

# 景顺长城国证 2000 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。

普华永道中天会计师事务所（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 9 月 5 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
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
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
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 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	67
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 .....	67
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 .....	67
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 .....	67
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 .....	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	68
8.12 投资组合报告附注 .....	68
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>69</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>70</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>70</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
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 .....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
11.4 基金投资策略的改变 .....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	71
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 .....	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
11.8 其他重大事件 .....	72
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>74</b>
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 .....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>74</b>
13.1 备查文件目录 .....	74
13.2 存放地点 .....	74
13.3 查阅方式 .....	74

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城国证 2000 指数增强	
基金主代码	019013	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 5 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	91,122,693.18 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城国证 2000 指数增强 A	景顺长城国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019013	019014
报告期末下属分级基金的份额总额	12,766,380.79 份	78,356,312.39 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。</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</p>

	<p>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 本基金将通过对宏观经济、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 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 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。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。</p>
业绩比较基准	国证 2000 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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	杨军智
	联系电话	0755-82370388	010-60834299
	电子邮箱	investor@igwfm.com	yjz@citics.com
客户服务电话		4008888606	010-60836588
传真		0755-22381339	010-60834004
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	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
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	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码		518048	100125
法定代表人		李进	张佑君

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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 9 月 5 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日	
	景顺长城国证 2000 指数增强 A	景顺长城国证 2000 指数增强 C
本期已实现收益	-60,223.42	-919,250.11
本期利润	-106,734.80	-1,259,762.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0051	-0.0086
本期加权平均净值利润率	-0.52%	-0.87%
本期基金份额净值增长率	-0.67%	-0.80%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	
期末可供分配利润	-84,904.15	-619,207.01
期末可供分配基金份额利润	-0.0067	-0.0079
期末基金资产净值	12,681,476.64	77,737,105.38
期末基金份额净值	0.9933	0.9920
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	
基金份额累计净值增长率	-0.67%	-0.80%

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。

5、本基金基金合同生效日为 2023 年 9 月 5 日。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城国证 2000 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	0.40%	0.98%	-1.03%	1.02%	1.43%	-0.04%
自基金合同生效	-0.67%	0.93%	-2.25%	0.98%	1.58%	-0.05%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

景顺长城国证 2000 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	0.30%	0.98%	-1.03%	1.02%	1.33%	-0.04%
自基金合同生效 起至今	-0.80%	0.93%	-2.25%	0.98%	1.45%	-0.05%

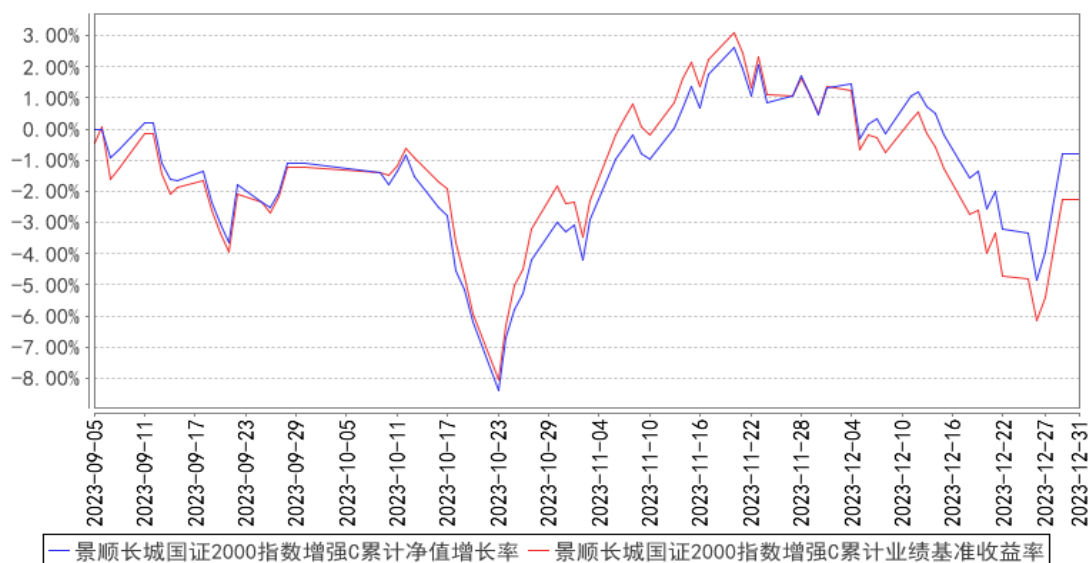
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城国证2000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





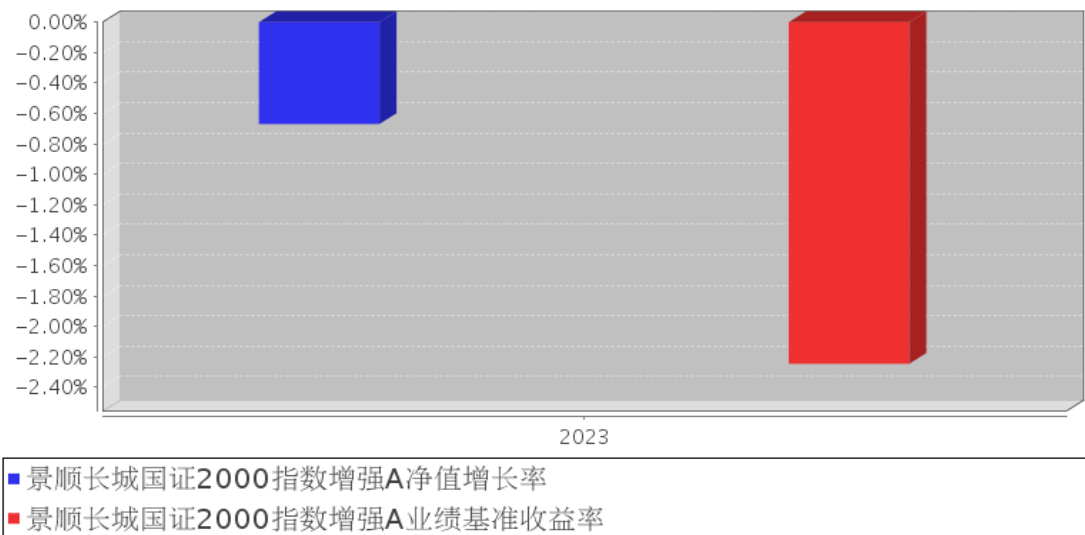
景顺长城国证2000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



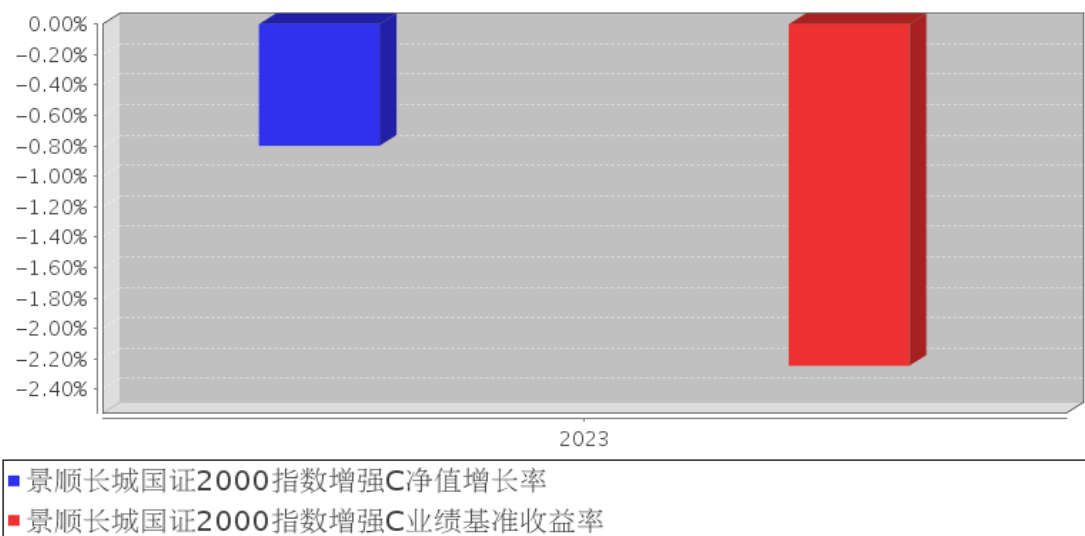
注：本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股及其备选成份股（含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2023 年 9 月 5 日基金合同生效日起 6 个月。截至本报告期末，本基金仍处于建仓期。基金合同生效日（2023 年 9 月 5 日）起至本报告期末不满一年。

