

长盛中证 100 指数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44

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	44
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	44
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	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	46
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛中证 100 指数证券投资基金
基金简称	长盛中证 100 指数
基金主代码	519100
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 22 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	209,005,440.60 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在 4% 以下，以实现对基准指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率 \times 95% + 一年期银行储蓄存款利率（税后） \times 5%
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，风险中等，将获得证券市场平均收益率。其风险因素主要来自于市场风险和跟踪误差的风险。由于采用被动投资策略，在投资管理上将最大限度的分散非系统性风险。对于跟踪误差的风险，本基金将通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的跟踪误差在限定范围内。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张利宁	秦一楠
	联系电话	010-86497608	010-66060069
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95599
传真		010-86497999	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100029	100031
法定代表人		胡甲	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn

基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址
------------	------------------

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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,708,212.57
本期利润	893,360.99
加权平均基金份额本期利润	0.0042
本期加权平均净值利润率	0.35%
本期基金份额净值增长率	0.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	39,240,642.87
期末可供分配基金份额利润	0.1877
期末基金资产净值	248,246,083.47
期末基金份额净值	1.1877
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	161.25%

注：1、所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。

2、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。

3、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（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 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	2.82%	0.88%	1.87%	0.89%	0.95%	-0.01%
过去三个月	-4.22%	0.81%	-5.54%	0.83%	1.32%	-0.02%
过去六个月	0.31%	0.84%	-1.14%	0.85%	1.45%	-0.01%
过去一年	-12.73%	0.98%	-15.43%	1.00%	2.70%	-0.02%

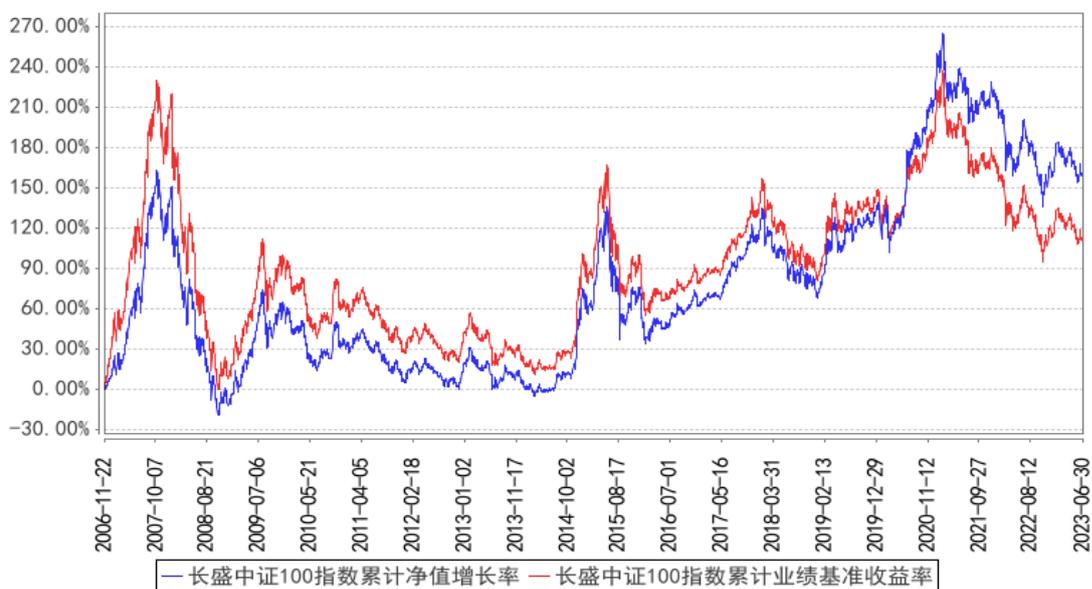
过去三年	9.03%	1.16%	-11.10%	1.17%	20.13%	-0.01%
自基金合同生效起至今	161.25%	1.57%	112.09%	1.58%	49.16%	-0.01%

注：本基金基准指数：中证 100 指数

本基金的业绩比较基准中证 100 指数由中证指数有限公司构建和发布。具体的编制规则和再平衡过程请参见中证 100 指数编制细则。

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

长盛中证100指数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：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内首批成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金总部办公地位于北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，并拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行（DBS）有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用融资担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、

全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基金的投资顾问。截至 2023 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

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		
陈亘斯	本基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2019 年 10 月 9 日	-	14 年	陈亘斯先生，硕士。曾任 PineRiver 资产管理公司量化分析师，国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理，北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

本基金本报告期内无基金经理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，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现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。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2023 年上半年，A 股市场整体呈现震荡格局，板块分化剧烈并且行业轮动迅猛。去年底受到经济修复至常态的预期引导而快速反弹的消费相关板块走势乏力，缺乏宏观经济数据和政策力度的支持，居民超额储蓄的内部不平衡的结构和蕴含的低风险偏好依然未见起色。三架马车中的出口增速的中期展望亦显疲软，市场对政府投资及采购的发力和落地的预期较高，叠加一带一路大外交的破局，带动了大基建、信创、数据资产板块的行情持续发酵。随着三月份 chatgpt 新版本

