

景顺长城中证 1000 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：中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投证券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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
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	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
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	17
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	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24

§ 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	67
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	72
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	72
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	72
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	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	73
§ 9 基金份额持有人信息	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
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	74
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	75
§ 10 开放式基金份额变动	75
§ 11 重大事件揭示	75
11.1 基金份额持有人大会决议	75
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	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
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	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	77
§ 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	82
13.3 查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城中证 1000 指数增强	
基金主代码	015495	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 4 月 27 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	153,325,235.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015495	015496
报告期末下属分级基金的份额总额	58,382,476.41 份	94,942,758.76 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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。</p>

	<p>6、股票期权投资策略</p> <p>本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。</p> <p>8、参与融资及转融通证券出借业务的投资策略</p> <p>本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。</p> <p>9、信用衍生品投资策略</p> <p>本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95587
传真	0755-22381339	010-85130975
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 10 层
邮政编码	518048	100010
法定代表人	李进	王常青

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

座 21 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年 4 月 27 日 (基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日	
	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-1,968,356.57	-3,043,889.55	27,677,585.18	16,990,599.44
本期利润	1,168,393.74	1,183,211.53	23,335,410.98	12,082,065.69
加权平均基金份额本期利润	0.0202	0.0154	0.1610	0.0710
本期加权平均净值利润率	1.95%	1.50%	15.39%	6.79%
本期基金份额净值增长率	-0.11%	-0.51%	-1.66%	-1.93%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	-1,029,640.11	-2,301,318.12	-1,126,229.52	-1,686,149.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0176	-0.0242	-0.0165	-0.0192
期末基金资产净值	57,352,836.30	92,641,440.64	67,015,056.36	86,056,135.22
期末基金份额净值	0.9823	0.9757	0.9834	0.9807
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-1.77%	-2.43%	-1.66%	-1.93%

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

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

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

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

低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城中证 1000 指数增强 A

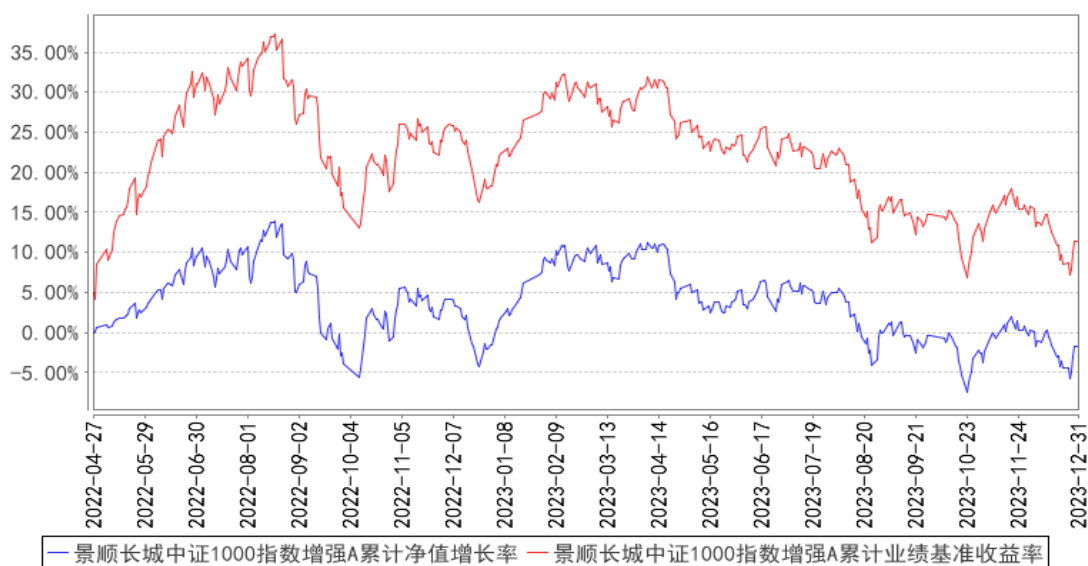
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.35%	0.96%	-2.98%	0.98%	1.63%	-0.02%
过去六个月	-7.31%	0.93%	-10.28%	0.95%	2.97%	-0.02%
过去一年	-0.11%	0.89%	-5.91%	0.90%	5.80%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-1.77%	1.00%	11.34%	1.09%	-13.11%	-0.09%

景顺长城中证 1000 指数增强 C

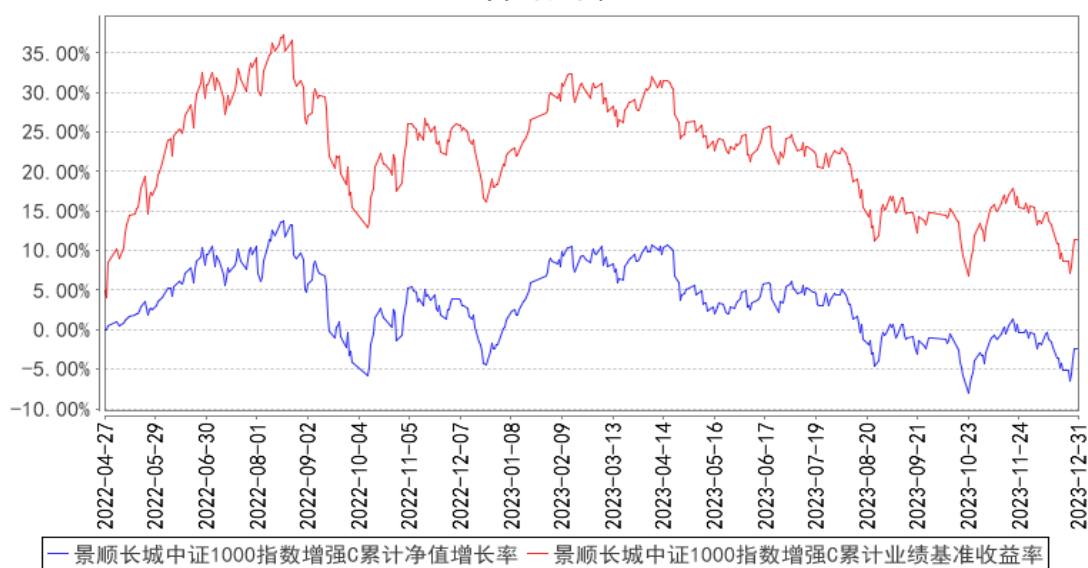
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.44%	0.96%	-2.98%	0.98%	1.54%	-0.02%
过去六个月	-7.50%	0.93%	-10.28%	0.95%	2.78%	-0.02%
过去一年	-0.51%	0.89%	-5.91%	0.90%	5.40%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-2.43%	1.00%	11.34%	1.09%	-13.77%	-0.09%

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

景顺长城中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



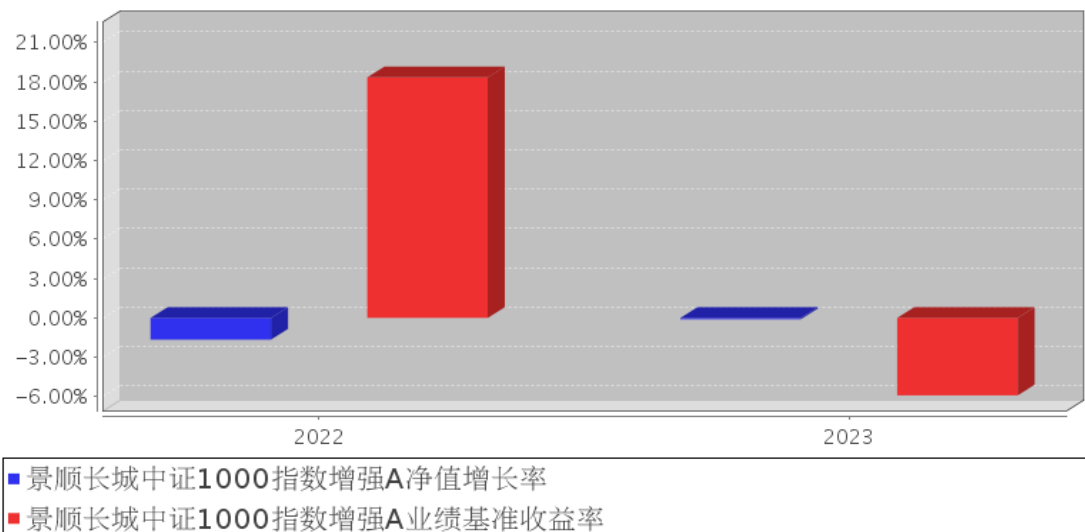
景顺长城中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



