.2 存放地点 .....	82
13.3 查阅方式 .....	83

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	长城中证 500 指数增强	
基金主代码	006048	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 8 月 13 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	252,415,794.19 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 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	006048	007413
报告期末下属分级 基金的份额总额	135,334,908.97 份	117,080,885.22 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目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，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 7.75%。
投资策略	本基金为增强型指数基金，股票投资以中证 500 指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对稳定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	车君	李申
	联系电话	0755-23982338	021-60637102
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	021-60637111
传真		0755-23982328	021-60635778
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世	北京市西城区金融大街 25 号

	界商务中心 41 层	
办公地址	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518026	100033
法定代表人	王军	田国立

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）16 层
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021 年		2020 年		2019 年	2019 年 5 月 9 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日
	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	15,985,259.70	7,389,766.47	11,966,039.27	1,319,333.47	5,830,254.51	162,225.49
本期利润	18,593,385.44	4,918,082.15	11,557,908.67	999,492.85	9,075,176.21	374,479.72
加权平均基金份额本期利润	0.2659	0.0961	0.2825	0.2047	0.2175	0.1931
本期	15.71%	5.59%	22.36%	15.83%	22.20%	19.33%

加权平均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	26.46%	26.09%	30.30%	29.88%	35.60%	13.49%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末可供分配利润	62,253,402.74	73,254,668.61	5,864,274.64	2,076,041.52	-6,073,114.17	48,055.20
期末可供分配基金份额利润	0.4600	0.6257	0.1392	0.3133	-0.1604	0.0203
期末基金资产净值	239,929,841.95	204,752,561.95	59,082,130.64	9,190,887.92	40,742,744.16	2,521,783.85
期末基金份额净值	1.7729	1.7488	1.4020	1.3870	1.0760	1.0679
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金份额累计净值增长率	77.68%	85.84%	40.51%	47.40%	7.84%	13.49%

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 500 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
过去三个月	-0.07%	0.79%	3.43%	0.72%	-3.50%	0.07%
过去六个月	5.16%	0.95%	7.72%	0.91%	-2.56%	0.04%
过去一年	26.46%	1.09%	14.83%	0.92%	11.63%	0.17%
过去三年	123.43%	1.32%	72.29%	1.31%	51.14%	0.01%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	77.68%	1.34%	44.19%	1.34%	33.49%	0.00%

长城中证 500 指数增强 C

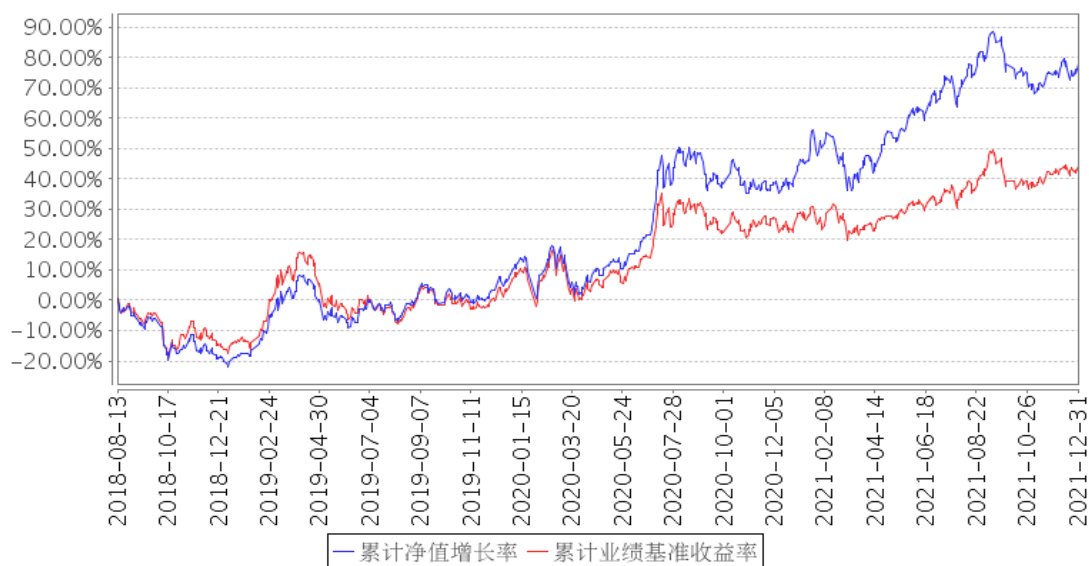
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.15%	0.79%	3.43%	0.72%	-3.58%	0.07%



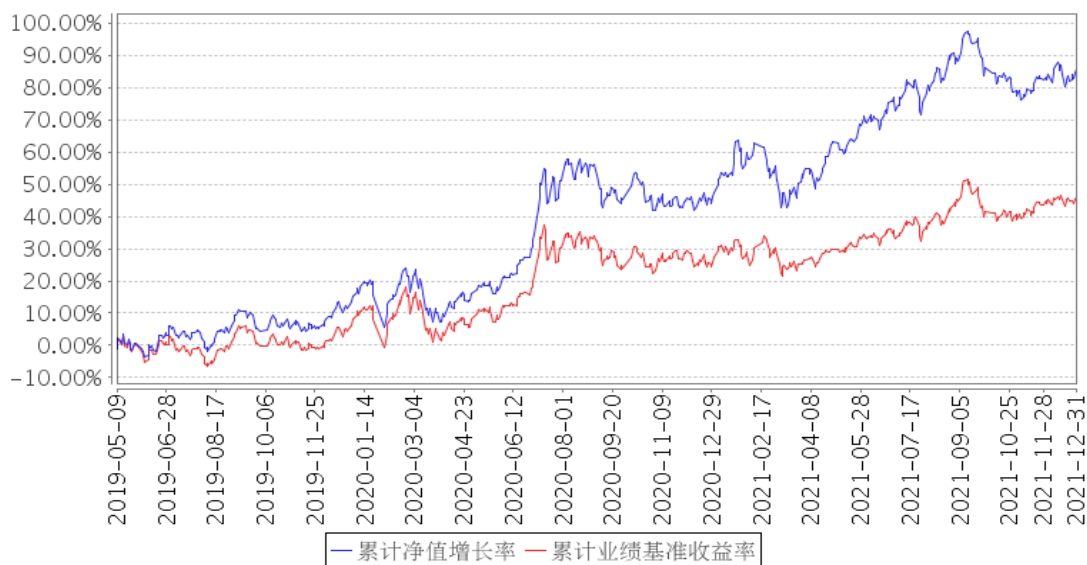
过去六个月	5.01%	0.95%	7.72%	0.91%	-2.71%	0.04%
过去一年	26.09%	1.09%	14.83%	0.92%	11.26%	0.17%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起 至今	85.84%	1.28%	46.27%	1.23%	39.57%	0.05%

