

# 景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式 指数证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

<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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</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	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	10
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
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	49
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 .....	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
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 .....	53
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
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
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
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500 增强策略 ETF
场内简称	500ETF 增强
基金主代码	159610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 13 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	964,568,207.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 1 月 10 日

### 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的基础上，通过主动化投资管理，力争获取超越指数表现的投资收益。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用主动量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>2、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。</p> <p>3、股票期权投资策略</p> <p>本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>4、存托凭证投资策略</p> <p>本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，通过定性和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的，以更好地实现投资目标。</p> <p>5、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。</p> <p>6、可转换债券投资策略和可交换债券投资策略</p> <p>基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析</p>

	可转换债券和可交换债券的股性和债性的相对价值。 7、融资及转融通证券出借业务投资策略 本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳	郭明
	联系电话	0755-82370388	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	(010) 66105798
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		李进	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-141,169,292.91
本期利润	-138,436,334.00
加权平均基金份额本期利润	-0.1345
本期加权平均净值利润率	-15.20%

本期基金份额净值增长率	-12.19%
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	-133,316,698.72
期末可供分配基金份额利润	-0.1382
期末基金资产净值	858,368,021.71
期末基金份额净值	0.8899
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	-11.01%

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、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。

4、本基金基金合同生效日为 2021 年 12 月 13 日。

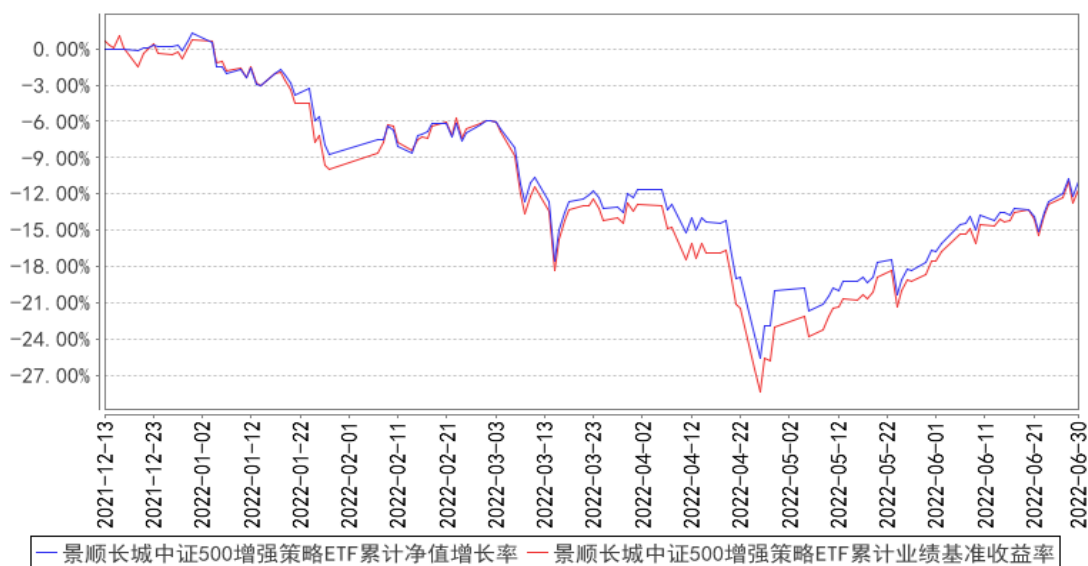
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.72%	1.04%	7.10%	1.10%	-0.38%	-0.06%
过去三个月	1.54%	1.62%	2.04%	1.75%	-0.50%	-0.13%
过去六个月	-12.19%	1.53%	-12.30%	1.63%	0.11%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-11.01%	1.44%	-11.67%	1.55%	0.66%	-0.11%

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

景顺长城中证500增强策略ETF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：本基金的投资组合比例为：基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2021 年 12 月 13 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。报告期末距离建仓结束期未满一年。基金合同生效日（2021 年 12 月 13 日）起至本报告期末不满一年。

### 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		
徐喻军	本基金的基金经理	2021 年 12 月 13 日	-	12 年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员，自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 12 年证券、基金行业从业经验。
张晓南	本基金的基金经理	2021 年 12 月 13 日	-	12 年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 12 年证券、基金行业从业经验。
汪洋	本基金的基金经理	2022 年 5 月 20 日	-	14 年	理学硕士。曾任美国 KeyBank 利率衍生品部首席数量分析师，华泰联合证券股份有限公司金融工程部高级研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部基金经理助理，汇添富基金管理有限公司指数与量化投资部基金经理，博时基金管理有限公司指数与量化投资部副总经理兼基金经理。2021 年 10 月加入本公司，现任 ETF 与创新投资部总经理、基金经理。具有 14 年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数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 6 月工业增加值当月同比增长 3.90%，前值 0.70%，上海疫情对二季度经济造成的影响已经基本恢复；当月环比增长 0.84%，在 4 月和 5 月大幅波动后仍然平稳增长。6 月 PMI 指数为 50.20，从 4 月的 47.40 向上恢复，预计后续将延续 50 以上景气度。6 月 PPI 同比增长 6.10%，前值 6.40%，环比增长 0.00%；CPI 同比增长 2.50%，前值 2.10%，环比增长 0.00%，全球滞胀风险有所回落。6 月 M2 同比增长 11.40%，M1 同比增长 5.80%，社会融资规模存量同比增长 10.80%，基本可控且处于良性增长态势。5 月末外汇储备 3.07 万亿美元。今年上半年经济整体呈现 V 型态势，一季度全球经济在原本疫情冲击外受到俄乌冲突这一突发事件的影响，双方的相互制裁令全球风险偏好快速下降，对大宗商品及全球商贸活动的影响令滞胀风险再次出现；同时国内受到境外输入疫情的影响加大，深圳、上海等地经济活动受到了极大影响，国内市场对疫情的担忧再次出现。本次上海疫情自 3 月底开始发酵，后续对周边及相关产业链形成了较大范围的冲击，此次疫情对