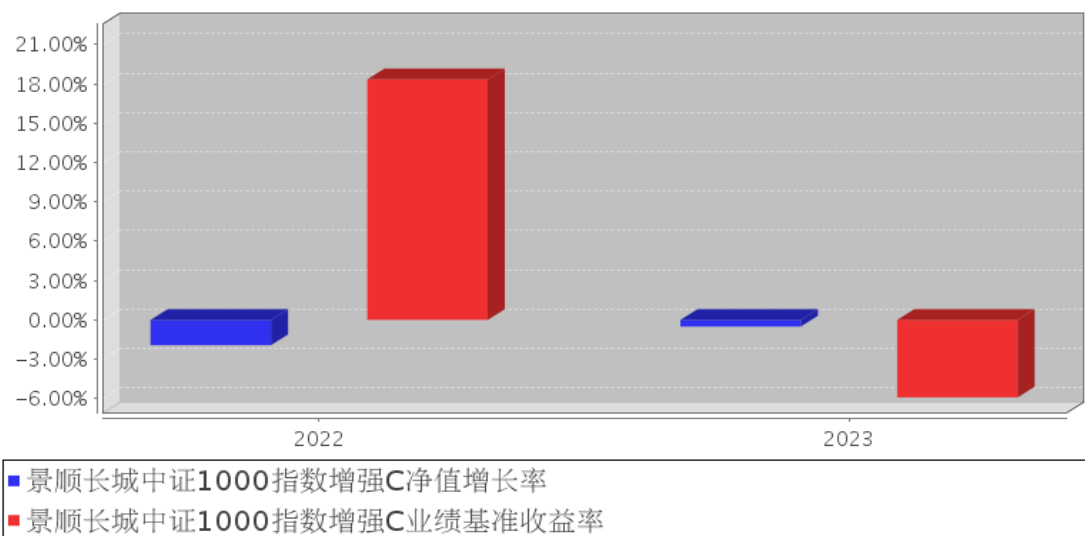
注：本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证，下同）的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2022 年 4 月 27 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

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

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



景顺长城中证1000指数增强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：2022 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间为 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自2022年4月27日（基金合同生效日）至本报告期末未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至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	2022年4月27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。
徐喻军	本基金的基金经理	2022年4月27日	-	13年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012年3月加入本公司，担任量化及ETF投资部ETF专员，自2014年4月起担任量化及指数投资部基金经理。具有13年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内,本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

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

2、交易执行的内部控制

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

3、交易指令分配的控制

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

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

4、公平交易监控

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 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，景顺长城中证 1000 指数增强 A 份额净值增长率为-0.11%，业绩比较基准收益率为-5.91%。

2023 年度，景顺长城中证 1000 指数增强 C 份额净值增长率为-0.51%，业绩比较基准收益率为-5.91%。

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。

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽

核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在

遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管本基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，

尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70015711_H74 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 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，后附的景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金 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中证 1000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他信息	<p>景顺长城中证 1000 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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内</p>

	容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	昌华	黄拥璇
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 1000 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	12,291,515.77	9,456,284.59
结算备付金		449,156.23	2,186,208.20
存出保证金		561,273.60	374,592.00
交易性金融资产	7.4.7.2	136,776,147.08	141,310,601.33
其中：股票投资		136,657,139.11	141,284,599.16
基金投资		-	-
债券投资		119,007.97	26,002.17
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		333,904.78	57,345.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		150,411,997.46	153,385,031.38
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2023 年 12 月 31 日	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		92,728.26	79,723.63
应付管理人报酬		118,811.48	133,867.17
应付托管费		17,821.71	20,080.05
应付销售服务费		28,309.03	30,116.24
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.21	0.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	160,049.83	50,052.70
负债合计		417,720.52	313,839.80
净 资 产:			
实收基金	7.4.7.10	153,325,235.17	155,883,570.10
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-3,330,958.23	-2,812,378.52
净资产合计		149,994,276.94	153,071,191.58
负债和净资产总计		150,411,997.46	153,385,031.38

注：（1）报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 153,325,235.17 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 0.9823 元，基金份额 58,382,476.41 份；本基金 C 类份额净值人民币 0.9757 元，基金份额 94,942,758.76 份。

（2）本基金财务报表上年度实际可比期间为 2022 年 4 月 27 日至 2022 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：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 4 月 27 日（基金 合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		4,428,309.30	38,650,803.37
1. 利息收入		81,247.66	390,384.03
其中：存款利息收入	7.4.7.13	81,247.66	324,022.40
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息		-	-

收入			
买入返售金融资产收入		-	66,361.63
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,106,917.27	46,419,353.06
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-4,850,504.88	44,111,667.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	242,580.99	74,538.32
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-133,076.64	-313,114.55
股利收益	7.4.7.19	1,634,083.26	2,546,261.90
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	7,363,851.39	-9,250,707.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	90,127.52	1,091,774.23
减：二、营业总支出		2,076,704.03	3,233,326.70
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,391,136.17	2,262,197.01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	208,670.40	339,329.49
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	316,532.68	490,600.04
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		364.78	0.16
8. 其他费用	7.4.7.23	160,000.00	141,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,351,605.27	35,417,476.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,351,605.27	35,417,476.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,351,605.27	35,417,476.67

7.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：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	155,883,570.10	-	-2,812,378.52	153,071,191.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	155,883,570.10	-	-2,812,378.52	153,071,191.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,558,334.93	-	-518,579.71	-3,076,914.64
(一)、综合收益总额	-	-	2,351,605.27	2,351,605.27
(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)	-2,558,334.93	-	-2,870,184.98	-5,428,519.91
其中：1. 基金申购款	73,498,745.54	-	1,476,327.56	74,975,073.10
2. 基金赎回款	-76,057,080.47	-	-4,346,512.54	-80,403,593.01
(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	153,325,235.17	-	-3,330,958.23	149,994,276.94
项目	上年度可比期间 2022 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	581,904,249.10	-	-	581,904,249.10
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-426,020,679.00	-	-2,812,378.52	-428,833,057.52
(一)、综合收益总额	-	-	35,417,476.67	35,417,476.67
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-426,020,679.00	-	-38,229,855.19	-464,250,534.19
其中：1. 基金申购款	198,952,262.10	-	14,269,518.83	213,221,780.93
2. 基金赎回款	-624,972,941.10	-	-52,499,374.02	-677,472,315.12
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(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	155,883,570.10	-	-2,812,378.52	153,071,191.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

基金管理人负责人

吴建军

主管会计工作负责人

邵媛媛

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]478 号文《关于准予景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2022 年 4 月 27 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 581,796,523.71 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 107,725.39 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 581,904,249.10 元，折合 581,904,249.10 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

根据《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与转融通证券出借及融资业务。

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

照法律法规或监管机构的规定执行。

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

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 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	9,854,145.72	8,303,651.45	8,301,974.35
等于：本金	9,852,540.58			
加：应计利息	1,605.14		1,677.10	
减：坏账准备	-		-	
定期存款	-		-	
等于：本金	-		-	
加：应计利息	-		-	
减：坏账准备	-		-	
其中：存款期限 1 个月以 内	-		-	
存款期限 1 个月（含） -3 个月	-		-	
其他存款	2,437,370.05	1,152,633.14		
等于：本金	2,437,063.94	1,152,506.03		
加：应计利息	306.11	127.11		
减：坏账准备	-	-		
合计	12,291,515.77	9,456,284.59		

注：其他存款为存放在证券经纪商经纪专用证券账户的证券交易结算资金。

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	138,437,715.67	-	136,657,139.11	-1,780,576.56	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	119,000.00	7.97	119,007.97	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	119,000.00	7.97	119,007.97	0.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	138,556,715.67	7.97	136,776,147.08	-1,780,576.56	

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	150,377,267.11	-	141,284,599.16	-9,092,667.95
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	26,000.00	26,002.17	0.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	26,000.00	26,002.17	0.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	150,403,267.11	2.17	141,310,601.33	-9,092,667.95

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 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	4,783,560.00	-	-	-
其中：股指期 货投资	4,783,560.00	-	-	-
其他衍生 工具	-	-	-	-
合计	4,783,560.00	-	-	-
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	2,655,320.00	-	-	-
其中	2,655,320.00	-	-	-

