

景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 24 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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	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
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22

§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	65
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	66
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	66
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 投资组合报告附注	66
§ 9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	68
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	68
§ 10 开放式基金份额变动	68
§ 11 重大事件揭示	69
11.1 基金份额持有人大会决议	69
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	71
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 13 备查文件目录	75
13.1 备查文件目录	75
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城中证 1000 指数增强	
基金主代码	015495	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 4 月 27 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	155,883,570.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015495	015496
报告期末下属分级基金的份额总额	68,141,285.88 份	87,742,284.22 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 债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>4、股指期货投资策略 本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。</p> <p>5、国债期货投资策略 本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。</p> <p>6、股票期权投资策略 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>7、资产支持证券投资策略 本基金将通过分析宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前</p>

	<p>偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。</p> <p>8、参与融资及转融通证券出借业务的投资策略 本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。</p> <p>9、信用衍生品投资策略 本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95587
传真	0755-22381339	010-85130975
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	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
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	北京市东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 10 层
邮政编码	518048	100010
法定代表人	李进	王常青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年 4 月 27 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日	
	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C

本期已实现收益	27,677,585.18	16,990,599.44
本期利润	23,335,410.98	12,082,065.69
加权平均基金份额本期利润	0.1610	0.0710
本期加权平均净值利润率	15.39%	6.79%
本期基金份额净值增长率	-1.66%	-1.93%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	
期末可供分配利润	-1,126,229.52	-1,686,149.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0165	-0.0192
期末基金资产净值	67,015,056.36	86,056,135.22
期末基金份额净值	0.9834	0.9807
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-1.66%	-1.93%

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

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

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

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

5、本基金基金合同生效日为 2022 年 4 月 27 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

景顺长城中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.41%	1.16%	2.46%	1.14%	-0.05%	0.02%
过去六个月	-10.27%	1.25%	-9.67%	1.21%	-0.60%	0.04%
自基金合同生效起至今	-1.66%	1.15%	18.33%	1.32%	-19.99%	-0.17%

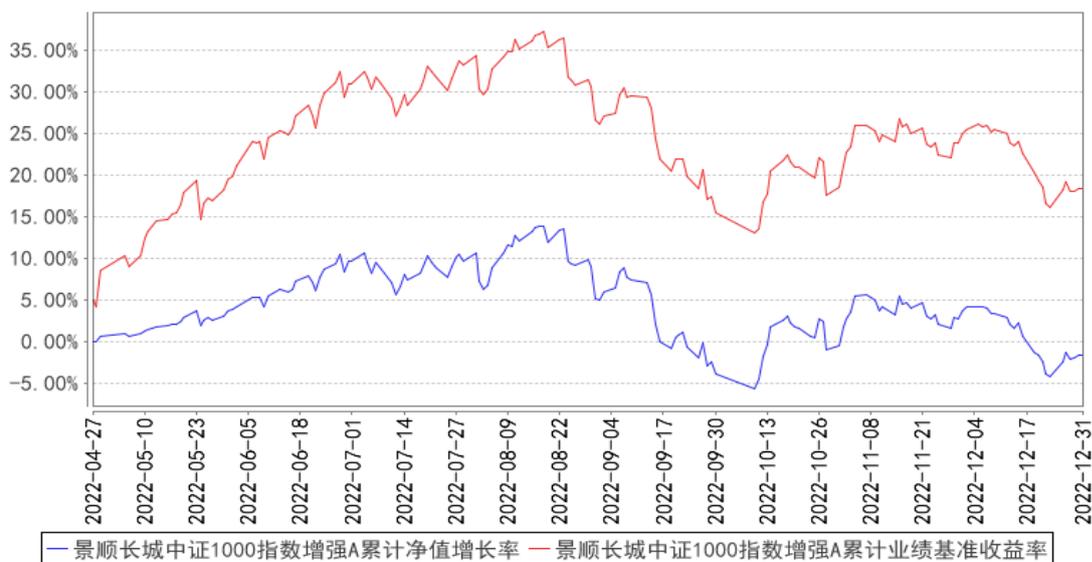
景顺长城中证 1000 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.31%	1.16%	2.46%	1.14%	-0.15%	0.02%

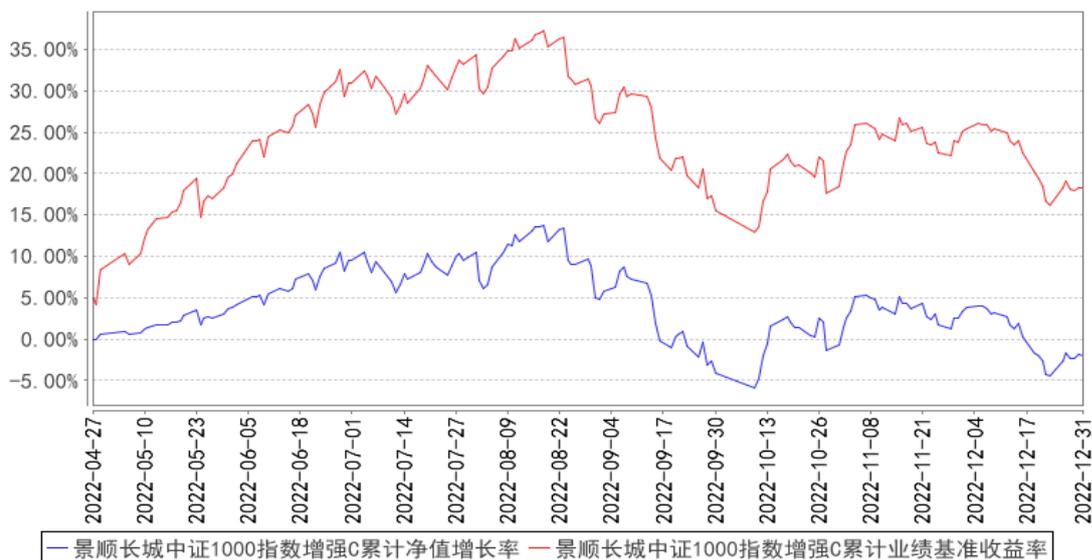
过去六个月	-10.45%	1.25%	-9.67%	1.21%	-0.78%	0.04%
自基金合同生效起至今	-1.93%	1.15%	18.33%	1.32%	-20.26%	-0.17%

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1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城中证1000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

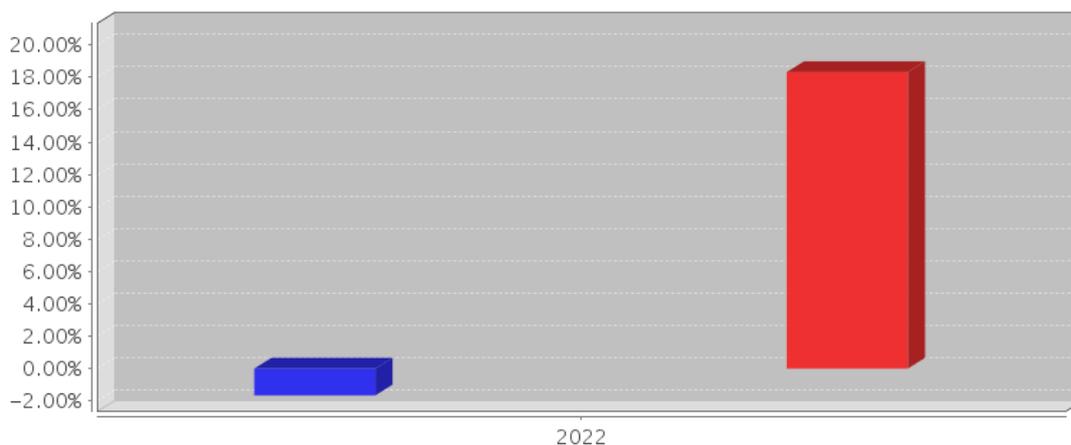


注：本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证，下同）的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依

照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2022 年 4 月 27 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足一年。基金合同生效日（2022 年 4 月 27 日）起至本报告期末不满一年。