的推出，投资者对于技术革命的热情在多年沉寂后重被点燃，TMT 板块的未来预期被全面打开。二季度 A 股延续了一季度启动的重点板块行情，即红利低估性质的央国企价值重估走势和强成长预期的人工智能相关板块的突围。市场既追求远期的成长性，又不忘当下的分红安全性，这两者并存所带来杠铃型行情在一定程度上反应了对经济增长的不确定性的担忧。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1877 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.31%，同期业绩比较基准收益率为-1.14%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0122%，年度化跟踪误差为 0.6589%。

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 年下半年，目前能观察到大国外交关系有解冻趋缓的态势并且市场对经济政策的预期开始增强，譬如促进新能源汽车、储能和电网建设的政策频频发力，管理层对于人工智能相关产业链高度重视并鼓励前瞻布局等。虽然下半年的国内经济可能还会处于夯实底部阶段，但库存去化开始进入后半程。我们预计美联储即便停止加息，但美国经济自然回落可能仍将美元的实际利率维持在显著的 1%-2%的水平到四季度，这对中美息差收窄和外资流入仍有一定压制作用，并且国内的风险偏好重新上升仍需等待政策的进一步发力。真正的重大机会或许来自供给侧的一定程度的调整出清配合需求侧的有力支持从而两者达到较为平衡的状态之时。柳暗花明总在峰回路转处，若干年后回头看这也许是国内经济迈向高质量发展、打开更广阔天地的转型途中一次短暂的波折。我们更需要耐心等待，在投资上转变追求短平快的心态，戒急用忍方能行稳致远。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司业务运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、

风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2023 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为 39,240,642.87 元，其中，未分配收益已实现部分为 211,726,553.43 元，未分配收益未实现部分为-172,485,910.56 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——长盛基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长盛中证 100 指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	14,981,328.36	15,359,309.39
结算备付金		310,627.45	300,135.00
存出保证金		304,367.85	315,500.08
交易性金融资产	6.4.7.2	233,001,818.98	234,888,854.48
其中：股票投资		232,935,749.28	234,823,720.50
基金投资		-	-
债券投资		66,069.70	65,133.98
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		18,783.25	26,842.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		248,616,925.89	250,890,641.05
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		71,750.58	24,604.42
应付管理人报酬		153,052.97	160,775.56
应付托管费		30,610.57	32,155.10
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	0.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	115,427.96	198,217.12
负债合计		370,842.42	415,752.55
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.10	209,005,440.60	211,554,585.08
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	39,240,642.87	38,920,303.42
净资产合计		248,246,083.47	250,474,888.50
负债和净资产总计		248,616,925.89	250,890,641.05

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1877 元，基金份额总额 209,005,440.60 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛中证 100 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,140,824.55	-19,336,517.85
1. 利息收入		128,243.12	131,049.07
其中：存款利息收入	6.4.7.13	128,243.12	131,049.07
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		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,821,754.99	18,670,557.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,892,033.80	16,019,852.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	61.86	162,364.37
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,929,659.33	2,488,340.42
以摊余成本计量的			
金融资产终止确认产生的			
收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-2,814,851.58	-38,145,815.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	5,678.02	7,690.83
减：二、营业总支出		1,247,463.56	1,344,562.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	963,388.84	1,043,698.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	192,677.72	208,739.85
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.24	0.12
8. 其他费用	6.4.7.23	91,396.76	92,123.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		893,360.99	-20,681,080.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		893,360.99	-20,681,080.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		893,360.99	-20,681,080.12

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长盛中证 100 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	211,554,585.08	-	38,920,303.42	250,474,888.50
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)	211,554,585.08	-	38,920,303.42	250,474,888.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,549,144.48	-	320,339.45	-2,228,805.03
(一)、综合收益总额	-	-	893,360.99	893,360.99
(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)	-2,549,144.48	-	-573,021.54	-3,122,166.02
其中：1. 基金申购款	6,844,075.33	-	1,624,809.37	8,468,884.70
2. 基金赎回款	-9,393,219.81	-	-2,197,830.91	-11,591,050.72
(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)	209,005,440.60	-	39,240,642.87	248,246,083.47
项目	上年度可比期间 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)	213,380,900.59	-	97,664,959.65	311,045,860.24
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)	213,380,900.59	-	97,664,959.65	311,045,860.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	861,908.71	-	-20,345,330.84	-19,483,422.13
(一)、综合收益总额	-	-	-20,681,080.12	-20,681,080.12
(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)	861,908.71	-	335,749.28	1,197,657.99
其中: 1. 基金申购款	10,384,894.03	-	3,270,675.27	13,655,569.30
2. 基金赎回款	-9,522,985.32	-	-2,934,925.99	-12,457,911.31
(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)	214,242,809.30	-	77,319,628.81	291,562,438.11

