

景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放
式指数证券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46

7.6 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	46
7.7 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	46
7.8 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	46
7.9 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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末上市基金前十名持有人	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.4 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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证红利低波动 100ETF
场内简称	红利 100（扩位证券简称：红利低波 100ETF）
基金主代码	515100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 22 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	497,441,529.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 7 月 3 日

注：自 2023 年 8 月 28 日起，本基金扩位证券简称由“红利 100ETF”变更为“红利低波 100ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	<p>本基金以中证红利低波动 100 指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>本基金将在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资及转融通交易。本基金将基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。若相关融资及转融通业务法律法规发生变化，本基金将从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p>

业绩比较基准	中证红利低波动 100 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95559
传真	0755-22381339	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518048	200336
法定代表人	李进	任德奇

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	35,181,200.17
本期利润	17,336,663.32
加权平均基金份额本期利润	0.0705
本期加权平均净值利润率	4.14%
本期基金份额净值增长率	12.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	356,150,663.81
期末可供分配基金份额利润	0.7160
期末基金资产净值	853,592,192.81
期末基金份额净值	1.7160

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	71.60%

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、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。

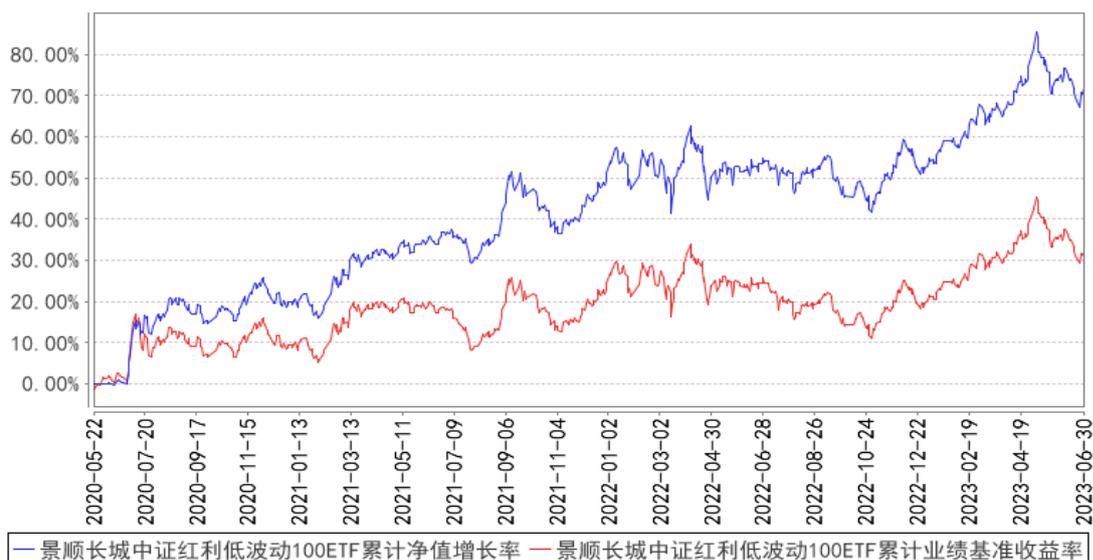
3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.16%	0.78%	-2.51%	0.80%	1.35%	-0.02%
过去三个月	3.34%	0.90%	1.29%	0.92%	2.05%	-0.02%
过去六个月	12.59%	0.79%	10.29%	0.81%	2.30%	-0.02%
过去一年	11.40%	0.83%	5.89%	0.85%	5.51%	-0.02%
过去三年	70.66%	0.96%	30.13%	1.00%	40.53%	-0.04%
自基金合同生效起至今	71.60%	0.95%	31.91%	0.99%	39.69%	-0.04%

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

景顺长城中证红利低波动100ETF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：基金的投资组合比例为：基金投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的建仓期为自 2020 年 5 月 22 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。

3.3 其他指标

无。

§ 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 6 月 30 日，本公司旗下共管理 175 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		
张 晓 南	本基金的基金经理	2020 年 5 月 22 日	-	13 年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 13 年证券、基金行业从业经验。
郑 天 行	本基金的基金经理	2023 年 2 月 10 日	-	9 年	理学硕士，CFA。曾任美国摩根斯坦利（纽约）对冲基金投资组合分析员，美国 Aristeia 基金（纽约）数据分析员，美国城堡基金（纽约）大数据研究员。2019 年

					5 月加入本公司，历任养老及资产配置部研究员、ETF 投资部研究员、专户投资部投资经理，自 2022 年 8 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 9 年证券、基金行业从业经验。
金璜	本基金的基金经理助理	2022 年 8 月 2 日	-	7 年	工学硕士，CFA。曾任美国 AltfestPersonalWealthManagement（艾福斯特个人财富管理）投资部量化研究员，Morgan Stanley（美国摩根士丹利）风险管理部信用风险分析员。2018 年 7 月加入本公司，历任风险管理部经理、ETF 与创新投资部研究员，现任基金经理助理。具有 7 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。

4.2 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、《景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 17 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