### 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

景顺长城国证2000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



景顺长城国证2000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：2023 年净值增长率与业绩比较基准收益率的实际计算期间是 2023 年 9 月 5 日（基金合同生效日）至 2023 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2023年9月5日（基金合同生效日）至本期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		
徐喻军	本基金的基金经理	2023年9月5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。
黎海威	本基金的基金经理	2023年9月5日	-	20年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪KMV公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，自2013年10月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有20年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内,本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《景顺长城国证 2000 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 9 月 5 日（基金合同生效日）至本报告期末，景顺长城国证 2000 指数增强 A 份额净值增长率为 -0.67%，业绩比较基准收益率为 -2.25%。

2023 年 9 月 5 日（基金合同生效日）至本报告期末，景顺长城国证 2000 指数增强 C 份额净值增长率为 -0.80%，业绩比较基准收益率为 -2.25%。

## 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。

本基金是以国证 2000 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

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有



关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，景顺长城基金管理有限公司在景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 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

本报告期，由景顺长城基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

# § 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	普华永道中天审字(2024)第 25211 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	景顺长城国证 2000 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>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金(以下简称“景顺长城国证 2000 指数增强基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年 9 月 5 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了景顺长城国证 2000 指数增强基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 9 月 5 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	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

	<p>步阐述了我们在这些准则下的责任。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于景顺长城国证 2000 指数增强基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>景顺长城国证 2000 指数增强基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估景顺长城国证 2000 指数增强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，除非基金管理人管理层计划清算景顺长城国证 2000 指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督景顺长城国证 2000 指数增强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>(一) 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>(二) 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>(三) 评价基金管理人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>(四) 对基金管理人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，就可能对景顺长城国证 2000 指数增强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国证 2000 指数增强基金不能持续经营。</p>

	(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	朱宏宇	郭劲扬
会计师事务所的地址	中国上海市	
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：景顺长城国证 2000 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
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	6,229,148.05
结算备付金		1,646,780.75
存出保证金		420,955.20
交易性金融资产	7.4.7.2	81,693,373.77
其中：股票投资		81,622,468.91
基金投资		-
债券投资		70,904.86
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		1,266,346.53
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		91,256,604.30

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>		
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		652,129.16
应付管理人报酬		60,022.06
应付托管费		11,254.14
应付销售服务费		25,561.55
应付投资顾问费		-
应交税费		4,555.37
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	84,500.00
负债合计		838,022.28
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.10	91,122,693.18
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	-704,111.16
净资产合计		90,418,582.02
负债和净资产总计		91,256,604.30

注：1. 报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 91,122,693.18 份，其中 A 类基金份额净值 0.9933 元，基金份额 12,766,380.79 份；C 类基金份额净值 0.9920 元，基金份额 78,356,312.39 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 9 月 5 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 5 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 9 月 5 日(基金合同生 效日)至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-575,586.84
1. 利息收入		91,983.55
其中：存款利息收入	7.4.7.13	91,983.55
债券利息收入		-

资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-283,893.52
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-526,557.21
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	16,691.50
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	135,375.01
股利收益	7.4.7.19	90,597.18
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	-387,024.15
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	3,347.28
<b>减：二、营业总支出</b>		790,910.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	433,518.53
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	81,284.68
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	189,919.55
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		488.08
8. 其他费用	7.4.7.23	85,700.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,366,497.68
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,366,497.68
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,366,497.68

### 7.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 5 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 9 月 5 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	253,258,172.70	-	-	253,258,172.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-162,135,479.52	-	-704,111.16	-162,839,590.68
(一)、综合收益总额	-	-	-1,366,497.68	-1,366,497.68
(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)	-162,135,479.52	-	662,386.52	-161,473,093.00
其中：1. 基金申购款	26,934,818.04	-	-41,679.25	26,893,138.79
2. 基金赎回款	-189,070,297.56	-	704,065.77	-188,366,231.79
(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	91,122,693.18	-	-704,111.16	90,418,582.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1632 号《关于准予景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册,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《景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 253,184,356.01 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0463 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 253,258,172.70 份基金份额,其中认购资金利息折合 73,816.69 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,基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城国证 2000 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,将基金份额类别分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。在投资者认购/申购时收取前端认购或申购费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购或申购费用,而从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。投资者可自行选择认购/申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股(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、可交换公司债券)、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。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为 90-95%,投资于标的指数成分股及其备选成分股(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、股票期权合约需要缴纳的交易保证金后,本基金保留的

现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金净资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：国证 2000 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 9 月 5 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 9 月 5 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

##### 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，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。



## 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指

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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，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后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 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

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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)本基金的基金管理人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)本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中基协字[2022]566号《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得

税。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请, 由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利, 由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》, 自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

#### 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
活期存款	4,615,668.50
等于: 本金	4,613,388.55
加: 应计利息	2,279.95
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	1,613,479.55
等于: 本金	1,613,378.47
加: 应计利息	101.08
减: 坏账准备	-
合计	6,229,148.05

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		81,930,253.06	-	81,622,468.91	-307,784.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	70,900.00	4.86	70,904.86	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	70,900.00	4.86	70,904.86	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		82,001,153.06	4.86	81,693,373.77	-307,784.15

#### 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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,587,200.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,587,200.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,587,200.00	-	-	-

##### 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	3.00	3,507,960.00	-79,240.00
合计				-79,240.00
减：可抵销期货暂收款				-79,240.00
净额				-

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	84,500.00
合计	84,500.00

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 景顺长城国证 2000 指数增强 A

项目	本期 2023 年 9 月 5 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	27,540,194.77	27,540,194.77
本期申购	1,148,244.24	1,148,244.24
本期赎回（以“-”号填列）	-15,922,058.22	-15,922,058.22
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	12,766,380.79	12,766,380.79

##### 景顺长城国证 2000 指数增强 C

项目	本期 2023 年 9 月 5 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	225,717,977.93	225,717,977.93
本期申购	25,786,573.80	25,786,573.80
本期赎回（以“-”号填列）	-173,148,239.34	-173,148,239.34
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	78,356,312.39	78,356,312.39

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金合同于 2023 年 9 月 5 日生效。首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 253,184,356.01 元，折合 253,184,356.01 份基金份额（其中 A 类基金份额 27,528,178.01 份，C 类基金份额 225,656,178.00 份）；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息为人民币 73,816.69 元，折合 73,816.69 份基金份额（其中 A 类基金份额 12,016.76 份，C 类基金份额 61,799.93 份）。以上收到的实收基金共计人民币 253,258,172.70 元，折合 253,258,172.70 份基金份额。

## 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

景顺长城国证 2000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-60,223.42	-46,511.38	-106,734.80
本期基金份额交易产生的变动数	108,912.93	-87,082.28	21,830.65
其中：基金申购款	-9,237.19	-630.12	-9,867.31
基金赎回款	118,150.12	-86,452.16	31,697.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,689.51	-133,593.66	-84,904.15

景顺长城国证 2000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-919,250.11	-340,512.77	-1,259,762.88
本期基金份额交易产生的变动数	1,120,241.62	-479,685.75	640,555.87
其中：基金申购款	191,944.77	-223,756.71	-31,811.94
基金赎回款	928,296.85	-255,929.04	672,367.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	200,991.51	-820,198.52	-619,207.01

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 9 月 5 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	78,423.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,026.31
结算备付金利息收入	7,533.76
其他	-
合计	91,983.55