### 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



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

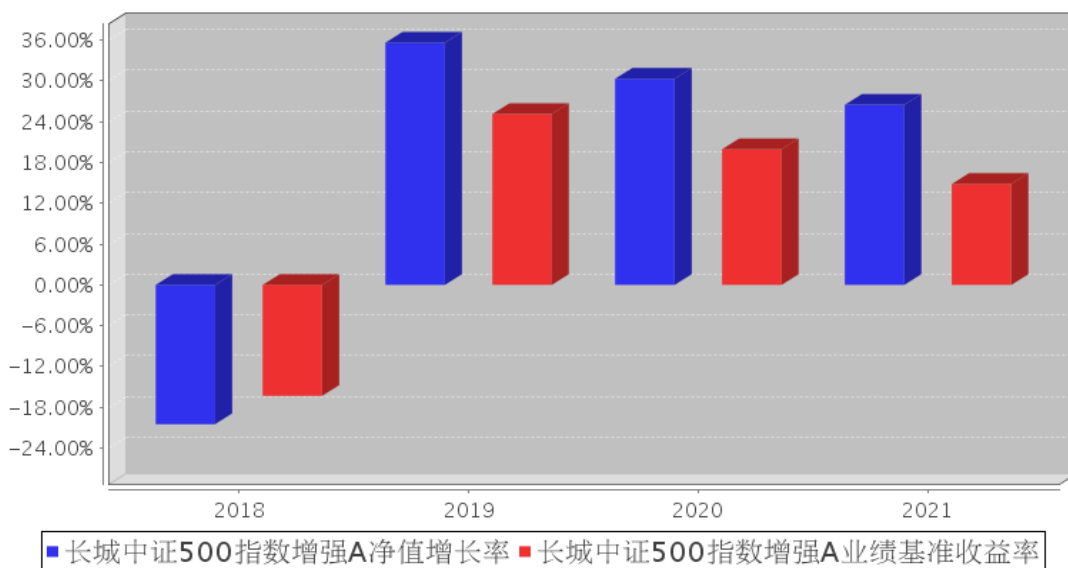


注：①本基金合同规定基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

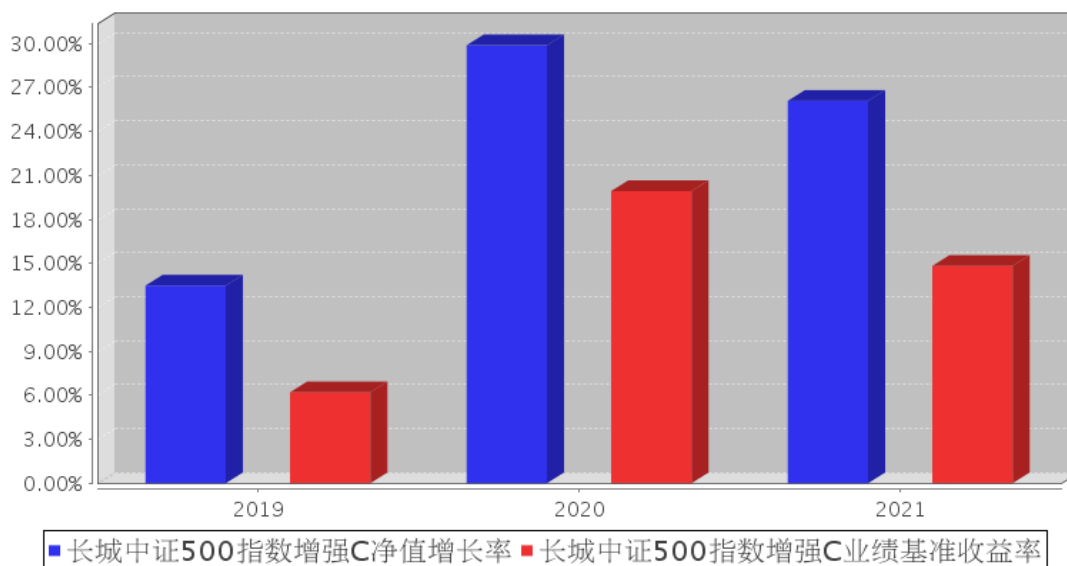
②本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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500指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长城中证500指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、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、长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、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。

#### 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、量化与指数投资部总经理、本基金的基金经理、兼任投资经理	2018 年 11 月 30 日	-	13 年	男，中国籍，硕士。曾就职于南方基金管理有限公司，2017 年 11 月加入长城基金管理有限公司，现任公司总经理助理、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。

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证券业协会《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

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	6	3,645,731,639.13	2014 年 12 月 23 日
	私募资产管理计划	1	201,187,357.11	2021 年 4 月 7 日
	其他组合	-	-	-
	合计	7	3,846,918,996.24	-

注：雷俊于报告期内离任产品名称：长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金；离任产品类型：公募基金；产品数量：1 只；离任时间：2021 年 10 月 29 日。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理的薪酬激励是基于私募资产管理计划所产生的净收入（净管理费+超额业绩报酬）进行计算，原则上不超过净收入的 20%，具体比例根据考核结果进行核算，并采取 3 年的递延方式发放。

## 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》、《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，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 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

### 4.3.2 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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》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，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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，同一组合经理管理的多个投资组合的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同一组合经理管理的多个投资组合的同日反向交易，对同向交易的价差进行强化的监测和事后分析，对不同时间窗的（同日、3 日内、5 日内、7 日内、9 日内、11 日内、13 日内）同向交易和临近交易日的反向交易价差进行监控分析，并结成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，定期出具公平交易稽核报告。

本报告期报告认为，本基金管理人旗下同一组合经理管理的多个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。

#### 4.3.3 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

2021 年，市场风格上呈现显著的“小市值效应”，小盘股的表现平均看大幅好于大盘股。行业上，以煤炭为代表的旧能源产业和以光伏为代表的新能源产业轮番阶段性领涨市场，消费、医药、金融地产等权重板块表现相对较弱。年度内中证 500 指数表现较好，显著战胜大盘，其成分板块中部分二线成长股、周期股获得了较多资金的关注。报告期内，本基金根据市场变化，对基金风格敞口做出了合理调整，基金相对表现不错，相对业绩基准超额收益显著。

本基金基于长城基金量化投资研究平台的研究成果，采用量化多因子模型，基于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；在组合层面上，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。

#### 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 500 指数增强 A 基金份额净值为 1.7729 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.46%；长城中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.7488 元，本报告期基金份额净值增长率为 26.09%，同期业绩比较基准收益率为 14.83%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期多地疫情近期出现反复，美国通胀水平创新新高，美联储加息预期较强，俄罗斯乌克兰地区局势紧张等等因素，都可能对市场情绪造成一定影响。对未来我们持有审慎乐观态度，一方面积极跟踪市场变化，控制好投资组合的风险敞口水平。另一方面，我们对中国经济的长期表现有信心，对中国政府的稳增长政策有信心，市场前期的大幅回调已经消化掉了部分风险。

从行业风格上看，近年来行业轮动加快，行业间的分化与波动加剧，但当前市场已经呈现出投资逐渐分散化的趋势，大盘与小盘、价值与成长都呈现出一些均值修复的现象，未来一年市场风格预计将更加均衡。

### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善

了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监控关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“诚信、稳健、规范、创新”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监督和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

#### 4.7 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及其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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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，本基金无需要说明的情况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	安永华明（2022）审字第 60737541_H34 号
--------	------------------------------

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长城中证 500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了长城中证 500 指数增强型证券投资基金财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表及所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的长城中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于长城中证 500 指数增强型证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>长城中证 500 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,管理层负责评估长城中证 500 指数增强型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长城中证 500 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则

	<p>执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对长城中证 500 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长城中证 500 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	吴翠蓉 黄雨飞
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2022 年 03 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
----	-----	-------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	28,168,796.96	5,197,645.30
结算备付金		8,829,603.49	1,558,210.74
存出保证金		1,428,495.87	203,199.24
交易性金融资产	7.4.7.2	427,187,755.06	62,212,733.49
其中：股票投资		411,008,538.36	62,153,701.69
基金投资		-	-
债券投资		16,179,216.70	59,031.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	527,630.63
应收利息	7.4.7.5	272,973.97	5,062.28
应收股利		-	-
应收申购款		8,101,558.13	586,187.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		473,989,183.48	70,290,669.37
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		5,000,000.00	-
应付证券清算款		20,764,901.55	1,196,443.35
应付赎回款		2,509,514.58	518,708.75
应付管理人报酬		336,633.24	56,815.91
应付托管费		50,494.99	8,522.37
应付销售服务费		47,908.11	2,363.67
应付交易费用	7.4.7.7	289,185.32	53,048.23
应交税费		3,515.62	1,233.52
应付利息		-6,282.46	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	310,908.63	180,515.01
负债合计		29,306,779.58	2,017,650.81
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	228,915,988.07	41,450,641.44
未分配利润	7.4.7.10	215,766,415.83	26,822,377.12
所有者权益合计		444,682,403.90	68,273,018.56
负债和所有者权益总计		473,989,183.48	70,290,669.37

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 252,415,794.19 份，其中长城中证 500 指数增强 A 基金份额总额 135,334,908.97 份，基金份额净值 1.7729 元；长城中证 500 指数增强 C 基金份额总额 117,080,885.22 份，基金份额净值 1.7488 元。

## 7.2 利润表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		28,246,530.86	13,996,306.12
1. 利息收入		185,834.94	52,532.90
其中：存款利息收入	7.4.7.11	65,768.56	35,588.15
债券利息收入		120,066.38	16,944.75
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）		27,207,720.87	14,499,477.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	24,914,597.44	13,119,685.54
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	147,477.72	82,859.57
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	520,121.17	580,640.77
股利收益	7.4.7.16	1,625,524.54	716,292.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	136,760.24	-727,913.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	716,214.81	172,208.69
减：二、费用		4,735,063.27	1,438,904.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,058,119.67	576,964.85
2. 托管费	7.4.10.2.2	308,718.01	86,544.80
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	264,474.02	18,775.47
4. 交易费用	7.4.7.19	1,103,851.57	472,299.93

5. 利息支出		17,987.74	-
其中：卖出回购金融资产支出		17,987.74	-
6. 税金及附加		2,270.16	2,148.38
7. 其他费用	7.4.7.20	364,951.75	282,171.17
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		23,511,467.59	12,557,401.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		23,511,467.59	12,557,401.52

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	41,450,641.44	26,822,377.12	68,273,018.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,511,467.59	23,511,467.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	187,465,346.63	165,432,571.12	352,897,917.75
其中：1. 基金申购款	422,369,411.23	361,552,374.66	783,921,785.89
2. 基金赎回款	-234,904,064.60	-196,119,803.54	-431,023,868.14
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	228,915,988.07	215,766,415.83	444,682,403.90
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	33,650,841.96	9,613,686.05	43,264,528.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,557,401.52	12,557,401.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	7,799,799.48	4,651,289.55	12,451,089.03
其中：1. 基金申购款	76,015,122.97	34,498,284.19	110,513,407.16
2. 基金赎回款	-68,215,323.49	-29,846,994.64	-98,062,318.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	41,450,641.44	26,822,377.12	68,273,018.56