经济的影响超出了此前的市场预期，相当多重要产品供应链出现问题。随着国内疫情的好转，国内经济生产走势再次验证了市场韧性，可以看到后续多个经济指标出现明显好转，预计国内经济后续将再次回到之前的稳健增长曲线。由于一季度整体市场较差，即使二季度市场略有回暖，上半年主流市场指数仍然呈现跌势，上证综指、深证成指、沪深 300、中证 500、创业板指和科创 50 的收益率分别为-6.63%、-13.20%、-9.22%、-12.30%、-15.41%和-20.92%。

上半年海外最重要的事件是俄乌冲突的爆发，在这种灰犀牛事件的影响下，全球投资者风险厌恶程度快速上升，由于对能源、粮食等大宗商品的供给担忧，全球大宗商品价格出现了比较大的波动，同时叠加美国中期选举的临近，当前全球主要经济体未来的政策不确定性进一步增加。虽然 5 月份美联储议息会议之后，市场对于美联储可以实现“软着陆”的信心有所增强，但 6 月中旬以来，随着通胀数据的超预期走高、经济数据的全面走弱，市场对于美联储牺牲需求被动加快收紧以及经济“硬着陆”担忧加剧，各市场波动明显加大。

而在国内方面，3 月底开始发酵的上海疫情对周边以及产业链相关地区、企业的冲击和对国内经济的影响超出了此前市场预期。在上海逐步复商复市，相关产业链及工商企业逐步恢复正常后，政策方面对于稳定经济大盘诉求更是明显提升，近期疫情的影响大概率也可以告一段落。虽然当前国内还有部分地区存在零星疫情，但是当前最新版防疫政策已经根据新的病毒流行株特征进行了修订，预计后续将更好的兼顾疫情防护与经济增长的关系，国内经济走势将持续稳中向好。

本基金为中证 500 增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数的基础上，通过主动化投资管理，力争获取超越指数表现的投资收益。在报告期内，本基金结合申购赎回情况，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用主动量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022 年上半年，本基金份额净值增长率为-12.19%，业绩比较基准收益率为-12.30%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%以内，跟踪误差（年化）控制在 6.5%以内。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，疫情仍将是影响全球经济活动的最大变量，在 Omicron 不同变异株的影响下，大部分经济体短时间内无法做到对病毒感染的有效控制，全球产能恢复的速度在当前时点仍然无法明确预见，且 COVID-19 的长期影响也开始显现。在这种情况下，更加凸显了国内疫情防控的前瞻性和先进性，今年上半年上海疫情的快速控制和疫情后恢复也凸显了“中国制造”的韧性，预计后续国内企业仍将为全球工业品和消费品的生产做出卓越的贡献，全球市场地位有望后

持续提升。在整体经济复苏的基础上，资本市场仍有强大的吸引力，我们对市场保持乐观。当前继续看好成长板块在全球经济复苏阶段的表现，后续成长性高、现金流好、行业竞争格局稳定且公司地位明确的股票更有优势。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,260,735.76	52,171,776.11
结算备付金		2,495,292.49	-
存出保证金		566,701.95	-
交易性金融资产	6.4.7.2	847,852,182.74	1,468,784,916.58
其中：股票投资		847,852,182.74	1,468,784,916.58
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		1,025,423.49	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	19,363.18
资产总计		863,200,336.43	1,520,976,055.87
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		770,765.83	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		353,109.30	370,039.83
应付托管费		70,621.88	74,007.97
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.19	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,637,817.52	925,965.76
负债合计		4,832,314.72	1,370,013.56
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	964,568,207.00	1,499,568,207.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-106,200,185.29	20,037,835.31
净资产合计		858,368,021.71	1,519,606,042.31
负债和净资产总计		863,200,336.43	1,520,976,055.87

注：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 12 月 13 日。

2、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8899 元，基金份额总额 964,568,207.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		-135,505,925.16
1. 利息收入		75,291.05
其中：存款利息收入	6.4.7.9	74,861.51
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		429.54
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-140,038,286.01
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-152,631,702.62
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	169,073.52
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	12,424,343.09
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	2,732,958.91
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	1,724,110.89
<b>减：二、营业总支出</b>		2,930,408.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,276,620.41
2. 托管费	6.4.10.2.2	455,324.07
3. 销售服务费		-
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		1.86
8. 其他费用	6.4.7.16	198,462.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-138,436,334.00
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-138,436,334.00
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-138,436,334.00