## 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9月5日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-526,557.21
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	-526,557.21

## 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9月5日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	484,580,132.05
减：卖出股票成本总额	484,245,471.68
减：交易费用	861,217.58
买卖股票差价收入	-526,557.21

## 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9月5日（基金合同生效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	12.55
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	16,678.95
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	16,691.50

## 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9月5日（基金合同生效日）至2023年12月31日

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	57,922.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	41,200.00
减：应计利息总额	7.80
减：交易费用	35.81
买卖债券差价收入	16,678.95

#### 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9月5日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股指期货投资收益	135,375.01

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月5日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	90,597.18
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	90,597.18

#### 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 9 月 5 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-307,784.15
股票投资	-307,784.15
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	-79,240.00
权证投资	-
期货投资	-79,240.00
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	-387,024.15

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 9 月 5 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	3,347.25
基金转换费收入	0.03
合计	3,347.28

#### 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 9 月 5 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	4,500.00
其他	1,200.00
合计	85,700.00

#### 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
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	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
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9月5日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中信证券	524,262,424.15	49.92

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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9月5日（基金合同生效日）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（%）
中信证券	275,324.23	49.92	-	-

注：1、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。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 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 9 月 5 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	433,518.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	158,790.43
应支付基金管理人的净管理费	274,728.10

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}。$$

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 9 月 5 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	81,284.68

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 9 月 5 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城国证 2000 指数增强 A	景顺长城国证 2000 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	194.18	194.18
中信证券	-	102,806.56	102,806.56
合计	-	103,000.74	103,000.74

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$



**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**

本基金本报告期末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**

本基金于本报告期末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**

本基金于本报告期末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末未运用固有资金投资本基金。

**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未持有本基金份额。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年9月5日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信证券-证券资金账户	1,420,871.01	3,277.60

注：基金托管人中信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**

本基金本报告期末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**

本基金本报告期无其他关联交易事项。

**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	证券	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日	期	受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额	总额	
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股流通受限	12.05	19.92	108	1,301.40	2,151.36	-
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股流通受限	53.63	75.36	36	1,930.68	2,712.96	-
001326	联域股份	2023年11月1日	6个月	新股流通受限	41.18	48.64	75	3,088.50	3,648.00	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股流通受限	41.00	44.16	28	1,148.00	1,236.48	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	84	2,793.00	4,887.96	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	93	2,966.70	3,705.12	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	252	4,238.64	6,723.36	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股流通受限	6.87	15.51	397	2,727.39	6,157.47	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股流通受限	2.66	4.45	1,546	4,112.36	6,879.70	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股流通受限	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	257	2,287.30	5,689.98	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股流通受限	23.23	35.58	156	3,623.88	5,550.48	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	49	2,398.06	3,347.68	-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股流通	58.08	57.81	41	2,381.28	2,370.21	-

				受限						
603107	上海汽配	2023年10月25日	6个月	新股流通受限	14.23	18.19	138	1,963.74	2,510.22	-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
688648	中邮科技	2023年11月6日	6个月	新股流通受限	15.18	21.43	297	4,508.46	6,364.71	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	424	4,452.00	6,779.76	-

## 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转债	2023年12月25日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	460	46,000.00	46,003.02	-
118046	诺泰转债	2023年12月18日	1-6个月(含)	新债未上市	100.00	100.01	200	20,000.00	20,001.49	-
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	49	4,900.00	4,900.35	-

## 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发行的证券，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%。

### 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。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	6,229,148.05	-	-	-	-	-	6,229,148.05
结算备付金	1,646,780.75	-	-	-	-	-	1,646,780.75
存出保证金	-	-	-	-	-	420,955.20	420,955.20
交易性金融资产	-	-	-	46,003.02	24,901.84	81,622,468.91	81,693,373.77
应收申购款	-	-	-	-	-	1,266,346.53	1,266,346.53
资产总计	7,875,928.80	-	-	46,003.02	24,901.84	83,309,770.64	91,256,604.30
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	652,129.16	652,129.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	60,022.06	60,022.06
应付托管费	-	-	-	-	-	11,254.14	11,254.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	25,561.55	25,561.55
应交税费	-	-	-	-	-	4,555.37	4,555.37
其他负债	-	-	-	-	-	84,500.00	84,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	838,022.28	838,022.28
利率敏感度缺口	7,875,928.80	-	-	46,003.02	24,901.84	-	-

##### 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%，因此市场利率

的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	81,622,468.91	90.27
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	81,622,468.91	90.27

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）
	沪深 300 指数上升 5%	3,710,272.92
	沪深 300 指数下降 5%	-3,710,272.92

## 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
第一层次	81,541,110.24
第二层次	70,904.86
第三层次	81,358.67
合计	81,693,373.77

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

项目	本期 2023 年 9 月 5 日（基金合同生效日）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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	52,737.51	52,737.51
转出第三层次	-	-	-



当期利得或损失总额	-	28,621.16	28,621.16
其中：计入损益的利得或损失	-	28,621.16	28,621.16
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	81,358.67	81,358.67
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	-	28,621.16	28,621.16

#### 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	81,358.67	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.5141-2.1988	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	81,622,468.91	89.44
	其中：股票	81,622,468.91	89.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	70,904.86	0.08
	其中：债券	70,904.86	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	7,875,928.80	8.63
8	其他各项资产	1,687,301.73	1.85
9	合计	91,256,604.30	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	495,355.00	0.55
B	采矿业	394,108.56	0.44
C	制造业	47,225,344.05	52.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,363,028.00	1.51
E	建筑业	1,180,110.00	1.31
F	批发和零售业	1,908,241.00	2.11
G	交通运输、仓储和邮政业	497,280.00	0.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,734,136.75	10.77
J	金融业	276,618.00	0.31
K	房地产业	2,184,022.00	2.42
L	租赁和商务服务业	635,916.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	2,339,962.88	2.59
N	水利、环境和公共设施管理业	810,540.00	0.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	293,972.00	0.33
R	文化、体育和娱乐业	1,449,669.00	1.60
S	综合	-	-
	合计	70,788,303.24	78.29

### 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	254,736.00	0.28
C	制造业	6,688,606.31	7.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	754,262.00	0.83
E	建筑业	265,428.00	0.29
F	批发和零售业	869,271.00	0.96

G	交通运输、仓储和邮政业	854,666.00	0.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	798,543.00	0.88
J	金融业	14,695.00	0.02
K	房地产业	7,567.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	184,323.36	0.20
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	66,056.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	76,012.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	10,834,165.67	11.98

### 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	300102	乾照光电	77,700	571,095.00	0.63
2	300228	富瑞特装	80,000	568,000.00	0.63
3	300925	法本信息	45,200	531,100.00	0.59
4	688235	百济神州	3,600	500,544.00	0.55
5	603167	渤海轮渡	56,000	497,280.00	0.55
6	300460	惠伦晶体	39,000	478,140.00	0.53
7	002803	吉宏股份	23,000	472,880.00	0.52
8	002707	众信旅游	63,900	456,246.00	0.50
9	600757	长江传媒	61,000	454,450.00	0.50
10	300398	飞凯材料	28,200	444,432.00	0.49
11	300378	鼎捷软件	20,600	438,986.00	0.49
12	300177	中海达	60,800	437,152.00	0.48
13	300455	航天智装	36,200	432,228.00	0.48
14	002208	合肥城建	65,400	419,214.00	0.46
15	002970	锐明技术	13,500	413,235.00	0.46
16	300825	阿尔特	29,800	409,750.00	0.45
17	300681	英搏尔	20,100	387,327.00	0.43
18	688035	德邦科技	6,700	357,512.00	0.40