注：附注为本财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王军

邱春杨

赵永强

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长城中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)，是根据中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)2018 年 5 月 15 日证监许可[2018]820 号文“关于准予长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更注册的批复”及原长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金(以下简称“久兆中小板基金”)基金份额持有人大会 2018 年 7 月 5 日决议通过的《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，由原久兆中小板基金转型而来。原久兆中小板基金为契约型开放式基金，于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市，存续期限

不定，首次募集规模为 965,942,785.13 份基金份额。根据深交所深证上[2018]346 号《终止上市通知书》，自 2018 年 8 月 6 日起，久兆中小板基金之中小 300A 份额、中小 300B 份额终止上市。根据久兆中小板基金基金份额持有人大会的授权，管理人自 2018 年 8 月 6 日至 2018 年 8 月 13 日对久兆中小板基金实施转型与基金份额转换。基金份额转换于 2018 年 8 月 13 日完成，久兆中小板基金正式转型成为“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”，原《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》终止，《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

久兆中小板基金之中小 300A 份额、中小 300B 份额终止上市后，基金管理人于 2018 年 8 月 6 日（份额转换起始日）将中小 300A 份额与中小 300B 份额转换为久兆 300 份额的场内份额；于 2018 年 8 月 13 日（份额转换基准日）将久兆 300 份额的场内份额、久兆 300 份额的场外份额转换为份额净值为 1.0000 元的本基金基金份额。基金份额转换后，本基金份额数保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位截位，由此产生的计算误差归入基金财产。

根据基金管理人长城基金管理有限公司于 2019 年 5 月 9 日发布的《关于长城中证 500 指数增强型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》，本基金于 2019 年 5 月 9 日起增加 C 类基金份额类别，原份额转为 A 类基金份额。根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本基金基金份额分为不同的类别。其中在投资人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、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别，称为 C 类基金份额。增加基金份额类别后，A 类基金份额、C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。A 类基金份额基金代码为 006048，C 类基金份额基金代码为 007413。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板、存托凭证以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、权证、股指期货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）。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 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%；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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

#### 7.4.2 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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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 2 号《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

#### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；

保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于卖出债券成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额扣除应由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提；

(3) 基金销售服务费，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 0.30% 年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；同一基金账户的不同基金交易账户对本基金各类别份额设置的分红方式相互独立、互不影响；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 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，证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

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、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

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。

### 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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。

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。

### 4. 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	28,168,796.96	5,197,645.30
定期存款	-	-
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	-	-
合计	28,168,796.96	5,197,645.30

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	409,189,480.09	411,008,538.36	1,819,058.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	16,173,014.37	16,179,216.70
	银行间市场	-	-
	合计	16,173,014.37	16,179,216.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	425,362,494.46	427,187,755.06	1,825,260.60
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	60,372,830.02	62,153,701.69	1,780,871.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	41,000.00	59,031.80
	银行间市场	-	-
	合计	41,000.00	59,031.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	60,413,830.02	62,212,733.49	1,798,903.47

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	8,615,440.00	-	-	

工具				
其中：股指期货投资	8,615,440.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	8,615,440.00	-	-	
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	1,242,900.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	1,242,900.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,679.48	511.07
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	6,848.76	4,537.21
应收债券利息	264,387.98	6.96
应收资产支持证券利息	-	-

应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	57.75	7.04
合计	272,973.97	5,062.28

注：1. 其他为应收交易所结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

注：无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	289,185.32	53,048.23
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	289,185.32	53,048.23

注：交易所市场应付交易费用均为应付佣金。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	908.63	515.01
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费用	30,000.00	30,000.00
预提信息披露费用	80,000.00	50,000.00
应付指数使用费	200,000.00	100,000.00
合计	310,908.63	180,515.01

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长城中证 500 指数增强 A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,142,233.84	34,824,313.59
本期申购	204,043,489.21	168,612,445.75
本期赎回（以“-”号填列）	-110,850,814.08	-91,601,656.49
-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	135,334,908.97	111,835,102.85
-----	----------------	----------------

长城中证 500 指数增强 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	6,626,327.85	6,626,327.85
本期申购	253,756,965.48	253,756,965.48
本期赎回 (以“-”号填列)	-143,302,408.11	-143,302,408.11
-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	117,080,885.22	117,080,885.22

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。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

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	5,864,274.64	18,393,542.41	24,257,817.05
本期利润	15,985,259.70	2,608,125.74	18,593,385.44
本期基金份额交易产生的变动数	40,403,868.40	44,839,668.21	85,243,536.61
其中：基金申购款	83,969,225.86	98,175,492.37	182,144,718.23
基金赎回款	-43,565,357.46	-53,335,824.16	-96,901,181.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,253,402.74	65,841,336.36	128,094,739.10

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	2,076,041.52	488,518.55	2,564,560.07
本期利润	7,389,766.47	-2,471,684.32	4,918,082.15
本期基金份额交易产生的变动数	63,788,860.62	16,400,173.89	80,189,034.51
其中：基金申购款	148,426,647.83	30,981,008.60	179,407,656.43
基金赎回款	-84,637,787.21	-14,580,834.71	-99,218,621.92

本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,254,668.61	14,417,008.12	87,671,676.73

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	31,333.03	19,576.62
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	33,716.82	15,756.90
其他	718.71	254.63
合计	65,768.56	35,588.15

注：注：其他为交易所结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	24,914,597.44	13,119,685.54
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	24,914,597.44	13,119,685.54

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	968,240,465.59	284,927,690.23
减：卖出股票成本总	943,325,868.15	271,808,004.69

额		
买卖股票差价收入	24,914,597.44	13,119,685.54

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	147,477.72	82,859.57
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	147,477.72	82,859.57

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,088,338.57	1,983,461.32
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,858,347.03	1,843,021.52
减：应收利息总额	82,513.82	57,580.23
买卖债券差价收入	147,477.72	82,859.57

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.15.2 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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货-投资收益	520,121.17	580,640.77

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

	日	日
股票投资产生的股利收益	1,625,524.54	716,292.06
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,625,524.54	716,292.06

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
1. 交易性金融资产	26,357.13	-743,971.66
股票投资	38,186.60	-770,191.58
债券投资	-11,829.47	26,219.92
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	113,060.00	16,540.00
权证投资	-	-
期货投资	113,060.00	16,540.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	2,656.89	481.75
合计	136,760.24	-727,913.41

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	716,214.81	168,102.66
转出基金补偿收入	-	4,102.02
其他	-	4.01
合计	716,214.81	172,208.69

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,718,541.92	472,299.93
银行间市场交易费用	-	-



合计	1,718,541.92	472,299.93
----	--------------	------------

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	80,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	4,591.75	2,171.17
账户维护费	360.00	-
指数使用费	200,000.00	200,000.00
律师费	40,000.00	-
公证费	10,000.00	-
合计	364,951.75	282,171.17

#### 7.4.7.21 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。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
北方国际信托股份有限公司（“北方国际”）	基金管理人的股东

中原信托有限公司(“中原信托”)	基金管理人的股东
长城嘉信资产管理有限公司(“长城嘉信”)	基金管理人的控股子公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	2,252,783,616.77	100.00	577,419,119.48	100.00

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	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 成交总额的比例 (%)
长城证券	23,213,764.76	100.00	447,967.12	100.00

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
长城证券	188,600,000.00	100.00	-	-

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31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	521,079.34	100.00	289,185.32	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	133,552.99	100.00	53,048.23	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,058,119.67
其中：支付销售机构的客户维护费	496,651.98	207,525.28

注：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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	308,718.01

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 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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

#### 7.4.10.2.3 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C	合计
长城基金管理有限公司	-	98,130.04	98,130.04
合计	-	98,130.04	98,130.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C	合计
长城基金管理有限公司	-	22.93	22.93
合计	-	22.93	22.93

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 0.3%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用自有资金投资于本基金，于本期末及上年度末亦均未持有本基金份额。

##### 7.4.10.5.2 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

份额单位：份

长城中证 500 指数增强 A

关联方名称	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
长城嘉信资产管理有限公司	2,843,621.13	1.1266	-	-

注：关联方持有本基金份额变动相关的交易费用按基金合同及招募说明书的有关规定计算。

##### 7.4.10.6 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	28,168,796.96	31,333.03	5,197,645.30	19,576.62

注：注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

##### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 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

7.4.8.2 资产负债表日后事项。

#### 7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 01 月 11 日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	新股锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301045	天禄科技	2021 年 8 月 6 日	2022 年 02 月 17 日	新股锁定	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 02 月 28 日	新股锁定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301056	森赫股份	2021 年 8 月 27 日	2022 年 3 月 7 日	新股锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮	2021 年	2022 年	新股锁	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-

