

景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 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。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50

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	50
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	50
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12	投资组合报告附注	51
§ 8	基金份额持有人信息	52
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9	开放式基金份额变动	53
§ 10	重大事件揭示	53
10.1	基金份额持有人大会决议	53
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	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4	基金投资策略的改变	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8	其他重大事件	57
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12	备查文件目录	60
12.1	备查文件目录	60
12.2	存放地点	60
12.3	查阅方式	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城沪深 300 指数增强	
场内简称	无	
基金主代码	000311	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 10 月 29 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,997,981,315.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	000311	015679
报告期末下属分级基金的份额总额	1,997,143,543.75 份	837,771.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	<p>1、资产配置策略:本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略:本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>3、债券投资策略:出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>4、权证、股指期货投资策略:本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成分股、备选成分股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>5、中小企业私募债券的投资策略:对单个券种的分析判断与其它信</p>

	用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳	秦一楠
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		李进	谷澍

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.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	2022 年 05 月 05 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日
		景顺长城沪深 300 指数增强 A
本期已实现收益	-638,447,113.24	32,130.34

本期利润	-433,163,693.56	154,377.08
加权平均基金份额本期利润	-0.2212	0.4172
本期加权平均净值利润率	-9.20%	17.71%
本期基金份额净值增长率	-8.77%	10.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	2,463,626,401.23	1,032,844.07
期末可供分配基金份额利润	1.2336	1.2328
期末基金资产净值	4,962,737,866.84	2,081,138.70
期末基金份额净值	2.485	2.484
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	192.22%	10.60%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

5、本基金于 2022 年 4 月 29 日增设 C 类基金份额，并于 2022 年 5 月 5 日开始对 C 类份额进行估值。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城沪深 300 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	9.96%	0.99%	9.26%	1.02%	0.70%	-0.03%
过去三个月	3.54%	1.34%	6.32%	1.36%	-2.78%	-0.02%
过去六个月	-8.77%	1.34%	-8.05%	1.38%	-0.72%	-0.04%

过去一年	-15.85%	1.17%	-12.11%	1.18%	-3.74%	-0.01%
过去三年	20.63%	1.21%	21.96%	1.20%	-1.33%	0.01%
自基金合同生效起至今	192.22%	1.43%	111.13%	1.37%	81.09%	0.06%

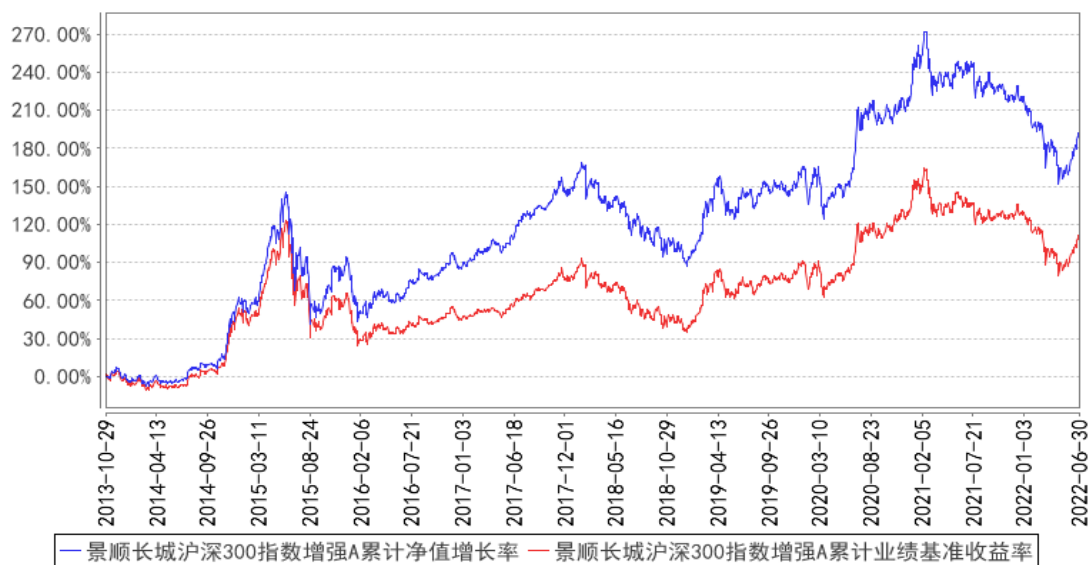
景顺长城沪深 300 指数增强 C

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	9.91%	0.99%	9.26%	1.02%	0.65%	-0.03%
自基金合同生效起至今	10.60%	1.05%	11.33%	1.08%	-0.73%	-0.03%