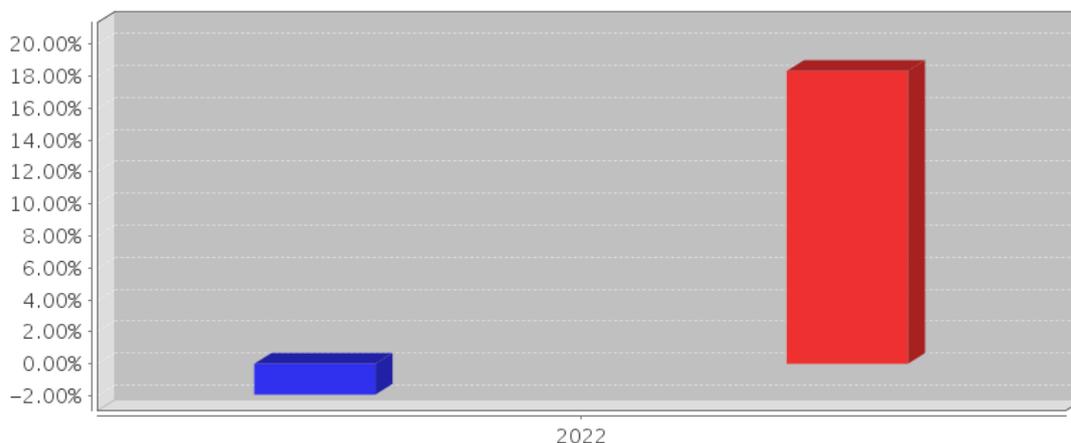
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城中证1000指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



■ 景顺长城中证1000指数增强A净值增长率
■ 景顺长城中证1000指数增强A业绩基准收益率

景顺长城中证1000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



■ 景顺长城中证1000指数增强C净值增长率
■ 景顺长城中证1000指数增强C业绩基准收益率

注：2022 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间为 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2022年4月27日（基金合同生效日）至本报告期末未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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12月31日，本公司旗下共管理165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	2022年4月27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。
徐喻军	本基金的基金经理	2022年4月27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。

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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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 1000 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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的交易指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 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投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 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 47 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，新冠疫情对经济供需两侧多次产生冲击。2022 全年 GDP 增长 3%，工业增加值累计增长 3.6%。12 月 PMI 指数 47，疫情影响下景气指数持续回落。12 月 PPI 同比下跌 0.7%，环比下跌 0.5%；12 月 CPI 同比上涨 1.8%，环比持平，通胀无压力。12 月 M2 同比增速 11.8%，M1 同比增速 3.7%，全年社会融资规模存量同比增长 9.58%。12 月末外汇储备 3.1 万亿美元，人民币汇率波动有所放大。12 月底社会消费品零售总额同比下跌 1.8%，居民消费意愿持续下滑。整体来看，国内货币政策总体保持稳健，流动性合理适度，疫情影响下经济基本面有所下行。2022 年全年 A 股市场表现疲弱，风格方面价值优于成长，沪深 300、中证 500 和创业板指分别下跌 21.63%、20.31% 和 29.37%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至本报告期末，景顺长城中证 1000 指数增强 A 份额净值增长率为-1.66%，业绩比较基准收益率为 18.33%。

2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至本报告期末，景顺长城中证 1000 指数增强 C 份额净值增长率为-1.93%，业绩比较基准收益率为 18.33%。

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 2023 年，海外方面，通胀预计将会得到缓解，美联储加息周期进入后半场，全球流动性压力减小。国内方面，随着防疫措施优化调整以及各项稳经济政策的出台，经济不确定性下降、居民预期随之改善，国内经济或将企稳复苏。宏观场景判断短期内倾向于“稳货币、宽信用”，当前经济处于复苏的早期阶段，尚需货币政策的呵护，预期货币保持合理充裕。而从中期视角看，随着经济复苏的演进，核心通胀有望恢复扩张，央行收敛货币的可能性在上升。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

本基金是以中证 1000 指数为基准的指数增强基金，我们的投资组合主要以基本面量化选股为主，风格上维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生持续稳定的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规

章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本基金未满足收益分配条件，不进行利润分配。

4.9 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

在本报告期内，本基金托管人在托管景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金过程中，严

格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2023）审字第 60467014_H74 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
其他信息	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金管理层对其他

	<p>信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日</p>

	可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	昌华	黄拥璇
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2023 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	9,456,284.59
结算备付金		2,186,208.20
存出保证金		374,592.00
交易性金融资产	7.4.7.2	141,310,601.33
其中：股票投资		141,284,599.16
基金投资		-
债券投资		26,002.17
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		57,345.26
递延所得税资产		-

其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		153,385,031.38
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		79,723.63
应付管理人报酬		133,867.17
应付托管费		20,080.05
应付销售服务费		30,116.24
应付投资顾问费		-
应交税费		0.01
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	50,052.70
负债合计		313,839.80
净资产:		
实收基金	7.4.7.10	155,883,570.10
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	-2,812,378.52
净资产合计		153,071,191.58
负债和净资产总计		153,385,031.38

注：（1）报告截止日 2022 年 12 月 31 日，景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 0.9834 元，景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 C 类基金份额净值人民币 0.9807 元，基金份额总额 155,883,570.10 份，其中景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额 68,141,285.88 份；景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 C 类基金份额 87,742,284.22 份。

（2）本基金合同于 2022 年 4 月 27 日生效，本报实际编制期间为 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
-----	-----	----

		2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		38,650,803.37
1. 利息收入		390,384.03
其中：存款利息收入	7.4.7.13	324,022.40
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		66,361.63
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		46,419,353.06
其中：股票投资收益	7.4.7.14	44,111,667.39
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	74,538.32
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-313,114.55
股利收益	7.4.7.19	2,546,261.90
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）	7.4.7.20	-9,250,707.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	1,091,774.23
减：二、营业总支出		3,233,326.70
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,262,197.01
2. 托管费	7.4.10.2.2	339,329.49
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	490,600.04
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	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		0.16
8. 其他费用	7.4.7.23	141,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		35,417,476.67
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35,417,476.67
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		35,417,476.67

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	581,904,249.10	-	-	581,904,249.10
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-426,020,679.00	-	-2,812,378.52	-428,833,057.52
（一）、综合收益总额	-	-	35,417,476.67	35,417,476.67
（二）、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数 （净值减少以“-”号 填列）	-426,020,679.00	-	-38,229,855.19	-464,250,534.19
其中：1. 基金申购款	198,952,262.10	-	14,269,518.83	213,221,780.93
2. 基金赎回款	-624,972,941.10	-	-52,499,374.02	-677,472,315.12
（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）	155,883,570.10	-	-2,812,378.52	153,071,191.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐吴建军邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 1000 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[2022]478 号文《关于准予景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 1000 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 2022 年 4 月 27 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 581,796,523.71 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 107,725.39 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 581,904,249.10 元，折合 581,904,249.10 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，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

根据《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。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、科创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）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债）、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、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证，下同）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、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计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、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依

照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2023 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时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

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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的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按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，

应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	8,303,651.45
等于：本金	8,301,974.35
加：应计利息	1,677.10
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	1,152,633.14
等于：本金	1,152,506.03
加：应计利息	127.11
减：坏账准备	-
合计	9,456,284.59

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	150,377,267.11	-	141,284,599.16	-9,092,667.95
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	26,000.00	26,002.17	0.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	26,000.00	26,002.17	0.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	150,403,267.11	2.17	141,310,601.33	-9,092,667.95

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,655,320.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	2,655,320.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,655,320.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2303	中证 1000 股指期货 2303	2.00	2,497,280.00	-158,040.00
合计				-158,040.00
减：可抵销期 货暂收款				-158,040.00
净额				-

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

（2）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	52.70

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	50,000.00
合计	50,052.70

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	317,257,520.90	317,257,520.90
本期申购	20,776,852.85	20,776,852.85
本期赎回（以“-”号填列）	-269,893,087.87	-269,893,087.87
本期末	68,141,285.88	68,141,285.88

景顺长城中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	264,646,728.20	264,646,728.20
本期申购	178,175,409.25	178,175,409.25
本期赎回（以“-”号填列）	-355,079,853.23	-355,079,853.23
本期末	87,742,284.22	87,742,284.22

