

长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型  
证券投资基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2023 年 8 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 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	38

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....	46
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 .....	48
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	48
7.11 投资组合报告附注 .....	49
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	50
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金
基金简称	长信标普 100 等权重指数 (QDII)
场内简称	长信标普 100
基金主代码	519981
交易代码	519981
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 30 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,204,623.61 份
基金合同存续期	不定期

注：1、本基金另设美元份额，基金代码 011706，与人民币份额并表披露；

2、截止本报告期末，本基金人民币份额净值 1.744 元，人民币总份额 27,483,067.74 份；本基金美元份额净值 0.241 美元，美元总份额 4,721,555.87 份。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过增强型指数化的投资来追求美国超大市值蓝筹股股票市场的中长期资本增值，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段力争将基金净值增长率和美国标准普尔 100 等权重指数（本基金的标的指数，以下简称“标普 100 等权重指数”）收益率之间的日均跟踪误差控制在 0.50% 以内（相应的年化跟踪误差控制在 7.94% 以内）。在控制跟踪误差的前提下通过有效的资产及行业组合和基本面研究，力求实现对标的指数的有效跟踪并取得优于标的指数的收益率。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，原则上不少于 80% 的基金净资产采用完全复制法，按照成份股在标普 100 等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变化、进行相应的调整。对于不高于基金净资产 15% 的主动型投资部分，基金管理人会根据深入的公司基本面和数量化研究以及对美国及全球宏观经济的理解和判断，在美国公开发行或上市交易的证券中有选择地重点投资于基金管理人认为最具有中长期成长价值的企业或本基金允许投资的固定收益类品种、货币市场工具、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。
业绩比较基准	标准普尔 100 等权重指数总收益率
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，本基金的净值波动与美国大市值蓝筹股票市场的整体波动高度相关，为较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

### 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	长信基金管理有限责任公司	中国银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	周永刚	许俊
	联系电话	021-61009999	010-66594319
	电子邮箱	zhouyug@cxfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	4007005566	95566	
传真	021-61009800	010-66594942	
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号	
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号	
邮政编码	200120	100818	
法定代表人	刘元瑞	葛海蛟	

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank Of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

## 2.5 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	人民币份额：中国证券登记结算有限责任公司、美元份额：长信基金管理有限责任公司	人民币份额：北京市西城区太平桥大街 17 号、美元份额：上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

# § 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	472,848.22
本期利润	3,829,867.32
加权平均基金份额本期利润	0.1208
本期加权平均净值利润率	7.25%

本期基金份额净值增长率	7.32%
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	13,936,743.58
期末可供分配基金份额利润	0.4328
期末基金资产净值	56,175,785.30
期末基金份额净值	1.744
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	180.66%

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、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（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

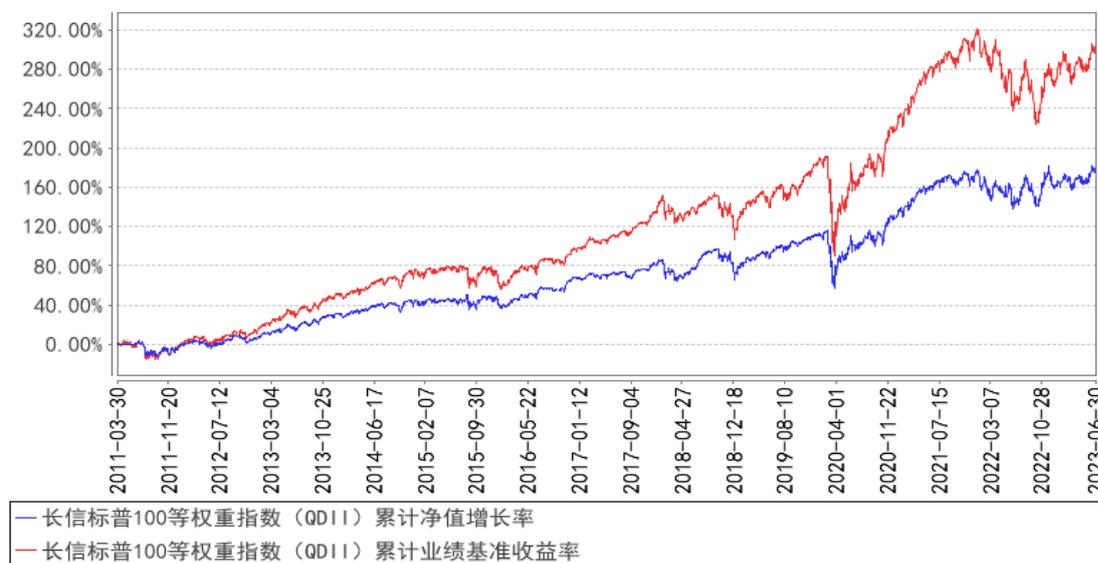
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.57%	0.78%	6.02%	0.67%	-0.45%	0.11%
过去三个月	4.24%	0.83%	4.94%	0.85%	-0.70%	-0.02%
过去六个月	7.32%	0.89%	10.03%	0.95%	-2.71%	-0.06%
过去一年	15.04%	1.07%	16.85%	1.13%	-1.81%	-0.06%
过去三年	41.21%	1.00%	54.63%	1.07%	-13.42%	-0.07%
自基金合同生效起至今	180.66%	0.96%	305.23%	1.13%	-124.57%	-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