中：股指期货投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,655,320.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2403	中证1000股指期货2403	4.00	4,677,280.00	-106,280.00
合计				-106,280.00
减：可抵销期货暂收款				-106,280.00
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	49.83	52.70
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	50,000.00
合计	160,049.83	50,052.70

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城中证 1000 指数增强 A

项目	本期 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	68,141,285.88	68,141,285.88
本期申购	27,374,077.90	27,374,077.90
本期赎回（以“-”号填列）	-37,132,887.37	-37,132,887.37
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	58,382,476.41	58,382,476.41
-----	---------------	---------------

景顺长城中证 1000 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	87,742,284.22	87,742,284.22
本期申购	46,124,667.64	46,124,667.64
本期赎回 (以“-”号填列)	-38,924,193.10	-38,924,193.10
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	94,942,758.76	94,942,758.76

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

景顺长城中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,836,545.18	-6,962,774.70	-1,126,229.52
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	5,836,545.18	-6,962,774.70	-1,126,229.52
本期利润	-1,968,356.57	3,136,750.31	1,168,393.74
本期基金份额交易产生的变动数	-1,280,762.97	208,958.64	-1,071,804.33
其中：基金申购款	2,764,434.15	-1,683,565.40	1,080,868.75
基金赎回款	-4,045,197.12	1,892,524.04	-2,152,673.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,587,425.64	-3,617,065.75	-1,029,640.11

景顺长城中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,268,711.44	-8,954,860.44	-1,686,149.00
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,268,711.44	-8,954,860.44	-1,686,149.00
本期利润	-3,043,889.55	4,227,101.08	1,183,211.53
本期基金份额交易产	-644,660.17	-1,153,720.48	-1,798,380.65

生的变动数			
其中：基金申购款	3,411,886.49	-3,016,427.68	395,458.81
基金赎回款	-4,056,546.66	1,862,707.20	-2,193,839.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,580,161.72	-5,881,479.84	-2,301,318.12

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	43,539.84	147,868.71
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	9,796.24	144,198.94
结算备付金利息收入	27,911.58	31,954.75
其他	-	-
合计	81,247.66	324,022.40

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,850,504.88	44,111,667.39
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-4,850,504.88	44,111,667.39

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,167,619,510.81	1,826,223,768.54
减：卖出股票成本	1,170,113,807.70	1,778,032,362.11

总额		
减：交易费用	2,356,207.99	4,079,739.04
买卖股票差价收入	-4,850,504.88	44,111,667.39

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	172.05	57.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	242,408.94	74,481.28
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	242,580.99	74,538.32

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,307,532.62	269,244.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,064,900.00	194,700.00
减：应计利息总额	171.32	56.20
减：交易费用	52.36	7.43
买卖债券差价收入	242,408.94	74,481.28

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

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**

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年4月27日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
股指期货投资收益	-133,076.64	-313,114.55

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4月27日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利 收益	1,634,083.26	2,546,261.90
其中：证券出借权益补 偿收入	-	-
基金投资产生的股利 收益	-	-
合计	1,634,083.26	2,546,261.90

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年4月27日（基金合 同生效日）至2022年12月31 日
1. 交易性金融资产	7,312,091.39	-9,092,667.95
股票投资	7,312,091.39	-9,092,667.95
债券投资	-	-

资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	51,760.00	-158,040.00
权证投资	-	-
期货投资	51,760.00	-158,040.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	7,363,851.39	-9,250,707.95

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	86,323.95	1,089,520.80
基金转换费收入	3,803.57	2,253.43
合计	90,127.52	1,091,774.23

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	90,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	-	1,200.00
合计	160,000.00	141,200.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金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
中信建投证券股份有限公司（“中信建投证券”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、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4月27日（基金合同生效日）至 2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
中信建投证券	2,321,891,775.62	100.00	3,746,667,923.11	100.00

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（%）
中信建投证券	1,199,706.80	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信建投证券	1,939,173.15	100.00	-	-

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,391,136.17	2,262,197.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	355,528.56	703,704.06
应支付基金管理人的净管理费	1,035,607.61	1,558,492.95

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	208,670.40	339,329.49

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

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		
	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	193,231.95	193,231.95
中信建投证券	-	73,906.82	73,906.82
长城证券	-	11.88	11.88
合计	-	267,150.65	267,150.65
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		

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

注：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 0.40% 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×0.40%/当年天数。

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固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期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		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		2022 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信建投证券-证券资金账户	2,437,370.05	9,796.24	1,152,633.14	144,198.94

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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	126	1,518.30	2,509.92	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	44	1,804.00	1,943.04	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	25.82	31.80	123	3,175.86	3,911.40	-
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股流通受限	19.99	19.35	249	4,977.51	4,818.15	-
301329	信音电子	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股流通受限	21.00	22.23	200	4,200.00	4,446.00	-
301348	蓝箭电	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股流通受限	18.08	44.57	259	4,682.72	11,543.63	-

	子									
301381	赛 维 时 代	2023 年7月 5日	6个月	新股 流通 受限	20.45	29.69	277	5,664.65	8,224.13	-
301393	昊 帆 生 物	2023 年7月 5日	6个月	新股 流通 受限	67.68	59.37	67	4,534.56	3,977.79	-
301413	安 培 龙	2023 年12 月11 日	6个月	新股 流通 受限	33.25	58.19	104	3,458.00	6,051.76	-
301421	波 长 光 电	2023 年8月 16日	6个月	新股 流通 受限	29.38	59.37	147	4,318.86	8,727.39	-
301456	盘 古 智 能	2023 年7月 6日	6个月	新股 流通 受限	37.96	30.39	122	4,631.12	3,707.58	-
301459	丰 茂 股 份	2023 年12 月6日	6个月	新股 流通 受限	31.90	39.84	109	3,477.10	4,342.56	-
301486	致 尚 科 技	2023 年6月 30日	6个月	新股 流通 受限	57.66	47.25	97	5,593.02	4,583.25	-
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	115	4,598.85	4,463.15	-
301499	维 科 精 密	2023 年7月 13日	6个月	新股 流通 受限	19.50	28.93	203	3,958.50	5,872.79	-
301505	苏 州 规 划	2023 年7月 12日	6个月	新股 流通 受限	26.35	35.81	136	3,583.60	4,870.16	-

301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	318	3,180.00	5,040.30	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股流通受限	6.87	15.51	405	2,782.35	6,281.55	-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股流通受限	25.75	23.01	175	4,506.25	4,026.75	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	20.93	20.21	195	4,081.35	3,940.95	-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股流通受限	99.57	81.46	41	4,082.37	3,339.86	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股流通受限	2.66	4.45	2,370	6,304.20	10,546.50	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股流通受限	29.50	33.16	135	3,982.50	4,476.60	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股流通受限	66.80	58.99	42	2,805.60	2,477.58	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	84	3,155.04	3,659.88	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	154	3,523.52	4,995.76	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	395	3,515.50	8,745.30	-
301578	辰	2023	6个月	新股	48.94	68.32	76	3,719.44	5,192.32	-

	奕智能	2023年12月21日		流通受限						
601083	锦江航运	2023年11月28日	6个月	新股流通受限	11.25	11.07	234	2,632.50	2,590.38	-
601096	宏盛华源	2023年12月15日	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	1,104	1,876.80	4,482.24	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	79	1,327.20	2,464.01	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	55	1,270.50	1,282.05	-
603119	浙江荣泰	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	15.32	23.87	78	1,194.96	1,861.86	-
603231	索宝蛋白	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	61	1,298.69	1,313.33	-
603270	金帝股份	2023年8月25日	6个月	新股流通受限	21.77	29.58	70	1,523.90	2,070.60	-
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	49.97	39.70	43	2,148.71	1,707.10	-
603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	65	1,241.50	2,258.75	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	495	4,885.65	6,311.25	-
688549	中	2023	6个月	新股	5.18	8.09	773	4,004.14	6,253.57	-

	巨芯	年8月30日		流通受限						
688592	司南导航	2023年8月7日	6个月	新股流通受限	50.50	50.53	130	6,565.00	6,568.90	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	74.14	73	4,015.00	5,412.22	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	75	3,546.75	2,847.75	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股流通受限	46.80	36.07	85	3,978.00	3,065.95	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	39.90	46.05	97	3,870.30	4,466.85	-
688671	碧兴物联	2023年8月2日	6个月	新股流通受限	36.12	34.30	140	5,056.80	4,802.00	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	80	3,266.40	3,472.80	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	86	3,668.76	4,143.48	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	113	3,167.39	5,631.92	-