今年上半年，A 股权益市场整体表现较为平稳但结构上有所分化，主要宽基指数涨跌幅及排序为：科创 50(4.71%)>上证指数(3.65%)>沪深 300(-0.75%)>中小 100(-1.84%)>创业板指(-5.61%)。市值维度，总体表现出小盘占优特征，规模指数涨跌幅及排序为：中证 1000(5.10%)>中证 500(2.29%)>沪深 300(-0.75%)。风格维度，中信风格指数涨跌幅及排序为：稳定(10.12%)>成长(7.80%)>周期(1.29%)>金融(-0.72%)>消费(-2.52%)。行业维度，涨跌幅排前五行业为：通信(50.66%)、传媒(42.75%)、计算机(27.57%)、机械设备(13.44%)、家用电器(13.29%)，排后五行业为：商贸零售(-23.44%)、房地产(-14.29%)、美容护理(-13.61%)、建筑材料(-10.52%)、综合(-9.62%)。

本基金采用复制标的指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况、标的指数成分调整情况定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年上半年，本基金份额净值增长率为 12.59%，业绩比较基准收益率为 10.29%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.20%以内，跟踪误差（年化）控制在 2%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观数据层面，主要经济活动指标：5 月工业增加值同比增长 3.5%，前值 5.6%，经季度调整后环比增长 0.63%；5 月 PMI48.8，6 月 PMI49；5 月社会消费品零售总额同比增长 12.7%，前值 18.40%。通胀指标：5 月 PPI 同比-4.6%，前值-3.6%；5 月 CPI 当月同比 0.2%，前值 0.1%。货币金融指标：5 月 M2 同比增长 11.6%，前值 12.4%；5 月社会融资规模同比增长 9.5%，前值 10.0%。总体来看，增长斜率有所放缓，但保持良好的复苏态势，同时通胀在高基数下保持稳步回落态势。

权益市场的长期趋势反映上市公司总体盈利能力的逐步提升，背后的驱动力是经济长期增长动能以及科技升级、产业升级带来的生产力提升。目前主要宽基指数估值水平处在历史低位，在

经济复苏大背景下，权益市场配置价值凸显。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 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。

4.8 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，基金托管人在景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金的

托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，景顺长城基金管理有限公司在景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,629,489.61	2,181,407.12
结算备付金		861,234.87	30,994.17
存出保证金		62,467.74	17,411.76
交易性金融资产	6.4.7.2	843,966,991.72	194,127,823.86
其中：股票投资		843,966,991.72	194,127,823.86
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-

应收清算款		3,581,767.86	13,584,929.26
应收股利		291,736.38	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	8,363.74	-
资产总计		859,402,051.92	209,942,566.17
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,323,780.25	12,424,430.70
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		348,077.21	67,069.87
应付托管费		69,615.43	13,414.01
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,059.18	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,067,327.04	1,681,148.25
负债合计		5,809,859.11	14,186,062.83
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	497,441,529.00	128,441,529.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	356,150,663.81	67,314,974.34
净资产合计		853,592,192.81	195,756,503.34
负债和净资产总计		859,402,051.92	209,942,566.17

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.7160 元，基金份额总额 497,441,529.00 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		18,739,384.27	2,598,368.90
1. 利息收入		71,003.91	9,039.34

其中：存款利息收入	6.4.7.13	22,464.57	9,039.34
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		48,539.34	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		35,966,817.92	4,892,122.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	19,272,066.64	2,068,558.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	30,224.72
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	16,694,751.28	2,793,339.39
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-17,844,536.85	-2,511,394.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	546,099.29	208,601.34
减：二、营业总支出		1,402,720.95	522,973.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,030,247.92	308,317.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	206,049.57	61,663.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		174.75	0.19
8. 其他费用	6.4.7.23	166,248.71	152,992.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,336,663.32	2,075,394.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,336,663.32	2,075,394.93

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		17,336,663.32	2,075,394.93

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	128,441,529.00	-	67,314,974.34	195,756,503.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	128,441,529.00	-	67,314,974.34	195,756,503.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	369,000,000.00	-	288,835,689.47	657,835,689.47
（一）、综合收益总额	-	-	17,336,663.32	17,336,663.32
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	369,000,000.00	-	271,499,026.15	640,499,026.15
其中：1. 基金申购款	489,000,000.00	-	361,010,895.18	850,010,895.18
2. 基金赎回款	-120,000,000.00	-	-89,511,869.03	-209,511,869.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收	-	-	-	-

益				
四、本期期末净资产(基金净值)	497,441,529.00	-	356,150,663.81	853,592,192.81
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	52,941,529.00	-	27,104,859.62	80,046,388.62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	52,941,529.00	-	27,104,859.62	80,046,388.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	41,000,000.00	-	23,664,548.92	64,664,548.92
(一)、综合收益总额	-	-	2,075,394.93	2,075,394.93
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	41,000,000.00	-	21,589,153.99	62,589,153.99
其中：1. 基金申购款	70,000,000.00	-	36,549,133.91	106,549,133.91
2. 基金赎回款	-29,000,000.00	-	-14,959,979.92	-43,959,979.92
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	93,941,529.00	-	50,769,408.54	144,710,937.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金(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[2019]379 号《关于准予景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》和机构部函[2019]2565 号《景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金延期募集备案的回函》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《景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,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 1,276,941,529.00 元(含募集股票市值),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(2020)第 0397 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,276,941,529.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]172 号文审核同意,本基金 1,276,941,529.00 份基金份额于 2020 年 7 月 3 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证红利低波动 100 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股,投资于标的指数成份股及备选成份股的资产不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、股指期货、权证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准

