

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券
投资基金
2024 年中期报告

2024 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	5
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	7
§ 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	10
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	11
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	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 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末上市基金前十名持有人	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 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	54
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	54
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	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF 景顺
基金主代码	159935
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	31,572,956.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 1 月 21 日

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。
投资策略	本基金以中证 500 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%。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
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	95566

传真	0755-22381339	010-66594942
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	李进	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-1,667,575.06
本期利润	-4,046,690.53
加权平均基金份额本期利润	-0.1323
本期加权平均净值利润率	-8.17%
本期基金份额净值增长率	-7.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	17,077,930.04
期末可供分配基金份额利润	0.5409
期末基金资产净值	48,650,886.04
期末基金份额净值	1.5409
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	54.09%

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。

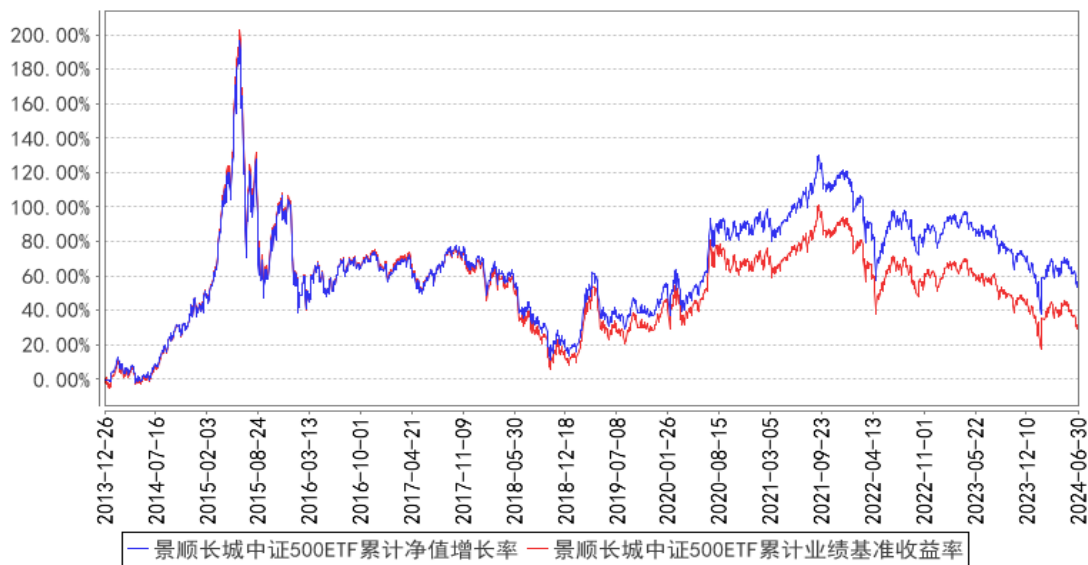
3.2 基金净值表现

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	-6.16%	0.94%	-6.89%	0.96%	0.73%	-0.02%
过去三个月	-5.36%	1.12%	-6.50%	1.14%	1.14%	-0.02%
过去六个月	-7.91%	1.57%	-8.96%	1.61%	1.05%	-0.04%
过去一年	-16.65%	1.25%	-17.60%	1.27%	0.95%	-0.02%
过去三年	-24.51%	1.17%	-27.40%	1.20%	2.89%	-0.03%
自基金合同生效起至今	54.09%	1.54%	29.78%	1.57%	24.31%	-0.03%

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500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：本基金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比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的建仓期为自 2013 年 12 月 26 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2024年6月30日，本公司旗下共管理184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		
郑天行	本基金的基金经理	2023年6月20日	-	10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）数据分析师，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10年证券、基金行业从业经验。
张晓南	本基金的基金助理	2023年9月13日	-	14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14年证券、基金行业从业经验。
龚丽丽	本基金的基金经理	2024年5月30日	-	13年	理学硕士。曾任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部研究员、基金经理助理、基金经理，申万菱信基金管理有限公司指数投资部负责人、基金经理。2022年3月加

					入本公司，担任 ETF 与创新投资部副总经理，自 2023 年 11 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理，现任 ETF 与创新投资部副总经理、基金经理，兼任投资经理。具有 13 年证券、基金行业从业经验。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
龚丽丽	公募基金	7	8,498,427,458.84	2023 年 11 月 15 日
	私募资产管理计划	1	250,659,215.43	2023 年 12 月 27 日
	其他组合	-	-	-
	合计	8	8,749,086,674.27	-

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 500 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 9 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

上半年，A 股权益市场整体情绪分化较为明显，宽基指数涨跌幅及排序为：沪深 300(0.89%)>上证指数(-0.25%)>中小 100(-5.86%)>创业板指(-10.99%)>科创 50(-16.42%)。市值维度，总体表现出大盘占优特征，规模指数涨跌幅及排序为：沪深 300(0.89%)>中证 500(-8.96%)>中证 1000(-16.84%)。风格维度，中信风格指数涨跌幅及排序为：稳定(8.79%)>金融(2.77%)>周期(-1.21%)>消费(-13.24%)>成长(-14.76%)。行业维度，涨跌幅排前五行业为：银行(17.02%)、煤炭(11.96%)、公用事业(11.76%)、家用电器(8.48%)、石油石化(7.90%)，排后五行业为：综合(-33.34%)、计算机(-24.88%)、商贸零售(-24.59%)、社会服务(-24.05%)、传媒(-21.33%)。

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

2024 年上半年，本基金份额净值增长率为-7.91%，业绩比较基准收益率为-8.96%。

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：6 月工业增加值同比增长 5.3%，前值 5.6%，经季节调整后环比增长 0.42%；6 月 PMI49.5，5 月 49.5；6 月社会消费品零售总额同比增长 2.0%。通胀指标：6 月 PPI 同比-0.8%，前值-1.4%；6 月 CPI 同比 0.2%，前值 0.3%。货币金融指标：5 月 M2 同比增长 6.2%，前值 7.0%；6 月社会融资规模同比增长 8.1%，前值 8.4%。总体来看，增长斜率保持稳定，继续保持良好的复苏态势，同时通胀仍处在低位区间运行。

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、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