19	600363	联创光电	10,500	357,000.00	0.39
20	688700	东威科技	5,600	341,712.00	0.38
21	300846	首都在线	23,800	340,102.00	0.38
22	300101	振芯科技	14,800	337,884.00	0.37
23	688185	康希诺	4,397	327,664.44	0.36
24	300123	亚光科技	44,700	327,651.00	0.36
25	601137	博威合金	21,000	326,130.00	0.36
26	002215	诺普信	39,400	325,444.00	0.36
27	300188	国投智能	20,100	322,002.00	0.36
28	002845	同兴达	18,100	321,275.00	0.36
29	300348	长亮科技	31,100	320,641.00	0.35
30	688048	长光华芯	5,100	319,617.00	0.35
31	300170	汉得信息	38,200	317,442.00	0.35
32	002488	金固股份	44,200	317,356.00	0.35
33	605299	舒华体育	32,000	316,800.00	0.35
34	300168	万达信息	37,200	315,456.00	0.35
35	600480	凌云股份	34,600	315,206.00	0.35
36	300342	天银机电	20,300	312,011.00	0.35
37	688518	联赢激光	15,100	309,248.00	0.34
38	002212	天融信	31,600	309,048.00	0.34
39	000090	天健集团	66,700	306,820.00	0.34
40	603033	三维股份	19,400	306,714.00	0.34
41	000925	众合科技	35,400	306,564.00	0.34
42	688800	瑞可达	7,600	305,368.00	0.34
43	002038	双鹭药业	29,800	303,662.00	0.34
44	000829	天音控股	31,800	303,372.00	0.34
45	300698	万马科技	8,300	302,950.00	0.34
46	000029	深深房 A	25,700	302,232.00	0.33
47	688300	联瑞新材	5,700	301,815.00	0.33
48	300222	科大智能	40,900	301,024.00	0.33
49	300429	强力新材	23,400	300,924.00	0.33
50	300180	华峰超纤	68,000	300,560.00	0.33
51	603636	南威软件	23,400	299,988.00	0.33
52	603197	保隆科技	5,300	298,920.00	0.33
53	002335	科华数据	10,794	298,777.92	0.33
54	688733	壹石通	10,200	298,554.00	0.33
55	603439	贵州三力	15,800	298,304.00	0.33
56	603297	永新光学	3,000	298,050.00	0.33
57	000006	深振业 A	64,500	296,055.00	0.33
58	603938	三孚股份	16,400	294,872.00	0.33
59	300480	光力科技	13,800	294,630.00	0.33
60	688553	汇宇制药	19,400	293,522.00	0.32
61	300134	大富科技	28,400	293,088.00	0.32

62	000600	建投能源	58,300	292,083.00	0.32
63	300903	科翔股份	29,000	291,740.00	0.32
64	603897	长城科技	14,200	290,816.00	0.32
65	301217	铜冠铜箔	24,500	290,570.00	0.32
66	002026	山东威达	28,600	290,290.00	0.32
67	600502	安徽建工	62,400	290,160.00	0.32
68	688197	首药控股	5,255	290,023.45	0.32
69	002277	友阿股份	71,900	289,757.00	0.32
70	688003	天准科技	7,704	289,054.08	0.32
71	002194	武汉凡谷	29,300	288,898.00	0.32
72	002534	西子洁能	23,100	288,519.00	0.32
73	688102	斯瑞新材	21,800	287,542.00	0.32
74	300527	中船应急	37,700	287,274.00	0.32
75	002158	汉钟精机	12,900	287,154.00	0.32
76	301120	新特电气	24,700	286,273.00	0.32
77	688238	和元生物	31,800	285,882.00	0.32
78	603131	上海沪工	19,300	284,868.00	0.32
79	603132	金徽股份	20,742	283,750.56	0.31
80	605598	上海港湾	10,600	283,656.00	0.31
81	000791	甘肃能源	50,900	283,513.00	0.31
82	605365	立达信	15,200	282,872.00	0.31
83	688306	均普智能	50,720	282,510.40	0.31
84	300224	正海磁材	24,100	282,452.00	0.31
85	688225	亚信安全	15,400	282,436.00	0.31
86	300172	中电环保	52,500	281,925.00	0.31
87	301123	奕东电子	12,000	281,520.00	0.31
88	603319	湘油泵	16,000	280,640.00	0.31
89	601019	山东出版	29,900	280,462.00	0.31
90	002224	三力士	55,100	280,459.00	0.31
91	301179	泽宇智能	10,800	280,260.00	0.31
92	301096	百诚医药	4,300	279,930.00	0.31
93	301060	兰卫医学	21,000	279,090.00	0.31
94	000589	贵州轮胎	45,500	278,460.00	0.31
95	600180	瑞茂通	45,700	278,313.00	0.31
96	603421	鼎信通讯	29,600	278,240.00	0.31
97	000863	三湘印象	70,400	278,080.00	0.31
98	300137	先河环保	49,900	277,444.00	0.31
99	000919	金陵药业	35,200	277,024.00	0.31
100	301366	一博科技	8,300	276,971.00	0.31
101	301180	万祥科技	15,300	276,777.00	0.31
102	688505	复旦张江	29,900	275,977.00	0.31
103	600738	丽尚国潮	51,700	275,044.00	0.30
104	603610	麒盛科技	23,000	274,160.00	0.30

105	000928	中钢国际	47,000	274,010.00	0.30
106	300542	新晨科技	20,900	273,790.00	0.30
107	300966	共同药业	11,900	273,343.00	0.30
108	300384	三联虹普	17,100	272,916.00	0.30
109	002588	史丹利	42,700	272,426.00	0.30
110	605007	五洲特纸	18,500	272,135.00	0.30
111	002351	漫步者	15,400	272,118.00	0.30
112	300355	蒙草生态	72,500	271,875.00	0.30
113	002187	广百股份	43,000	271,330.00	0.30
114	300236	上海新阳	7,700	271,194.00	0.30
115	300946	恒而达	8,400	271,068.00	0.30
116	300997	欢乐家	19,400	271,018.00	0.30
117	603611	诺力股份	14,300	270,699.00	0.30
118	300043	星辉娱乐	72,900	270,459.00	0.30
119	603680	今创集团	28,500	269,325.00	0.30
120	301328	维峰电子	5,500	269,280.00	0.30
121	300189	神农科技	81,800	269,122.00	0.30
122	002880	卫光生物	7,600	266,988.00	0.30
123	603618	杭电股份	41,700	266,880.00	0.30
124	300292	吴通控股	71,700	266,724.00	0.29
125	605138	盛泰集团	34,400	266,600.00	0.29
126	300878	维康药业	10,500	266,385.00	0.29
127	300149	睿智医药	34,800	266,220.00	0.29
128	000011	深物业 A	30,000	265,800.00	0.29
129	603306	华懋科技	9,800	265,678.00	0.29
130	600351	亚宝药业	38,500	265,650.00	0.29
131	001313	粤海饲料	30,800	265,496.00	0.29
132	000920	沃顿科技	26,700	265,131.00	0.29
133	603520	司太立	18,800	264,704.00	0.29
134	002213	大为股份	18,800	264,516.00	0.29
135	600266	城建发展	54,600	264,264.00	0.29
136	301149	隆华新材	21,300	263,481.00	0.29
137	300639	凯普生物	28,200	263,388.00	0.29
138	601811	新华文轩	19,200	262,272.00	0.29
139	002196	方正电机	36,400	261,352.00	0.29
140	002083	孚日股份	51,800	261,072.00	0.29
141	688339	亿华通	5,700	260,718.00	0.29
142	002296	辉煌科技	31,500	259,875.00	0.29
143	002860	星帅尔	20,000	259,000.00	0.29
144	000612	焦作万方	45,000	258,750.00	0.29
145	301030	仕净科技	6,200	258,540.00	0.29
146	300802	矩子科技	13,400	256,208.00	0.28
147	300020	银江技术	30,800	255,640.00	0.28