	工科	9月1日	3月9日	定						
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股锁定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股锁定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股锁定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股锁定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股锁定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年4月27日	新股锁定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股锁定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股锁定	93.09	75.34	268	24,948.12	20,191.12	-

301088	戎美股份	2021年 10月19 日	2022年 4月28 日	新股锁 定	33.16	24.67	466	15,452.56	11,496.22	-
301089	拓新药业	2021年 10月20 日	2022年 4月27 日	新股锁 定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年 10月19 日	2022年 4月26 日	新股锁 定	10.45	11.22	1,650	17,242.50	18,513.00	-
301091	深城交	2021年 10月20 日	2022年 4月29 日	新股锁 定	36.50	31.31	498	18,177.00	15,592.38	-
301092	争光股份	2021年 10月21 日	2022年 5月5 日	新股锁 定	36.31	35.52	303	11,001.93	10,762.56	-
301093	华兰股份	2021年 10月21 日	2022年 5月5 日	新股锁 定	58.08	49.85	242	14,055.36	12,063.70	-
301096	百诚医药	2021年 12月13 日	2022年 6月20 日	新股锁 定	79.60	78.53	170	13,532.00	13,350.10	-
301118	恒光股份	2021年 11月9 日	2022年 5月18 日	新股锁 定	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301127	天源环保	2021年 12月23 日	2022年 6月30 日	新股锁 定	12.03	17.12	1,492	17,948.76	25,543.04	-
301133	金钟股份	2021年 11月19 日	2022年 5月26 日	新股锁 定	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301179	泽宇智能	2021年 12月1 日	2022年 6月8 日	新股锁 定	43.99	50.77	265	11,657.35	13,454.05	-
301180	万祥科技	2021年 11月9 日	2022年 5月16 日	新股锁 定	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301185	鸥玛软件	2021年 11月11 日	2022年 5月19 日	新股锁 定	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301193	家联科技	2021年 12月2 日	2022年 6月9 日	新股锁 定	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
688701	卓锦股份	2021年 9月8 日	2022年 3月16 日	新股锁 定	7.48	13.50	2,340	17,503.20	31,590.00	-



		日	日							
688737	中自科技	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 22 日	新股锁 定	70.90	55.06	1,978	140,240.20	108,908.68	-
688772	珠海冠宇	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 15 日	新股锁 定	14.43	39.09	8,640	124,675.20	337,737.60	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，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 5,000,000.00 元，于 2022 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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。

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：无。

#### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：无。

### **7.4.13.3 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。

#### **7.4.13.3.1 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 7.4.12 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 7.4.12.3 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

本基金本期末及上年度末面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	28,168,796.96	-	-	-	-	-	28,168,796.96
结算备付金	8,829,603.4	-	-	-	-	-	8,829,603.4

		9					49
存出保证金	1,428,495.87	-	-	-	-	-	1,428,495.87
交易性金融资产	-	-	16,115,707.80	-	63,508.90	411,008,538.36	427,187,755.06
应收利息	-	-	-	-	-	272,973.97	272,973.97
应收申购款	-	-	-	-	-	8,101,558.13	8,101,558.13
资产总计	38,426,896.32	-	16,115,707.80	-	63,508.90	419,383,070.46	473,989,183.48
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,509,514.58	2,509,514.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	336,633.24	336,633.24
应付托管费	-	-	-	-	-	50,494.99	50,494.99
应付证券清算款	-	-	-	-	-	20,764,901.55	20,764,901.55
卖出回购金融资产款	5,000,000.00	-	-	-	-	-	5,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	47,908.11	47,908.11
应付交易费用	-	-	-	-	-	289,185.32	289,185.32
应付利息	-	-	-	-	-	-6,282.46	-6,282.46
应交税费	-	-	-	-	-	3,515.62	3,515.62
其他负债	-	-	-	-	-	310,908.63	310,908.63
负债总计	5,000,000.00	-	-	-	-	24,306,779.58	29,306,779.58
利率敏感度缺口	33,426,896.32	-	16,115,707.80	-	63,508.90	-	-
上年度末							
2020 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	5,197,645.30	-	-	-	-	-	5,197,645.30
结算备付金	1,558,210.74	-	-	-	-	-	1,558,210.74
存出保证金	203,199.24	-	-	-	-	-	203,199.24
交易性金融资产	-	-	-	-	59,031.80	62,153,701.69	62,212,733.49

应收证券清算款	-	-	-	-	-	527,630.63	527,630.63
应收利息	-	-	-	-	-	5,062.28	5,062.28
应收申购款	-	-	-	-	-	586,187.69	586,187.69
资产总计	6,959,055.28	-	-	-	59,031.80	63,272,582.29	70,290,669.37
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,196,443.35	1,196,443.35
应付赎回款	-	-	-	-	-	518,708.75	518,708.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	56,815.91	56,815.91
应付托管费	-	-	-	-	-	8,522.37	8,522.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,363.67	2,363.67
应付交易费用	-	-	-	-	-	53,048.23	53,048.23
应交税费	-	-	-	-	-	1,233.52	1,233.52
其他负债	-	-	-	-	-	180,515.01	180,515.01
负债总计	-	-	-	-	-	2,017,650.81	2,017,650.81
利率敏感度缺口	6,959,055.28	-	-	-	59,031.80	-	-

#### 7.4.13.4.1.2 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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	利率上升 25 个基点	-12,278.74	-
	利率下降 25 个基点	12,297.49	-

#### 7.4.13.4.2 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。

### 7.4.13.4.3 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。

本基金投资组合的资产配置为：股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中证 500 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%；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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	411,008,538.36	92.43	62,153,701.69	91.04
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	16,179,216.70	3.64	59,031.80	0.09
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	427,187,755.06	96.07	62,212,733.49	91.12

#### 7.4.13.4.3.2 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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	沪深 300 指数上升	19,631,822.83	2,973,433.09

	5%		
	沪深 300 指数下降	-19,631,822.83	-2,973,433.09
	5%		

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.2 其他事项

###### (1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、存出保证金、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 410,161,826.21 元，划分为第二层次的余额为人民币 17,025,928.85 元，无划分为第三层次的余额。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 62,191,588.05 元，划分为第二层次的余额为人民币 21,145.44 元，无划分为第三层次的余额。

###### 公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7 号)、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》(财会〔2017〕8 号)、《企业会计准则第 24 号—套期会计》(财会〔2017〕9 号)、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(财会〔2017〕14 号)(以上统称新金融工具相关会计准则)，以及《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22 号)，自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

(3) 除以上事项外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	411,008,538.36	86.71
	其中：股票	411,008,538.36	86.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,179,216.70	3.41
	其中：债券	16,179,216.70	3.41
	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	36,998,400.45	7.81
8	其他各项资产	9,803,027.97	2.07
9	合计	473,989,183.48	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	14,187,862.60	3.19
C	制造业	233,808,101.38	52.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,834,795.02	1.09
E	建筑业	891,780.67	0.20
F	批发和零售业	16,448,864.00	3.70
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	32,529,319.98	7.32
J	金融业	847.80	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,543,784.00	0.35
M	科学研究和技术	9,696.12	-



	服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	15,254,969.61	3.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,770,297.00	1.07
R	文化、体育和娱乐业	2,143,508.50	0.48
S	综合	-	-
	合计	326,423,826.68	73.41

### 8.2.2 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	5,869,817.00	1.32
C	制造业	55,472,905.55	12.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,492.37	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	20,674.06	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,812,770.94	0.41
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	849,349.69	0.19
J	金融业	14,796,589.80	3.33
K	房地产业	734,074.60	0.17
L	租赁和商务服务业	1,769,143.70	0.40
M	科学研究和技术服务业	3,165,460.76	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	69,125.23	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	538.20	0.00
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	84,584,711.68	19.02

