

景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基
金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23

§ 8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	71
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	71
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	71
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
8.12 投资组合报告附注	72
§ 9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	73
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	73
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	78
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	81
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§ 13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城沪深 300 指数增强	
场内简称	无	
基金主代码	000311	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 10 月 29 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,140,092,526.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	000311	015679
报告期末下属分级基金的 份额总额	2,125,130,372.31 份	14,962,153.72 份

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年	2022 年	2022 年 5 月 5 日 (C 类份额首个估值日)-2022 年 12	2021 年

			月 31 日			
	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	-322,579,845.01	-1,916,243.59	-968,049,826.15	-700,798.14	602,054,119.07	-
本期利润	-438,199,078.82	-2,225,082.24	-1,112,482,152.84	-359,622.22	3,839,421.41	-
加权平均基金份额本期利润	-0.2081	-0.2138	-0.5524	-0.1374	0.0021	-
本期加权平均净值利润率	-9.83%	-10.20%	-23.83%	-6.25%	0.07%	-
本期基金份额净值增长率	-9.94%	-10.09%	-20.96%	-4.27%	-2.61%	-
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	1,972,023,757.71	13,789,405.48	2,355,013,173.70	6,236,937.27	3,006,909,395.09	-
期末可供分配基金份额利润	0.9280	0.9216	1.0827	1.0801	1.5597	-
期末基金资产净值	4,121,148,733.68	28,922,878.04	4,682,413,728.77	12,415,193.94	45,252,175,293.04	-
期末基金份额净值	1.939	1.933	2.153	2.150	2.724	-
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	128.02%	-13.94%	153.18%	-4.27%	220.33%	-

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城沪深 300 指数增强 A

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	-------	------	-------	-----	-----

	增长率①	长率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-5.74%	0.69%	-6.31%	0.75%	0.57%	-0.06%
过去六个月	-8.58%	0.74%	-9.50%	0.81%	0.92%	-0.07%
过去一年	-9.94%	0.75%	-9.47%	0.81%	-0.47%	-0.06%
过去三年	-30.68%	1.03%	-29.54%	1.06%	-1.14%	-0.03%
过去五年	19.84%	1.15%	22.50%	1.15%	-2.66%	0.00%
自基金合同生效起至今	128.02%	1.36%	67.54%	1.31%	60.48%	0.05%

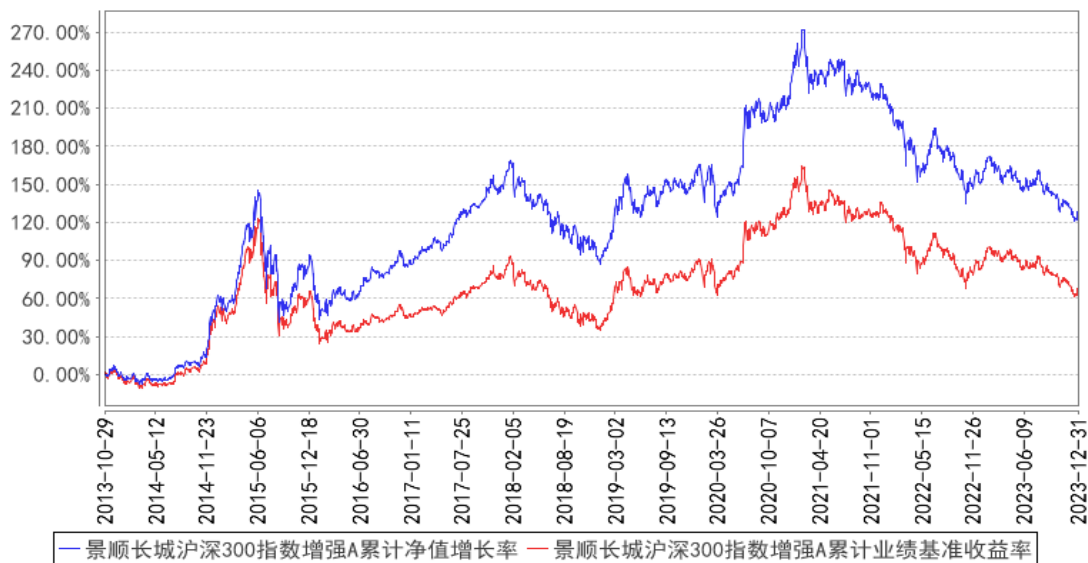
景顺长城沪深 300 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.75%	0.69%	-6.31%	0.75%	0.56%	-0.06%
过去六个月	-8.69%	0.74%	-9.50%	0.81%	0.81%	-0.07%
过去一年	-10.09%	0.75%	-9.47%	0.81%	-0.62%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-13.94%	0.88%	-11.66%	0.92%	-2.28%	-0.04%

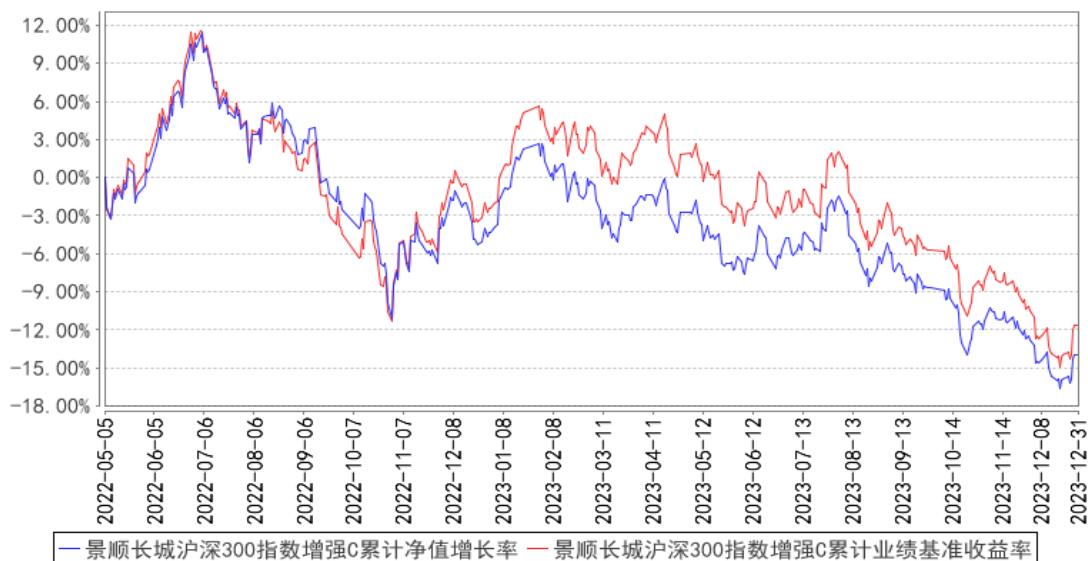
注：本基金于 2022 年 4 月 29 日增设 C 类基金份额，并于 2022 年 5 月 5 日开始对 C 类份额进行估值。

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

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



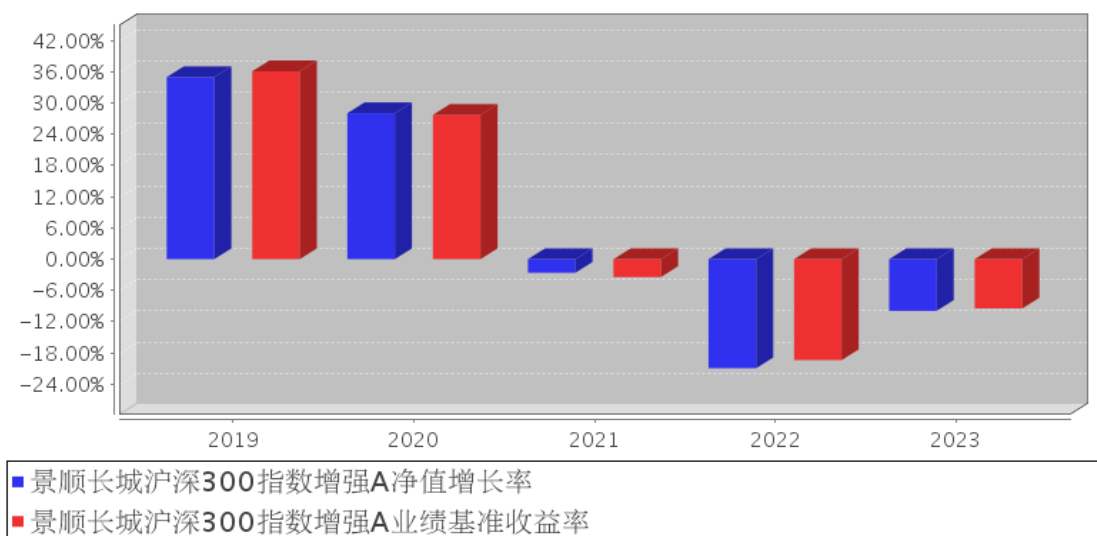
景顺长城沪深300指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