注：（1）本基金合同于 2022 年 4 月 27 日生效。首次发售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 581,796,523.71 元，折合 581,796,523.71 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 107,725.39 元，折合 107,725.39 份基金份额。其中 A 类基金已收到的首次发售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 317,188,722.55 元，折合 317,188,722.55 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 68,798.35 元，折合 68,798.35 份基金份额。C 类基金已收到的首次发售募集的有效认购资金金额为人民币 264,607,801.16 元，折合 264,607,801.16 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 38,927.04 元，折合 38,927.04 份基金份额。以上收到的实收基金共计人民币 581,904,249.10 元，折合 581,904,249.10 份基金份额。

（2）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	27,677,585.18	-4,342,174.20	23,335,410.98
本期基金份额交易产生的变动数	-21,841,040.00	-2,620,600.50	-24,461,640.50
其中：基金申购款	2,787,863.86	-1,588,767.74	1,199,096.12
基金赎回款	-24,628,903.86	-1,031,832.76	-25,660,736.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,836,545.18	-6,962,774.70	-1,126,229.52

景顺长城中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	16,990,599.44	-4,908,533.75	12,082,065.69
本期基金份额交易产生的变动数	-9,721,888.00	-4,046,326.69	-13,768,214.69
其中：基金申购款	24,606,368.03	-11,535,945.32	13,070,422.71
基金赎回款	-34,328,256.03	7,489,618.63	-26,838,637.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,268,711.44	-8,954,860.44	-1,686,149.00

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	147,868.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	144,198.94
结算备付金利息收入	31,954.75
其他	-
合计	324,022.40

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	44,111,667.39
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-

合计	44,111,667.39
----	---------------

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,826,223,768.54
减：卖出股票成本总额	1,778,032,362.11
减：交易费用	4,079,739.04
买卖股票差价收入	44,111,667.39

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	57.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	74,481.28
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	74,538.32

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	269,244.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	194,700.00
减：应计利息总额	56.20
减：交易费用	7.43
买卖债券差价收入	74,481.28

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-313,114.55

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,546,261.90
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	2,546,261.90

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-9,092,667.95
股票投资	-9,092,667.95
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	-158,040.00
权证投资	-
期货投资	-158,040.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-9,250,707.95

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,089,520.80
基金转换费收入	2,253.43
合计	1,091,774.23

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	90,000.00
证券出借违约金	-
其他	1,200.00
合计	141,200.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
中信建投证券股份有限公司（“中信建投证券”）	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
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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中信建投证券	3,746,667,923.11	100.00

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 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4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信建投证券	1,939,173.15	100.00	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	703,704.06

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的托管费

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 0.15% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	187,733.79	187,733.79
中信建投证券	-	255,329.26	255,329.26
合计	-	443,063.05	443,063.05

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金本报告期末未发生转融通证券出借业务交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固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末未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中信建投证券-证券资金账户	1,152,633.14	144,198.94

注：基金托管人中信建投证券受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于中信建投证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新股流通受限	58.00	86.49	217	12,586.00	18,768.33	-
301115	建科股份	2022 年 8 月 23 日	6 个月	新股流通受限	42.05	24.04	350	14,717.50	8,414.00	-
301132	满坤科技	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股流通受限	26.80	24.48	355	9,514.00	8,690.40	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股流通受限	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-
301152	天力锂能	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股流通受限	57.00	46.64	236	13,452.00	11,007.04	-
301161	唯万密封	2022 年 9 月 6 日	6 个月	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-

301176	逸豪新材	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	23.88	16.89	447	10,674.36	7,549.83	-
301195	北路智控	2022年7月25日	6个月	新股流通受限	71.17	73.04	175	12,454.75	12,782.00	-
301231	荣信文化	2022年8月31日	6个月	新股流通受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	354	4,701.12	4,035.60	-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	221	11,244.48	14,630.20	-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301282	金禄电子	2022年8月18日	6个月	新股流通受限	30.38	25.25	317	9,630.46	8,004.25	-
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	52.69	51.41	196	10,327.24	10,076.36	-
301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	44.09	35.13	163	7,186.67	5,726.19	-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股流通受限	8.48	12.99	755	6,402.40	9,807.45	-
301300	远翔新材	2022年8月9日	6个月	新股流通受限	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	7.53	1,359	6,795.00	10,233.27	-

		日									
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股流通受限	43.23	42.29	200	8,646.00	8,458.00		-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	181	7,059.00	4,427.26		-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	111	5,300.25	5,912.97		-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	237.50	176.97	133	31,587.50	23,537.01		-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	78.80	76.96	132	10,401.60	10,158.72		-
301330	熵基科技	2022年8月10日	6个月	新股流通受限	43.32	31.31	372	16,115.04	11,647.32		-
301338	凯格精机	2022年8月8日	6个月	新股流通受限	46.33	48.99	223	10,331.59	10,924.77		-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股流通受限	18.78	15.59	601	11,286.78	9,369.59		-
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股流通受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20		-
301361	众智科技	2022年11月8日	6个月	新股流通受限	26.44	20.96	334	8,830.96	7,000.64		-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	332	10,179.12	12,566.20		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	85	10,189.80	14,941.30		-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	247	5,515.51	4,574.44		-
301388	欣灵	2022年	6个月	新股流	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20		-

	电气	10月26日		通受限							
301396	宏景科技	2022年11月4日	6个月	新股流通受限	40.13	31.90	212	8,507.56	6,762.80		-
301398	星源卓镁	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	34.40	28.94	187	6,432.80	5,411.78		-
600459	贵研铂业	2022年12月22日	1个月内(含)	配股流通受限	10.91	15.74	6,540	71,351.40	102,939.60		-
688035	德邦科技	2022年9月9日	6个月	新股流通受限	46.12	48.82	2,889	133,240.68	141,040.98		-
688351	微电生理	2022年8月23日	6个月	新股流通受限	16.51	24.76	8,072	133,268.72	199,862.72		-
688376	美埃科技	2022年11月10日	6个月	新股流通受限	29.19	28.49	1,620	47,287.80	46,153.80		-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110091	合力转债	2022年12月14日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	260	26,000.00	26,002.17	-

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止, 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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时间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 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,456,284.59	-	-	-	-	-	9,456,284.59
结算备付金	2,186,208.20	-	-	-	-	-	2,186,208.20
存出保证金	-	-	-	-	-	374,592.00	374,592.00
交易性金融资产	-	-	-	-	26,002.17	141,284,599.16	141,310,601.33
应收申购款	-	-	-	-	-	57,345.26	57,345.26
资产总计	11,642,492.79	-	-	-	26,002.17	141,716,536.42	153,385,031.38
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	79,723.63	79,723.63
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	133,867.17	133,867.17
应付托管费	-	-	-	-	-	20,080.05	20,080.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	30,116.24	30,116.24
应交税费	-	-	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	-	-	50,052.70	50,052.70
负债总计	-	-	-	-	-	313,839.80	313,839.80
利率敏感度缺口	11,642,492.79	-	-	-	26,002.17	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.02%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	141,284,599.16	92.30
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	141,284,599.16	92.30

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注：7.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

7.4.13.4.3.2 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12月31日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	4,290,383.58
	沪深 300 指数下降 5%	-4,290,383.58

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	140,419,001.35
第二层次	128,941.77
第三层次	762,658.21
合计	141,310,601.33

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	693,400.40	693,400.40
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	69,257.81	69,257.81
其中：计入损益的利得或损失	-	69,257.81	69,257.81
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	762,658.21	762,658.21
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	69,257.81	69,257.81

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	762,658.21	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	141,284,599.16	92.11
	其中：股票	141,284,599.16	92.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	26,002.17	0.02
	其中：债券	26,002.17	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,642,492.79	7.59
8	其他各项资产	431,937.26	0.28
9	合计	153,385,031.38	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,075,450.00	0.70
B	采矿业	4,438,260.00	2.90
C	制造业	102,368,187.50	66.88
D	电力、热力、燃气及水生产和	2,177,948.00	1.42

	供应业		
E	建筑业	3,462,068.00	2.26
F	批发和零售业	4,399,841.00	2.87
G	交通运输、仓储和邮政业	692,614.00	0.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,520,601.00	8.18
J	金融业	1,568,672.00	1.02
K	房地产业	2,162,235.00	1.41
L	租赁和商务服务业	1,115,191.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	1,893,459.45	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	47,268.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	893,754.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	1,706,392.00	1.11
S	综合	-	-
	合计	140,521,940.95	91.80

