

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券
投资基金
2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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	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	9
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	12
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	36
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
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	53
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	54
10.4 基金投资策略的改变	54
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	59
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	59
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	叶才	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(2025年1月1日-2025年6月30日)
本期已实现收益	114,066.47
本期利润	2,825,790.94
加权平均基金份额本期利润	0.0840
本期加权平均净值利润率	4.67%
本期基金份额净值增长率	3.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)
期末可供分配利润	27,123,188.96
期末可供分配基金份额利润	0.8591
期末基金资产净值	58,696,144.96
期末基金份额净值	1.8591
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)
基金份额累计净值增长率	85.91%

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

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

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

低于所列数字。

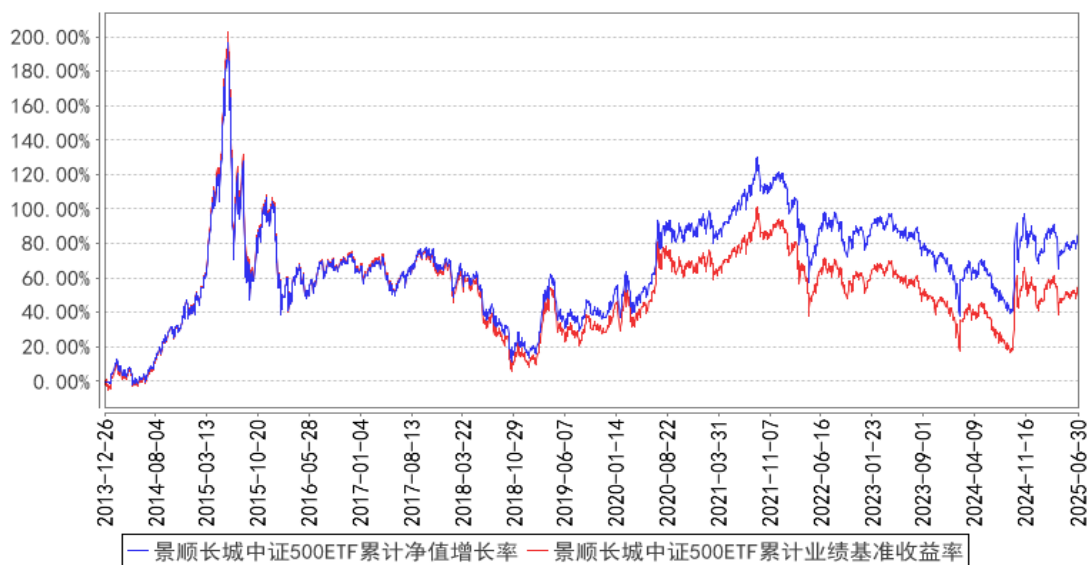
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.84%	0.77%	4.31%	0.79%	0.53%	-0.02%
过去三个月	1.73%	1.48%	0.98%	1.50%	0.75%	-0.02%
过去六个月	3.87%	1.34%	3.31%	1.36%	0.56%	-0.02%
过去一年	20.65%	1.69%	19.68%	1.72%	0.97%	-0.03%
过去三年	-4.98%	1.33%	-8.35%	1.35%	3.37%	-0.02%
自基金合同生效起至今	85.91%	1.55%	55.32%	1.58%	30.59%	-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2025年6月30日，本公司旗下共管理199只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张 晓 南	本基金的基金助理	2023年9月13日	-	15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15年证券、基金行业从业经验。
龚 丽	本基金的基金经理	2024年5月30日	-	14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14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	14	29,136,201,249.91	2023年11月15日
	私募资产管理计划	3	791,025,047.22	2023年12月27日
	其他组合	-	-	-
	合计	17	29,927,226,297.13	-

注：基金经理龚丽丽女士所管理公募产品景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金于 2025 年 6 月 20 日进入清算期。

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 5 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的同日反向交易。

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 股市场一波三折：开年第一天大跌后，受到科技板块的带动出现起色，但 4 月再次

因美国新一届政府关税政策的影响出现较大下跌，后续则随着关税谈判的进行逐渐企稳回升，最终录得个位数涨幅。主要宽基指数有一定程度分化，宽基指数涨跌幅及排序为：中证 500(3.31%)> 科创 50(1.46%)> 沪深 300(0.03%)> 创业板 50(-0.43%)。市值维度，总体表现出小盘占优特征，规模指数涨跌幅及排序为：中证 2000(15.24%)> 中证 1000(6.69%)> 中证 500(3.31%)> 沪深 300(0.03%)。风格维度，中信风格指数涨跌幅及排序为：成长(7.51%)> 金融(7.34%)> 周期(6.57%)> 消费(1.19%)> 稳定(-1.06%)。行业维度，中信证券一级行业指数涨跌幅前五为：综合金融(33.09%)> 有色金属(18.22%)> 银行(15.90%)> 传媒(14.10%)> 国防军工(13.99%)，后五为：煤炭(-10.77%)< 房地产(-5.97%)< 食品饮料(-5.87%)< 石油石化(-4.13%)< 交通运输(-1.33%)。

宏观数据层面，2025 年 6 月工业增加值同比增长 6.8%，前值 5.8%；6 月社会消费品零售总额同比增长 4.8%，前值 6.4%。通胀指标：6 月 PPI 同比-3.6%，前值-3.3%；6 月 CPI 同比 0.1%，前值-0.1%。货币金融指标：6 月 M2 同比增长 8.3%，前值 7.9%；6 月社会融资规模同比增长 8.9%，前值 8.7%。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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 3.87%，业绩比较基准收益率为 3.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。二季度宏观经济整体延续较强韧性，生产端的表现依旧强劲，需求端表现有所分化，出口在关税的冲击扰动下有所回落，消费在以旧换新政策的支持下延续亮眼表现，而投资则在二季度以来逐月降温，房地产重现新一轮下行压力，总体价格则延续低迷表现。在经济数据总体韧性较强的背景下，金融数据表现相对较弱，指向目前经济内生动能仍有待进一步加强。当前中国经济有望在宏观政策加力下进一步复苏，财政政策和货币政策的协同发力将继续为经济提供支撑，内需对经济的拉动作用将更加显著。在经济复苏大背景下，权益市场配置价值凸显。在科技领先但市场仍未确定明显主线时，宽基指数仍是较优选择。

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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等

方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及其适用性的情况时，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 2024 年 6 月 24 日至 2024 年 9 月 27 日，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。本基金管理人已按照基金合同要求向中国证监会报告解决方案。

