

长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型 证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	7
2.5 信息披露方式.....	7
2.6 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	13
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18

6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末在各个国家 (地区) 证券市场的权益投资分布.....	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	41
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细.....	41
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	47
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	48
7.7 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.....	49
7.8 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.....	49
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金融衍生品投资明细.....	49
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	49
7.11 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.3 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的情况.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58

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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金
基金简称	长信标普 100 等权重指数 (QDII)
基金主代码	519981
交易代码	519981
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 3 月 30 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	26,194,196.48 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过增强型指数化的投资来追求美国超大市值蓝筹股股票市场的中长期资本增值，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段力争将基金净值增长率和美国标准普尔 100 等权重指数（本基金的标的指数，以下简称“标普 100 等权重指数”）收益率之间的日均跟踪误差控制在 0.50% 以内（相应的年化跟踪误差控制在 7.94% 以内）。在控制跟踪误差的前提下通过有效的资产及行业组合和基本面研究，力求实现对标的指数的有效跟踪并取得优于标的指数的收益率。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，原则上不少于 80% 的基金净资产采用完全复制法，按照成份股在标普 100 等权重指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成分股及其权重的变化、进行相应的调整。对于不高于基金净资产 15% 的主动型投资部分，基金管理人会根据深入的公司基本面和数量化研究以及对美国及全球宏观经济的理解和判断，在美国公开发行或上市交易的证券中有选择地重点投资于基金管理人认为最具有中长期成长价值的企业或本基金允许投资的固定收益类品种、货币市场工具、金融衍生品以及有关法律法规和中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。
业绩比较基准	标准普尔 100 等权重指数总收益率
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，本基金的净值波动与美国大市值蓝筹股票市场的整体波动高度相关，为较高预期收益和较高预期风险的基金品种。

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		长信基金管理有限责任公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	许俊
	联系电话	021-61009999	010-66594319
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4007005566	95566
传真		021-61009800	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		刘元瑞	刘连舸

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank Of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行（香港）有限公司
注册地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
办公地址		-	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.6 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(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	1,620,924.17
本期利润	4,998,869.11
加权平均基金份额本期利润	0.2009
本期加权平均净值利润率	12.96%
本期基金份额净值增长率	14.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	7,015,749.60
期末可供分配基金份额利润	0.2678
期末基金资产净值	42,937,193.91
期末基金份额净值	1.639
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	163.76%

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、所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（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润为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。

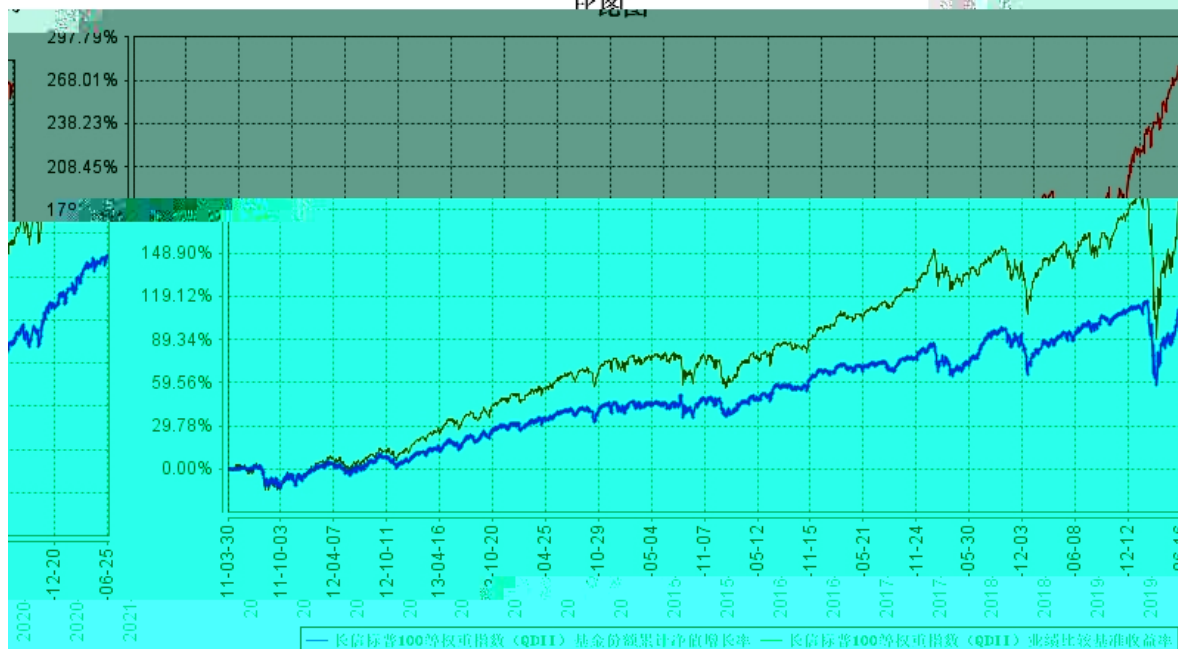
3.2 基金净值表现

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	1.93%	0.59%	1.06%	0.59%	0.87%	0.00%
过去三个月	5.13%	0.68%	7.72%	0.69%	-2.59%	-0.01%
过去六个月	14.22%	0.78%	18.65%	0.84%	-4.43%	-0.06%
过去一年	32.71%	0.92%	45.99%	0.98%	-13.28%	-0.06%
过去三年	47.30%	1.21%	63.35%	1.50%	-16.05%	-0.29%
自基金合同生效起至今	163.76%	0.94%	282.57%	1.13%	-118.81%	-0.19%