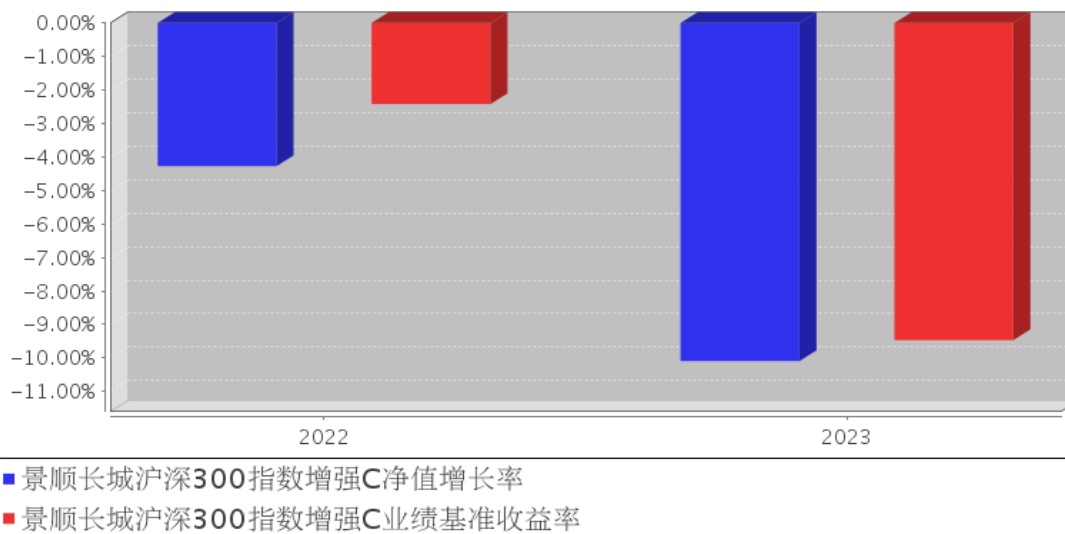
注：本基金的资产配置比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2013 年 10 月 29 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2022 年 4 月 29 日起增设 C 类基金份额。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城沪深300指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



景顺长城沪深300指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：景顺长城沪深 300 指数增强 C 基金 2022 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2022 年 5 月 5 日（C 类份额首个估值日）至 2022 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2023年12月31日，本公司旗下共管理179只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黎海威	本基金的基金经理	2013 年 10 月 29 日	-	20 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 20 年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任

私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

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

2、交易执行的内部控制

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

3、交易指令分配的控制

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

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

4、公平交易监控

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 31 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年是三年新冠疫情防控转折后经济恢复发展的一年，但受制于地产持续调整、外需走弱、社会预期偏弱等不利因素，修复过程较为波折。2023 年全年 GDP 增长 5.2%，高于年初制定的 5% 左右的增长目标。12 月 PMI 指数为 49，经济景气程度依旧偏弱。12 月 PPI 同比下跌 2.7%，环比下跌 0.3%；12 月 CPI 同比下跌 0.30%，环比上涨 0.10%，价格信号依旧偏弱。12 月 M2 同比增速为 9.7%，M1 同比增速为 1.3%，全年社会融资规模同比增长 9.84%。12 月末外汇储备 3.2 万亿美元，汇率整体平稳。2023 年全年 A 股市场表现疲软，风格方面小盘优于大盘、价值优于成长，沪深 300、中证 500 和创业板指分别下跌 11.38%、7.42% 和 19.41%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年度，景顺长城沪深 300 指数增强 A 类份额净值增长率为-9.94%，业绩比较基准收益率为-9.47%。

2023 年度，景顺长城沪深 300 指数增强 C 类份额净值增长率为-10.09%，业绩比较基准收益率为-9.47%。

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 2024 年，海外方面，美国经济预计保持相当韧性，在通胀得到控制之后，联储有望开启宽松周期，这将有利于新兴市场的资产表现；国内方面，有效需求不足以及地产行业的调整等因

素将会导致经济回升面临一定的困难，但中央财政的持续发力以及“三大工程”有望对经济形成一定支撑，而中美库存周期的震荡回升有望对全年经济形成拉动。市场风格方面，过去 2 年成长与价值、大盘与小盘的分化有望得到改善，市场风格将更加均衡。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

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

5、执行以 KPI(Key Performance Indicator 主要绩效指标)为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的

报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经本基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在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—景顺长城基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70015711_H11 号
--------	------------------------------

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则</p>

	<p>执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	昌华 黄拥璇
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	7.4.7.1	100,991,076.87	155,710,770.28
结算备付金		67,182,230.59	14,483,802.02
存出保证金		8,608,349.27	719,418.30
交易性金融资产	7.4.7.2	3,984,937,877.36	4,538,588,105.79
其中：股票投资		3,853,578,368.49	4,407,657,804.42
基金投资		-	-
债券投资		131,359,508.87	130,930,301.37
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		168,623.95	214,565.97
应收股利		-	-
应收申购款		3,740,610.03	3,857,385.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		4,165,628,768.07	4,713,574,048.28
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,214,728.53	2,369,223.36
应付管理人报酬		3,460,992.18	3,992,373.38
应付托管费		692,198.45	798,474.68
应付销售服务费		4,714.36	2,013.66
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	7,184,522.83	11,583,040.49
负债合计		15,557,156.35	18,745,125.57
净资产：			

实收基金	7.4.7.10	2,140,092,526.03	2,180,988,407.47
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	2,009,979,085.69	2,513,840,515.24
净资产合计		4,150,071,611.72	4,694,828,922.71
负债和净资产总计		4,165,628,768.07	4,713,574,048.28

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,140,092,526.03 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.939 元，基金份额 2,125,130,372.31 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.933 元，基金份额 14,962,153.72 份。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-385,528,371.16	-1,055,690,268.71
1. 利息收入		1,731,462.48	1,453,123.64
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,731,462.48	1,453,123.64
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-272,032,808.76	-915,060,993.17
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-380,469,066.86	-1,010,842,564.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	2,450,743.75	8,410,393.37
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-6,176,097.54	-
股利收益	7.4.7.19	112,161,611.89	87,371,177.96
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-115,928,072.46	-144,091,150.77
4. 汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.21	701,047.58	2,008,751.59
减: 二、营业总支出		54,895,789.90	57,151,506.35
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	44,891,597.66	46,765,302.62
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	8,978,319.64	9,353,060.48
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	43,649.10	7,538.97
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.58	5.70
8. 其他费用	7.4.7.23	982,222.92	1,025,598.58
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-440,424,161.06	-1,112,841,775.06
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-440,424,161.06	-1,112,841,775.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-440,424,161.06	-1,112,841,775.06

7.3 净资产变动表

会计主体: 景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期: 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,180,988,407.47	-	2,513,840,515.24	4,694,828,922.71
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,180,988,407.47	-	2,513,840,515.24	4,694,828,922.71
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-40,895,881.44	-	-503,861,429.55	-544,757,310.99

(一)、综合收益总额	-	-	-440,424,161.06	-440,424,161.06
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-40,895,881.44	-	-63,437,268.49	-104,333,149.93
其中: 1. 基金申购款	494,363,586.17	-	551,325,549.77	1,045,689,135.94
2. 基金赎回款	-535,259,467.61	-	-614,762,818.26	-1,150,022,285.87
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,140,092,526.03	-	2,009,979,085.69	4,150,071,611.72
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,927,875,014.16	-	3,324,300,278.88	5,252,175,293.04
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,927,875,014.16	-	3,324,300,278.88	5,252,175,293.04
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	253,113,393.31	-	-810,459,763.64	-557,346,370.33
(一)、综合收益总额	-	-	-1,112,841,775.06	-1,112,841,775.06
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	253,113,393.31	-	302,382,011.42	555,495,404.73
其中: 1. 基金申购款	1,155,810,548.32	-	1,513,626,386.97	2,669,436,935.29
2. 基金赎回款	-902,697,155.01	-	-1,211,244,375.5	-2,113,941,530.56

