

# 景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

## 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 08 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 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69

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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
7.12 投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>71</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	71
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	71
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>72</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>72</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
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 .....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
10.4 基金投资策略的改变 .....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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 .....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
10.8 其他重大事件 .....	77
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>78</b>
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 .....	78
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>79</b>
12.1 备查文件目录 .....	79
12.2 存放地点 .....	79
12.3 查阅方式 .....	79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城中证 500 指数增强	
场内简称	无	
基金主代码	006682	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 25 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	450,649,839.56 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	006682	016935
报告期末下属分级基金的份额总额	443,471,495.61 份	7,178,343.95 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75% 的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>4、权证、股指期货投资策略</p> <p>本基金可投资权证、股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融</p>

	<p>产品。</p> <p>本基金对权证的分析判断主要从市场环境、时机、权证定价、市场供求、发行人资质、交易冲击等方面综合考量，运用权证定价模型计算权证当前的合理价格。本基金适时选择具有相对优势的权证并制定相应的投资计划。</p> <p>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，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>5、中小企业私募债券的投资策略</p> <p>对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金将加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率 $\times$ 95% + 商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨皞阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66596688
	电子邮箱	investor@igwfmc.com	fxjd_hq@bank-of-china.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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfmc.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	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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)	
	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	23,391,136.97	5,863,312.49
本期利润	37,180,710.70	6,945,141.21
加权平均基金份额 额本期利润	0.0633	0.1159
本期加权平均净值 利润率	4.67%	8.59%
本期基金份额净值 增长率	5.25%	5.07%
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	183,003,479.43	2,860,999.51
期末可供分配基金 份额利润	0.4127	0.3986
期末基金资产净值	626,474,975.04	10,039,343.46
期末基金份额净值	1.4126	1.3985
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	41.26%	-2.22%

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

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

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

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

低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.32%	0.74%	4.09%	0.75%	1.23%	-0.01%
过去三个月	2.31%	1.45%	0.97%	1.43%	1.34%	0.02%
过去六个月	5.25%	1.28%	3.21%	1.29%	2.04%	-0.01%
过去一年	19.08%	1.60%	18.83%	1.64%	0.25%	-0.04%
过去三年	-8.46%	1.26%	-7.61%	1.29%	-0.85%	-0.03%
自基金合同生效起至今	41.26%	1.30%	5.79%	1.31%	35.47%	-0.01%

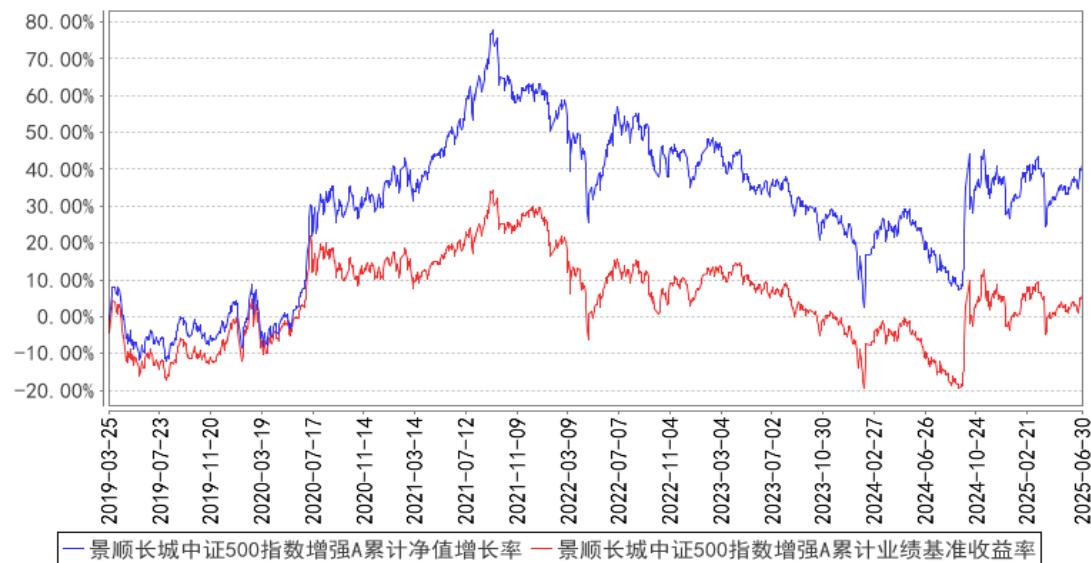
景顺长城中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.28%	0.74%	4.09%	0.75%	1.19%	-0.01%
过去三个月	2.21%	1.45%	0.97%	1.43%	1.24%	0.02%
过去六个月	5.07%	1.28%	3.21%	1.29%	1.86%	-0.01%
过去一年	18.63%	1.60%	18.83%	1.64%	-0.20%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-2.22%	1.28%	-0.42%	1.31%	-1.80%	-0.03%