同时为减轻迷你基金固定费用支出给投资者造成的负担，切实保障基金份额持有人利益，自 2024 年 9 月 14 日起至 2024 年 12 月 27 日，我司承担本基金的固定费用（包括信息披露费、审计费等）。

§ 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合规守信、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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	818,907.83	873,726.26
结算备付金		146,797.04	12,956.91
存出保证金		1,804.25	7,797.07
交易性金融资产	6.4.7.2	58,104,094.98	63,018,314.59
其中：股票投资		58,102,494.87	63,018,314.59
基金投资		-	-
债券投资		1,600.11	-
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		194,800.66	-
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		59,266,404.76	63,912,794.83
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024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		-	135,597.06
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,587.70	28,216.84
应付托管费		4,917.54	5,643.35
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	540,754.56	70,797.51
负债合计		570,259.80	240,254.76
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	31,572,956.00	35,572,956.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	27,123,188.96	28,099,584.07
净资产合计		58,696,144.96	63,672,540.07
负债和净资产总计		59,266,404.76	63,912,794.83

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.8591 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024
-----	-----	----------------------------	---------------------------------

		年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,054,096.77	-3,817,341.58
1. 利息收入		1,477.37	2,010.28
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,477.37	2,010.28
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）		300,828.28	-1,436,068.85
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-290,277.64	-2,090,897.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,691.89	439.24
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	587,414.03	654,389.13
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	2,711,724.47	-2,379,115.47
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	40,066.65	-4,167.54
减：二、营业总支出		228,305.83	229,348.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	149,846.15	123,190.33
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	29,969.29	24,638.05
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	48,490.39	81,520.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,825,790.94	-4,046,690.53

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,825,790.94	-4,046,690.53
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,825,790.94	-4,046,690.53

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	35,572,956.00	-	28,099,584.07	63,672,540.07
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	35,572,956.00	-	28,099,584.07	63,672,540.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	-	-976,395.11	-4,976,395.11
（一）、综合收益总额	-	-	2,825,790.94	2,825,790.94
（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）	-4,000,000.00	-	-3,802,186.05	-7,802,186.05
其中：1. 基金申购款	17,000,000.00	-	13,387,139.03	30,387,139.03
2. 基金赎回款	-21,000,000.00	-	-17,189,325.08	-38,189,325.08
（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	-	27,123,188.96	58,696,144.96
项目	上年度可比期间 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

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：

<u>康乐</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	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 2025 年 8 月 27 日批准报出。

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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

(1) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金

融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征

收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3%调整为1%，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《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[2016]127号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2025年6月30日
活期存款	818,907.83
等于：本金	818,809.28
加：应计利息	98.55
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	-
存款期限 3 个月（含）至 1 年	-
存款期限 1 年（含）以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	818,907.83

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	57,036,659.59	-	58,102,494.87	1,065,835.28
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,600.00	1,600.11	0.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,600.00	1,600.11	0.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	57,038,259.59	0.11	58,104,094.98	1,065,835.28

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

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 2025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	10,370.23
其中：交易所市场	10,370.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	43,639.10
应退替代款	486,745.23

合计	540,754.56
----	------------

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,572,956.00	35,572,956.00
本期申购	17,000,000.00	17,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-21,000,000.00	-21,000,000.00
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	54,614,995.47	-26,515,411.40	28,099,584.07
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	54,614,995.47	-26,515,411.40	28,099,584.07
本期利润	114,066.47	2,711,724.47	2,825,790.94
本期基金份额交易产生的变动数	-6,132,558.12	2,330,372.07	-3,802,186.05
其中：基金申购款	26,105,035.06	-12,717,896.03	13,387,139.03
基金赎回款	-32,237,593.18	15,048,268.10	-17,189,325.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	48,596,503.82	-21,473,314.86	27,123,188.96

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
	活期存款利息收入
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	66.61

其他	6.37
合计	1,477.37

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-493,991.93
股票投资收益——赎回差价收入	203,714.29
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	-290,277.64

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	31,174,329.99
减：卖出股票成本总额	31,637,027.90
减：交易费用	31,294.02
买卖股票差价收入	-493,991.93

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 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	38,189,325.08
减：现金支付赎回款总额	19,581,077.08
减：赎回股票成本总额	18,404,533.71
减：交易费用	-
赎回差价收入	203,714.29

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	2.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,689.57

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	3,691.89

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	26,392.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,700.00
减：应计利息总额	2.21
减：交易费用	0.98
买卖债券差价收入	3,689.57

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	587,414.03
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	587,414.03

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	2,711,724.47
股票投资	2,711,724.47
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	2,711,724.47

注：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。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	40,066.65
合计	40,066.65

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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	3,967.52
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	759.43

指数使用费	4,070.93
存托服务费	20.93
合计	48,490.39

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。根据《关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费调整为基金管理人承担。

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投资基金联接基金（“景顺长城中证 500ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	149,846.15	123,190.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,557.24	3,477.49
应支付基金管理人的净管理费	139,288.91	119,712.84

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	29,969.29	24,638.05

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固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024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	24,961,400.00	79.06	26,225,900.00	73.72

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	818,907.83	1,404.39	963,430.29	1,924.78

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2025年6月30日，本基金持有12,800股长城证券的A股普通股，成本总额为人民币117,127.90元，估值总额为人民币107,264.00元，占基金净资产的比例为0.18%（2024年12月31日：本基金持有14,500股长城证券的A股普通股，成本总额为人民币143,292.40元，估值总额为人民币118,900.00元，占基金净资产的比例为0.19%）。

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（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值	备注
		认购	期	受限	价格	估值	(单	成本总额	总额	

	名称	日期		类型		单价	位：张)			
123257	安克转债	2025年6月16日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	16	1,600.00	1,600.11	-

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 2025 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 2025 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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.00%（上年度末：0.00%）。