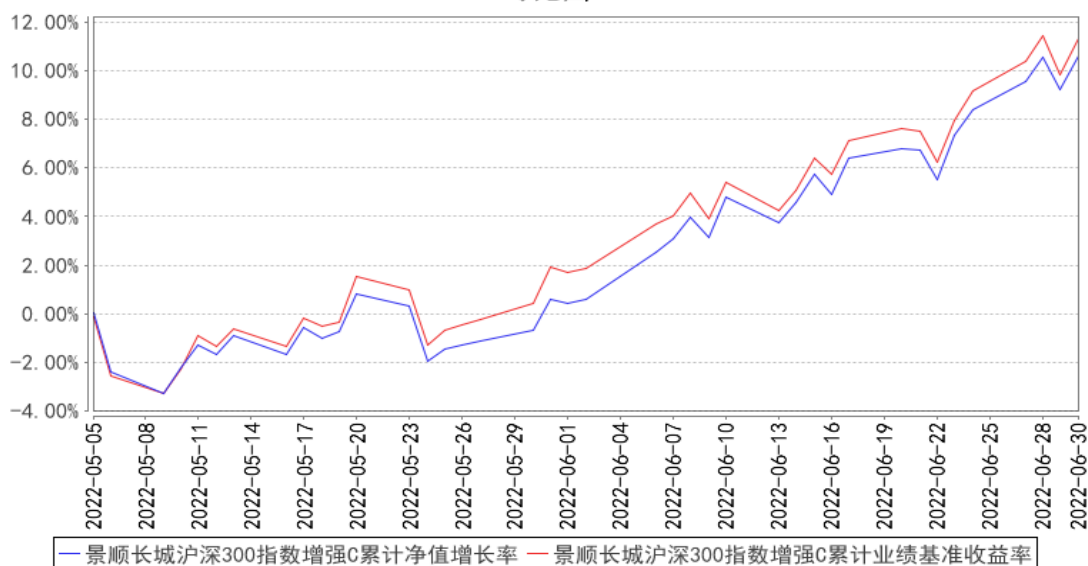
注：本基金于 2022 年 4 月 29 日增设 C 类基金份额，并于 2022 年 5 月 5 日开始对 C 类份额进行估值。

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

景顺长城沪深300指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城沪深300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：本基金的资产配置比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2013 年 10 月 29 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2022 年 4 月 29 日起增设 C 类基金份额。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2022 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 150 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黎海威	本基金的基金经理	2013 年 10 月 29 日	-	19 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 19 年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 27 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，俄乌冲突、美联储加息、新冠疫情等内外部因素引发全球资本市场的风险偏好下行。随着国内疫情逐步得到控制、稳增长政策的不断加码，消费和出行需求复苏，经济逐步回暖。从国内来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 47.4、49.6、50.2，今年前 6 个月工业增加值累计同比上升 3.4%，其中 6 月份工业增加值当月同比增长 3.9%，经济复苏趋势明显。6 月 PPI 同比上升 6.1%，环比持平；CPI 同比上升 2.5%，环比持平，通胀依旧温和。6 月 M2 同比增长 11.4%，M1 同比增长 5.8%，流动性充裕；6 月末外汇储备 3.07 万亿美元，汇率维持平稳。整体而言，国内货币政策总体保持稳健，流动性充裕，宏观环境总体温和，经济呈现出弱复苏的态势。上半年 A 股权益市场出现大幅波动，1-4 月份市场出现连续下跌，4 月末以来市场风险偏好有所提升，前期下跌较多的成长板块表现突出。综合来看，上半年上证指数、沪深 300 指数以及创业板指数分别下跌 6.63%、9.22% 和 15.41%。

本基金是以沪深 300 指数为基准的指数增强基金，我们的投资组合主要以基本面量化选股为主，风格上维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生持续稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022 年上半年，景顺长城沪深 300 指数增强 A 类份额净值增长率为 -8.77%，业绩比较基准收益率为 -8.05%。

2022 年 5 月 5 日（C 类基金份额首个估值日）至 2022 年 6 月 30 日，景顺长城沪深 300 指数增强 C 类份额净值增长率为 10.60%，业绩比较基准收益率为 11.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，海外方面，俄乌冲突、美联储加息对国内资本市场的边际影响明显降低。国内方面，我们对宏观场景的判断倾向于“宽货币、宽信用”，随着稳增长政策效应的逐步显现，盈利下行周期进入末段。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入

长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和

《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	148,537,872.50	196,724,393.94
结算备付金		16,244,729.74	16,397,497.27
存出保证金		968,611.47	457,678.51
交易性金融资产	6.4.7.2	4,834,008,444.80	5,052,858,176.00
其中：股票投资		4,691,334,061.24	4,913,082,176.00
基金投资		-	-
债券投资		142,674,383.56	139,776,000.00
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		46,405,795.47	86,930.17
应收股利		-	-
应收申购款		3,625,302.58	5,806,967.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	1,240,702.00
资产总计		5,049,790,756.56	5,273,572,345.49
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		68,125,663.38	7,254,535.71
应付管理人报酬		3,938,199.41	4,386,233.55
应付托管费		787,639.85	877,246.73
应付销售服务费		229.35	-
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	6.4.7.6	12,120,019.03	8,879,036.46
负债合计		84,971,751.02	21,397,052.45
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,997,981,315.72	1,927,875,014.16
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	2,966,837,689.82	3,324,300,278.88
净资产合计		4,964,819,005.54	5,252,175,293.04
负债和净资产总计		5,049,790,756.56	5,273,572,345.49

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,997,981,315.72 份，其中景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 2.485 元，份额总额 1,997,143,543.75 份；景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 C 类基金份额净值人民币 2.484 元，份额总额 837,771.97 份。

（2）以下比较数据已根据本年《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》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-404,437,459.04	472,967,672.30
1. 利息收入		717,230.84	3,041,258.96
其中：存款利息收入	6.4.7.9	717,230.84	744,715.35
债券利息收入		-	2,296,543.61
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）		-611,793,447.20	812,552,365.13
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-666,756,911.73	767,140,537.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	6,244,565.77	2,626,287.73
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	48,718,898.76	42,785,539.79
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）	6.4.7.14	205,405,666.42	-345,384,559.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,233,090.90	2,758,607.48

减：二、营业总支出		28,571,857.44	65,362,978.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	23,379,831.51	26,431,648.73
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,675,966.27	5,286,329.80
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	268.23	-
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		-	-
7. 税金及附加		4.04	3.49
8. 其他费用	6.4.7.16	515,787.39	33,644,996.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-433,009,316.48	407,604,693.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-433,009,316.48	407,604,693.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-433,009,316.48	407,604,693.72