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

长信标普100等权重指数 (QDII) 基金份额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：1、图示日期为 2011 年 3 月 30 日至 2021 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同约定。

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

§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

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 76 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球

债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金 (FOF)、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信易进混合型证券投资基金、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信添利安心收益混合型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金。

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		
傅瑶纯	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理、国际业务部副总监	2020 年 1 月 2 日	-	6 年	华威大学金融与经济学硕士，中国国籍，具有基金从业资格。曾任职于中国农业银行、易唯思商务咨询有限公司，2016 年 4 月加入长信基金管理有限责任公司，现任国际业务部副总监、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金和长信全球债券证券投资基金的基金经理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注：本基金未聘请境外投资顾问。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，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财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与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% 的情形，未发现异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，海外资本市场风云变幻。新年伊始，拜登履新，美国政府多项政策并举，立下“独立日”70% 人群免疫目标，叠加 1.9 万亿美元纾困法案落地，美国经济复苏态势强劲，再通胀交易升温。在此背景下，投资者担忧美联储将提前迫于通胀压力进行 Taper，作为全球资产定价锚的美债收益率一路走高，由年初的 0.9% 水平，以极其陡峭的斜率拉升至三月末的 1.7% 附近；

因此，以科技股为主要成分的纳斯达克指数在一季度走势波折，一度回撤幅度超 10.5%，而顺周期和价值板块则表现出众。进入二季度，美联储“通胀暂时论”开始得到广泛接受，德尔塔变种毒株扩散超出预期，市场再次进入远离风险模式，资金往安全投资进行转移，美债和科技龙头再次获得追捧，十年期美债收益率于近期跌破 1.3%，FAAMG 等科技龙头也涨至新高附近。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截止到 2021 年 6 月 30 日，本基金人民币份额净值为 1.639 元，人民币份额累计净值为 2.156 元，本报告期内本基金净值增长率为 14.22%；同期业绩比较基准涨幅为 18.65%。本基金在上半年的超额收益为-4.43%（考虑人民币汇率影响）。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们预计随着供应端的修复，通胀压力将趋于缓和，同时市场对于美联储的缩表计划已充分预期，虽然基准利率有超调的迹象，但整体向上反弹的空间预计不会太大。考虑到下半年欧美主要国家有望实现群体免疫，盈利修复仍将成为驱动美股行情的主要力量，截至 7 月末，在已发布半年报的标普 500 成分股中，高达 86% 的公司超出市场一致预期，我们预计业绩环比高增的趋势有望在三季度得到延续。长期来看，我们认为全球范围内高企的表观通胀是暂时的，以科技创新驱动的生产效率提升与低生育率时代下实际需求匮乏将是长期矛盾，抑制长期核心通胀的上行空间，而作为全球最优质的权益标的池，美股仍将成为全球投资者首选的配置资产之一。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性、适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成，相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。

对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

- 1、基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；
- 3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资者的现金红利按分红权益再投资日（具体以届时的基金分红公告为准）的基金份额净值自动转为基金份额；
- 4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；
- 5、基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；
- 6、基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额净值分配金额后不能低于面值；
- 7、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日。
- 8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

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

自 2017 年 10 月 11 日至 2018 年 1 月 3 日，本基金资产净值已连续六十个工作日低于五千万，本基金管理人已向中国证监会报送了解决方案。截至报告期末，本基金资产净值仍低于五千

万元。

§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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长信美国标准普尔 100 等权重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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《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规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	4,007,861.15	1,927,258.79
结算备付金		-	1,673,684.01
存出保证金		-	726,000.00
交易性金融资产	6.4.6.2	39,469,004.10	31,893,923.41
其中：股票投资		39,469,004.10	31,893,923.41
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.6.5	77.89	61.62
应收股利		25,681.16	32,361.68
应收申购款		250,487.42	55,293.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		43,753,111.72	36,308,582.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		541,021.02	292,979.34
应付管理人报酬		38,211.62	33,180.75
应付托管费		10,421.36	9,049.28
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.6.7	-	-
应交税费		-	27,442.73
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	226,263.81	333,731.27
负债合计		815,917.81	696,383.37
所有者权益:			
实收基金	6.4.6.9	26,194,196.48	24,814,974.64
未分配利润	6.4.6.10	16,742,997.43	10,797,224.98
所有者权益合计		42,937,193.91	35,612,199.62
负债和所有者权益总计		43,753,111.72	36,308,582.99