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发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025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	818,907.83	-	-	-	-	-	818,907.83
结算备付金	146,797.04	-	-	-	-	-	146,797.04
存出保证金	1,804.25	-	-	-	-	-	1,804.25
交易性金融资产	-	-	-	-	1,600.11	58,102,494.87	58,104,094.98
应收清算款	-	-	-	-	-	194,800.66	194,800.66
资产总计	967,509.12	-	-	-	1,600.11	58,297,295.53	59,266,404.76
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,587.70	24,587.70
应付托管费	-	-	-	-	-	4,917.54	4,917.54
其他负债	-	-	-	-	-	540,754.56	540,754.56
负债总计	-	-	-	-	-	570,259.80	570,259.80
利率敏感度缺口	967,509.12	-	-	-	1,600.11	-	-
上年度末 2024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	873,726.26	-	-	-	-	-	873,726.26
结算备付金	12,956.91	-	-	-	-	-	12,956.91
存出保证金	7,797.07	-	-	-	-	-	7,797.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	63,018,314.59	63,018,314.59
资产总计	894,480.24	-	-	-	-	63,018,314.59	63,912,794.83
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,216.84	28,216.84
应付托管费	-	-	-	-	-	5,643.35	5,643.35
应付清算款	-	-	-	-	-	135,597.06	135,597.06
其他负债	-	-	-	-	-	70,797.51	70,797.51
负债总计	-	-	-	-	-	240,254.76	240,254.76
利率敏感度缺口	894,480.24	-	-	-	-	-	-

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：0.00%），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 2025年6月30日		上年度末 2024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	58,102,494.87	98.99	63,018,314.59	98.97
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	58,102,494.87	98.99	63,018,314.59	98.97

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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,342,249.21	3,572,959.38
	沪深 300 指数下降 5%	-3,342,249.21	-3,572,959.38

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	58,097,951.87	63,013,771.59
第二层次	1,600.11	-
第三层次	4,543.00	4,543.00
合计	58,104,094.98	63,018,314.59

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

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	58,102,494.87	98.04
	其中：股票	58,102,494.87	98.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,600.11	0.00
	其中：债券	1,600.11	0.00
	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	965,704.87	1.63
8	其他各项资产	196,604.91	0.33
9	合计	59,266,404.76	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	146,386.00	0.25
B	采矿业	2,090,842.00	3.56
C	制造业	36,760,930.80	62.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,880,088.66	3.20
E	建筑业	511,990.00	0.87
F	批发和零售业	1,283,889.06	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	972,137.16	1.66
H	住宿和餐饮业	157,917.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,353,836.55	9.12
J	金融业	5,724,323.40	9.75
K	房地产业	723,991.44	1.23
L	租赁和商务服务业	500,494.60	0.85
M	科学研究和技术服务业	395,220.48	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	245,506.84	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	119,340.00	0.20
Q	卫生和社会工作	269,878.88	0.46
R	文化、体育和娱乐业	822,782.00	1.40
S	综合	138,397.00	0.24
	合计	58,097,951.87	98.98

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	300476	胜宏科技	4,700	631,586.00	1.08
2	000988	华工科技	7,959	374,152.59	0.64
3	600988	赤峰黄金	13,200	328,416.00	0.56
4	300339	润和软件	6,300	320,229.00	0.55
5	002966	苏州银行	35,360	310,460.80	0.53
6	600839	四川长虹	29,200	283,824.00	0.48
7	601162	天风证券	56,100	276,573.00	0.47
8	601555	东吴证券	31,490	275,537.50	0.47
9	689009	九号公司	4,491	265,732.47	0.45
10	688521	芯原股份	2,711	261,611.50	0.45
11	002517	恺英网络	13,500	260,685.00	0.44
12	002340	格林美	40,538	257,416.30	0.44
13	002195	岩山科技	44,922	252,910.86	0.43
14	002558	巨人网络	10,700	251,985.00	0.43
15	002261	拓维信息	8,000	247,600.00	0.42
16	002156	通富微电	9,600	245,952.00	0.42
17	603893	瑞芯微	1,600	242,976.00	0.41
18	600487	亨通光电	15,600	238,680.00	0.41
19	600157	永泰能源	175,500	235,170.00	0.40
20	300251	光线传媒	11,600	235,132.00	0.40
21	002797	第一创业	33,200	235,056.00	0.40
22	300207	欣旺达	11,700	234,702.00	0.40
23	688608	恒玄科技	662	230,362.76	0.39

24	000066	中国长城	15,300	226,440.00	0.39
25	300803	指南针	2,800	225,848.00	0.38
26	600096	云天化	10,100	221,897.00	0.38
27	600536	中国软件	4,742	221,783.34	0.38
28	002273	水晶光电	11,024	220,149.28	0.38
29	601168	西部矿业	13,200	219,516.00	0.37
30	002465	海格通信	15,700	218,858.00	0.37
31	600879	航天电子	20,892	218,739.24	0.37
32	688777	中控技术	4,866	218,532.06	0.37
33	300450	先导智能	8,700	216,195.00	0.37
34	688120	华海清科	1,271	214,417.70	0.37
35	688213	思特威	2,096	214,253.12	0.37
36	000831	中国稀土	5,900	213,108.00	0.36
37	002294	信立泰	4,500	212,985.00	0.36
38	601099	太平洋	53,900	211,827.00	0.36
39	688235	百济神州	906	211,677.84	0.36
40	600352	浙江龙盛	20,600	209,296.00	0.36
41	000933	神火股份	12,500	208,000.00	0.35
42	300017	网宿科技	19,400	207,968.00	0.35
43	600885	宏发股份	9,227	205,854.37	0.35
44	002185	华天科技	20,300	205,030.00	0.35
45	601108	财通证券	25,700	203,287.00	0.35
46	688002	睿创微纳	2,837	197,795.64	0.34
47	601128	常熟银行	26,195	193,057.15	0.33
48	600079	人福医药	9,100	190,918.00	0.33
49	002281	光迅科技	3,869	190,819.08	0.33
50	002130	沃尔核材	8,000	190,560.00	0.32
51	601577	长沙银行	19,100	189,854.00	0.32
52	000423	东阿阿胶	3,600	188,280.00	0.32
53	002085	万丰奥威	11,800	187,502.00	0.32
54	688469	芯联集成	39,101	186,511.77	0.32
55	000997	新大陆	5,752	186,249.76	0.32
56	002738	中矿资源	5,740	184,598.40	0.31
57	688099	晶晨股份	2,589	183,844.89	0.31
58	002532	天山铝业	22,100	183,651.00	0.31
59	002595	豪迈科技	3,100	183,582.00	0.31
60	300058	蓝色光标	27,960	183,417.60	0.31
61	300002	神州泰岳	15,500	182,900.00	0.31
62	300458	全志科技	4,600	182,574.00	0.31
63	000783	长江证券	26,300	182,259.00	0.31
64	002472	双环传动	5,400	180,846.00	0.31
65	600109	国金证券	20,600	180,662.00	0.31
66	002138	顺络电子	6,400	179,968.00	0.31