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	602,571.30	0.39
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,106.76	0.05
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	26,679.45	0.02
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	54,696.20	0.04
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	762,658.21	0.50

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300352	北信源	719,800	2,936,784.00	1.92
2	002258	利尔化学	155,589	2,794,378.44	1.83
3	002597	金禾实业	76,700	2,492,750.00	1.63
4	300900	广联航空	80,720	2,319,085.60	1.52
5	300639	凯普生物	135,400	2,281,490.00	1.49
6	601908	京运通	339,400	2,229,858.00	1.46
7	000758	中色股份	464,200	2,204,950.00	1.44
8	600210	紫江企业	432,600	2,163,000.00	1.41
9	002649	博彦科技	191,000	1,965,390.00	1.28
10	002662	京威股份	585,700	1,926,953.00	1.26
11	300502	新易盛	79,200	1,881,000.00	1.23
12	002036	联创电子	151,100	1,869,107.00	1.22
13	002276	万马股份	223,400	1,843,050.00	1.20
14	600330	天通股份	172,100	1,813,934.00	1.19
15	002697	红旗连锁	319,900	1,801,037.00	1.18
16	600481	双良节能	138,900	1,797,366.00	1.17
17	600971	恒源煤电	251,000	1,797,160.00	1.17
18	002261	拓维信息	263,000	1,743,690.00	1.14
19	600284	浦东建设	256,900	1,731,506.00	1.13
20	600073	上海梅林	215,700	1,714,815.00	1.12
21	300457	赢合科技	96,900	1,712,223.00	1.12
22	603105	芯能科技	113,400	1,670,382.00	1.09
23	600285	羚锐制药	126,400	1,648,256.00	1.08
24	600559	老白干酒	58,900	1,621,517.00	1.06
25	000517	荣安地产	548,300	1,617,485.00	1.06
26	002517	恺英网络	244,500	1,603,920.00	1.05
27	300438	鹏辉能源	19,776	1,542,330.24	1.01
28	300401	花园生物	103,600	1,490,804.00	0.97
29	000915	华特达因	32,400	1,474,200.00	0.96
30	300377	赢时胜	175,400	1,440,034.00	0.94
31	000913	钱江摩托	77,800	1,437,744.00	0.94
32	000933	神火股份	93,644	1,400,914.24	0.92
33	000612	焦作万方	264,700	1,381,734.00	0.90
34	603612	索通发展	53,100	1,381,662.00	0.90
35	300910	瑞丰新材	11,138	1,373,426.78	0.90
36	603108	润达医疗	132,600	1,340,586.00	0.88

37	603118	共进股份	166,288	1,321,989.60	0.86
38	002100	天康生物	158,300	1,315,473.00	0.86
39	002610	爱康科技	454,500	1,295,325.00	0.85
40	603690	至纯科技	31,200	1,180,608.00	0.77
41	002463	沪电股份	98,500	1,172,150.00	0.77
42	000917	电广传媒	225,100	1,166,018.00	0.76
43	600572	康恩贝	244,300	1,155,539.00	0.75
44	600158	中体产业	130,500	1,139,265.00	0.74
45	002020	京新药业	92,700	1,129,086.00	0.74
46	000791	甘肃电投	210,800	1,113,024.00	0.73
47	300725	药石科技	13,800	1,110,900.00	0.73
48	600742	一汽富维	132,000	1,103,520.00	0.72
49	600993	马应龙	48,130	1,087,738.00	0.71
50	300761	立华股份	31,400	1,075,450.00	0.70
51	002158	汉钟精机	44,500	1,065,775.00	0.70
52	688148	芳源股份	71,500	1,043,185.00	0.68
53	688559	海目星	17,900	1,035,336.00	0.68
54	300130	新国都	84,700	1,022,329.00	0.67
55	600750	江中药业	69,190	999,795.50	0.65
56	600305	恒顺醋业	79,500	978,645.00	0.64
57	002139	拓邦股份	93,300	967,521.00	0.63
58	688233	神工股份	23,700	966,960.00	0.63
59	603368	柳药集团	51,100	954,037.00	0.62
60	002291	遥望科技	70,900	921,700.00	0.60
61	300101	振芯科技	37,300	913,850.00	0.60
62	000030	富奥股份	204,000	897,600.00	0.59
63	601137	博威合金	60,500	896,005.00	0.59
64	000049	德赛电池	20,600	895,688.00	0.59
65	002044	美年健康	145,800	893,754.00	0.58
66	603959	百利科技	84,000	887,880.00	0.58
67	603960	克来机电	49,700	881,181.00	0.58
68	002324	普利特	54,700	875,200.00	0.57
69	600888	新疆众和	105,000	859,950.00	0.56
70	600057	厦门象屿	83,300	855,491.00	0.56
71	688556	高测股份	11,200	840,224.00	0.55
72	300634	彩讯股份	55,000	838,750.00	0.55
73	002733	雄韬股份	48,400	830,060.00	0.54
74	688202	美迪西	3,805	813,851.45	0.53
75	300842	帝科股份	15,800	811,962.00	0.53
76	002085	万丰奥威	133,100	791,945.00	0.52
77	603129	春风动力	7,000	787,640.00	0.51
78	002967	广电计量	46,900	786,982.00	0.51
79	000600	建投能源	149,900	786,975.00	0.51

80	688598	金博股份	3,496	767,302.08	0.50
81	600063	皖维高新	130,000	760,500.00	0.50
82	688518	联赢激光	25,300	739,013.00	0.48
83	002402	和而泰	47,500	692,550.00	0.45
84	002768	国恩股份	23,600	684,872.00	0.45
85	688037	芯源微	4,365	683,122.50	0.45
86	002055	得润电子	78,200	674,084.00	0.44
87	600502	安徽建工	139,600	670,080.00	0.44
88	603920	世运电路	45,200	649,976.00	0.42
89	688516	奥特维	3,222	647,622.00	0.42
90	688800	瑞可达	6,000	640,080.00	0.42
91	300224	正海磁材	50,100	627,753.00	0.41
92	600963	岳阳林纸	114,200	622,390.00	0.41
93	300219	鸿利智汇	91,000	607,880.00	0.40
94	688733	壹石通	15,900	598,953.00	0.39
95	600685	中船防务	28,700	595,812.00	0.39
96	002807	江阴银行	149,300	592,721.00	0.39
97	600389	江山股份	13,200	581,856.00	0.38
98	600797	浙大网新	98,100	573,885.00	0.37
99	300860	锋尚文化	10,900	567,127.00	0.37
100	688399	硕世生物	6,452	565,904.92	0.37
101	000560	我爱我家	217,900	544,750.00	0.36
102	002839	张家港行	117,900	543,519.00	0.36
103	300119	瑞普生物	28,700	534,107.00	0.35
104	000921	海信家电	39,600	521,532.00	0.34
105	300394	天孚通信	20,300	514,605.00	0.34
106	688778	厦钨新能	6,600	512,688.00	0.33
107	003021	兆威机电	10,500	504,735.00	0.33
108	688707	振华新材	11,100	498,945.00	0.33
109	601567	三星医疗	35,600	479,888.00	0.31
110	002108	沧州明珠	103,700	478,057.00	0.31
111	300382	斯莱克	24,800	468,224.00	0.31
112	000810	创维数字	32,800	457,232.00	0.30
113	300775	三角防务	11,900	452,200.00	0.30
114	300567	精测电子	9,000	451,800.00	0.30
115	600428	中远海特	74,100	441,636.00	0.29
116	601126	四方股份	30,100	439,460.00	0.29
117	300666	江丰电子	6,300	435,960.00	0.28
118	002518	科士达	7,500	432,000.00	0.28
119	601069	西部黄金	36,200	430,418.00	0.28
120	301039	中集车辆	52,600	419,222.00	0.27
121	000795	英洛华	64,400	417,956.00	0.27
122	600211	西藏药业	11,400	409,488.00	0.27