从 2023 年 12 月 15 日至 2024 年 2 月 26 日，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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”）在景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（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：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	963,430.29	1,047,584.35
结算备付金		117.81	3,916.32
存出保证金		396.89	1,569.23
交易性金融资产	6.4.7.2	47,848,661.16	48,616,069.03
其中：股票投资		47,848,661.16	48,612,168.91
基金投资		-	-
债券投资		-	3,900.12
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		48,812,606.15	49,669,138.93
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		44,151.11	0.09
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,577.71	21,076.23
应付托管费		4,115.55	4,215.24
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	92,875.74	163,172.72
负债合计		161,720.11	188,464.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	31,572,956.00	29,572,956.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	17,077,930.04	19,907,718.65
净资产合计		48,650,886.04	49,480,674.65
负债和净资产总计		48,812,606.15	49,669,138.93

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.5409 元，基金份额总额 31,572,956.00 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		-3,817,341.58	2,208,591.48
1. 利息收入		2,010.28	1,736.79
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,010.28	1,736.79
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,436,068.85	-737,148.90
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,090,897.22	-1,394,891.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	439.24	8,874.79
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	654,389.13	648,867.57
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	-2,379,115.47	2,944,003.59
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	-4,167.54	-
减：二、营业总支出		229,348.95	332,825.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	123,190.33	146,192.87
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,638.05	29,238.61
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	81,520.57	157,393.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,046,690.53	1,875,766.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,046,690.53	1,875,766.21
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,046,690.53	1,875,766.21

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	29,572,956.00	-	19,907,718.65	49,480,674.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	29,572,956.00	-	19,907,718.65	49,480,674.65
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,000,000.00	-	-2,829,788.61	-829,788.61
(一)、综合收益总额	-	-	-4,046,690.53	-4,046,690.53
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	2,000,000.00	-	1,216,901.92	3,216,901.92
其中：1. 基金申购款	3,000,000.00	-	1,802,319.19	4,802,319.19
2. 基金赎回款	-1,000,000.00	-	-585,417.27	-1,585,417.27
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	31,572,956.00	-	17,077,930.04	48,650,886.04
项目	上年度可比期间 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	33,572,956.00	-	26,626,895.97	60,199,851.97
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	33,572,956.00	-	26,626,895.97	60,199,851.97
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-	-675,385.19	-3,675,385.19
(一)、综合收益总额	-	-	1,875,766.21	1,875,766.21
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-	-2,551,151.40	-5,551,151.40
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-3,000,000.00	-	-2,551,151.40	-5,551,151.40
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	30,572,956.00	-	25,951,510.78	56,524,466.78

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 500 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[2013]1501 号《关于核准景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》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 500 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 512,538,347.00 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(2013)第 887 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 512,572,956.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 34,609.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2014]第 17 号文审核同意,本基金 512,572,956.00 份基金份额于 2014 年 1 月 21 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 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 500 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比例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发行的股票及存托凭证)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、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 500 指数。

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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“景顺长城中证 500ETF 联接基金”)。景顺长城中证 500ETF 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 2024 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》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 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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》、财税[2023]39 号《关于减半征收交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	963,430.29
等于：本金	963,333.70
加：应计利息	96.59
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	963,430.29

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	57,612,092.06	-	47,848,661.16	-9,763,430.90
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	57,612,092.06	-	47,848,661.16	-9,763,430.90

注：于2024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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

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

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	15,608.06
其中：交易所市场	15,608.06
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	42,267.68
应付指数使用费	35,000.00
合计	92,875.74

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,572,956.00	29,572,956.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,000,000.00	-1,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	31,572,956.00	31,572,956.00

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	47,915,975.26	-28,008,256.61	19,907,718.65
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	47,915,975.26	-28,008,256.61	19,907,718.65

本期利润	-1,667,575.06	-2,379,115.47	-4,046,690.53
本期基金份额交易产生的变动数	3,250,000.20	-2,033,098.28	1,216,901.92
其中：基金申购款	4,822,811.47	-3,020,492.28	1,802,319.19
基金赎回款	-1,572,811.27	987,394.00	-585,417.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,498,400.40	-32,420,470.36	17,077,930.04

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		1,924.78
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		80.71
其他		4.79
合计		2,010.28

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-1,952,637.08
股票投资收益——赎回差价收入		-138,260.14
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		-2,090,897.22

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		8,608,022.37
减：卖出股票成本总额		10,536,952.83
减：交易费用		23,706.62
买卖股票差价收入		-1,952,637.08

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
赎回基金份额对价总额		1,585,417.27

减：现金支付赎回款总额	806,746.27
减：赎回股票成本总额	916,931.14
减：交易费用	-
赎回差价收入	-138,260.14

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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	438.97
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	439.24

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,339.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,900.00
减：应计利息总额	0.39
减：交易费用	0.17
买卖债券差价收入	438.97

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	654,389.13
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	654,389.13

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,379,115.47
股票投资	-2,379,115.47
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	-2,379,115.47

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
	2024年1月1日至2024年6月30日

基金赎回费收入	-
替代损益	-4,167.54
合计	-4,167.54

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申赎本基金时，补入（卖出）被替代成分券的实际买入（卖出）成本与申赎确认日估值的差额，或强制退款的被替代成分券在强制退款计算日与申赎确认日估值的差额。

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	17,404.66
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行划款手续费	613.53
指数使用费	38,621.52
存托服务费	17.84
合计	81,520.57

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% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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、申购赎回代理券商、基金销售机构
景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券	本基金的基金管理人管理的其他基金

投资基金联接基金（“景顺长城中证 500ETF 联接基金”）	
--------------------------------	--

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金 额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
长城证券	-	-	8,367,222.37	53.17

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
长城证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
长城证券	7,793.86	53.17	6,690.19	52.13

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	123,190.33	146,192.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,477.49	-
应支付基金管理人的净管理费	119,712.84	146,192.87

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,638.05	29,238.61

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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自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未运用自有资金投资本基金。

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 2024年6月30日	上年度末 2023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 500ETF 联 接基金	25,587,500.00	81.04	26,378,100.00	89.20

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 2024年1月1日至2024年6月30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国银行-活期	963,430.29	1,924.78	1,179,287.28	1,608.33

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。

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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有 13,100 股长城证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 135,242.51 元，估值总额为人民币 87,770.00 元，占基金净资产的比例为 0.18% (于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 12,300 股长城证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 132,392.22 元，估值总额为人民币 98,400.00 元，占基金净资产的比例为 0.20%)。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2024 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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 单 价	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
400174	中天 3	2023 年 8 月 30 日	重大事 项停牌	0.11	-	-	41,300	104,332.59	4,543.00	-

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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：0.01%）。