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:

胡甲

基金管理人负责人

刁俊东

主管会计工作负责人

龚珉

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长盛中证 100 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”)证监基金字[2006]第 172 号《关于同意长盛中证 100 指数证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛中证 100

指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 4,029,660,276.84 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 179 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》于 2006 年 11 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,031,424,938.24 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,764,661.40 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括中证 100 指数成份股、备选成份股、新股(如一级市场初次发行或增发)等，以及法律法规及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券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，并且可以依照法律法规或监管机构的规定运用金融衍生产品进行风险管理。本基金力争保持基金净值收益率与业绩衡量基准之间的年跟踪误差在 4% 以下。本基金的业绩比较基准为：中证 100 指数收益率 \times 95%+一年期银行储蓄存款利率(税后) \times 5%。本基金标的指数使用费由基金管理人长盛基金管理有限公司承担，不计入本基金费用。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》和中国证监会、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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

(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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	14,981,328.36
等于：本金	14,975,488.67
加：应计利息	5,839.69
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	14,981,328.36

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	233,019,200.11	-	232,935,749.28	-83,450.83	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	53,500.00	98.85	66,069.70	12,470.85
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	53,500.00	98.85	66,069.70	12,470.85

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	233,072,700.11	98.85	233,001,818.98	-70,979.98

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.7.5 债权投资

无余额。

6.4.7.6 其他债权投资

无余额。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无余额。

6.4.7.8 其他资产

无余额。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	74.35
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	22,350.89
其中：交易所市场	22,350.89
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
其他	3,742.57
合计	115,427.96

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	211,554,585.08	211,554,585.08
本期申购	6,844,075.33	6,844,075.33

本期赎回（以“-”号填列）	-9,393,219.81	-9,393,219.81
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	209,005,440.60	209,005,440.60

注：申购含转换入；赎回含转换出。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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
上年度末	210,570,692.35	-171,650,388.93	38,920,303.42
本期利润	3,708,212.57	-2,814,851.58	893,360.99
本期基金份额交易产生的变动数	-2,552,351.49	1,979,329.95	-573,021.54
其中：基金申购款	6,833,281.00	-5,208,471.63	1,624,809.37
基金赎回款	-9,385,632.49	7,187,801.58	-2,197,830.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	211,726,553.43	-172,485,910.56	39,240,642.87

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	123,249.64
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	2,507.86
其他	2,485.62
合计	128,243.12

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,892,033.80
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-

合计	1,892,033.80
----	--------------

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	16,705,201.04
减：卖出股票成本总额	14,766,512.73
减：交易费用	46,654.51
买卖股票差价收入	1,892,033.80

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	61.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	61.86

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,929,659.33
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	2,929,659.33

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,814,851.58
股票投资	-2,815,723.63
债券投资	872.05
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	-2,814,851.58

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	5,674.97
基金转换费收入	3.05
合计	5,678.02

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,136.61
合计	91,396.76

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 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 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国元证券	27,222,762.29	98.98	263,939,070.54	96.72

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
国元证券	-	-	1,065,382.80	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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 (%)
国元证券	25,352.46	98.98	22,350.89	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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 (%)
国元证券	245,460.47	96.72	241,173.90	99.82

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 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等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年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	963,388.84
其中：支付销售机构的客户维护费	431,816.70	466,976.40

注：支付基金管理人长盛基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.75\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年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	192,677.72

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	14,981,328.36	123,249.64	16,431,894.49	125,623.90
合计	14,981,328.36	123,249.64	16,431,894.49	125,623.90

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	受限期	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日		限类型	价格	值单价	(单 位:股)	成本总额	总额	
001286	陕西能源	2023年 3月31日	6个月	限售期 锁定	9.60	9.93	3,767	36,163.20	37,406.31	-
001287	中电港	2023年 3月30日	6个月	限售期 锁定	11.88	25.32	352	4,181.76	8,912.64	-
001324	长青科技	2023年 5月12日	6个月	限售期 锁定	18.88	20.03	114	2,152.32	2,283.42	-
001360	南矿集团	2023年 3月31日	6个月	限售期 锁定	15.38	16.45	150	2,307.00	2,467.50	-
001367	海森药业	2023年 3月30日	6个月	限售期 锁定	44.48	42.55	48	2,135.04	2,042.40	-
301141	中科磁业	2023年 3月27日	6个月	限售期 锁定	41.20	42.71	234	9,640.80	9,994.14	-
301157	华塑科技	2023年 3月1日	6个月	限售期 锁定	56.50	52.92	132	7,458.00	6,985.44	-
301202	朗威股份	2023年 6月28日	1个月 内(含)	新股未 上市	25.82	25.82	1,844	47,612.08	47,612.08	-
301202	朗威股份	2023年 6月28日	6个月	限售期 锁定	25.82	25.82	205	5,293.10	5,293.10	-
301246	宏源药业	2023年 3月10日	6个月	限售期 锁定	50.00	30.71	304	15,200.00	9,335.84	-
301281	科源制药	2023年 3月28日	6个月	限售期 锁定	44.18	25.36	280	8,836.00	7,100.80	-
301305	朗坤环境	2023年 5月15日	6个月	限售期 锁定	25.25	19.83	389	9,822.25	7,713.87	-
301315	威士顿	2023年 6月13日	6个月	限售期 锁定	32.29	55.59	201	6,490.29	11,173.59	-
301320	豪江智能	2023年 6月1日	6个月	限售期 锁定	13.06	23.16	642	8,384.52	14,868.72	-
301322	绿通科技	2023年 2月27日	6个月	限售期 锁定	131.11	53.20	122	10,619.91	6,490.40	-