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
113069	博23转	2023年12月25日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	960	96,000.00	96,006.31	-

	债	日								
127100	神 码 转 债	2023 年 12 月 21 日	1 个月 内(含)	新债 未上 市	100.00	100.01	230	23,000.00	23,001.66	-

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 0.08%（上年度末：0.02%）。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	12,291,515.77	-	-	-	-	-	12,291,515.77
结算备付金	449,156.23	-	-	-	-	-	449,156.23

存出保证金	-	-	-	-	-	561,273.60	561,273.60
交易性金融资产	-	-	-96,006.31	23,001.66	136,657,139.11	136,776,147.08	
应收申购款	-	-	-	-	333,904.78	333,904.78	
资产总计	12,740,672.00	-	-96,006.31	23,001.66	137,552,317.49	150,411,997.46	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	92,728.26	92,728.26	
应付管理人报酬	-	-	-	-	118,811.48	118,811.48	
应付托管费	-	-	-	-	17,821.71	17,821.71	
应付销售服务费	-	-	-	-	28,309.03	28,309.03	
应交税费	-	-	-	-	0.21	0.21	
其他负债	-	-	-	-	160,049.83	160,049.83	
负债总计	-	-	-	-	417,720.52	417,720.52	
利率敏感度缺口	12,740,672.00	-	-96,006.31	23,001.66	-	-	
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	9,456,284.59	-	-	-	-	-	9,456,284.59
结算备付金	2,186,208.20	-	-	-	-	-	2,186,208.20
存出保证金	-	-	-	-	-	374,592.00	374,592.00
交易性金融资产	-	-	-	-26,002.17	141,284,599.16	141,310,601.33	
应收申购款	-	-	-	-	57,345.26	57,345.26	
资产总计	11,642,492.79	-	-	-26,002.17	141,716,536.42	153,385,031.38	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	79,723.63	79,723.63	
应付管理人报酬	-	-	-	-	133,867.17	133,867.17	
应付托管费	-	-	-	-	20,080.05	20,080.05	
应付销售服务费	-	-	-	-	30,116.24	30,116.24	
应交税费	-	-	-	-	0.01	0.01	
其他负债	-	-	-	-	50,052.70	50,052.70	
负债总计	-	-	-	-	313,839.80	313,839.80	
利率敏感度缺口	11,642,492.79	-	-	-26,002.17	-	-	

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.08%（上年度末：0.02%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

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	136,657,139.11	91.11	141,284,599.16	92.30
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	136,657,139.11	91.11	141,284,599.16	92.30

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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%	6,906,327.25	4,290,383.58

	沪深 300 指数下降 5%	-6,906,327.25	-4,290,383.58
--	-------------------	---------------	---------------

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	136,401,903.73	140,419,001.35
第二层次	119,007.97	128,941.77
第三层次	255,235.38	762,658.21
合计	136,776,147.08	141,310,601.33

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	-	762,658.21	762,658.21

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	174,966.16	174,966.16
转出第三层次	-	762,658.21	762,658.21
当期利得或损失总额	-	80,269.22	80,269.22
其中：计入损益的利得或损失	-	80,269.22	80,269.22
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	255,235.38	255,235.38
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	-	80,269.22	80,269.22
项目	上年度可比期间 2022年4月27日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	693,400.40	693,400.40
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	69,257.81	69,257.81
其中：计入损益的利得或损失	-	69,257.81	69,257.81
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	762,658.21	762,658.21
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	69,257.81	69,257.81

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

单位：人民币元

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

限售股票	255,235.38	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962-2.1775	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	762,658.21	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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	136,657,139.11	90.86
	其中：股票	136,657,139.11	90.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	119,007.97	0.08
	其中：债券	119,007.97	0.08
	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	12,740,672.00	8.47
8	其他各项资产	895,178.38	0.60
9	合计	150,411,997.46	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,515,494.00	1.01

B	采矿业	2,985,331.00	1.99
C	制造业	90,536,572.51	60.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,884,341.00	1.26
E	建筑业	3,857,741.00	2.57
F	批发和零售业	5,384,394.13	3.59
G	交通运输、仓储和邮政业	2,499,465.00	1.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,042,416.75	10.03
J	金融业	1,374,988.00	0.92
K	房地产业	3,748,478.00	2.50
L	租赁和商务服务业	1,239,589.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	1,982,284.47	1.32
N	水利、环境和公共设施管理业	1,448,439.00	0.97
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	501,033.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	2,400,652.00	1.60
S	综合	-	-
	合计	136,401,218.86	90.94

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	233,649.68	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,590.38	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,610.33	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,258.75	0.00
M	科学研究和技术服务业	4,870.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	3,940.95	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	255,920.25	0.17

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	688235	百济神州	8,300	1,154,032.00	0.77
2	300398	飞凯材料	65,700	1,035,432.00	0.69
3	600100	同方股份	138,800	1,020,180.00	0.68
4	600623	华谊集团	153,300	987,252.00	0.66
5	600312	平高电气	73,900	937,791.00	0.63
6	000813	德展健康	284,400	929,988.00	0.62
7	300458	全志科技	39,300	891,717.00	0.59
8	002215	诺普信	105,800	873,908.00	0.58
9	600480	凌云股份	94,500	860,895.00	0.57
10	300476	胜宏科技	45,500	839,475.00	0.56
11	603005	晶方科技	38,000	834,480.00	0.56
12	688037	芯源微	6,119	817,559.59	0.55
13	000928	中钢国际	139,100	810,953.00	0.54
14	300170	汉得信息	94,100	781,971.00	0.52
15	300455	航天智装	65,400	780,876.00	0.52
16	600266	城建发展	154,100	745,844.00	0.50
17	603306	华懋科技	27,500	745,525.00	0.50
18	688185	康希诺	10,000	745,200.00	0.50
19	600201	生物股份	68,700	739,899.00	0.49
20	601137	博威合金	46,800	726,804.00	0.48
21	000969	安泰科技	80,700	725,493.00	0.48
22	002041	登海种业	53,700	710,451.00	0.47
23	300303	聚飞光电	118,200	700,926.00	0.47
24	002488	金固股份	97,300	698,614.00	0.47
25	603229	奥翔药业	52,800	697,488.00	0.47
26	300123	亚光科技	94,800	694,884.00	0.46
27	600363	联创光电	20,400	693,600.00	0.46
28	300379	东方通	37,600	687,328.00	0.46
29	603983	丸美股份	27,000	682,290.00	0.45
30	002436	兴森科技	45,100	664,323.00	0.44
31	300101	振芯科技	27,500	627,825.00	0.42
32	600123	兰花科创	56,700	625,968.00	0.42
33	300323	华灿光电	85,000	622,200.00	0.41

34	300663	科蓝软件	43,900	620,746.00	0.41
35	003012	东鹏控股	75,200	620,400.00	0.41
36	301080	百普赛斯	10,300	607,082.00	0.40
37	600872	中炬高新	21,600	606,960.00	0.40
38	603567	珍宝岛	49,700	604,352.00	0.40
39	688139	海尔生物	14,900	603,748.00	0.40
40	601918	新集能源	114,000	600,780.00	0.40
41	688700	东威科技	9,800	597,996.00	0.40
42	600531	豫光金铅	98,200	594,110.00	0.40
43	600456	宝钛股份	18,900	593,271.00	0.40
44	002130	沃尔核材	78,300	591,165.00	0.39
45	002727	一心堂	25,500	590,580.00	0.39
46	300188	国投智能	36,800	589,536.00	0.39
47	600572	康恩贝	114,800	579,740.00	0.39
48	002428	云南锗业	46,900	578,277.00	0.39
49	300366	创意信息	43,900	575,968.00	0.38
50	002276	万马股份	56,300	575,386.00	0.38
51	600612	老凤祥	8,300	572,700.00	0.38
52	600810	神马股份	76,400	568,416.00	0.38
53	000415	渤海租赁	265,100	567,314.00	0.38
54	688518	联赢激光	27,500	563,200.00	0.38
55	600797	浙大网新	85,700	562,192.00	0.37
56	002446	盛路通信	67,400	559,420.00	0.37
57	603033	三维股份	35,200	556,512.00	0.37
58	600667	太极实业	79,100	556,073.00	0.37
59	301155	海力风电	9,400	556,010.00	0.37
60	603128	华贸物流	75,100	554,989.00	0.37
61	002467	二六三	119,100	552,624.00	0.37
62	000829	天音控股	57,600	549,504.00	0.37
63	300236	上海新阳	15,600	549,432.00	0.37
64	688686	奥普特	4,890	547,680.00	0.37
65	600206	有研新材	44,000	545,160.00	0.36
66	688800	瑞可达	13,500	542,430.00	0.36
67	600295	鄂尔多斯	55,900	542,230.00	0.36
68	600993	马应龙	22,400	541,632.00	0.36
69	002498	汉缆股份	135,400	541,600.00	0.36
70	002402	和而泰	37,900	541,591.00	0.36
71	002212	天融信	55,000	537,900.00	0.36
72	688339	亿华通	11,700	535,158.00	0.36
73	603636	南威软件	41,600	533,312.00	0.36
74	688733	壹石通	18,200	532,714.00	0.36
75	000090	天健集团	115,700	532,220.00	0.35
76	603368	柳药集团	28,100	531,652.00	0.35