67	300223	北京君正	2,600	179,920.00	0.31
68	002078	太阳纸业	13,320	179,287.20	0.31
69	300454	深信服	1,900	178,942.00	0.30
70	300474	景嘉微	2,450	178,850.00	0.30
71	688122	西部超导	3,435	178,207.80	0.30
72	002436	兴森科技	13,400	177,416.00	0.30
73	603596	伯特利	3,360	177,038.40	0.30
74	601933	永辉超市	35,900	175,910.00	0.30
75	300765	新诺威	3,400	175,746.00	0.30
76	002410	广联达	13,100	175,671.00	0.30
77	002851	麦格米特	3,500	175,490.00	0.30
78	600862	中航高科	6,700	174,736.00	0.30
79	300346	南大光电	5,500	174,020.00	0.30
80	603129	春风动力	800	173,200.00	0.30
81	600580	卧龙电驱	8,732	172,631.64	0.29
82	300136	信维通信	7,700	172,480.00	0.29
83	600143	金发科技	16,700	172,177.00	0.29
84	300054	鼎龙股份	6,000	172,080.00	0.29
85	002223	鱼跃医疗	4,826	171,805.60	0.29
86	601198	东兴证券	15,400	171,710.00	0.29
87	300496	中科创达	3,000	171,660.00	0.29
88	002353	杰瑞股份	4,900	171,500.00	0.29
89	002065	东华软件	17,800	170,880.00	0.29
90	603606	东方电缆	3,300	170,643.00	0.29
91	300024	机器人	9,900	170,082.00	0.29
92	002850	科达利	1,500	169,755.00	0.29
93	000034	神州数码	4,500	169,380.00	0.29
94	600363	联创光电	2,900	169,157.00	0.29
95	600873	梅花生物	15,800	168,902.00	0.29
96	600298	安琪酵母	4,800	168,816.00	0.29
97	300395	菲利华	3,300	168,630.00	0.29
98	002202	金风科技	16,375	167,843.75	0.29
99	002673	西部证券	21,200	167,056.00	0.28
100	688525	佰维存储	2,465	166,141.00	0.28
101	601615	明阳智能	14,400	165,456.00	0.28
102	002624	完美世界	10,800	163,836.00	0.28
103	688617	惠泰医疗	551	163,647.00	0.28
104	000728	国元证券	20,700	163,323.00	0.28
105	002008	大族激光	6,700	163,279.00	0.28
106	300383	光环新网	11,400	163,020.00	0.28
107	000021	深科技	8,630	161,726.20	0.28
108	300115	长盈精密	7,500	160,500.00	0.27
109	688072	拓荆科技	1,041	160,012.11	0.27

110	603659	璞泰来	8,500	159,630.00	0.27
111	600895	张江高科	6,200	159,340.00	0.27
112	600549	厦门钨业	7,600	158,992.00	0.27
113	603087	甘李药业	2,900	158,862.00	0.27
114	300604	长川科技	3,500	157,185.00	0.27
115	000426	兴业银锡	9,900	156,420.00	0.27
116	300012	华测检测	13,300	155,477.00	0.26
117	000733	振华科技	3,100	155,155.00	0.26
118	300857	协创数据	1,800	154,908.00	0.26
119	002155	湖南黄金	8,640	154,224.00	0.26
120	600171	上海贝岭	4,500	154,125.00	0.26
121	300627	华测导航	4,400	154,000.00	0.26
122	605589	圣泉集团	5,400	149,850.00	0.26
123	603160	汇顶科技	2,100	149,163.00	0.25
124	603605	珀莱雅	1,800	149,022.00	0.25
125	688578	艾力斯	1,597	148,584.88	0.25
126	300037	新宙邦	4,220	148,544.00	0.25
127	300699	光威复材	4,660	147,582.20	0.25
128	601216	君正集团	26,700	147,384.00	0.25
129	600392	盛和资源	11,095	146,121.15	0.25
130	601665	齐鲁银行	23,100	145,992.00	0.25
131	000750	国海证券	35,390	145,806.80	0.25
132	002444	巨星科技	5,711	145,687.61	0.25
133	000519	中兵红箭	6,627	145,065.03	0.25
134	000729	燕京啤酒	11,200	144,816.00	0.25
135	000932	华菱钢铁	32,800	144,320.00	0.25
136	601997	贵阳银行	23,100	144,144.00	0.25
137	688180	君实生物	4,237	143,973.26	0.25
138	300003	乐普医疗	10,400	143,312.00	0.24
139	600153	建发股份	13,800	143,106.00	0.24
140	601717	中创智领	8,610	143,098.20	0.24
141	688220	翱捷科技	1,827	143,054.10	0.24
142	600060	海信视像	6,200	142,724.00	0.24
143	300001	特锐德	5,900	141,423.00	0.24
144	601990	南京证券	17,500	141,400.00	0.24
145	000878	云南铜业	11,100	141,192.00	0.24
146	601696	中银证券	13,200	141,108.00	0.24
147	601233	桐昆股份	13,300	140,980.00	0.24
148	300073	当升科技	3,200	140,384.00	0.24
149	300142	沃森生物	12,700	139,700.00	0.24
150	603979	金诚信	3,000	139,320.00	0.24
151	600673	东阳光	11,900	138,397.00	0.24
152	002414	高德红外	13,500	138,375.00	0.24