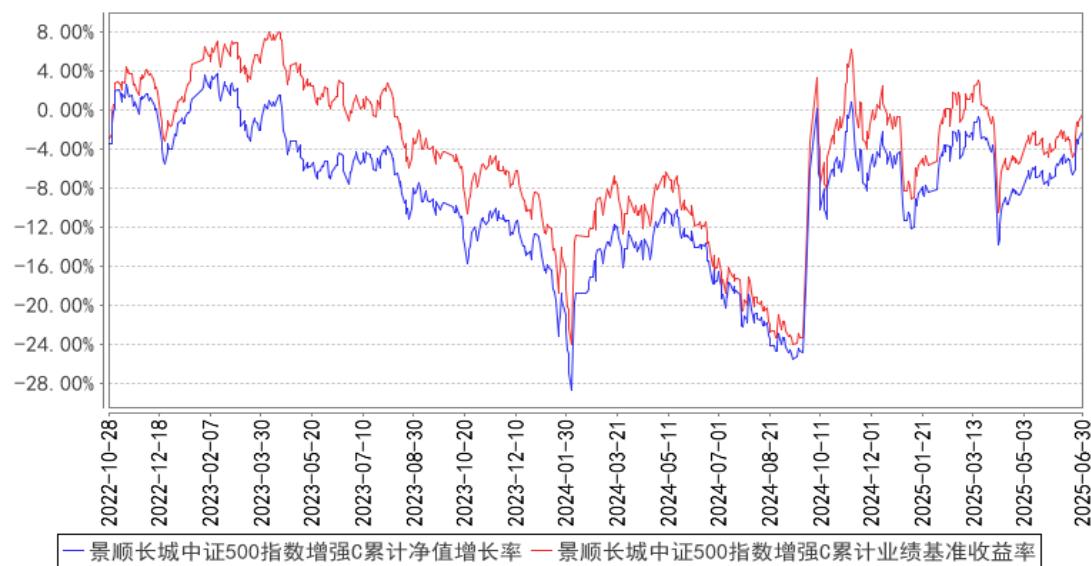
注：本基金于 2022 年 10 月 27 日增设 C 类基金份额，并于 2022 年 10 月 28 日开始对 C 类份额进行估值。

### 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500指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



景顺长城中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自2019年3月25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。本基金自2022年10月27日起增设C类基金份额。

### 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		
黎海威	本基金的 基金经理	2019 年 3 月 25 日	-	22 年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012 年 8 月加入本公司，自 2013 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有 22 年证券、基金行业从业经验。
徐喻军	本基金的 基金经理	2019 年 3 月 25 日	-	15 年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员，自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 15 年证券、基金行业从业经验。

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

无。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2025 年上半年，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。从数据来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 49.0、49.5、49.7，经济景气指数呈现逐步抬升的趋势。今年前 5 个月工业增加值累计同比 6.3%，其中 5 月份工业增加值当月同比增长 5.8%，经济呈现出较强的韧性。5 月 PPI 同比下降 3.3%，环比下降 0.4%；CPI 同比下滑 0.1%，环比下降 0.2%，价格类指数整体偏弱。5 月 M2 同比增长 7.9%，M1 同比增长 2.3%，信贷需求依然较弱；5 月末外汇储备 3.28 万亿美元，人民币汇率维持强势。整体来看，国内经济数据虽然边际有所走弱，但整体依然维持较强的韧性，经济动能的切换提升了权益市场的估值水平。上半年 A 股市场震荡上行，上证综指上涨 2.76%，沪深 300 上涨 0.03%，创业板指上涨 0.53%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 5.25%，业绩比较基准收益率为 3.21%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 5.07%，业绩比较基准收益率为 3.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，外需在抢出口效应退潮后可能会进一步降温回落，内需在补贴政策的支持下可能对经济形成一定支撑，海外环境依然面临一定的不确定性。同时随着经济动能的转换，新质生产力相关产业有望迎来快速发展，权益市场依然具有较多结构性的投资机会。个股层面相对充裕的流动性环境，市场层面相对分散的结构性行情，这对于我们量化选股模型是相对有利的。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