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.639 元，基金份额总额 26,194,196.48 份。

6.2 利润表

公告主体：长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		5,416,483.64	452,272.36
1. 利息收入		2,107.88	7,600.97
其中：存款利息收入	6.4.6.11	2,107.88	7,600.97
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,101,633.68	1,816,413.16
其中：股票投资收益	6.4.6.12	1,286,849.96	1,622,273.98
基金投资收益	6.4.6.13	-	-
债券投资收益	6.4.6.14	1,798.64	-
资产支持证券投资收益	6.4.6.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.6.15	-	-
衍生工具收益	6.4.6.16	506,165.04	-348,418.84
股利收益	6.4.6.17	306,820.04	542,558.02
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	3,377,944.94	-1,475,679.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-81,561.31	75,299.43

5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.6.19	16,358.45	28,637.81
减: 二、费用		417,614.53	404,139.55
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	210,073.39	189,202.93
2. 托管费	6.4.9.2.2	57,292.75	51,600.84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.6.20	7,306.78	11,514.86
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,822.20	43.07
7. 其他费用	6.4.6.21	141,119.41	151,777.85
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		4,998,869.11	48,132.81
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		4,998,869.11	48,132.81

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	24,814,974.64	10,797,224.98	35,612,199.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	4,998,869.11	4,998,869.11
三、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)	1,379,221.84	946,903.34	2,326,125.18
其中: 1. 基金申购款	10,516,064.70	5,978,953.41	16,495,018.11
2. 基金赎回款	-9,136,842.86	-5,032,050.07	-14,168,892.93
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基	26,194,196.48	16,742,997.43	42,937,193.91

银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行（香港）有限公司。

本基金主要投资于标普 100 等权重指数成份股，同时也可主动投资于下列金融产品或工具：权益类品种（包括在美国证券市场挂牌交易的普通股、优先股、美国存托凭证、交易型开放式指数基金等）；固定收益类品种（包括美国政府债券、美国市场公开发行的公司债券及可转换债券等债券资产）；回购协议、美国或中国短期政府债券、现金等价物、货币市场基金等货币市场工具；经中国证监会认可的境外交易所（美国）挂牌交易的金融衍生品（包括期权期货）；以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金为股票指数增强型基金，对标普 100 等权重指数的成份股的投资比例为基金资产净值的 80%-95%；现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）、现金等价物及到期日在一年以内的美国或中国短期政府债券的比例为基金资产净值的 5%-20%；主动投资部分占基金资产净值的 0%-15%，投资于在美国证券市场公开发行或挂牌交易的权益类品种、固定收益类品种、金融衍生品以及有关法律法规和证监会允许本基金投资的其他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：标准普尔 100 等权重指数总收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至

2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行

规定 (2011 年修订)》及相关地方教育附加的征收规定, 凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人, 都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加 (除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外) 及地方教育费附加。

基金取得的源自境外的差价收入, 其涉及的境外所得税税收政策, 按照相关国家或地区税收法律和法规执行, 在境内暂免征营业税或增值税和企业所得税;

基金取得的源自境外的股利收益, 其涉及的境外所得税税收政策, 按照相关国家或地区税收法律和法规执行, 在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	4,007,861.15
定期存款	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计:	4,007,861.15

注: 截止至 2021 年 6 月 30 日, 活期存款中人民币活期存款为人民币 719,870.64 元, 外币活期存款折合人民币 3,287,990.51 元。

6.4.6.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	30,467,510.40	39,469,004.10	9,001,493.70
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	30,467,510.40	39,469,004.10	9,001,493.70

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	77.89
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	77.89

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,004.46
应付证券出借违约金	-
预提账户维护费	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	100,000.00
预提指数授权费	80,241.23
预提指数使用费	19,222.93
合计	226,263.81

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,814,974.64	24,814,974.64
本期申购	10,516,064.70	10,516,064.70
本期赎回(以“-”号填列)	-9,136,842.86	-9,136,842.86
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	26,194,196.48	26,194,196.48

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

金额单位：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	5,026,107.55	5,771,117.43	10,797,224.98
本期利润	1,620,924.17	3,377,944.94	4,998,869.11
本期基金份额交易产生的变动数	368,717.88	578,185.46	946,903.34
其中：基金申购款	2,673,309.83	3,305,643.58	5,978,953.41
基金赎回款	-2,304,591.95	-2,727,458.12	-5,032,050.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,015,749.60	9,727,247.83	16,742,997.43

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日

活期存款利息收入	2,107.88
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	-
其他	-
合计	2,107.88

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	6,700,540.02
减：卖出股票成本总额	5,413,690.06
买卖股票差价收入	1,286,849.96

6.4.6.13 基金投资收益

注：本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.6.14 债券投资收益

6.4.6.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,798.64
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	1,798.64

6.4.6.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,323,978.13
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,319,055.37
减：应收利息总额	3,124.12
买卖债券差价收入	1,798.64