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	000733	振华科技	91,500	11,371,620.00	2.56
2	300037	新宙邦	88,300	9,977,900.00	2.24
3	002867	周大生	537,550	9,557,639.00	2.15
4	000960	锡业股份	479,900	9,372,447.00	2.11
5	600862	中航高科	256,100	9,158,136.00	2.06
6	603568	伟明环保	248,710	9,085,376.30	2.04
7	600141	兴发集团	235,100	8,905,588.00	2.00
8	000988	华工科技	319,600	8,904,056.00	2.00
9	603707	健友股份	195,886	8,227,212.00	1.85
10	600884	杉杉股份	247,600	8,113,852.00	1.82
11	000636	风华高科	257,500	7,673,500.00	1.73
12	601615	明阳智能	283,413	7,397,079.30	1.66
13	603444	吉比特	17,400	7,340,190.00	1.65
14	688099	晶晨股份	54,452	7,089,650.40	1.59
15	688188	柏楚电子	17,872	6,888,941.12	1.55
16	600256	广汇能源	1,032,000	6,749,280.00	1.52
17	000830	鲁西化工	434,100	6,624,366.00	1.49
18	002572	索菲亚	292,600	6,495,720.00	1.46
19	002416	爱施德	566,400	6,445,632.00	1.45
20	605358	立昂微	53,000	6,360,530.00	1.43
21	002266	浙富控股	866,500	6,169,480.00	1.39
22	603198	迎驾贡酒	86,400	6,000,480.00	1.35
23	601168	西部矿业	428,700	5,834,607.00	1.31
24	603589	口子窖	78,000	5,527,860.00	1.24
25	300357	我武生物	93,520	5,358,696.00	1.21
26	300418	昆仑万维	226,200	5,236,530.00	1.18
27	300223	北京君正	38,700	5,185,800.00	1.17
28	000062	深圳华强	298,200	5,137,986.00	1.16
29	601636	旗滨集团	299,100	5,114,610.00	1.15
30	300751	迈为股份	7,900	5,074,170.00	1.14
31	000807	云铝股份	449,900	5,025,383.00	1.13
32	002690	美亚光电	133,500	5,000,910.00	1.12
33	603868	飞科电器	114,100	4,954,222.00	1.11
34	600546	山煤国际	592,600	4,865,246.00	1.09

35	600885	宏发股份	65,000	4,851,600.00	1.09
36	000598	兴蓉环境	764,650	4,832,588.00	1.09
37	300244	迪安诊断	142,100	4,770,297.00	1.07
38	300009	安科生物	361,400	4,730,726.00	1.06
39	002408	齐翔腾达	448,701	4,711,360.50	1.06
40	002925	盈趣科技	136,820	4,655,984.60	1.05
41	000039	中集集团	269,200	4,619,472.00	1.04
42	603267	鸿远电子	24,600	4,414,224.00	0.99
43	300630	普利制药	78,000	4,293,120.00	0.97
44	601689	拓普集团	78,000	4,134,000.00	0.93
45	688005	容百科技	32,923	3,805,240.34	0.86
46	603613	国联股份	34,300	3,687,250.00	0.83
47	600867	通化东宝	285,000	3,123,600.00	0.70
48	603077	和邦生物	838,600	2,859,626.00	0.64
49	600171	上海贝岭	107,100	2,748,186.00	0.62
50	603290	斯达半导	6,000	2,286,000.00	0.51
51	688536	思瑞浦	2,974	2,284,032.00	0.51
52	002508	老板电器	61,732	2,223,586.64	0.50
53	603156	养元饮品	76,400	2,170,524.00	0.49
54	300251	光线传媒	166,810	2,143,508.50	0.48
55	002294	信立泰	68,800	1,879,616.00	0.42
56	688208	道通科技	20,288	1,610,867.20	0.36
57	002128	电投能源	108,000	1,603,800.00	0.36
58	600765	中航重机	31,300	1,580,337.00	0.36
59	002396	星网锐捷	65,500	1,543,835.00	0.35
60	002183	怡亚通	233,200	1,543,784.00	0.35
61	000825	太钢不锈	197,500	1,390,400.00	0.31
62	002557	洽洽食品	22,400	1,374,464.00	0.31
63	600808	马钢股份	336,600	1,242,054.00	0.28
64	002434	万里扬	74,800	1,102,552.00	0.25
65	300363	博腾股份	11,900	1,064,455.00	0.24
66	600970	中材国际	78,000	891,540.00	0.20
67	603127	昭衍新药	84	9,696.12	0.00
68	002368	太极股份	99	2,726.46	0.00
69	603638	艾迪精密	80	2,553.60	0.00
70	002223	鱼跃医疗	50	1,890.00	0.00
71	000513	丽珠集团	36	1,447.56	0.00
72	600803	新奥股份	75	1,377.00	0.00
73	002985	北摩高科	10	1,204.60	0.00
74	600801	华新水泥	60	1,158.00	0.00
75	601139	深圳燃气	94	830.02	0.00
76	603218	日月股份	20	659.00	0.00

77	002273	水晶光电	30	521.70	0.00
78	002249	大洋电机	54	474.66	0.00
79	000728	国元证券	50	385.00	0.00
80	000750	国海证券	90	369.90	0.00
81	600507	方大特钢	38	296.40	0.00
82	002353	杰瑞股份	7	280.00	0.00
83	000090	天健集团	41	240.67	0.00
84	000975	银泰黄金	20	175.60	0.00
85	601200	上海环境	9	113.31	0.00
86	000563	陕国投 A	18	58.14	0.00
87	002936	郑州银行	11	34.76	0.00
88	002387	维信诺	1	9.28	0.00

### 8.3.2 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	300059	东方财富	149,460	5,546,460.60	1.25
2	000776	广发证券	198,200	4,873,738.00	1.10
3	601377	兴业证券	425,100	4,199,988.00	0.94
4	688357	建龙微纳	15,989	3,068,928.66	0.69
5	300316	晶盛机电	36,600	2,543,700.00	0.57
6	603095	越剑智能	89,900	2,260,086.00	0.51
7	600395	盘江股份	274,800	1,997,796.00	0.45
8	688308	欧科亿	28,060	1,983,280.80	0.45
9	300873	海晨股份	36,900	1,811,790.00	0.41
10	300596	利安隆	37,800	1,691,928.00	0.38
11	600436	片仔癀	3,700	1,617,455.00	0.36
12	603610	麒盛科技	62,400	1,613,664.00	0.36
13	601899	紫金矿业	166,200	1,612,140.00	0.36
14	688200	华峰测控	3,120	1,597,128.00	0.36
15	601677	明泰铝业	36,000	1,587,240.00	0.36
16	300347	泰格医药	12,400	1,584,720.00	0.36
17	603599	广信股份	39,600	1,544,400.00	0.35
18	002850	科达利	9,500	1,523,230.00	0.34
19	002436	兴森科技	107,800	1,509,200.00	0.34
20	601882	海天精工	60,300	1,493,631.00	0.34
21	300662	科锐国际	23,400	1,455,714.00	0.33
22	688356	键凯科技	4,113	1,386,615.69	0.31
23	605111	新洁能	7,700	1,371,370.00	0.31
24	688196	卓越新能	23,384	1,366,327.12	0.31
25	300327	中颖电子	19,840	1,347,136.00	0.30
26	603392	万泰生物	6,060	1,342,290.00	0.30

27	002978	安宁股份	31,100	1,314,908.00	0.30
28	300861	美畅股份	15,800	1,228,766.00	0.28
29	300260	新莱应材	25,500	1,202,835.00	0.27
30	002129	中环股份	28,600	1,194,050.00	0.27
31	688093	世华科技	31,900	1,189,870.00	0.27
32	688122	西部超导	12,135	1,176,366.90	0.26
33	300171	东富龙	22,800	1,152,312.00	0.26
34	603931	格林达	33,800	1,115,400.00	0.25
35	688598	金博股份	3,065	1,088,197.60	0.24
36	605377	华旺科技	55,400	993,876.00	0.22
37	300833	浩洋股份	11,800	956,154.00	0.22
38	300638	广和通	17,500	953,750.00	0.21
39	600987	航民股份	170,810	949,703.60	0.21
40	600183	生益科技	40,300	949,065.00	0.21
41	601666	平煤股份	112,900	944,973.00	0.21
42	002585	双星新材	34,000	920,720.00	0.21
43	300759	康龙化成	6,300	890,001.00	0.20
44	300820	英杰电气	9,200	827,080.00	0.19
45	300390	天华超净	9,500	769,500.00	0.17
46	002968	新大正	20,700	733,401.00	0.16
47	000799	酒鬼酒	3,250	690,625.00	0.16
48	300852	四会富仕	10,400	607,568.00	0.14
49	002371	北方华创	1,600	555,232.00	0.12
50	002709	天赐材料	4,700	538,855.00	0.12
51	300373	扬杰科技	8,000	537,440.00	0.12
52	300919	中伟股份	3,500	530,285.00	0.12
53	002988	豪美新材	24,300	500,823.00	0.11
54	003026	中晶科技	6,600	488,730.00	0.11
55	603383	顶点软件	13,500	484,650.00	0.11
56	300593	新雷能	7,740	420,901.20	0.09
57	688133	泰坦科技	1,900	414,580.00	0.09
58	300790	宇瞳光学	8,500	384,030.00	0.09
59	605123	派克新材	2,600	356,772.00	0.08
60	601208	东材科技	19,670	341,274.50	0.08
61	688772	珠海冠宇	8,640	337,737.60	0.08
62	300750	宁德时代	500	294,000.00	0.07
63	300661	圣邦股份	700	216,300.00	0.05
64	003013	地铁设计	10,200	204,816.00	0.05
65	603185	上机数控	1,200	200,376.00	0.05
66	603039	泛微网络	2,800	195,356.00	0.04
67	600926	杭州银行	13,760	176,403.20	0.04
68	603300	华铁应急	13,100	176,195.00	0.04
69	002821	凯莱英	400	174,000.00	0.04