153	600699	均胜电子	7,880	137,427.20	0.23
154	600369	西南证券	31,500	137,025.00	0.23
155	002837	英维克	4,600	136,666.00	0.23
156	002007	华兰生物	8,700	136,329.00	0.23
157	300373	扬杰科技	2,600	134,940.00	0.23
158	600118	中国卫星	4,700	134,279.00	0.23
159	600521	华海药业	7,200	134,136.00	0.23
160	688361	中科飞测	1,588	133,693.72	0.23
161	688027	国盾量子	486	133,654.86	0.23
162	600177	雅戈尔	18,300	133,590.00	0.23
163	002152	广电运通	9,900	133,056.00	0.23
164	000893	亚钾国际	4,400	132,616.00	0.23
165	002821	凯莱英	1,500	132,375.00	0.23
166	600398	海澜之家	19,000	132,240.00	0.23
167	688065	凯赛生物	2,800	131,880.00	0.22
168	600435	北方导航	8,420	131,267.80	0.22
169	000738	航发控制	6,300	130,725.00	0.22
170	600704	物产中大	24,700	130,169.00	0.22
171	688052	纳芯微	744	129,820.56	0.22
172	300748	金力永磁	5,440	129,689.60	0.22
173	600909	华安证券	22,220	129,542.60	0.22
174	688249	晶合集成	6,373	129,180.71	0.22
175	000623	吉林敖东	7,600	128,820.00	0.22
176	603345	安井食品	1,600	128,672.00	0.22
177	002318	久立特材	5,500	128,645.00	0.22
178	600316	洪都航空	3,400	128,180.00	0.22
179	600038	中直股份	3,300	128,073.00	0.22
180	600497	驰宏锌锗	24,200	128,018.00	0.22
181	603228	景旺电子	3,052	127,695.68	0.22
182	002044	美年健康	24,800	127,472.00	0.22
183	603179	新泉股份	2,700	126,819.00	0.22
184	000009	中国宝安	14,280	126,806.40	0.22
185	002958	青农商行	35,100	126,711.00	0.22
186	600765	中航重机	7,505	126,684.40	0.22
187	600562	国睿科技	4,000	125,960.00	0.21
188	002409	雅克科技	2,300	125,787.00	0.21
189	600141	兴发集团	6,120	125,643.60	0.21
190	002683	广东宏大	3,700	125,578.00	0.21
191	300919	中伟股份	3,800	124,944.00	0.21
192	000400	许继电气	5,694	123,958.38	0.21
193	001696	宗申动力	5,500	123,475.00	0.21
194	000528	柳工	12,800	123,008.00	0.21
195	600155	华创云信	17,600	122,496.00	0.21

196	688385	复旦微电	2,459	121,154.93	0.21
197	600498	烽火通信	5,700	119,871.00	0.20
198	600637	东方明珠	16,000	119,520.00	0.20
199	300724	捷佳伟创	2,200	119,460.00	0.20
200	000960	锡业股份	7,800	119,340.00	0.20
200	002607	中公教育	39,000	119,340.00	0.20
201	300623	捷捷微电	4,000	119,200.00	0.20
202	603939	益丰药房	4,848	118,630.56	0.20
203	600884	杉杉股份	12,500	118,250.00	0.20
204	600529	山东药玻	5,300	117,342.00	0.20
205	300558	贝达药业	2,000	115,900.00	0.20
206	002739	万达电影	10,100	115,443.00	0.20
207	000039	中集集团	14,640	115,070.40	0.20
208	688568	中科星图	3,192	114,943.92	0.20
209	002841	视源股份	3,300	114,180.00	0.19
210	002653	海思科	2,700	113,994.00	0.19
211	000415	渤海租赁	34,200	113,886.00	0.19
212	002025	航天电器	2,200	113,102.00	0.19
213	600486	扬农化工	1,950	113,100.00	0.19
214	301358	湖南裕能	3,600	112,284.00	0.19
215	002926	华西证券	12,500	111,750.00	0.19
216	600901	江苏金租	18,380	111,382.80	0.19
217	600563	法拉电子	1,019	111,162.71	0.19
218	000887	中鼎股份	6,300	110,817.00	0.19
219	603486	科沃斯	1,900	110,637.00	0.19
220	600132	重庆啤酒	2,000	110,200.00	0.19
221	002385	大北农	27,200	109,888.00	0.19
222	300285	国瓷材料	6,300	109,305.00	0.19
223	300763	锦浪科技	1,900	109,041.00	0.19
224	300679	电连技术	2,400	108,912.00	0.19
225	688188	柏楚电子	824	108,487.84	0.18
226	002568	百润股份	4,200	107,562.00	0.18
227	002939	长城证券	12,800	107,264.00	0.18
228	300144	宋城演艺	12,500	106,875.00	0.18
229	600820	隧道股份	17,400	106,140.00	0.18
230	688582	芯动联科	1,578	106,041.60	0.18
231	600863	内蒙华电	25,800	106,038.00	0.18
232	300487	蓝晓科技	2,100	105,630.00	0.18
233	000723	美锦能源	24,400	105,408.00	0.18
234	600008	首创环保	34,870	105,307.40	0.18
235	002080	中材科技	5,400	105,300.00	0.18
236	300757	罗博特科	700	104,979.00	0.18
237	688017	绿的谐波	840	104,907.60	0.18

238	000513	丽珠集团	2,903	104,624.12	0.18
239	603568	伟明环保	5,478	104,520.24	0.18
240	600763	通策医疗	2,521	104,066.88	0.18
241	002064	华峰化学	15,700	103,777.00	0.18
242	600390	五矿资本	17,800	103,774.00	0.18
243	600516	方大炭素	22,300	103,472.00	0.18
244	002312	川发龙蟒	9,000	103,320.00	0.18
245	600998	九州通	19,980	102,697.20	0.17
246	688538	和辉光电	43,735	102,339.90	0.17
247	000703	恒逸石化	17,400	102,312.00	0.17
248	600166	福田汽车	37,600	101,896.00	0.17
249	002262	恩华药业	4,900	101,822.00	0.17
250	603589	口子窖	2,900	100,920.00	0.17
251	600170	上海建工	42,200	100,858.00	0.17
252	605358	立昂微	4,300	100,190.00	0.17
253	600312	平高电气	6,500	100,035.00	0.17
254	002500	山西证券	17,060	99,630.40	0.17
255	300676	华大基因	2,000	99,540.00	0.17
256	603816	顾家家居	3,900	99,528.00	0.17
257	601179	中国西电	16,200	99,468.00	0.17
258	600208	衢州发展	33,600	99,456.00	0.17
259	000683	博源化工	20,600	98,674.00	0.17
260	601155	新城控股	7,200	98,496.00	0.17
261	600021	上海电力	11,200	98,448.00	0.17
262	002432	九安医疗	2,700	98,361.00	0.17
263	002203	海亮股份	9,500	98,040.00	0.17
264	688728	格科微	6,339	97,620.60	0.17
265	600985	淮北矿业	8,600	97,524.00	0.17
266	000403	派林生物	5,340	96,814.20	0.16
267	002244	滨江集团	9,924	96,759.00	0.16
268	600126	杭钢股份	10,740	96,660.00	0.16
269	600380	健康元	8,692	95,872.76	0.16
270	000921	海信家电	3,719	95,578.30	0.16
271	600583	海油工程	17,500	95,550.00	0.16
272	603379	三美股份	1,980	95,277.60	0.16
273	000591	太阳能	21,700	95,263.00	0.16
274	600348	华阳股份	14,300	95,238.00	0.16
275	601000	唐山港	23,411	95,048.66	0.16
276	600872	中炬高新	5,000	95,000.00	0.16
277	000060	中金岭南	20,700	94,806.00	0.16
278	603338	浙江鼎力	2,000	94,800.00	0.16
279	603885	吉祥航空	7,000	94,290.00	0.16
280	000629	钒钛股份	36,800	94,208.00	0.16