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 个工作日内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 个工作日内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 2024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							
货币资金	963,430.29	-	-	-	-	-	963,430.29
结算备付金	117.81	-	-	-	-	-	117.81
存出保证金	396.89	-	-	-	-	-	396.89
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-47,848,661.16	-47,848,661.16
资产总计	963,944.99	-	-	-	-	-47,848,661.16	48,812,606.15
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,577.71	20,577.71
应付托管费	-	-	-	-	-	4,115.55	4,115.55
应付清算款	-	-	-	-	-	44,151.11	44,151.11
其他负债	-	-	-	-	-	92,875.74	92,875.74
负债总计	-	-	-	-	-	161,720.11	161,720.11
利率敏感度缺口	963,944.99	-	-	-	-	-	-

上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,047,584.35	-	-	-	-	-	1,047,584.35
结算备付金	3,916.32	-	-	-	-	-	3,916.32
存出保证金	1,569.23	-	-	-	-	-	1,569.23
交易性金融资产	-	-	-	-3,900.12	48,612,168.91	-	48,616,069.03
资产总计	1,053,069.90	-	-	-3,900.12	48,612,168.91	-	49,669,138.93
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	21,076.23	21,076.23
应付托管费	-	-	-	-	-	4,215.24	4,215.24
应付清算款	-	-	-	-	-	0.09	0.09
其他负债	-	-	-	-	-	163,172.72	163,172.72
负债总计	-	-	-	-	-	188,464.28	188,464.28
利率敏感度缺口	1,053,069.90	-	-	-3,900.12	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.00%（上年度末：0.01%），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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	47,848,661.16	98.35	48,612,168.91	98.24
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	47,848,661.16	98.35	48,612,168.91	98.24

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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,577,344.65	2,133,387.23
	沪深 300 指数下降 5%	-3,577,344.65	-2,133,387.23

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	47,844,118.16	48,607,625.91
第二层次	-	3,900.12
第三层次	4,543.00	4,543.00
合计	47,848,661.16	48,616,069.03

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发售等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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	47,848,661.16	98.03
	其中：股票	47,848,661.16	98.03
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	963,548.10	1.97
8	其他各项资产	396.89	0.00
9	合计	48,812,606.15	100.00

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	302,446.00	0.62
B	采矿业	2,246,471.10	4.62

C	制造业	30,243,409.08	62.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,932,645.40	3.97
E	建筑业	488,937.00	1.00
F	批发和零售业	1,024,001.02	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	969,664.47	1.99
H	住宿和餐饮业	152,951.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,329,410.05	6.84
J	金融业	4,461,681.54	9.17
K	房地产业	544,652.62	1.12
L	租赁和商务服务业	366,792.34	0.75
M	科学研究和技术服务业	394,592.75	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	218,442.79	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	53,397.00	0.11
Q	卫生和社会工作	304,378.00	0.63
R	文化、体育和娱乐业	724,358.00	1.49
S	综合	85,888.00	0.18
	合计	47,844,118.16	98.34

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	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,543.00	0.01

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	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,543.00	0.01

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	300502	新易盛	5,700	601,635.00	1.24
2	002028	思源电气	5,020	335,838.00	0.69
3	601058	赛轮轮胎	21,300	298,200.00	0.61
4	600066	宇通客车	10,800	278,640.00	0.57
5	002340	格林美	41,500	264,355.00	0.54
6	000933	神火股份	12,700	256,921.00	0.53
7	688169	石头科技	643	252,441.80	0.52
8	601077	渝农商行	50,000	251,000.00	0.52
9	000988	华工科技	8,159	244,198.87	0.50
10	601168	西部矿业	13,500	242,325.00	0.50
11	300394	天孚通信	2,640	233,428.80	0.48
12	000423	东阿阿胶	3,700	231,620.00	0.48
13	002384	东山精密	11,100	229,770.00	0.47
14	600418	江淮汽车	14,162	224,326.08	0.46
15	000630	铜陵有色	61,900	223,459.00	0.46
16	600988	赤峰黄金	13,500	220,590.00	0.45
17	601233	桐昆股份	13,700	218,652.00	0.45
18	002625	光启技术	12,200	211,670.00	0.44
19	600157	永泰能源	179,200	211,456.00	0.43
20	600096	云天化	10,400	201,968.00	0.42
21	601567	三星医疗	5,700	199,500.00	0.41
22	000400	许继电气	5,794	199,371.54	0.41

23	002128	电投能源	9,131	192,664.10	0.40
24	002156	通富微电	8,600	192,554.00	0.40
25	002273	水晶光电	11,224	190,583.52	0.39
26	601555	东吴证券	32,090	189,331.00	0.39
27	002078	太阳纸业	13,526	188,687.70	0.39
28	600885	宏发股份	6,748	186,784.64	0.38
29	688777	中控技术	4,948	186,539.60	0.38
30	002223	鱼跃医疗	4,926	185,217.60	0.38
31	601128	常熟银行	24,350	184,329.50	0.38
32	300207	欣旺达	12,100	183,557.00	0.38
33	002532	天山铝业	22,600	183,286.00	0.38
34	002138	顺络电子	6,600	181,236.00	0.37
35	600352	浙江龙盛	21,000	180,390.00	0.37
36	600398	海澜之家	19,400	179,256.00	0.37
37	002966	苏州银行	23,660	177,450.00	0.36
38	002353	杰瑞股份	5,000	175,400.00	0.36
39	601108	财通证券	26,300	173,843.00	0.36
40	600765	中航重机	8,405	171,462.00	0.35
41	002185	华天科技	20,700	168,705.00	0.35
42	002517	恺英网络	17,400	166,170.00	0.34
43	603606	东方电缆	3,400	165,954.00	0.34
44	301236	软通动力	4,700	165,487.00	0.34
45	600879	航天电子	21,292	165,438.84	0.34
46	600873	梅花生物	16,200	162,324.00	0.33
47	600079	人福医药	9,300	159,681.00	0.33
48	601577	长沙银行	19,500	159,510.00	0.33
49	600177	雅戈尔	22,400	159,488.00	0.33
50	002738	中矿资源	5,940	159,192.00	0.33
51	300003	乐普医疗	10,700	158,788.00	0.33
52	600109	国金证券	21,000	158,550.00	0.33
53	600060	海信视像	6,400	158,336.00	0.33
54	300017	网宿科技	19,700	155,630.00	0.32
55	300136	信维通信	7,900	154,682.00	0.32
56	600497	驰宏锌锗	28,800	153,792.00	0.32
57	603979	金诚信	3,000	151,590.00	0.31
58	603160	汇顶科技	2,200	151,250.00	0.31
59	002409	雅克科技	2,400	150,984.00	0.31
60	002739	万达电影	12,400	149,916.00	0.31
61	688099	晶晨股份	2,527	149,901.64	0.31
62	002202	金风科技	22,300	149,856.00	0.31
63	000932	华菱钢铁	33,500	148,405.00	0.31
64	600536	中国软件	4,942	147,864.64	0.30
65	002465	海格通信	14,100	146,076.00	0.30