		日								
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	限售期 锁定	14.81	13.74	577	8,545.37	7,927.98	-
301337	亚华电 子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	限售期 锁定	32.60	32.24	200	6,520.00	6,448.00	-
301345	涛涛车 业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	限售期 锁定	73.45	46.64	110	8,079.50	5,130.40	-
301355	南王科 技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	限售期 锁定	17.55	17.23	424	7,441.20	7,305.52	-
301358	湖南裕 能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	限售期 锁定	23.77	42.86	310	7,368.70	13,286.60	-
301360	荣旗科 技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	限售期 锁定	71.88	92.81	111	7,978.68	10,301.91	-
301373	凌玮科 技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	限售期 锁定	33.73	31.84	232	7,825.36	7,386.88	-
301376	致欧科 技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	限售期 锁定	24.66	22.57	301	7,422.66	6,793.57	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	限售期 锁定	23.80	35.90	327	7,782.60	11,739.30	-
301408	华人健 康	2023 年 2 月 22 日	6 个月	限售期 锁定	16.24	16.95	582	9,451.68	9,864.90	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	6 个月	限售期 锁定	24.80	43.78	330	8,184.00	14,447.40	-
301428	世纪恒 通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	限售期 锁定	26.35	33.25	229	6,034.15	7,614.25	-
301439	泓淋电 力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	限售期 锁定	19.99	16.91	345	6,896.55	5,833.95	-
301486	致尚科 技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	57.66	57.66	1,458	84,068.28	84,068.28	-
301486	致尚科 技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	限售期 锁定	57.66	57.66	163	9,398.58	9,398.58	-
601061	中信金 属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	限售期 锁定	6.58	8.18	776	5,106.08	6,347.68	-

601065	江盐集团	2023年 3月31 日	6个月	限售期 锁定	10.36	12.59	280	2,900.80	3,525.20	-
601133	柏诚股份	2023年 3月31 日	6个月	限售期 锁定	11.66	13.72	252	2,938.32	3,457.44	-
603125	常青科技	2023年 3月30 日	6个月	限售期 锁定	25.98	26.51	91	2,364.18	2,412.41	-
603137	恒尚节能	2023年 4月10 日	6个月	限售期 锁定	15.90	18.25	139	2,210.10	2,536.75	-
603172	万丰股份	2023年 4月28 日	6个月	限售期 锁定	14.58	16.68	122	1,778.76	2,034.96	-
688249	晶合集成	2023年 4月24 日	6个月	限售期 锁定	19.86	18.07	1,543	30,643.98	27,882.01	-
688334	西高院	2023年 6月9日	6个月	限售期 锁定	14.16	17.20	487	6,895.92	8,376.40	-
688352	硕中科技	2023年 4月11 日	6个月	限售期 锁定	12.10	12.63	752	9,099.20	9,497.76	-
688361	中科飞测	2023年 5月12 日	6个月	限售期 锁定	23.60	78.84	240	5,664.00	18,921.60	-
688429	时创能源	2023年 6月20 日	6个月	限售期 锁定	19.20	27.88	294	5,644.80	8,196.72	-
688458	美芯晟	2023年 5月15 日	6个月	限售期 锁定	75.00	90.95	101	7,575.00	9,185.95	-
688469	中芯集成	2023年 4月28 日	6个月	限售期 锁定	5.69	5.45	2,774	15,784.06	15,118.30	-
688472	阿特斯	2023年 6月2日	6个月	限售期 锁定	11.10	17.24	1,016	11,277.60	17,515.84	-
688479	友车科技	2023年 5月4日	6个月	限售期 锁定	33.99	29.83	188	6,390.12	5,608.04	-
688484	南芯科技	2023年 3月28 日	6个月	限售期 锁定	39.99	38.64	271	10,837.29	10,471.44	-
688535	华海诚科	2023年 3月28	6个月	限售期 锁定	35.00	54.75	161	5,635.00	8,814.75	-