123	002432	九安医疗	7,900	403,769.00	0.26
124	601375	中原证券	105,400	383,656.00	0.25
125	000860	顺鑫农业	10,900	325,038.00	0.21
126	603906	龙蟠科技	13,300	307,895.00	0.20
127	688131	皓元医药	2,700	292,626.00	0.19
128	600105	永鼎股份	84,700	288,827.00	0.19
129	603299	苏盐井神	27,600	275,172.00	0.18
130	300068	南都电源	12,700	270,510.00	0.18
131	300662	科锐国际	5,300	259,700.00	0.17
132	601975	招商南油	63,700	250,978.00	0.16
133	300777	中简科技	5,100	250,665.00	0.16
134	002446	盛路通信	25,400	242,824.00	0.16
135	603396	金辰股份	2,800	233,072.00	0.15
136	300748	金力永磁	7,900	231,154.00	0.15
137	000767	晋控电力	63,700	215,943.00	0.14
138	688700	东威科技	1,500	214,725.00	0.14
139	300035	中科电气	10,400	214,032.00	0.14
140	600172	黄河旋风	44,100	213,444.00	0.14
141	002567	唐人神	28,100	198,948.00	0.13
142	688278	特宝生物	4,600	179,078.00	0.12
143	601886	江河集团	22,300	172,602.00	0.11
144	300031	宝通科技	12,400	171,492.00	0.11
145	600682	南京新百	17,300	157,949.00	0.10
146	688408	中信博	1,600	157,440.00	0.10
147	688019	安集科技	800	144,000.00	0.09
148	688578	艾力斯	6,600	129,888.00	0.08
149	605009	豪悦护理	2,500	129,675.00	0.08
150	600761	安徽合力	9,300	122,295.00	0.08
151	605111	新洁能	1,500	116,370.00	0.08
152	002865	钧达股份	600	111,060.00	0.07
153	300080	易成新能	23,400	109,044.00	0.07
154	600496	精工钢构	27,300	107,835.00	0.07
155	300358	楚天科技	7,100	104,725.00	0.07
156	688268	华特气体	1,400	103,950.00	0.07
157	600459	贵研铂业	6,540	102,939.60	0.07
158	300841	康华生物	1,200	101,544.00	0.07
159	601890	亚星锚链	11,400	100,662.00	0.07
160	688085	三友医疗	3,600	99,900.00	0.07
161	603529	爱玛科技	2,100	96,327.00	0.06
162	002222	福晶科技	5,700	90,174.00	0.06
163	605136	丽人丽妆	5,900	82,482.00	0.05
164	300075	数字政通	4,600	80,638.00	0.05
165	601311	骆驼股份	9,800	79,968.00	0.05

166	000059	华锦股份	11,600	78,880.00	0.05
167	002091	江苏国泰	7,500	63,750.00	0.04
168	600995	南网储能	4,300	62,006.00	0.04
169	600587	新华医疗	2,500	53,550.00	0.03
170	603323	苏农银行	10,400	48,776.00	0.03
171	300607	拓斯达	3,300	48,015.00	0.03
172	000546	金圆股份	3,900	47,268.00	0.03
173	603301	振德医疗	1,100	41,855.00	0.03
174	300602	飞荣达	2,800	40,292.00	0.03
175	300767	震安科技	828	38,709.00	0.03
176	600872	中炬高新	900	33,183.00	0.02
177	002011	盾安环境	2,400	31,512.00	0.02
178	688356	键凯科技	200	31,310.00	0.02
179	688298	东方生物	400	30,844.00	0.02
180	300079	数码视讯	5,000	23,950.00	0.02
181	300827	上能电气	400	23,536.00	0.02
182	600811	东方集团	9,300	22,692.00	0.01
183	600478	科力远	1,400	13,132.00	0.01
184	600869	远东股份	2,100	10,605.00	0.01
185	600508	上海能源	400	5,732.00	0.00
186	603328	依顿电子	700	4,543.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688351	微电生理	8,072	199,862.72	0.13
2	688035	德邦科技	2,889	141,040.98	0.09
3	688376	美埃科技	1,620	46,153.80	0.03
4	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.03
5	301327	华宝新能	133	23,537.01	0.02
6	301095	广立微	217	18,768.33	0.01
7	301367	怡和嘉业	85	14,941.30	0.01
8	301267	华夏眼科	221	14,630.20	0.01
9	301139	元道通信	566	14,325.46	0.01
10	301195	北路智控	175	12,782.00	0.01
11	301363	美好医疗	332	12,566.20	0.01
12	301330	熵基科技	372	11,647.32	0.01
13	301152	天力锂能	236	11,007.04	0.01
14	301338	凯格精机	223	10,924.77	0.01
15	301301	川宁生物	1,359	10,233.27	0.01
16	301328	维峰电子	132	10,158.72	0.01
17	301283	聚胶股份	196	10,076.36	0.01
18	301297	富乐德	755	9,807.45	0.01
19	301339	通行宝	601	9,369.59	0.01

20	301132	满坤科技	355	8,690.40	0.01
21	301306	西测测试	200	8,458.00	0.01
22	301115	建科股份	350	8,414.00	0.01
23	301282	金禄电子	317	8,004.25	0.01
24	301176	逸豪新材	447	7,549.83	0.00
25	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
26	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
27	301361	众智科技	334	7,000.64	0.00
28	301396	宏景科技	212	6,762.80	0.00
29	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
30	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
31	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
32	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
33	301319	唯特偶	111	5,912.97	0.00
34	301290	东星医疗	163	5,726.19	0.00
35	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
36	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
37	301398	星源卓镁	187	5,411.78	0.00
38	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
39	301368	丰立智能	247	4,574.44	0.00
40	301309	万得凯	181	4,427.26	0.00
41	301265	华新环保	354	4,035.60	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300457	赢合科技	20,119,107.70	13.14
2	300634	彩讯股份	19,695,480.00	12.87
3	002649	博彦科技	18,389,239.66	12.01
4	300401	花园生物	16,916,332.00	11.05
5	000915	华特达因	16,793,650.00	10.97
6	002085	万丰奥威	16,622,699.00	10.86
7	300224	正海磁材	15,615,343.00	10.20
8	300900	广联航空	15,551,779.78	10.16
9	601677	明泰铝业	15,370,235.00	10.04
10	002258	利尔化学	15,061,119.09	9.84
11	300639	凯普生物	14,986,718.29	9.79
12	600285	羚锐制药	14,922,661.62	9.75
13	300666	江丰电子	14,710,733.28	9.61
14	603599	广信股份	14,470,772.14	9.45
15	300170	汉得信息	14,248,592.11	9.31
16	002446	盛路通信	14,188,034.00	9.27
17	000543	皖能电力	14,080,039.00	9.20

18	603387	基蛋生物	14,031,568.81	9.17
19	002276	万马股份	13,944,180.00	9.11
20	300477	合纵科技	13,747,599.00	8.98
21	600797	浙大网新	13,680,240.48	8.94
22	300770	新媒股份	13,620,942.00	8.90
23	002929	润建股份	13,452,833.00	8.79
24	300378	鼎捷软件	13,321,470.76	8.70
25	000933	神火股份	13,144,747.84	8.59
26	300226	上海钢联	13,072,803.40	8.54
27	688399	硕世生物	12,858,348.33	8.40
28	600273	嘉化能源	12,824,297.00	8.38
29	603236	移远通信	12,685,066.40	8.29
30	600971	恒源煤电	12,671,689.72	8.28
31	300352	北信源	12,669,971.00	8.28
32	603212	赛伍技术	12,232,374.50	7.99
33	600639	浦东金桥	12,157,657.00	7.94
34	002463	沪电股份	12,133,958.50	7.93
35	601666	平煤股份	11,934,820.00	7.80
36	300394	天孚通信	11,894,478.00	7.77
37	002738	中矿资源	11,788,080.60	7.70
38	002891	中宠股份	11,705,348.90	7.65
39	300409	道氏技术	11,654,812.00	7.61
40	688033	天宜上佳	11,636,932.46	7.60
41	300735	光弘科技	11,528,040.65	7.53
42	000567	海德股份	11,495,917.05	7.51
43	002662	京威股份	11,366,954.13	7.43
44	600063	皖维高新	11,187,093.60	7.31
45	600363	联创光电	11,134,995.00	7.27
46	002291	遥望科技	11,108,255.48	7.26
47	688388	嘉元科技	10,925,180.28	7.14
48	002573	清新环境	10,741,499.00	7.02
49	300696	爱乐达	10,716,428.40	7.00
50	300775	三角防务	10,540,094.00	6.89
51	603368	柳药集团	10,469,814.00	6.84
52	002091	江苏国泰	10,381,292.26	6.78
53	002850	科达利	10,222,893.00	6.68
54	000682	东方电子	10,204,671.00	6.67
55	300035	中科电气	10,192,755.00	6.66
56	600481	双良节能	10,157,528.00	6.64
57	603305	旭升集团	10,067,350.51	6.58
58	002344	海宁皮城	9,760,092.00	6.38
59	600330	天通股份	9,732,090.00	6.36
60	600496	精工钢构	9,723,294.00	6.35