## 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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）	1,499,568,207.00	-	20,037,835.31	1,519,606,042.31
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）	1,499,568,207.00	-	20,037,835.31	1,519,606,042.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-535,000,000.00	-	126,238,020.60	-661,238,020.60
（一）、综合收益总额	-	-	138,436,334.00	-138,436,334.00
（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）	-535,000,000.00	-	12,198,313.40	-522,801,686.60
其中：1. 基金申购款	564,000,000.00	-	-83,640,593.18	480,359,406.82
2. 基金赎回款	-1,099,000,000.00	-	95,838,906.58	1,003,161,093.42
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	964,568,207.00	-	106,200,185.29	858,368,021.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3579 号《关于准予景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式指数基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,499,494,370.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 1141 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,499,568,207.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 73,837.00 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2021]第 1362 号文审核同意,本基金 1,499,568,207.00 份基金份额于 2022 年 1 月 10 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是有效跟踪标的指数中证 500 指数的基础上,通过主动化投资管理,力争获取超越指数表现的投资收益。本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证,下同),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份股(包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、衍生工具(股指期货、股票期权等)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券等)、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、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例不低于 80%,投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年化跟踪误差

超过 6.5%。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

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

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年半年度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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

### (1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

### (2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占净资产比例计算的金额。未实现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损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，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后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金收益评价日核定的基金净值率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时,本基金的基金管理人可进行收益分配;以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则确定收益分配。本基金收益每年最多分配 12 次,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款和应收利息，金额分别为 52,171,776.11 元和 19,363.18 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款和其他资产-应收利息，金额分别为 52,191,139.29 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,468,784,916.58 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,468,784,916.58 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为 370,039.83 元、74,007.97 元和 908,304.47 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 370,039.83 元、74,007.97 元和 908,304.47 元。

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应



付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	11,260,735.76
等于：本金	11,259,731.35
加：应计利息	1,004.41
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	11,260,735.76

#### 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	823,502,967.90	-	847,852,182.74	24,349,214.84
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	823,502,967.90	-	847,852,182.74	24,349,214.84

注：于 2022 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元。

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,095,314.95

其中：交易所市场	1,095,314.95
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	197,890.50
应退替代款	2,344,612.07
合计	3,637,817.52

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,499,568,207.00	1,499,568,207.00
本期申购	564,000,000.00	564,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,099,000,000.00	-1,099,000,000.00
本期末	964,568,207.00	964,568,207.00

注：本基金合同于 2021 年 12 月 13 日生效。首次设立募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 1,499,494,370.00 元（含募集股票市值），折合 1,499,494,370.00 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 73,837.00 元，折合 73,837.00 份基金份额。

以上收到的实收基金共计人民币 1,499,568,207.00 元，折合 1,499,568,207.00 份基金份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,578,420.62	21,616,255.93	20,037,835.31
本期利润	-141,169,292.91	2,732,958.91	-138,436,334.00
本期基金份额交易产生的变动数	9,431,014.81	2,767,298.59	12,198,313.40
其中：基金申购款	-46,943,442.80	-36,697,150.38	-83,640,593.18
基金赎回款	56,374,457.61	39,464,448.97	95,838,906.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-133,316,698.72	27,116,513.43	-106,200,185.29

#### 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
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	42,828.57
其他	3,433.90
合计	74,861.51

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-127,830,658.86
股票投资收益——赎回差价收入	-24,801,043.76
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	-152,631,702.62

## 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	2,184,190,899.27
减：卖出股票成本总额	2,307,410,899.01
减：交易费用	4,610,659.12
买卖股票差价收入	-127,830,658.86

## 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,003,161,093.42
减：现金支付赎回款总额	533,599,521.42
减：赎回股票成本总额	494,362,615.76
减：交易费用	-
赎回差价收入	-24,801,043.76

## 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	87.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	168,985.68
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	169,073.52
----	------------

#### 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	710,689.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	541,600.00
减：应计利息总额	90.54
减：交易费用	13.18
买卖债券差价收入	168,985.68

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 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	12,424,343.09
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	12,424,343.09

#### 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	2,732,958.91
股票投资	2,732,958.91
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
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	2,732,958.91

注：本基金本报告期公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益

0.00 元。

#### 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	-
替代损益	1,724,110.89
合计	1,724,110.89

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 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	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	172.00
其他	400.00
IOPV 数据费	9,451.40
注册登记费	74,383.76
合计	198,462.50

### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
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
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东

景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司
------------------	-----------

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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
长城证券	218,374,731.35	5.28

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末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	203,373.59	9.93	-	-

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 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,276,620.41
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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托管费	455,324.07

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期末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

本基金本报告期末与关联方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

本基金本报告期末与关联方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固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

##### 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	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期	11,260,735.76	28,599.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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	-
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	1 个月内(含)	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	-
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	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股流通受限	76.56	51.92	674	51,601.44	34,994.08	-
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	1,003	35,787.04	29,929.52	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	173.98	87.82	168	29,228.64	14,753.76	-
301219	腾远钴业	2022 年 5 月 24 日	4 个月	新股流通受限—转增	-	87.82	134	-	11,767.88	-
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	1 个月内(含)	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	2,468	47,336.24	79,148.76	-
301239	普瑞眼科	2022 年 6 月 22 日	1 个月内(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	-
688163	赛伦生物	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股流通受限	33.03	23.56	3,607	119,139.21	84,980.92	-
688223	晶科能源	2022 年 1 月 19 日	6 个月	新股流通受限	5.00	14.47	128,013	640,065.00	1,852,348.11	-
688237	超卓航科	2022 年 6 月 24 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-
688267	中触媒	2022 年 2 月 9 日	6 个月	新股流通受限	41.90	31.90	3,390	142,041.00	108,141.00	-
688322	奥比中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月内 (含)	新股流通受限	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内 (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