6.4.6.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.6.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.6.14.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.15 贵金属投资收益**6.4.6.15.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.16 衍生工具收益**6.4.6.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.6.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-
外汇期货-投资收益	506,165.04

6.4.6.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	306,820.04
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	306,820.04

6.4.6.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,612,014.94
——股票投资	3,612,014.94

——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	-234,070.00
——权证投资	-
——外汇期货合约	-234,070.00
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	3,377,944.94

6.4.6.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	16,358.45
合计	16,358.45

注：本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，对其他投资者收取的赎回费用的 25% 应当归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

6.4.6.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	7,306.78
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	7,306.78

6.4.6.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数授权费	60,967.76
指数使用费	19,256.68
银行汇划费	36,099.78
合计	141,119.41

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

注：根据 2021 年 6 月 29 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金增设美元类基金份额相关事项的公告》，从 2021 年 7 月 1 日起，本基金增设美元类份额，原有基金份额将自动划归为本基金人民币类基金份额。

除上述情况外，截至本财务报告批准报出日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

注：本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.8.2 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
长信基金管理有限责任公司（以下简称“长信基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国银行（香港）有限公司（以下简称“中银香港”）	基金境外托管人

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.9.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.9.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方交易单元的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	210,073.39	189,202.93
其中：支付销售机构的客户维护费	81,390.21	85,046.48

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	57,292.75	51,600.84

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.9.4 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

6.4.9.4.1 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.9.4.2 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2011 年 3 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	7,501,888.88	10,001,888.88
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	2,500,000.00
报告期末持有的基金份额	7,501,888.88	7,501,888.88
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	28.64%	23.17%

注：基金管理人运用自有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

6.4.9.5.2 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

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.9.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 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
中银香港	3,287,989.41	-	1,557,376.66	-
中国银行	719,871.74	2,107.88	2,781,919.90	7,600.90

6.4.9.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.10 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.11 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购**

注：截至本报告期末，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。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末，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。

6.4.11.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

6.4.12.2 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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行股份有限公司以及基金境外次托管人中国银行（香港）有限公司，与该等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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券

的 10%。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.12.3 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。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

6.4.12.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。本基金的基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的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。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款等。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	6个月以内	6个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	719,871.74	-	-	-	3,287,989.41	4,007,861.15
交易性金融资产	-	-	-	-	39,469,004.10	39,469,004.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	77.89	77.89
应收股利	-	-	-	-	25,681.16	25,681.16
应收申购款	-	-	-	-	250,487.42	250,487.42
资产总计	719,871.74	-	-	-	43,033,239.98	43,753,111.72
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	541,021.02	541,021.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	38,211.62	38,211.62
应付托管费	-	-	-	-	10,421.36	10,421.36
其他负债	-	-	-	-	226,263.81	226,263.81
应交税费	-	-	-	-	-	0.00
负债总计	-	-	-	-	815,917.81	815,917.81
利率敏感度缺口	719,871.74	-	-	-	42,217,322.17	42,937,193.91
上年度末 2020年12月31日	6个月以内	6个月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	305,634.72	-	-	-	1,621,624.07	1,927,258.79
结算备付金	-	-	-	-	1,673,684.01	1,673,684.01
存出保证金	-	-	-	-	726,000.00	726,000.00
交易性金融资产	-	-	-	-	31,893,923.41	31,893,923.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	-	61.62	61.62
应收股利	-	-	-	-	32,361.68	32,361.68
应收申购款	-	-	-	-	55,293.48	55,293.48
资产总计	305,634.72	-	-	-	36,002,948.27	36,308,582.99
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	292,979.34	292,979.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	33,180.75	33,180.75
应付托管费	-	-	-	-	9,049.28	9,049.28
其他负债	-	-	-	-	333,731.27	333,731.27
应交税费	-	-	-	-	27,442.73	27,442.73
负债总计	-	-	-	-	696,383.37	696,383.37
利率敏感度缺口	305,634.72	-	-	-	35,306,564.90	35,612,199.62

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末及上年度末均未持有债券，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.12.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.12.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	3,287,990.51	-	-	3,287,990.51
交易性金融资产	39,469,004.10	-	-	39,469,004.10
应收股利	25,681.16	-	-	25,681.16
资产合计	42,782,675.77	-	-	42,782,675.77
以外币计价的负债				
其它负债	99,464.16	-	-	99,464.16
负债合计	99,464.16	-	-	99,464.16
资产负债表外汇风险敞口净额	42,683,211.61	-	-	42,683,211.61
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
银行存款	1,621,624.07	-	-	1,621,624.07
结算备付金	14,964.01	-	-	14,964.01
交易性金融资产	31,893,923.41	-	-	31,893,923.41
应收股利	32,361.68	-	-	32,361.68
应收利息	0.13	-	-	0.13
资产合计	33,562,873.30	-	-	33,562,873.30
以外币计价的负债				
其它负债	182,697.20	-	-	182,697.20
负债合计	182,697.20	-	-	182,697.20
资产负债表外汇风险敞口净额	33,380,176.10	-	-	33,380,176.10