长信标普100等权重指数 (QDII) 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2011 年 3 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 86 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资

资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金 (FOF)、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信稳健增长一年持有

期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
傅瑶纯	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理、国际业务部总监	2020 年 1 月 2 日	-	8 年	华威大学金融与经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于中国农业银行、易唯思商务咨询有限公司，2016 年 4 月加入长信基金管理有限责任公司，现任国际业务部总监、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，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、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，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财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

## 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

### 4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。

## 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，美股整体风险偏好随着加息接近尾声迅速抬升。虽然 3 月份发生了硅谷银行事件，但得益于美联储的快速介入解决，整体风险并没有出现进一步外溢。另一方面，随着经济数据的韧性，联储加息的步伐也开始继续回到原有轨道上，5 月，美联储将联邦基金利率目标区间再度上调 25 个基点到 5% 至 5.25% 的水平。虽然 6 月的议息会议上联储作出了暂停加息的决定，但加息大概率还未结束，联储最新的点阵图显示市场未来仍有 1-2 次的加息。但无论如何，加息进入到了尾声对于权益市场来说无疑提振了风险偏好，而得益于人工智能的兴起，相关股票的涨幅带动了整体指数的显著涨幅。最终，上半年标普 500 指数、纳斯达克指数、道琼斯指数分别上涨 15.91%，31.73% 及 3.8%。其中人工智能成分股占比较高的纳斯达克指数显著跑赢。

经济数据方面，虽然利率大幅上升，但美国经济增长仅是放缓，未见衰退；与此同时，劳动力市场表现也仍然强劲，其中 5 月最新的失业率只有 3.7%，为上世纪 60 年代以来最低水平附近。目前美国的经济增长的韧性主要来自于消费，居民部门目前的资产负债表仍相对健康，另一方面，疫情期间的超额储蓄也仍有结余，在未来至少半年以上的时间将继续支撑消费表现韧性。与之相反的企业部门，随着利率不断攀升，盈利空间受到压制的同时，负债成本也逐步开始上升，在目前核心通胀仍未出现显著下行的情况下，未来企业部门的风险将逐步累加。

### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止到 2023 年 6 月 30 日，本基金人民币份额净值为 1.744 元，份额累计净值为 2.261 元，美元份额净值为 0.241 美元，份额累计净值为 0.241 美元。本报告期内本基金净值增长率为 7.32%，同期业绩比较基准为 10.03%。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，较强的消费韧性预计将延缓美国衰退的时间点，在加息临近尾声期间美股整体风险偏好有望持续，板块上可能继续会呈现出人工智能显著跑赢的情况。但随着估值不断地上移，目前已经可以观察到无风险利率与美股收益率在同一水平附近，整体美股风险在不断上行的过程中将继续累加。目前阶段我们认为美债的配置价值将显著优于美股。等衰退兑现后，美股配置的性价比将开始逐步体现。

上半年标普 500 指数上涨 15.91%，本基金跟踪的标普 100 等权重指数上涨 10.03%，由于本轮的上涨中个股的分化差异较大，标普 100 指数显著跑输标普 500 指数。

#### 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，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性、适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成，相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2022 年 7 月 11 日至 2023 年 2 月 22 日。本基金管理人已经向中国证监会报告并提出解决方案。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,310,598.48	4,200,885.16
结算备付金		988,871.12	-
存出保证金		1,320,000.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	50,873,869.52	40,666,299.51
其中：股票投资		49,896,184.31	36,745,394.28
基金投资		834,794.51	3,920,905.23
债券投资		142,890.70	-
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		64,239.12	47,264.35
应收申购款		229,312.99	322,094.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		60,786,891.23	45,236,543.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,088,994.37	453,035.05
应付管理人报酬		51,923.58	41,590.49
应付托管费		14,160.97	11,342.90
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.01	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	456,026.00	426,642.73
负债合计		4,611,105.93	932,611.17
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	32,204,623.61	27,266,078.32
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	23,971,161.69	17,037,853.68
净资产合计		56,175,785.30	44,303,932.00
负债和净资产总计		60,786,891.23	45,236,543.17

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，长信标普 100 (QDII) 人民币份额净值 1.744 元，长信标普 100 (QDII) 美元份额净值 0.241 美元，基金份额总额为 32,204,623.61 份，其中长信标普 100 (QDII) 人民币份额 27,483,067.74 份，长信标普 100 (QDII) 美元份额 4,721,555.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		4,339,919.30	-5,368,516.92
1. 利息收入		4,286.26	2,085.42
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,286.26	2,085.42
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）		661,014.31	1,046,491.81
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,411,870.80	885,933.26
基金投资收益	6.4.7.15	-8,568.46	-246,183.87
债券投资收益	6.4.7.16	104.47	-
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-1,215,277.18	-
股利收益	6.4.7.20	472,884.68	406,742.42
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）	6.4.7.21	3,357,019.10	-6,806,966.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		299,457.16	377,898.08
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	18,142.47	11,974.67
<b>减：二、营业总支出</b>		510,051.98	481,874.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	287,662.98	262,629.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	78,453.49	71,626.11
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	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		0.42	-
8. 其他费用	6.4.7.24	143,935.09	147,619.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,829,867.32	-5,850,391.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,829,867.32	-5,850,391.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,829,867.32	-5,850,391.50