77	300180	华峰超纤	119,900	529,958.00	0.35
78	000006	深振业 A	115,400	529,686.00	0.35
79	603439	贵州三力	28,000	528,640.00	0.35
80	600740	山西焦化	104,500	526,680.00	0.35
81	688048	长光华芯	8,400	526,428.00	0.35
82	300348	长亮科技	51,000	525,810.00	0.35
83	600360	华微电子	72,700	525,621.00	0.35
84	300224	正海磁材	44,800	525,056.00	0.35
85	603938	三孚股份	29,200	525,016.00	0.35
86	301071	力量钻石	16,200	523,260.00	0.35
87	002335	科华数据	18,900	523,152.00	0.35
88	000543	皖能电力	83,500	522,710.00	0.35
89	002396	星网锐捷	28,900	522,223.00	0.35
90	000600	建投能源	104,200	522,042.00	0.35
91	300134	大富科技	50,500	521,160.00	0.35
92	002194	武汉凡谷	52,700	519,622.00	0.35
93	300203	聚光科技	32,700	518,295.00	0.35
94	600986	浙文互联	94,700	517,062.00	0.34
95	603297	永新光学	5,200	516,620.00	0.34
96	600446	金证股份	44,600	516,022.00	0.34
97	002741	光华科技	34,700	515,989.00	0.34
98	600037	歌华有线	66,700	515,591.00	0.34
99	300527	中船应急	67,500	514,350.00	0.34
100	600284	浦东建设	81,500	513,450.00	0.34
101	301217	铜冠铜箔	43,200	512,352.00	0.34
102	688268	华特气体	7,600	512,088.00	0.34
103	601609	金田股份	75,600	511,812.00	0.34
104	000555	神州信息	45,300	511,437.00	0.34
105	688238	和元生物	56,853	511,108.47	0.34
106	600475	华光环能	49,100	510,640.00	0.34
107	002516	旷达科技	103,200	508,776.00	0.34
108	002583	海能达	85,500	508,725.00	0.34
109	000029	深深房 A	43,200	508,032.00	0.34
110	301087	可孚医疗	13,400	507,860.00	0.34
111	002534	西子洁能	40,600	507,094.00	0.34
112	300618	寒锐钴业	17,900	506,391.00	0.34
113	688326	经纬恒润	4,347	504,469.35	0.34
114	002706	良信股份	57,100	504,193.00	0.34
115	002697	红旗连锁	100,900	502,482.00	0.34
116	603025	大豪科技	37,860	502,023.60	0.33
117	603588	高能环境	76,700	501,618.00	0.33
118	301060	兰卫医学	37,700	501,033.00	0.33
119	600604	市北高新	108,200	500,966.00	0.33

120	603920	世运电路	27,400	500,872.00	0.33
121	002023	海特高新	55,000	500,500.00	0.33
121	688166	博瑞医药	14,300	500,500.00	0.33
122	603881	数据港	25,240	500,256.80	0.33
123	603027	千禾味业	30,900	499,653.00	0.33
124	002320	海峡股份	85,600	499,048.00	0.33
125	603328	依顿电子	61,100	497,965.00	0.33
126	002249	大洋电机	100,100	497,497.00	0.33
127	002456	欧菲光	57,000	496,470.00	0.33
128	000062	深圳华强	44,000	495,880.00	0.33
129	600586	金晶科技	74,200	495,656.00	0.33
130	603132	金徽股份	36,200	495,216.00	0.33
131	300183	东软载波	32,800	494,952.00	0.33
132	300377	赢时胜	63,700	494,312.00	0.33
133	001696	宗申动力	74,500	493,935.00	0.33
134	601890	亚星锚链	49,800	493,020.00	0.33
135	600320	振华重工	148,400	492,688.00	0.33
136	603919	金徽酒	20,000	492,400.00	0.33
137	605365	立达信	26,300	489,443.00	0.33
138	688131	皓元医药	9,400	489,364.00	0.33
139	301165	锐捷网络	12,900	488,781.00	0.33
140	601019	山东出版	52,000	487,760.00	0.33
141	000690	宝新能源	110,100	487,743.00	0.33
142	002773	康弘药业	26,400	486,816.00	0.32
143	002158	汉钟精机	21,800	485,268.00	0.32
144	603197	保隆科技	8,600	485,040.00	0.32
145	688128	中国电研	23,600	484,272.00	0.32
146	600502	安徽建工	104,100	484,065.00	0.32
147	002283	天润工业	82,700	483,795.00	0.32
148	000951	中国重汽	36,100	482,296.00	0.32
149	300639	凯普生物	51,600	481,944.00	0.32
150	603505	金石资源	17,700	480,555.00	0.32
151	000901	航天科技	51,400	479,048.00	0.32
152	000990	诚志股份	58,200	477,822.00	0.32
153	300579	数字认证	18,400	475,824.00	0.32
154	300741	华宝股份	22,200	475,302.00	0.32
155	600618	氯碱化工	52,200	475,020.00	0.32
156	605338	巴比食品	22,000	472,560.00	0.32
157	688298	东方生物	13,200	472,032.00	0.31
158	600649	城投控股	127,200	470,640.00	0.31
159	600861	北京人力	25,100	470,374.00	0.31
160	600391	航发科技	24,600	470,352.00	0.31
161	601068	中铝国际	99,800	461,076.00	0.31

162	601921	浙版传媒	60,300	460,692.00	0.31
163	603530	神马电力	22,100	458,354.00	0.31
164	600389	江山股份	26,200	455,880.00	0.30
165	603801	志邦家居	27,100	454,467.00	0.30
166	688027	国盾量子	3,500	447,650.00	0.30
167	688356	键凯科技	4,200	446,880.00	0.30
168	603013	亚普股份	25,800	445,824.00	0.30
169	000597	东北制药	82,900	443,515.00	0.30
170	002351	漫步者	24,900	439,983.00	0.29
171	601811	新华文轩	32,200	439,852.00	0.29
172	300087	荃银高科	52,100	436,598.00	0.29
173	002649	博彦科技	35,500	435,585.00	0.29
174	603713	密尔克卫	8,000	425,680.00	0.28
175	002036	联创电子	41,500	423,715.00	0.28
176	301286	侨源股份	14,500	421,370.00	0.28
177	000035	中国天楹	84,900	419,406.00	0.28
178	000034	神州数码	14,000	418,740.00	0.28
179	002901	大博医疗	10,200	414,018.00	0.28
180	600225	卓朗科技	108,900	413,820.00	0.28
181	000030	富奥股份	76,600	409,044.00	0.27
182	000019	深粮控股	54,200	408,668.00	0.27
183	000795	英洛华	65,200	406,196.00	0.27
184	300036	超图软件	19,300	403,370.00	0.27
185	300463	迈克生物	26,600	400,862.00	0.27
186	601677	明泰铝业	35,300	400,302.00	0.27
187	000059	华锦股份	72,900	400,221.00	0.27
188	603093	南华期货	32,500	390,000.00	0.26
189	603123	翠微股份	36,600	389,790.00	0.26
190	601126	四方股份	27,500	389,400.00	0.26
191	002895	川恒股份	20,400	387,600.00	0.26
192	688198	佰仁医疗	3,100	386,043.00	0.26
193	688321	微芯生物	17,500	384,125.00	0.26
194	000921	海信家电	18,200	371,280.00	0.25
195	002124	天邦食品	101,500	368,445.00	0.25
196	300027	华谊兄弟	136,300	365,284.00	0.24
197	603187	海容冷链	24,000	363,840.00	0.24
198	600458	时代新材	39,000	359,190.00	0.24
199	002978	安宁股份	11,200	354,592.00	0.24
200	301207	华兰疫苗	12,700	353,060.00	0.24
201	300382	斯莱克	35,300	350,529.00	0.23
202	301219	腾远钴业	8,800	346,456.00	0.23
203	688158	优刻得	21,000	345,450.00	0.23
204	600710	苏美达	48,700	345,283.00	0.23