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,927,875,014.16	-	3,324,300,278.88	5,252,175,293.04
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,927,875,014.16	-	3,324,300,278.88	5,252,175,293.04
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	70,106,301.56	-	-357,462,589.06	-287,356,287.50

(一)、综合收益总额	-	-	-433,009,316.48	-433,009,316.48
(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)	70,106,301.56	-	75,546,727.42	145,653,028.98
其中: 1. 基金申购款	589,689,995.01	-	821,947,418.08	1,411,637,413.09
2. 基金赎回款	-519,583,693.45	-	-746,400,690.66	-1,265,984,384.11
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,997,981,315.72	-	2,966,837,689.82	4,964,819,005.54
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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)	2,413,006,459.22	-	4,335,523,589.65	6,748,530,048.87
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,413,006,459.22	-	4,335,523,589.65	6,748,530,048.87
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-613,207,675.71	-	-821,339,355.79	-1,434,547,031.50
(一)、综合收益总额	-	-	407,604,693.72	407,604,693.72
(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)	-613,207,675.71	-	-1,228,944,049.51	-1,842,151,725.22
其中: 1. 基金申购款	774,393,588.84	-	1,476,381,574.68	2,250,775,163.52

2. 基金赎回款	-1,387,601,264.55	-	-2,705,325,624.19	-4,092,926,888.74
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,799,798,783.51	-	3,514,184,233.86	5,313,983,017.37

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>康乐</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</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

景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]1028 号文《关于核准景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金募集的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2013 年 10 月 29 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 381,986,684.48 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 155,294.37 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 382,141,978.85 元，折合 382,141,978.85 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》的约定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2022 年 4 月 29 日起对景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中

计提销售服务费。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包含创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

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

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 \times 95%+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2022 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除了由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于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，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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。

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计

入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 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。

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

新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 196,724,393.94 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 37,939.12 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 196,762,333.06 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 16,397,497.27 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 7,378.90 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 16,404,876.17 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 457,678.51 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 205.90 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 457,884.41 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,240,702.00 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 37,939.12 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 7,378.90 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 205.90 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 1,195,178.08 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,052,858,176.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,195,178.08 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,054,053,354.08 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

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

(2) 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基

金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

(3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

(4) 企业所得税

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

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

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

(5) 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2022 年 6 月 30 日	
活期存款	148,537,872.50	
等于：本金	148,512,143.52	
加：应计利息	25,728.98	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	148,537,872.50	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	4,400,583,899.89	-	4,691,334,061.24	290,750,161.35	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	139,738,620.00	2,618,383.56	142,674,383.56	317,380.00
	合计	139,738,620.00	2,618,383.56	142,674,383.56	317,380.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	4,540,322,519.89	2,618,383.56	4,834,008,444.80	291,067,541.35	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末的买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	236,483.34
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,380,986.09
其中：交易所市场	11,380,986.09
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	128,472.33
应付指数使用费	374,077.27
合计	12,120,019.03

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城沪深 300 指数增强 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,927,875,014.16	1,927,875,014.16
本期申购	588,286,644.35	588,286,644.35
本期赎回（以“-”号填列）	-519,018,114.76	-519,018,114.76
本期末	1,997,143,543.75	1,997,143,543.75

景顺长城沪深 300 指数增强 C

项目	本期 2022年5月5日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	1,403,350.66	1,403,350.66

本期赎回（以“-”号填列）	-565,578.69	-565,578.69
本期末	837,771.97	837,771.97

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城沪深 300 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	3,006,909,395.09	317,390,883.79	3,324,300,278.88
本期利润	-638,447,113.24	205,283,419.68	-433,163,693.56
本期基金份额交易产生的变动数	95,164,119.38	-20,706,381.61	74,457,737.77
其中：基金申购款	814,035,473.66	6,055,003.26	820,090,476.92
基金赎回款	-718,871,354.28	-26,761,384.87	-745,632,739.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,463,626,401.23	501,967,921.86	2,965,594,323.09

景顺长城沪深 300 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	32,130.34	122,246.74	154,377.08
本期基金份额交易产生的变动数	1,000,713.73	88,275.92	1,088,989.65
其中：基金申购款	1,677,740.50	179,200.66	1,856,941.16
基金赎回款	-677,026.77	-90,924.74	-767,951.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,032,844.07	210,522.66	1,243,366.73

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	551,463.02
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	160,002.59
其他	5,765.23
合计	717,230.84

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	13,227,806,976.14
减：卖出股票成本总额	13,854,669,513.12

减：交易费用	39,894,374.75
买卖股票差价收入	-666,756,911.73

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,428,334.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,816,231.61
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	6,244,565.77

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	25,474,419.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,653,000.00
减：应计利息总额	5,162.20
减：交易费用	25.29
买卖债券差价收入	4,816,231.61

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	48,718,898.76
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	48,718,898.76

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	205,405,666.42

股票投资	205,125,666.42
债券投资	280,000.00
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	205,405,666.42

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,163,792.69
基金转换费收入	69,298.21
合计	1,233,090.90

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	64,464.96
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	8,737.79
指数使用费	374,077.27
合计	515,787.39

6.4.7.17 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
长城证券	723,649,868.24	2.72	1,330,705,456.54	6.28

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	673,934.59	2.77	673,934.59	5.92
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	1,239,289.43	6.31	1,239,289.43	12.51

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	23,379,831.51	26,431,648.73
其中：支付销售机构的客户维护费	7,165,369.42	8,789,586.08