688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	限售期 锁定	21.17	24.18	372	7,875.24	8,994.96	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	限售期 锁定	12.68	25.35	526	6,669.68	13,334.10	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	限售期 锁定	125.80	118.08	64	8,051.20	7,557.12	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25 日	6 个月	限售期 锁定	11.18	16.26	636	7,110.48	10,341.36	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	限售期 锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	限售期 锁定	125.88	89.31	71	8,937.48	6,341.01	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、本基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、本基金可作为特定投资者，参与上市公司公开或非公开发行股份认购。本基金可作为特定投资者所认购的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

4、本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。本基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

5、本基金可以通过网下发行获配的创业板股票。发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值比例为 0.03%（2022 年 12 月 31 日：0.03%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金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%，本基金与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上述比例限制）。

本基金所持证券均在证券交易所上市，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%。于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合上述要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 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。于 2023 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,975,488.67	-	-	5,839.69	14,981,328.36
结算备付金	310,501.72	-	-	125.73	310,627.45
存出保证金	304,244.55	-	-	123.30	304,367.85

交易性金融资产	-	65,970.85	-	-232,935,848.13	233,001,818.98
应收申购款	-	-	-	18,783.25	18,783.25
资产总计	15,590,234.94	65,970.85	-	-232,960,720.10	248,616,925.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	71,750.58	71,750.58
应付管理人报酬	-	-	-	153,052.97	153,052.97
应付托管费	-	-	-	30,610.57	30,610.57
应交税费	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	115,427.96	115,427.96
负债总计	-	-	-	370,842.42	370,842.42
利率敏感度缺口	15,590,234.94	65,970.85	-	-232,589,877.68	248,246,083.47
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,352,651.00	-	-	6,658.39	15,359,309.39
结算备付金	300,000.00	-	-	135.00	300,135.00
存出保证金	315,358.18	-	-	141.90	315,500.08
交易性金融资产	-	65,098.80	-	-234,823,755.68	234,888,854.48
应收申购款	-	-	-	26,842.10	26,842.10
资产总计	15,968,009.18	65,098.80	-	-234,857,533.07	250,890,641.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	24,604.42	24,604.42
应付管理人报酬	-	-	-	160,775.56	160,775.56
应付托管费	-	-	-	32,155.10	32,155.10
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	198,217.12	198,217.12
负债总计	-	-	-	415,752.55	415,752.55
利率敏感度缺口	15,968,009.18	65,098.80	-	-234,441,780.52	250,474,888.50

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.03%（2022 年 12 月 31 日：0.03%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022 年 12 月 31 日：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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的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。

本基金原则上采用复制指数投资策略，股票资产跟踪的标的指数为中证 100 指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中包括中证 100 指数成份股、备选成份股、新股（如一级市场初次发行或增发）等，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	232,935,749.28	93.83	234,823,720.50	93.75
合计	232,935,749.28	93.83	234,823,720.50	93.75

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2023 年 6 月 30 日)	上年度末(2022 年 12 月 31 日)
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	12,168,565.00	12,439,841.60
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-12,168,565.00	-12,439,841.60

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	232,331,614.41	233,867,749.32
第二层次	222,877.04	-
第三层次	447,327.53	1,021,105.16
合计	233,001,818.98	234,888,854.48

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的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 2023 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资产(2022 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

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	232,935,749.28	93.69
	其中：股票	232,935,749.28	93.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	66,069.70	0.03
	其中：债券	66,069.70	0.03
	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	15,291,955.81	6.15
8	其他各项资产	323,151.10	0.13
9	合计	248,616,925.89	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	2,501,181.00	1.01
B	采矿业	13,100,270.58	5.28
C	制造业	143,043,444.01	57.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,754,026.32	3.12
E	建筑业	4,219,137.06	1.70
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,667,734.10	1.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,187,207.68	6.52
J	金融业	27,150,240.36	10.94
K	房地产业	4,971,122.79	2.00
L	租赁和商务服务业	3,815,516.40	1.54
M	科学研究和技术服务业	3,423,376.56	1.38
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	1,848,396.20	0.74
R	文化、体育和娱乐业	561,044.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	232,242,697.06	93.55

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	522,877.73	0.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,406.31	0.02
E	建筑业	5,994.19	0.00
F	批发和零售业	31,918.79	0.01
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	55,917.28	0.02
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	31,224.05	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	7,713.87	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	693,052.22	0.28