70	002818	富森美	10,970	137,234.70	0.03
71	600089	特变电工	6,200	131,254.00	0.03
72	600702	舍得酒业	500	113,650.00	0.03
73	600050	中国联通	28,700	112,791.00	0.03
74	300748	金力永磁	2,500	112,225.00	0.03
75	688737	中自科技	1,978	108,908.68	0.02
76	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.01
77	301127	天源环保	1,492	25,543.04	0.01
78	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
79	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
80	301087	可孚医疗	268	20,191.12	0.00
81	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
82	301090	华润材料	1,650	18,513.00	0.00
83	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
84	301091	深城交	498	15,592.38	0.00
85	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
86	688018	乐鑫科技	79	15,013.16	0.00
87	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
88	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
89	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
90	000625	长安汽车	900	13,671.00	0.00
91	301179	泽宇智能	265	13,454.05	0.00
92	301096	百诚医药	170	13,350.10	0.00
93	600809	山西汾酒	40	12,631.20	0.00
94	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
95	301093	华兰股份	242	12,063.70	0.00
96	301088	戎美股份	466	11,496.22	0.00
97	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
98	301092	争光股份	303	10,762.56	0.00
99	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
100	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
101	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
102	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
103	300014	亿纬锂能	70	8,272.60	0.00
104	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
105	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
106	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
107	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
108	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
109	688111	金山办公	23	6,095.00	0.00
110	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
111	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
112	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00

113	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
114	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
115	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
116	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
117	603208	江山欧派	70	4,415.60	0.00
118	688078	龙软科技	72	4,190.40	0.00
119	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
120	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
121	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
122	300595	欧普康视	60	3,442.20	0.00
123	688202	美迪西	6	2,913.54	0.00
124	603520	司太立	40	2,600.00	0.00
125	300770	新媒股份	40	2,400.00	0.00
126	603596	伯特利	28	1,948.80	0.00
127	300379	东方通	60	1,771.80	0.00
128	002851	麦格米特	50	1,601.00	0.00
129	603700	宁水集团	80	1,550.40	0.00
130	002324	普利特	96	1,355.52	0.00
131	002833	弘亚数控	40	1,287.20	0.00
132	600845	宝信软件	20	1,216.60	0.00
133	600452	涪陵电力	56	1,127.84	0.00
134	300639	凯普生物	35	1,032.85	0.00
135	000848	承德露露	90	976.50	0.00
136	300737	科顺股份	60	975.00	0.00
137	600426	华鲁恒升	30	939.00	0.00
138	601919	中远海控	50	934.50	0.00
139	002879	长缆科技	36	849.60	0.00
140	300572	安车检测	40	826.00	0.00
141	002414	高德红外	28	677.88	0.00
142	603506	南都物业	40	673.60	0.00
143	603377	东方时尚	60	538.20	0.00
144	002832	比音勒芬	19	483.55	0.00
145	000543	皖能电力	50	278.00	0.00
146	300259	新天科技	45	235.35	0.00
147	300559	佳发教育	20	181.20	0.00
148	000600	建投能源	17	86.53	0.00
149	600125	铁龙物流	9	46.44	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	603444	吉比特	26,306,657.62	38.53

2	000799	酒鬼酒	23,005,058.00	33.70
3	000807	云铝股份	21,031,251.01	30.80
4	603568	伟明环保	19,499,021.36	28.56
5	000830	鲁西化工	17,972,699.96	26.32
6	600141	兴发集团	17,862,185.00	26.16
7	002867	周大生	17,531,466.46	25.68
8	002709	天赐材料	17,244,469.00	25.26
9	600884	杉杉股份	17,013,407.00	24.92
10	601233	桐昆股份	16,947,170.00	24.82
11	002690	美亚光电	16,533,872.67	24.22
12	002648	卫星化学	16,364,024.20	23.97
13	603290	斯达半导	16,129,033.00	23.62
14	300223	北京君正	15,963,608.00	23.38
15	000039	中集集团	15,811,025.67	23.16
16	688208	道通科技	15,759,554.24	23.08
17	300059	东方财富	14,952,141.00	21.90
18	002266	浙富控股	14,937,824.00	21.88
19	603225	新凤鸣	14,741,244.32	21.59
20	002925	盈趣科技	14,693,660.92	21.52
21	605358	立昂微	14,298,909.00	20.94
22	601636	旗滨集团	14,213,202.00	20.82
23	002396	星网锐捷	13,765,774.97	20.16
24	000636	风华高科	13,731,490.00	20.11
25	300037	新宙邦	13,471,191.98	19.73
26	603486	科沃斯	13,124,064.99	19.22
27	000960	锡业股份	12,872,555.00	18.85
28	300244	迪安诊断	12,409,410.92	18.18
29	002985	北摩高科	11,832,604.00	17.33
30	000733	振华科技	11,445,321.23	16.76
31	600862	中航高科	11,362,991.00	16.64
32	600171	上海贝岭	11,187,606.11	16.39
33	688099	晶晨股份	10,729,733.43	15.72
34	600885	宏发股份	10,630,775.00	15.57
35	603260	合盛硅业	10,146,041.00	14.86
36	002572	索菲亚	10,045,822.66	14.71
37	000988	华工科技	9,406,601.79	13.78
38	603198	迎驾贡酒	9,367,608.12	13.72
39	601615	明阳智能	9,283,280.93	13.60
40	300251	光线传媒	8,981,587.50	13.16
41	300418	昆仑万维	8,888,740.97	13.02
42	000887	中鼎股份	8,689,901.00	12.73
43	603156	养元饮品	8,564,302.44	12.54



44	603707	健友股份	8,511,762.61	12.47
45	002901	大博医疗	7,858,752.88	11.51
46	600729	重庆百货	7,839,104.01	11.48
47	600808	马钢股份	7,499,105.00	10.98
48	002372	伟星新材	7,456,183.00	10.92
49	601168	西部矿业	7,446,699.58	10.91
50	688188	柏楚电子	7,345,531.92	10.76
51	600779	水井坊	7,260,621.00	10.63
52	002416	爱施德	7,129,035.68	10.44
53	600707	彩虹股份	7,098,181.57	10.40
54	600256	广汇能源	6,940,334.00	10.17
55	002408	齐翔腾达	6,871,383.82	10.06
56	300316	晶盛机电	6,868,892.00	10.06
57	300630	普利制药	6,691,844.00	9.80
58	600867	通化东宝	6,597,374.50	9.66
59	002156	通富微电	6,534,772.68	9.57
60	000012	南玻 A	6,510,776.72	9.54
61	002078	太阳纸业	6,374,950.68	9.34
62	000717	韶钢松山	6,309,757.00	9.24
63	600460	士兰微	6,175,365.00	9.05
64	000062	深圳华强	6,114,126.00	8.96
65	000776	广发证券	6,072,144.00	8.89
66	300463	迈克生物	6,060,524.00	8.88
67	601928	凤凰传媒	5,910,158.00	8.66
68	300146	汤臣倍健	5,877,664.00	8.61
69	600563	法拉电子	5,858,882.77	8.58
70	300357	我武生物	5,818,726.80	8.52
71	600325	华发股份	5,806,392.00	8.50
72	600546	山煤国际	5,651,239.00	8.28
73	300482	万孚生物	5,648,180.00	8.27
74	300009	安科生物	5,629,790.00	8.25
75	603267	鸿远电子	5,599,307.00	8.20
76	603868	飞科电器	5,527,140.00	8.10
77	601377	兴业证券	5,479,437.00	8.03
78	000488	晨鸣纸业	5,461,723.00	8.00
79	000723	美锦能源	5,397,164.00	7.91
80	000739	普洛药业	5,371,754.00	7.87
81	300751	迈为股份	5,360,365.16	7.85
82	600803	新奥股份	5,325,611.00	7.80
83	600760	中航沈飞	5,156,439.00	7.55
84	603589	口子窖	5,130,531.00	7.51
85	000671	阳光城	5,121,840.00	7.50