本基金是以中证 500 指数为基准的指数增强基金，我们的投资组合主要以基本面量化选股为主，风格上维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生持续稳定的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人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，控制执行中可能产生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

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
<b>资产:</b>			
货币资金	6. 4. 7. 1	35, 650, 364. 36	60, 197, 255. 03
结算备付金		6, 785, 477. 44	12, 297, 721. 76
存出保证金		2, 071, 973. 91	2, 777, 362. 79
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	592, 575, 657. 52	1, 003, 905, 445. 03
其中: 股票投资		588, 495, 832. 32	999, 874, 398. 45
基金投资		—	—
债券投资		4, 079, 825. 20	4, 031, 046. 58
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		2, 975, 514. 71	—
应收股利		—	—
应收申购款		79, 458. 07	211, 001. 81
递延所得税资产		—	—
其他资产	6. 4. 7. 8	—	—
资产总计		640, 138, 446. 01	1, 079, 388, 786. 42
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
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		500, 157. 58	0. 19
应付赎回款		1, 749, 952. 25	1, 397, 149. 01
应付管理人报酬		630, 027. 29	1, 125, 871. 53
应付托管费		105, 004. 51	187, 645. 27
应付销售服务费		3, 189. 20	55, 808. 63
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	635, 796. 68	973, 418. 33
负债合计		3, 624, 127. 51	3, 739, 892. 96
<b>净资产：</b>			
实收基金	6. 4. 7. 10	450, 649, 839. 56	802, 386, 921. 21
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	185, 864, 478. 94	273, 261, 972. 25
净资产合计		636, 514, 318. 50	1, 075, 648, 893. 46
负债和净资产总计		640, 138, 446. 01	1, 079, 388, 786. 42

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日， 基金份额总额 450, 649, 839. 56 份， 其中本基金 A 类份额净值人民币 1. 4126 元， 基金份额 443, 471, 495. 61 份； 本基金 C 类份额净值人民币 1. 3985 元， 基金份额 7, 178, 343. 95 份。

## 6. 2 利润表

会计主体： 景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

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 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
<b>一、 营业总收入</b>		50, 534, 143. 70	-54, 590, 564. 45
1. 利息收入		136, 019. 46	239, 621. 81
其中： 存款利息收入	6. 4. 7. 13	136, 019. 46	239, 621. 81
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）		35, 098, 023. 10	-25, 889, 127. 99
其中： 股票投资收益	6. 4. 7. 14	28, 371, 862. 62	-44, 687, 476. 38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	138, 625. 82	35, 488. 78
资产支持证券投资 收益	6. 4. 7. 16	-	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	-334, 888. 52	2, 504, 585. 12
股利收益	6. 4. 7. 19	6, 922, 423. 18	16, 258, 274. 49
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	14, 871, 402. 45	-29, 002, 734. 79
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	428, 698. 69	61, 676. 52
<b>减：二、营业总支出</b>		6, 408, 291. 79	8, 318, 200. 80
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	5, 234, 133. 79	6, 893, 782. 31
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	872, 355. 66	1, 148, 963. 75
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	162, 395. 60	51, 276. 37
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		2, 890. 96	9, 031. 23
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	136, 515. 78	215, 147. 14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		44, 125, 851. 91	-62, 908, 765. 25
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		44, 125, 851. 91	-62, 908, 765. 25
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		44, 125, 851. 91	-62, 908, 765. 25

### 6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

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	802, 386, 921. 21	-	273, 261, 972. 25	1, 075, 648, 893. 46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	802, 386, 921. 21	-	273, 261, 972. 25	1, 075, 648, 893. 46

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-351,737,081.65	-	-87,397,493.31	-439,134,574.96
(一)、综合收益总额	-	-	44,125,851.91	44,125,851.91
(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)	-351,737,081.65	-	-131,523,345.22	-483,260,426.87
其中：1. 基金申购款	27,295,497.40	-	9,621,770.55	36,917,267.95
2. 基金赎回款	-379,032,579.05	-	-141,145,115.77	-520,177,694.82
(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	450,649,839.56	-	185,864,478.94	636,514,318.50
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	953,799,133.20	-	241,106,597.91	1,194,905,731.11
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	953,799,133.20	-	241,106,597.91	1,194,905,731.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-38,020,869.99	-	-70,546,636.59	-108,567,506.58
(一)、综合收益总额	-	-	-62,908,765.25	-62,908,765.25