			5	
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,180,988,407.47	-	2,513,840,515.24	4,694,828,922.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

净值。

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

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

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

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

个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

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

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

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

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要

意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

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

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份

额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税及附加

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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

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

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

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

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	100,991,076.87	155,710,770.28
等于：本金	100,964,569.38	155,676,170.75
加：应计利息	26,507.49	34,599.53
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	100,991,076.87	155,710,770.28

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		4,028,382,200.79	-	3,853,578,368.49	-174,803,832.30
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,000.00	0.67	9,000.67	0.00
	银行间市场	129,937,220.00	1,454,508.20	131,350,508.20	-41,220.00
	合计	129,946,220.00	1,454,508.87	131,359,508.87	-41,220.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,158,328,420.79	1,454,508.87	3,984,937,877.36	-174,845,052.30
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		4,465,698,900.26	-	4,407,657,804.42	-58,041,095.84
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	130,180,180.00	1,138,301.37	130,930,301.37	-388,180.00
	合计	130,180,180.00	1,138,301.37	130,930,301.37	-388,180.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,595,879,080.26	1,138,301.37	4,538,588,105.79	-58,429,275.84

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	67,677,936.00	-	-	

其中：股指期货投资	67,677,936.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	67,677,936.00	-	-	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2401	沪深 300 指数期货 2401	54.00	55,724,760.00	246,084.00
IF2403	沪深 300 指数期货 2403	12.00	12,440,880.00	241,620.00
合计				487,704.00
减：可抵销期货暂收款				487,704.00
净额				-

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

（2）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末的债权投资余额为零。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末的债权投资余额为零。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末的其他债权投资余额为零。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末的其他债权投资余额为零。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末的其他资产余额为零。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6,595.08	3,938.00
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	6,774,060.42	11,147,260.13
其中：交易所市场	6,774,060.42	11,147,260.13
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	234,500.00	244,500.00
应付指数使用费	169,367.33	187,342.36
合计	7,184,522.83	11,583,040.49

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城沪深 300 指数增强 A

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	2,175,214,131.06	2,175,214,131.06
本期申购	461,120,568.82	461,120,568.82
本期赎回 (以“-”号填列)	-511,204,327.57	-511,204,327.57
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	2,125,130,372.31	2,125,130,372.31

景顺长城沪深 300 指数增强 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	5,774,276.41	5,774,276.41
本期申购	33,243,017.35	33,243,017.35
本期赎回 (以“-”号填列)	-24,055,140.04	-24,055,140.04
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	14,962,153.72	14,962,153.72

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城沪深 300 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,355,013,173.70	152,186,424.01	2,507,199,597.71
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,355,013,173.70	152,186,424.01	2,507,199,597.71
本期利润	-322,579,845.01	-115,619,233.81	-438,199,078.82
本期基金份额交易产生的变动数	-60,409,570.98	-12,572,586.54	-72,982,157.52
其中：基金申购款	487,374,691.17	27,801,541.00	515,176,232.17
基金赎回款	-547,784,262.15	-40,374,127.54	-588,158,389.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,972,023,757.71	23,994,603.66	1,996,018,361.37

景顺长城沪深 300 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,236,937.27	403,980.26	6,640,917.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	6,236,937.27	403,980.26	6,640,917.53
本期利润	-1,916,243.59	-308,838.65	-2,225,082.24
本期基金份额交易产生的变动数	9,468,711.80	76,177.23	9,544,889.03
其中：基金申购款	34,681,009.62	1,468,307.98	36,149,317.60
基金赎回款	-25,212,297.82	-1,392,130.75	-26,604,428.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,789,405.48	171,318.84	13,960,724.32

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	1,047,761.33	1,153,224.04
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	673,261.68	287,634.29
其他	10,439.47	12,265.31
合计	1,731,462.48	1,453,123.64

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-380,469,066.86	-1,010,842,564.50
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	-380,469,066.86	-1,010,842,564.50

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	16,899,636,255.85	23,954,006,545.42
减：卖出股票成本总额	17,232,043,029.63	24,892,357,308.35
减：交易费用	48,062,293.08	72,491,801.57
买卖股票差价收入	-380,469,066.86	-1,010,842,564.50

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	2,455,608.37	2,658,010.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,864.62	5,752,382.39
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	2,450,743.75	8,410,393.37

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	133,472,641.25	171,886,430.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	131,032,680.00	163,257,620.00
减：应计利息总额	2,444,159.72	2,875,636.40
减：交易费用	666.15	791.87
买卖债券差价收入	-4,864.62	5,752,382.39

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益**7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.18 衍生工具收益**7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股指期货投资收益	-6,176,097.54	-

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	112,161,611.89	87,371,177.96
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	112,161,611.89	87,371,177.96

7.4.7.20 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	-116,415,776.46	-144,091,150.77
股票投资	-116,762,736.46	-143,665,590.77
债券投资	346,960.00	-425,560.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	487,704.00	-

权证投资	-	-
期货投资	487,704.00	-
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	-115,928,072.46	-144,091,150.77

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	691,788.49	1,920,740.66
基金转换费收入	9,259.09	88,010.93
合计	701,047.58	2,008,751.59

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	110,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款手续费	15,957.35	19,353.83
指数使用费	718,265.57	748,244.75
合计	982,222.92	1,025,598.58

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中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
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东

大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
长城证券	992,132,956.47	2.95	723,649,868.24	1.49

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	928,226.87	2.96	180,091.79	2.66
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	673,934.59	1.52	-	-

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	44,891,597.66
其中：应支付销售机构的客户维护	15,883,882.65	14,668,501.55

费		
应支付基金管理人的净管理费	29,007,715.01	32,096,801.07

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,978,319.64	9,353,060.48

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城沪深300指数增强A	景顺长城沪深300指数增强C	合计
长城证券	-	-	-
景顺长城基金管理有限公司	-	6,179.78	6,179.78
中国农业银行	-	-	-
合计	-	6,179.78	6,179.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城沪深300指数增强A	景顺长城沪深300指数增强C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	479.85	479.85
中国农业银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	479.85	479.85

注：（1）支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售

机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.20%/当年天数。

(2) 自 2022 年 4 月 29 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原有基金份额转为 A 类基金份额。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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-活期	100,991,076.87	1,047,761.33	155,710,770.28	1,153,224.04

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	新股流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023 年 11 月 1 日	6 个月	新股流通受限	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
300904	威力传动	2023 年 8 月 2 日	6 个月	新股流通受限	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股流通受限	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301348	蓝箭电子	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股流通受限	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-
301371	敷尔佳	2023 年 7 月 24 日	6 个月	新股流通受限	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301381	赛维时代	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股流通受限	20.45	29.69	571	11,676.95	16,952.99	-

301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股 流通 受限	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股 流通 受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股 流通 受限	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股 流通 受限	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股 流通 受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股 流通 受限	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301487	盟固利	2023年8月1日	6个月	新股 流通 受限	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股 流通 受限	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股 流通 受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股 流通 受限	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股 流通 受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股 流通 受限	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股 流通 受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301509	金凯生科	2023年7月26日	6个月	新股 流通 受限	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股 流通	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-

				受限							
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股 流通 受限	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-	
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股 流通 受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-	
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股 流通 受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-	
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股 流通 受限	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-	
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股 流通 受限	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-	
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股 流通 受限	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-	
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股 流通 受限	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-	
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股 流通 受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-	
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股 流通 受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-	
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股 流通 受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-	
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股 流通 受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-	
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股 流通 受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-	
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股 流通 受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-	
301558	三态股份	2023年9月21日	6个月	新股 流通 受限	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-	
301559	中集环科	2023年9	6个月	新股	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-	

		月 26 日		流通受限						
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	6 个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023 年 12 月 21 日	6 个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023 年 11 月 28 日	6 个月	新股流通受限	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
601096	宏盛华源	2023 年 12 月 15 日	6 个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603062	麦加芯彩	2023 年 10 月 31 日	6 个月	新股流通受限	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023 年 10 月 25 日	6 个月	新股流通受限	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603119	浙江荣泰	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股流通受限	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股流通受限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603270	金帝股份	2023 年 8 月 25 日	6 个月	新股流通受限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-