注：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,675,966.27	5,286,329.80

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	16.36	16.36
农业银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	16.36	16.36

注：自 2022 年 4 月 29 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转

为 A 类基金份额。

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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
农业银行-活期	148,537,872.50	551,463.02	169,143,999.11	604,842.70

注：本基金的活期银行存款由基金托管人农业银行保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	6 个月	新股流通受限	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022 年 1 月 10 日	6 个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301123	奕东电子	2022 年 1 月 14 日	6 个月	新股流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301125	腾亚精工	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	6 个月	新股流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301137	哈焊华通	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301148	嘉戎技术	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301151	冠龙节能	2022 年 3 月 30 日	6 个月	新股流通受限	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	6 个月	新股流通受限	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	6 个月	新股流通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301160	翔楼新材	2022 年 5 月 25 日	6 个月	新股流通受限	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301162	国能日新	2022 年 4 月 19 日	6 个月	新股流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301163	宏德股份	2022 年 4 月 11 日	6 个月	新股流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301187	欧圣电气	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301212	联盛化学	2022 年 4 月 7 日	6 个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	173.98	87.82	321	55,847.58	28,190.22	-
301219	腾远钴业	2022 年 5 月 24 日	4 个月	新股流通受限-转增	-	87.82	257	-	22,569.74	-
301220	亚香股份	2022 年 6 月 15 日	6 个月	新股流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301228	实朴检测	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-

301238	瑞泰新材	2022 年 6 月 10 日	6 个月	新股流通受限	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月(含)	新股流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	6 个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	6 个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022 年 4 月 18 日	6 个月	新股流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	6 个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301266	宇邦新材	2022 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301279	金道科技	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301286	侨源股份	2022 年 6 月 6 日	6 个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
600938	中国海油	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688120	华海清科	2022 年 5 月 30 日	6 个月	新股流通受限	136.66	217.12	4,822	658,974.52	1,046,952.64	-
688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月(含)	新股流通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688322	奥比中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月(含)	新股流通受限	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
688348	昱能科技	2022 年 5 月 31 日	6 个月	新股流通受限	163.00	416.57	5,644	919,972.00	2,351,121.08	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月(含)	新股流通受限	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

注：受限期内，本基金因上市公司发生股票红利、送股、资本公积转增股本、配股等权益行为获取的衍生股份，亦应遵守相关股份的受限安排。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	148,537,872.50	-	-	-	-	-	148,537,872.50
结算备付金	16,244,729.74	-	-	-	-	-	16,244,729.74
存出保证金	968,611.47	-	-	-	-	-	968,611.47
交易性金融资产	-	142,674,383.56	-	-	-	4,691,334,061.24	4,834,008,444.80
应收申购款	-	-	-	-	-	3,625,302.58	3,625,302.58
应收证券清算款	-	-	-	-	-	46,405,795.47	46,405,795.47
资产总计	165,751,213.71	142,674,383.56	-	-	-	4,741,365,159.29	5,049,790,756.56
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	68,125,663.38	68,125,663.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,938,199.41	3,938,199.41
应付托管费	-	-	-	-	-	787,639.85	787,639.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	229.35	229.35
其他负债	-	-	-	-	-	12,120,019.03	12,120,019.03
负债总计	-	-	-	-	-	84,971,751.02	84,971,751.02
利率敏感度缺口	165,751,213.71	142,674,383.56	-	-	-	-	-
上年度末 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	196,724,393.94	-	-	-	-	-	196,724,393.94
结算备付金	16,397,497.27	-	-	-	-	-	16,397,497.27
存出保证金	457,678.51	-	-	-	-	-	457,678.51
交易性金融资产	-	-	139,776,000.00	-	-	4,913,082,176.00	5,052,858,176.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,240,702.00	1,240,702.00
应收申购款	-	-	-	-	-	5,806,967.60	5,806,967.60
应收证券清算款	-	-	-	-	-	86,930.17	86,930.17
资产总计	213,579,569.72	-	139,776,000.00	-	-	4,920,216,775.77	5,273,572,345.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,254,535.71	7,254,535.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,386,233.55	4,386,233.55
应付托管费	-	-	-	-	-	877,246.73	877,246.73

应付交易费用	-	-	-	-	8,406,044.08	8,406,044.08
其他负债	-	-	-	-	472,992.38	472,992.38
负债总计	-	-	-	-	21,397,052.45	21,397,052.45
利率敏感度缺口	213,579,569.72	-139,776,000.00	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-31,610.51	-201,858.69
	市场利率下降 25 个基点	31,624.78	202,443.39

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。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大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它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的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 2022年6月30日		上年度末 2021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	4,691,334,061.24	94.49	4,913,082,176.00	93.54
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,691,334,061.24	94.49	4,913,082,176.00	93.54

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	225,487,126.89	234,400,269.74
	沪深 300 指数下降 5%	-225,487,126.89	-234,400,269.74

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	4,684,687,036.30	4,904,776,803.99
第二层次	143,821,692.60	148,081,372.01
第三层次	5,499,715.90	-
合计	4,834,008,444.80	5,052,858,176.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,691,334,061.24	92.90
	其中：股票	4,691,334,061.24	92.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	142,674,383.56	2.83
	其中：债券	142,674,383.56	2.83
	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	164,782,602.24	3.26
8	其他各项资产	50,999,709.52	1.01
9	合计	5,049,790,756.56	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	32,767,439.00	0.66
B	采矿业	133,821,373.38	2.70
C	制造业	2,261,233,464.71	45.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	81,881,139.86	1.65
E	建筑业	165,837,900.80	3.34
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	43,697,532.82	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	175,521,848.40	3.54
J	金融业	944,226,643.99	19.02
K	房地产业	97,739,003.48	1.97
L	租赁和商务服务业	7,255,769.50	0.15
M	科学研究和技术服务业	103,814,779.95	2.09