为中证红利低波动 100 指数收益率。

本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“景顺长城中证红利低波动 100 ETF 发起式联接基金”)。景顺长城中证红利低波动 100ETF 发起式联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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 2023 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 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》、本基金基金合同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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年半年度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 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 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》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。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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	10,629,489.61
等于：本金	10,627,391.24
加：应计利息	2,098.37
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	10,629,489.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	866,273,041.58	-	843,966,991.72	-22,306,049.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	866,273,041.58	-	843,966,991.72	-22,306,049.86

注：于 2023 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	8,363.74
待摊费用	-
合计	8,363.74

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	838,694.07
其中：交易所市场	838,694.07
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	134,302.56
应付指数使用费	44,931.56
应退替代款	1,043,633.75
可退替代款	5,765.10
合计	2,067,327.04

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,441,529.00	128,441,529.00
本期申购	489,000,000.00	489,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-120,000,000.00	-120,000,000.00
本期末	497,441,529.00	497,441,529.00

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	92,190,655.51	-24,875,681.17	67,314,974.34
本期利润	35,181,200.17	-17,844,536.85	17,336,663.32
本期基金份额交易产生的变动数	277,787,162.43	-6,288,136.28	271,499,026.15
其中：基金申购款	371,480,096.62	-10,469,201.44	361,010,895.18
基金赎回款	-93,692,934.19	4,181,065.16	-89,511,869.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	405,159,018.11	-49,008,354.30	356,150,663.81

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
活期存款利息收入	19,308.53	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	2,918.43	
其他	237.61	
合计	22,464.57	

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 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6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	14,791,669.85	
股票投资收益——赎回差价收入	4,480,396.79	
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	19,272,066.64	

6.4.7.14.2 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6月30日	
卖出股票成交总额	424,780,050.19	
减：卖出股票成本总额	408,510,784.95	
减：交易费用	1,477,595.39	
买卖股票差价收入	14,791,669.85	

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	

赎回基金份额对价总额	209,511,869.03
减：现金支付赎回款总额	61,887,304.03
减：赎回股票成本总额	143,144,168.21
减：交易费用	-
赎回差价收入	4,480,396.79

6.4.7.14.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,694,751.28
其中：证券出借权益补偿收	387,253.38

入	
基金投资产生的股利收益	-
合计	16,694,751.28

6.4.7.20 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6月30日
1. 交易性金融资产	-17,844,536.85
股票投资	-17,844,536.85
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	-
权证投资	-
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	-17,844,536.85

注：本基金本报告期公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益0.00元。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	546,099.29
合计	546,099.29

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	24,795.19

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,014.59
指数使用费	79,931.56
合计	166,248.71

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的季费率计提，逐日累计，按季支付。本基金当季日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限调整为每季度人民币 3.5 万元，当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费无收取下限。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东
景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“景顺长城中证红利低波动 100ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,030,247.92	308,317.46
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	206,049.57	61,663.46

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例(%)
景顺长城中证红利低波动 100ETF 发起式联接基金	51,314,600.00	10.3200	15,781,600.00	12.2900

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期	10,629,489.61	19,308.53	2,379,555.15	7,801.61

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 1,658,500 股托管人交通银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 9,248,921.73 元，估值总额为人民币 9,619,300.00 元，占基金资产净值的比例为 1.13% (2022 年 12 月 31 日：本基金持有 426,700 股托管人交通银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 2,022,922.87 元，估值总额为人民币 2,022,558.00 元，占基金净资产的比例为 1.03%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	335	3,979.80	7,041.70	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	101	2,088.68	2,574.49	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	147	2,260.86	2,185.89	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	50	2,224.00	1,974.00	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	202	8,322.40	8,623.38	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	180	8,303.40	6,192.00	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	242	12,100.00	7,431.82	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301307	美利信	2023年4月14日	6个月	新股流通受限	32.34	31.86	312	10,090.08	9,940.32	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股流通受限	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	173	13,286.40	18,675.35	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	720	10,663.20	9,885.60	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	77	5,655.65	3,591.28	-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	146	7,300.00	7,064.94	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股流通受限	71.88	92.60	104	7,475.52	9,630.40	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	248	7,437.52	5,899.92	-
301397	溯联股份	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	269	5,377.31	4,546.10	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-

301486	致尚科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	6.58	7.58	742	4,882.36	5,624.36	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	285	2,952.60	3,374.40	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	263	3,066.58	3,224.38	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	87	2,260.26	2,134.11	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	245	4,361.00	4,383.05	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	219	7,916.85	8,350.47	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	1,876	37,257.36	33,880.56	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	689	8,336.90	8,316.23	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	306	7,221.60	19,789.02	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	224	5,971.84	7,056.00	-
688435	英方软件	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	38.66	73.03	1,628	62,938.48	118,892.84	-
688443	智翔金泰	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	37.88	29.49	1,508	57,123.04	44,470.92	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	75.00	90.76	127	9,525.00	11,526.52	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	3,540	20,142.60	19,151.40	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	2,164	24,020.40	36,874.56	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	261	8,487.72	11,058.57	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	33.99	29.49	230	7,817.70	6,782.70	-
688502	茂莱光学	2023年2月28日	6个月	新股流通受限	69.72	178.59	995	69,371.40	177,697.05	-
688531	日联科技	2023年3月24日	6个月	新股流通受限	152.38	135.97	81	12,342.78	11,013.57	-
688535	华海诚科	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	35.00	51.23	156	5,460.00	7,991.88	-
688543	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688562	航天软件	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	12.68	22.31	656	8,318.08	14,635.36	-
688576	西山科技	2023年5月30日	6个月	新股流通受限	135.80	120.41	200	27,160.00	24,082.00	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023年6月15日	6个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	二元科技	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	125.88	86.79	150	18,882.00	13,018.50	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	------	------	--------	-------	--------	--------	----