281	688114	华大智造	1,448	93,873.84	0.16
282	000830	鲁西化工	9,107	93,802.10	0.16
283	002984	森麒麟	5,000	93,750.00	0.16
284	601991	大唐发电	29,400	93,198.00	0.16
285	002603	以岭药业	6,600	93,060.00	0.16
286	688183	生益电子	1,814	92,876.80	0.16
287	002439	启明星辰	5,800	92,742.00	0.16
288	600535	天士力	5,900	92,335.00	0.16
289	600816	建元信托	31,100	91,745.00	0.16
290	002056	横店东磁	6,464	91,465.60	0.16
291	000062	深圳华强	3,400	91,324.00	0.16
292	600095	湘财股份	9,100	91,273.00	0.16
293	300146	汤臣倍健	8,100	91,044.00	0.16
294	300567	精测电子	1,500	90,915.00	0.15
295	603927	中科软	4,676	90,433.84	0.15
296	600685	中船防务	3,300	89,727.00	0.15
297	688278	特宝生物	1,244	89,704.84	0.15
298	600970	中材国际	10,450	89,661.00	0.15
299	300390	天华新能	4,690	89,438.30	0.15
300	002423	中粮资本	7,300	89,279.00	0.15
301	600499	科达制造	9,100	89,180.00	0.15
302	601880	辽港股份	59,299	88,948.50	0.15
303	603000	人民网	4,400	88,924.00	0.15
304	601016	节能风电	30,720	88,780.80	0.15
305	000636	风华高科	6,443	88,526.82	0.15
306	601611	中国核建	9,600	88,224.00	0.15
307	603298	杭叉集团	4,200	87,990.00	0.15
308	300212	易华录	4,040	87,910.40	0.15
309	000958	电投产融	12,800	87,552.00	0.15
310	601666	平煤股份	11,800	87,438.00	0.15
311	600511	国药股份	2,986	87,071.76	0.15
312	600859	王府井	6,264	87,006.96	0.15
313	603899	晨光股份	3,000	86,970.00	0.15
314	002773	康弘药业	3,000	86,910.00	0.15
315	000563	陕国投 A	24,330	86,858.10	0.15
316	603737	三棵树	2,348	86,523.80	0.15
317	000155	川能动力	8,800	86,416.00	0.15
318	601456	国联民生	8,300	85,905.00	0.15
319	600004	白云机场	9,400	85,540.00	0.15
320	603077	和邦生物	48,843	85,475.25	0.15
321	600655	豫园股份	15,400	85,470.00	0.15
322	688297	中无人机	1,597	85,279.80	0.15
323	300677	英科医疗	3,600	85,248.00	0.15

324	601966	玲珑轮胎	5,800	85,086.00	0.14
325	000598	兴蓉环境	11,800	85,078.00	0.14
326	600131	国网信通	4,800	84,960.00	0.14
327	600483	福能股份	8,800	84,832.00	0.14
328	600325	华发股份	17,412	84,796.44	0.14
329	603156	养元饮品	4,000	84,640.00	0.14
330	301536	星辰科技	1,400	84,420.00	0.14
331	601958	金钼股份	7,700	84,238.00	0.14
332	600378	昊华科技	3,100	83,917.00	0.14
333	000050	深天马 A	9,800	83,496.00	0.14
334	600663	陆家嘴	9,400	83,284.00	0.14
335	600754	锦江酒店	3,700	83,028.00	0.14
336	000951	中国重汽	4,700	82,626.00	0.14
337	002756	永兴材料	2,600	82,550.00	0.14
338	600598	北大荒	5,700	82,194.00	0.14
339	002507	涪陵榨菜	6,420	82,111.80	0.14
340	300529	健帆生物	3,800	81,966.00	0.14
341	600282	南钢股份	19,500	81,900.00	0.14
342	601001	晋控煤业	6,700	81,874.00	0.14
343	000987	越秀资本	11,930	81,839.80	0.14
344	600271	航天信息	8,800	81,312.00	0.14
345	300601	康泰生物	5,300	80,507.00	0.14
346	603728	鸣志电器	1,400	80,458.00	0.14
347	000559	万向钱潮	10,500	80,325.00	0.14
347	600737	中粮糖业	8,500	80,325.00	0.14
348	600739	辽宁成大	7,300	80,300.00	0.14
349	601918	新集能源	12,300	79,458.00	0.14
350	600566	济川药业	3,000	78,990.00	0.13
351	301308	江波龙	900	78,741.00	0.13
352	600582	天地科技	13,100	78,469.00	0.13
353	002429	兆驰股份	17,900	78,402.00	0.13
354	600764	中国海防	2,300	78,200.00	0.13
355	300735	光弘科技	3,100	77,810.00	0.13
356	688234	天岳先进	1,325	77,578.75	0.13
357	601231	环旭电子	5,300	77,539.00	0.13
358	688363	华熙生物	1,510	77,538.50	0.13
359	601333	广深铁路	26,800	77,452.00	0.13
360	300070	碧水源	17,200	77,400.00	0.13
361	603341	龙旗科技	1,900	77,197.00	0.13
362	688772	珠海冠宇	5,397	77,123.13	0.13
363	002120	韵达股份	11,500	77,050.00	0.13
364	601866	中远海发	31,100	76,817.00	0.13
365	003031	中瓷电子	1,440	76,622.40	0.13