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	37,329,110.00	0.75
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,085,126,005.89	82.28

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	74,267,571.25	1.50
C	制造业	435,521,447.18	8.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,316,590.00	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	36,157,740.16	0.73
G	交通运输、仓储和邮政业	28,281,232.96	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	315,617.58	0.01
J	金融业	3,262,438.00	0.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,716,946.82	0.26
M	科学研究和技术服务业	53,749.33	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	24,378.42	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,290,343.65	0.21
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	606,208,055.35	12.21

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	158,875	324,899,375.00	6.54
2	300750	宁德时代	339,619	181,356,546.00	3.65
3	600030	中信证券	6,393,940	138,492,740.40	2.79
4	601668	中国建筑	23,140,040	123,105,012.80	2.48
5	601658	邮储银行	21,518,927	115,987,016.53	2.34

6	600887	伊利股份	2,905,461	113,167,705.95	2.28
7	002460	赣锋锂业	691,071	102,762,257.70	2.07
8	601319	中国人保	19,767,630	100,024,207.80	2.01
9	600809	山西汾酒	286,456	93,040,908.80	1.87
10	000333	美的集团	1,453,160	87,756,332.40	1.77
11	600036	招商银行	2,026,485	85,517,667.00	1.72
12	002475	立讯精密	2,515,001	84,981,883.79	1.71
13	600438	通威股份	1,398,970	83,742,344.20	1.69
14	603259	药明康德	789,810	82,132,341.90	1.65
15	600050	中国联通	22,466,900	77,735,474.00	1.57
16	601166	兴业银行	3,860,500	76,823,950.00	1.55
17	600584	长电科技	2,765,223	74,661,021.00	1.50
18	002304	洋河股份	390,200	71,465,130.00	1.44
19	300059	东方财富	2,724,801	69,209,945.40	1.39
20	600919	江苏银行	9,089,582	64,717,823.84	1.30
21	601012	隆基绿能	954,037	63,567,485.31	1.28
22	601898	中煤能源	6,090,966	63,224,227.08	1.27
23	601328	交通银行	12,040,456	59,961,470.88	1.21
24	002594	比亚迪	169,200	56,426,508.00	1.14
25	601899	紫金矿业	5,994,510	55,928,778.30	1.13
26	002466	天齐锂业	447,241	55,815,676.80	1.12
27	600089	特变电工	2,020,413	55,339,112.07	1.11
28	002410	广联达	975,926	53,129,411.44	1.07
29	300661	圣邦股份	274,987	50,053,133.74	1.01
30	600905	三峡能源	7,800,034	49,062,213.86	0.99
31	300316	晶盛机电	724,431	48,964,291.29	0.99
32	300450	先导智能	768,386	48,546,627.48	0.98
33	600176	中国巨石	2,572,214	44,782,245.74	0.90
34	601398	工商银行	9,358,800	44,641,476.00	0.90
35	002736	国信证券	4,433,862	42,432,059.34	0.85
36	688008	澜起科技	669,383	40,551,222.14	0.82
37	601009	南京银行	3,601,668	37,529,380.56	0.76
38	603882	金域医学	452,200	37,329,110.00	0.75
39	601318	中国平安	765,012	35,718,410.28	0.72
40	603392	万泰生物	229,332	35,615,259.60	0.72
41	000002	万科 A	1,612,501	33,056,270.50	0.67
42	601985	中国核电	4,784,100	32,818,926.00	0.66
43	300498	温氏股份	1,539,100	32,767,439.00	0.66
44	300122	智飞生物	295,090	32,757,940.90	0.66
45	601825	沪农商行	5,065,380	31,759,932.60	0.64
46	600426	华鲁恒升	1,055,500	30,820,600.00	0.62
47	300760	迈瑞医疗	97,440	30,518,208.00	0.61

48	600048	保利发展	1,701,391	29,706,286.86	0.60
49	002311	海大集团	480,700	28,846,807.00	0.58
50	002352	顺丰控股	509,400	28,429,614.00	0.57
51	600741	华域汽车	1,169,569	26,900,087.00	0.54
52	688599	天合光能	383,321	25,011,695.25	0.50
53	601838	成都银行	1,502,000	24,903,160.00	0.50
54	600383	金地集团	1,851,873	24,889,173.12	0.50
55	603659	璞泰来	289,500	24,433,800.00	0.49
56	601618	中国中冶	6,648,700	23,270,450.00	0.47
57	002821	凯莱英	80,307	23,208,723.00	0.47
58	601728	中国电信	6,098,100	22,745,913.00	0.46
59	002920	德赛西威	147,916	21,891,568.00	0.44
60	300347	泰格医药	189,449	21,682,438.05	0.44
61	002049	紫光国微	113,233	21,482,564.76	0.43
62	000596	古井贡酒	80,200	20,022,732.00	0.40
63	300014	亿纬锂能	197,550	19,261,125.00	0.39
64	688981	中芯国际	405,657	18,323,526.69	0.37
65	002129	TCL 中环	292,400	17,219,436.00	0.35
66	002074	国轩高科	374,900	17,095,440.00	0.34
67	000661	长春高新	68,368	15,958,458.56	0.32
68	603799	华友钴业	163,002	15,586,251.24	0.31
69	600018	上港集团	2,618,854	15,267,918.82	0.31
70	600660	福耀玻璃	347,100	14,512,251.00	0.29
71	000792	盐湖股份	469,800	14,075,208.00	0.28
72	002648	卫星化学	524,097	13,547,907.45	0.27
73	002938	鹏鼎控股	374,659	11,318,448.39	0.23
74	688111	金山办公	56,133	11,064,936.96	0.22
75	001979	招商蛇口	751,100	10,087,273.00	0.20
76	002371	北方华创	35,700	9,893,184.00	0.20
77	601390	中国中铁	1,600,200	9,825,228.00	0.20
78	600547	山东黄金	522,300	9,693,888.00	0.20
79	601186	中国铁建	1,219,900	9,637,210.00	0.19
80	603290	斯达半导	24,200	9,338,780.00	0.19
81	002230	科大讯飞	200,900	8,281,098.00	0.17
82	000408	藏格矿业	232,000	7,642,080.00	0.15
83	601877	正泰电器	210,200	7,520,956.00	0.15
84	002415	海康威视	204,400	7,399,280.00	0.15
85	002241	歌尔股份	218,974	7,357,526.40	0.15
86	000568	泸州老窖	29,500	7,272,930.00	0.15
87	601888	中国中免	31,150	7,255,769.50	0.15
88	601238	广汽集团	462,900	7,054,596.00	0.14
89	603185	上机数控	44,200	6,894,758.00	0.14