(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)	-38,020,869.99	-	-7,637,871.34	-45,658,741.33
其中：1. 基金申购款	61,075,510.56	-	11,881,163.99	72,956,674.55
2. 基金赎回款	-99,096,380.55	-	-19,519,035.33	-118,615,415.88
(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	915,778,263.21	-	170,559,961.32	1,086,338,224.53

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

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1897 号文《关于准予景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》，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 指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集。基金合同于 2019 年 3 月 25 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,507,912,000.78 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 967,567.93 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,508,879,568.71 元，折合 1,508,879,568.71 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，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的约定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2022 年 10 月 27 日起对景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。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分股（包含创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、衍生工具（权证、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、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%–95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率  $\times$  95% + 商业银行活期存款利率（税后） $\times$  5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 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、地方政府债券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	35,650,364.36
等于： 本金	35,647,145.83
加： 应计利息	3,218.53
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	35,650,364.36

#### 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	569,929,678.92	—	588,495,832.32	18,566,153.40
贵金属投资-金交所 黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	4,028,840.00	50,825.20	4,079,825.20
	银行间市场	—	—	—

	合计	4,028,840.00	50,825.20	4,079,825.20	160.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		573,958,518.92	50,825.20	592,575,657.52	18,566,313.40

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	14,564,800.00	-	-	
其中：股指期货投资	14,564,800.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	14,564,800.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	13.00	15,255,240.00	690,440.00
合计				690,440.00
减：可抵销期货暂收款				690,440.00
净额				0.00

注：(1) 衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

(2) 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的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

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

#### 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	1,588.75
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	542,468.08

其中：交易所市场		542,468.08
银行间市场		—
应付利息		—
预提费用		91,739.85
合计		635,796.68

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 景顺长城中证 500 指数增强 A

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	681,619,872.95	681,619,872.95
本期申购	22,427,463.10	22,427,463.10
本期赎回(以“-”号填列)	-260,575,840.44	-260,575,840.44
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	443,471,495.61	443,471,495.61

##### 景顺长城中证 500 指数增强 C

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	120,767,048.26	120,767,048.26
本期申购	4,868,034.30	4,868,034.30
本期赎回(以“-”号填列)	-118,456,738.61	-118,456,738.61
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	7,178,343.95	7,178,343.95

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 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

##### 景顺长城中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	309,178,614.26	-75,896,980.09	233,281,634.17
加：会计政策变更	—	—	—
前期差错更正	—	—	—

其他	-	-	-
本期期初	309,178,614.26	-75,896,980.09	233,281,634.17
本期利润	23,391,136.97	13,789,573.73	37,180,710.70
本期基金份额交易产生的变动数	-113,963,772.08	26,504,906.64	-87,458,865.44
其中：基金申购款	10,560,195.64	-2,580,193.69	7,980,001.95
基金赎回款	-124,523,967.72	29,085,100.33	-95,438,867.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	218,605,979.15	-35,602,499.72	183,003,479.43

## 景顺长城中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	53,412,999.85	-13,432,661.77	39,980,338.08
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	53,412,999.85	-13,432,661.77	39,980,338.08
本期利润	5,863,312.49	1,081,828.72	6,945,141.21
本期基金份额交易产生的变动数	-55,837,244.68	11,772,764.90	-44,064,479.78
其中：基金申购款	2,215,055.09	-573,286.49	1,641,768.60
基金赎回款	-58,052,299.77	12,346,051.39	-45,706,248.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,439,067.66	-578,068.15	2,860,999.51

## 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	94,244.78
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	37,927.98
其他	3,846.70
合计	136,019.46

## 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	28,371,862.62
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	28,371,862.62

#### 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	3,524,411,528.36
减: 卖出股票成本总额	3,492,569,478.65
减: 交易费用	3,470,187.09
买卖股票差价收入	28,371,862.62

#### 6.4.7.14.3 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	27,010.37
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	111,615.45
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	138,625.82

##### 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	461,765.99
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	350,100.00
减: 应计利息总额	32.71
减: 交易费用	17.83
买卖债券差价收入	111,615.45

#### 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**

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-334,888.52

**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	6,922,423.18
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,922,423.18

**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	13,770,547.45
股票投资	13,777,747.45
债券投资	-7,200.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	1,100,855.00
权证投资	-
期货投资	1,100,855.00