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

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）	27,266,078.32	-	17,037,853.68	44,303,932.00
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）	27,266,078.32	-	17,037,853.68	44,303,932.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,938,545.29	-	6,933,308.01	11,871,853.30
（一）、综合收益总额	-	-	3,829,867.32	3,829,867.32
（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）	4,938,545.29	-	3,103,440.69	8,041,985.98
其中：1. 基金申购款	14,191,106.86	-	9,451,056.57	23,642,163.43
2. 基金赎回	-9,252,561.57	-	-6,347,615.88	-15,600,177.45

回款				
(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)	32,204,623.61	-	23,971,161.69	56,175,785.30
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)	29,767,700.76	-	21,008,418.73	50,776,119.49
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)	29,767,700.76	-	21,008,418.73	50,776,119.49
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,530,966.41	-	-4,352,100.88	-1,821,134.47
(一)、综合收益总额	-	-	-5,850,391.50	-5,850,391.50
(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)	2,530,966.41	-	1,498,290.62	4,029,257.03
其中: 1. 基金申购款	8,896,499.43	-	5,338,526.72	14,235,026.15
2. 基金赎回款	-6,365,533.02	-	-3,840,236.10	-10,205,769.12
(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)	32,298,667.17	-	16,656,317.85	48,954,985.02

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：

刘元瑞

覃波

孙红辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长信美国标准普尔 100 等权重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〔2010〕1586 号文《关于核准长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2011 年 3 月 30 日正式生效，首次设立募集规模为 508,424,713.40 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行（香港）有限公司。

根据基金管理人于 2021 年 6 月 29 日发布的《关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金增设美元类基金份额相关事项的公告》，自 2021 年 7 月 1 日起对本基金进行份额分类，原有基金份额归为人民币类基金份额，同时增设美元类基金份额。本基金根据申购、赎回所使用货币的不同，将基金份额分为不同的类别。注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，且以人民币计价并进行申购、赎回的份额类别，称为人民币份额；注册登记机构为长信基金管理有限责任公司，且以美元计价并进行申购、赎回的份额类别，称为美元份额。

本基金主要投资于标普 100 等权重指数成份股，同时也可主动投资于下列金融产品或工具：权益类品种（包括在美国证券市场挂牌交易的普通股、优先股、美国存托凭证、交易型开放式指数基金等）；固定收益类品种（包括美国政府债券、美国市场公开发行的公司债券及可转换债券等债券资产）；回购协议、美国或中国短期政府债券、现金等价物、货币市场基金等货币市场工具；经中国证监会认可的境外交易所（美国）挂牌交易的金融衍生品（包括期权期货）；以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金为股票指数增强型基金，对标普 100 等权重指数的成份股的投资比例为基金资产净值的 80%-95%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、现金等价物及到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券的比例为基金资产净值的 5%-20%；主动投资部分占基金资产净值的 0%-15%，投资于在美国证券市场公开发行或挂牌交易的权益类品种、固定收益类品种、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：标准普尔 100 等权重指数总收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，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基金净值变动情况。

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

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 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[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。

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。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	7,310,598.48
等于：本金	7,310,213.10
加：应计利息	385.38

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	7,310,598.48

注：截止至 2023 年 6 月 30 日，活期存款中人民币活期存款本金为人民币 4,145,153.16 元，应计利息为人民币 380.83 元；外币活期存款本金折合人民币 3,165,059.94 元，应计利息折合人民币 4.55 元。

#### 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	42,204,677.76	-	49,896,184.31	7,691,506.55
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	90.83	142,890.70	7,212.42
	银行间市场	-	-	-
	合计	90.83	142,890.70	7,212.42
资产支持证券	-	-	-	-
基金	977,019.47	-	834,794.51	-142,224.96
其他	-	-	-	-
合计	43,317,284.68	90.83	50,873,869.52	7,556,494.01

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 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	-35,495,670.00	-	-	-

工具				
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-35,495,670.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的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。

#### 6.4.7.3.2 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
UC2309	XUCU3 Curncy	-50.00	-36,170,500.00	-674,830.00
合计				-674,830.00
减：可抵销期货暂收款				-674,830.00
净额				0.00

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益投资工具。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 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	14,537.22
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	-
预提指数使用费	64,856.18
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	124,795.19
预提指数授权费	227,042.22
合计	456,026.00

## 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	27,266,078.32	27,266,078.32
本期申购	14,191,106.86	14,191,106.86
本期赎回 (以“-”号填列)	-9,252,561.57	-9,252,561.57
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	32,204,623.61	32,204,623.61

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

## 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	11,408,446.82	5,629,406.86	17,037,853.68
本期利润	472,848.22	3,357,019.10	3,829,867.32
本期基金份额交易产生的变动数	2,055,448.54	1,047,992.15	3,103,440.69
其中：基金申购款	5,980,822.61	3,470,233.96	9,451,056.57
基金赎回款	-3,925,374.07	-2,422,241.81	-6,347,615.88

本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,936,743.58	10,034,418.11	23,971,161.69

#### 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			4,286.10
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			-
其他			0.16
合计			4,286.26

注：其他为申购款利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 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			6,309,315.60
减：卖出股票成本总额			4,892,078.41
减：交易费用			5,366.39
买卖股票差价收入			1,411,870.80

#### 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
卖出/赎回基金成交总额			3,179,126.09
减：卖出/赎回基金成本总额			3,187,278.84
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额			-
减：交易费用			415.71
基金投资收益			-8,568.46