148	688068	热景生物	6,226	255,577.30	0.28
149	002491	通鼎互联	48,700	255,188.00	0.28
150	688268	华特气体	3,764	253,618.32	0.28
151	600797	浙大网新	38,200	250,592.00	0.28
152	688018	乐鑫科技	2,432	250,374.40	0.28
153	600618	氯碱化工	27,400	249,340.00	0.28
154	301215	中汽股份	40,000	246,800.00	0.27
155	000059	华锦股份	44,500	244,305.00	0.27
156	002283	天润工业	41,500	242,775.00	0.27
157	002467	二六三	51,900	240,816.00	0.27
158	300400	劲拓股份	14,600	237,834.00	0.26
159	003012	东鹏控股	28,800	237,600.00	0.26
160	300113	顺网科技	16,900	236,600.00	0.26
161	301297	富乐德	8,700	234,552.00	0.26
162	000531	穗恒运 A	34,900	233,481.00	0.26
163	002956	西麦食品	16,100	230,713.00	0.26
164	300485	赛升药业	21,500	227,685.00	0.25
165	002041	登海种业	17,100	226,233.00	0.25
166	600526	菲达环保	45,300	223,782.00	0.25
167	000690	宝新能源	50,200	222,386.00	0.25
168	600979	广安爱众	64,200	222,132.00	0.25
169	601609	金田股份	32,600	220,702.00	0.24
170	300105	龙源技术	32,000	217,280.00	0.24
171	301046	能辉科技	8,000	216,960.00	0.24
172	002565	顺灏股份	63,200	214,248.00	0.24
173	600094	大名城	70,900	212,700.00	0.24
174	002121	科陆电子	37,700	211,497.00	0.23
175	002437	誉衡药业	83,700	210,087.00	0.23
176	300036	超图软件	10,000	209,000.00	0.23
177	605338	巴比食品	9,700	208,356.00	0.23
178	002469	三维化学	34,200	207,252.00	0.23
179	688556	高测股份	5,299	206,608.01	0.23
180	601500	通用股份	49,300	204,102.00	0.23
181	688128	中国电研	9,735	199,762.20	0.22
182	002741	光华科技	13,400	199,258.00	0.22
183	300990	同飞股份	4,400	195,844.00	0.22
184	300066	三川智慧	38,700	195,435.00	0.22
185	603990	麦迪科技	15,100	195,092.00	0.22
186	601890	亚星锚链	19,700	195,030.00	0.22
187	688298	东方生物	5,350	191,316.00	0.21
188	002757	南兴股份	12,200	190,808.00	0.21
189	300379	东方通	10,400	190,112.00	0.21
190	600446	金证股份	16,400	189,748.00	0.21

191	688711	宏微科技	4,552	188,862.48	0.21
192	600609	金杯汽车	38,600	187,596.00	0.21
193	301207	华兰疫苗	6,700	186,260.00	0.21
194	300319	麦捷科技	19,300	186,052.00	0.21
195	002792	通宇通讯	11,100	186,036.00	0.21
196	605116	奥锐特	7,200	185,904.00	0.21
197	300791	仙乐健康	5,300	183,698.00	0.20
198	002393	力生制药	7,000	182,700.00	0.20
199	600664	哈药股份	54,500	182,575.00	0.20
200	300366	创意信息	13,700	179,744.00	0.20
201	002376	新北洋	23,300	177,546.00	0.20
202	002428	云南锗业	14,000	172,620.00	0.19
203	600866	星湖科技	36,600	170,556.00	0.19
204	000990	诚志股份	20,700	169,947.00	0.19
205	300344	立方数科	29,700	168,993.00	0.19
206	003000	劲仔食品	13,800	168,636.00	0.19
207	688247	宣泰医药	15,300	167,994.00	0.19
208	002519	银河电子	26,900	165,973.00	0.18
209	301117	佳缘科技	3,000	163,530.00	0.18
210	688326	经纬恒润	1,400	162,470.00	0.18
211	601528	瑞丰银行	32,600	161,370.00	0.18
212	300882	万胜智能	6,600	160,776.00	0.18
213	002106	莱宝高科	14,300	152,152.00	0.17
214	300872	天阳科技	11,023	150,794.64	0.17
215	600312	平高电气	11,700	148,473.00	0.16
216	300774	倍杰特	14,400	148,176.00	0.16
217	600288	大恒科技	13,000	147,940.00	0.16
218	300440	运达科技	19,800	147,510.00	0.16
219	300278	华昌达	38,300	146,306.00	0.16
220	603801	志邦家居	8,700	145,899.00	0.16
221	688277	天智航	10,890	143,530.20	0.16
222	002583	海能达	24,100	143,395.00	0.16
223	300452	山河药辅	10,000	142,400.00	0.16
224	688158	优刻得	8,600	141,470.00	0.16
225	603063	禾望电气	5,500	137,500.00	0.15
226	300327	中颖电子	5,900	134,520.00	0.15
227	301017	漱玉平民	6,500	132,795.00	0.15
228	300771	智莱科技	12,200	132,614.00	0.15
229	600587	新华医疗	5,100	131,529.00	0.15
230	688208	道通科技	5,532	131,385.00	0.15
231	600880	博瑞传播	26,100	130,761.00	0.14
232	600531	豫光金铅	21,100	127,655.00	0.14
233	603738	泰晶科技	7,700	125,895.00	0.14



234	300199	翰宇药业	9,200	124,936.00	0.14
235	300985	致远新能	3,300	124,443.00	0.14
236	002611	东方精工	24,400	121,024.00	0.13
237	300441	鲍斯股份	17,300	119,197.00	0.13
238	603076	乐惠国际	4,300	115,240.00	0.13
239	600576	祥源文旅	15,400	114,576.00	0.13
240	301162	国能日新	2,200	114,136.00	0.13
241	603093	南华期货	9,500	114,000.00	0.13
242	600391	航发科技	5,900	112,808.00	0.12
243	300389	艾比森	6,500	112,710.00	0.12
244	300045	华力创通	4,600	111,918.00	0.12
245	603187	海容冷链	7,200	109,152.00	0.12
246	002401	中远海科	6,000	108,720.00	0.12
247	603588	高能环境	16,600	108,564.00	0.12
248	002115	三维通信	14,400	103,968.00	0.11
249	300709	精研科技	3,300	102,927.00	0.11
250	002079	苏州固锔	9,100	102,648.00	0.11
251	600986	浙文互联	17,700	96,642.00	0.11
252	002483	润邦股份	18,200	95,004.00	0.11
253	301349	信德新材	2,000	94,160.00	0.10
254	300490	华自科技	8,100	94,041.00	0.10
255	688661	和林微纳	2,052	94,022.64	0.10
256	300856	科思股份	1,500	93,345.00	0.10
257	603530	神马电力	4,400	91,256.00	0.10
258	002130	沃尔核材	11,900	89,845.00	0.10
259	000707	双环科技	11,200	89,600.00	0.10
260	601028	玉龙股份	8,300	88,893.00	0.10
261	688766	普冉股份	900	88,182.00	0.10
262	300981	中红医疗	5,500	88,110.00	0.10
263	300194	福安药业	19,600	85,848.00	0.09
264	000543	皖能电力	13,700	85,762.00	0.09
265	688356	键凯科技	800	85,120.00	0.09
266	300130	新国都	3,500	84,700.00	0.09
267	300850	新强联	2,600	82,758.00	0.09
268	601801	皖新传媒	11,900	82,705.00	0.09
269	300663	科蓝软件	5,600	79,184.00	0.09
270	688403	汇成股份	7,300	77,015.00	0.09
271	688121	卓然股份	3,800	76,874.00	0.09
272	603920	世运电路	4,200	76,776.00	0.08
273	603256	宏和科技	9,200	76,544.00	0.08
274	688368	晶丰明源	700	75,558.00	0.08
275	301122	采纳股份	2,200	74,492.00	0.08
276	300288	朗玛信息	4,500	74,025.00	0.08