3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	14,871,402.45

#### 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	425,992.76
基金转换费收入	2,705.93
合计	428,698.69

#### 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	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	7,805.96
指数使用费	36,940.92
存托服务费	29.05
合计	136,515.78

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 0.016% 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、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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 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	
	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	408,136,181.97	6.19	194,401,130.26	2.54

##### 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 2025年1月1日至2025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	79,586.59	6.19	79,586.59	14.67
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日				
关联方名称	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（%）
	183,888.14	2.54	117,399.03	3.05

注：（1）上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

（2）上年度可比期间该类佣金协议的服务范围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等。

（3）根据《公开募集证券投资基金管理费用管理规定》，本报告期内被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

## 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	5,234,133.79	6,893,782.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,503,235.30	1,983,956.61
应支付基金管理人的净管理费	3,730,898.49	4,909,825.70

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/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	872,355.66	1,148,963.75

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	—	83.50	83.50
中国银行	—	—	—
长城证券	—	—	—
合计	—	83.50	83.50
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	41,373.43	41,373.43
中国银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	41,373.43	41,373.43

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.40%/当年天数。

#### 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

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 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	35,650,364.36	94,244.78	69,673,837.67	129,522.36

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或约定利率计息。

#### 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

无。

#### 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：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301458	钧崴电	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-

	子									
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	130	5,447.00	10,123.10	-
301479	弘景光电	2025 年 5 月 28 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	-	77.87	52	-	4,049.24	转增股
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	241	9,620.72	10,898.02	-
301501	恒鑫生活	2025 年 6 月 6 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	-	45.22	108	-	4,883.76	转增股
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-

	份									
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	46.50	42.85	379	17,623.50	16,240.15	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	131	12,248.50	11,876.46	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-
688583	思看	2025 年 6 月内(含)	1 个月	新股流通	-	79.68	52	-	4,143.36	转增股

	科技	19 日		受限						
688757	胜科纳米	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-

#### 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118056	路维转债	2025 年 6 月 12 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	130	13,000.00	13,001.14	-
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	160	16,000.00	16,001.05	-

注：以上限售股的实际流通日期以上市公司的公告为准。

#### 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
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	13,100	390,662.63	498,455.00	-

#### 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管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》(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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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，并按照合约规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	35,650,364.36	-	-	-	-	-	35,650,364.36
结算备付 金	6,785,477.44	-	-	-	-	-	6,785,477.44
存出保证 金	241,345.11	-	-	-	-	1,830,628.80	2,071,973.91
交易性金 融资产	4,050,823.01	-	-	29,002.19	588,495,832.32	592,575,657.52	
应收申购 款	-	-	-	-	-	79,458.07	79,458.07
应收清算 款	-	-	-	-	-	2,975,514.71	2,975,514.71
资产总计	46,728,009.92	-	-	29,002.19	593,381,433.90	640,138,446.01	
负债							
应付赎回 款	-	-	-	-	-	1,749,952.25	1,749,952.25
应付管理	-	-	-	-	-	630,027.29	630,027.29

人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	105,004.51	105,004.51
应付清算款	-	-	-	-	-	500,157.58	500,157.58
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,189.20	3,189.20
其他负债	-	-	-	-	-	635,796.68	635,796.68
负债总计	-	-	-	-	-	3,624,127.51	3,624,127.51
利率敏感度缺口	46,728,009.92	-	-	-29,002.19	-	-	-
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	60,197,255.03	-	-	-	-	-	60,197,255.03
结算备付金	12,297,721.76	-	-	-	-	-	12,297,721.76
存出保证金	306,495.59	-	-	-	-	2,470,867.20	2,777,362.79
交易性金融资产	-	-4,031,046.58	-	-	-	999,874,398.45	1,003,905,445.03
应收申购款	-	-	-	-	-	211,001.81	211,001.81
资产总计	72,801,472.38	-4,031,046.58	-	-	-1,002,556,267.46	1,079,388,786.42	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,397,149.01	1,397,149.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,125,871.53	1,125,871.53
应付托管费	-	-	-	-	-	187,645.27	187,645.27
应付清算款	-	-	-	-	-	0.19	0.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-	55,808.63	55,808.63
其他负债	-	-	-	-	-	973,418.33	973,418.33
负债总计	-	-	-	-	-	3,739,892.96	3,739,892.96
利率敏感度缺口	72,801,472.38	-4,031,046.58	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的	

变动	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)
市场利率上升 25 个基点	-684.14	-5,623.91
市场利率下降 25 个基点	685.04	5,634.80

#### 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	588,495,832.32	92.46	999,874,398.45	92.96
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	588,495,832.32	92.46	999,874,398.45	92.96

注: 其他包含在期货交易所交易的期货投资 (附注: 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下, 期货投资与相关的期货暂收款 (结算所得的持仓损益) 之间按抵销后的净额为 0.