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 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			104.47
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	104.47

#### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

#### 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.19 衍生工具收益

##### 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 6.4.7.19.2 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
外汇期货投资收益	-1,215,277.18

#### 6.4.7.20 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	472,884.68
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	472,884.68

#### 6.4.7.21 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	4,031,849.10
股票投资	3,923,468.56
债券投资	7,212.42
资产支持证券投资	-
基金投资	101,168.12
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-674,830.00
权证投资	-
外汇期货合约	-674,830.00
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	3,357,019.10

#### 6.4.7.22 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	18,142.47
合计	18,142.47

注：本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。本基金对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对其他投资者收取的赎回费用的25%应当归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

#### 6.4.7.23 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.24 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	24,795.19
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
指数使用费	20,605.15
指数授权费	65,237.00
银行汇划费	8,502.56
合计	143,935.09

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司(“长信基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国银行(香港)有限公司(“中银香港”)	基金境外托管人

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。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

###### 6.4.10.1.5 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

##### 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	287,662.98	262,629.07
其中：支付销售机构的客户维护费	127,745.44	105,503.03

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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	78,453.49	71,626.11

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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

份额单位：份

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

基金合同生效日 (2011 年 3 月 30 日) 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	7,501,888.88
报告期内申购/买入总份额	-	0.00
报告期内因拆分变动份额	-	0.00
减: 报告期内赎回/卖出总份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额	-	7,501,888.88
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	23.23%

注: 基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

#### 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 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
中国银行	4,390,581.53	4,286.10	5,243,525.72	2,085.41
中银香港	2,920,016.95	-	2,268,729.58	-

注: 本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司, 按银行同业利率计息。于 2023 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示 (2022 年 6 月 30 日: 同)。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险, 主要包括: 信用风险、流动性风险和市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡, 以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标, 本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险, 设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念, 建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会, 负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等; 在管理层层面设立内部控制委员会, 主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施; 在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作, 战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责, 并向总经理汇报日常行政事务。

##### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行股份有限公司以及基金境外次托管人中国银行（香港）有限公司，与该等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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	142,890.70	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	142,890.70	-

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券以及标准普尔、惠誉和穆迪评级均为未评级的海外债券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现

投资的风险。

#### 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系, 审慎评估各类资产的流动性, 针对性制定流动性风险管理措施, 对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动, 所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易, 并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具, 基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析, 定期开展压力测试, 评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况, 当市场环境或投资者结构发生变化时, 及时调整投资组合资产结构及比例, 保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时, 针对兑付赎回资金的流动性风险, 基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款, 制定了发生巨额赎回时资金的处理模式, 控制因开放模式而产生的流动性风险。

#### 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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款等。

##### 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	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	7,310,598.48	-	-	-	-	7,310,598.48
结算备付金	988,871.12	-	-	-	-	988,871.12
存出保证金	1,320,000.00	-	-	-	-	1,320,000.00
交易性金融资产	142,890.70	-	-	-	50,730,978.82	50,873,869.52
应收股利	-	-	-	-	64,239.12	64,239.12
应收申购款	-	-	-	-	229,312.99	229,312.99
资产总计	9,762,360.30	-	-	-	51,024,530.93	60,786,891.23
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	4,088,994.37	4,088,994.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	51,923.58	51,923.58

应付托管费	-	-	-	-	14,160.97	14,160.97
应交税费	-	-	-	-	1.01	1.01
其他负债	-	-	-	-	456,026.00	456,026.00
负债总计	-	-	-	-	4,611,105.93	4,611,105.93
利率敏感度缺口	9,762,360.30	-	-	-	46,413,425.00	56,175,785.30
上年度末 2022 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	1,858,840.20	-	-	-	2,342,044.96	4,200,885.16
交易性金融资产	-	-	-	-	40,666,299.51	40,666,299.51
应收股利	-	-	-	-	47,264.35	47,264.35
应收申购款	-	-	-	-	322,094.15	322,094.15
资产总计	1,858,840.20	-	-	-	43,377,702.97	45,236,543.17
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	453,035.05	453,035.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	41,590.49	41,590.49
应付托管费	-	-	-	-	11,342.90	11,342.90
其他负债	-	-	-	-	426,642.73	426,642.73
负债总计	-	-	-	-	932,611.17	932,611.17
利率敏感度缺口	1,858,840.20	-	-	-	42,445,091.80	44,303,932.00

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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）
	市场利率上升 27 个基点	-94.85	-
	市场利率下降 27 个基点	94.85	-

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

## 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	3,165,064.49	-	-	3,165,064.49
结算备付金	1,561,871.12	-	-	1,561,871.12
交易性金融资产	50,873,869.52	-	-	50,873,869.52
应收股利	64,239.12	-	-	64,239.12
应收申购款	14,450.15	-	-	14,450.15
资产合计	55,679,494.40	-	-	55,679,494.40
以外币计价的负债				
应付赎回款	134,012.00	-	-	134,012.00
其他负债	292,221.25	-	-	292,221.25
负债合计	426,233.25	-	-	426,233.25
资产负债表外汇 风险敞口净额	55,253,261.15	-	-	55,253,261.15
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	3,003,904.55	-	-	3,003,904.55
交易性金融资产	40,666,299.51	-	-	40,666,299.51
应收股利	47,264.35	-	-	47,264.35
应收申购款	9,053.07	-	-	9,053.07
资产合计	43,726,521.48	-	-	43,726,521.48
以外币计价的负债				
应付赎回款	56,720.75	-	-	56,720.75
其他负债	195,222.47	-	-	195,222.47