366	300751	迈为股份	1,100	76,516.00	0.13
367	600867	通化东宝	9,300	76,260.00	0.13
368	688301	奕瑞科技	866	75,870.26	0.13
369	002430	杭氧股份	3,900	75,738.00	0.13
370	603688	石英股份	2,150	75,723.00	0.13
371	300888	稳健医疗	1,840	75,624.00	0.13
372	600329	达仁堂	2,255	75,226.80	0.13
373	600258	首旅酒店	5,300	74,889.00	0.13
374	601098	中南传媒	5,700	74,784.00	0.13
375	300573	兴齐眼药	1,440	74,577.60	0.13
376	600995	南网储能	7,600	74,328.00	0.13
377	600707	彩虹股份	11,400	73,644.00	0.13
378	688520	神州细胞	1,226	73,376.10	0.13
379	601212	白银有色	23,400	73,242.00	0.12
380	603290	斯达半导	900	73,143.00	0.12
381	000032	深桑达 A	3,600	72,828.00	0.12
382	688778	厦钨新能	1,294	72,360.48	0.12
383	603529	爱玛科技	2,100	72,240.00	0.12
384	002508	老板电器	3,800	72,238.00	0.12
385	000027	深圳能源	11,320	72,221.60	0.12
386	603858	步长制药	4,400	71,456.00	0.12
387	002299	圣农发展	5,000	71,450.00	0.12
388	600578	京能电力	15,900	71,391.00	0.12
389	002831	裕同科技	3,020	70,728.40	0.12
390	000709	河钢股份	32,700	70,632.00	0.12
391	600906	财达证券	10,300	70,246.00	0.12
392	000967	盈峰环境	10,100	70,195.00	0.12
393	688318	财富趋势	605	69,526.60	0.12
394	000883	湖北能源	15,400	69,454.00	0.12
395	600517	国网英大	13,600	69,360.00	0.12
396	002670	国盛金控	4,601	69,245.05	0.12
397	600546	山煤国际	7,900	68,967.00	0.12
398	600848	上海临港	7,600	68,932.00	0.12
399	601399	国机重装	22,800	68,400.00	0.12
400	601928	凤凰传媒	6,100	68,137.00	0.12
401	600959	江苏有线	19,800	68,112.00	0.12
402	688561	奇安信	1,969	66,906.62	0.11
403	601156	东航物流	5,100	66,759.00	0.11
404	688676	金盘科技	1,982	66,297.90	0.11
405	000739	普洛药业	4,700	65,800.00	0.11
406	600968	海油发展	16,100	65,688.00	0.11
407	300595	欧普康视	4,300	65,661.00	0.11
408	301498	乖宝宠物	600	65,622.00	0.11

409	600808	马钢股份	19,000	65,550.00	0.11
410	000825	太钢不锈	18,100	64,979.00	0.11
411	600528	中铁工业	8,800	64,944.00	0.11
412	603225	新凤鸣	6,072	64,666.80	0.11
413	002572	索菲亚	4,600	64,446.00	0.11
414	601118	海南橡胶	13,600	64,192.00	0.11
415	601636	旗滨集团	12,800	64,128.00	0.11
416	603565	中谷物流	6,700	63,985.00	0.11
417	301301	川宁生物	5,300	63,812.00	0.11
418	002266	浙富控股	20,645	63,586.60	0.11
419	601608	中信重工	14,500	63,365.00	0.11
420	600801	华新水泥	5,351	63,355.84	0.11
421	600977	中国电影	5,900	63,248.00	0.11
422	000543	皖能电力	9,000	63,000.00	0.11
423	600062	华润双鹤	3,362	62,734.92	0.11
424	600871	石化油服	32,100	62,595.00	0.11
425	300957	贝泰妮	1,400	61,908.00	0.11
426	600056	中国医药	5,977	61,802.18	0.11
427	688387	信科移动	10,917	61,681.05	0.11
428	601598	中国外运	12,500	61,625.00	0.10
429	603650	彤程新材	1,900	61,085.00	0.10
430	000582	北部湾港	7,400	61,050.00	0.10
431	601106	中国一重	21,700	60,760.00	0.10
432	603233	大参林	3,688	60,114.40	0.10
433	000785	居然智家	19,700	60,085.00	0.10
434	688702	盛科通信	968	59,125.44	0.10
435	600373	中文传媒	5,600	57,512.00	0.10
436	600925	苏能股份	10,900	57,007.00	0.10
437	601965	中国汽研	3,200	56,800.00	0.10
438	002153	石基信息	6,530	56,549.80	0.10
439	688563	航材股份	998	56,516.74	0.10
440	000429	粤高速 A	4,200	55,986.00	0.10
441	000537	中绿电	6,600	55,176.00	0.09
442	600612	老凤祥	1,100	54,725.00	0.09
443	600606	绿地控股	33,300	54,279.00	0.09
444	002372	伟星新材	5,110	52,939.60	0.09
445	600098	广州发展	8,400	52,500.00	0.09
445	603658	安图生物	1,400	52,500.00	0.09
446	001286	陕西能源	6,013	52,313.10	0.09
447	601568	北元集团	12,590	52,248.50	0.09
448	688281	华秦科技	858	51,917.58	0.09
449	600361	创新新材	13,000	51,870.00	0.09
450	688425	铁建重工	12,652	51,620.16	0.09

451	688349	三一重能	2,059	51,351.46	0.09
452	003022	联泓新科	3,200	50,656.00	0.09
453	600688	上海石化	17,400	49,590.00	0.08
454	000937	冀中能源	8,400	48,300.00	0.08
455	601019	山东出版	5,000	47,350.00	0.08
456	601139	深圳燃气	6,900	43,884.00	0.07
457	000898	鞍钢股份	18,900	43,848.00	0.07
458	002608	江苏国信	5,976	43,804.08	0.07
459	600339	中油工程	13,300	43,491.00	0.07
460	600032	浙江新能	5,700	43,092.00	0.07
461	603707	健友股份	3,864	43,083.60	0.07
462	301165	锐捷网络	700	43,022.00	0.07
463	688100	威胜信息	1,161	43,015.05	0.07
464	600720	中交设计	5,500	42,515.00	0.07
465	688248	南网科技	1,338	42,093.48	0.07
466	000959	首钢股份	12,300	41,820.00	0.07
467	600928	西安银行	10,600	41,552.00	0.07
468	003035	南网能源	9,000	41,310.00	0.07
469	600295	鄂尔多斯	4,700	40,937.00	0.07
470	603556	海兴电力	1,600	40,752.00	0.07
471	688172	燕东微	2,020	39,713.20	0.07
472	002461	珠江啤酒	3,500	39,515.00	0.07
473	688475	萤石网络	1,238	39,021.76	0.07
474	603786	科博达	700	38,787.00	0.07
475	601228	广州港	12,000	38,760.00	0.07
476	301267	华夏眼科	2,000	38,340.00	0.07
477	600927	永安期货	2,300	34,063.00	0.06
478	601061	中信金属	4,300	34,013.00	0.06
479	002563	森马服饰	6,400	33,664.00	0.06
480	600007	中国国贸	1,600	32,928.00	0.06
481	000539	粤电力 A	7,092	32,197.68	0.05
482	688375	国博电子	533	31,985.33	0.05
483	002945	华林证券	2,200	31,614.00	0.05
484	603826	坤彩科技	1,580	30,920.60	0.05
485	600299	安迪苏	3,200	30,880.00	0.05
486	300140	节能环境	4,948	30,529.16	0.05
487	688819	天能股份	1,075	29,842.00	0.05
488	688032	禾迈股份	298	29,758.28	0.05
489	601921	浙版传媒	3,600	29,016.00	0.05
490	001213	中铁特货	7,100	28,826.00	0.05
491	601858	中国科传	1,300	25,285.00	0.04
492	001389	广合科技	400	23,508.00	0.04
493	601158	重庆水务	4,600	21,344.00	0.04