				单 价						
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.40	1,318,600	9,019,780.01	9,190,642.00	-

注：本基金截至 2023 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（单位： 股）	期末估值总额
1	000039	中集集团	2023年7月11日	6.89	153,900	1,060,371.00
2	000401	冀东水泥	2023年7月11日	7.37	100,000	737,000.00
3	000402	金融街	2023年7月10日	4.52	171,100	773,372.00
4	000559	万向钱潮	2023年7月10日	5.45	109,700	597,865.00
5	000783	长江证券	2023年7月11日	5.80	199,800	1,158,840.00
6	000898	鞍钢股份	2023年7月10日	2.78	319,400	887,932.00
7	000932	华菱钢铁	2023年7月11日	4.77	249,500	1,190,115.00
8	002030	达安基因	2023年7月11日	9.97	66,000	658,020.00
9	002110	三钢闽光	2023年7月11日	4.22	200,000	844,000.00
10	002233	塔牌集团	2023年7月11日	7.72	100,000	772,000.00
11	002563	森马服饰	2023年7月10日	6.22	241,800	1,503,996.00
12	002958	青农商行	2023年7月11日	2.72	251,700	684,624.00
13	002966	苏州银行	2023年7月10日	6.55	34,600	226,630.00
14	600008	首创环保	2023年7月10日	2.88	256,900	739,872.00
15	600170	上海建工	2023年7月11日	2.69	300,000	807,000.00
16	600282	南钢股份	2023年7月11日	3.37	300,000	1,011,000.00
17	600352	浙江龙盛	2023年7月11日	9.35	90,800	848,980.00
18	600390	五矿资本	2023年7月10日	5.38	113,300	609,554.00
19	600598	北大荒	2023年7月10日	13.33	47,000	626,510.00
20	600623	华谊集团	2023年7月10日	6.23	99,500	619,885.00
21	600642	申能股份	2023年7月10日	6.99	98,900	691,311.00
22	600648	外高桥	2023年7月11日	11.31	93,900	1,062,009.00
23	600655	豫园股份	2023年7月11日	6.86	155,500	1,066,730.00
24	600663	陆家嘴	2023年7月10日	9.87	91,300	901,131.00
25	600674	川投能源	2023年7月11日	15.05	52,700	793,135.00

26	600704	物产中大	2023 年 7 月 10 日	4.94	159,700	788,918.00
27	600867	通化东宝	2023 年 7 月 10 日	10.44	53,100	554,364.00
28	600901	江苏金租	2023 年 7 月 10 日	4.13	206,080	851,110.40
29	600928	西安银行	2023 年 7 月 10 日	3.52	126,000	443,520.00
30	601006	大秦铁路	2023 年 7 月 11 日	7.43	200,000	1,486,000.00
31	601019	山东出版	2023 年 7 月 10 日	9.17	51,300	470,421.00
32	601077	渝农商行	2023 年 7 月 11 日	3.59	343,900	1,234,601.00
33	601098	中南传媒	2023 年 7 月 11 日-2023 年 7 月 13 日	11.60	103,500	1,200,600.00
34	601128	常熟银行	2023 年 7 月 11 日	6.82	38,500	262,570.00
35	601298	青岛港	2023 年 7 月 11 日	6.97	177,600	1,237,872.00
36	601577	长沙银行	2023 年 7 月 10 日	7.76	41,000	318,160.00
37	601598	中国外运	2023 年 7 月 11 日	4.66	227,300	1,059,218.00
38	601866	中远海发	2023 年 7 月 11 日	2.47	430,500	1,063,335.00
39	601992	金隅集团	2023 年 7 月 11 日	2.18	668,100	1,456,458.00
40	601997	贵阳银行	2023 年 7 月 11 日	5.16	178,600	921,576.00
41	688009	中国通号	2023 年 7 月 10 日	5.80	110,300	639,740.00
合计	-	-	-	-	7,012,780	34,860,345.40

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、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，本基金未持有除国债、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（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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 6.4.12。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	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							
银行存款	10,629,489.61	-	-	-	-	-	10,629,489.61
结算备付金	861,234.87	-	-	-	-	-	861,234.87
存出保证金	62,467.74	-	-	-	-	-	62,467.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-843,966,991.72	843,966,991.72
应收股利	-	-	-	-	-	291,736.38	291,736.38