205	002051	中工国际	42,500	345,100.00	0.23
206	600216	浙江医药	32,100	344,433.00	0.23
207	000058	深赛格	47,900	343,443.00	0.23
208	002190	成飞集成	18,100	343,357.00	0.23
209	600578	京能电力	115,400	341,584.00	0.23
210	600643	爱建集团	66,600	339,660.00	0.23
211	002390	信邦制药	76,000	337,440.00	0.22
212	600787	中储股份	65,600	334,560.00	0.22
213	600158	中体产业	42,300	329,094.00	0.22
214	301078	孩子王	40,000	328,400.00	0.22
215	300319	麦捷科技	33,500	322,940.00	0.22
216	600007	中国国贸	16,500	319,770.00	0.21
217	300113	顺网科技	22,700	317,800.00	0.21
218	002646	天佑德酒	22,900	311,669.00	0.21
219	000811	冰轮环境	22,800	309,396.00	0.21
220	601333	广深铁路	118,200	306,138.00	0.20
221	688439	振华风光	3,400	302,974.00	0.20
222	002287	奇正藏药	13,400	301,366.00	0.20
223	000818	航锦科技	9,600	301,248.00	0.20
224	300119	瑞普生物	18,300	299,937.00	0.20
225	688023	安恒信息	2,700	299,403.00	0.20
226	601222	林洋能源	46,400	296,496.00	0.20
227	300271	华宇软件	35,300	289,107.00	0.19
228	600602	云赛智联	24,500	283,465.00	0.19
229	301039	中集车辆	30,200	283,276.00	0.19
230	002928	华夏航空	39,400	281,316.00	0.19
231	300079	数码视讯	49,100	279,379.00	0.19
232	300054	鼎龙股份	11,500	278,300.00	0.19
233	300973	立高食品	5,700	276,735.00	0.18
234	002085	万丰奥威	55,900	276,146.00	0.18
235	600595	中孚实业	79,200	275,616.00	0.18
236	002929	润建股份	6,600	275,418.00	0.18
237	688556	高测股份	7,000	272,930.00	0.18
238	300432	富临精工	25,800	270,900.00	0.18
239	002237	恒邦股份	24,800	267,344.00	0.18
240	600771	广誉远	9,900	267,201.00	0.18
241	600587	新华医疗	10,300	265,637.00	0.18
242	688711	宏微科技	6,400	265,536.00	0.18
243	688018	乐鑫科技	2,521	259,536.95	0.17
244	601028	玉龙股份	23,400	250,614.00	0.17
245	002612	朗姿股份	13,000	249,990.00	0.17
246	300747	锐科激光	10,500	247,065.00	0.16
247	601101	昊华能源	38,900	245,848.00	0.16

248	688066	航天宏图	5,600	236,544.00	0.16
249	603599	广信股份	16,200	234,900.00	0.16
250	603063	禾望电气	9,300	232,500.00	0.16
251	688017	绿的谐波	1,500	230,250.00	0.15
252	688083	中望软件	2,300	228,942.00	0.15
253	002585	双星新材	27,100	219,781.00	0.15
254	300887	谱尼测试	18,400	217,304.00	0.14
255	002961	瑞达期货	14,500	216,050.00	0.14
256	000650	仁和药业	32,200	213,486.00	0.14
257	603236	移远通信	3,900	209,625.00	0.14
258	601528	瑞丰银行	42,300	209,385.00	0.14
259	600691	阳煤化工	64,800	208,008.00	0.14
260	688019	安集科技	1,300	207,688.00	0.14
261	300065	海兰信	20,400	207,468.00	0.14
262	605168	三人行	3,200	202,752.00	0.14
263	688110	东芯股份	5,859	201,725.37	0.13
264	688403	汇成股份	18,700	197,285.00	0.13
265	300856	科思股份	3,100	192,913.00	0.13
266	300627	华测导航	6,200	192,324.00	0.13
267	600850	电科数字	8,700	189,225.00	0.13
268	000860	顺鑫农业	8,800	187,352.00	0.12
269	301316	慧博云通	7,900	183,596.00	0.12
270	301090	华润材料	16,900	183,534.00	0.12
271	601801	皖新传媒	26,100	181,395.00	0.12
272	300820	英杰电气	3,150	180,432.00	0.12
273	002745	木林森	20,800	180,128.00	0.12
274	300409	道氏技术	15,900	177,126.00	0.12
275	002261	拓维信息	11,500	172,960.00	0.12
276	603010	万盛股份	15,600	168,324.00	0.11
277	688798	艾为电子	2,400	165,672.00	0.11
278	600556	天下秀	27,200	160,752.00	0.11
279	603323	苏农银行	38,200	158,912.00	0.11
280	603666	亿嘉和	4,900	153,811.00	0.10
281	300811	铂科新材	2,900	153,323.00	0.10
282	300457	赢合科技	8,200	151,208.00	0.10
283	300346	南大光电	5,300	146,333.00	0.10
284	300674	宇信科技	8,900	144,892.00	0.10
285	600645	中源协和	7,100	143,917.00	0.10
286	600508	上海能源	10,200	141,372.00	0.09
287	002163	海南发展	15,400	139,832.00	0.09
288	688559	海目星	3,900	139,230.00	0.09
289	688289	圣湘生物	7,000	136,850.00	0.09
290	300860	锋尚文化	2,500	136,575.00	0.09

291	300666	江丰电子	2,300	134,734.00	0.09
292	300593	新雷能	9,000	132,930.00	0.09
293	300567	精测电子	1,500	131,430.00	0.09
294	000718	苏宁环球	50,400	130,536.00	0.09
295	300737	科顺股份	21,100	129,554.00	0.09
296	601369	陕鼓动力	16,200	129,276.00	0.09
297	601606	长城军工	10,500	127,890.00	0.09
298	603300	华铁应急	19,700	126,080.00	0.08
299	300451	创业慧康	19,000	124,450.00	0.08
300	688033	天宜上佳	7,300	123,370.00	0.08
301	688016	心脉医疗	600	116,778.00	0.08
302	605589	圣泉集团	5,200	116,376.00	0.08
303	300613	富瀚微	2,700	114,588.00	0.08
304	603208	江山欧派	3,800	112,822.00	0.08
305	601952	苏垦农发	10,900	111,616.00	0.07
306	002079	苏州固锴	9,400	106,032.00	0.07
307	603032	德新科技	5,100	103,530.00	0.07
308	688327	云从科技	6,100	102,846.00	0.07
309	003009	中天火箭	2,200	101,442.00	0.07
310	000828	东莞控股	9,100	97,734.00	0.07
311	300630	普利制药	4,300	97,266.00	0.06
312	301095	广立微	1,300	97,149.00	0.06
313	300260	新莱应材	3,120	94,941.60	0.06
314	600641	万业企业	5,000	86,300.00	0.06
315	600195	中牧股份	7,200	85,392.00	0.06
316	002747	埃斯顿	4,000	74,360.00	0.05
317	002206	海利得	14,800	74,296.00	0.05
318	300768	迪普科技	5,000	73,900.00	0.05
319	603105	芯能科技	6,300	72,954.00	0.05
320	600750	江中药业	3,400	70,992.00	0.05
321	300327	中颖电子	3,000	68,400.00	0.05
322	300226	上海钢联	2,400	68,376.00	0.05
323	002020	京新药业	5,100	64,872.00	0.04
324	600718	东软集团	6,900	63,825.00	0.04
325	300130	新国都	2,600	62,920.00	0.04
326	002993	奥海科技	1,600	60,960.00	0.04
327	002043	兔宝宝	6,800	60,248.00	0.04
328	688596	正帆科技	1,500	59,445.00	0.04
329	603087	甘李药业	1,100	57,915.00	0.04
330	300482	万孚生物	1,900	57,323.00	0.04
331	600751	海航科技	21,700	56,854.00	0.04
332	300671	富满微	1,700	54,961.00	0.04
333	603690	至纯科技	2,120	54,484.00	0.04