66	002444	巨星科技	5,911	146,001.70	0.30
67	000683	远兴能源	21,100	145,801.00	0.30
68	600985	淮北矿业	8,700	145,638.00	0.30
69	600348	华阳股份	14,600	145,416.00	0.30
70	002281	光迅科技	3,869	144,584.53	0.30
71	000009	中国宝安	16,680	143,448.00	0.29
72	689009	九号公司	3,877	142,712.37	0.29
73	688120	华海清科	752	142,564.16	0.29
74	300474	景嘉微	2,250	142,267.50	0.29
75	000878	云南铜业	11,400	142,044.00	0.29
76	002008	大族激光	6,800	141,440.00	0.29
77	002436	兴森科技	13,700	141,384.00	0.29
78	688122	西部超导	3,663	140,366.16	0.29
79	600298	安琪酵母	5,000	139,650.00	0.29
80	600642	申能股份	15,800	139,514.00	0.29
81	601615	明阳智能	14,700	138,768.00	0.29
82	002797	第一创业	27,200	138,448.00	0.28
83	300054	鼎龙股份	6,100	138,348.00	0.28
84	000039	中集集团	14,940	138,344.40	0.28
85	601990	南京证券	17,900	137,472.00	0.28
86	000066	中国长城	15,700	137,375.00	0.28
87	600529	山东药玻	5,400	136,836.00	0.28
88	300012	华测检测	13,600	136,816.00	0.28
89	603596	伯特利	3,460	134,594.00	0.28
90	601666	平煤股份	12,000	134,400.00	0.28
91	002673	西部证券	21,700	134,323.00	0.28
92	600839	四川长虹	29,800	133,802.00	0.28
93	601179	中国西电	16,600	133,464.00	0.27
94	000831	中国稀土	5,200	131,820.00	0.27
95	688180	君实生物	4,523	131,393.15	0.27
96	002432	九安医疗	3,200	129,728.00	0.27
97	000783	长江证券	26,800	129,444.00	0.27
98	603816	顾家家居	4,000	129,160.00	0.27
99	300395	菲利华	4,200	129,150.00	0.27
100	300002	神州泰岳	15,900	129,108.00	0.27
101	601717	郑煤机	8,710	128,908.00	0.26
102	000728	国元证券	21,200	128,472.00	0.26
103	000738	航发控制	6,400	128,448.00	0.26
104	600862	中航高科	6,800	127,704.00	0.26
105	603338	浙江鼎力	2,100	126,882.00	0.26
106	000703	恒逸石化	17,800	126,202.00	0.26
107	002595	豪迈科技	3,300	125,961.00	0.26
108	601198	东兴证券	15,700	124,972.00	0.26

109	601997	贵阳银行	23,600	124,372.00	0.26
110	300724	捷佳伟创	2,300	124,223.00	0.26
111	000960	锡业股份	8,000	123,920.00	0.25
112	300037	新宙邦	4,320	123,379.20	0.25
113	600038	中直股份	3,000	123,330.00	0.25
114	002155	湖南黄金	6,800	123,080.00	0.25
115	601696	中银证券	13,500	122,580.00	0.25
116	000921	海信家电	3,800	122,512.00	0.25
117	600863	内蒙华电	26,400	122,496.00	0.25
118	688525	佰维存储	1,904	122,141.60	0.25
119	601162	天风证券	56,000	122,080.00	0.25
120	603939	益丰药房	4,948	121,473.40	0.25
121	002472	双环传动	5,500	121,110.00	0.25
122	600521	华海药业	7,100	121,055.00	0.25
123	300001	特锐德	6,000	120,720.00	0.25
124	600141	兴发集团	6,320	120,585.60	0.25
125	002984	森麒麟	5,000	120,450.00	0.25
126	002294	信立泰	4,500	119,835.00	0.25
127	600549	厦门钨业	6,900	119,025.00	0.24
128	603345	安井食品	1,600	118,896.00	0.24
129	002407	多氟多	9,700	118,631.00	0.24
130	600699	均胜电子	7,980	118,263.60	0.24
131	300699	光威复材	4,760	118,190.80	0.24
132	603589	口子窖	3,000	117,570.00	0.24
133	300866	安克创新	1,650	117,496.50	0.24
134	600546	山煤国际	8,000	116,960.00	0.24
135	600895	张江高科	6,300	116,424.00	0.24
136	301358	湖南裕能	3,700	116,402.00	0.24
137	002262	恩华药业	4,900	116,326.00	0.24
138	600820	隧道股份	17,800	116,234.00	0.24
139	300285	国瓷材料	6,500	116,025.00	0.24
140	603087	甘李药业	2,500	115,800.00	0.24
141	600486	扬农化工	2,050	115,722.50	0.24
142	600872	中炬高新	5,100	115,719.00	0.24
143	002064	华峰化学	16,100	115,437.00	0.24
144	000021	深科技	7,630	115,365.60	0.24
145	600369	西南证券	32,200	115,276.00	0.24
146	002195	岩山科技	45,822	115,013.22	0.24
147	002850	科达利	1,500	114,570.00	0.24
148	300073	当升科技	3,300	113,223.00	0.23
149	600021	上海电力	11,400	112,746.00	0.23
150	300146	汤臣倍健	8,300	112,465.00	0.23
151	601000	唐山港	23,911	112,381.70	0.23

