

景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基
金
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,321,848,353.83 份 |
| 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、</p> |

| | |
|-----------------|--|
| | <p>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用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金会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。</p> |
| 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。 |
| 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 |
| 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 | 2,168,862,611.34 份 152,985,742.49 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 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 |
| 1. 本期已实现收益 | -150,165,719.87 | -1,843,933.84 |
| 2. 本期利润 | 612,913,321.44 | 47,792,531.60 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.2870 | 1.2309 |
| 4. 期末基金资产净值 | 4,864,244,671.49 | 341,583,825.56 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.243 | 2.233 |

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、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 | 净值增长率① | 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 | 14.38% | 1.42% | 15.68% | 1.51% | -1.30% | -0.09% |
| 过去六个月 | 12.88% | 1.13% | 13.75% | 1.19% | -0.87% | -0.06% |
| 过去一年 | 9.04% | 1.00% | 10.14% | 1.05% | -1.10% | -0.05% |
| 过去三年 | -18.79% | 1.00% | -12.65% | 1.04% | -6.14% | -0.04% |
| 过去五年 | 7.78% | 1.11% | 13.64% | 1.12% | -5.86% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 163.76% | 1.34% | 96.94% | 1.30% | 66.82% | 0.04% |

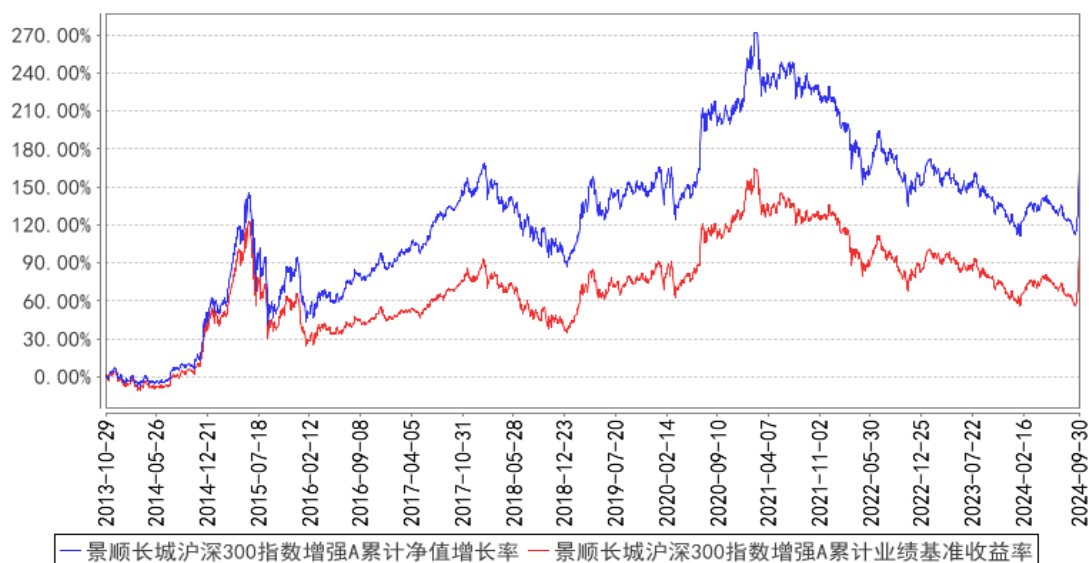
景顺长城沪深 300 指数增强 C

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 14.34% | 1.43% | 15.68% | 1.51% | -1.34% | -0.08% |
| 过去六个月 | 12.78% | 1.14% | 13.75% | 1.19% | -0.97% | -0.05% |
| 过去一年 | 8.87% | 1.00% | 10.14% | 1.05% | -1.27% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.58% | 0.95% | 3.85% | 0.99% | -4.43% | -0.04% |