334	002617	露笑科技	8,500	52,700.00	0.04
335	600621	华鑫股份	3,500	49,245.00	0.03
336	300687	赛意信息	2,200	47,916.00	0.03
337	688368	晶丰明源	400	43,176.00	0.03
338	002913	奥士康	1,400	42,910.00	0.03
339	600064	南京高科	7,100	42,884.00	0.03
340	688630	芯碁微装	500	42,685.00	0.03
341	002984	森麒麟	1,300	37,505.00	0.03
342	688209	英集芯	2,000	35,720.00	0.02
343	688007	光峰科技	1,300	33,644.00	0.02
344	601311	骆驼股份	3,800	30,438.00	0.02
345	000552	甘肃能化	9,400	28,670.00	0.02
346	002705	新宝股份	1,800	26,226.00	0.02
347	688318	财富趋势	200	25,260.00	0.02
348	688389	普门科技	1,000	22,510.00	0.02
349	600058	五矿发展	2,100	19,698.00	0.01
350	001270	铖昌科技	300	18,813.00	0.01
351	000528	柳工	2,700	18,198.00	0.01
352	002416	爱施德	1,900	17,651.00	0.01
353	002034	旺能环境	1,100	16,775.00	0.01
354	600491	龙元建设	3,800	14,972.00	0.01
355	000727	冠捷科技	5,400	14,472.00	0.01
356	002967	广电计量	900	13,509.00	0.01
357	601001	晋控煤业	1,000	12,330.00	0.01
358	000712	锦龙股份	800	11,736.00	0.01
359	300039	上海凯宝	1,600	10,640.00	0.01
360	002267	陕天然气	1,400	10,262.00	0.01
361	600267	海正药业	900	8,424.00	0.01
362	301381	赛维时代	277	8,224.13	0.01
363	300002	神州泰岳	800	7,080.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301487	盟固利	867	35,512.32	0.02
2	301348	蓝箭电子	259	11,543.63	0.01
3	301526	国际复材	2,370	10,546.50	0.01
4	301566	达利凯普	395	8,745.30	0.01
5	301421	波长光电	147	8,727.39	0.01
6	688592	司南导航	130	6,568.90	0.00
7	688548	广钢气体	495	6,311.25	0.00
8	301516	中远通	405	6,281.55	0.00
9	688549	中巨芯	773	6,253.57	0.00
10	301413	安培龙	104	6,051.76	0.00

11	301499	维科精密	203	5,872.79	0.00
12	688720	艾森股份	113	5,631.92	0.00
13	688603	天承科技	73	5,412.22	0.00
14	301578	辰奕智能	76	5,192.32	0.00
15	002903	宇环数控	200	5,110.00	0.00
16	301507	民生健康	318	5,040.30	0.00
17	301555	惠柏新材	154	4,995.76	0.00
18	301505	苏州规划	136	4,870.16	0.00
19	301292	海科新源	249	4,818.15	0.00
20	688671	碧兴物联	140	4,802.00	0.00
21	301486	致尚科技	97	4,583.25	0.00
22	601096	宏盛华源	1,104	4,482.24	0.00
23	301533	威马农机	135	4,476.60	0.00
24	688651	盛邦安全	97	4,466.85	0.00
25	301498	乖宝宠物	115	4,463.15	0.00
26	301329	信音电子	200	4,446.00	0.00
27	301459	丰茂股份	109	4,342.56	0.00
28	688702	盛科通信	86	4,143.48	0.00
29	301518	长华化学	175	4,026.75	0.00
30	301393	昊帆生物	67	3,977.79	0.00
31	301519	舜禹股份	195	3,940.95	0.00
32	301202	朗威股份	123	3,911.40	0.00
33	300604	长川科技	100	3,799.00	0.00
34	301456	盘古智能	122	3,707.58	0.00
35	301550	斯菱股份	84	3,659.88	0.00
36	688693	锆威特	80	3,472.80	0.00
37	301525	儒竞科技	41	3,339.86	0.00
38	688646	逸飞激光	85	3,065.95	0.00
39	688612	威迈斯	75	2,847.75	0.00
40	601083	锦江航运	234	2,590.38	0.00
41	001239	永达股份	126	2,509.92	0.00
42	301548	崇德科技	42	2,477.58	0.00
43	603004	鼎龙科技	79	2,464.01	0.00
44	603373	安邦护卫	65	2,258.75	0.00
45	603270	金帝股份	70	2,070.60	0.00
46	001358	兴欣新材	44	1,943.04	0.00
47	603119	浙江荣泰	78	1,861.86	0.00
48	603275	众辰科技	43	1,707.10	0.00
49	603231	索宝蛋白	61	1,313.33	0.00
50	603075	热威股份	55	1,282.05	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	600797	浙大网新	7,613,171.00	4.97
2	301039	中集车辆	6,020,594.78	3.93
3	605388	均瑶健康	5,745,205.00	3.75
4	002597	金禾实业	5,710,132.00	3.73
5	601137	博威合金	5,692,772.00	3.72
6	600850	电科数字	5,465,119.00	3.57
7	605111	新洁能	5,244,045.80	3.43
8	600750	江中药业	4,966,745.16	3.24
9	002044	美年健康	4,508,295.00	2.95
10	002697	红旗连锁	4,495,581.00	2.94
11	300856	科思股份	4,379,259.00	2.86
12	605589	圣泉集团	4,348,045.00	2.84
13	002402	和而泰	4,327,960.00	2.83
14	603118	共进股份	4,306,165.00	2.81
15	300036	超图软件	4,270,972.00	2.79
16	002291	遥望科技	4,253,239.00	2.78
17	000758	中色股份	4,175,041.00	2.73
18	600572	康恩贝	4,117,298.00	2.69
19	600761	安徽合力	4,101,725.00	2.68
20	002126	银轮股份	4,050,386.00	2.65
21	603368	柳药集团	4,018,331.00	2.63
22	002158	汉钟精机	4,003,300.00	2.62
23	002463	沪电股份	3,964,836.80	2.59
24	300232	洲明科技	3,954,244.76	2.58
25	600073	上海梅林	3,933,640.00	2.57
26	601126	四方股份	3,925,156.00	2.56
27	600502	安徽建工	3,885,389.00	2.54
28	600266	城建发展	3,875,521.00	2.53
29	600789	鲁抗医药	3,754,753.00	2.45
30	600285	羚锐制药	3,741,686.00	2.44
31	300348	长亮科技	3,713,100.00	2.43
32	600458	时代新材	3,684,245.00	2.41
33	000555	神州信息	3,670,696.00	2.40
34	600158	中体产业	3,653,374.00	2.39
35	603920	世运电路	3,646,665.00	2.38
36	600210	紫江企业	3,634,025.00	2.37
37	603236	移远通信	3,610,380.00	2.36
38	002746	仙坛股份	3,601,194.00	2.35
39	600420	国药现代	3,594,199.56	2.35
40	300119	瑞普生物	3,538,527.00	2.31
41	300226	上海钢联	3,492,662.50	2.28
42	300775	三角防务	3,487,995.70	2.28

43	300777	中简科技	3,465,184.00	2.26
44	002979	雷赛智能	3,421,221.00	2.24
45	002215	诺普信	3,343,233.00	2.18
46	002517	恺英网络	3,309,435.00	2.16
47	603027	千禾味业	3,304,836.80	2.16
48	300674	宇信科技	3,250,015.00	2.12
49	000928	中钢国际	3,248,166.00	2.12
50	603306	华懋科技	3,229,419.00	2.11
51	002768	国恩股份	3,226,925.65	2.11
52	002782	可立克	3,225,744.00	2.11
53	300638	广和通	3,223,038.40	2.11
54	002017	东信和平	3,213,225.00	2.10
55	000917	电广传媒	3,208,248.00	2.10
56	002237	恒邦股份	3,194,792.00	2.09
57	600211	西藏药业	3,138,279.00	2.05
58	688106	金宏气体	3,137,105.60	2.05
59	300762	上海瀚讯	3,130,775.00	2.05
60	600064	南京高科	3,125,056.00	2.04
61	600057	厦门象屿	3,118,203.00	2.04
62	000034	神州数码	3,108,590.00	2.03
63	002649	博彦科技	3,091,058.00	2.02