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	13,530	22,879,230.00	9.22
2	300750	宁德时代	56,700	12,972,393.00	5.23
3	601318	中国平安	234,784	10,893,977.60	4.39
4	600036	招商银行	267,966	8,778,566.16	3.54
5	000333	美的集团	106,096	6,251,176.32	2.52
6	002594	比亚迪	19,647	5,074,230.69	2.04
7	600900	长江电力	210,972	4,654,042.32	1.87
8	600276	恒瑞医药	96,809	4,637,151.10	1.87
9	601899	紫金矿业	363,211	4,129,709.07	1.66
10	300059	东方财富	271,953	3,861,732.60	1.56
11	601012	隆基绿能	131,392	3,767,008.64	1.52
12	601398	工商银行	750,200	3,615,964.00	1.46
13	600309	万华化学	40,618	3,567,885.12	1.44
14	000651	格力电器	97,142	3,546,654.42	1.43
15	002475	立讯精密	106,940	3,470,203.00	1.40
16	002415	海康威视	99,984	3,310,470.24	1.33
17	000725	京东方 A	794,455	3,249,320.95	1.31
18	300760	迈瑞医疗	10,500	3,147,900.00	1.27
19	000063	中兴通讯	68,475	3,118,351.50	1.26
20	603259	药明康德	44,376	2,765,068.56	1.11
21	002230	科大讯飞	40,500	2,752,380.00	1.11
22	300274	阳光电源	22,600	2,635,838.00	1.06
23	601668	中国建筑	454,819	2,610,661.06	1.05
24	300124	汇川技术	40,300	2,587,663.00	1.04
25	600028	中国石化	404,253	2,571,049.08	1.04
26	002714	牧原股份	59,340	2,501,181.00	1.01
27	002352	顺丰控股	52,490	2,366,774.10	0.95
28	601888	中国中免	21,000	2,321,130.00	0.94
29	002129	TCL 中环	68,500	2,274,200.00	0.92
30	000792	盐湖股份	117,200	2,246,724.00	0.91
31	601088	中国神华	71,412	2,195,919.00	0.88
32	688981	中芯国际	42,215	2,132,701.80	0.86
33	600031	三一重工	127,300	2,116,999.00	0.85
34	000002	万科 A	147,208	2,063,856.16	0.83
35	600406	国电南瑞	87,720	2,026,332.00	0.82
36	600048	保利发展	155,421	2,025,135.63	0.82
37	600438	通威股份	58,600	2,010,566.00	0.81
38	600050	中国联通	414,975	1,991,880.00	0.80
39	600690	海尔智家	82,085	1,927,355.80	0.78

40	600436	片仔癀	6,700	1,918,612.00	0.77
41	600089	特变电工	84,500	1,883,505.00	0.76
42	601728	中国电信	333,300	1,876,479.00	0.76
43	002371	北方华创	5,900	1,874,135.00	0.75
44	601857	中国石油	247,869	1,851,581.43	0.75
45	300015	爱尔眼科	99,644	1,848,396.20	0.74
46	600941	中国移动	19,500	1,819,350.00	0.73
47	603501	韦尔股份	18,235	1,787,759.40	0.72
48	601766	中国中车	259,963	1,689,759.50	0.68
49	600905	三峡能源	306,700	1,646,979.00	0.66
50	000938	紫光股份	51,200	1,630,720.00	0.66
51	601390	中国中铁	212,200	1,608,476.00	0.65
52	300014	亿纬锂能	26,400	1,597,200.00	0.64
53	603986	兆易创新	14,600	1,551,250.00	0.62
54	601225	陕西煤业	84,500	1,537,055.00	0.62
55	002027	分众传媒	219,440	1,494,386.40	0.60
56	002049	紫光国微	16,000	1,492,000.00	0.60
57	002460	赣锋锂业	24,460	1,491,081.60	0.60
58	002466	天齐锂业	21,200	1,482,092.00	0.60
59	600570	恒生电子	33,060	1,464,227.40	0.59
60	000338	潍柴动力	117,000	1,457,820.00	0.59
61	601985	中国核电	206,100	1,453,005.00	0.59
62	600111	北方稀土	55,500	1,330,890.00	0.54
63	601919	中远海控	138,400	1,300,960.00	0.52
64	000100	TCL 科技	328,500	1,294,290.00	0.52
65	603799	华友钴业	27,600	1,267,116.00	0.51
66	600585	海螺水泥	52,144	1,237,898.56	0.50
67	600893	航发动力	29,100	1,229,766.00	0.50
68	688111	金山办公	2,584	1,220,216.48	0.49
69	002271	东方雨虹	43,400	1,183,084.00	0.48
70	002555	三七互娱	33,900	1,182,432.00	0.48
71	300122	智飞生物	25,950	1,146,990.00	0.46
72	002812	恩捷股份	11,500	1,108,025.00	0.45
73	600019	宝钢股份	190,286	1,069,407.32	0.43
74	002709	天赐材料	25,100	1,033,869.00	0.42
75	600426	华鲁恒升	32,400	992,412.00	0.40
76	000661	长春高新	7,200	981,360.00	0.40
77	601600	中国铝业	171,400	940,986.00	0.38
78	002410	广联达	28,920	939,610.80	0.38
79	002241	歌尔股份	52,200	926,550.00	0.37
80	300142	沃森生物	34,600	915,170.00	0.37
81	600745	闻泰科技	18,700	914,430.00	0.37
82	600588	用友网络	44,600	914,300.00	0.37