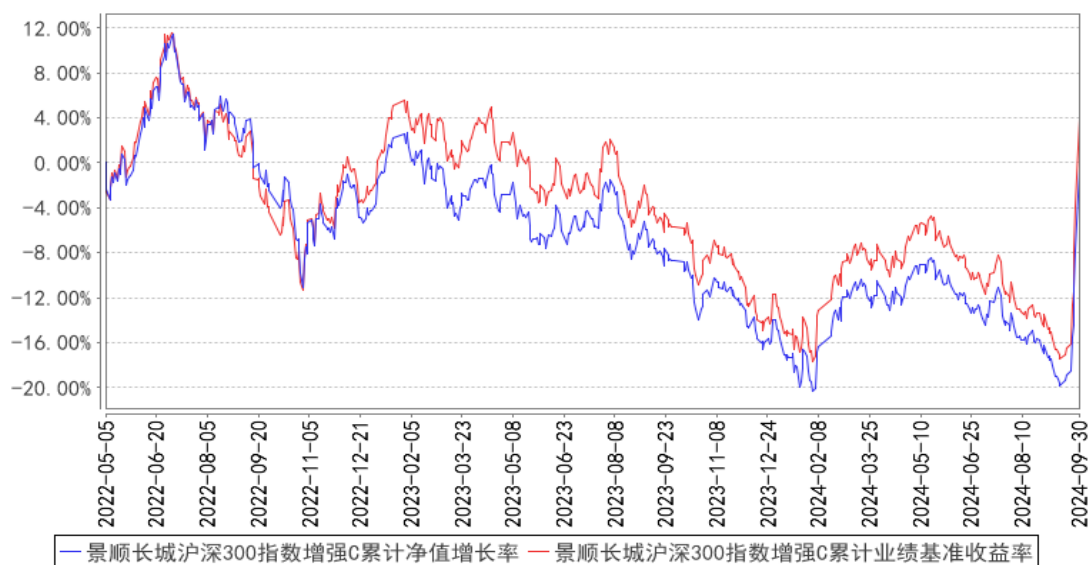
注：本基金于 2022 年 4 月 29 日增设 C 类基金份额，并于 2022 年 5 月 5 日开始对 C 类份额进行估值。

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。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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 | - | 21 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 21 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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 14 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的同日反向交易。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾 2024 年三季度，国内供需仍然在企稳复苏的过程中，出口依然保持较强韧性，9 月末在美联储降息以及国内稳增长政策的刺激下，投资者预期得到修正，市场快速反弹。从数据来看，今年前 8 个月工业增加值累计同比上升 5.8%，7-9 月国内制造业 PMI 依次为 49.4、49.1、49.8，经济呈现弱复苏状态；8 月份以美元计价的出口金额同比增长 8.7%，出口数据保持较强的韧性。8 月 PPI 同比下降 1.8%，环比下降 0.7%，生产者价格数据继续走低，企业盈利仍面临一定压力。8 月 CPI 同比上升 0.6%，环比上升 0.4%，消费者价格指数有所回升，持续性有待观察。8 月 M2 同比增长 6.3%，M1 同比下滑 7.3%，信贷需求仍然偏弱；9 月末外汇储备 3.32 万亿美元，在美联储降息背景下人民币汇率相对强势。在一系列增量政策出台之后，市场快速反弹，2024 年三季度上证指数、沪深 300 指数及创业板指数分别上涨 12.44%、16.07%、29.21%。

展望 2024 年四季度，在央行一系列稳增长的货币政策出台之后，我们需要密切观察财政政策是否会跟进，另外各项政策的实施效果也需要进一步跟踪和验证。整体而言，市场在经历了快速的估值修复之后，可能会走向分化，真正受益于政策红利的公司和行业将会迎来基本面持续改善，这将给我们的选股模型带来较大的发挥空间。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 股市场整体估值依然处于长期价值配置区间，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，而经济增长预期的持续改善也将会带来较多的投资机会。

本基金是以沪深 300 指数为基准的指数增强基金，从基准的角度来看，沪深 300 指数汇聚了国内各行业的头部企业，这些企业在经济逐步企稳复苏的过程中将会率先迎来基本面的改善。从选股模型的角度来看，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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2024 年 3 季度，景顺长城沪深 300 指数增强 A 类份额净值增长率为 14.38%，业绩比较基准收