61	002643	万润股份	9,583,773.00	6.26
62	300432	富临精工	9,397,827.50	6.14
63	002023	海特高新	9,361,603.00	6.12
64	300373	扬杰科技	9,272,436.00	6.06
65	600389	江山股份	9,255,475.52	6.05
66	002192	融捷股份	9,149,239.50	5.98
67	300861	美畅股份	9,003,767.00	5.88
68	600873	梅花生物	8,831,271.00	5.77
69	300803	指南针	8,830,665.00	5.77
70	300151	昌红科技	8,728,738.00	5.70
71	600559	老白干酒	8,715,824.00	5.69
72	600596	新安股份	8,511,671.80	5.56
73	000762	西藏矿业	8,498,654.00	5.55
74	300233	金城医药	8,472,881.00	5.54
75	300130	新国都	8,455,125.00	5.52
76	600929	雪天盐业	8,266,770.00	5.40
77	600882	妙可蓝多	8,196,467.00	5.35
78	002182	云海金属	8,196,291.00	5.35
79	300346	南大光电	8,140,298.70	5.32
80	600206	有研新材	8,030,443.00	5.25
81	603896	寿仙谷	8,021,881.00	5.24
82	300755	华致酒行	8,005,539.00	5.23
83	002497	雅化集团	7,964,646.00	5.20
84	300604	长川科技	7,964,098.00	5.20
85	002741	光华科技	7,758,602.00	5.07
86	688516	奥特维	7,729,673.36	5.05
87	002832	比音勒芬	7,703,463.00	5.03
88	603920	世运电路	7,669,910.00	5.01
89	600750	江中药业	7,662,863.55	5.01
90	300662	科锐国际	7,590,480.00	4.96
91	000065	北方国际	7,468,015.90	4.88
92	002768	国恩股份	7,467,767.00	4.88
93	000848	承德露露	7,405,656.10	4.84
94	002733	雄韬股份	7,253,311.50	4.74
95	002547	春兴精工	7,238,012.00	4.73
96	002585	双星新材	7,212,852.00	4.71
97	300709	精研科技	7,203,204.05	4.71
98	002518	科士达	7,128,973.00	4.66
99	300762	上海瀚讯	7,075,417.35	4.62
100	000758	中色股份	6,788,646.00	4.43
101	601137	博威合金	6,761,527.00	4.42
102	300765	新诺威	6,681,259.74	4.36
103	600565	迪马股份	6,597,293.00	4.31

104	002955	鸿合科技	6,526,478.00	4.26
105	600557	康缘药业	6,519,015.00	4.26
106	002267	陕天然气	6,502,002.00	4.25
107	300398	飞凯材料	6,460,910.00	4.22
108	600057	厦门象屿	6,446,190.55	4.21
109	603128	华贸物流	6,356,466.00	4.15
110	600123	兰花科创	6,267,206.00	4.09
111	002539	云图控股	6,245,038.00	4.08
112	600428	中远海特	6,230,005.00	4.07
113	600662	外服控股	6,207,095.36	4.06
114	300684	中石科技	6,189,323.00	4.04
115	600223	鲁商发展	6,166,431.24	4.03
116	603609	禾丰股份	6,120,241.93	4.00
117	300748	金力永磁	6,108,813.00	3.99
118	601330	绿色动力	5,985,290.86	3.91
119	300777	中简科技	5,894,968.00	3.85
120	688233	神工股份	5,780,943.79	3.78
121	300327	中颖电子	5,735,750.60	3.75
122	002567	唐人神	5,660,785.00	3.70
123	600326	西藏天路	5,603,591.20	3.66
124	300101	振芯科技	5,493,245.00	3.59
125	603328	依顿电子	5,411,156.98	3.54
126	300302	同有科技	5,403,247.72	3.53
127	002413	雷科防务	5,386,018.00	3.52
128	600888	新疆众和	5,377,078.00	3.51
129	688298	东方生物	5,223,058.27	3.41
130	300573	兴齐眼药	5,210,355.00	3.40
131	000989	九芝堂	5,189,107.00	3.39
132	300769	德方纳米	5,159,111.27	3.37
133	600452	涪陵电力	5,106,999.99	3.34
134	002041	登海种业	5,085,656.00	3.32
135	300382	斯莱克	5,073,502.11	3.31
136	002484	江海股份	5,063,608.00	3.31
137	000902	新洋丰	5,025,217.00	3.28
138	002545	东方铁塔	4,990,799.00	3.26
139	300438	鹏辉能源	4,985,060.08	3.26
140	601908	京运通	4,884,414.00	3.19
141	300183	东软载波	4,835,182.00	3.16
142	688019	安集科技	4,754,561.24	3.11
143	300502	新易盛	4,680,257.00	3.06
144	002176	江特电机	4,604,672.00	3.01
145	002036	联创电子	4,547,136.00	2.97
146	601619	嘉泽新能	4,493,457.00	2.94

147	600360	华微电子	4,488,558.00	2.93
148	600017	日照港	4,442,020.00	2.90
149	000882	华联股份	4,393,320.00	2.87
150	002063	远光软件	4,372,262.00	2.86
151	002043	兔宝宝	4,339,674.00	2.84
152	600908	无锡银行	4,198,338.00	2.74
153	300143	盈康生命	4,158,858.00	2.72
154	000935	四川双马	4,108,627.00	2.68
155	000049	德赛电池	4,097,087.00	2.68
156	002746	仙坛股份	4,030,858.00	2.63
157	000918	嘉凯城	4,004,414.00	2.62
158	601882	海天精工	3,984,308.00	2.60
159	688037	芯源微	3,963,190.85	2.59
160	603187	海容冷链	3,940,554.76	2.57
161	002782	可立克	3,938,645.00	2.57
162	002906	华阳集团	3,869,057.00	2.53
163	603612	索通发展	3,858,605.00	2.52
164	600366	宁波韵升	3,848,702.00	2.51
165	002984	森麒麟	3,839,799.00	2.51
166	600211	西藏药业	3,831,991.00	2.50
167	603959	百利科技	3,782,346.00	2.47
168	300602	飞荣达	3,760,723.00	2.46
169	603018	华设集团	3,742,213.00	2.44
170	600876	洛阳玻璃	3,713,806.00	2.43
171	002042	华孚时尚	3,670,060.00	2.40
172	603688	石英股份	3,594,096.00	2.35
173	002436	兴森科技	3,574,451.00	2.34
174	300476	胜宏科技	3,563,558.00	2.33
175	600499	科达制造	3,559,893.00	2.33
176	603520	司太立	3,553,037.00	2.32
177	002756	永兴材料	3,533,809.00	2.31
178	002582	好想你	3,530,106.00	2.31
179	300328	宜安科技	3,503,378.00	2.29
180	300171	东富龙	3,500,566.00	2.29
181	600997	开滦股份	3,427,041.00	2.24
182	603306	华懋科技	3,390,335.00	2.21
183	002597	金禾实业	3,387,326.00	2.21
184	300377	赢时胜	3,341,792.00	2.18
185	000006	深振业 A	3,307,640.00	2.16
186	300860	锋尚文化	3,245,859.00	2.12
187	301031	中熔电气	3,194,921.00	2.09
188	603229	奥翔药业	3,167,868.00	2.07
189	000893	亚钾国际	3,158,977.00	2.06