603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股流通受限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023年8月1日	6个月	新股流通受限	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688563	航材股份	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月以上	新股流通受限	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688591	泰凌微	2023年8月18日	6个月	新股流通受限	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688592	司南导航	2023年8月7日	6个月	新股流通受限	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688627	精智达	2023年7月11日	6个月	新股流通	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-

				受限						
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股 流通 受限	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股 流通 受限	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股 流通 受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股 流通 受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股 流通 受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股 流通 受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股 流通 受限	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股 流通 受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股 流通 受限	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股 流通 受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股 流通 受限	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股 流通 受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118046	诺泰转债	2023年12月18日	1-6个月(含)	新债未上市	100.00	100.01	90	9,000.00	9,000.67	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.00%（上年度末：0.00%）。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合集中度指标、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公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日内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 个工作日内可变现资产的可变现价值。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个 月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	100,991,076.87	-	-	-	-	-	100,991,076.87
结算备付金	67,182,230.59	-	-	-	-	-	67,182,230.59
存出保证金	428,472.47	-	-	-	-	8,179,876.80	8,608,349.27
交易性金融 资产	-	-	131,350,508.20	-	9,000.67	3,853,578,368.49	3,984,937,877.36
应收申购款	-	-	-	-	-	3,740,610.03	3,740,610.03
应收清算款	-	-	-	-	-	168,623.95	168,623.95

资产总计	168,601,779.93	-131,350,508.20	-9,000.67	3,865,667,479.27	4,165,628,768.07		
负债							
应付赎回款	-	-	-	4,214,728.53	4,214,728.53		
应付管理人报酬	-	-	-	3,460,992.18	3,460,992.18		
应付托管费	-	-	-	692,198.45	692,198.45		
应付销售服务费	-	-	-	4,714.36	4,714.36		
其他负债	-	-	-	7,184,522.83	7,184,522.83		
负债总计	-	-	-	15,557,156.35	15,557,156.35		
利率敏感度缺口	168,601,779.93	-131,350,508.20	-9,000.67	-	-		
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	155,710,770.28	-	-	-	-	-	155,710,770.28
结算备付金	14,483,802.02	-	-	-	-	-	14,483,802.02
存出保证金	719,418.30	-	-	-	-	-	719,418.30
交易性金融资产	-	-130,930,301.37	-	-	-4,407,657,804.42	-	4,538,588,105.79
应收申购款	-	-	-	-	3,857,385.92	-	3,857,385.92
应收清算款	-	-	-	-	214,565.97	-	214,565.97
资产总计	170,913,990.60	-130,930,301.37	-	-	-4,411,729,756.31	-	4,713,574,048.28
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	2,369,223.36	-	2,369,223.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,992,373.38	-	3,992,373.38
应付托管费	-	-	-	-	798,474.68	-	798,474.68
应付销售服务费	-	-	-	-	2,013.66	-	2,013.66
其他负债	-	-	-	-	11,583,040.49	-	11,583,040.49
负债总计	-	-	-	-	18,745,125.57	-	18,745,125.57
利率敏感度缺口	170,913,990.60	-130,930,301.37	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 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 12 月 31 日）	上年度末 （2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-140,689.53	-174,670.34

	市场利率下降 25 个基点	140,991.64	175,141.60
--	---------------	------------	------------

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	3,853,578,368.49	92.86	4,407,657,804.42	93.88
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,853,578,368.49	92.86	4,407,657,804.42	93.88

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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 12 月 31 日）	上年度末 （2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	176,590,963.42	213,393,137.16

	沪深 300 指数下降 5%	-176, 590, 963. 42	-213, 393, 137. 16
--	----------------	--------------------	--------------------

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	3, 852, 413, 015. 36	4, 405, 208, 433. 73
第二层次	131, 384, 567. 03	130, 930, 301. 37
第三层次	1, 140, 294. 97	2, 449, 370. 69
合计	3, 984, 937, 877. 36	4, 538, 588, 105. 79

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	2, 449, 370. 69	2, 449, 370. 69

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	980,784.73	980,784.73
转出第三层次	-	2,449,370.69	2,449,370.69
当期利得或损失总额	-	159,510.24	159,510.24
其中：计入损益的利得或损失	-	159,510.24	159,510.24
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,140,294.97	1,140,294.97
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	159,510.24	159,510.24
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,136,210.06	2,136,210.06
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	313,160.63	313,160.63
其中：计入损益的利得或损失	-	313,160.63	313,160.63
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,449,370.69	2,449,370.69
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	313,160.63	313,160.63

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

限售股票	1,140,294.97	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	2,449,370.69	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,853,578,368.49	92.51
	其中：股票	3,853,578,368.49	92.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	131,359,508.87	3.15
	其中：债券	131,359,508.87	3.15
	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	168,173,307.46	4.04
8	其他各项资产	12,517,583.25	0.30
9	合计	4,165,628,768.07	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	22,908,520.00	0.55

B	采矿业	136,822,075.70	3.30
C	制造业	1,780,470,364.92	42.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	130,756,081.70	3.15
E	建筑业	47,262,872.60	1.14
F	批发和零售业	4,246,074.00	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	126,825,588.44	3.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	149,784,845.85	3.61
J	金融业	730,174,502.28	17.59
K	房地产业	55,877,506.86	1.35
L	租赁和商务服务业	32,376,422.56	0.78
M	科学研究和技术服务业	29,841,058.80	0.72
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	23,524,292.54	0.57
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,270,870,206.25	78.81

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,170,160.00	0.15
B	采矿业	38,015,493.39	0.92
C	制造业	340,481,954.81	8.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,944,142.40	0.50
E	建筑业	23,495,215.31	0.57
F	批发和零售业	21,398,112.19	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	10,688,630.41	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,536,124.43	0.98
J	金融业	59,158,007.42	1.43
K	房地产业	6,131,237.80	0.15
L	租赁和商务服务业	1,906,582.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	1,572,474.26	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	8,932.82	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,446,786.00	0.03
Q	卫生和社会工作	742,911.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	5,462,634.00	0.13

S	综合	4,548,764.00	0.11
	合计	582,708,162.24	14.04

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	135,627	234,092,202.00	5.64
2	300750	宁德时代	644,173	105,167,683.98	2.53
3	601318	中国平安	2,301,449	92,748,394.70	2.23
4	600900	长江电力	3,191,100	74,480,274.00	1.79
5	300760	迈瑞医疗	224,310	65,184,486.00	1.57
6	000651	格力电器	1,756,882	56,518,893.94	1.36
7	600887	伊利股份	2,041,400	54,607,450.00	1.32
8	000568	泸州老窖	284,607	51,064,187.94	1.23
9	600919	江苏银行	7,250,100	48,503,169.00	1.17
10	000858	五粮液	307,700	43,173,387.00	1.04
11	000338	潍柴动力	3,118,258	42,564,221.70	1.03
12	002594	比亚迪	213,969	42,365,862.00	1.02
13	601211	国泰君安	2,804,273	41,727,582.24	1.01
14	600016	民生银行	10,628,126	39,749,191.24	0.96
15	600036	招商银行	1,415,318	39,374,146.76	0.95
16	601919	中远海控	3,984,668	38,173,119.44	0.92
17	000725	京东方A	9,553,000	37,256,700.00	0.90
18	601939	建设银行	5,591,600	36,401,316.00	0.88
19	601328	交通银行	6,130,900	35,191,366.00	0.85
20	600150	中国船舶	1,191,200	35,068,928.00	0.85
21	601006	大秦铁路	4,858,700	35,031,227.00	0.84
22	000333	美的集团	639,900	34,957,737.00	0.84
23	600845	宝信软件	681,408	33,252,710.40	0.80
24	600030	中信证券	1,624,540	33,091,879.80	0.80
25	600276	恒瑞医药	716,440	32,404,581.20	0.78
26	601111	中国国航	4,338,900	31,847,526.00	0.77
27	002007	华兰生物	1,435,800	31,774,254.00	0.77
28	601688	华泰证券	2,253,278	31,433,228.10	0.76
29	000063	中兴通讯	1,183,417	31,336,882.16	0.76
30	603259	药明康德	410,130	29,841,058.80	0.72
31	002027	分众传媒	4,693,808	29,664,866.56	0.71
32	600570	恒生电子	976,165	28,074,505.40	0.68
33	601169	北京银行	6,062,900	27,464,937.00	0.66