6.4.12.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除美元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(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)
	美元对人民币升值 5%	2,134,160.58	1,669,008.81
	美元对人民币贬值 5%	-2,134,160.58	-1,669,008.81

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素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的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券,所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险,并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR (Value at Risk) 等指标来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于6月30日,本基金面临的其他市场价格风险列示如下:

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	39,469,004.10	91.92	31,893,923.41	89.56
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	39,469,004.10	91.92	31,893,923.41	89.56

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95% 的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 2.82%（2020 年 12 月 31 日 VaR 值为 4.41%）	-1,208,767.00	-1,571,580.02

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95% 的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2020 年的分析同样基于该假设。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.13.1 公允价值

6.4.13.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

6.4.13.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.13.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，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中属于第一层次的余额为人民币 39,469,004.10 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元。

6.4.13.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.13.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.13.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.13.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	39,469,004.10	90.21
	其中: 普通股票	39,110,698.53	89.40
	存托凭证	358,305.57	0.82
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中: 远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,007,861.15	9.16
8	其他各项资产	276,246.47	0.63
9	合计	43,753,111.72	100.00

注: 本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
美国	39,469,004.10	91.92
合计	39,469,004.10	91.92

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
保健	5,195,970.00	12.10
必需消费品	4,606,712.08	10.73
材料	1,116,571.12	2.60
电信服务	1,565,897.74	3.65
非必需消费品	5,220,031.23	12.16
工业	5,441,078.40	12.67
公共事业	1,507,227.06	3.51
金融	6,123,890.12	14.26
能源	1,172,374.68	2.73
信息技术	7,160,946.10	16.68
合计	39,110,698.53	91.09

注: 以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
电信服务	358,305.57	0.83
合计	358,305.57	0.83

注: 以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

7.4.1 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权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属 国家 (地 区)	数量 (股)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	NIKE INC -CL B	耐克公司	NKE US	NYSE	美国	458	457,093.55	1.06
2	BIOGEN INC	百健	BIIB US	NASDAQ	美国	203	454,098.58	1.06
3	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	NASDAQ	美国	85	439,341.71	1.02
4	TESLA INC	特斯拉汽车	TSLA US	NASDAQ	美国	99	434,702.07	1.01

		公司						
5	DANAHER CORP	丹纳赫	DHR US	NYSE	美国	245	424,739.95	0.99
6	ADOBE SYSTEMS INC	奥多比	ADBE US	NASDAQ	美国	112	423,728.81	0.99
7	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	Thermo Fisher Scientific 公司	TMO US	NYSE	美国	130	423,660.46	0.99
8	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	NASDAQ	美国	475	420,268.27	0.98
9	NETFLIX INC	奈飞公司	NFLX US	NASDAQ	美国	123	419,711.60	0.98
10	PAYPAL HOLDINGS INC	Paypal 控股股份有限公司	PYPL US	NASDAQ	美国	222	418,023.77	0.97
11	QUALCOMM INC	高通公司	QCOM US	NASDAQ	美国	449	414,580.60	0.97
12	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT US	NYSE	美国	550	411,905.67	0.96
13	FACEBOOK INC-A	Facebook 公司	FB US	NASDAQ	美国	183	411,062.17	0.96
14	Charter Communications Inc	Charter Communications Inc	CHTR US	NASDAQ	美国	88	410,136.24	0.96
15	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	NASDAQ	美国	234	409,509.62	0.95
16	COSTCO WHOLESALE CORP	好市多批发	COST US	NASDAQ	美国	159	406,414.77	0.95
17	TARGET CORP	塔吉特公司	TGT US	NYSE	美国	260	406,032.79	0.95
18	ACCENTURE PLC-CL A	埃森哲公司	ACN US	NYSE	美国	212	403,727.05	0.94
19	HOME DEPOT INC	家得宝	HD US	NYSE	美国	195	401,711.95	0.94
20	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	联合包裹服务股份有限公司	UPS US	NYSE	美国	298	400,365.09	0.93
21	ELI LILLY & CO	礼来	LLY US	NYSE	美国	270	400,334.98	0.93
22	AMAZON.COM	亚马逊公司	AMZN US	NASDAQ	美国	18	400,028.00	0.93