190	002991	甘源食品	3,149,756.00	2.06
191	002100	天康生物	3,074,698.00	2.01
192	300219	鸿利智汇	3,073,315.00	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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300457	赢合科技	20,401,534.00	13.33
2	300634	彩讯股份	19,711,103.00	12.88
3	300401	花园生物	17,120,186.00	11.18
4	000915	华特达因	16,645,396.00	10.87
5	002085	万丰奥威	16,643,171.00	10.87
6	002649	博彦科技	16,358,941.32	10.69
7	000543	皖能电力	16,124,308.00	10.53
8	300666	江丰电子	15,697,832.00	10.26
9	300224	正海磁材	15,102,510.00	9.87
10	601677	明泰铝业	14,965,205.40	9.78
11	603599	广信股份	14,869,785.16	9.71
12	300170	汉得信息	14,791,602.06	9.66
13	002929	润建股份	14,721,407.00	9.62
14	002738	中矿资源	14,501,534.00	9.47
15	002446	盛路通信	14,475,315.16	9.46
16	603387	基蛋生物	14,294,044.98	9.34
17	300477	合纵科技	14,067,194.00	9.19
18	300378	鼎捷软件	14,022,994.74	9.16
19	600797	浙大网新	14,007,046.60	9.15
20	600285	羚锐制药	13,804,116.76	9.02
21	300900	广联航空	13,693,788.00	8.95
22	300770	新媒股份	13,544,776.00	8.85
23	300226	上海钢联	13,383,318.20	8.74
24	600363	联创光电	13,363,060.38	8.73
25	603236	移远通信	13,285,461.60	8.68
26	000933	神火股份	12,811,654.92	8.37
27	002276	万马股份	12,518,258.10	8.18
28	300735	光弘科技	12,373,348.60	8.08
29	600273	嘉化能源	12,369,931.00	8.08
30	002891	中宠股份	12,211,280.00	7.98
31	688033	天宜上佳	12,201,638.11	7.97
32	688399	硕世生物	12,032,803.98	7.86
33	300639	凯普生物	12,028,756.50	7.86
34	002258	利尔化学	11,995,109.60	7.84
35	603305	旭升集团	11,988,998.53	7.83
36	000567	海德股份	11,933,424.38	7.80

37	601666	平煤股份	11,698,066.00	7.64
38	603212	赛伍技术	11,656,249.44	7.61
39	300409	道氏技术	11,603,399.32	7.58
40	300394	天孚通信	11,562,105.00	7.55
41	600639	浦东金桥	11,319,688.00	7.40
42	600063	皖维高新	11,186,263.12	7.31
43	002573	清新环境	10,986,770.00	7.18
44	000682	东方电子	10,737,780.40	7.01
45	002850	科达利	10,723,434.00	7.01
46	300151	昌红科技	10,635,648.00	6.95
47	600971	恒源煤电	10,626,371.00	6.94
48	002463	沪电股份	10,455,373.70	6.83
49	603368	柳药集团	10,356,448.08	6.77
50	002291	遥望科技	10,272,125.58	6.71
51	002192	融捷股份	10,067,848.50	6.58
52	300035	中科电气	10,058,462.00	6.57
53	002344	海宁皮城	10,034,275.00	6.56
54	600496	精工钢构	9,971,880.00	6.51
55	300775	三角防务	9,961,637.31	6.51
56	002643	万润股份	9,956,665.00	6.50
57	688388	嘉元科技	9,917,283.87	6.48
58	300696	爱乐达	9,832,024.20	6.42
59	002023	海特高新	9,744,730.58	6.37
60	600873	梅花生物	9,696,582.99	6.33
61	002662	京威股份	9,419,547.72	6.15
62	300803	指南针	9,357,715.00	6.11
63	002091	江苏国泰	9,339,490.46	6.10
64	002182	云海金属	9,291,748.00	6.07
65	600882	妙可蓝多	9,285,974.00	6.07
66	300352	北信源	9,284,150.00	6.07
67	300346	南大光电	9,022,798.47	5.89
68	300432	富临精工	8,863,288.98	5.79
69	600596	新安股份	8,800,342.19	5.75
70	002497	雅化集团	8,776,693.00	5.73
71	600481	双良节能	8,757,722.00	5.72
72	600330	天通股份	8,648,528.60	5.65
73	600929	雪天盐业	8,577,911.54	5.60
74	002741	光华科技	8,517,339.00	5.56
75	300373	扬杰科技	8,511,538.00	5.56
76	600389	江山股份	8,506,116.32	5.56
77	000065	北方国际	8,491,354.71	5.55
78	000762	西藏矿业	8,405,936.00	5.49
79	300233	金城医药	8,388,814.38	5.48

80	002585	双星新材	8,337,322.00	5.45
81	300604	长川科技	8,265,760.00	5.40
82	603896	寿仙谷	8,241,266.60	5.38
83	002733	雄韬股份	7,862,630.00	5.14
84	600206	有研新材	7,790,578.42	5.09
85	002832	比音勒芬	7,686,481.00	5.02
86	300709	精研科技	7,641,468.30	4.99
87	002955	鸿合科技	7,601,908.60	4.97
88	600557	康缘药业	7,592,684.00	4.96
89	300755	华致酒行	7,529,567.00	4.92
90	300861	美畅股份	7,475,686.00	4.88
91	000848	承德露露	7,442,542.90	4.86
92	688516	奥特维	7,354,306.36	4.80
93	002547	春兴精工	7,322,965.00	4.78
94	002518	科士达	7,275,676.00	4.75
95	002768	国恩股份	7,159,729.62	4.68
96	600559	老白干酒	7,142,710.00	4.67
97	600223	鲁商发展	6,981,498.56	4.56
98	002267	陕天然气	6,920,057.00	4.52
99	300130	新国都	6,919,648.00	4.52
100	603920	世运电路	6,639,250.91	4.34
101	300398	飞凯材料	6,525,280.00	4.26
102	300765	新诺威	6,505,816.00	4.25
103	601137	博威合金	6,455,054.00	4.22
104	300769	德方纳米	6,442,655.04	4.21
105	603128	华贸物流	6,312,062.53	4.12
106	300662	科锐国际	6,267,071.00	4.09
107	300684	中石科技	6,235,702.33	4.07
108	600565	迪马股份	6,220,356.50	4.06
109	601330	绿色动力	6,206,086.00	4.05
110	603609	禾丰股份	6,197,506.93	4.05
111	600123	兰花科创	6,092,221.13	3.98
112	300762	上海瀚讯	6,050,199.81	3.95
113	600057	厦门象屿	5,977,970.00	3.91
114	600428	中远海特	5,749,404.00	3.76
115	300777	中简科技	5,692,306.00	3.72
116	600326	西藏天路	5,667,560.40	3.70
117	300327	中颖电子	5,658,545.59	3.70
118	002567	唐人神	5,658,177.00	3.70
119	600750	江中药业	5,648,218.26	3.69
120	002539	云图控股	5,619,994.00	3.67
121	600662	外服控股	5,581,626.02	3.65
122	300302	同有科技	5,541,401.20	3.62

123	002413	雷科防务	5,534,536.00	3.62
124	603328	依顿电子	5,292,595.38	3.46
125	300382	斯莱克	5,176,419.00	3.38
126	002176	江特电机	5,111,250.00	3.34
127	688019	安集科技	5,100,652.92	3.33
128	000989	九芝堂	5,082,126.00	3.32
129	002041	登海种业	5,060,943.14	3.31
130	002545	东方铁塔	4,930,204.00	3.22
131	300143	盈康生命	4,902,522.00	3.20
132	600360	华微电子	4,883,624.00	3.19
133	600452	涪陵电力	4,867,770.42	3.18
134	002484	江海股份	4,836,957.00	3.16
135	688298	东方生物	4,833,196.45	3.16
136	601619	嘉泽新能	4,809,288.00	3.14
137	300101	振芯科技	4,807,674.00	3.14
138	002063	远光软件	4,762,001.00	3.11
139	600017	日照港	4,714,496.00	3.08
140	300748	金力永磁	4,603,529.40	3.01
141	600888	新疆众和	4,587,165.44	3.00
142	002043	兔宝宝	4,499,493.00	2.94
143	300573	兴齐眼药	4,474,970.80	2.92
144	300183	东软载波	4,442,041.00	2.90
145	000882	华联股份	4,351,226.80	2.84
146	688233	神工股份	4,233,292.10	2.77
147	002984	森麒麟	4,194,968.00	2.74
148	600908	无锡银行	4,182,511.00	2.73
149	603018	华设集团	4,153,119.64	2.71
150	000758	中色股份	4,086,257.00	2.67
151	000902	新洋丰	4,062,515.00	2.65
152	601882	海天精工	4,034,612.00	2.64
153	002756	永兴材料	4,022,214.00	2.63
154	000935	四川双马	4,006,673.00	2.62
155	000918	嘉凯城	3,924,869.00	2.56
156	002746	仙坛股份	3,913,090.00	2.56
157	600499	科达制造	3,897,344.00	2.55
158	301031	中熔电气	3,887,546.00	2.54
159	002436	兴森科技	3,843,927.00	2.51
160	002906	华阳集团	3,800,242.00	2.48
161	603306	华懋科技	3,784,113.00	2.47
162	300476	胜宏科技	3,753,457.00	2.45
163	002042	华孚时尚	3,649,821.00	2.38
164	603187	海容冷链	3,641,349.96	2.38
165	002582	好想你	3,618,946.00	2.36