34	000100	TCL 科技	6,382,400	27,444,320.00	0.66
35	600958	东方证券	2,965,000	25,795,500.00	0.62
36	688981	中芯国际	480,948	25,499,862.96	0.61
37	600941	中国移动	249,932	24,863,235.36	0.60
38	601916	浙商银行	9,864,481	24,858,492.12	0.60
39	600584	长电科技	830,900	24,810,674.00	0.60
40	600019	宝钢股份	4,110,800	24,377,044.00	0.59
41	601838	成都银行	2,096,255	23,603,831.30	0.57
42	300015	爱尔眼科	1,486,997	23,524,292.54	0.57
43	601088	中国神华	733,066	22,981,619.10	0.55
44	300498	温氏股份	1,142,000	22,908,520.00	0.55
45	000661	长春高新	154,200	22,482,360.00	0.54
46	603501	韦尔股份	203,428	21,707,801.88	0.52
47	601225	陕西煤业	1,026,100	21,435,229.00	0.52
48	688008	澜起科技	358,605	21,071,629.80	0.51
49	002142	宁波银行	1,031,200	20,737,432.00	0.50
50	600938	中国海油	978,328	20,515,538.16	0.49
51	601138	工业富联	1,325,400	20,040,048.00	0.48
52	300450	先导智能	781,697	20,011,443.20	0.48
53	000538	云南白药	400,840	19,701,286.00	0.47
54	300122	智飞生物	315,400	19,274,094.00	0.46
55	600309	万华化学	247,700	19,028,314.00	0.46
56	000157	中联重科	2,891,600	18,882,148.00	0.45
57	300274	阳光电源	215,057	18,836,842.63	0.45
58	600104	上汽集团	1,390,693	18,816,076.29	0.45
59	600745	闻泰科技	442,347	18,715,701.57	0.45
60	688036	传音控股	132,992	18,406,092.80	0.44
61	600489	中金黄金	1,847,889	18,404,974.44	0.44
62	002179	中航光电	471,722	18,397,158.00	0.44
63	002050	三花智控	620,800	18,251,520.00	0.44
64	600837	海通证券	1,909,651	17,893,429.87	0.43
65	600999	招商证券	1,258,800	17,170,032.00	0.41
66	601229	上海银行	2,847,100	16,997,187.00	0.41
67	600048	保利发展	1,709,307	16,922,139.30	0.41
68	000895	双汇发展	619,100	16,536,161.00	0.40
69	002129	TCL 中环	1,053,425	16,475,567.00	0.40
70	601166	兴业银行	1,002,239	16,246,294.19	0.39
71	000938	紫光股份	821,100	15,888,285.00	0.38
72	601899	紫金矿业	1,250,600	15,582,476.00	0.38
73	300751	迈为股份	116,180	15,046,471.80	0.36
74	000166	申万宏源	3,272,800	14,531,232.00	0.35
75	600886	国投电力	1,099,600	14,492,728.00	0.35
76	600795	国电电力	3,441,500	14,316,640.00	0.34

77	002415	海康威视	404,318	14,037,920.96	0.34
78	600000	浦发银行	2,113,400	13,990,708.00	0.34
79	601390	中国中铁	2,461,756	13,982,774.08	0.34
80	600438	通威股份	558,100	13,969,243.00	0.34
81	002236	大华股份	742,500	13,699,125.00	0.33
82	002736	国信证券	1,597,100	13,639,234.00	0.33
83	600809	山西汾酒	58,731	13,551,003.63	0.33
84	002001	新和成	798,700	13,545,952.00	0.33
85	601881	中国银河	1,116,600	13,455,030.00	0.32
86	601066	中信建投	564,700	13,360,802.00	0.32
87	002555	三七互娱	687,900	12,939,399.00	0.31
88	601186	中国铁建	1,694,900	12,898,189.00	0.31
89	600061	国投资本	1,910,100	12,874,074.00	0.31
90	600515	海南机场	3,419,000	12,650,300.00	0.30
91	600690	海尔智家	597,900	12,555,900.00	0.30
92	300999	金龙鱼	373,100	12,454,078.00	0.30
93	000617	中油资本	2,300,100	12,420,540.00	0.30
94	603659	璞泰来	589,480	12,337,816.40	0.30
95	002180	纳思达	531,100	12,018,793.00	0.29
96	600918	中泰证券	1,745,800	11,976,188.00	0.29
97	603899	晨光股份	318,098	11,944,579.90	0.29
98	002821	凯莱英	102,480	11,897,928.00	0.29
99	601898	中煤能源	1,223,900	11,859,591.00	0.29
100	002916	深南电路	166,400	11,812,736.00	0.28
101	603486	科沃斯	282,900	11,723,376.00	0.28
102	600588	用友网络	657,500	11,696,925.00	0.28
103	600025	华能水电	1,338,200	11,548,666.00	0.28
104	002410	广联达	666,800	11,428,952.00	0.28
105	688012	中微公司	72,571	11,146,905.60	0.27
106	000800	一汽解放	1,310,400	11,138,400.00	0.27
107	601155	新城控股	944,100	10,772,181.00	0.26
108	603986	兆易创新	112,500	10,393,875.00	0.25
109	600188	兖矿能源	523,200	10,364,592.00	0.25
110	001289	龙源电力	520,600	10,313,086.00	0.25
111	300316	晶盛机电	233,680	10,302,951.20	0.25
112	002601	龙佰集团	600,400	10,284,852.00	0.25
113	603290	斯达半导	56,300	10,190,300.00	0.25
114	000002	万科A	876,736	9,170,658.56	0.22
115	600741	华域汽车	556,690	9,062,913.20	0.22
116	300433	蓝思科技	683,000	9,015,600.00	0.22
117	603369	今世缘	182,419	8,892,926.25	0.21
118	300223	北京君正	132,600	8,572,590.00	0.21
119	688111	金山办公	26,985	8,532,657.00	0.21

120	600115	中国东航	2,181,400	8,463,832.00	0.20
121	600436	片仔癀	34,500	8,348,655.00	0.20
122	600176	中国巨石	832,100	8,179,543.00	0.20
123	605499	东鹏饮料	41,500	7,574,165.00	0.18
124	601615	明阳智能	603,869	7,572,517.26	0.18
125	002459	晶澳科技	364,059	7,543,302.48	0.18
126	601668	中国建筑	1,563,000	7,518,030.00	0.18
127	688599	天合光能	261,545	7,461,878.85	0.18
128	600039	四川路桥	974,400	7,298,256.00	0.18
129	600989	宝丰能源	459,300	6,783,861.00	0.16
130	600050	中国联通	1,506,300	6,597,594.00	0.16
131	001979	招商蛇口	667,600	6,362,228.00	0.15
132	002371	北方华创	25,400	6,241,034.00	0.15
133	600362	江西铜业	343,000	6,125,980.00	0.15
134	603993	洛阳钼业	1,174,300	6,106,360.00	0.15
135	601377	兴业证券	1,010,568	5,932,034.16	0.14
136	600028	中国石化	1,052,900	5,875,182.00	0.14
137	601336	新华保险	178,208	5,547,615.04	0.13
138	002709	天赐材料	207,900	5,214,132.00	0.13
139	600029	南方航空	888,500	5,117,760.00	0.12
140	688561	奇安信	126,041	5,052,983.69	0.12
141	002049	紫光国微	74,144	5,001,012.80	0.12
142	601398	工商银行	1,002,900	4,793,862.00	0.12
143	600585	海螺水泥	205,824	4,643,389.44	0.11
144	600346	恒力石化	346,600	4,564,722.00	0.11
145	002938	鹏鼎控股	203,111	4,533,437.52	0.11
146	601607	上海医药	253,800	4,246,074.00	0.10
147	600018	上港集团	863,700	4,232,130.00	0.10
148	300124	汇川技术	66,900	4,224,066.00	0.10
149	000977	浪潮信息	120,700	4,007,240.00	0.10
150	301269	华大九天	37,200	3,937,620.00	0.09
151	601600	中国铝业	695,400	3,922,056.00	0.09
152	603288	海天味业	101,000	3,832,950.00	0.09
153	601998	中信银行	723,600	3,827,844.00	0.09
154	601800	中国交建	466,100	3,542,360.00	0.09
155	688223	晶科能源	397,773	3,524,268.78	0.08
156	300782	卓胜微	23,900	3,369,900.00	0.08
157	002648	卫星化学	222,864	3,287,244.00	0.08
158	002493	荣盛石化	312,600	3,235,410.00	0.08
159	601888	中国中免	32,400	2,711,556.00	0.07
160	600674	川投能源	175,600	2,655,072.00	0.06
161	002304	洋河股份	24,100	2,648,590.00	0.06
162	000596	古井贡酒	11,334	2,638,555.20	0.06