86	000598	兴蓉环境	5,004,498.00	7.33
87	002244	滨江集团	4,960,248.00	7.27
88	002028	思源电气	4,831,233.54	7.08
89	603515	欧普照明	4,593,295.78	6.73
90	002458	益生股份	4,472,305.00	6.55
91	002128	电投能源	4,213,525.03	6.17
92	603355	莱克电气	4,109,563.40	6.02
93	688005	容百科技	4,037,711.05	5.91
94	601689	拓普集团	3,993,589.28	5.85
95	000581	威孚高科	3,905,320.99	5.72
96	002080	中材科技	3,770,037.00	5.52
97	603613	国联股份	3,758,545.00	5.51
98	600132	重庆啤酒	3,598,099.00	5.27
99	002532	天山铝业	3,443,614.00	5.04
100	600195	中牧股份	3,342,292.00	4.90
101	300699	光威复材	3,325,424.00	4.87
102	601919	中远海控	3,324,331.00	4.87
103	600507	方大特钢	3,182,676.00	4.66
104	300014	亿纬锂能	3,170,525.00	4.64
105	002110	三钢闽光	3,024,868.00	4.43
106	688357	建龙微纳	2,999,150.68	4.39
107	300618	寒锐钴业	2,988,400.00	4.38
108	600998	九州通	2,887,701.00	4.23
109	603638	艾迪精密	2,844,239.60	4.17
110	002382	蓝帆医疗	2,821,582.00	4.13
111	603077	和邦生物	2,814,716.00	4.12
112	600039	四川路桥	2,782,511.93	4.08
113	002327	富安娜	2,720,010.16	3.98
114	002978	安宁股份	2,715,612.00	3.98
115	002603	以岭药业	2,712,631.80	3.97
116	600398	海澜之家	2,689,863.00	3.94
117	600895	张江高科	2,680,016.00	3.93
118	600030	中信证券	2,624,181.00	3.84
119	603659	璞泰来	2,591,853.00	3.80
120	603377	东方时尚	2,536,402.60	3.72
121	603806	福斯特	2,524,099.00	3.70
122	002563	森马服饰	2,481,472.00	3.63
123	002508	老板电器	2,457,807.00	3.60
124	002223	鱼跃医疗	2,456,812.00	3.60
125	600409	三友化工	2,386,977.00	3.50
126	002879	长缆科技	2,382,293.40	3.49
127	002884	凌霄泵业	2,340,110.10	3.43

128	688536	思瑞浦	2,309,388.00	3.38
129	605123	派克新材	2,309,106.25	3.38
130	603095	越剑智能	2,238,592.00	3.28
131	002850	科达利	2,235,318.00	3.27
132	600765	中航重机	2,190,223.00	3.21
133	603737	三棵树	2,166,419.00	3.17
134	300122	智飞生物	2,132,952.00	3.12
135	600131	国网信通	2,063,908.38	3.02
136	002422	科伦药业	2,059,126.00	3.02
137	300003	乐普医疗	2,038,346.00	2.99
138	600395	盘江股份	2,004,967.00	2.94
139	688308	欧科亿	1,999,630.66	2.93
140	600089	特变电工	1,979,804.00	2.90
141	002254	泰和新材	1,958,331.00	2.87
142	603392	万泰生物	1,920,620.41	2.81
143	601865	福莱特	1,919,765.00	2.81
144	002294	信立泰	1,896,351.26	2.78
145	603599	广信股份	1,856,713.00	2.72
146	300873	海晨股份	1,839,072.00	2.69
147	300595	欧普康视	1,831,030.00	2.68
148	601857	中国石油	1,794,205.00	2.63
149	603606	东方电缆	1,750,127.00	2.56
150	600966	博汇纸业	1,734,525.00	2.54
151	688200	华峰测控	1,703,284.32	2.49
152	601899	紫金矿业	1,694,545.00	2.48
153	300662	科锐国际	1,678,382.00	2.46
154	600436	片仔癀	1,676,930.00	2.46
155	002818	富森美	1,651,270.00	2.42
156	603610	麒盛科技	1,648,428.00	2.41
157	002368	太极股份	1,631,500.00	2.39
158	300260	新莱应材	1,630,845.00	2.39
159	300327	中颖电子	1,630,610.00	2.39
160	600919	江苏银行	1,629,860.00	2.39
161	300347	泰格医药	1,629,679.00	2.39
162	300596	利安隆	1,618,208.00	2.37
163	300705	九典制药	1,603,245.00	2.35
164	000708	中信特钢	1,558,649.00	2.28
165	600426	华鲁恒升	1,544,032.00	2.26
166	688122	西部超导	1,535,450.42	2.25
167	000400	许继电气	1,509,549.82	2.21
168	002129	中环股份	1,495,238.00	2.19
169	601601	中国太保	1,479,790.00	2.17

170	002436	兴森科技	1,473,721.00	2.16
171	601882	海天精工	1,472,385.00	2.16
172	000825	太钢不锈	1,458,648.00	2.14
173	000555	神州信息	1,435,347.38	2.10
174	601225	陕西煤业	1,433,994.00	2.10
175	605111	新洁能	1,422,874.00	2.08
176	603882	金域医学	1,416,104.00	2.07
177	600183	生益科技	1,412,691.00	2.07
178	002064	华峰化学	1,396,972.00	2.05
179	000725	京东方 A	1,396,899.00	2.05
180	002557	洽洽食品	1,390,028.00	2.04
181	688356	键凯科技	1,388,416.01	2.03
182	002183	怡亚通	1,380,527.00	2.02

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。

#### 8.4.2 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	000799	酒鬼酒	24,787,024.00	36.31
2	002709	天赐材料	21,905,750.00	32.09
3	603444	吉比特	20,750,573.00	30.39
4	002648	卫星化学	17,756,765.75	26.01
5	603260	合盛硅业	16,769,742.00	24.56
6	603568	伟明环保	16,499,167.00	24.17
7	603290	斯达半导	15,938,728.00	23.35
8	601233	桐昆股份	15,707,558.00	23.01
9	603486	科沃斯	15,648,158.00	22.92
10	688208	道通科技	14,274,186.73	20.91
11	002266	浙富控股	14,149,911.58	20.73
12	002925	盈趣科技	12,419,531.40	18.19
13	603225	新凤鸣	12,093,881.28	17.71
14	000807	云铝股份	11,992,371.23	17.57
15	600141	兴发集团	11,480,385.93	16.82
16	300223	北京君正	11,263,009.00	16.50
17	601636	旗滨集团	11,120,013.32	16.29
18	002396	星网锐捷	11,005,618.00	16.12
19	000039	中集集团	10,815,704.00	15.84
20	002985	北摩高科	10,781,329.00	15.79
21	300059	东方财富	10,695,748.00	15.67
22	000887	中鼎股份	10,276,712.93	15.05
23	002690	美亚光电	10,136,273.00	14.85
24	300244	迪安诊断	9,752,360.25	14.28

25	000830	鲁西化工	8,805,062.00	12.90
26	600884	杉杉股份	8,556,714.03	12.53
27	002901	大博医疗	8,376,198.00	12.27
28	605358	立昂微	8,121,554.00	11.90
29	002372	伟星新材	8,002,543.00	11.72
30	600171	上海贝岭	7,933,573.00	11.62
31	300146	汤臣倍健	7,857,978.00	11.51
32	600563	法拉电子	7,421,869.70	10.87
33	600779	水井坊	7,225,484.00	10.58
34	300463	迈克生物	7,217,171.52	10.57
35	300251	光线传媒	7,151,045.00	10.47
36	600729	重庆百货	7,062,723.96	10.34
37	002867	周大生	6,961,406.00	10.20
38	600885	宏发股份	6,901,872.00	10.11
39	002028	思源电气	6,812,011.66	9.98
40	600507	方大特钢	6,401,224.00	9.38
41	002156	通富微电	6,255,309.14	9.16
42	000636	风华高科	6,215,632.00	9.10
43	600460	士兰微	6,193,159.64	9.07
44	601928	凤凰传媒	6,187,181.00	9.06
45	600707	彩虹股份	6,161,298.00	9.02
46	002382	蓝帆医疗	6,076,510.30	8.90
47	603156	养元饮品	6,048,427.00	8.86
48	600803	新奥股份	6,048,130.00	8.86
49	000723	美锦能源	5,871,412.00	8.60
50	002078	太阳纸业	5,862,449.00	8.59
51	000739	普洛药业	5,763,500.00	8.44
52	000012	南玻 A	5,650,522.00	8.28
53	002458	益生股份	5,434,075.00	7.96
54	600808	马钢股份	5,426,102.00	7.95
55	000960	锡业股份	5,238,794.00	7.67
56	600325	华发股份	5,128,390.00	7.51
57	600760	中航沈飞	5,075,567.00	7.43
58	000717	韶钢松山	4,993,146.00	7.31
59	000488	晨鸣纸业	4,964,918.00	7.27
60	603198	迎驾贡酒	4,900,849.00	7.18
61	688099	晶晨股份	4,768,763.80	6.98
62	300482	万孚生物	4,704,442.00	6.89
63	300316	晶盛机电	4,689,658.00	6.87
64	603882	金域医学	4,411,676.00	6.46
65	002244	滨江集团	4,382,660.00	6.42
66	002080	中材科技	4,328,467.63	6.34