应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,581,767.86	3,581,767.86
其他资产	-	-	-	-	-	8,363.74	8,363.74
资产总计	11,553,192.22	-	-	-	-	847,848,859.70	859,402,051.92
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	348,077.21	348,077.21
应付托管费	-	-	-	-	-	69,615.43	69,615.43
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,323,780.25	3,323,780.25
应交税费	-	-	-	-	-	1,059.18	1,059.18
其他负债	-	-	-	-	-	2,067,327.04	2,067,327.04
负债总计	-	-	-	-	-	5,809,859.11	5,809,859.11
利率敏感度缺口	11,553,192.22	-	-	-	-	-	-
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							
银行存款	2,181,407.12	-	-	-	-	-	2,181,407.12
结算备付金	30,994.17	-	-	-	-	-	30,994.17
存出保证金	17,411.76	-	-	-	-	-	17,411.76
交易性金融资产	-	-	-	-	-	194,127,823.86	194,127,823.86
应收证券清算款	-	-	-	-	-	13,584,929.26	13,584,929.26
资产总计	2,229,813.05	-	-	-	-	207,712,753.12	209,942,566.17
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	67,069.87	67,069.87
应付托管费	-	-	-	-	-	13,414.01	13,414.01
应付证券清算款	-	-	-	-	-	12,424,430.70	12,424,430.70
其他负债	-	-	-	-	-	1,681,148.25	1,681,148.25
负债总计	-	-	-	-	-	14,186,062.83	14,186,062.83
利率敏感度缺口	2,229,813.05	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券资产（上年度末：同），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）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	843,966,991.72	98.87	194,127,823.86	99.17
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	843,966,991.72	98.87	194,127,823.86	99.17

6.4.13.4.3.2 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6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	25,494,704.45	6,349,311.98
	沪深 300 指数下降 5%	-25,494,704.45	-6,349,311.98

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	833,183,523.66	194,026,503.88
第二层次	9,813,302.86	-
第三层次	970,165.20	101,319.98
合计	843,966,991.72	194,127,823.86

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	843,966,991.72	98.20
	其中：股票	843,966,991.72	98.20

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	11,490,724.48	1.34
8	其他各项资产	3,944,335.72	0.46
9	合计	859,402,051.92	100.00

注：权益投资中参与转融通证券出借业务出借证券公允价值为 34,860,345.40 元，占基金资产净值的比例为 4.08%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	6,273,098.00	0.73
B	采矿业	12,026,569.20	1.41
C	制造业	368,367,818.77	43.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,197,887.43	5.76
E	建筑业	27,113,807.00	3.18
F	批发和零售业	23,861,509.57	2.80
G	交通运输、仓储和邮政业	80,901,342.60	9.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,245,052.00	0.73
J	金融业	219,953,072.18	25.77
K	房地产业	29,541,019.11	3.46
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-

R	文化、体育和娱乐业	18,892,989.80	2.21
S	综合	-	-
	合计	842,374,165.66	98.69

7.2.2 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	1,318,789.72	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	5,599.89	0.00
F	批发和零售业	12,666.06	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	175,953.58	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	6,192.00	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,592,826.06	0.19

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 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

7.3.1 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	002110	三钢闽光	5,765,500	24,330,410.00	2.85
2	601006	大秦铁路	2,799,500	20,800,285.00	2.44

3	000895	双汇发展	776,707	19,021,554.43	2.23
4	000789	万年青	2,347,300	18,191,575.00	2.13
5	600177	雅戈尔	2,710,002	17,100,112.62	2.00
6	600782	新钢股份	4,502,700	16,705,017.00	1.96
7	000651	格力电器	444,300	16,221,393.00	1.90
8	002563	森马服饰	2,421,300	15,060,486.00	1.76
9	002233	塔牌集团	1,810,300	13,975,516.00	1.64
10	600282	南钢股份	4,077,900	13,742,523.00	1.61
11	000717	中南股份	4,921,700	13,682,326.00	1.60
12	600170	上海建工	5,057,700	13,605,213.00	1.59
13	600019	宝钢股份	2,400,700	13,491,934.00	1.58
14	600064	南京高科	1,929,851	12,756,315.11	1.49
15	002440	闰土股份	1,805,700	12,044,019.00	1.41
16	600028	中国石化	1,890,970	12,026,569.20	1.41
17	601169	北京银行	2,591,900	12,000,497.00	1.41
18	600104	上汽集团	846,100	11,989,237.00	1.40
19	002042	华孚时尚	3,658,200	11,486,748.00	1.35
20	600398	海澜之家	1,662,800	11,440,064.00	1.34
21	601000	唐山港	3,152,220	11,127,336.60	1.30
22	601992	金隅集团	5,006,241	10,913,605.38	1.28
23	600016	民生银行	2,890,000	10,837,500.00	1.27
24	600269	赣粤高速	2,933,800	10,767,046.00	1.26
25	000401	冀东水泥	1,439,300	10,607,641.00	1.24
26	600273	嘉化能源	1,079,700	10,170,774.00	1.19
27	601211	国泰君安	700,000	9,793,000.00	1.15
28	601398	工商银行	2,003,800	9,658,316.00	1.13
29	601328	交通银行	1,658,500	9,619,300.00	1.13
30	601229	上海银行	1,667,782	9,589,746.50	1.12
31	601288	农业银行	2,674,300	9,440,279.00	1.11
32	000157	中联重科	1,393,600	9,406,800.00	1.10
33	601077	渝农商行	2,577,500	9,253,225.00	1.08
34	601298	青岛港	1,318,600	9,190,642.00	1.08
35	601988	中国银行	2,324,900	9,090,359.00	1.06
36	600663	陆家嘴	915,600	9,036,972.00	1.06
37	000932	华菱钢铁	1,869,400	8,917,038.00	1.04
38	000898	鞍钢股份	3,198,600	8,892,108.00	1.04
39	000783	长江证券	1,497,900	8,687,820.00	1.02
40	600900	长江电力	390,500	8,614,430.00	1.01
41	600901	江苏金租	2,063,900	8,523,907.00	1.00
42	003816	中国广核	2,716,500	8,448,315.00	0.99
43	601098	中南传媒	726,318	8,425,288.80	0.99
44	600000	浦发银行	1,154,700	8,360,028.00	0.98
45	600655	豫园股份	1,165,300	7,993,958.00	0.94