277	002546	新联电子	14,600	73,000.00	0.08
278	300758	七彩化学	7,200	72,792.00	0.08
279	300531	优博讯	4,700	72,051.00	0.08
280	000034	神州数码	2,400	71,784.00	0.08
281	603229	奥翔药业	5,400	71,334.00	0.08
282	300065	海兰信	6,900	70,173.00	0.08
283	301048	金鹰重工	6,600	69,564.00	0.08
284	600649	城投控股	18,600	68,820.00	0.08
285	000650	仁和药业	9,800	64,974.00	0.07
286	000727	冠捷科技	24,100	64,588.00	0.07
287	600861	北京人力	3,400	63,716.00	0.07
288	002036	联创电子	6,100	62,281.00	0.07
289	605199	葫芦娃	4,100	62,156.00	0.07
290	002947	恒铭达	1,900	61,142.00	0.07
291	300119	瑞普生物	3,600	59,004.00	0.07
292	000597	东北制药	10,900	58,315.00	0.06
293	603983	丸美股份	2,300	58,121.00	0.06
294	001215	千味央厨	1,100	58,091.00	0.06
295	301369	联动科技	1,000	57,870.00	0.06
296	300053	航宇微	4,700	57,481.00	0.06
297	603567	珍宝岛	4,700	57,152.00	0.06
298	600201	生物股份	5,300	57,081.00	0.06
299	300286	安科瑞	2,200	57,046.00	0.06
300	688166	博瑞医药	1,600	56,000.00	0.06
301	003038	鑫铂股份	1,600	54,960.00	0.06
302	301080	百普赛斯	900	53,046.00	0.06
303	600199	金种子酒	2,800	51,856.00	0.06
304	688033	天宜上佳	3,057	51,663.30	0.06
305	300386	飞天诚信	4,800	51,504.00	0.06
306	002197	证通电子	4,900	50,911.00	0.06
307	300337	银邦股份	5,800	46,922.00	0.05
308	000811	冰轮环境	3,400	46,138.00	0.05
309	002895	川恒股份	2,400	45,600.00	0.05
310	300908	仲景食品	1,100	45,397.00	0.05
311	002664	信质集团	2,700	44,901.00	0.05
312	300303	聚飞光电	7,500	44,475.00	0.05
313	301102	兆讯传媒	2,300	44,022.00	0.05
314	688798	艾为电子	600	41,418.00	0.05
315	301078	孩子王	5,000	41,050.00	0.05
316	603505	金石资源	1,400	38,010.00	0.04
317	603859	能科科技	1,000	37,730.00	0.04
318	300291	百纳千成	5,800	37,352.00	0.04
319	002905	金逸影视	3,400	37,264.00	0.04

320	002897	意华股份	1,000	37,160.00	0.04
321	002237	恒邦股份	3,400	36,652.00	0.04
322	688596	正帆科技	921	36,499.23	0.04
323	600225	卓朗科技	9,400	35,720.00	0.04
324	300377	赢时胜	4,600	35,696.00	0.04
325	300671	富满微	1,100	35,563.00	0.04
326	300213	佳讯飞鸿	4,500	32,400.00	0.04
327	600771	广誉远	1,200	32,388.00	0.04
328	688327	云从科技	1,900	32,034.00	0.04
329	605168	三人行	500	31,680.00	0.04
330	002275	桂林三金	2,100	30,429.00	0.03
331	600200	江苏吴中	3,700	30,414.00	0.03
332	300368	汇金股份	4,400	30,008.00	0.03
333	688176	亚虹医药	2,700	29,106.00	0.03
334	002991	甘源食品	400	28,584.00	0.03
335	603583	捷昌驱动	1,400	28,042.00	0.03
336	300860	锋尚文化	500	27,315.00	0.03
337	002662	京威股份	7,700	27,027.00	0.03
338	600713	南京医药	5,500	26,620.00	0.03
339	688680	海优新材	400	26,260.00	0.03
340	300566	激智科技	1,400	26,152.00	0.03
341	600081	东风科技	2,300	25,829.00	0.03
342	603690	至纯科技	1,000	25,700.00	0.03
343	688027	国盾量子	200	25,580.00	0.03
344	688639	华恒生物	200	25,180.00	0.03
345	002977	天箭科技	700	24,794.00	0.03
346	603912	佳力图	2,700	23,841.00	0.03
347	002533	金杯电工	2,900	23,432.00	0.03
348	688131	皓元医药	448	23,322.88	0.03
349	688023	安恒信息	200	22,178.00	0.02
350	688366	昊海生科	200	21,658.00	0.02
351	688408	中信博	300	21,525.00	0.02
352	300260	新莱应材	700	21,301.00	0.02
353	300179	四方达	2,300	20,493.00	0.02
354	688789	宏华数科	200	19,982.00	0.02
355	002859	洁美科技	800	19,960.00	0.02
356	300226	上海钢联	700	19,943.00	0.02
357	688083	中望软件	200	19,908.00	0.02
358	300618	寒锐钴业	700	19,803.00	0.02
359	688239	航宇科技	400	19,108.00	0.02
360	603979	金诚信	500	18,880.00	0.02
361	000030	富奥股份	3,500	18,690.00	0.02
362	600817	宇通重工	1,900	18,240.00	0.02

363	002919	名臣健康	700	17,948.00	0.02
364	002318	久立特材	900	17,892.00	0.02
365	300820	英杰电气	300	17,184.00	0.02
366	688578	艾力斯	410	17,080.60	0.02
367	688630	芯碁微装	200	17,074.00	0.02
368	300679	电连技术	400	16,600.00	0.02
369	603396	金辰股份	300	16,395.00	0.02
370	600761	安徽合力	900	16,389.00	0.02
371	000426	兴业银锡	1,800	16,344.00	0.02
372	600507	方大特钢	3,400	15,674.00	0.02
373	300659	中孚信息	700	15,554.00	0.02
374	688278	特宝生物	297	15,547.95	0.02
375	688007	光峰科技	600	15,528.00	0.02
376	300627	华测导航	500	15,510.00	0.02
377	603279	景津装备	700	15,477.00	0.02
378	300770	新媒股份	400	15,472.00	0.02
379	600285	羚锐制药	900	15,399.00	0.02
380	300685	艾德生物	700	15,386.00	0.02
381	688526	科前生物	752	15,325.76	0.02
382	002913	奥士康	500	15,325.00	0.02
383	300687	赛意信息	700	15,246.00	0.02
384	002960	青鸟消防	1,100	15,224.00	0.02
385	688127	蓝特光学	650	15,138.50	0.02
386	300470	中密控股	400	15,120.00	0.02
387	688322	奥比中光	400	15,032.00	0.02
388	300233	金城医药	900	14,994.00	0.02
389	300143	盈康生命	1,400	14,882.00	0.02
390	600331	宏达股份	2,900	14,877.00	0.02
391	002416	爱施德	1,600	14,864.00	0.02
392	603208	江山欧派	500	14,845.00	0.02
393	300596	利安隆	500	14,780.00	0.02
393	300768	迪普科技	1,000	14,780.00	0.02
394	002645	华宏科技	1,300	14,690.00	0.02
395	600971	恒源煤电	1,300	14,495.00	0.02
396	002421	达实智能	4,500	14,490.00	0.02
397	300109	新开源	800	14,432.00	0.02
398	688389	普门科技	640	14,406.40	0.02
399	601918	新集能源	2,700	14,229.00	0.02
400	603171	税友股份	400	14,152.00	0.02
401	605376	博迁新材	500	14,100.00	0.02
402	002206	海利得	2,800	14,056.00	0.02
403	605090	九丰能源	500	13,965.00	0.02
404	300696	爱乐达	800	13,928.00	0.02