负债合计	251,943.22	-	-	251,943.22
资产负债表外汇 风险敞口净额	43,474,578.26	-	-	43,474,578.26

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除美元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)
	美元相对人民币贬值 5%	-2,762,663.06	-2,173,728.91
	美元相对人民币升值 5%	2,762,663.06	2,173,728.91

#### 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的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券,所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险,并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR(Value at Risk)等指标来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 6 月 30 日,本基金面临的其他市场价格风险列示如下:

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 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	49,896,184.31	88.82	36,745,394.28	82.94
交易性金融资产—基金投资	834,794.51	1.49	3,920,905.23	8.85
交易性金融资产—债券投资	142,890.70	0.25	-	-
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	50,873,869.52	90.56	40,666,299.51	91.79
----	---------------	-------	---------------	-------

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95% 的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
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）
	VaR 值为 2.79% (2022 年 12 月 31 日 VaR 值为 2.92%)	-1,565,156.16	-1,295,640.21

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95% 的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2022 年的分析同样基于该假设。

#### 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	50,730,978.82	40,666,299.51
第二层次	142,890.70	-
第三层次	-	-
合计	50,873,869.52	40,666,299.51

###### 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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.15.2 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	49,896,184.31	82.08
	其中：普通股	48,985,765.29	80.59
	存托凭证	910,419.02	1.50
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	834,794.51	1.37
3	固定收益投资	142,890.70	0.24
	其中：债券	142,890.70	0.24
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	8,299,469.60	13.65
8	其他各项资产	1,613,552.11	2.65
9	合计	60,786,891.23	100.00

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	49,896,184.31	88.82
合计	49,896,184.31	88.82

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
工业	5,651,163.28	10.06
原材料	955,301.77	1.70
非日常生活消费品	4,838,732.13	8.61
日常消费品	5,531,819.36	9.85
能源	1,366,047.53	2.43
金融	8,340,712.54	14.85
医疗保健	6,465,171.47	11.51
信息技术	6,633,660.72	11.81
通信服务	4,273,595.43	7.61
公用事业	1,821,240.20	3.24
房地产	950,960.66	1.69
合计	46,828,405.09	83.36

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
工业	18,122.31	0.03
原材料	-	-
非日常生活消费品	948,537.63	1.69
日常消费品	153,475.99	0.27
能源	-	-
金融	134,962.05	0.24
医疗保健	-	-
信息技术	1,133,130.87	2.02
通信服务	679,550.37	1.21
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	3,067,779.22	5.46

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

## 7.4.1 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	Charter 通信公司	CHTR US	NASDAQ	美国	193	512,326.63	0.91
2	FEDEX CORP	联邦快递	FDX US	NYSE	美国	283	506,931.06	0.90
3	FORD MOTOR CO	福特汽车	F US	NYSE	美国	4,603	503,229.21	0.90
4	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	NASDAQ	美国	164	501,291.90	0.89
5	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL US	NYSE	美国	576	495,659.82	0.88
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	Meta 平台股份有限公司	META US	NASDAQ	美国	239	495,604.76	0.88
7	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGO US	NASDAQ	美国	79	495,162.18	0.88
8	ADOBE INC	奥多比	ADBE US	NASDAQ	美国	140	494,668.15	0.88
9	LOWE'S COS INC	劳氏	LOW US	NYSE	美国	303	494,151.51	0.88
10	EMERSON ELECT CO	艾默生电气	EMR US	NYSE	美国	752	491,161.33	0.87
11	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	NASDAQ	美国	350	490,555.95	0.87
12	ABBOTT LABS	雅培制药	ABT US	NYSE	美国	622	489,984.68	0.87
13	TESLA INC	特斯拉汽车公司	TSLA US	NASDAQ	美国	259	489,897.90	0.87
14	MASTERCARD INC-A	万事达股份有限公司	MA US	NYSE	美国	172	488,808.03	0.87
15	BOOKING HOLDINGS	Booking 控股股份有限公司	BKNG US	NASDAQ	美国	25	487,801.11	0.87

16	INTEL CORP	英特尔	INTC US	NASDAQ	美国	2,018	487,610.86	0.87
17	GENERAL MOTORS C	通用汽车 公司	GM US	NYSE	美国	1,746	486,482.48	0.87
18	VISA INC-CLA SS A	维萨公司	V US	NYSE	美国	283	485,623.18	0.86
19	LINDE PLC	Linde Public 股份有限 公司	LIN US	NYSE	美国	176	484,634.98	0.86
20	T-MOBIL E US INC	T-Mobile 股份有限 公司	TMUS US	NASDAQ	美国	482	483,765.86	0.86
21	AMAZON. COM INC	亚马逊公 司	AMZN US	NASDAQ	美国	513	483,223.06	0.86
22	TEXAS INSTRUM ENT	德州仪器	TXN US	NASDAQ	美国	371	482,592.54	0.86
23	PHILIP MORRIS IN	菲利普莫 里斯国际 集团公司	PM US	NYSE	美国	683	481,776.31	0.86
24	MEDTRON IC PLC	美敦力	MDT US	NYSE	美国	756	481,264.29	0.86
25	ELI LI LLY & CO	礼来	LLY US	NYSE	美国	142	481,203.31	0.86
26	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	NASDAQ	美国	151	480,616.79	0.86
27	UNITED PARCEL- B	联合包裹 服务股份 有限公司	UPS US	NYSE	美国	371	480,528.35	0.86
28	PAYPAL HOLDING S	Paypal 控股股份 有限公司	PYPL US	NASDAQ	美国	996	480,248.92	0.85
29	CATERPI LLAR INC	卡特彼勒	CAT US	NYSE	美国	270	480,035.18	0.85
30	HONEYWE LL INTL	霍尼韦尔	HON US	NYSE	美国	320	479,793.12	0.85
31	METLIFE INC	大都会集 团	MET US	NYSE	美国	1,174	479,549.03	0.85
32	VERIZON COMMUNI C	Verizon 通信股份 有限公司	VZ US	NYSE	美国	1,783	479,141.14	0.85