46	601939	建设银行	1,276,700	7,992,142.00	0.94
47	601866	中远海发	3,225,200	7,966,244.00	0.93
48	600648	外高桥	704,247	7,965,033.57	0.93
49	000039	中集集团	1,153,100	7,944,859.00	0.93
50	601598	中国外运	1,703,800	7,939,708.00	0.93
51	600704	物产中大	1,599,700	7,902,518.00	0.93
52	000402	金融街	1,714,100	7,747,732.00	0.91
53	600837	海通证券	823,400	7,591,748.00	0.89
54	600126	杭钢股份	1,735,500	7,532,070.00	0.88
55	600999	招商证券	546,460	7,415,462.20	0.87
56	600008	首创环保	2,573,700	7,412,256.00	0.87
57	000538	云南白药	140,100	7,352,448.00	0.86
58	601818	光大银行	2,337,200	7,175,204.00	0.84
59	000900	现代投资	1,720,200	6,932,406.00	0.81
60	600642	申能股份	991,200	6,928,488.00	0.81
61	601997	贵阳银行	1,337,410	6,901,035.60	0.81
62	600846	同济科技	603,300	6,756,960.00	0.79
63	600820	隧道股份	1,123,400	6,751,634.00	0.79
64	600015	华夏银行	1,209,500	6,543,395.00	0.77
65	688009	中国通号	1,105,609	6,412,532.20	0.75
66	600352	浙江龙盛	680,300	6,360,805.00	0.75
67	601139	深圳燃气	867,867	6,326,750.43	0.74
68	600598	北大荒	470,600	6,273,098.00	0.73
69	600637	东方明珠	798,600	6,245,052.00	0.73
70	000778	新兴铸管	1,524,800	6,221,184.00	0.73
71	600623	华谊集团	997,100	6,211,933.00	0.73
72	600018	上港集团	1,176,700	6,177,675.00	0.72
73	601688	华泰证券	446,300	6,145,551.00	0.72
74	600390	五矿资本	1,134,000	6,100,920.00	0.71
75	000559	万向钱潮	1,099,200	5,990,640.00	0.70
76	600674	川投能源	395,000	5,944,750.00	0.70
77	000156	华数传媒	661,100	5,751,570.00	0.67
78	601766	中国中车	883,153	5,740,494.50	0.67
79	600867	通化东宝	532,600	5,560,344.00	0.65
80	600025	华能水电	774,600	5,522,898.00	0.65
81	000725	京东方 A	1,317,400	5,388,166.00	0.63
82	600887	伊利股份	188,252	5,331,296.64	0.62
83	002958	青农商行	1,886,604	5,131,562.88	0.60
84	002030	达安基因	494,500	4,930,165.00	0.58
85	601019	山东出版	514,300	4,716,131.00	0.55
86	600928	西安银行	1,262,100	4,442,592.00	0.52
87	601166	兴业银行	258,900	4,051,785.00	0.47
88	601860	紫金银行	1,542,600	3,871,926.00	0.45

89	002948	青岛银行	1,143,800	3,580,094.00	0.42
90	601009	南京银行	414,400	3,315,200.00	0.39
91	601577	长沙银行	411,300	3,191,688.00	0.37
92	600919	江苏银行	426,200	3,132,570.00	0.37
93	601998	中信银行	495,500	2,963,090.00	0.35
94	603323	苏农银行	614,300	2,586,203.00	0.30
95	601658	邮储银行	501,700	2,453,313.00	0.29
96	002966	苏州银行	346,000	2,266,300.00	0.27
97	002839	张家港行	534,800	2,262,204.00	0.27
98	600908	无锡银行	374,900	2,009,464.00	0.24
99	600926	杭州银行	170,900	2,008,075.00	0.24
100	601128	常熟银行	288,500	1,967,570.00	0.23

7.3.2 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	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
2	688502	茂莱光学	995	177,697.05	0.02
3	688435	英方软件	1,628	118,892.84	0.01
4	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
5	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
6	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
7	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
8	688443	智翔金泰	1,508	44,470.92	0.01
9	688472	阿特斯	2,164	36,874.56	0.00
10	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
11	688249	晶合集成	1,876	33,880.56	0.00
12	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
13	688576	西山科技	200	24,082.00	0.00
14	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
15	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
16	688361	中科飞测	306	19,789.02	0.00
17	688469	中芯集成	3,540	19,151.40	0.00
18	301325	曼恩斯特	173	18,675.35	0.00
19	688562	航天软件	656	14,635.36	0.00
20	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
21	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
22	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
23	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
24	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
25	688623	双元科技	150	13,018.50	0.00
26	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
27	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
28	688458	美芯晟	127	11,526.52	0.00