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	600797	浙大网新	7,658,502.00	5.00
2	002597	金禾实业	7,624,657.00	4.98
3	000758	中色股份	7,027,851.00	4.59
4	301039	中集车辆	6,931,157.00	4.53
5	002463	沪电股份	6,535,673.00	4.27
6	600750	江中药业	6,311,937.80	4.12
7	300352	北信源	6,096,240.00	3.98
8	603118	共进股份	6,048,384.44	3.95
9	600210	紫江企业	6,030,321.00	3.94
10	002517	恺英网络	5,977,679.00	3.91
11	601137	博威合金	5,862,689.00	3.83
12	600285	羚锐制药	5,862,466.18	3.83
13	605388	均瑶健康	5,681,043.00	3.71
14	002697	红旗连锁	5,644,977.60	3.69
15	002291	遥望科技	5,558,817.49	3.63
16	600073	上海梅林	5,526,223.00	3.61
17	002044	美年健康	5,373,647.43	3.51

18	002649	博彦科技	5,230,674.00	3.42
19	600850	电科数字	5,096,834.48	3.33
20	605111	新洁能	5,060,653.04	3.31
21	300900	广联航空	4,973,704.61	3.25
22	600971	恒源煤电	4,737,711.70	3.10
23	000917	电广传媒	4,714,862.00	3.08
24	603368	柳药集团	4,712,758.00	3.08
25	600572	康恩贝	4,636,082.00	3.03
26	600158	中体产业	4,496,924.00	2.94
27	600761	安徽合力	4,482,522.00	2.93
28	300856	科思股份	4,421,082.63	2.89
29	002402	和而泰	4,413,116.00	2.88
30	605589	圣泉集团	4,339,584.00	2.84
31	002158	汉钟精机	4,328,268.00	2.83
32	002276	万马股份	4,300,914.00	2.81
33	000933	神火股份	4,259,615.44	2.78
34	600502	安徽建工	4,162,647.00	2.72
35	600330	天通股份	4,102,935.00	2.68
36	300130	新国都	4,075,183.70	2.66
37	600481	双良节能	4,054,052.00	2.65
38	300119	瑞普生物	3,990,756.00	2.61
39	603920	世运电路	3,990,472.00	2.61
40	002610	爱康科技	3,972,159.00	2.59
41	300226	上海钢联	3,949,228.92	2.58
42	601126	四方股份	3,941,831.00	2.58
43	300036	超图软件	3,940,195.00	2.57
44	002126	银轮股份	3,937,086.00	2.57
45	002139	拓邦股份	3,915,010.00	2.56
46	300502	新易盛	3,874,949.00	2.53
47	000612	焦作万方	3,848,290.60	2.51
48	600789	鲁抗医药	3,814,333.00	2.49
49	300232	洲明科技	3,808,400.53	2.49
50	300377	赢时胜	3,808,122.00	2.49
51	000913	钱江摩托	3,798,966.00	2.48
52	002036	联创电子	3,793,120.00	2.48
53	300775	三角防务	3,723,804.87	2.43
54	600057	厦门象屿	3,663,517.90	2.39
55	000915	华特达因	3,633,843.00	2.37
56	300634	彩讯股份	3,599,194.00	2.35
57	603690	至纯科技	3,590,483.00	2.35
58	002768	国恩股份	3,563,859.00	2.33
59	300842	帝科股份	3,551,176.00	2.32
60	600420	国药现代	3,518,400.00	2.30

61	002746	仙坛股份	3,508,862.00	2.29
62	688556	高测股份	3,458,597.93	2.26
63	603105	芯能科技	3,452,917.00	2.26
64	600211	西藏药业	3,431,857.00	2.24
65	002222	福晶科技	3,407,101.00	2.23
66	600559	老白干酒	3,400,624.00	2.22
67	300777	中简科技	3,393,829.00	2.22
68	000517	荣安地产	3,326,898.00	2.17
69	002020	京新药业	3,325,844.00	2.17
70	000600	建投能源	3,280,340.00	2.14
71	002865	钧达股份	3,279,551.60	2.14
72	300567	精测电子	3,266,798.00	2.13
73	002017	东信和平	3,205,653.20	2.09
74	300725	药石科技	3,181,215.60	2.08
75	601908	京运通	3,177,864.00	2.08
76	600284	浦东建设	3,172,708.84	2.07
77	300762	上海瀚讯	3,161,554.00	2.07
78	600458	时代新材	3,159,487.00	2.06
79	002258	利尔化学	3,151,979.81	2.06
80	002979	雷赛智能	3,146,802.20	2.06
81	603236	移远通信	3,128,269.00	2.04
82	300348	长亮科技	3,122,762.00	2.04
83	300638	广和通	3,110,163.00	2.03
84	601567	三星医疗	3,090,594.00	2.02
85	688106	金宏气体	3,084,720.88	2.02
86	600129	太极集团	3,078,129.00	2.01
87	300674	宇信科技	3,075,259.00	2.01

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,158,174,256.26
卖出股票收入（成交）总额	1,167,619,510.81

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	119,007.97	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	119,007.97	0.08

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	113069	博 23 转债	960	96,006.31	0.06
2	127100	神码转债	230	23,001.66	0.02

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

胜宏科技(惠州)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到广东省统计局的处罚。

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	561,273.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	333,904.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	895,178.38

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	301487	盟固利	35,512.32	0.02	新股流通受限
2	301348	蓝箭电子	11,543.63	0.01	新股流通受限
3	301526	国际复材	10,546.50	0.01	新股流通受限
4	301566	达利凯普	8,745.30	0.01	新股流通受限

5	301421	波长光电	8,727.39	0.01	新股流通受限
---	--------	------	----------	------	--------

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
景顺长城中证 1000 指数增强 A	5,602	10,421.72	2,355.05	0.00	58,380,121.36	100.00
景顺长城中证 1000 指数增强 C	4,206	22,573.17	57,532,166.29	60.60	37,410,592.47	39.40
合计	9,808	15,632.67	57,534,521.34	37.52	95,790,713.83	62.48

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城中证 1000 指数增强 A	486,961.77	0.834089
	景顺长城中证 1000 指数增强 C	7.00	0.000007
	合计	486,968.77	0.317605

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	景顺长城中证 1000 指数增强 A	10~50
	景顺长城中证 1000 指数增强 C	-
	合计	10~50

本基金基金经理持有本 开放式基金	景顺长城中证 1000 指数增强 A	10~50
	景顺长城中证 1000 指数增强 C	-
	合计	10~50

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	景顺长城中证 1000 指数增强 A	景顺长城中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2022 年 4 月 27 日) 基金份额总额	317,257,520.90	264,646,728.20
本报告期期初基金份 额总额	68,141,285.88	87,742,284.22
本报告期基金总申购 份额	27,374,077.90	46,124,667.64
减：本报告期基金总 赎回份额	37,132,887.37	38,924,193.10
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	58,382,476.41	94,942,758.76

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 2 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 40,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券股份有限公司	3	2,321,891,775.62	100.00	1,199,706.80	100.00	未变更
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中国银河证券股份有限公司	3	-	-	-	-	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

- 资金实力雄厚，信誉良好；
- 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 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；
- 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(%)
中信建投证券股份有限公司	1,307,532.62	100.00	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增济安财富为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023年1月12日
2	景顺长城中证 1000 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
3	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
4	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2月10日

	停机维护的公告	网站	
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增肯特瑞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 2 月 15 日
6	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
7	关于旗下部分基金参加华安证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 6 日
8	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
9	景顺长城中证 1000 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
10	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
11	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
12	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 18 日
13	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
14	景顺长城中证 1000 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
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 4 月 22 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 6 日
17	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
18	关于旗下部分基金新增平安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 5 月 15 日
19	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
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 5 月 27 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 10 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海证券为销售机构并	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 14 日

	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		
23	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 6 月 16 日
24	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
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 6 月 22 日
26	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
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 1 日
28	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
29	关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司银银平台“机构投资交易平台”为销售平台并开通基金定期定额投资业务、转换业务及参加申购、定期定额申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 6 日
30	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
31	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 7 月 12 日
32	关于景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金新增长城证券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 7 月 12 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 7 月 15 日
34	关于景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金新增国联证券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 7 月 18 日
35	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

36	景顺长城中证 1000 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
37	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
38	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
39	景顺长城中证 1000 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
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 9 月 2 日
41	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏财富为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 14 日
42	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中金财富证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 22 日
43	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
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 10 月 14 日
45	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧财富为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 23 日
46	景顺长城中证 1000 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
47	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
48	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 1 日
49	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
50	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
51	景顺长城中证 1000 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
52	景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 30 日
53	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 9 日
54	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 16 日

55	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230101-20231231	44,912,107.89	0.00	0.00	44,912,107.89	29.29

产品特有风险

本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：

1、大额申购风险

在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

- 2、《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日