405	600389	江山股份	800	13,920.00	0.02
406	603100	川仪股份	500	13,860.00	0.02
407	002516	旷达科技	2,800	13,804.00	0.02
408	002946	新乳业	1,200	13,776.00	0.02
409	003006	百亚股份	900	13,644.00	0.02
410	603566	普莱柯	600	13,590.00	0.02
411	300762	上海瀚讯	900	13,572.00	0.02
412	603995	甬金股份	700	13,461.00	0.01
413	002233	塔牌集团	1,900	13,452.00	0.01
414	000560	我爱我家	5,900	13,275.00	0.01
415	603368	柳药集团	700	13,244.00	0.01
416	688106	金宏气体	549	13,225.41	0.01
417	000503	国新健康	1,000	13,180.00	0.01
418	002891	中宠股份	500	13,175.00	0.01
419	600572	康恩贝	2,600	13,130.00	0.01
420	300451	创业慧康	2,000	13,100.00	0.01
421	603328	依顿电子	1,600	13,040.00	0.01
422	688031	星环科技	200	13,014.00	0.01
423	000982	中银绒业	8,800	12,936.00	0.01
424	603989	艾华集团	600	12,912.00	0.01
425	600458	时代新材	1,400	12,894.00	0.01
426	600248	陕建股份	3,200	12,864.00	0.01
427	688381	帝奥微	500	12,660.00	0.01
428	600284	浦东建设	2,000	12,600.00	0.01
429	603666	亿嘉和	400	12,556.00	0.01
430	002651	利君股份	1,800	12,456.00	0.01
431	603103	横店影视	700	12,446.00	0.01
432	688088	虹软科技	300	12,312.00	0.01
433	300497	富祥药业	1,300	12,168.00	0.01
434	002746	仙坛股份	1,700	11,968.00	0.01
435	000631	顺发恒业	3,600	11,952.00	0.01
436	688173	希荻微	669	11,767.71	0.01
437	000420	吉林化纤	4,000	11,640.00	0.01
438	002154	报喜鸟	2,000	11,360.00	0.01
439	000517	荣安地产	4,600	11,270.00	0.01
440	600648	外高桥	1,100	10,846.00	0.01
441	600210	紫江企业	2,300	10,810.00	0.01
442	301015	百洋医药	300	10,758.00	0.01
443	002903	宇环数控	400	10,220.00	0.01
444	603466	风语筑	700	10,066.00	0.01
445	603985	恒润股份	400	9,940.00	0.01
446	601126	四方股份	700	9,912.00	0.01
447	688508	芯朋微	200	9,842.00	0.01

448	002851	麦格米特	400	9,840.00	0.01
449	688568	中科星图	200	9,812.00	0.01
450	605222	起帆电缆	500	9,640.00	0.01
451	002918	蒙娜丽莎	700	9,478.00	0.01
452	601965	中国汽研	400	8,824.00	0.01
453	688100	威胜信息	300	8,676.00	0.01
454	600729	重庆百货	300	8,460.00	0.01
455	000923	河钢资源	500	8,400.00	0.01
456	002724	海洋王	1,000	8,220.00	0.01
457	688320	禾川科技	200	8,200.00	0.01
458	603997	继峰股份	600	8,082.00	0.01
459	000685	中山公用	1,100	8,041.00	0.01
460	002214	大立科技	700	8,029.00	0.01
461	002537	海联金汇	1,200	7,992.00	0.01
462	301219	腾远钴业	200	7,874.00	0.01
463	603612	索通发展	500	7,695.00	0.01
464	605009	豪悦护理	200	7,634.00	0.01
465	688499	利元亨	200	7,616.00	0.01
466	000550	江铃汽车	400	7,612.00	0.01
467	301087	可孚医疗	200	7,580.00	0.01
468	300525	博思软件	500	7,460.00	0.01
469	002276	万马股份	700	7,154.00	0.01
470	002226	江南化工	1,600	7,008.00	0.01
471	002990	盛视科技	200	6,906.00	0.01
472	600400	红豆股份	2,400	6,696.00	0.01
473	300674	宇信科技	400	6,512.00	0.01
474	300203	聚光科技	400	6,340.00	0.01
475	002043	兔宝宝	700	6,202.00	0.01
476	301085	亚康股份	100	5,741.00	0.01
477	600320	振华重工	1,700	5,644.00	0.01
478	000682	东方电子	700	5,635.00	0.01
479	603699	纽威股份	400	5,544.00	0.01
480	002443	金洲管道	800	5,480.00	0.01
481	002048	宁波华翔	400	5,204.00	0.01
482	300456	赛微电子	200	4,808.00	0.01
483	603078	江化微	300	4,806.00	0.01
484	300166	东方国信	500	4,700.00	0.01
485	688209	英集芯	261	4,661.46	0.01
486	002314	南山控股	1,600	4,640.00	0.01
487	603105	芯能科技	400	4,632.00	0.01
488	300057	万顺新材	700	4,319.00	0.00
489	688046	药康生物	200	4,030.00	0.00
490	603327	福蓉科技	300	3,999.00	0.00

491	001696	宗申动力	600	3,978.00	0.00
492	300352	北信源	800	3,800.00	0.00
493	601208	东材科技	300	3,714.00	0.00
494	600577	精达股份	800	3,312.00	0.00
495	300369	绿盟科技	300	2,829.00	0.00
496	300579	数字认证	100	2,586.00	0.00
497	688206	概伦电子	100	2,180.00	0.00
498	600186	莲花健康	300	1,815.00	0.00
499	600869	远东股份	400	1,756.00	0.00
500	002284	亚太股份	200	1,754.00	0.00
501	600874	创业环保	300	1,665.00	0.00
502	300975	商络电子	200	1,654.00	0.00
503	603323	苏农银行	300	1,248.00	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	002456	欧菲光	31,900	277,849.00	0.31
2	603861	白云电器	28,000	273,840.00	0.30
3	600860	京城股份	20,200	270,478.00	0.30
4	603887	城地香江	33,600	270,144.00	0.30
5	000529	广弘控股	39,600	268,884.00	0.30
6	600198	大唐电信	40,800	268,056.00	0.30
7	600135	乐凯胶片	33,200	267,924.00	0.30
8	002819	东方中科	10,400	266,344.00	0.29
9	002152	广电运通	21,700	266,042.00	0.29
10	002822	ST 中装	60,600	265,428.00	0.29
11	002268	电科网安	11,800	265,028.00	0.29
12	000626	远大控股	36,300	264,990.00	0.29
13	300024	机器人	22,300	264,701.00	0.29
14	300442	润泽科技	10,400	263,848.00	0.29
15	600345	长江通信	13,600	263,432.00	0.29
16	603689	皖天然气	30,200	262,438.00	0.29
17	605018	长华集团	23,500	260,380.00	0.29
18	601866	中远海发	109,700	256,698.00	0.28
19	601777	力帆科技	71,400	255,612.00	0.28
20	001205	盛航股份	15,600	255,372.00	0.28
21	600740	山西焦化	50,600	255,024.00	0.28
22	600348	华阳股份	26,100	254,736.00	0.28
23	600350	山东高速	36,700	254,698.00	0.28
24	600236	桂冠电力	45,700	253,178.00	0.28
25	600161	天坛生物	8,100	250,614.00	0.28
26	600841	动力新科	42,400	250,584.00	0.28
27	000813	德展健康	73,900	241,653.00	0.27