90	002916	深南电路	68,609	6,429,349.39	0.13
91	600690	海尔智家	219,838	6,036,751.48	0.12
92	002001	新和成	258,659	5,900,011.79	0.12
93	601688	华泰证券	394,556	5,602,695.20	0.11
94	600188	兖矿能源	126,000	4,974,480.00	0.10
95	000001	平安银行	320,642	4,803,217.16	0.10
96	601998	中信银行	861,300	4,091,175.00	0.08
97	002812	恩捷股份	12,300	3,080,535.00	0.06
98	603369	今世缘	54,500	2,779,500.00	0.06
99	002179	中航光电	42,020	2,660,706.40	0.05
100	300896	爱美客	3,900	2,340,039.00	0.05
101	600926	杭州银行	134,200	2,010,316.00	0.04
102	002555	三七互娱	82,500	1,751,475.00	0.04
103	600219	南山铝业	364,400	1,344,636.00	0.03
104	600845	宝信软件	14,900	813,540.00	0.02

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	600380	健康元	4,706,948	58,130,807.80	1.17
2	600486	扬农化工	316,000	42,116,480.00	0.85
3	600153	建发股份	2,498,500	32,655,395.00	0.66
4	300775	三角防务	556,900	26,814,735.00	0.54
5	300138	晨光生物	1,689,090	26,299,131.30	0.53
6	300696	爱乐达	574,198	25,236,002.10	0.51
7	300308	中际旭创	804,203	24,970,503.15	0.50
8	000039	中集集团	1,588,200	21,996,570.00	0.44
9	601231	环旭电子	1,516,029	21,770,176.44	0.44
10	600256	广汇能源	2,000,650	21,086,851.00	0.42
11	002468	申通快递	1,719,600	20,497,632.00	0.41
12	000983	山西焦煤	1,481,900	19,842,641.00	0.40
13	300171	东富龙	562,400	19,070,984.00	0.38
14	000935	四川双马	760,100	18,409,622.00	0.37
15	601666	平煤股份	975,659	13,259,205.81	0.27
16	000733	振华科技	94,600	12,862,762.00	0.26
17	002643	万润股份	550,150	11,476,129.00	0.23
18	601699	潞安环能	720,200	10,529,324.00	0.21
19	002258	利尔化学	432,860	10,224,153.20	0.21
20	300639	凯普生物	472,510	10,102,263.80	0.20
21	300244	迪安诊断	324,661	10,096,957.10	0.20
22	601677	明泰铝业	403,400	9,600,920.00	0.19
23	600415	小商品城	1,683,761	9,378,548.77	0.19

24	002497	雅化集团	283,500	9,256,275.00	0.19
25	002832	比音勒芬	362,700	9,140,040.00	0.18
26	600499	科达制造	436,200	9,003,168.00	0.18
27	300482	万孚生物	205,700	8,374,047.00	0.17
28	603128	华贸物流	776,032	7,783,600.96	0.16
29	600873	梅花生物	592,100	6,678,888.00	0.13
30	002585	双星新材	341,900	6,184,971.00	0.12
31	688575	亚辉龙	281,834	5,895,967.28	0.12
32	002645	华宏科技	261,517	5,706,300.94	0.11
33	600863	内蒙华电	1,456,600	5,316,590.00	0.11
34	600985	淮北矿业	339,000	4,935,840.00	0.10
35	002756	永兴材料	27,299	4,155,180.79	0.08
36	688122	西部超导	42,741	3,940,720.20	0.08
37	688819	天能股份	99,416	3,437,805.28	0.07
38	002085	万丰奥威	624,700	3,354,639.00	0.07
39	600057	厦门象屿	379,795	3,338,398.05	0.07
40	000975	银泰黄金	336,900	3,281,406.00	0.07
41	000567	海德股份	220,435	3,262,438.00	0.07
42	300196	长海股份	162,300	3,065,847.00	0.06
43	300363	博腾股份	37,800	2,948,022.00	0.06
44	002865	钧达股份	27,800	2,651,008.00	0.05
45	601933	永辉超市	596,800	2,554,304.00	0.05
46	688348	昱能科技	5,644	2,351,121.08	0.05
47	688235	百济神州	19,217	1,908,824.61	0.04
48	000915	华特达因	39,500	1,633,325.00	0.03
49	603599	广信股份	50,740	1,428,331.00	0.03
50	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.03
51	600211	西藏药业	28,100	1,166,431.00	0.02
52	688120	华海清科	4,822	1,046,952.64	0.02
53	002556	辉隆股份	79,200	926,640.00	0.02
54	688298	东方生物	5,506	628,509.90	0.01
55	002387	维信诺	78,300	526,176.00	0.01
56	600389	江山股份	6,400	388,672.00	0.01
57	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
58	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.01
59	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.00
60	300181	佐力药业	21,400	212,716.00	0.00
61	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.00
62	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
63	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
64	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
65	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00