163	600426	华鲁恒升	94,600	2,610,014.00	0.06
164	600760	中航沈飞	61,700	2,602,506.00	0.06
165	601988	中国银行	612,200	2,442,678.00	0.06
166	002311	海大集团	54,241	2,435,963.31	0.06
167	601808	中海油服	165,000	2,412,300.00	0.06
168	601021	春秋航空	46,800	2,349,360.00	0.06
169	601901	方正证券	281,100	2,265,666.00	0.05
170	603806	福斯特	77,900	1,890,633.00	0.05
171	600011	华能国际	242,911	1,870,414.70	0.05
172	601100	恒立液压	33,700	1,842,716.00	0.04
173	601728	中国电信	322,100	1,742,561.00	0.04
174	601601	中国太保	67,300	1,600,394.00	0.04
175	600660	福耀玻璃	42,300	1,581,597.00	0.04
176	601633	长城汽车	61,400	1,548,508.00	0.04
177	601766	中国中车	288,500	1,517,510.00	0.04
178	601818	光大银行	487,916	1,414,956.40	0.03
179	601658	邮储银行	313,100	1,361,985.00	0.03
180	601628	中国人寿	47,904	1,358,078.40	0.03
181	601816	京沪高铁	269,400	1,325,448.00	0.03
182	300408	三环集团	43,800	1,289,910.00	0.03
183	601857	中国石油	181,900	1,284,214.00	0.03
184	600926	杭州银行	125,196	1,253,211.96	0.03
185	300896	爱美客	4,200	1,236,186.00	0.03
186	300059	东方财富	85,900	1,206,036.00	0.03
187	600010	包钢股份	797,900	1,164,934.00	0.03
188	002920	德赛西威	8,900	1,152,639.00	0.03
189	600085	同仁堂	21,200	1,138,440.00	0.03
190	601877	正泰电器	52,444	1,128,070.44	0.03
191	601618	中国中冶	359,792	1,100,963.52	0.03
192	000786	北新建材	47,000	1,097,920.00	0.03
193	688396	华润微	24,530	1,096,245.70	0.03
194	600023	浙能电力	234,100	1,079,201.00	0.03
195	600875	东方电气	72,540	1,060,534.80	0.03
196	603833	欧派家居	14,700	1,023,267.00	0.02
197	601319	中国人保	211,100	1,021,724.00	0.02
198	603195	公牛集团	10,559	1,009,968.35	0.02
199	600893	航发动力	25,900	968,142.00	0.02
200	300454	深信服	13,100	946,999.00	0.02
201	000733	振华科技	15,800	929,672.00	0.02
202	600606	绿地控股	401,000	922,300.00	0.02
203	601995	中金公司	24,000	913,200.00	0.02
204	300957	贝泰妮	13,300	906,661.00	0.02
205	600219	南山铝业	290,000	852,600.00	0.02

206	300919	中伟股份	16,700	820,471.00	0.02
207	600406	国电南瑞	32,200	718,704.00	0.02
208	601799	星宇股份	4,800	629,328.00	0.02
209	600183	生益科技	20,400	373,524.00	0.01
210	603799	华友钴业	9,000	296,370.00	0.01
211	600009	上海机场	8,700	285,186.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600872	中炬高新	592,800	16,657,680.00	0.40
2	000591	太阳能	2,954,780	16,487,672.40	0.40
3	601168	西部矿业	1,143,361	16,315,761.47	0.39
4	600737	中粮糖业	1,951,400	16,079,536.00	0.39
5	000830	鲁西化工	1,584,800	15,895,544.00	0.38
6	000728	国元证券	2,277,050	15,552,251.50	0.37
7	000928	中钢国际	2,641,357	15,399,111.31	0.37
8	000513	丽珠集团	437,769	15,326,292.69	0.37
9	600161	天坛生物	400,900	12,403,846.00	0.30
10	600901	江苏金租	2,469,358	11,951,692.72	0.29
11	601077	渝农商行	2,827,400	11,535,792.00	0.28
12	603132	金徽股份	781,500	10,690,920.00	0.26
13	688048	长光华芯	168,900	10,584,963.00	0.26
14	603025	大豪科技	793,600	10,523,136.00	0.25
15	300442	润泽科技	414,000	10,503,180.00	0.25
16	600348	华阳股份	1,023,217	9,986,597.92	0.24
17	601018	宁波港	2,757,600	9,817,056.00	0.24
18	002152	广电运通	766,900	9,402,194.00	0.23
19	000581	威孚高科	616,394	9,289,057.58	0.22
20	600637	东方明珠	1,215,200	9,138,304.00	0.22
21	300188	国投智能	554,700	8,886,294.00	0.21
22	600066	宇通客车	661,200	8,760,900.00	0.21
23	002268	电科网安	379,800	8,530,308.00	0.21
24	002966	苏州银行	1,319,420	8,523,453.20	0.21
25	688700	东威科技	139,500	8,512,290.00	0.21
26	300741	华宝股份	359,100	7,688,331.00	0.19
27	002925	盈趣科技	376,700	7,334,349.00	0.18
28	002100	天康生物	821,000	7,200,170.00	0.17
29	600867	通化东宝	597,200	6,467,676.00	0.16
30	603033	三维股份	408,669	6,461,056.89	0.16
31	300001	特锐德	312,300	6,277,230.00	0.15
32	300009	安科生物	607,600	6,209,672.00	0.15
33	000998	隆平高科	437,600	6,170,160.00	0.15
34	688518	联赢激光	301,100	6,166,528.00	0.15

35	002819	东方中科	236,800	6,064,448.00	0.15
36	688375	国博电子	75,716	6,021,693.48	0.15
37	000059	华锦股份	1,087,200	5,968,728.00	0.14
38	601128	常熟银行	878,800	5,615,532.00	0.14
39	002414	高德红外	767,316	5,601,406.80	0.13
40	603826	坤彩科技	94,500	5,578,335.00	0.13
41	688300	联瑞新材	103,600	5,485,620.00	0.13
42	601811	新华文轩	399,900	5,462,634.00	0.13
43	300134	大富科技	510,900	5,272,488.00	0.13
44	000829	天音控股	550,600	5,252,724.00	0.13
45	688772	珠海冠宇	238,312	5,245,247.12	0.13
46	603589	口子窖	111,900	5,069,070.00	0.12
47	601136	首创证券	284,500	4,825,120.00	0.12
48	600733	北汽蓝谷	786,500	4,821,245.00	0.12
49	600595	中孚实业	1,349,700	4,696,956.00	0.11
50	000090	天健集团	971,500	4,468,900.00	0.11
51	688733	壹石通	150,500	4,405,135.00	0.11
52	603855	华荣股份	219,400	4,379,224.00	0.11
53	000011	深物业 A	490,700	4,347,602.00	0.10
54	002534	西子洁能	327,700	4,092,973.00	0.10
55	300398	飞凯材料	242,100	3,815,496.00	0.09
56	000009	中国宝安	318,900	3,743,886.00	0.09
57	600180	瑞茂通	596,700	3,633,903.00	0.09
58	688521	芯原股份	72,715	3,632,841.40	0.09
59	002051	中工国际	446,700	3,627,204.00	0.09
60	601158	重庆水务	636,400	3,608,388.00	0.09
61	603920	世运电路	191,900	3,507,932.00	0.08
62	300455	航天智装	277,700	3,315,738.00	0.08
63	300460	惠伦晶体	267,600	3,280,776.00	0.08
64	002194	武汉凡谷	322,800	3,182,808.00	0.08
65	688003	天准科技	84,212	3,159,634.24	0.08
66	600153	建发股份	324,000	3,120,120.00	0.08
67	600062	华润双鹤	167,100	3,108,060.00	0.07
68	002481	双塔食品	685,300	3,022,173.00	0.07
69	600206	有研新材	234,371	2,903,856.69	0.07
70	002409	雅克科技	47,600	2,652,748.00	0.06
71	603228	景旺电子	114,400	2,580,864.00	0.06
72	000158	常山北明	293,300	2,528,246.00	0.06
73	688083	中望软件	24,700	2,458,638.00	0.06
74	688268	华特气体	36,200	2,439,156.00	0.06
75	688167	炬光科技	18,882	2,152,548.00	0.05
76	300997	欢乐家	146,200	2,042,414.00	0.05
77	300480	光力科技	94,200	2,011,170.00	0.05