#### 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%	35,321,912.38 56,034,118.17
	沪深 300 指数下降 5%	-35,321,912.38 -56,034,118.17

#### 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	587,593,960.47	999,476,458.16
第二层次	4,578,280.20	4,058,783.08
第三层次	403,416.85	370,203.79
合计	592,575,657.52	1,003,905,445.03

###### 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	588,495,832.32	91.93
	其中：股票	588,495,832.32	91.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,079,825.20	0.64
	其中：债券	4,079,825.20	0.64
	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	42,435,841.80	6.63
8	其他各项资产	5,126,946.69	0.80
9	合计	640,138,446.01	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	161,504.00	0.03
B	采矿业	18,995,562.32	2.98
C	制造业	316,952,379.13	49.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,509,497.00	2.59
E	建筑业	3,143,672.00	0.49
F	批发和零售业	12,891,615.55	2.03
G	交通运输、仓储和邮政业	8,060,874.00	1.27

H	住宿和餐饮业	1, 177, 608. 00	0. 19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48, 457, 582. 41	7. 61
J	金融业	38, 752, 800. 22	6. 09
K	房地产业	7, 519, 585. 00	1. 18
L	租赁和商务服务业	3, 335, 677. 00	0. 52
M	科学研究和技术服务业	2, 984, 679. 00	0. 47
N	水利、环境和公共设施管理业	371, 340. 00	0. 06
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	1, 481, 040. 00	0. 23
Q	卫生和社会工作	2, 013, 977. 88	0. 32
R	文化、体育和娱乐业	5, 192, 296. 00	0. 82
S	综合	—	—
	合计	488, 001, 689. 51	76. 67

### 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	508, 443. 00	0. 08
B	采矿业	1, 815, 340. 12	0. 29
C	制造业	61, 868, 278. 68	9. 72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1, 270, 265. 00	0. 20
E	建筑业	552, 947. 00	0. 09
F	批发和零售业	4, 087, 561. 00	0. 64
G	交通运输、仓储和邮政业	1, 109, 130. 00	0. 17
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17, 821, 707. 90	2. 80
J	金融业	5, 821, 151. 00	0. 91
K	房地产业	2, 426, 361. 00	0. 38
L	租赁和商务服务业	672, 555. 37	0. 11
M	科学研究和技术服务业	1, 542, 645. 74	0. 24
N	水利、环境和公共设施管理业	707, 635. 00	0. 11
O	居民服务、修理和	—	—

	其他服务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	68,200.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	221,922.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	100,494,142.81	15.79

### 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	002340	格林美	811,600	5,153,660.00	0.81
2	300207	欣旺达	243,300	4,880,598.00	0.77
3	002202	金风科技	453,423	4,647,585.75	0.73
4	601168	西部矿业	269,614	4,483,680.82	0.70
5	300476	胜宏科技	32,400	4,353,912.00	0.68
6	300496	中科创达	74,500	4,262,890.00	0.67
7	002138	顺络电子	146,650	4,123,798.00	0.65
8	002624	完美世界	262,700	3,985,159.00	0.63
9	000783	长江证券	549,400	3,807,342.00	0.60
10	000988	华工科技	78,400	3,685,584.00	0.58
11	002472	双环传动	109,900	3,680,551.00	0.58
12	002156	通富微电	142,050	3,639,321.00	0.57
13	002414	高德红外	354,220	3,630,755.00	0.57
14	600704	物产中大	684,460	3,607,104.20	0.57
15	600352	浙江龙盛	350,100	3,557,016.00	0.56
16	600535	天士力	220,900	3,457,085.00	0.54
17	688002	睿创微纳	48,508	3,381,977.76	0.53
18	688213	思特威	32,829	3,355,780.38	0.53
19	600959	江苏有线	972,900	3,346,776.00	0.53
20	600909	华安证券	571,800	3,333,594.00	0.52
21	300017	网宿科技	306,000	3,280,320.00	0.52
22	600873	梅花生物	306,800	3,279,692.00	0.52
23	000878	云南铜业	257,500	3,275,400.00	0.51
24	002532	天山铝业	390,600	3,245,886.00	0.51
25	600885	宏发股份	143,400	3,199,254.00	0.50
26	600498	烽火通信	150,800	3,171,324.00	0.50
27	600839	四川长虹	323,300	3,142,476.00	0.49
28	688608	恒玄科技	9,000	3,131,820.00	0.49