66	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
67	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
68	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
69	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
70	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
71	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
72	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
73	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
74	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
75	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
76	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
77	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
78	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
79	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
80	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
81	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
82	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
83	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
84	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
85	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
86	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
87	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
88	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
89	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
90	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
91	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
92	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
93	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
94	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
95	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
96	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
97	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
98	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
99	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
100	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
101	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
102	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
103	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
104	301279	金道科技	296	6,751.76	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	601668	中国建筑	223,385,744.60	4.25
2	601658	邮储银行	202,570,356.63	3.86
3	600519	贵州茅台	189,727,498.90	3.61
4	601390	中国中铁	184,693,192.36	3.52
5	600030	中信证券	179,078,021.09	3.41
6	601319	中国人保	158,605,547.71	3.02
7	002709	天赐材料	154,601,725.06	2.94
8	002736	国信证券	146,006,644.43	2.78
9	300750	宁德时代	144,088,859.97	2.74
10	002460	赣锋锂业	140,888,888.76	2.68
11	601166	兴业银行	139,083,835.81	2.65
12	600809	山西汾酒	138,548,573.47	2.64
13	003816	中国广核	137,803,116.00	2.62
14	601398	工商银行	136,360,262.00	2.60
15	002410	广联达	132,064,538.16	2.51
16	601012	隆基绿能	130,572,130.02	2.49
17	601919	中远海控	126,647,490.72	2.41
18	600050	中国联通	126,487,778.00	2.41
19	601328	交通银行	125,227,040.68	2.38
20	000725	京东方 A	124,248,105.00	2.37
21	000333	美的集团	123,734,128.67	2.36
22	601009	南京银行	121,180,734.74	2.31
23	600036	招商银行	121,118,911.00	2.31
24	603259	药明康德	120,091,402.63	2.29
25	000651	格力电器	119,131,661.64	2.27
26	300059	东方财富	118,524,789.74	2.26
27	601988	中国银行	116,622,104.00	2.22
28	600919	江苏银行	112,001,944.38	2.13
29	600438	通威股份	106,455,077.16	2.03
30	002475	立讯精密	106,100,388.78	2.02
31	601899	紫金矿业	106,054,054.20	2.02
32	601898	中煤能源	105,559,880.52	2.01
33	600584	长电科技	105,313,137.09	2.01

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	-----------------

1	600030	中信证券	187,388,093.34	3.57
2	601009	南京银行	175,103,503.68	3.33
3	601390	中国中铁	171,721,941.47	3.27
4	600519	贵州茅台	170,912,268.62	3.25
5	601668	中国建筑	169,877,702.72	3.23
6	002709	天赐材料	164,892,029.49	3.14
7	601012	隆基绿能	160,446,306.40	3.05
8	601658	邮储银行	158,760,238.00	3.02
9	600309	万华化学	157,944,790.85	3.01
10	601318	中国平安	155,314,599.55	2.96
11	300750	宁德时代	147,952,119.93	2.82
12	600036	招商银行	145,486,396.06	2.77
13	000725	京东方 A	135,215,199.46	2.57
14	003816	中国广核	133,873,027.00	2.55
15	601919	中远海控	130,525,609.16	2.49
16	600809	山西汾酒	127,672,474.55	2.43
17	002415	海康威视	124,508,158.89	2.37
18	600919	江苏银行	124,039,208.50	2.36
19	000333	美的集团	123,356,518.50	2.35
20	601225	陕西煤业	123,273,909.00	2.35
21	300059	东方财富	122,339,079.07	2.33
22	601328	交通银行	121,284,276.00	2.31
23	000651	格力电器	119,370,578.32	2.27
24	601138	工业富联	118,347,219.99	2.25
25	601398	工商银行	116,984,916.00	2.23
26	603799	华友钴业	113,377,146.10	2.16
27	601988	中国银行	113,208,478.00	2.16
28	601818	光大银行	112,393,944.00	2.14
29	002241	歌尔股份	111,637,382.30	2.13
30	600887	伊利股份	111,071,092.51	2.11
31	002736	国信证券	108,683,802.45	2.07
32	603986	兆易创新	107,977,182.63	2.06

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	13,427,795,731.94
卖出股票收入（成交）总额	13,227,806,976.14

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	142,674,383.56	2.87
	其中：政策性金融债	142,674,383.56	2.87
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	142,674,383.56	2.87

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	210407	21 农发 07	1,400,000	142,674,383.56	2.87

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“邮储银行”，股票代码：601658）于 2021 年 8 月 13 日收到中国人民银行出具的行政处罚决定书（银罚字〔2021〕16 号）。其因违反账户管理相关规定，被处以 600 万元罚款。

邮储银行于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字〔2022〕16 号）。其因逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差、漏报贷款核销业务 EAST 数据等多项违法违规行为，被处以 370 万元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对邮储银行进行了投资。