152	000513	丽珠集团	3,003	111,741.63	0.23
153	002756	永兴材料	3,100	110,918.00	0.23
154	601966	玲珑轮胎	6,000	110,220.00	0.23
155	603179	新泉股份	2,800	109,872.00	0.23
156	600704	物产中大	25,200	109,368.00	0.22
157	300058	蓝色光标	20,100	109,344.00	0.22
158	600153	建发股份	12,200	108,946.00	0.22
159	300529	健帆生物	4,000	108,840.00	0.22
160	300114	中航电测	2,400	108,600.00	0.22
161	600155	华创云信	18,300	108,153.00	0.22
162	000830	鲁西化工	9,307	107,868.13	0.22
163	600118	中国卫星	4,800	106,704.00	0.22
164	002025	航天电器	2,300	106,674.00	0.22
165	601156	东航物流	5,200	105,820.00	0.22
166	600583	海油工程	17,900	105,789.00	0.22
167	002558	巨人网络	11,200	105,728.00	0.22
168	002152	广电运通	10,100	105,646.00	0.22
169	300373	扬杰科技	2,700	105,030.00	0.22
170	000623	吉林敖东	7,800	104,520.00	0.21
171	000591	太阳能	22,100	104,091.00	0.21
172	600970	中材国际	8,550	103,113.00	0.21
173	600763	通策医疗	1,900	102,695.00	0.21
174	002385	大北农	26,600	102,410.00	0.21
175	300144	宋城演艺	12,700	101,981.00	0.21
176	002439	启明星辰	5,900	101,834.00	0.21
177	605358	立昂微	4,400	101,816.00	0.21
178	600380	健康元	9,092	101,557.64	0.21
179	601216	君正集团	27,300	100,737.00	0.21
180	000729	燕京啤酒	11,400	100,662.00	0.21
181	000519	中兵红箭	6,827	100,152.09	0.21
182	300251	光线传媒	11,900	100,079.00	0.21
183	000723	美锦能源	21,000	99,960.00	0.21
184	600143	金发科技	15,100	99,811.00	0.21
185	600998	九州通	20,380	99,454.40	0.20
186	300677	英科医疗	3,700	99,197.00	0.20
187	600637	东方明珠	16,300	99,104.00	0.20
188	600282	南钢股份	19,900	99,102.00	0.20
189	688065	凯赛生物	2,177	98,814.03	0.20
190	000636	风华高科	7,543	98,511.58	0.20
191	300024	机器人	10,100	98,374.00	0.20
192	600516	方大炭素	22,800	98,268.00	0.20
193	600392	盛和资源	11,395	98,224.90	0.20
194	300383	光环新网	11,600	98,020.00	0.20

195	000818	航锦科技	4,400	97,152.00	0.20
196	002958	青农商行	35,900	96,212.00	0.20
197	600909	华安证券	22,820	96,072.20	0.20
198	601665	齐鲁银行	19,500	95,745.00	0.20
199	002044	美年健康	25,300	95,634.00	0.20
200	600008	首创环保	35,570	95,327.60	0.20
201	600566	济川药业	3,000	95,130.00	0.20
202	600511	国药股份	3,086	95,017.94	0.20
203	000883	湖北能源	15,800	94,958.00	0.20
204	601016	节能风电	31,420	93,945.80	0.19
205	000997	新大陆	6,752	93,920.32	0.19
206	000629	钒钛股份	37,500	93,750.00	0.19
207	600867	通化东宝	11,200	93,744.00	0.19
208	601456	国联证券	9,700	93,508.00	0.19
209	300088	长信科技	19,871	93,393.70	0.19
210	688188	柏楚电子	504	93,013.20	0.19
211	600129	太极集团	3,200	92,544.00	0.19
212	600170	上海建工	43,000	92,450.00	0.19
213	600582	天地科技	13,400	92,326.00	0.19
214	600498	烽火通信	5,800	92,220.00	0.19
215	600499	科达制造	10,900	91,887.00	0.19
216	600535	天士力	7,300	91,834.00	0.19
217	688617	惠泰医疗	200	91,220.00	0.19
218	600004	白云机场	9,600	91,008.00	0.19
219	000598	兴蓉环境	12,100	90,992.00	0.19
220	600580	卧龙电驱	7,477	90,845.55	0.19
221	601933	永辉超市	36,600	90,768.00	0.19
222	002120	韵达股份	11,700	90,558.00	0.19
223	300567	精测电子	1,600	90,416.00	0.19
224	601991	大唐发电	30,000	90,300.00	0.19
225	000750	国海证券	30,990	90,180.90	0.19
226	603000	人民网	4,500	89,955.00	0.18
227	002261	拓维信息	8,100	89,667.00	0.18
228	603486	科沃斯	1,900	89,642.00	0.18
229	300118	东方日升	7,400	89,540.00	0.18
230	000060	中金岭南	21,100	89,464.00	0.18
231	300568	星源材质	10,900	89,380.00	0.18
232	002430	杭氧股份	4,000	89,000.00	0.18
233	002429	兆驰股份	18,300	88,023.00	0.18
234	002939	长城证券	13,100	87,770.00	0.18
235	300487	蓝晓科技	2,100	87,696.00	0.18
236	603658	安图生物	1,900	87,533.00	0.18
237	603228	景旺电子	2,752	87,513.60	0.18

238	600166	福田汽车	38,800	87,300.00	0.18
239	603156	养元饮品	4,100	87,207.00	0.18
240	600325	华发股份	13,412	87,178.00	0.18
241	601231	环旭电子	5,400	86,670.00	0.18
242	688002	睿创微纳	3,091	86,455.27	0.18
243	603927	中科软	4,776	86,397.84	0.18
244	002508	老板电器	3,900	86,190.00	0.18
245	600816	建元信托	31,800	86,178.00	0.18
246	603568	伟明环保	4,178	85,983.24	0.18
247	600673	东阳光	12,200	85,888.00	0.18
248	300601	康泰生物	5,500	85,855.00	0.18
249	300765	新诺威	3,400	85,782.00	0.18
250	000893	亚钾国际	5,300	85,648.00	0.18
251	688213	思特威	1,756	85,166.00	0.18
252	600754	锦江酒店	3,700	85,026.00	0.17
253	603298	杭叉集团	4,300	84,452.00	0.17
254	002926	华西证券	12,800	84,352.00	0.17
255	300604	长川科技	3,100	84,227.00	0.17
256	000027	深圳能源	11,520	84,096.00	0.17
257	601636	旗滨集团	13,000	83,850.00	0.17
258	688772	珠海冠宇	5,627	83,842.30	0.17
259	002624	完美世界	11,000	83,600.00	0.17
260	000998	隆平高科	8,500	83,555.00	0.17
261	600737	中粮糖业	8,700	83,433.00	0.17
262	300763	锦浪科技	2,000	83,280.00	0.17
263	002299	圣农发展	6,100	83,204.00	0.17
264	002497	雅化集团	9,300	82,956.00	0.17
265	002653	海思科	2,700	82,890.00	0.17
266	603893	瑞芯微	1,400	82,838.00	0.17
267	600131	国网信通	4,900	82,663.00	0.17
268	300253	卫宁健康	14,000	82,600.00	0.17
269	601866	中远海发	32,000	82,560.00	0.17
270	603077	和邦生物	49,943	82,405.95	0.17
271	300390	天华新能	4,790	82,292.20	0.17
272	601958	金钼股份	7,900	82,239.00	0.17
273	002500	山西证券	17,460	82,062.00	0.17
274	688385	复旦微电	2,614	82,027.32	0.17
275	002056	横店东磁	6,564	81,853.08	0.17
276	002065	东华软件	18,100	81,812.00	0.17
277	600373	中文传媒	5,500	81,620.00	0.17
278	300009	安科生物	9,532	81,403.28	0.17
279	600655	豫园股份	15,800	81,370.00	0.17
280	002414	高德红外	13,800	81,282.00	0.17