29	688478	晶升股份	261	11,058.57	0.00
30	688531	日联科技	81	11,013.57	0.00
31	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
32	301307	美利信	312	9,940.32	0.00
33	301332	德尔玛	720	9,885.60	0.00
34	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
35	301360	荣旗科技	104	9,630.40	0.00
36	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
37	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
38	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
39	301141	中科磁业	202	8,623.38	0.00
40	688146	中船特气	219	8,350.47	0.00
41	688352	颀中科技	689	8,316.23	0.00
42	688535	华海诚科	156	7,991.88	0.00
43	301246	宏源药业	242	7,431.82	0.00
44	301357	北方长龙	146	7,064.94	0.00
45	688433	华曙高科	224	7,056.00	0.00
46	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
47	001287	中电港	335	7,041.70	0.00
48	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
49	688479	友车科技	230	6,782.70	0.00
50	301203	国泰环保	180	6,192.00	0.00
51	301386	未来电器	248	5,899.92	0.00
52	601061	中信金属	742	5,624.36	0.00
53	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
54	301439	泓淋电力	269	4,546.10	0.00
55	603135	中重科技	245	4,383.05	0.00
56	301345	涛涛车业	77	3,591.28	0.00
57	601065	江盐集团	285	3,374.40	0.00
58	601133	柏诚股份	263	3,224.38	0.00
59	001328	登康口腔	101	2,574.49	0.00
60	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
61	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
62	001360	南矿集团	147	2,185.89	0.00
63	603125	常青科技	87	2,134.11	0.00
64	001367	海森药业	50	1,974.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002110	三钢闽光	28,311,247.71	14.46
2	000895	双汇发展	21,377,772.62	10.92

3	000789	万年青	21,073,213.79	10.77
4	600782	新钢股份	19,676,566.00	10.05
5	000717	中南股份	17,127,352.00	8.75
6	002563	森马服饰	16,796,305.00	8.58
7	000651	格力电器	16,248,497.95	8.30
8	000581	威孚高科	15,787,824.00	8.07
9	002233	塔牌集团	15,767,079.00	8.05
10	600170	上海建工	15,641,940.00	7.99
11	002042	华孚时尚	14,321,781.35	7.32
12	002440	闰土股份	13,942,301.11	7.12
13	000401	冀东水泥	12,266,826.00	6.27
14	600663	陆家嘴	10,763,361.00	5.50
15	000932	华菱钢铁	10,623,831.40	5.43
16	000685	中山公用	10,496,073.00	5.36
17	000898	鞍钢股份	9,769,418.00	4.99
18	600655	豫园股份	9,741,126.00	4.98
19	000402	金融街	9,452,540.00	4.83
20	000783	长江证券	9,307,895.00	4.75
21	601598	中国外运	9,297,293.00	4.75
22	000900	现代投资	9,146,819.25	4.67
23	601866	中远海发	9,132,069.00	4.67
24	000157	中联重科	9,058,128.00	4.63
25	003816	中国广核	8,776,872.00	4.48
26	600008	首创环保	8,711,125.00	4.45
27	000039	中集集团	8,594,486.50	4.39
28	000538	云南白药	8,008,585.20	4.09
29	600642	申能股份	7,533,952.00	3.85
30	000156	华数传媒	7,349,085.00	3.75
31	000778	新兴铸管	7,342,312.00	3.75
32	600598	北大荒	7,230,587.00	3.69
33	600352	浙江龙盛	7,181,501.00	3.67
34	600623	华谊集团	7,084,425.00	3.62
35	000559	万向钱潮	7,071,495.40	3.61
36	002030	达安基因	6,978,087.00	3.56
37	002736	国信证券	6,965,479.00	3.56
38	601139	深圳燃气	6,661,179.45	3.40
39	600025	华能水电	6,477,741.00	3.31
40	600887	伊利股份	6,327,340.20	3.23
41	000725	京东方 A	6,289,738.00	3.21
42	601019	山东出版	6,214,225.00	3.17
43	601992	金隅集团	5,904,165.00	3.02
44	600064	南京高科	5,667,124.23	2.89
45	002958	青农商行	5,637,288.68	2.88

46	600928	西安银行	5,442,020.00	2.78
47	600999	招商证券	5,035,054.40	2.57
48	600269	赣粤高速	4,953,791.00	2.53
49	600104	上汽集团	4,919,671.00	2.51
50	000828	东莞控股	4,737,387.00	2.42
51	600177	雅戈尔	4,580,965.00	2.34
52	600282	南钢股份	4,527,283.00	2.31
53	600019	宝钢股份	4,105,216.00	2.10
54	600694	大商股份	4,076,730.36	2.08
55	600126	杭钢股份	4,067,781.00	2.08
56	002948	青岛银行	4,023,548.00	2.06