166	300602	飞荣达	3,562,937.00	2.33
167	300171	东富龙	3,556,463.00	2.32
168	603688	石英股份	3,541,112.00	2.31
169	600876	洛阳玻璃	3,511,907.00	2.29
170	300328	宜安科技	3,385,848.00	2.21
171	600211	西藏药业	3,364,118.00	2.20
172	605168	三人行	3,355,487.04	2.19
173	600997	开滦股份	3,323,602.00	2.17
174	603229	奥翔药业	3,283,142.00	2.14
175	002782	可立克	3,254,249.00	2.13
176	300772	运达股份	3,218,205.00	2.10
177	600366	宁波韵升	3,190,925.00	2.08
178	603520	司太立	3,190,402.60	2.08
179	600395	盘江股份	3,167,082.00	2.07
180	000006	深振业 A	3,067,194.00	2.00

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,928,409,629.22
卖出股票收入（成交）总额	1,826,223,768.54

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	26,002.17	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,002.17	0.02

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110091	合力转债	260	26,002.17	0.02

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

(1) 时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

(2) 套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

(3) 合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

安徽金禾实业股份有限公司（以下简称“金禾实业”，股票代码：002597）于 2022 年 12 月 27 日收到滁州市应急管理局下达的《行政处罚决定书》（滁）应急罚[2022]7-8 号，其因未能认真履行法定安全生产主体责任、组织开展工艺和装置的安全风险辨识不到位等多项违法违规行为，被处以罚款 50 万元的行政处罚。

金禾实业于 2022 年 9 月 30 日收到滁州市生态环境局出具的《行政处罚决定书》，其因污染排放、其他环境违规等违法违规行为，被处以罚款 74.76 万元的行政处罚。

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

序对金禾实业进行了投资。

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	374,592.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	57,345.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	431,937.26

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688351	微电生理	199,862.72	0.13	新股流通受限
2	688035	德邦科技	141,040.98	0.09	新股流通受限
3	688376	美埃科技	46,153.80	0.03	新股流通受限
4	301239	普瑞眼科	40,066.00	0.03	新股流通受限
5	301327	华宝新能	23,537.01	0.02	新股流通受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
景顺长城中证 1000 指数增强 A	5,429	12,551.35	346,577.43	0.51	67,794,708.45	99.49
景顺长城中证 1000 指数增强 C	1,991	44,069.45	54,095,709.27	61.65	33,646,574.95	38.35
合计	7,420	21,008.57	54,442,286.70	34.92	101,441,283.40	65.08

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城中证 1000 指数增强 A	10,644.77	0.015622
	景顺长城中证 1000 指数增强 C	27.01	0.000031
	合计	10,671.78	0.006846

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

- 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、本期末基金的基金经理未持有本基金。

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

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2022 年 4 月 27 日）基金份额总额	317,257,520.90	264,646,728.20
基金合同生效日起至报告期期末	20,776,852.85	178,175,409.25

末基金总申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	269,893,087.87	355,079,853.23
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	68,141,285.88	87,742,284.22

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

本基金管理人于 2022 年 12 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任康乐先生担任本公司财务负责人。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 1 年为本基金提供审计服务，本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 50,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券股份有限公司	3	3,746,667,923.11	100.00	1,939,173.15	100.00	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

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情况稳定；
- 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、本基金本期交易单元均为新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券回	成交金额	占当期权证成

		交总额的 比例 (%)		购成交 总额的 比例 (%)		交总额的 比例 (%)
中信建投证券股 份有限公司	269,244.91	100.00	220,000,000.00	100.00	-	-
国泰君安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资 基金基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及 网站	2022 年 4 月 2 日
2	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资 基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及 网站	2022 年 4 月 2 日
3	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资 基金基金合同	中国证监会指定报刊及 网站	2022 年 4 月 2 日
4	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资 基金托管协议	中国证监会指定报刊及 网站	2022 年 4 月 2 日
5	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资 基金招募说明书	中国证监会指定报刊及 网站	2022 年 4 月 2 日
6	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资 基金基金合同及招募说明书提示 性公告	中国证监会指定报刊及 网站	2022 年 4 月 2 日
7	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资 基金新增蚂蚁基金等多家公 司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及 网站	2022 年 4 月 7 日
8	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资 基金新增长江证券等多家公 司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及 网站	2022 年 4 月 8 日
9	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 年 4 月 8 日
10	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资 基金新增广东南粤银行为销售机 构的公告	中国证监会指定报刊及 网站	2022 年 4 月 11 日
11	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资 基金新增好买基金为销售机构的 公告	中国证监会指定报刊及 网站	2022 年 4 月 12 日
12	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 年 4 月 12 日
13	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 年 4 月 16 日
14	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资 基金新增申万宏源证券等多家公	中国证监会指定报刊及 网站	2022 年 4 月 19 日

	司为销售机构的公告		
15	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金新增国元证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 20 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 22 日
17	关于景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同生效的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 4 月 28 日
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 年 4 月 29 日
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 年 5 月 6 日
20	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 年 5 月 12 日
21	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 年 5 月 26 日
22	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 年 5 月 26 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 6 月 10 日
24	关于旗下部分基金新增中国人寿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 年 6 月 15 日
25	景顺长城中证 1000 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 年 6 月 16 日
26	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 年 6 月 22 日
27	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 年 6 月 24 日
28	关于旗下部分基金新增诺亚正行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 年 6 月 29 日
29	关于景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金参加部分销售机构申购及/或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 年 6 月 30 日

30	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金关于开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 6 月 30 日
31	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金在直销网上交易系统开展申购、定投和转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 7 月 1 日
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 年 7 月 15 日
33	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 7 月 19 日
34	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 7 月 21 日
35	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 7 月 21 日
36	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 年 7 月 29 日
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 年 8 月 6 日
38	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增创金启富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 年 8 月 24 日
39	景顺长城基金管理有限公司关于开通交通银行借记卡直销网上交易业务及费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 25 日
40	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 年 8 月 27 日
41	关于网络平台冒用“景顺长城基金”及员工名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 31 日
42	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 31 日
43	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 8 月 31 日
44	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 年 9 月 2 日
45	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 年 9 月 9 日
46	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 年 9 月 16 日
47	关于旗下部分基金新增宁波银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 9 月 19 日

	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		
48	景顺长城基金管理有限公司关于公司固有资金投资旗下偏股型公募基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 10 月 18 日
49	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 10 月 26 日
50	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 10 月 26 日
51	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 年 10 月 31 日
52	景顺长城基金管理有限公司关于暂停武汉市伯嘉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 年 10 月 31 日
53	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 年 11 月 5 日
54	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 年 11 月 18 日
55	景顺长城中证 1000 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 年 11 月 30 日
56	景顺长城中证 1000 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 年 11 月 30 日
57	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增博时财富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 年 12 月 2 日
58	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（财务负责人）变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2022 年 12 月 6 日
59	关于旗下部分基金新增招商银行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 年 12 月 7 日
60	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 年 12 月 16 日
61	关于旗下部分基金参加东莞农村商业银行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 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220712-20221231	0.00	144,180,925.33	99,268,817.44	44,912,107.89	28.81
产品特有风险							
<p>本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20% 的情况,可能会出现如下风险:</p> <p>1、大额申购风险</p> <p>在出现投资者大额申购时,如本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况,可能导致以下风险:</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;</p> <p>(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回,如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;</p> <p>(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;</p> <p>(4) 因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;</p> <p>(5) 基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;</p> <p>(6) 大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p> <p>本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止和化解上述风险,最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前,请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各类风险。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》;

- 3、《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 1000 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。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2023 年 3 月 28 日