281	002507	涪陵榨菜	6,600	80,850.00	0.17
282	002368	太极股份	3,551	80,075.05	0.16
283	002372	伟星新材	5,160	79,567.20	0.16
284	601611	中国核建	9,800	79,282.00	0.16
285	603885	吉祥航空	7,200	79,128.00	0.16
286	600707	彩虹股份	11,600	78,996.00	0.16
287	000887	中鼎股份	6,400	78,336.00	0.16
288	600563	法拉电子	1,019	77,627.42	0.16
289	603225	新凤鸣	4,972	77,513.48	0.16
290	603290	斯达半导	900	77,499.00	0.16
291	603379	三美股份	1,980	77,497.20	0.16
292	002203	海亮股份	9,700	77,406.00	0.16
293	002831	裕同科技	3,020	77,281.80	0.16
294	600755	厦门国贸	10,702	76,733.34	0.16
295	600329	达仁堂	2,355	76,278.45	0.16
296	688521	芯原股份	2,851	76,264.25	0.16
297	600859	王府井	6,464	75,887.36	0.16
298	600995	南网储能	7,800	75,348.00	0.15
299	600801	华新水泥	5,451	74,951.25	0.15
300	601880	辽港股份	60,799	74,782.77	0.15
301	600884	杉杉股份	9,200	74,704.00	0.15
302	600416	湘电股份	7,500	74,550.00	0.15
303	002683	广东宏大	3,700	74,481.00	0.15
304	002019	亿帆医药	6,000	74,160.00	0.15
305	300296	利亚德	16,400	73,800.00	0.15
306	300070	碧水源	17,600	73,744.00	0.15
307	600390	五矿资本	18,200	73,710.00	0.15
308	300676	华大基因	2,100	73,521.00	0.15
309	002244	滨江集团	10,124	73,500.24	0.15
310	600435	北方导航	8,520	73,442.40	0.15
311	002506	协鑫集成	37,800	73,332.00	0.15
312	300803	指南针	2,000	72,820.00	0.15
313	600739	辽宁成大	8,700	72,819.00	0.15
314	000050	深天马 A	10,000	72,800.00	0.15
315	600598	北大荒	5,800	72,442.00	0.15
316	600483	福能股份	6,200	72,292.00	0.15
317	600399	抚顺特钢	12,800	72,064.00	0.15
317	601598	中国外运	12,800	72,064.00	0.15
318	002572	索菲亚	4,700	72,051.00	0.15
319	601098	中南传媒	5,800	72,036.00	0.15
320	300748	金力永磁	5,540	71,798.40	0.15
321	600901	江苏金租	14,180	71,609.00	0.15
322	002568	百润股份	4,240	71,359.20	0.15

323	688052	纳芯微	694	71,329.32	0.15
324	002240	盛新锂能	5,300	71,126.00	0.15
325	000155	川能动力	6,600	71,082.00	0.15
326	600848	上海临港	7,800	71,058.00	0.15
327	002080	中材科技	5,500	70,950.00	0.15
328	002487	大金重工	3,100	70,928.00	0.15
329	688114	华大智造	1,493	70,783.13	0.15
330	001286	陕西能源	6,100	70,333.00	0.14
331	002373	千方科技	7,700	69,839.00	0.14
332	002557	洽洽食品	2,459	69,319.21	0.14
333	603883	老百姓	3,773	69,272.28	0.14
334	603712	七一二	3,800	69,122.00	0.14
335	002936	郑州银行	39,929	69,077.17	0.14
336	300595	欧普康视	4,400	68,992.00	0.14
337	002268	电科网安	4,820	68,588.60	0.14
338	688390	固德威	1,219	68,410.28	0.14
339	300558	贝达药业	2,100	68,355.00	0.14
340	000563	陕国投 A	24,830	68,282.50	0.14
341	688005	容百科技	2,931	68,233.68	0.14
342	603858	步长制药	4,500	68,175.00	0.14
343	601928	凤凰传媒	6,200	67,952.00	0.14
344	600258	首旅酒店	5,500	67,925.00	0.14
345	600968	海油发展	16,400	67,568.00	0.14
346	000778	新兴铸管	19,400	67,512.00	0.14
347	603688	石英股份	2,250	66,622.50	0.14
348	600378	昊华科技	2,300	66,470.00	0.14
349	688538	和辉光电	33,562	66,452.76	0.14
350	601212	白银有色	23,900	66,442.00	0.14
351	600271	航天信息	9,000	66,240.00	0.14
352	600528	中铁工业	9,000	65,880.00	0.14
353	600062	华润双鹤	3,362	65,827.96	0.14
354	600977	中国电影	6,100	65,636.00	0.13
355	002531	天顺风能	7,300	65,262.00	0.13
356	000739	普洛药业	4,800	65,136.00	0.13
357	000709	河钢股份	33,400	64,796.00	0.13
358	601155	新城控股	7,300	64,751.00	0.13
359	002408	齐翔腾达	11,528	64,556.80	0.13
360	600612	老凤祥	1,100	64,009.00	0.13
361	600959	江苏有线	24,200	63,888.00	0.13
362	688234	天岳先进	1,355	63,576.60	0.13
363	601118	海南橡胶	13,900	63,245.00	0.13
364	603882	金城医学	2,300	62,537.00	0.13
365	000825	太钢不锈	18,500	62,530.00	0.13