78	002707	众信旅游	266,600	1,903,524.00	0.05
79	000541	佛山照明	281,200	1,869,980.00	0.05
80	605365	立达信	97,300	1,810,753.00	0.04
81	002158	汉钟精机	81,300	1,809,738.00	0.04
82	000050	深天马 A	167,600	1,784,940.00	0.04
83	688099	晶晨股份	28,016	1,754,642.08	0.04
84	688020	方邦股份	34,969	1,695,297.12	0.04
85	603123	翠微股份	124,800	1,329,120.00	0.03
86	002607	中公教育	318,700	1,300,296.00	0.03
87	688128	中国电研	58,697	1,204,462.44	0.03
88	688248	南网科技	46,340	1,157,109.80	0.03
89	300102	乾照光电	139,200	1,023,120.00	0.02
90	300119	瑞普生物	60,000	983,400.00	0.02
91	300866	安克创新	10,400	921,440.00	0.02
92	603160	汇顶科技	12,900	891,390.00	0.02
93	688188	柏楚电子	3,500	885,885.00	0.02
94	688234	天岳先进	13,300	878,731.00	0.02
95	002891	中宠股份	33,200	874,820.00	0.02
96	600755	厦门国贸	125,500	874,735.00	0.02
97	002138	顺络电子	32,300	872,423.00	0.02
98	002706	良信股份	98,500	869,755.00	0.02
99	002064	华峰化学	129,600	869,616.00	0.02
100	002320	海峡股份	147,100	857,593.00	0.02
101	300558	贝达药业	16,600	855,730.00	0.02
102	600022	山东钢铁	619,500	848,715.00	0.02
103	600642	申能股份	132,100	848,082.00	0.02
104	000987	越秀资本	138,300	832,566.00	0.02
105	688153	唯捷创芯	12,555	822,352.50	0.02
106	688198	佰仁医疗	6,600	821,898.00	0.02
107	600212	绿能慧充	112,100	804,878.00	0.02
108	300908	仲景食品	19,300	796,511.00	0.02
109	600649	城投控股	212,484	786,190.80	0.02
110	600648	外高桥	76,400	753,304.00	0.02
111	301060	兰卫医学	55,900	742,911.00	0.02
112	688018	乐鑫科技	6,660	685,647.00	0.02
113	002128	电投能源	45,800	653,566.00	0.02
114	688072	拓荆科技	2,740	633,762.00	0.02
115	605007	五洲特纸	42,200	620,762.00	0.01
116	002946	新乳业	50,900	584,332.00	0.01
117	001914	招商积余	45,900	548,964.00	0.01
118	002588	史丹利	83,400	532,092.00	0.01
119	300271	华宇软件	64,500	528,255.00	0.01
120	601058	赛轮轮胎	44,840	526,870.00	0.01

121	301179	泽宇智能	20,300	526,785.00	0.01
122	688798	艾为电子	7,400	510,822.00	0.01
123	603198	迎驾贡酒	7,300	483,917.00	0.01
124	300676	华大基因	8,100	388,800.00	0.01
125	603688	石英股份	4,400	382,272.00	0.01
126	300024	机器人	31,100	369,157.00	0.01
127	000426	兴业银锡	40,600	368,648.00	0.01
128	002249	大洋电机	73,400	364,798.00	0.01
129	000997	新大陆	17,600	345,136.00	0.01
130	000019	深粮控股	44,200	333,268.00	0.01
131	603093	南华期货	26,800	321,600.00	0.01
132	600325	华发股份	39,700	286,237.00	0.01
133	688050	爱博医疗	1,500	258,060.00	0.01
134	688386	泛亚微透	6,188	252,470.40	0.01
135	300681	英搏尔	12,800	246,656.00	0.01
136	688601	力芯微	4,700	246,233.00	0.01
137	688508	芯朋微	4,800	236,208.00	0.01
138	603279	景津装备	9,900	218,889.00	0.01
139	300666	江丰电子	3,100	181,598.00	0.00
140	688200	华峰测控	1,472	180,761.60	0.00
141	688037	芯源微	1,324	176,899.64	0.00
142	688009	中国通号	39,034	170,968.92	0.00
143	603690	至纯科技	6,580	169,106.00	0.00
144	300820	英杰电气	2,950	168,976.00	0.00
145	688082	盛美上海	1,600	167,056.00	0.00
146	688120	华海清科	890	167,053.00	0.00
147	600536	中国软件	4,600	166,796.00	0.00
148	300567	精测电子	1,900	166,478.00	0.00
149	688596	正帆科技	4,200	166,446.00	0.00
150	300260	新莱应材	5,360	163,104.80	0.00
151	600641	万业企业	9,400	162,244.00	0.00
152	688630	芯碁微装	1,900	162,203.00	0.00
153	300604	长川科技	4,200	159,558.00	0.00
154	605098	行动教育	3,800	146,490.00	0.00
155	605116	奥锐特	5,500	142,010.00	0.00
156	605016	百龙创园	4,500	127,755.00	0.00
157	601636	旗滨集团	16,400	112,176.00	0.00
158	300846	首都在线	7,800	111,462.00	0.00
159	300776	帝尔激光	1,760	106,057.60	0.00
160	000723	美锦能源	15,200	101,232.00	0.00
161	300685	艾德生物	4,300	94,514.00	0.00
162	000589	贵州轮胎	14,900	91,188.00	0.00
163	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00

164	002803	吉宏股份	3,800	78,128.00	0.00
165	603112	华翔股份	6,000	72,900.00	0.00
166	003000	劲仔食品	4,800	58,656.00	0.00
167	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
168	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
169	603893	瑞芯微	700	44,380.00	0.00
170	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
171	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
172	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
173	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
174	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
175	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
176	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
177	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
178	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
179	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
180	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
181	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
182	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
183	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
184	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
185	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
186	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
187	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
188	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
189	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
190	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
191	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
192	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
193	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
194	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
195	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
196	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
197	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
198	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
199	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
200	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
201	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
202	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
203	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
204	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
205	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
206	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00

207	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
208	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
209	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
210	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
211	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
212	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
213	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
214	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
215	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
216	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
217	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
218	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
219	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
220	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
221	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
222	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
223	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
224	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
225	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
226	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
227	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
228	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
229	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
230	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
231	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
232	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
233	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
234	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
235	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
236	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
237	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
238	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
239	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
240	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
241	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
242	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
243	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
244	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
245	603590	康辰药业	100	3,808.00	0.00
246	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
247	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
248	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
249	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00

250	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
-----	--------	------	----	----------	------

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	171,223,042.76	3.65
2	000858	五粮液	169,576,037.91	3.61
3	601919	中远海控	166,816,880.55	3.55
4	600941	中国移动	158,847,660.19	3.38
5	600887	伊利股份	154,383,407.89	3.29
6	600900	长江电力	133,465,046.00	2.84
7	601211	国泰君安	131,337,064.01	2.80
8	601012	隆基绿能	128,127,369.94	2.73
9	000063	中兴通讯	125,877,571.50	2.68
10	601916	浙商银行	122,586,083.20	2.61
11	300750	宁德时代	120,643,207.73	2.57
12	300122	智飞生物	120,255,799.81	2.56
13	600795	国电电力	119,734,908.41	2.55
14	300760	迈瑞医疗	115,114,313.20	2.45
15	000651	格力电器	112,578,632.16	2.40
16	600309	万华化学	111,125,740.00	2.37
17	002466	天齐锂业	109,764,599.50	2.34
18	300316	晶盛机电	104,415,379.69	2.22
19	600104	上汽集团	102,156,772.52	2.18
20	600845	宝信软件	100,301,460.94	2.14
21	601186	中国铁建	100,223,682.00	2.13
22	603290	斯达半导	99,388,669.31	2.12
23	002050	三花智控	99,127,767.10	2.11
24	600039	四川路桥	98,541,192.80	2.10
25	000425	徐工机械	97,852,944.00	2.08
26	002415	海康威视	96,999,500.14	2.07
27	600150	中国船舶	96,838,945.00	2.06
28	000568	泸州老窖	95,945,265.97	2.04
29	002129	TCL 中环	95,625,475.76	2.04
30	300498	温氏股份	95,490,029.20	2.03
31	600036	招商银行	94,985,503.16	2.02
32	601766	中国中车	94,827,306.00	2.02
33	688981	中芯国际	94,112,207.67	2.00