	INC							
23	MERCK & CO. INC.	默克	MRK US	NYSE	美国	793	398,404.77	0.93
24	SALESFORCE .COM INC	Salesforce .com 股份有限公司	CRM US	NYSE	美国	252	397,658.17	0.93
25	TEXAS INSTRUMENTS INC	德州仪器	TXN US	NASDAQ	美国	320	397,528.71	0.93
26	LOWES COS INC	劳氏	LOW US	NYSE	美国	317	397,221.79	0.93
27	BANK OF NEW YORK MELLON CORP	纽约梅隆银行股份有限公司	BK US	NYSE	美国	1,200	397,141.11	0.92
28	CONOCOPHIL LIPS	康菲石油	COP US	NYSE	美国	1,009	396,960.87	0.92
29	EXXON MOBIL CORP	埃克森美孚石油	XOM US	NYSE	美国	973	396,500.52	0.92
30	AMERICAN TOWER CORP	美国发射塔公司	AMT US	NYSE	美国	226	394,399.70	0.92
31	BROADCOM INC	博通股份有限公司	AVGO US	NASDAQ	美国	128	394,295.56	0.92
32	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH US	NYSE	美国	152	393,206.13	0.92
33	FEDEX CORP	联邦快递	FDX US	NYSE	美国	204	393,157.29	0.92
34	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	菲利普莫里斯国际集团公司	PM US	NYSE	美国	613	392,479.69	0.91
35	GOLDMAN SACHS GROUP INC	高盛	GS US	NYSE	美国	160	392,288.28	0.91
36	AMGEN INC	AMGEN-T	AMGN US	NASDAQ	美国	249	392,087.69	0.91
37	AMERICAN EXPRESS CO	美国运通	AXP US	NYSE	美国	367	391,736.65	0.91
38	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	NASDAQ	美国	1,063	391,561.26	0.91
39	PEPSICO INC	百事可乐	PEP US	NASDAQ	美国	409	391,491.94	0.91
40	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	NYSE	美国	488	391,323.40	0.91

41	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	NASDAQ	美国	879	391,016.55	0.91
42	WAL-MART STORES INC	沃尔玛股份有限公司	WMT US	NYSE	美国	429	390,820.42	0.91
43	PROCTER & GAMBLE CO/THE	宝洁	PG US	NYSE	美国	448	390,504.26	0.91
44	T MOBILE US INC	T-Mobile 股份有限公司	TMUS US	NASDAQ	美国	417	390,151.99	0.91
45	BLK US	贝莱德有限公司	BLK US	NYSE	美国	69	390,015.17	0.91
46	NEXTERA ENERGY INC	新纪元能源公司	NEE US	NYSE	美国	823	389,605.01	0.91
47	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	NYSE	美国	366	389,510.70	0.91
48	MORGAN STANLEY	摩根士丹利	MS US	NYSE	美国	657	389,158.56	0.91
49	MASTERCARD INC-CLASS A	万事达股份有限公司	MA US	NYSE	美国	165	389,155.45	0.91
50	VISA INC-CLASS A SHARES	维萨公司	V US	NYSE	美国	257	388,198.65	0.90
51	STARBUCKS CORP	星巴克-T	SBUX US	NASDAQ	美国	537	387,877.13	0.90
52	UNION PACIFIC CORP	联合太平洋	UNP US	NYSE	美国	273	387,870.15	0.90
53	WELLS FARGO & CO	富国银行	WFC US	NYSE	美国	1,325	387,665.76	0.90
54	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	百时美施贵宝	BMJ US	NYSE	美国	898	387,634.17	0.90
55	EMERSON ELECTRIC CO	艾默生电气	EMR US	NYSE	美国	623	387,331.57	0.90
56	WALT DISNEY CO/THE	华特迪士尼	DIS US	NYSE	美国	341	387,202.70	0.90
57	LINDE PLC	Linde Public 股份有限公司	LIN US	NYSE	美国	207	386,596.29	0.90

58	CATERPILLAR INC	卡特彼勒	CAT US	NYSE	美国	274	385,219.77	0.90
59	BANK OF AMERICA CORP	美国银行	BAC US	NYSE	美国	1,445	384,875.64	0.90
60	GENERAL ELECTRIC CO	通用电气	GE US	NYSE	美国	4,420	384,332.02	0.90
61	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力	GD US	NYSE	美国	316	384,312.38	0.90
62	AT&T INC	美国电话电报公司	T US	NYSE	美国	2,064	383,742.34	0.89
63	LOCKHEED MARTIN CORP	洛克希德马丁	LMT US	NYSE	美国	157	383,736.08	0.89
64	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	亿滋国际	MDLZ US	NASDAQ	美国	949	382,796.84	0.89
65	3M CO	3M 公司	MMM US	NYSE	美国	298	382,384.56	0.89
66	CVS CAREMARK CORP	CVS 保健公司	CVS US	NYSE	美国	709	382,172.80	0.89
67	VERIZON COMMUNICATIONS INC	Verizon 通信股份有限公司	VZ US	NYSE	美国	1,055	381,867.17	0.89
68	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	NYSE	美国	1,508	381,490.09	0.89
69	ABBVIE INC	艾伯维生物制药公司	ABBV US	NYSE	美国	524	381,296.81	0.89
70	MCDONALDS CORP	麦当劳	MCD US	NYSE	美国	255	380,515.72	0.89
71	FORD MOTOR CO	福特汽车	F US	NYSE	美国	3,961	380,244.46	0.89
72	SIMON PROPERTY GROUP INC	西蒙房地产集团公司	SPG US	NYSE	美国	451	380,154.15	0.89
73	COLGATE-PALMOLIVE CO	高露洁棕榄	CL US	NYSE	美国	723	379,957.56	0.88
74	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	霍尼韦尔	HON US	NYSE	美国	268	379,762.15	0.88
75	INTL BUSINESS MACHINES	国际商业机器	IBM US	NYSE	美国	401	379,741.41	0.88