本基金本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

截止本报告期末，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

截止本报告期末，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

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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，并按照合约规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	11,260,735.76	-	-	-	-	-	11,260,735.76
结算备付金	2,495,292.49	-	-	-	-	-	2,495,292.49
存出保证金	566,701.95	-	-	-	-	-	566,701.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	847,852,182.74	847,852,182.74
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,025,423.49	1,025,423.49
资产总计	14,322,730.20	-	-	-	-	848,877,606.23	863,200,336.43
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	353,109.30	353,109.30
应付托管费	-	-	-	-	-	70,621.88	70,621.88
应付证券清算款	-	-	-	-	-	770,765.83	770,765.83
应交税费	-	-	-	-	-	0.19	0.19
其他负债	-	-	-	-	-	3,637,817.52	3,637,817.52
负债总计	-	-	-	-	-	4,832,314.72	4,832,314.72
利率敏感度缺口	14,322,730.20	-	-	-	-	-	-
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	52,171,776.11	-	-	-	-	-	52,171,776.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,468,784,916.58	1,468,784,916.58
应收利息	-	-	-	-	-	19,363.18	19,363.18
资产总计	52,171,776.11	-	-	-	-	1,468,804,279.76	1,520,976,055.87
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	370,039.83	370,039.83
应付托管费	-	-	-	-	-	74,007.97	74,007.97
应付交易费用	-	-	-	-	-	908,304.47	908,304.47
其他负债	-	-	-	-	-	17,661.29	17,661.29
负债总计	-	-	-	-	-	1,370,013.56	1,370,013.56
利率敏感度缺口	52,171,776.11	-	-	-	-	-	-

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券资产（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

## 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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，所面临的重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	847,852,182.74	98.77	1,468,784,916.58	96.66
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	847,852,182.74	98.77	1,468,784,916.58	96.66

##### 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%	40,569,932.02	20,480,909.28
	沪深 300 指数下降 5%	-40,569,932.02	-20,480,909.28

#### 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	844,020,912.40	1,468,724,676.58
第二层次	1,147,309.04	60,240.00
第三层次	2,683,961.30	-
合计	847,852,182.74	1,468,784,916.58

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（2021 年 12 月 31 日：同）。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、基金申购款

于 2022 年上半年，本基金申购基金份额的对价总额为 480,359,406.82 元，其中包括以股票支付的申购款 213,262,028.40 元和以现金支付的申购款 267,097,378.42 元。

##### 2、除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	847,852,182.74	98.22
	其中：股票	847,852,182.74	98.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	13,756,028.25	1.59
8	其他各项资产	1,592,125.44	0.18
9	合计	863,200,336.43	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	7,115,374.00	0.83
B	采矿业	44,228,719.90	5.15
C	制造业	459,563,183.03	53.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,138,013.30	2.58
E	建筑业	5,041,044.00	0.59
F	批发和零售业	23,721,741.00	2.76
G	交通运输、仓储和邮政业	24,475,539.00	2.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,456,188.28	6.34
J	金融业	78,698,879.79	9.17
K	房地产业	13,100,453.00	1.53
L	租赁和商务服务业	8,379,090.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	10,316,680.40	1.20
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,766,766.00	1.84

S	综合	4,004,146.00	0.47
	合计	771,005,817.70	89.82

### 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	1,902,349.00	0.22
B	采矿业	738,003.00	0.09
C	制造业	53,801,530.93	6.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	983,309.16	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	774,696.00	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,653,760.30	0.31
J	金融业	8,257,946.35	0.96
K	房地产业	3,733,146.00	0.43
L	租赁和商务服务业	2,700,400.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	53,749.33	0.01
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	1,223,096.55	0.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	76,846,365.04	8.95

### 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	002557	洽洽食品	210,471	11,982,114.03	1.40
2	601615	明阳智能	287,900	9,731,020.00	1.13
3	600390	五矿资本	1,920,400	9,390,756.00	1.09
4	000878	云南铜业	824,200	9,387,638.00	1.09
5	601077	渝农商行	2,520,200	9,324,740.00	1.09
6	600325	华发股份	1,182,900	8,954,553.00	1.04
7	000050	深天马 A	886,100	8,834,417.00	1.03