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。

7.4.2 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	603156	养元饮品	18,919,979.84	9.67
2	600373	中文传媒	18,815,964.01	9.61
3	600350	山东高速	18,025,265.00	9.21
4	000581	威孚高科	16,925,506.75	8.65
5	600028	中国石化	16,230,853.00	8.29
6	601138	工业富联	16,050,257.00	8.20
7	600694	大商股份	14,506,537.00	7.41
8	000685	中山公用	12,932,293.00	6.61
9	601857	中国石油	11,300,565.00	5.77
10	601318	中国平安	11,299,841.00	5.77
11	600755	厦门国贸	9,687,363.00	4.95
12	600449	宁夏建材	8,963,985.80	4.58
13	600643	爱建集团	8,780,934.03	4.49
14	002736	国信证券	8,506,911.00	4.35
15	600035	楚天高速	7,958,658.00	4.07
16	600368	五洲交通	7,457,070.00	3.81
17	601098	中南传媒	7,209,264.00	3.68
18	601186	中国铁建	6,993,058.00	3.57
19	601319	中国人保	6,650,215.00	3.40
20	002563	森马服饰	6,597,231.00	3.37
21	600308	华泰股份	6,485,059.91	3.31
22	601818	光大银行	6,136,003.00	3.13
23	002110	三钢闽光	5,740,283.00	2.93
24	000828	东莞控股	5,720,819.00	2.92
25	002233	塔牌集团	5,543,625.00	2.83
26	601288	农业银行	5,431,342.00	2.77
27	601988	中国银行	5,299,626.00	2.71

28	600183	生益科技	5,172,703.00	2.64
29	600398	海澜之家	4,990,443.00	2.55
30	601000	唐山港	4,699,351.00	2.40
31	000895	双汇发展	4,604,904.00	2.35
32	000789	万年青	4,467,227.00	2.28
33	000651	格力电器	4,194,388.00	2.14

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。

7.4.3 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	622,909,105.54
卖出股票收入（成交）总额	424,780,050.19

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	62,467.74
2	应收清算款	3,581,767.86
3	应收股利	291,736.38
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	8,363.74
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,944,335.72

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002563	森马服饰	1,503,996.00	0.18	转融通流通受限
2	601006	大秦铁路	1,486,000.00	0.17	转融通流通受限
3	600282	南钢股份	1,011,000.00	0.12	转融通流通受限
4	002110	三钢闽光	844,000.00	0.10	转融通流通受限
5	002233	塔牌集团	772,000.00	0.09	转融通流通受限

7.12.5.2 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	301486	致尚科技	277,921.20	0.03	新股流通受限

2	688502	茂莱光学	177,697.05	0.02	新股流通受限
3	688435	英方软件	118,892.84	0.01	新股流通受限
4	301292	海科新源	116,421.76	0.01	新股流通受限
5	301202	朗威股份	79,009.20	0.01	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		交通银行股份有限公司 -景顺长城中证红利低 波动 100 交易型开放式 指数证券投资基金发起 式联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
3,133	158,774.83	357,081,705.00	71.78	89,045,224.00	17.90	51,314,600.00	10.32

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国平安人寿保险股份有限公司—分红 —一个险分红	133,897,000.00	26.92
2	交通银行股份有限公司—景顺长城中证 红利低波动 100 交易型开放式指数证券 投资基金发起式联接基金	51,314,600.00	10.32
3	华泰证券股份有限公司	17,778,590.00	3.57
4	歌斐诺宝（上海）资产管理有限公司— 歌斐目标策略平衡型私募证券投资基金	17,290,700.00	3.48
5	五矿鑫扬（浙江）投资管理有限公司— 五矿鑫扬鑫锐 2 号私募证券投资基金	15,421,600.00	3.10
6	中国人寿保险（集团）公司	15,000,000.00	3.02
7	中国平安人寿保险股份有限公司—自有 资金	14,532,000.00	2.92
8	五矿鑫扬（浙江）投资管理有限公司— 五矿鑫扬鑫成 1 号私募证券投资基金	12,825,100.00	2.58
9	中国人寿资管—工商银行—国寿资产—	9,770,994.00	1.96

	低波优选 1 号保险资产管理产品		
10	中国建设银行股份有限公司—华夏养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)	9,275,500.00	1.86
11	翟建琴	6,990,400.00	1.41

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	124,300.00	0.024988

8.4 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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 5 月 22 日) 基金份额总额	1,276,941,529.00
本报告期期初基金份额总额	128,441,529.00
本报告期基金总申购份额	489,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	120,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	497,441,529.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券股份有限公司	2	744,685,679.57	71.59	693,543.10	71.59	-
国泰君安证券股份有限公司	2	288,434,826.64	27.73	268,621.34	27.73	-
东吴证券股份有限公司	1	7,110,940.11	0.68	6,622.92	0.68	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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. 本基金本报告期交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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
2	景顺长城中证红利低波动 100 交易型	中国证监会指定报刊及	2023 年 1 月 20 日

	开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	网站	
3	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
5	景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金 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 2 月 13 日
6	景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数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 2 月 13 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华安证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 22 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 2 月 24 日
9	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一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
10	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
11	景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
12	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
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东海证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 3 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 8 日
15	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
16	景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金 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
17	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
18	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 22 日
19	关于景顺长城中证红利低波动 100 交	中国证监会指定报刊及	2023 年 4 月 25 日

	易型开放式指数证券投资基金新增中信建投证券为一级交易商的公告	网站	
20	关于景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金新增安信证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 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 5 月 6 日
22	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
23	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
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 29 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 10 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 6 月 17 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 6 月 22 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20230101-20230321; 20230608-20230630	33,090,700.00	156,904,200.00	56,097,900.00	133,897,000.00	26.92
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：</p> <p>(1) 基金在短期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；</p> <p>(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，</p>							

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件；

2、《景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

4、《景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数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。

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 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

2023 年 8 月 30 日