	CORP							
76	INTEL CORP	英特尔	INTC US	NASDAQ	美国	1,046	379,352.83	0.88
77	CHEVRON CORP	雪佛龙	CVX US	NYSE	美国	560	378,913.29	0.88
78	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通	JPM US	NYSE	美国	377	378,811.09	0.88
79	CISCO SYSTEMS INC	思科-T	CSCO US	NASDAQ	美国	1,105	378,335.76	0.88
80	DUKE ENERGY CORP	杜克能源	DUK US	NYSE	美国	593	378,180.46	0.88
81	BOEING CO/THE	波音	BA US	NYSE	美国	244	377,609.90	0.88
82	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	伯克希尔哈撒韦公司	BRK/B US	NYSE	美国	210	377,032.11	0.88
83	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	第一资本金融	COF US	NYSE	美国	377	376,740.95	0.88
84	US BANCORP	美国合众银行	USB US	NYSE	美国	1,023	376,496.63	0.88
85	COCA-COLA CO/THE	可口可乐	KO US	NYSE	美国	1,077	376,471.82	0.88
86	GENERAL MOTORS CO	通用汽车公司	GM US	NYSE	美国	984	376,128.21	0.88
87	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	雷神技术公司	RTX US	NYSE	美国	682	375,857.79	0.88
88	ALTRIA GROUP INC	高特利	MO US	NYSE	美国	1,216	374,549.36	0.87
89	WALGREEN BOOTS ALLTANCE	Walgreens Boots Alliance 公司	WBA US	NASDAQ	美国	1,094	371,813.25	0.87
90	SOUTHERN CO	南方	SO US	NYSE	美国	947	370,182.92	0.86
91	EXELON CORP	Exelon公司	EXC US	NASDAQ	美国	1,290	369,258.67	0.86
92	ORACLE CORP	甲骨文	ORCL US	NYSE	美国	731	367,586.41	0.86
93	BOOKING HOLDINGS	Booking 控股股份有限	BKNG US	NASDAQ	美国	26	367,517.29	0.86

	INC	公司						
94	KRAFT HEINZ CO/THE	卡夫亨氏公 司	KHC US	NASDAQ	美国	1,394	367,239.37	0.86
95	DuPont de Nemours Inc	陶氏杜邦	DD US	NYSE	美国	733	366,555.96	0.85
96	METLIFE INC	大都会集团	MET US	NYSE	美国	943	364,598.68	0.85
97	Dow Inv	Dow Inc	DOW US	NYSE	美国	889	363,418.87	0.85
98	CITIGROUP INC	花旗集团	C US	NYSE	美国	791	361,528.19	0.84
99	AMERICAN INTERNATIO NAL GROUP	美国国际集 团	AIG US	NYSE	美国	1,163	357,623.38	0.83
10 0	GOOGL US	Alphabet 公司	GOOGL US	NASDAQ	美国	13	205,064.70	0.48
10 1	GOOGLE INC-CL A	Alphabet 公司	GOOG US	NASDAQ	美国	12	194,292.93	0.45

7.4.2 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前五名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名 称(中文)	证券代 码	所在证 券市场	所属国 家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
1	BAIDU INC	百度股 份有限 公司	BIDU US	NASDAQ	美国	100	131,721.44	0.31
2	BILIBILI INC	哔哩哔哩	BILI US	NASDAQ	美国	160	125,935.77	0.29
3	IQIYI INC	爱奇艺 公司	IQ US	NASDAQ	美国	1,000	100,648.36	0.23

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产 净值比例 (%)
1	BROADCOM INC	AVGO US	393,432.08	1.10

2	LINDE PLC	LIN US	366,576.11	1.03
3	T MOBILE US INC	TMUS US	350,978.72	0.99
4	MERCK & CO. INC.	MRK US	140,619.64	0.39
5	QUALCOMM INC	QCOM US	136,372.69	0.38
6	AT&T INC	T US	135,406.99	0.38
7	VERIZON COMMUNICATIONS INC	VZ US	131,936.25	0.37
8	NIKE INC -CL B	NKE US	131,092.94	0.37
9	NETFLIX INC	NFLX US	127,883.71	0.36
10	BAIDU INC	BIDU US	126,746.59	0.36
11	BILIBILI INC	BILI US	126,013.23	0.35
12	WAL-MART STORES INC	WMT US	124,721.79	0.35
13	PFIZER INC	PFE US	124,425.10	0.35
14	TESLA INC	TSLA US	122,087.01	0.34
15	NEXTERA ENERGY INC	NEE US	120,765.66	0.34
16	PROCTER & GAMBLE CO/THE	PG US	119,221.66	0.33
17	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	TMO US	118,604.20	0.33
18	WALT DISNEY CO/THE	DIS US	117,046.45	0.33
19	ABBOTT LABORATORIES	ABT US	115,826.11	0.33
20	COLGATE-PALMOLIVE CO	CL US	114,348.73	0.32