366	603737	三棵树	1,720	62,384.40	0.13
367	600056	中国医药	6,077	61,499.24	0.13
368	000987	越秀资本	12,230	60,660.80	0.12
369	603456	九洲药业	4,400	60,368.00	0.12
370	688331	荣昌生物	1,396	60,307.20	0.12
371	601019	山东出版	5,100	60,282.00	0.12
372	600517	国网英大	13,900	60,187.00	0.12
373	600906	财达证券	10,500	60,165.00	0.12
374	601399	国机重装	23,300	60,114.00	0.12
375	300212	易华录	3,540	59,578.20	0.12
376	603650	彤程新材	2,000	59,100.00	0.12
377	002266	浙富控股	21,045	58,715.55	0.12
378	600316	洪都航空	3,500	58,205.00	0.12
379	688301	奕瑞科技	504	58,075.92	0.12
380	000937	冀中能源	8,600	57,620.00	0.12
381	603529	爱玛科技	2,100	57,393.00	0.12
382	688567	孚能科技	5,966	57,273.60	0.12
383	600871	石化油服	32,900	57,246.00	0.12
384	688220	翱捷科技	1,524	57,089.04	0.12
385	688561	奇安信	2,409	56,900.58	0.12
386	600925	苏能股份	11,200	56,560.00	0.12
387	603728	鸣志电器	1,400	56,322.00	0.12
388	002423	中粮资本	7,500	56,175.00	0.12
389	601965	中国汽研	3,300	55,737.00	0.11
390	000032	深桑达 A	3,700	55,426.00	0.11
391	688063	派能科技	1,384	54,958.64	0.11
392	001227	兰州银行	23,000	54,740.00	0.11
393	688297	中无人机	1,650	54,499.50	0.11
394	601298	青岛港	5,700	54,492.00	0.11
395	600098	广州发展	8,500	54,400.00	0.11
396	600208	新湖中宝	34,400	54,352.00	0.11
397	603444	吉比特	300	53,403.00	0.11
398	002607	中公教育	34,900	53,397.00	0.11
399	002670	国盛金控	6,301	53,369.47	0.11
400	601608	中信重工	14,000	53,340.00	0.11
401	300438	鹏辉能源	2,900	53,186.00	0.11
402	600663	陆家嘴	6,000	52,920.00	0.11
403	603233	大参林	3,688	52,738.40	0.11
404	600022	山东钢铁	43,210	52,716.20	0.11
405	003031	中瓷电子	1,140	52,713.60	0.11
406	300357	我武生物	2,600	52,572.00	0.11
407	600578	京能电力	16,200	52,488.00	0.11
408	600377	宁沪高速	4,100	51,660.00	0.11

409	300776	帝尔激光	1,120	51,475.20	0.11
410	688017	绿的谐波	625	51,312.50	0.11
411	601106	中国一重	22,200	51,282.00	0.11
412	688349	三一重能	2,036	50,574.24	0.10
413	600500	中化国际	14,490	50,570.10	0.10
414	688516	奥特维	1,202	50,255.62	0.10
415	002865	钧达股份	1,300	49,894.00	0.10
416	600315	上海家化	2,800	49,784.00	0.10
417	600967	内蒙一机	6,901	49,687.20	0.10
418	000785	居然之家	20,300	49,329.00	0.10
419	300888	稳健医疗	1,940	49,082.00	0.10
420	600350	山东高速	5,500	48,675.00	0.10
421	603826	坤彩科技	1,680	48,669.60	0.10
422	002690	美亚光电	2,910	48,015.00	0.10
423	600827	百联股份	6,500	47,970.00	0.10
424	000958	电投产融	13,100	47,946.00	0.10
425	601568	北元集团	12,890	47,821.90	0.10
426	000559	万向钱潮	10,700	47,722.00	0.10
427	000537	中绿电	5,000	47,650.00	0.10
428	688425	铁建重工	12,948	47,648.64	0.10
429	002608	江苏国信	6,100	47,275.00	0.10
430	000156	华数传媒	7,500	47,100.00	0.10
431	603707	健友股份	3,964	47,092.32	0.10
432	688248	南网科技	1,565	46,370.95	0.10
433	002867	周大生	3,550	46,363.00	0.10
434	603517	绝味食品	3,000	46,200.00	0.09
435	601992	金隅集团	33,700	46,169.00	0.09
436	688029	南微医学	748	46,046.88	0.09
437	003022	联泓新科	3,300	45,243.00	0.09
438	300682	朗新集团	5,300	45,103.00	0.09
439	600126	杭钢股份	10,940	44,963.40	0.09
440	603786	科博达	700	44,905.00	0.09
441	688536	思瑞浦	449	43,916.69	0.09
442	688475	萤石网络	1,284	43,797.24	0.09
443	000967	盈峰环境	10,300	43,569.00	0.09
444	301267	华夏眼科	2,100	43,512.00	0.09
445	688778	厦钨新能	1,388	43,361.12	0.09
446	603218	日月股份	4,200	43,134.00	0.09
447	600032	浙江新能	5,900	42,952.00	0.09
448	600481	双良节能	9,100	42,497.00	0.09
449	600339	中油工程	13,600	42,432.00	0.09
450	600361	创新新材	10,500	42,315.00	0.09
451	688200	华峰测控	460	42,205.00	0.09