8	000750	国海证券	2,385,460	8,659,219.80	1.01
9	600867	通化东宝	804,570	8,319,253.80	0.97
10	600572	康恩贝	1,862,100	8,249,103.00	0.96
11	600256	广汇能源	776,800	8,187,472.00	0.95
12	601555	东吴证券	1,181,189	8,185,639.77	0.95
13	600348	华阳股份	522,000	8,070,120.00	0.94
14	002507	涪陵榨菜	230,500	7,956,860.00	0.93
15	000999	华润三九	176,445	7,940,025.00	0.93
16	300144	宋城演艺	512,840	7,872,094.00	0.92
17	603444	吉比特	20,100	7,798,800.00	0.91
18	002572	索菲亚	280,400	7,711,000.00	0.90
19	603127	昭衍新药	64,958	7,392,220.40	0.86
20	002797	第一创业	1,151,700	7,382,397.00	0.86
21	600522	中天科技	316,300	7,306,530.00	0.85
22	300699	光威复材	123,900	7,293,993.00	0.85
23	002028	思源电气	203,600	7,260,376.00	0.85
24	603658	安图生物	142,600	6,971,714.00	0.81
25	000975	银泰黄金	714,600	6,960,204.00	0.81
26	600801	华新水泥	355,600	6,937,756.00	0.81
27	601577	长沙银行	873,114	6,923,794.02	0.81
28	002240	盛新锂能	112,400	6,784,464.00	0.79
29	600096	云天化	211,500	6,658,020.00	0.78
30	600008	首创环保	2,294,900	6,655,210.00	0.78
31	600177	雅戈尔	1,003,400	6,652,542.00	0.78
32	002409	雅克科技	118,556	6,581,043.56	0.77
33	300390	天华超净	72,700	6,353,980.00	0.74
34	600060	海信视像	504,700	6,308,750.00	0.73
35	002407	多氟多	127,800	6,250,698.00	0.73
36	002497	雅化集团	190,700	6,226,355.00	0.73
37	300769	德方纳米	15,200	6,211,936.00	0.72
38	600141	兴发集团	140,194	6,167,134.06	0.72
39	603225	新凤鸣	506,600	5,846,164.00	0.68
40	603077	和邦生物	1,359,900	5,793,174.00	0.67
41	601992	金隅集团	2,070,300	5,734,731.00	0.67
42	000883	湖北能源	1,106,100	5,652,171.00	0.66
43	688009	中国通号	1,244,734	5,638,645.02	0.66
44	600499	科达制造	266,400	5,498,496.00	0.64
45	300296	利亚德	748,600	5,464,780.00	0.64
46	600546	山煤国际	279,400	5,437,124.00	0.63
47	002294	信立泰	190,200	5,344,620.00	0.62
48	300037	新宙邦	100,660	5,290,689.60	0.62
49	000898	鞍钢股份	1,626,600	5,237,652.00	0.61

50	600153	建发股份	396,500	5,182,255.00	0.60
51	600765	中航重机	157,560	5,070,280.80	0.59
52	600820	隧道股份	823,700	5,041,044.00	0.59
53	300168	万达信息	530,297	5,006,003.68	0.58
54	002948	青岛银行	1,372,910	4,969,934.20	0.58
55	600392	盛和资源	219,600	4,962,960.00	0.58
56	601198	东兴证券	553,000	4,921,700.00	0.57
57	600959	江苏有线	1,503,500	4,901,410.00	0.57
58	000630	铜陵有色	1,500,400	4,891,304.00	0.57
59	002958	青农商行	1,470,200	4,881,064.00	0.57
60	000039	中集集团	351,090	4,862,596.50	0.57
61	000988	华工科技	207,900	4,817,043.00	0.56
62	601168	西部矿业	406,762	4,811,994.46	0.56
63	000983	山西焦煤	357,000	4,780,230.00	0.56
64	000729	燕京啤酒	492,600	4,758,516.00	0.55
65	600233	圆通速递	232,400	4,738,636.00	0.55
66	600580	卧龙电驱	328,200	4,732,644.00	0.55
67	600497	驰宏锌锗	908,600	4,715,634.00	0.55
68	300073	当升科技	51,900	4,688,646.00	0.55
69	000415	渤海租赁	2,160,300	4,687,851.00	0.55
70	300363	博腾股份	58,900	4,593,611.00	0.54
71	600718	东软集团	398,800	4,590,188.00	0.53
72	603613	国联股份	50,776	4,498,753.60	0.52
73	002384	东山精密	195,200	4,475,936.00	0.52
74	000519	中兵红箭	152,900	4,457,035.00	0.52
75	002180	纳思达	87,100	4,409,002.00	0.51
76	600418	江淮汽车	255,500	4,384,380.00	0.51
77	002004	华邦健康	766,200	4,275,396.00	0.50
78	601298	青岛港	769,400	4,208,618.00	0.49
79	600064	南京高科	376,900	4,145,900.00	0.48
80	002756	永兴材料	27,200	4,140,112.00	0.48
81	000027	深圳能源	644,060	4,128,424.60	0.48
82	600373	中文传媒	412,800	4,123,872.00	0.48
83	000559	万向钱潮	691,900	4,109,886.00	0.48
84	300017	网宿科技	766,100	4,106,296.00	0.48
85	000581	威孚高科	212,000	4,081,000.00	0.48
86	600755	厦门国贸	541,400	4,060,500.00	0.47
87	601636	旗滨集团	316,100	4,030,275.00	0.47
88	600673	东阳光	445,400	4,004,146.00	0.47
89	688321	微芯生物	156,932	3,953,117.08	0.46
90	002048	宁波华翔	246,700	3,952,134.00	0.46
91	600782	新钢股份	782,800	3,945,312.00	0.46