494	688295	中复神鹰	946	19,676.80	0.03
495	600956	新天绿能	2,500	19,300.00	0.03
496	688153	唯捷创芯	586	18,171.86	0.03
497	603868	飞科电器	400	14,348.00	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	603893	瑞芯微	410,385.00	0.64
2	688608	恒玄科技	247,883.90	0.39
3	688617	惠泰医疗	245,547.22	0.39
4	688235	百济神州	233,163.66	0.37
5	603345	安井食品	229,359.00	0.36
6	000933	神火股份	221,033.00	0.35
7	688777	中控技术	219,870.57	0.35
8	600536	中国软件	215,298.00	0.34
9	600363	联创光电	213,462.00	0.34
10	603605	珀莱雅	209,584.00	0.33
11	300450	先导智能	194,386.00	0.31
12	600418	江淮汽车	190,908.00	0.30
13	002130	沃尔核材	190,529.00	0.30
14	300458	全志科技	185,224.00	0.29
15	600988	赤峰黄金	184,812.00	0.29
16	688120	华海清科	184,052.06	0.29
17	300454	深信服	180,171.00	0.28
18	605589	圣泉集团	178,026.00	0.28
19	603160	汇顶科技	176,096.00	0.28
20	002851	麦格米特	172,863.00	0.27

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	600418	江淮汽车	855,481.46	1.34
2	002625	光启技术	465,863.00	0.73
3	603893	瑞芯微	447,845.00	0.70
4	002384	东山精密	373,730.00	0.59
5	301236	软通动力	290,330.00	0.46

6	688617	惠泰医疗	290,324.00	0.46
7	688777	中控技术	258,152.42	0.41
8	603345	安井食品	247,093.00	0.39
9	600536	中国软件	244,380.00	0.38
10	603605	珀莱雅	237,119.00	0.37
11	600988	赤峰黄金	218,631.00	0.34
12	300866	安克创新	215,833.50	0.34
13	302132	中航成飞	214,602.00	0.34
14	688047	龙芯中科	210,475.38	0.33
15	601567	三星医疗	208,707.00	0.33
16	600642	申能股份	208,454.00	0.33
17	600839	四川长虹	206,150.00	0.32
18	603160	汇顶科技	201,089.00	0.32
19	600298	安琪酵母	177,707.00	0.28
20	688213	思特威	176,896.30	0.28

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	29,433,191.80
卖出股票收入（成交）总额	31,174,329.99

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,600.11	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,600.11	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123257	安克转债	16	1,600.11	0.00

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**

胜宏科技(惠州)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方海关的处罚。

苏州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

天风证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到人社局的处罚。

东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证监会的处罚。

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未出现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	1,804.25
2	应收清算款	194,800.66
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	196,604.91

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 (%)
500	63,145.91	2,964,101.00	9.39	3,647,455.00	11.55	24,961,400.00	79.06

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	中信建投证券股份有限公司	1,434,000.00	4.54
2	简街香港有限公司—JSQB 有限公司（R）	705,700.00	2.24
3	中信证券股份有限公司	317,801.00	1.01
4	BARCLAYS BANK PLC	295,000.00	0.93
5	彭波	226,800.00	0.72
6	於佳倩	211,500.00	0.67
7	上海柏泰华盈私募基金管理有限公司—柏泰华盈常青藤套利 2 号私募证券投资基金	210,600.00	0.67
8	秦琴	200,000.00	0.63
9	程敬雯	132,800.00	0.42
10	徐康锋	113,900.00	0.36
-	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	24,961,400.00	79.06

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

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） 基金份额总额	512,572,956.00
本报告期期初基金份额总额	35,572,956.00
本报告期基金总申购份额	17,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	21,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	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：

1、本基金管理人于 2025 年 4 月 2 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任卫学文先生担任本公司副总经理。

2、本基金管理人于 2025 年 5 月 30 日发布公告，因李进董事长任期届满，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。本基金管理人于 2025 年 8 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任叶才先生担任本公司董事长。本基金管理人于 2025 年 8 月 15 日发布公告，经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人变更为叶才先生。

有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

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，聘任边济东先生为资产托管部总经理。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

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

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	4	46,974,129.05	77.51	9,160.24	77.49	未变更

公司						
中国国际金融股份有限公司	1	13,633,392.74	22.49	2,660.34	22.51	未变更
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	未变更
德邦证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
信达证券	1	-	-	-	-	未变

股份有限 公司						更
招商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	未变 更
浙商证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	未变 更
中泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
中信建投 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	未变 更

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

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	18,588.87	70.43	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
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	7,803.89	29.57	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
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	关于不法分子冒用景顺长城基金 APP 及员工名义进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 3 日
2	关于不法分子冒用景顺长城基金 APP 及员工名义进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 3 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 6 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 22 日
5	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 22 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西部证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 24 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江海证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 6 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 25 日
9	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（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 19 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 19 日
11	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 19 日
12	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（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 19 日
13	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 21 日
14	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	2025 年 3 月 21 日
15	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日

16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
17	景顺长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 31 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 2 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增甬兴证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 11 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 14 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 15 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 22 日
23	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 22 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 23 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 12 日
26	关于不法分子冒用景顺长城基金及股东方 APP 进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 20 日
27	关于不法分子冒用景顺长城基金及股东方 APP 进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 20 日
28	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 24 日
29	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	2025 年 5 月 24 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 30 日
31	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东莞证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 9 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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
----	----------------	------------

者类别	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	20250101-20250630	26,225,900.00	302,300.00	1,566,800.00	24,961,400.00	79.06

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

为降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费调整为基金管理人承担，并相应修订各基金基金合同有关内容。本次调整后，基金管理人旗下全部指数基金指数使用费均由基金管理人承担。详情请参阅本基金管理人于 2025 年 3 月 20 日发布的《关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》。

§ 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

2025 年 8 月 29 日