江西赣锋锂业股份有限公司（以下简称“赣锋锂业”，股票代码：002460）于 2022 年 7 月 1 日收到中国证监会《立案告知书》，因涉嫌上市公司股票二级市场内幕交易，于 2022 年 1 月 24 日被中国证监会立案。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对赣锋锂业进行了投资。

山西杏花村汾酒厂股份有限公司（以下简称“山西汾酒”，股票代码：600809）于 2021 年 8 月 15 日收到山西省繁峙县工商行政管理局出具的行政处罚决定书（繁市监处〔2021〕64 号），其因未经商标注册人的许可，在同一种商品上使用与其注册商标相同的商标的，被处以 6100 元罚款的行政处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对山西汾酒进行了投资。

2022 年 3 月 21 日，中国农业发展银行（以下简称“农发行”）因漏报不良贷款余额 EAST 数据、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差等多项违法违规行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，收到中国银行保险监督管理委员会出具的行政处罚决定书（银保监罚决字〔2022〕10 号），被处以罚款 480 万元。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对农发行进行了投资。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	968,611.47
2	应收清算款	46,405,795.47
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,625,302.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,999,709.52

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限得情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限得情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
景顺长城沪深 300 指数增强 A	560,008	3,566.28	466,656,533.59	23.37	1,530,487,010.16	76.63
景顺长城沪深 300 指数增强 C	416	2,013.87	0.00	0.00	837,771.97	100.00

合计	560,424	3,565.12	466,656,533.59	23.36	1,531,324,782.13	76.64
----	---------	----------	----------------	-------	------------------	-------

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城沪深 300 指数增强 A	116,711.85	0.005844
	景顺长城沪深 300 指数增强 C	2,656.69	0.317114
	合计	119,368.54	0.005974

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	景顺长城沪深 300 指数增强 A	0~10
	景顺长城沪深 300 指数增强 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城沪深 300 指数增强 A	-
	景顺长城沪深 300 指数增强 C	-
	合计	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日（2013 年 10 月 29 日）基金份额总额	382,141,978.85	-
本报告期期初基金份额总额	1,927,875,014.16	-
本报告期基金总申购份额	588,286,644.35	1,403,350.66
减：本报告期基金总赎回份额	519,018,114.76	565,578.69
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,997,143,543.75	837,771.97

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

1、2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2、2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券股份有限公司	2	5,904,874,354.75	22.18	5,499,218.78	22.60	-
中信证券股份有限公司	5	4,199,283,602.13	15.77	3,446,822.62	14.17	-
光大证券股份有限公司	2	2,973,606,472.71	11.17	2,769,289.51	11.38	-
中国国际金融股份有限公司	2	2,890,539,761.50	10.86	2,691,952.00	11.06	-
中泰证券股份有限公司	2	2,036,857,468.85	7.65	1,896,936.25	7.80	-
中信建投证券股份有限公司	1	1,787,625,313.13	6.71	1,664,808.54	6.84	-
中国银河证券股份有限公司	2	1,377,091,504.64	5.17	1,282,485.71	5.27	-
天风证券股份有限公司	1	1,097,374,744.09	4.12	1,021,986.84	4.20	-
国泰君安证券股份有限公司	1	774,922,504.92	2.91	721,687.49	2.97	-
广发证券股份有限公司	1	768,741,479.56	2.89	715,925.66	2.94	-
长城证券股份有限公司	1	723,649,868.24	2.72	673,934.59	2.77	-

民生证券股份有限公司	1	705,144,483.74	2.65	656,705.75	2.70	-
兴业证券股份有限公司	1	537,800,944.07	2.02	500,856.32	2.06	-
申港证券股份有限公司	1	447,680,416.88	1.68	416,924.94	1.71	-
申万宏源证券有限公司	1	382,226,207.50	1.44	355,970.75	1.46	-
东兴证券股份有限公司	1	18,176,633.17	0.07	16,928.20	0.07	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

2、本基金本报告期交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	13,569,574.80	53.27	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1,245,687.00	4.89	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	10,659,157.30	41.84	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-01
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-01
3	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-07
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-20
5	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
7	关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-25
8	景顺长城基金管理有限公司关于投资旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-27
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-18
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-25
11	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-04
12	关于旗下部分基金参加西部证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-10
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
14	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
15	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司和北	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-01

	京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告		
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机升级的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08
17	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-12
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-16
19	关于旗下部分基金新增山西证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
22	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
23	景顺长城基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
24	景顺长城基金管理有限公司关于终止上海朝阳永续基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-27
25	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城沪深 300 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、托管协议部分条款的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-28
26	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 2022 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-28
27	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-28
28	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同更新	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-28
29	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议更新	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-28
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-29
31	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金关于开放 C 类份额日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-29
32	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-06
33	关于景顺长城基金管理有限公司旗下	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-12

	基金调整持有停牌股票估值价格的公告		
34	关于旗下部分基金新增攀赢基金为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-26
35	景顺长城基金管理有限公司关于暂停腾元基金、汇付基金、南京途牛和有鱼基金办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-26
36	关于旗下部分基金新增华金证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-30
37	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-10
38	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-16
39	关于旗下部分基金参加申万宏源证券和申万宏源西部证券基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-22
40	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信百信银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-23
41	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24

§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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足不同类型的投资者的投资需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》等法律法规的规定和《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2022 年 4 月 29 日起对景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额，同时对《基金合同》和《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》进行了相应的修改。详情请参

阅本基金管理人于 2022 年 4 月 28 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城沪深 300 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、托管协议部分条款的公告》。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日