92	603605	珀莱雅	23,800	3,931,284.00	0.46
93	600486	扬农化工	29,400	3,918,432.00	0.46
94	002268	卫士通	90,800	3,896,228.00	0.45
95	000728	国元证券	621,800	3,867,596.00	0.45
96	000686	东北证券	552,600	3,862,674.00	0.45
97	000960	锡业股份	229,500	3,848,715.00	0.45
98	688002	睿创微纳	96,829	3,846,047.88	0.45
99	000998	隆平高科	230,500	3,840,130.00	0.45
100	603026	石大胜华	26,400	3,837,240.00	0.45
101	002422	科伦药业	204,500	3,824,150.00	0.45
102	000709	河钢股份	1,685,300	3,808,778.00	0.44
103	603456	九洲药业	73,300	3,789,610.00	0.44
104	600566	济川药业	139,300	3,783,388.00	0.44
105	000830	鲁西化工	218,200	3,772,678.00	0.44
106	300182	捷成股份	685,600	3,770,800.00	0.44
107	600079	人福医药	232,000	3,712,000.00	0.43
108	000807	云铝股份	375,400	3,708,952.00	0.43
109	601000	唐山港	1,432,600	3,696,108.00	0.43
110	600415	小商品城	662,700	3,691,239.00	0.43
111	002195	二三四五	1,634,800	3,678,300.00	0.43
112	600160	巨化股份	279,300	3,672,795.00	0.43
113	600839	四川长虹	1,273,500	3,667,680.00	0.43
114	000738	航发控制	130,400	3,664,240.00	0.43
115	600985	淮北矿业	250,000	3,640,000.00	0.42
116	600282	南钢股份	1,152,500	3,630,375.00	0.42
117	600487	亨通光电	247,900	3,604,466.00	0.42
118	000932	华菱钢铁	705,000	3,588,450.00	0.42
119	688099	晶晨股份	35,358	3,571,158.00	0.42
120	002110	三钢闽光	579,800	3,530,982.00	0.41
121	601866	中远海发	1,148,700	3,446,100.00	0.40
122	000997	新大陆	260,600	3,442,526.00	0.40
123	000825	太钢不锈	630,900	3,438,405.00	0.40
124	600582	天地科技	716,400	3,424,392.00	0.40
125	600885	宏发股份	81,210	3,398,638.50	0.40
126	600155	华创阳安	398,600	3,380,128.00	0.39
127	000930	中粮科技	366,600	3,314,064.00	0.39
128	601058	赛轮轮胎	292,700	3,298,729.00	0.38
129	600598	北大荒	221,900	3,275,244.00	0.38
130	002273	水晶光电	269,200	3,260,012.00	0.38
131	300009	安科生物	321,600	3,251,376.00	0.38
132	002625	光启技术	186,400	3,219,128.00	0.38
133	688122	西部超导	34,551	3,185,602.20	0.37

134	600808	马钢股份	837,900	3,175,641.00	0.37
135	600648	外高桥	232,800	3,166,080.00	0.37
136	002065	东华软件	496,900	3,140,408.00	0.37
137	600739	辽宁成大	214,000	3,120,120.00	0.36
138	001872	招商港口	199,600	3,113,760.00	0.36
139	600879	航天电子	473,600	3,073,664.00	0.36
140	603589	口子窖	52,400	3,071,164.00	0.36
141	601699	潞安环能	209,512	3,063,065.44	0.36
142	600563	法拉电子	14,900	3,056,884.00	0.36
143	600862	中航高科	108,400	3,046,040.00	0.35
144	600236	桂冠电力	492,030	2,996,462.70	0.35
145	600380	健康元	241,600	2,983,760.00	0.35
146	600901	江苏租赁	574,900	2,949,237.00	0.34
147	600037	歌华有线	313,300	2,941,887.00	0.34
148	300012	华测检测	126,000	2,924,460.00	0.34
149	300253	卫宁健康	328,500	2,884,230.00	0.34
150	600507	方大特钢	410,700	2,870,793.00	0.33
151	002249	大洋电机	462,700	2,840,978.00	0.33
152	688185	康希诺	14,075	2,802,051.00	0.33
153	300832	新产业	61,600	2,778,776.00	0.32
154	601872	招商轮船	479,200	2,760,192.00	0.32
155	600511	国药股份	102,900	2,755,662.00	0.32
156	000778	新兴铸管	570,700	2,750,774.00	0.32
157	600863	内蒙华电	741,300	2,705,745.00	0.32
158	002465	海格通信	293,200	2,665,188.00	0.31
159	600350	山东高速	478,500	2,512,125.00	0.29

### 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	000776	广发证券	123,200	2,303,840.00	0.27
2	000625	长安汽车	132,870	2,301,308.40	0.27
3	600519	贵州茅台	1,000	2,045,000.00	0.24
4	688116	天奈科技	11,699	1,982,746.52	0.23
5	000858	五粮液	9,500	1,918,335.00	0.22
6	600048	保利发展	108,700	1,897,902.00	0.22
7	000568	泸州老窖	7,655	1,887,263.70	0.22
8	000333	美的集团	31,100	1,878,129.00	0.22
9	688223	晶科能源	128,013	1,852,348.11	0.22
10	002142	宁波银行	49,800	1,783,338.00	0.21
11	603197	保隆科技	35,900	1,765,921.00	0.21