33	COSTCO WHOLESA LE	好市多批 发	COST US	NASDAQ	美国	123	478,497.82	0.85
34	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	NYSE	美国	213	478,104.60	0.85
35	MICROSO FT CORP	微软	MSFT US	NASDAQ	美国	194	477,370.74	0.85
36	SIMON PROPERT Y	西蒙房地 产集团公 司	SPG US	NYSE	美国	572	477,297.04	0.85
37	MERCK & CO	默克	MRK US	NYSE	美国	572	476,925.06	0.85
38	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	NYSE	美国	598	476,911.90	0.85
39	MCDONAL DS CORP	麦当劳	MCD US	NYSE	美国	221	476,531.47	0.85
40	CISCO SYSTEMS	思科	CSCO US	NASDAQ	美国	1,274	476,301.32	0.85
41	TARGET CORP	塔吉特公 司	TGT US	NYSE	美国	498	474,635.34	0.84
42	AMERICA N TOWE R CO RP	美国发射 塔公司	AMT US	NYSE	美国	338	473,663.62	0.84
43	PROCTER & GA MBLE	宝洁	PG US	NYSE	美国	432	473,663.33	0.84
44	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	NYSE	美国	396	473,621.71	0.84
45	GENERAL ELECTRI C	通用电气	GE US	NYSE	美国	595	472,283.71	0.84
46	COMCAST CORP-A	康卡斯特	CMCSA US	NASDAQ	美国	1,572	471,964.69	0.84
47	JPMORGA N CHASE	摩根大通	JPM US	NYSE	美国	449	471,863.24	0.84
48	SCHWAB (CHARLE S) C ORP	嘉信理财 公司	SCHW US	NYSE	美国	1,150	470,992.10	0.84
49	DOW INC	Dow Inc	DOW US	NYSE	美国	1,223	470,666.79	0.84
50	WALMART	沃尔玛股	WMT US	NYSE	美国	414	470,201.02	0.84

	INC	份有限公司						
51	UNION PAC CORP	联合太平洋	UNP US	NYSE	美国	317	468,698.19	0.83
52	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR US	NYSE	美国	269	466,497.65	0.83
53	BERKSHIRE HATHAWAY INC	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B US	NYSE	美国	189	465,695.58	0.83
54	AMGEN INC	AMGEN-T	AMGN US	NASDAQ	美国	290	465,238.91	0.83
55	EXELON CORP	Exelon 公司	EXC US	NASDAQ	美国	1,578	464,530.21	0.83
56	AMERICAN EXPRESS	美国运通	AXP US	NYSE	美国	369	464,472.98	0.83
57	BLACKROCK INC	贝莱德有限公司	BLK US	NYSE	美国	93	464,445.67	0.83
58	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	NASDAQ	美国	347	464,411.85	0.83
59	COLGATE- PALMOLIVE	高露洁棕榄	CL US	NYSE	美国	834	464,267.48	0.83
60	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO US	NYSE	美国	123	463,717.52	0.83
61	GENERAL DYNAMICS	通用动力	GD US	NYSE	美国	298	463,280.00	0.82
62	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	NYSE	美国	1,501	462,904.11	0.82
63	STARBUCKS CORP	星巴克	SBUX US	NASDAQ	美国	646	462,398.89	0.82
64	AMERICAN INTERNATIONAL	美国国际集团	AIG US	NYSE	美国	1,112	462,339.06	0.82
65	US BANCORP	美国合众银行	USB US	NYSE	美国	1,925	459,575.33	0.82
66	BANK OF AMERICA CORP	纽约梅隆银行股份有限公司	BK US	NYSE	美国	1,424	458,090.29	0.82