452	600095	湘财股份	7,000	41,720.00	0.09
453	603127	昭衍新药	3,140	41,667.80	0.09
454	000898	鞍钢股份	19,300	40,916.00	0.08
455	003035	南网能源	9,200	40,480.00	0.08
456	600808	马钢股份	19,400	39,188.00	0.08
457	002563	森马服饰	6,600	38,346.00	0.08
458	002153	石基信息	6,630	37,989.90	0.08
459	603185	弘元绿能	2,200	37,598.00	0.08
460	688006	杭可科技	2,146	37,447.70	0.08
461	601228	广州港	12,200	37,210.00	0.08
462	688779	长远锂科	7,958	36,845.54	0.08
463	000539	粤电力 A	7,200	36,576.00	0.08
464	001872	招商港口	1,900	36,575.00	0.08
465	001203	大中矿业	3,700	35,557.00	0.07
466	688520	神州细胞	902	35,493.70	0.07
467	600764	中国海防	1,800	35,334.00	0.07
468	600928	西安银行	10,800	35,316.00	0.07
469	000401	冀东水泥	8,617	34,985.02	0.07
470	688172	燕东微	2,133	34,511.94	0.07
471	000959	首钢股份	12,600	34,272.00	0.07
472	688032	禾迈股份	298	34,204.44	0.07
473	688276	百克生物	1,200	34,044.00	0.07
474	002518	科士达	1,900	33,630.00	0.07
475	603056	德邦股份	2,500	32,750.00	0.07
476	603305	旭升集团	3,100	32,736.00	0.07
477	600299	安迪苏	3,300	32,010.00	0.07
478	601139	深圳燃气	4,700	31,396.00	0.06
479	300861	美畅股份	1,600	30,960.00	0.06
480	603317	天味食品	2,609	29,768.69	0.06
481	688819	天能股份	1,230	29,347.80	0.06
482	301029	怡合达	1,460	28,703.60	0.06
483	002791	坚朗五金	1,100	28,457.00	0.06
484	688387	信科移动	5,570	28,072.80	0.06
485	600927	永安期货	2,400	26,760.00	0.06
486	688107	安路科技	1,021	25,953.82	0.05
487	601858	中国科传	1,300	24,856.00	0.05
488	000031	大悦城	10,457	24,469.38	0.05
489	688281	华秦科技	282	23,496.24	0.05
490	601158	重庆水务	4,700	22,560.00	0.05
491	601828	美凯龙	8,800	22,440.00	0.05
492	002945	华林证券	2,200	21,956.00	0.05
493	600956	新天绿能	2,500	20,425.00	0.04
494	688295	中复神鹰	960	19,488.00	0.04

495	301165	锐捷网络	600	17,904.00	0.04
496	688153	唯捷创芯	482	17,834.00	0.04
497	603868	飞科电器	400	15,360.00	0.03
498	688375	国博电子	200	14,128.00	0.03
499	688348	昱能科技	200	11,800.00	0.02

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	400174	中天3	41,300	4,543.00	0.01

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	688777	中控技术	224,105.15	0.45
2	601567	三星医疗	198,798.00	0.40
3	002202	金风科技	168,879.00	0.34
4	601615	明阳智能	159,827.00	0.32
5	002436	兴森科技	159,471.00	0.32
6	603979	金诚信	156,636.00	0.32
7	301358	湖南裕能	155,047.00	0.31
8	000921	海信家电	148,060.00	0.30
9	300002	神州泰岳	147,104.00	0.30
10	300054	鼎龙股份	144,898.00	0.29
11	603345	安井食品	143,150.00	0.29
12	600872	中炬高新	137,868.00	0.28
13	002984	森麒麟	130,298.00	0.26
14	603179	新泉股份	123,044.00	0.25
15	603087	甘李药业	121,575.00	0.25
16	688525	佰维存储	119,031.46	0.24
17	688120	华海清科	116,948.47	0.24
18	600763	通策医疗	115,603.00	0.23
19	000818	航锦科技	110,002.00	0.22
20	688065	凯赛生物	108,622.36	0.22

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	002463	沪电股份	428,280.00	0.87
2	002422	科伦药业	343,584.00	0.69

3	000975	银泰黄金	273,995.20	0.55
4	600160	巨化股份	257,561.00	0.52
5	300418	昆仑万维	247,157.00	0.50
6	600161	天坛生物	214,966.00	0.43
7	600415	小商品城	189,475.00	0.38
8	688072	拓荆科技	188,754.00	0.38
9	600482	中国动力	173,783.00	0.35
10	002600	领益智造	126,402.00	0.26
11	688728	格科微	96,695.53	0.20
12	300502	新易盛	84,611.00	0.17
13	002131	利欧股份	81,150.85	0.16
14	300866	安克创新	76,090.00	0.15
15	000581	威孚高科	75,006.00	0.15
16	688120	华海清科	72,590.00	0.15
17	002032	苏泊尔	69,083.00	0.14
18	300394	天孚通信	68,502.00	0.14
19	000547	航天发展	67,968.00	0.14
20	000970	中科三环	66,409.00	0.13

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	10,598,902.69
卖出股票收入（成交）总额	8,608,022.37

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

思源电气股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到海事局的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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	396.89
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	396.89

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	400174	中天 3	4,543.00	0.01	重大事项停牌

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		中国银行股份有限公司—景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		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 (%)
358	88,192.61	4,385,501.00	13.89	1,599,955.00	5.07	25,587,500.00	81.04

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	中国银行股份有限公司—景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	25,587,500.00	81.04
2	中信证券股份有限公司	3,427,001	10.85
3	中信建投证券股份有限公司	878,500	2.78
4	杜培新	102,700	0.33
5	BARCLAYS BANK PLC	80,000	0.25
6	沈健美	78,000	0.25
7	吴源	52,900	0.17
8	于洋	51,000	0.16
9	汪氢	50,000	0.16
10	邵春风	50,000	0.16

11	高伟煊	46,000	0.15
----	-----	--------	------

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

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（2013年12月26日）	512,572,956.00
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	29,572,956.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	31,572,956.00

§ 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：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	4	11,980,388.64	62.38	11,332.63	62.37	-
中国国际金融股份有限公司	1	7,226,536.42	37.62	6,836.25	37.63	-
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

公司						
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	4,339.53	100.00	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

限公司						
中泰证 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	关于景顺长城基金管理有限公司旗下证券投资基金指定证券投资基金主流流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月4日
2	景顺长城基金管理有限公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月10日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2023年第4季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
4	景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
5	关于景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金变更场内简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月18日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月18日
7	景顺长城中证500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	2024年3月19日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月20日
9	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	2024年3月22日
10	景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金暂停场外实物申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月22日
11	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金主流流动性服务商为一般流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月23日
12	关于警惕假冒景顺长城基金APP开展诈骗活动的声明	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月27日
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2024年3月29日

	基金 2023 年年度报告提示性公告	网站	
14	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 13 日
16	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	2024 年 4 月 15 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东兴证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 18 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
19	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增渤海证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 20 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	2024 年 5 月 24 日
22	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 25 日
23	景顺长城中证 500 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	2024 年 5 月 25 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 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	2024 年 5 月 30 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	2024 年 5 月 31 日
26	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 4 日
27	景顺长城中证 500 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	2024 年 6 月 4 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增联储证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 20 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增爱建证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日
30	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日
31	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	2024 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 (%)
本基金的联接基金	1	20240101-20240630	26,378,100.00	383,800.00	1,174,400.00	25,587,500.00	81.04

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

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

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

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

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

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

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

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

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 500 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 500 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 500 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 500 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

2024 年 8 月 30 日