12	000910	大亚圣象	187,800	1,722,126.00	0.20
13	600887	伊利股份	43,900	1,709,905.00	0.20
14	603899	晨光股份	30,000	1,682,400.00	0.20
15	600570	恒生电子	38,440	1,673,677.60	0.19
16	002027	分众传媒	245,500	1,652,215.00	0.19
17	688187	时代电气	25,313	1,645,091.87	0.19
18	002906	华阳集团	35,100	1,590,381.00	0.19
19	002371	北方华创	5,630	1,560,185.60	0.18
20	600660	福耀玻璃	36,700	1,534,427.00	0.18
21	600989	宝丰能源	104,100	1,525,065.00	0.18
22	300059	东方财富	59,540	1,512,316.00	0.18
23	688518	联赢激光	36,001	1,223,673.99	0.14
24	002918	蒙娜丽莎	56,600	1,059,552.00	0.12
25	601888	中国中免	4,500	1,048,185.00	0.12
26	300015	爱尔眼科	23,000	1,029,710.00	0.12
27	600745	闻泰科技	12,006	1,021,830.66	0.12
28	300627	华测导航	29,340	1,009,002.60	0.12
29	300498	温氏股份	46,000	979,340.00	0.11
30	000963	华东医药	21,300	961,908.00	0.11
31	600309	万华化学	9,900	960,201.00	0.11
32	600383	金地集团	70,600	948,864.00	0.11
33	002597	金禾实业	21,800	944,594.00	0.11
34	002459	晶澳科技	11,880	937,332.00	0.11
35	300775	三角防务	19,400	934,110.00	0.11
36	605123	派克新材	6,600	928,752.00	0.11
37	002714	牧原股份	16,700	923,009.00	0.11
38	002271	东方雨虹	17,800	916,166.00	0.11
39	300957	贝泰妮	4,200	913,626.00	0.11
40	600919	江苏银行	128,227	912,976.24	0.11
41	600690	海尔智家	32,800	900,688.00	0.10
42	300568	星源材质	30,574	887,868.96	0.10
43	001979	招商蛇口	66,000	886,380.00	0.10
44	600926	杭州银行	58,800	880,824.00	0.10
45	002531	天顺风能	53,100	875,619.00	0.10
46	002154	报喜鸟	202,100	873,072.00	0.10
47	601318	中国平安	18,519	864,652.11	0.10
48	300593	新雷能	20,700	859,257.00	0.10
49	002415	海康威视	23,500	850,700.00	0.10
50	002541	鸿路钢构	25,020	835,668.00	0.10
51	300628	亿联网络	10,600	807,190.00	0.09
52	000708	中信特钢	39,700	799,955.00	0.09
53	605060	联德股份	43,700	793,155.00	0.09

54	300979	华利集团	10,700	781,956.00	0.09
55	603236	移远通信	5,850	781,911.00	0.09
56	603871	嘉友国际	45,840	774,696.00	0.09
57	688123	聚辰股份	6,981	743,616.12	0.09
58	601899	紫金矿业	79,100	738,003.00	0.09
59	002463	沪电股份	49,300	727,668.00	0.08
60	601952	苏垦农发	50,300	703,697.00	0.08
61	601865	福莱特	18,300	697,230.00	0.08
62	688078	龙软科技	13,720	678,728.40	0.08
63	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.03
64	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.03
65	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.03
66	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.02
67	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.01
68	688267	中触媒	3,390	108,141.00	0.01
69	688163	赛伦生物	3,607	84,980.92	0.01
70	301238	瑞泰新材	2,468	79,148.76	0.01
71	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
72	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
73	301200	大族数控	674	34,994.08	0.00
74	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
75	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
76	301216	万凯新材	1,003	29,929.52	0.00
77	301219	腾远钴业	302	26,521.64	0.00
78	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
79	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
80	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
81	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
82	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
83	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
84	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
85	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
86	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
87	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
88	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
89	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
90	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
91	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
92	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
93	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
94	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
95	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00



96	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
97	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
98	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
99	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
100	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
101	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
102	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
103	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
104	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
105	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
106	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	600519	贵州茅台	42,013,138.98	2.76
2	600765	中航重机	21,486,907.00	1.41
3	600256	广汇能源	19,766,007.22	1.30
4	300699	光威复材	18,986,480.60	1.25
5	600188	兖矿能源	17,270,370.00	1.14
6	300763	锦浪科技	16,881,737.00	1.11
7	603127	昭衍新药	16,739,549.42	1.10
8	300363	博腾股份	14,633,788.00	0.96
9	601699	潞安环能	14,396,661.79	0.95
10	603225	新凤鸣	14,320,965.15	0.94
11	600522	中天科技	13,756,835.00	0.91
12	000983	山西焦煤	13,509,842.30	0.89
13	600008	首创环保	13,485,350.00	0.89
14	002233	塔牌集团	12,803,595.73	0.84
15	000999	华润三九	12,677,136.90	0.83
16	601318	中国平安	12,204,469.48	0.80
17	000998	隆平高科	12,172,866.00	0.80
18	600885	宏发股份	12,153,096.00	0.80
19	600839	四川长虹	12,097,580.00	0.80
20	603444	吉比特	11,872,888.60	0.78