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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

1	600519	贵州茅台	182,119,086.56	3.88
2	601390	中国中铁	169,456,089.12	3.61
3	000651	格力电器	151,490,031.18	3.23
4	601012	隆基绿能	151,046,313.95	3.22
5	600837	海通证券	150,603,434.93	3.21
6	300750	宁德时代	141,980,527.05	3.02
7	600941	中国移动	136,765,862.30	2.91
8	603259	药明康德	130,935,589.84	2.79
9	000425	徐工机械	130,297,637.04	2.78
10	002049	紫光国微	130,041,573.57	2.77
11	000858	五粮液	128,725,254.35	2.74
12	601919	中远海控	127,684,564.12	2.72
13	601211	国泰君安	127,217,259.14	2.71
14	601318	中国平安	125,485,478.94	2.67
15	002594	比亚迪	124,807,846.29	2.66
16	002938	鹏鼎控股	124,450,785.32	2.65
17	600887	伊利股份	123,846,681.80	2.64
18	000063	中兴通讯	122,895,857.32	2.62
19	601916	浙商银行	121,696,233.24	2.59
20	601601	中国太保	121,349,765.60	2.58
21	601668	中国建筑	120,789,049.96	2.57
22	002466	天齐锂业	118,108,713.20	2.52
23	600809	山西汾酒	117,479,766.88	2.50
24	600089	特变电工	116,429,062.86	2.48
25	600009	上海机场	115,252,840.31	2.45
26	600438	通威股份	114,908,242.63	2.45
27	300498	温氏股份	114,504,765.83	2.44
28	002304	洋河股份	110,938,696.16	2.36
29	000568	泸州老窖	110,885,195.03	2.36
30	600741	华域汽车	107,662,149.48	2.29
31	600585	海螺水泥	107,487,872.08	2.29
32	600795	国电电力	106,378,474.92	2.27
33	300316	晶盛机电	105,627,656.88	2.25
34	600104	上汽集团	103,117,042.07	2.20
35	000001	平安银行	102,889,181.20	2.19
36	600036	招商银行	102,477,227.21	2.18
37	603369	今世缘	101,318,335.67	2.16
38	600150	中国船舶	101,165,929.07	2.15
39	300122	智飞生物	96,921,258.61	2.06

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	16,794,726,330.16
--------------	-------------------

卖出股票收入（成交）总额	16,899,636,255.85
--------------	-------------------

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	131,350,508.20	3.17
	其中：政策性金融债	131,350,508.20	3.17
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）	9,000.67	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	131,359,508.87	3.17

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	230304	23 进出 04	1,300,000	131,350,508.20	3.17
2	118046	诺泰转债	90	9,000.67	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局地方分局等的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,608,349.27
2	应收清算款	168,623.95
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,740,610.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,517,583.25

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
景顺长城沪深 300 指数增强 A	378,840	5,609.57	420,403,358.68	19.78	1,704,727,013.63	80.22
景顺长城沪深 300 指数增强 C	1,525	9,811.25	1,801,875.54	12.04	13,160,278.18	87.96
合计	380,365	5,626.42	422,205,234.22	19.73	1,717,887,291.81	80.27

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城沪深 300 指数增强 A	92,139.00	0.004336
	景顺长城沪深 300 指数增强 C	47,814.12	0.319567
	合计	139,953.12	0.006540

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

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

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城沪深 300 指数增强 A	景顺长城沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日 (2013 年 10 月)	382,141,978.85	-

29 日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	2, 175, 214, 131. 06	5, 774, 276. 41
本报告期基金总申购份额	461, 120, 568. 82	33, 243, 017. 35
减: 本报告期基金总赎回份额	511, 204, 327. 57	24, 055, 140. 04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2, 125, 130, 372. 31	14, 962, 153. 72

注: 申购含红利再投、转换入份额; 赎回含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内, 本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动:

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

在本报告期内, 本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)已经连续 11 年为本基金提供审计服务, 本年度应支付给会计师事务所的报酬为人民币 110, 000. 00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券股份有限公司	6	4,842,065,436.94	14.38	4,386,538.44	13.98	本期未变更
中国国际金融股份有限公司	2	4,831,005,632.79	14.35	4,506,394.18	14.37	本期未变更
长江证券股份有限公司	2	4,648,328,976.24	13.81	4,354,141.94	13.88	本期未变更
中国银河证券股份有限公司	2	2,484,404,778.30	7.38	2,323,471.75	7.41	本期未变更
光大证券股份有限公司	2	2,444,143,213.98	7.26	2,284,008.26	7.28	本期未变更
华泰证券股份有限公司	1	1,772,603,555.19	5.27	1,676,698.46	5.35	本期未变更
东方证券股份有限公司	2	1,683,649,670.06	5.00	1,585,010.50	5.05	本期未变更
兴业证券股份有限公司	1	1,682,014,496.39	5.00	1,566,464.43	4.99	本期未变更
华创证券有限责任公司	1	1,639,442,752.44	4.87	1,532,863.20	4.89	本期未变更
广发证券股份有限公司	2	1,289,779,643.22	3.83	1,210,282.12	3.86	本期未变更
长城证券股份有限公司	1	992,132,956.47	2.95	928,226.87	2.96	本期未变更
国泰君安证券股份有限公司	1	962,463,479.32	2.86	896,344.51	2.86	本期未变更
申万宏源证券有限公司	1	854,629,315.60	2.54	795,917.39	2.54	本期未变更
中信建投证券股份有限公司	1	795,432,097.58	2.36	744,145.16	2.37	本期未变更
天风证券股份有限公司	1	716,657,512.12	2.13	677,894.20	2.16	本期未变更
平安证券股份有限公司	2	564,881,395.93	1.68	534,323.20	1.70	本期未变更
瑞银证券有限责任公司	1	534,332,583.23	1.59	497,636.40	1.59	本期未变更
国盛证券有限责任公司	1	397,392,829.49	1.18	375,897.72	1.20	本期未变更
西南证券股份有限公司	1	329,561,815.86	0.98	306,926.73	0.98	本期未变更
方正证券股份有限公司	2	168,489,971.37	0.50	156,914.54	0.50	本期未变更

						变更
东北证券股份有限公司	2	29,047,565.00	0.09	27,475.98	0.09	本期未变更
诚通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期未变更
川财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本期未变更
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期未变更
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期未变更
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期未变更
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期未变更
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期未变更
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期未变更
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本期未变更
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期未变更
申港证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期未变更
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期未变更
中泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期未变更

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

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

2) 选择程序

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	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(%)
中信证券股份有限公司	148,830.00	14.47	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	611,464.46	59.44	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	268,346.79	26.09	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责	-	-	-	-	-	-

任公司						
国盛证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
诚通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
川财证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申港证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资 基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及 网站	2023 年 1 月 20 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下 基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及 网站	2023 年 1 月 20 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于系统 停机维护的公告	中国证监会指定报刊及 网站	2023 年 2 月 10 日

4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 25 日
6	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
8	关于旗下部分基金新增泰隆银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 29 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 8 日
10	关于旗下部分基金新增杭州银行股份有限公司杭 e 家平台为销售平台并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 12 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 18 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
13	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 22 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 6 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 13 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增德邦证券为销售机构并开通基金定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 27 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 10 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 17 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 22 日
22	景顺长城基金管理有限公司 2022 年度环境信息披露报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 30 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2023 年 7 月 1 日

	停机维护的公告	网站	
24	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 1 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 8 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 15 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 21 日
28	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 21 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金在腾安基金销售（深圳）有限公司开展赎回费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 2 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 30 日
31	景顺长城基金管理有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 30 日
32	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 30 日
33	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 2 日
34	景顺长城基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 4 日
35	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 22 日
36	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 14 日
37	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 25 日
38	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 25 日
39	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 2 日
40	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 25 日
41	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 30 日
42	景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 30 日
43	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2023 年 12 月 9 日

	停机维护的公告	网站	
44	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 16 日
45	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 23 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日