67	002572	索菲亚	4,252,665.00	6.23
68	601865	福莱特	4,009,497.26	5.87
69	300418	昆仑万维	3,968,439.00	5.81
70	600132	重庆啤酒	3,861,604.00	5.66
71	300274	阳光电源	3,786,837.00	5.55
72	000581	威孚高科	3,751,107.00	5.49
73	603515	欧普照明	3,724,357.00	5.46
74	002532	天山铝业	3,710,799.00	5.44
75	603355	莱克电气	3,605,990.00	5.28
76	600867	通化东宝	3,573,495.00	5.23
77	002110	三钢闽光	3,412,296.00	5.00
78	002128	电投能源	3,368,508.00	4.93
79	002557	洽洽食品	3,320,927.65	4.86
80	600039	四川路桥	3,275,409.00	4.80
81	600195	中牧股份	3,233,044.82	4.74
82	000671	阳光城	3,182,179.00	4.66
83	603816	顾家家居	3,116,157.00	4.56
84	603806	福斯特	3,115,809.00	4.56
85	601919	中远海控	3,113,288.80	4.56
86	300014	亿纬锂能	3,102,658.00	4.54
87	603659	璞泰来	3,038,766.00	4.45
88	300037	新宙邦	3,005,406.00	4.40
89	300699	光威复材	2,998,605.00	4.39
90	603650	彤程新材	2,959,954.88	4.34
91	002030	达安基因	2,929,279.70	4.29
92	603737	三棵树	2,913,915.00	4.27
93	603606	东方电缆	2,904,410.00	4.25
94	300618	寒锐钴业	2,786,627.00	4.08
95	600398	海澜之家	2,773,563.00	4.06
96	002879	长缆科技	2,718,930.20	3.98
97	603377	东方时尚	2,662,386.00	3.90
98	600862	中航高科	2,660,677.00	3.90
99	600030	中信证券	2,643,681.00	3.87
100	002884	凌霄泵业	2,628,436.00	3.85
101	603866	桃李面包	2,612,263.00	3.83
102	600895	张江高科	2,571,855.00	3.77
103	603638	艾迪精密	2,526,936.00	3.70
104	002327	富安娜	2,520,243.00	3.69
105	002223	鱼跃医疗	2,472,477.00	3.62
106	600998	九州通	2,455,865.00	3.60
107	600409	三友化工	2,376,917.00	3.48
108	300630	普利制药	2,367,118.00	3.47

109	002603	以岭药业	2,344,784.00	3.43
110	601799	星宇股份	2,333,406.00	3.42
111	002422	科伦药业	2,199,580.00	3.22
112	002444	巨星科技	2,171,047.00	3.18
113	002563	森马服饰	2,158,707.00	3.16
114	300595	欧普康视	2,154,231.00	3.16
115	002507	涪陵榨菜	2,118,551.00	3.10
116	600131	国网信通	2,057,388.94	3.01
117	300122	智飞生物	1,945,874.00	2.85
118	601857	中国石油	1,934,070.00	2.83
119	603707	健友股份	1,899,562.00	2.78
120	600089	特变电工	1,775,961.00	2.60
121	002368	太极股份	1,764,165.40	2.58
122	002254	泰和新材	1,761,912.00	2.58
123	000400	许继电气	1,696,613.00	2.49
124	605123	派克新材	1,659,951.00	2.43
125	002705	新宝股份	1,639,825.00	2.40
126	688002	睿创微纳	1,634,105.30	2.39
127	300003	乐普医疗	1,630,756.00	2.39
128	600966	博汇纸业	1,623,928.00	2.38
129	002408	齐翔腾达	1,596,226.00	2.34
130	603886	元祖股份	1,562,554.00	2.29
131	000776	广发证券	1,560,892.00	2.29
132	601377	兴业证券	1,542,680.00	2.26
133	600809	山西汾酒	1,542,080.00	2.26
134	600466	蓝光发展	1,503,211.00	2.20
135	600919	江苏银行	1,492,731.00	2.19
136	601225	陕西煤业	1,492,711.00	2.19
137	002818	富森美	1,467,000.00	2.15
138	300705	九典制药	1,463,113.00	2.14
139	601601	中国太保	1,457,336.00	2.13

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。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,292,142,518.22
卖出股票收入（成交）总额	968,240,465.59

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。

#### 8.5 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	16,115,707.80	3.62
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）	63,508.90	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,179,216.70	3.64

### 8.6 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	019654	21 国债 06	160,980	16,115,707.80	3.62
2	113633	科沃转债	490	63,508.90	0.01
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2201	IC2201	1	1,475,560.00	30,200.00	本基金在进行股指期货投资时，遵守法律法规的规定和基金合同的约定，符合既定的投资策略和投资目标。采用流动性好、交易活跃的期货合约，对现货资产进行部分对冲，以增厚整个组合的风险调整后的收益。基金
IC2202	IC2202	3	4,410,360.00	54,600.00	
IC2206	IC2206	2	2,859,120.00	44,800.00	



					管理人将充分考虑股指期货的收益特征、流动性以及风险特征,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
公允价值变动总额合计(元)					129,600.00
股指期货投资本期收益(元)					520,121.17
股指期货投资本期公允价值变动(元)					113,060.00

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金在进行股指期货投资时,遵守法律法规的规定和基金合同的约定,符合既定的投资策略和投资目标。采用流动性好、交易活跃的期货合约,对现货资产进行部分对冲,以增厚整个组合的风险调整后的收益。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等,暂不参与国债期货交易。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:无。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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

本报告期本基金投资的前十名证券发行主体未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。

#### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	1,428,495.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	272,973.97
5	应收申购款	8,101,558.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,803,027.97

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 500 指数 增强 A	36,607	3,696.97	37,026,144.64	27.36	98,308,764.33	72.64
长城中证 500 指数 增强 C	17,413	6,723.76	90,738,834.83	77.50	26,342,050.39	22.50
合计	54,020	4,672.64	127,764,979.47	50.62	124,650,814.72	49.38

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）。

### 9.2 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 500 指数增强 A	806,755.17	0.5961
	长城中证 500 指数增强 C	120,742.57	0.1031
	合计	927,497.74	0.3674

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）。

### 9.3 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 500 指数增强 A	10~50
	长城中证 500 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	长城中证 500 指数增强 A	0
	长城中证 500 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。

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
雷俊	公募基金	50~100
	私募资产管理计划	0
	合计	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2018 年 8 月 13 日)	19,420,400.59	-

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	42,142,233.84	6,626,327.85
本报告期基金总申购份额	204,043,489.21	253,756,965.48
减：本报告期基金总赎回份额	110,850,814.08	143,302,408.11
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	135,334,908.97	117,080,885.22

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人以通讯方式组织召开了长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会，于 2021 年 9 月 29 日表决通过了《关于长城中证 500 指数增强型证券投资基金新增业务及修改投资组合比例等有关事项的议案》，并根据会议议案修订、更新了《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》、《长城中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》、《长城中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》及《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要》中的相关内容。具体内容详见本基金管理人于 2021 年 9 月 30 日发布的《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》及《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件。

### 11.2 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 2021 年 4 月 14 日起，许明波先生不再担任公司董事，由曾晓玲女士担任公司董事。

自 2021 年 7 月 20 日起，赵建兴先生不再担任公司副总经理、首席信息官。

自 2021 年 7 月 30 日起，由邱春杨先生兼任公司首席信息官。

自 2021 年 9 月 30 日起，袁柳生先生不再担任公司职工监事。

自 2021 年 11 月 11 日起，由侯涛先生担任公司职工监事。

#### 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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

根据长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会决议，长城中证 500 指数增强型证券投资基金于 2021 年 9 月 30 日新增融资、转融通证券出借业务，投资策略中增加了参与融资及转融通证券出借业务策略。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

- 1、本期未有改聘会计师事务所。
- 2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币叁万元。
- 3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

### 11.6 管理人、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，本基金管理人、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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	7	2,252,783,616.77	100.00%	521,079.34	100.00%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

中银国际	2	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内新增 4 个专用交易单元（粤开证券、中银国际各新增 2 个交易单元），截止本报告期末共计 65 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务；
- (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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	23,213,764.76	100.00%	188,600,000.00	100.00%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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参加宁波银行费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 1 月 27 日
2	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 2 月 8 日
3	长城基金管理有限公司关于调整旗下	中国证监会规定报刊及	2021 年 2 月 23 日



	基金所持停牌股票估值方法的公告 (盛达资源)	网站	
4	关于长城中证 500 指数增强型证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 3 月 30 日
5	长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 4 月 27 日
6	长城基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并更新、完善身份信息以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 7 月 1 日
7	关于变更公司副总经理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 7 月 22 日
8	关于以通讯方式召开长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 8 月 30 日
9	关于以通讯方式召开长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 8 月 31 日
10	关于以通讯方式召开长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 9 月 1 日
11	长城中证 500 指数增强型证券投资基金持有人大会表决结果暨决议生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 9 月 30 日
12	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 11 月 9 日
13	长城基金管理有限公司关于北京分公司营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 12 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20210611-20210708	-	34,945,144.49	6,245,873.05	28,699,271.44	11.3698
产品特有风险							
<p>如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：</p> <p>1、流动性风险 本基金在短时间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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更注册的文件
- （二）《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- （三）《长城中证 500 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

### 13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 13.3 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：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)