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	600519	贵州茅台	39,597,537.00	2.61
2	600348	华阳股份	25,259,989.33	1.66
3	600885	宏发股份	23,954,376.00	1.58
4	603228	景旺电子	23,347,096.94	1.54
5	600988	赤峰黄金	22,070,878.01	1.45
6	600808	马钢股份	22,041,256.00	1.45
7	603786	科博达	21,950,825.65	1.44
8	600839	四川长虹	21,634,615.46	1.42
9	600765	中航重机	21,382,915.20	1.41
10	601636	旗滨集团	20,703,408.14	1.36
11	601098	中南传媒	19,593,749.50	1.29
12	600188	兖矿能源	19,476,690.90	1.28
13	600298	安琪酵母	18,463,603.00	1.22
14	688099	晶晨股份	18,057,588.11	1.19
15	600705	中航产融	17,847,236.98	1.17
16	688208	道通科技	17,255,517.18	1.14
17	300363	博腾股份	17,250,820.00	1.14
18	000733	振华科技	16,983,470.28	1.12
19	603127	昭衍新药	16,911,364.15	1.11
20	600507	方大特钢	16,446,365.65	1.08

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	1,964,845,793.62
卖出股票收入（成交）总额	2,184,190,899.27

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 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

云南铜业股份有限公司（以下简称“云南铜业”，股票代码：000878）西南铜业分公司（以下简称西南铜业）于 2022 年 6 月 13 日收到昆明市生态环境局出具的行政处罚决定书（昆生环罚（2022）1-1 号），其因一项大气污染物排放指标超过《铜镍钴工业污染物排放标准》（GB25467-2010）及修改单中的标准限值的 0.83 倍，违反了《中华人民共和国大气污染防治法》第十八条的规定，被处以罚款 56.40 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云南铜业进行了投资。

重庆农村商业银行股份有限公司于 2022 年 6 月 8 日收到中国人民银行重庆营业管理部出具的行政处罚决定书（渝银罚（2022）2 号）。其因未按照规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易，被处以罚款 255 万元。

2022 年 1 月 25 日，重庆农村商业银行股份有限公司收到中国银保监会重庆监管局出具的行政处罚决定书（渝银保监罚决字（2022）5 号），其因信贷资金被挪用、个人经营性贷款未按规定受托支付，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，被处以罚款 80 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重庆农村商业银行进行了投资。

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	566,701.95
2	应收清算款	1,025,423.49
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,592,125.44

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
13,127	73,479.71	300,893,536.00	31.19	663,674,671.00	68.81

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份
----	-------	----------	-------

			额比例 (%)
1	广发证券股份有限公司	94,063,001.00	9.75
2	招商证券股份有限公司	42,075,181.00	4.36
3	方正证券股份有限公司	28,009,142.00	2.90
4	中信建投证券股份有限公司	26,504,108.00	2.75
5	中信证券股份有限公司	22,447,018.00	2.33
6	都邦财产保险股份有限公司—自有资金	15,002,187.00	1.56
7	西部证券股份有限公司	14,506,301.00	1.50
8	中信中证资本管理有限公司	12,752,040.00	1.32
9	沈文荣	11,184,217.00	1.16
10	刘壮成	8,770,105.00	0.91

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年12月13日）基金份额总额	1,499,568,207.00
本报告期期初基金份额总额	1,499,568,207.00
本报告期基金总申购份额	564,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,099,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	964,568,207.00

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期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 (%)	
招商证券股份有限公司	4	3,911,778,941.66	94.58	1,839,914.15	89.80	-
长城证券股份有限公司	1	218,374,731.35	5.28	203,373.59	9.93	-
中信建投证券股份有限公司	2	5,918,926.25	0.14	5,512.28	0.27	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	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	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞信证券(中国)有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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、本基金与景顺长城新兴成长混合型证券投资基金共用交易单元。

### 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 (%)
招商证券股份有限公司	710,689.40	100.00	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞信证券(中国)有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-



## 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
2	关于景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金关于开放日常申购和赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-05
3	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-05
4	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-05
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-07
6	关于景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-10
7	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-10
8	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
9	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
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	2022-02-18
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	2022-02-25
12	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-04
13	关于景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金和景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增华创证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-18
14	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
15	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
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-16
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22

	下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告		
18	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中金公司为一二级交易商的公告	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	2022-04-29
22	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
23	关于景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-10
24	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-12
25	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-20
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广发证券为一二级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-23
27	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-24
28	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数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	2022-05-24
29	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-27
30	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数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	2022-05-27
31	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
32	关于景顺长城中证科技传媒通信 150 交易型开放式指数证券投资基金和景顺长城中证 500 增强策略交易型	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-22

	开放式指数证券投资基金新增申万宏源西部证券为一级交易商的公告		
33	关于景顺长城国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金和景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增平安证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-22
34	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

经深圳证券交易所核准，本基金自 2022 年 1 月 10 日开始在深圳证券交易所上市交易。本基金场内简称：500ETF 增强，基金代码：159610。详情请参阅本基金管理人于 2022 年 1 月 5 日发布的《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数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