67	ALTRIA GROUP INC	高特利	MO US	NYSE	美国	1,399	457,932.91	0.82
68	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能源公司	NEE US	NYSE	美国	854	457,875.82	0.82
69	3M CO	3M 公司	MMM US	NYSE	美国	633	457,804.79	0.81
70	ACCENTURE PLC-A	埃森哲公司	ACN US	NYSE	美国	205	457,096.16	0.81
71	AT&T INC	美国电话电报公司	T US	NYSE	美国	3,965	456,972.24	0.81
72	MONDELEZ INTER-A	亿滋国际	MDLZ US	NASDAQ	美国	867	456,952.22	0.81
73	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	NASDAQ	美国	531	456,744.55	0.81
74	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	XOM US	NYSE	美国	589	456,455.59	0.81
75	CONOCOP HILLIPS	康菲石油	COP US	NYSE	美国	609	455,937.07	0.81
76	LOCKHEED MARTIN	洛克希德马丁	LMT US	NYSE	美国	137	455,746.09	0.81
77	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO US	NYSE	美国	1,046	455,154.01	0.81
78	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX US	NYSE	美国	399	453,654.87	0.81
79	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS US	NYSE	美国	734	452,939.16	0.81
80	IBM	国际商业机器	IBM US	NYSE	美国	468	452,501.85	0.81
81	GILEAD SCIENCE S	吉利德科学	GILD US	NASDAQ	美国	810	451,082.85	0.80
82	BRISTOL -MYERS SQB	百时美施贵宝	BMY US	NYSE	美国	976	450,999.75	0.80
83	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	雷神技术公司	RTX US	NYSE	美国	637	450,893.68	0.80

84	SOUTHERN CO	南方	SO US	NYSE	美国	888	450,759.86	0.80
85	CAPITAL ONE FINANCIAL	第一资本金融	COF US	NYSE	美国	568	448,882.30	0.80
86	SALESFORCE INC	Salesforce.com 股份有限公司	CRM US	NYSE	美国	294	448,797.62	0.80
87	DUKE ENERGY CORP	杜克能源	DUK US	NYSE	美国	691	448,074.31	0.80
88	UNITEDHEALTH GROUP	联合健康	UNH US	NYSE	美国	129	448,018.10	0.80
89	BANK OF AMERICA	美国银行	BAC US	NYSE	美国	2,161	447,993.02	0.80
90	ABBVIE INC	艾伯维生物制药公司	ABBV US	NYSE	美国	458	445,877.67	0.79
91	BOEING CO/THE	波音	BA US	NYSE	美国	291	444,007.78	0.79
92	WALT DISNEY CO	华特迪士尼	DIS US	NYSE	美国	688	443,842.16	0.79
93	CVS HEALTH CORP	CVS 保健公司	CVS US	NYSE	美国	882	440,576.25	0.78
94	GOLDMAN SACHS GROUP	高盛	GS US	NYSE	美国	189	440,485.20	0.78
95	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏公司	KHC US	NASDAQ	美国	1,715	439,924.77	0.78
96	CITIGROUP INC	花旗集团	C US	NYSE	美国	1,310	435,805.34	0.78
97	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	NYSE	美国	1,623	430,163.72	0.77
98	ADVANCED MICRODEVICES	AMD 公司	AMD US	NASDAQ	美国	507	417,307.08	0.74
99	WALGREENS BOOTS ALLIANCE	Walgreens Boots Alliance	WBA US	NASDAQ	美国	2,013	414,402.30	0.74

		ance 公司						
100	ALPHABET INC	Alphabet 公司	GOOGL US	NASDAQ	美国	278	240,450.06	0.43
101	ALPHABET INC-C	Alphabet 公司	GOOG US	NASDAQ	美国	239	208,911.10	0.37

## 7.4.2 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权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	ALPHABET INC	Alphabet 公司	GOOGL US	NASDAQ	美国	426	368,459.44	0.66
2	LULULEMON ATHLETICA INC	Lululemon Athletica 股份有限公司	LULU US	NASDAQ	美国	100	273,496.53	0.49
3	BAIDU INC - SPON ADR	百度	BIDU US	NASDAQ	美国	200	197,856.86	0.35
4	TESLA INC	特斯拉汽车公司	TSLA US	NASDAQ	美国	103	194,824.26	0.35
5	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD 公司	AMD US	NASDAQ	美国	232	190,957.08	0.34
6	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	NASDAQ	美国	136	190,616.03	0.34
7	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	NASDAQ	美国	77	189,471.89	0.34
8	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGO US	NASDAQ	美国	30	188,036.27	0.33
9	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL US	NYSE	美国	218	187,593.47	0.33
10	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	NASDAQ	美国	199	187,449.10	0.33
11	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	NASDAQ	美国	61	186,456.13	0.33
12	ALIBABA GROUP HOLDING-SP	阿里巴巴	BABA US	NYSE	美国	300	180,681.13	0.32

	ADR							
13	DADA NEXUS LTD-ADR	达达集团	DADA US	NASDAQ	美国	4,000	153,475.99	0.27
14	FUTURO HOLDINGS LTD-ADR	富途控股有限公司	FUTU US	NASDAQ	美国	470	134,962.05	0.24
15	SEALTD-ADR	Sea 有限公司	SE US	NYSE	美国	270	113,234.07	0.20
16	HTHT WORLD GROUP LTD-ADR	华住酒店集团	HTHT US	NASDAQ	美国	400	112,086.61	0.20
17	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	中通快递 (开曼) 有限公司	ZTO US	NYSE	美国	100	18,122.31	0.03