29	000623	吉林敖东	180,400	3,057,780.00	0.48
30	300054	鼎龙股份	106,388	3,051,207.84	0.48
31	600867	通化东宝	364,529	2,989,137.80	0.47
32	600177	雅戈尔	406,113	2,964,624.90	0.47
33	601958	金钼股份	269,500	2,948,330.00	0.46
34	603596	伯特利	55,900	2,945,371.00	0.46
35	002410	广联达	216,240	2,899,778.40	0.46
36	688027	国盾量子	10,500	2,887,605.00	0.45
37	002821	凯莱英	32,700	2,885,775.00	0.45
38	002273	水晶光电	143,400	2,863,698.00	0.45
39	600663	陆家嘴	320,500	2,839,630.00	0.45
40	002056	横店东磁	200,100	2,831,415.00	0.44
41	002841	视源股份	80,700	2,792,220.00	0.44
42	002558	巨人网络	118,300	2,785,965.00	0.44
43	600118	中国卫星	97,500	2,785,575.00	0.44
44	000426	兴业银锡	173,800	2,746,040.00	0.43
45	600578	京能电力	604,000	2,711,960.00	0.43
46	000050	深天马 A	313,400	2,670,168.00	0.42
47	300699	光威复材	84,068	2,662,433.56	0.42
48	300395	菲利华	51,600	2,636,760.00	0.41
49	600166	福田汽车	964,400	2,613,524.00	0.41
50	002500	山西证券	447,200	2,611,648.00	0.41
51	002223	鱼跃医疗	71,601	2,548,995.60	0.40
52	002739	万达电影	222,600	2,544,318.00	0.40
53	600062	华润双鹤	135,000	2,519,100.00	0.40
54	600862	中航高科	96,300	2,511,504.00	0.39
55	603858	步长制药	154,230	2,504,695.20	0.39
56	601991	大唐发电	786,400	2,492,888.00	0.39
57	300373	扬杰科技	47,900	2,486,010.00	0.39
58	300627	华测导航	70,480	2,466,800.00	0.39
59	000039	中集集团	313,600	2,464,896.00	0.39
60	600316	洪都航空	65,100	2,454,270.00	0.39
61	000415	渤海租赁	734,000	2,444,220.00	0.38
62	688469	芯联集成	503,603	2,402,186.31	0.38
63	603087	甘李药业	43,800	2,399,364.00	0.38
64	300037	新宙邦	68,100	2,397,120.00	0.38
65	603893	瑞芯微	15,700	2,384,202.00	0.37
66	688220	翱捷科技	30,400	2,380,320.00	0.37
67	000423	东阿阿胶	45,400	2,374,420.00	0.37
68	600988	赤峰黄金	93,400	2,323,792.00	0.37
69	600141	兴发集团	110,000	2,258,300.00	0.35
70	601615	明阳智能	195,700	2,248,593.00	0.35
71	600998	九州通	436,000	2,241,040.00	0.35