28	600637	东方明珠	31,600	237,632.00	0.26
29	603110	东方材料	9,700	233,770.00	0.26
30	300741	华宝股份	10,800	231,228.00	0.26
31	603213	镇洋发展	19,400	209,326.00	0.23
32	000151	中成股份	17,700	200,541.00	0.22
33	601139	深圳燃气	28,300	194,987.00	0.22
34	300676	华大基因	3,700	177,600.00	0.20
35	300829	金丹科技	8,500	177,480.00	0.20
36	603228	景旺电子	7,300	164,688.00	0.18
37	600399	抚顺特钢	16,500	160,380.00	0.18
38	600612	老凤祥	2,200	151,800.00	0.17
39	600381	青海春天	18,700	144,551.00	0.16
40	600998	九州通	19,600	137,396.00	0.15
41	002813	路畅科技	3,900	136,656.00	0.15
42	002161	远望谷	22,300	122,650.00	0.14
43	002472	双环传动	4,700	122,294.00	0.14
44	002575	群兴玩具	19,800	111,672.00	0.12
45	603025	大豪科技	7,300	96,798.00	0.11
46	600152	维科技术	12,400	90,272.00	0.10
47	002320	海峡股份	12,900	75,207.00	0.08
48	000665	湖北广电	13,100	62,880.00	0.07
49	301293	三博脑科	1,000	62,420.00	0.07
50	300631	久吾高科	1,900	55,423.00	0.06
51	601158	重庆水务	7,700	43,659.00	0.05
52	300271	华宇软件	2,700	22,113.00	0.02
53	000050	深天马 A	1,800	19,170.00	0.02
54	301165	锐捷网络	400	15,156.00	0.02
55	600872	中炬高新	500	14,050.00	0.02
56	002249	大洋电机	2,700	13,419.00	0.01
56	601222	林洋能源	2,100	13,419.00	0.01
57	002706	良信股份	1,500	13,245.00	0.01
58	600688	上海石化	4,600	13,156.00	0.01
59	300027	华谊兄弟	4,900	13,132.00	0.01
60	000627	天茂集团	4,500	12,780.00	0.01
61	601333	广深铁路	4,900	12,691.00	0.01
62	603298	杭叉集团	500	12,440.00	0.01
63	000951	中国重汽	900	12,024.00	0.01
64	002984	森麒麟	400	11,540.00	0.01
65	300476	胜宏科技	500	9,225.00	0.01
66	300068	南都电源	700	9,058.00	0.01
67	000528	柳工	1,300	8,762.00	0.01
68	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.01
69	301526	国际复材	1,546	6,879.70	0.01



70	002217	合力泰	2,500	6,800.00	0.01
71	688653	康希通信	424	6,779.76	0.01
72	301508	中机认检	252	6,723.36	0.01
73	688648	中邮科技	297	6,364.71	0.01
74	002617	露笑科技	1,000	6,200.00	0.01
75	301516	中远通	397	6,157.47	0.01
76	601567	三星医疗	300	6,150.00	0.01
77	000921	海信家电	300	6,120.00	0.01
78	600246	万通发展	900	5,841.00	0.01
79	301566	达利凯普	257	5,689.98	0.01
80	301568	思泰克	156	5,550.48	0.01
81	301413	安培龙	84	4,887.96	0.01
82	603010	万盛股份	400	4,316.00	0.00
83	002402	和而泰	300	4,287.00	0.00
84	300604	长川科技	100	3,799.00	0.00
85	002701	奥瑞金	900	3,726.00	0.00
86	301459	丰茂股份	93	3,705.12	0.00
87	001326	联域股份	75	3,648.00	0.00
88	002219	新里程	1,200	3,636.00	0.00
89	600536	中国软件	100	3,626.00	0.00
90	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
91	301578	辰奕智能	49	3,347.68	0.00
92	001306	夏厦精密	36	2,712.96	0.00
93	603107	上海汽配	138	2,510.22	0.00
94	603062	麦加芯彩	41	2,370.21	0.00
95	001239	永达股份	108	2,151.36	0.00
96	601375	中原证券	500	1,915.00	0.00
97	600641	万业企业	100	1,726.00	0.00
98	001358	兴欣新材	28	1,236.48	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300036	超图软件	1,941,775.00	2.15
2	300168	万达信息	1,938,924.00	2.14
3	000811	冰轮环境	1,922,594.00	2.13
4	002467	二六三	1,888,450.00	2.09
5	300232	洲明科技	1,870,871.00	2.07
6	002803	吉宏股份	1,865,316.00	2.06
7	002913	奥士康	1,829,158.00	2.02
8	002233	塔牌集团	1,762,311.00	1.95
9	000589	贵州轮胎	1,759,788.00	1.95

10	002212	天融信	1,746,853.00	1.93
11	600459	贵研铂业	1,722,646.00	1.91
12	600210	紫江企业	1,673,357.00	1.85
13	002335	科华数据	1,661,137.00	1.84
14	300378	鼎捷软件	1,652,300.00	1.83
15	300228	富瑞特装	1,651,771.00	1.83
16	300729	乐歌股份	1,646,839.00	1.82
17	300188	国投智能	1,639,470.00	1.81
18	600094	大名城	1,614,801.00	1.79
19	300872	天阳科技	1,603,909.79	1.77
20	603887	城地香江	1,579,134.00	1.75

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002913	奥士康	1,761,298.00	1.95
2	000811	冰轮环境	1,723,040.00	1.91
3	600789	鲁抗医药	1,696,614.00	1.88
4	002467	二六三	1,668,188.00	1.84
5	002233	塔牌集团	1,636,938.00	1.81
6	300036	超图软件	1,626,115.00	1.80
7	300729	乐歌股份	1,614,519.48	1.79
8	600459	贵研铂业	1,614,303.00	1.79
9	300232	洲明科技	1,613,159.00	1.78
10	600211	西藏药业	1,588,378.00	1.76
11	002462	嘉事堂	1,575,384.00	1.74
12	600129	太极集团	1,560,521.00	1.73
13	603068	博通集成	1,538,097.00	1.70
14	301389	隆扬电子	1,535,320.00	1.70
15	002413	雷科防务	1,530,552.00	1.69
16	600210	紫江企业	1,521,596.00	1.68
17	600285	羚锐制药	1,517,481.00	1.68
18	300303	聚飞光电	1,514,543.00	1.68
19	002212	天融信	1,484,704.00	1.64
20	300168	万达信息	1,464,704.00	1.62

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	566,175,724.74
卖出股票收入（成交）总额	484,580,132.05

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）	70,904.86	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,904.86	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	460	46,003.02	0.05
2	118046	诺泰转债	200	20,001.49	0.02
3	127100	神码转债	49	4,900.35	0.01

### 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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在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	420,955.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,266,346.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,687,301.73

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
景顺长城国证 2000 指数增强 A	326	39,160.68	99,071.29	0.78	12,667,309.50	99.22
景顺长城国证 2000 指数增强 C	1,502	52,167.98	10,006.14	0.01	78,346,306.25	99.99
合计	1,828	49,848.30	109,077.43	0.12	91,013,615.75	99.88

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	景顺长城国证 2000 指数增强 A	17.01	0.000133
	景顺长城国证 2000 指数增强 C	35.09	0.000045
	合计	52.10	0.000057

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

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

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城国证 2000 指数增强 A	景顺长城国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 9 月 5 日) 基金份额总额	27,540,194.77	225,717,977.93
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	1,148,244.24	25,786,573.80
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	15,922,058.22	173,148,239.34
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	12,766,380.79	78,356,312.39

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：

自 2023 年 12 月 28 日起，孙沛涛先生任托管部行政负责人，吴俊文女士不再担任托管部行政负责人。

## 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

本基金聘请的普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已经连续 1 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 (%)	
中信证券股份有限公司	5	524,262,424.15	49.92	275,324.23	49.92	-
中信证券(山东)有限责任公司	2	525,964,553.06	50.08	276,255.09	50.08	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

#### 1) 选择标准

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

#### 2) 选择程序

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

券经营机构签订协议。

2、本基金本期交易单元均为新增。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券股份有限公司	15,029.43	25.95	-	-	-	-
中信证券(山东)有限责任公司	42,893.13	74.05	-	-	-	-

### 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	景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 15 日
2	景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 15 日
3	景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 15 日
4	景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 15 日
5	景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 15 日
6	景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 15 日
7	关于景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金新增平安银行等多家公 司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 21 日
8	景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金新增腾安基金为销售机构的 公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 22 日
9	关于景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金新增申万宏源证券和申 万宏源西部证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 25 日



10	关于景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金新增信达证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 28 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广发银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 28 日
12	关于景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金新增国元证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 8 月 29 日
13	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
14	关于景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同生效的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 6 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万家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 15 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 9 月 22 日
17	关于景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金参加部分销售机构申购及/或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 10 月 10 日
18	景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金关于开放日常申购、赎回、转换及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 10 月 10 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金在直销网上交易系统开展申购、定投和转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 10 月 11 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 10 月 14 日
21	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
22	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
23	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的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 17 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 11 月 20 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 11 月 25 日

26	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 9 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 12 月 16 日
28	关于景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金新增国金证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 21 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 23 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城国证 2000 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城国证 2000 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