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	ALPHABET INC	GOOGL US	413,857.23	0.93
2	TESLA INC	TSLA US	285,268.32	0.64
3	NVIDIA CORP	NVDA US	277,291.25	0.63
4	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	265,167.92	0.60
5	AMAZON.COM INC	AMZN US	261,064.14	0.59
6	ORACLE CORP	ORCL US	260,727.03	0.59
7	MICROSOFT CORP	MSFT US	259,388.86	0.59
8	APPLE INC	AAPL US	258,535.72	0.58
9	DADA NEXUS LTD-ADR	DADA US	255,036.94	0.58
10	BROADCOM INC	AVGO US	253,009.89	0.57
11	SCHWAB (CHARLES) CORP	SCHW US	236,170.86	0.53
12	CVS HEALTH CORP	CVS US	217,267.00	0.49
13	US BANCORP	USB US	215,090.32	0.49
14	METLIFE INC	MET US	214,093.90	0.48
15	TARGET CORP	TGT US	198,099.88	0.45
16	PFIZER INC	PFE US	197,742.25	0.45

17	WALGREENS BOOTS	WBA US	196,024.98	0.44
18	AMGEN INC	AMGN US	189,956.02	0.43
19	GENERAL ELECTRIC	GE US	189,219.08	0.43
20	3M CO	MMM US	185,468.85	0.42

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

### 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	NVIDIA CORP	NVDA US	503,753.48	1.14
2	MRTA PLATFORM INC-CLASS A	META US	471,265.00	1.06
3	ADVANCED MICRO DEVICES	AMD US	304,505.30	0.69
4	GENERAL ELECTRIC	GE US	248,419.95	0.56
5	SALESFORCE INC	CRM US	240,846.86	0.54
6	NETFLIX INC	NFLX US	192,094.82	0.43
7	TESLA INC	TSLA US	191,268.50	0.43
8	BROADCOM INC	AVGO US	188,699.16	0.43
9	ELI LILLY & CO	LLY US	181,951.04	0.41
10	ADOBE INC	ADBE US	170,441.58	0.38
11	ORACLE CORP	ORCL US	165,706.58	0.37
12	AMAZON.COM INC	AMZN US	162,885.90	0.37
13	MICROSOFT CORP	MSFT US	141,638.91	0.32
14	FEDEX CORP	FDX US	120,426.36	0.27
15	APPLE INC	AAPL US	110,704.02	0.25
16	ACCENTURE PLC-A	ACN US	94,368.24	0.21
17	GE HEALTHCARE TECHNOLOGIES INC	GEHC US	91,740.35	0.21
18	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	BILI US	89,437.86	0.20
19	ALPHABET INC	GOOGL US	78,012.49	0.18
20	BOEING CO/THE	BA US	76,222.91	0.17

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	14,119,399.88
卖出收入（成交）总额	6,309,315.60

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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。

## 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
AAA+至 AAA-	142,890.70	0.25

注：本债券投资组合境外债券主要采用标准普尔、惠誉、穆迪等机构提供的债券信用评级信息，境内债券主要采用联合信用评级有限公司等机构提供的债券信息评级信息。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	US91282CDA62	T 0 1/4 09/30/23	200	142,890.70	0.25

注：境外债券代码为 ISIN 码。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	外汇期货	XUCU3 Curncy	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《基金股指期货投资会计业务核算细则（试行）》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。期货投资的合约市值为-36,170,500.00 元。期货投资的公允价值变动金额为-674,830.00 元，已包含在结算备付金中。

## 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	KRANESHARE S CSI CHINA INTERN	ETF 基金	交易型开放式(ETF)	Krane Funds Advisors LLC	834,794.51	1.49

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.11.2 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

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,320,000.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	64,239.12
4	应收利息	-
5	应收申购款	229,312.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,613,552.11

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.11.5.1 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。

#### 7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

### 7.11.6 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 (%)
7,780	4,139.41	0.00	0.00	32,204,623.61	100.00

### 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	66.05	0.00

### 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、基金投资和研究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 (2011 年 3 月 30 日) 基金份额总额	508,424,713.40
本报告期期初基金份额总额	27,266,078.32
本报告期基金总申购份额	14,191,106.86
减：本报告期基金总赎回份额	9,252,561.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	32,204,623.61

注：上述份额变动包含人民币份额及美元份额的情况。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

## 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

本报告期内未发生基金管理人及高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

## 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 (%)	
Morgan Stanley & Co Int'l Plc	1	18,229,706.66	89.24	-	-	-
GS	1	2,199,008.82	10.76	-	-	-
CITI	1	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字【1998】29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

(1) 选择标准：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 券商协作表现评价。

(2) 选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低

进行选择基金专用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
Morgan Stanley & Co Int'l Plc	-	-	-	-	-	-	-	-
GS	-	-	-	-	-	-	3,179,126.09	100.00
CITI	135,587.45	100.00	-	-	-	-	-	-

### 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	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 1 月 12 日
2	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 1 月 20 日
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 1 月 20 日
4	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 2 月 16 日
5	长信基金管理有限责任公司关于增加东方财富证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 3 月 13 日
6	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 3 月 31 日
7	长信基金管理有限责任公司旗下全部基	上证报、中证报、证券	2023 年 3 月 31 日

	金 2022 年年度报告提示性公告	时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	
8	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 4 月 4 日
9	长信基金管理有限责任公司关于增加博时财富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购 (含定投申购)、转换费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 4 月 20 日
10	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 4 月 21 日
11	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 4 月 21 日
12	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 5 月 25 日
13	长信基金管理有限责任公司关于增加五矿证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购 (含定投申购)、转换费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 5 月 25 日
14	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 6 月 15 日
15	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 6 月 30 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

本基金本报告期内未有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

本基金本报告期未发生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、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2023 年 8 月 31 日