益率为 15.68%。

2024 年 3 季度，景顺长城沪深 300 指数增强 C 类份额净值增长率为 14.34%，业绩比较基准收益率为 15.68%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 4,763,919,909.01 | 91.09 |
| | 其中：股票 | 4,763,919,909.01 | 91.09 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 130,902,947.95 | 2.50 |
| | 其中：债券 | 130,902,947.95 | 2.50 |
| | 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 | 233,943,683.02 | 4.47 |
| 8 | 其他资产 | 101,042,874.46 | 1.93 |
| 9 | 合计 | 5,229,809,414.44 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 16,968,769.00 | 0.33 |
| B | 采矿业 | 220,321,311.12 | 4.23 |
| C | 制造业 | 2,103,399,313.07 | 40.40 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 142,430,267.85 | 2.74 |
| E | 建筑业 | 54,504,715.96 | 1.05 |
| F | 批发和零售业 | 17,533,608.75 | 0.34 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 155,379,370.13 | 2.98 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 176,853,216.98 | 3.40 |
| J | 金融业 | 1,107,919,138.44 | 21.28 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| K | 房地产业 | 24,800,656.45 | 0.48 |
| L | 租赁和商务服务业 | 40,220,986.56 | 0.77 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 18,227,326.32 | 0.35 |
| 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 | 4,362,474.27 | 0.08 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 4,082,921,154.90 | 78.43 |

5.2.2 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 | 5,825,220.00 | 0.11 |
| B | 采矿业 | 23,279,538.96 | 0.45 |
| C | 制造业 | 411,489,413.71 | 7.90 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,518,932.00 | 0.37 |
| E | 建筑业 | 7,893,741.00 | 0.15 |
| F | 批发和零售业 | 11,425,062.00 | 0.22 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 19,832,805.00 | 0.38 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 48,604,357.45 | 0.93 |
| J | 金融业 | 76,606,158.48 | 1.47 |
| K | 房地产业 | 35,534,455.77 | 0.68 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,596,948.00 | 0.07 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 821,544.74 | 0.02 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,518,780.00 | 0.09 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 755,118.00 | 0.01 |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,750,379.00 | 0.03 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 9,546,300.00 | 0.18 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 680,998,754.11 | 13.08 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 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 | 134,529 | 235,156,692.00 | 4.52 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 2,693,449 | 153,769,003.41 | 2.95 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 573,253 | 144,396,698.17 | 2.77 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 1,017,600 | 77,398,656.00 | 1.49 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 3,718,539 | 71,656,246.53 | 1.38 |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,368,840 | 71,590,332.00 | 1.38 |
| 7 | 601899 | 紫金矿业 | 3,712,100 | 67,337,494.00 | 1.29 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 1,227,882 | 58,864,663.08 | 1.13 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 2,117,840 | 57,605,248.00 | 1.11 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 1,492,518 | 56,133,601.98 | 1.08 |

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 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 | 601665 | 齐鲁银行 | 4,629,282 | 23,979,680.76 | 0.46 |
| 2 | 000039 | 中集集团 | 2,163,700 | 19,451,663.00 | 0.37 |
| 3 | 300866 | 安克创新 | 201,650 | 16,910,369.00 | 0.32 |
| 4 | 601860 | 紫金银行 | 5,587,800 | 16,707,522.00 | 0.32 |
| 5 | 600737 | 中粮糖业 | 1,476,800 | 15,166,736.00 | 0.29 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 130,902,947.95 | 2.51 |
| | 其中：政策性金融债 | 130,902,947.95 | 2.51 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 130,902,947.95 | 2.51 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 240304 | 24 进出 04 | 1,300,000 | 130,902,947.95 | 2.51 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量 (买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动 (元) | 风险说明 |
|-------------------|--------|--------------|----------------|---------------|--|
| IF2410 | IF2410 | 93 | 115,026,120.00 | 26,256,960.00 | 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。 |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | 26,256,960.00 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | -5,791,959.23 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | 25,984,233.79 |

注：买入持仓以正数表示，卖出持仓以负数表示。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

齐鲁银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

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未出现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。

5.11.2 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

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 14,795,668.04 |
| 2 | 应收证券清算款 | 17,399,875.33 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 68,847,331.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 101,042,874.46 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 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 |
|---------------------------|-------------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,129,159,901.46 | 18,521,835.80 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 108,167,612.40 | 137,402,744.16 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 68,464,902.52 | 2,938,837.47 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 2,168,862,611.34 | 152,985,742.49 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

基金管理人本期末未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本期末未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息**8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录**9.1 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。

9.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

9.3 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 10 月 25 日