83	001979	招商蛇口	67,700	882,131.00	0.36
84	600010	包钢股份	486,300	870,477.00	0.35
85	300450	先导智能	23,600	853,612.00	0.34
86	603993	洛阳钼业	152,900	814,957.00	0.33
87	002493	荣盛石化	65,900	767,076.00	0.31
88	600176	中国巨石	52,300	740,568.00	0.30
89	000301	东方盛虹	57,900	684,378.00	0.28
90	300347	泰格医药	10,200	658,308.00	0.27
91	600346	恒力石化	45,900	657,747.00	0.26
92	688599	天合光能	15,075	642,345.75	0.26
93	600989	宝丰能源	48,000	605,280.00	0.24
94	300413	芒果超媒	16,400	561,044.00	0.23
95	603260	合盛硅业	8,000	560,160.00	0.23
96	002648	卫星化学	36,700	549,032.00	0.22
97	300661	圣邦股份	6,370	523,168.10	0.21
98	002601	龙佰集团	31,100	513,150.00	0.21
99	300628	亿联网络	10,760	377,353.20	0.15
100	000708	中信特钢	21,900	346,896.00	0.14

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	301486	致尚科技	1,621	93,466.86	0.04
2	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.03
3	301202	朗威股份	2,049	52,905.18	0.02
4	001286	陕西能源	3,767	37,406.31	0.02
5	688249	晶合集成	1,543	27,882.01	0.01
6	301297	富乐德	1,015	22,847.65	0.01
7	688361	中科飞测	240	18,921.60	0.01
8	688472	阿特斯	1,016	17,515.84	0.01
9	688469	中芯集成	2,774	15,118.30	0.01
10	301320	豪江智能	642	14,868.72	0.01
11	301419	阿莱德	330	14,447.40	0.01
12	688562	航天软件	526	13,334.10	0.01
13	301358	湖南裕能	310	13,286.60	0.01
14	301382	蜂助手	327	11,739.30	0.00
15	301315	威士顿	201	11,173.59	0.00
16	688484	南芯科技	271	10,471.44	0.00
17	688593	新相微	636	10,341.36	0.00
18	301360	荣旗科技	111	10,301.91	0.00
19	301141	中科磁业	234	9,994.14	0.00
20	301408	华人健康	582	9,864.90	0.00
21	688352	颀中科技	752	9,497.76	0.00
22	301246	宏源药业	304	9,335.84	0.00

23	688458	美芯晟	101	9,185.95	0.00
24	688552	航天南湖	372	8,994.96	0.00
25	001287	中电港	352	8,912.64	0.00
26	688535	华海诚科	161	8,814.75	0.00
27	688334	西高院	487	8,376.40	0.00
28	688429	时创能源	294	8,196.72	0.00
29	301332	德尔玛	577	7,927.98	0.00
30	301305	朗坤环境	389	7,713.87	0.00
31	301428	世纪恒通	229	7,614.25	0.00
32	688581	安杰思	64	7,557.12	0.00
33	301373	凌玮科技	232	7,386.88	0.00
34	301355	南王科技	424	7,305.52	0.00
35	301281	科源制药	280	7,100.80	0.00
36	301157	华塑科技	132	6,985.44	0.00
37	301376	致欧科技	301	6,793.57	0.00
38	301322	绿通科技	122	6,490.40	0.00
39	301337	亚华电子	200	6,448.00	0.00
40	601061	中信金属	776	6,347.68	0.00
41	688623	双元科技	71	6,341.01	0.00
42	301439	泓淋电力	345	5,833.95	0.00
43	688479	友车科技	188	5,608.04	0.00
44	301345	涛涛车业	110	5,130.40	0.00
45	601065	江盐集团	280	3,525.20	0.00
46	601133	柏诚股份	252	3,457.44	0.00
47	603137	恒尚节能	139	2,536.75	0.00
48	001360	南矿集团	150	2,467.50	0.00
49	603125	常青科技	91	2,412.41	0.00
50	001324	长青科技	114	2,283.42	0.00
51	001367	海森药业	48	2,042.40	0.00
52	603172	万丰股份	122	2,034.96	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	688111	金山办公	1,268,615.95	0.51
2	601390	中国中铁	1,090,482.00	0.44
3	002466	天齐锂业	1,054,505.00	0.42
4	600941	中国移动	710,339.00	0.28
5	600028	中国石化	690,644.00	0.28
6	601728	中国电信	672,536.00	0.27
7	601899	紫金矿业	617,032.00	0.25
8	600905	三峡能源	613,987.00	0.25

9	688599	天合光能	595,362.94	0.24
10	300347	泰格医药	481,741.00	0.19
11	001286	陕西能源	361,603.20	0.14
12	300661	圣邦股份	351,637.00	0.14
13	688249	晶合集成	306,340.50	0.12
14	601857	中国石油	285,846.00	0.11
15	603501	韦尔股份	260,026.00	0.10
16	002049	紫光国微	243,555.00	0.10
17	000938	紫光股份	238,479.00	0.10
18	603260	合盛硅业	227,751.00	0.09
19	000301	东方盛虹	204,578.00	0.08
20	600111	北方稀土	196,308.00	0.08