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	SCHLUMBERGER LTD	SLB US	370,447.18	1.04
2	ALLSTATE CORP	ALL US	334,837.69	0.94
3	KINDER MORGAN INC	KMI US	332,852.28	0.93
4	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	COF US	147,047.91	0.41
5	FUTU HOLDINGS LTD	FUTU US	144,379.33	0.41
6	NVIDIA CORP	NVDA US	135,341.90	0.38
7	FORD MOTOR CO	F US	131,972.03	0.37
8	GOLDMAN SACHS GROUP INC	GS US	121,598.27	0.34
9	KANZHUN LTD	BZ US	109,960.03	0.31
10	WELLS FARGO & CO	WFC US	108,066.21	0.30
11	GENERAL MOTORS CO	GM US	107,201.77	0.30
12	TARGET CORP	TGT US	103,547.76	0.29

13	EXXON MOBIL CORP	XOM US	102,638.37	0.29
14	SIMON PROPERTY GROUP INC	SPG US	94,572.02	0.27
15	MORGAN STANLEY	MS US	89,434.45	0.25
16	BANK OF AMERICA CORP	BAC US	88,189.92	0.25
17	CONOCOPHILLIPS	COP US	87,744.61	0.25
18	AMERICAN TOWER CORP	AMT US	81,603.84	0.23
19	JPMORGAN CHASE & CO	JPM US	81,128.53	0.23
20	ORACLE CORP	ORCL US	80,000.56	0.22

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	9,376,755.09
卖出收入（成交）总额	6,700,540.02

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.8 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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金融衍生品投资明细

注：本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	25,681.16
4	应收利息	77.89
5	应收申购款	250,487.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	276,246.47

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名的股票中不存在流通受限情况。

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：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情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,030	6,499.80	7,501,888.88	28.64%	18,692,307.60	71.36%

8.2 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	0.00	0.00%

8.3 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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 3 月 30 日）基金份额总额	508,424,713.40
本报告期期初基金份额总额	24,814,974.64
本报告期基金总申购份额	10,516,064.70
减：本报告期基金总赎回份额	9,136,842.86
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	26,194,196.48

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2021 年 1 月 25 日起, 成善栋先生不再担任公司董事长, 由总经理覃波先生代任董事长。

自 2021 年 4 月 28 日起, 刘元瑞先生担任公司董事长, 总经理覃波先生不再代任董事长。

上述重大人事变动情况, 本基金管理人均已在规定信息披露媒介发布相关公告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

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

本报告期, 基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
Goldman Sachs Global	-	12,090,173.09	75.20%	2,380.85	71.71%	-
Morgan Stanley & Co Intl Plc	-	3,987,122.02	24.80%	939.49	28.29%	-
Citigroup Global Markets Limited London	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字【1998】29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 券商协作表现评价。

（2）选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Goldman Sachs	-	-	-	-	-	-	-	-

Global								
Morgan Stanley & Co Intl Plc	-	-	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Limited London	2,639,909.38	100.00%	-	-	-	-	-	-

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	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 1 月 14 日
2	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在天风证券股份有限公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 1 月 14 日
3	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 1 月 22 日
4	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 1 月 22 日
5	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 1 月 26 日
6	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（2021 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 1 月 28 日
7	长信基金管理有限责任公司关于增加中信建投证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 16 日
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加国金证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 26 日
9	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 30 日

10	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 30 日
11	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 31 日
12	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司申购 (含定投申购) 费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 31 日
13	长信基金管理有限责任公司关于修改旗下 5 只公募基金相关法律文件的公告	上证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 15 日
14	长信基金管理有限责任公司关于旗下 5 只公开募集证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修订相关法律文件部分条款的提示性公告	上证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 15 日
15	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 15 日
16	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要 (更新)	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 15 日
17	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 21 日
18	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2021 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 21 日
19	长信基金管理有限责任公司关于董事长变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 30 日
20	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资等业务公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 5 月 27 日
21	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 22 日
22	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金增设美元类基金份额相关事项的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 29 日
23	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金合同、托管协议和招募说明书提示	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 29 日

	性公告		
24	长信基金管理有限责任公司关于长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金美元份额净值计算与披露方法的说明	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 29 日
25	长信基金管理有限责任公司关于旗下 40 只公募基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 29 日
26	长信基金管理有限责任公司关于修订旗下公开募集证券投资基金法律文件并更新产品资料概要的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 29 日
27	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要 (更新)	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 29 日
28	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 29 日
29	长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 29 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	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	7,501,888.88	0.00	0.00	7,501,888.88	28.64%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：

。

长信基金管理有限责任公司

2021 年 8 月 31 日