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600900	长江电力	960,413.00	0.38
2	300782	卓胜微	828,787.20	0.33
3	600519	贵州茅台	679,738.00	0.27
4	600219	南山铝业	495,264.00	0.20
5	688515	裕太微	388,440.00	0.16
6	601318	中国平安	344,842.00	0.14
7	001286	陕西能源	339,000.00	0.14
8	000651	格力电器	303,750.00	0.12
9	600036	招商银行	273,212.00	0.11
10	000725	京东方 A	273,043.00	0.11
11	688249	晶合集成	270,887.37	0.11
12	300059	东方财富	211,282.00	0.08
13	601398	工商银行	203,856.00	0.08
14	600309	万华化学	196,144.00	0.08
15	688053	思科瑞	190,458.44	0.08
16	000333	美的集团	182,554.00	0.07
17	688439	振华风光	176,605.05	0.07
18	301358	湖南裕能	175,759.20	0.07
19	600436	片仔癀	175,657.00	0.07
20	002415	海康威视	175,023.00	0.07

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	15,694,265.14
卖出股票收入（成交）总额	16,705,201.04

注：本项中 7.4.1、7.4.2 和 7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
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）	66,069.70	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	66,069.70	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127073	天赐转债	535	66,069.70	0.03

注：本基金本报告期末仅持有上述 1 只债券。

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

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

招商银行

本基金跟踪的标的指数为中证 100 指数，配置了中证 100 指数成分股招商银行。2022 年 11 月 4 日，银保监罚决字(2022)48 号显示，招商银行股份有限公司存在个人经营贷款挪用至房地产市场等 3 项违法违规事实，被处罚款 460 万元。2022 年 12 月 30 日，银罚决字(2022)1 号显示，招商银行股份有限公司存在违反账户管理规定等 13 项违法违规事实，被处警告，没收违法所得 5.692641 万元，罚款 3,423.5 万元。2023 年 1 月 18 日，中国银行间市场交易商协会自律处分信息显示，招商银行股份有限公司存在多期债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销，个别债务融资工具挤占了其他投资人的正常投标，违背了公平公正原则，并影响了发行利率等 4 项违法违规事实，被处罚款 460 万元。对以上事件，本基金判断，招商银行股份有限公司经营较为稳健，上述处罚对公司影响可控。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	304,367.85
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,783.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	323,151.10

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127073	天赐转债	66,069.70	0.03

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

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	301486	致尚科技	93,466.86	0.04	新股未上市和限售期锁定
2	688603	天承科技	76,505.00	0.03	新股未上市和限售期锁定
3	301202	朗威股份	52,905.18	0.02	新股未上市和限售期锁定
4	001286	陕西能源	37,406.31	0.02	限售期锁定
5	688249	晶合集成	27,882.01	0.01	限售期锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
14,660	14,256.85	517,663.66	0.25	208,487,776.94	99.75

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	56,458.32	0.0270

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 11 月 22 日） 基金份额总额	4,031,424,938.24
本报告期期初基金份额总额	211,554,585.08
本报告期基金总申购份额	6,844,075.33
减：本报告期基金总赎回份额	9,393,219.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	209,005,440.60

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司第八届董事会相关会议决议，选举胡甲先生担任公司董事长，同时代行公司总经理职务，代行总经理职务期限不超 6 个月；高民和先生不再担任公司董事长，周兵先生不再担任公司总经理职务。公司已按规定向相关监管机构报备并进行公告。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 5 月 11 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改，整改措施主要包括完善内部制度、优化管控流程等
其他	-

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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 (%)	
国元证券	2	27,222,762.29	98.98	25,352.46	98.98	-
中信证券	2	281,828.64	1.02	262.47	1.02	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资质雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；
 - (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；
 - (3) 研究、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；
 - (4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；
 - (5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；
 - (6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。
- 3、本基金租用证券公司的北京交易单元为共用交易单元。
- 4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛中证 100 指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 20 日
2	长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 1 月 20 日
3	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加华瑞保险为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 8 日
4	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 15 日
5	长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 15 日
6	长盛基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
7	长盛中证 100 指数证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
8	长盛基金管理有限公司关于终止部分基金销售机构办理旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 3 月 31 日
9	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 17 日
10	长盛中证 100 指数证券投资基金 2023	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 22 日

	年第 1 季度报告	介	
11	长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 4 月 22 日
12	长盛基金管理有限公司关于旗下基金参与平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 5 月 5 日
13	长盛基金管理有限公司关于增加东方证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投业务与转换业务的公告	中国证监会指定披露媒介	2023 年 6 月 7 日
14	长盛中证 100 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定披露媒介	2023 年 6 月 26 日
15	长盛中证 100 指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定披露媒介	2023 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、长盛中证 100 指数证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛中证 100 指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛中证 100 指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛中证 100 指数证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日