72	600582	天地科技	368,700	2,208,513.00	0.35
73	002850	科达利	19,500	2,206,815.00	0.35
74	600901	江苏金租	363,384	2,202,107.04	0.35
75	600143	金发科技	213,300	2,199,123.00	0.35
76	002008	大族激光	89,400	2,178,678.00	0.34
77	002155	湖南黄金	121,690	2,172,166.50	0.34
78	601216	君正集团	393,400	2,171,568.00	0.34
79	600685	中船防务	77,300	2,101,787.00	0.33
80	688387	信科移动	367,960	2,078,974.00	0.33
81	600007	中国国贸	100,800	2,074,464.00	0.33
82	000987	越秀资本	300,225	2,059,543.50	0.32
83	600096	云天化	93,300	2,049,801.00	0.32
84	002797	第一创业	286,600	2,029,128.00	0.32
85	000750	国海证券	489,000	2,014,680.00	0.32
86	603156	养元饮品	94,600	2,001,736.00	0.31
87	300140	节能环保	322,400	1,989,208.00	0.31
88	600004	白云机场	217,700	1,981,070.00	0.31
89	003031	中瓷电子	35,800	1,904,918.00	0.30
90	300573	兴齐眼药	36,620	1,896,549.80	0.30
91	000825	太钢不锈	527,900	1,895,161.00	0.30
92	000933	神火股份	113,600	1,890,304.00	0.30
93	601233	桐昆股份	173,600	1,840,160.00	0.29
94	300623	捷捷微电	60,800	1,811,840.00	0.28
95	688122	西部超导	34,766	1,803,660.08	0.28
96	600820	隧道股份	295,400	1,801,940.00	0.28
97	600487	亨通光电	117,000	1,790,100.00	0.28
98	600295	鄂尔多斯	204,540	1,781,543.40	0.28
99	600536	中国软件	37,900	1,772,583.00	0.28
100	601568	北元集团	421,800	1,750,470.00	0.28
101	000733	振华科技	34,600	1,731,730.00	0.27
102	300454	深信服	18,100	1,704,658.00	0.27
103	601456	国联民生	164,300	1,700,505.00	0.27
104	300450	先导智能	68,000	1,689,800.00	0.27
105	002926	华西证券	187,600	1,677,144.00	0.26
106	688188	柏楚电子	12,600	1,658,916.00	0.26
107	600637	东方明珠	221,040	1,651,168.80	0.26
108	600155	华创云信	236,300	1,644,648.00	0.26
109	601231	环旭电子	112,400	1,644,412.00	0.26
110	688318	财富趋势	14,300	1,643,356.00	0.26
111	688617	惠泰医疗	5,530	1,642,410.00	0.26
112	300146	汤臣倍健	146,000	1,641,040.00	0.26
113	688153	唯捷创芯	51,900	1,609,419.00	0.25
114	601099	太平洋	409,300	1,608,549.00	0.25

115	601990	南京证券	197,800	1,598,224.00	0.25
116	300383	光环新网	111,400	1,593,020.00	0.25
117	600038	中直股份	39,500	1,532,995.00	0.24
118	300012	华测检测	130,000	1,519,700.00	0.24
119	600499	科达制造	154,412	1,513,237.60	0.24
120	002607	中公教育	484,000	1,481,040.00	0.23
121	688777	中控技术	32,896	1,477,359.36	0.23
122	000598	兴蓉环境	201,600	1,453,536.00	0.23
123	688099	晶晨股份	20,397	1,448,390.97	0.23
124	300888	稳健医疗	35,100	1,442,610.00	0.23
125	002244	滨江集团	147,800	1,441,050.00	0.23
126	688578	艾力斯	15,485	1,440,724.40	0.23
127	002837	英维克	48,200	1,432,022.00	0.22
128	688425	铁建重工	349,816	1,427,249.28	0.22
129	300567	精测电子	23,400	1,418,274.00	0.22
130	000034	神州数码	37,500	1,411,500.00	0.22
131	002517	恺英网络	73,000	1,409,630.00	0.22
132	300285	国瓷材料	81,000	1,405,350.00	0.22
133	600312	平高电气	90,700	1,395,873.00	0.22
134	603298	杭叉集团	66,100	1,384,795.00	0.22
135	600299	安迪苏	143,300	1,382,845.00	0.22
136	603605	珀莱雅	16,600	1,374,314.00	0.22
137	601108	财通证券	171,660	1,357,830.60	0.21
138	002436	兴森科技	102,400	1,355,776.00	0.21
139	000959	首钢股份	397,800	1,352,520.00	0.21
140	600483	福能股份	139,500	1,344,780.00	0.21
141	000027	深圳能源	209,300	1,335,334.00	0.21
142	300558	贝达药业	22,900	1,327,055.00	0.21
143	603379	三美股份	27,300	1,313,676.00	0.21
144	000830	鲁西化工	126,700	1,305,010.00	0.21
145	002595	豪迈科技	22,010	1,303,432.20	0.20
146	603939	益丰药房	52,100	1,274,887.00	0.20
147	000960	锡业股份	82,700	1,265,310.00	0.20
148	601000	唐山港	310,900	1,262,254.00	0.20
149	600131	国网信通	70,700	1,251,390.00	0.20
150	601098	中南传媒	95,200	1,249,024.00	0.20
151	300223	北京君正	17,900	1,238,680.00	0.19
152	300339	润和软件	24,300	1,235,169.00	0.19
153	600563	法拉电子	11,200	1,221,808.00	0.19
154	002153	石基信息	141,000	1,221,060.00	0.19
155	600486	扬农化工	21,000	1,218,000.00	0.19
156	688114	华大智造	18,702	1,212,450.66	0.19
157	601179	中国西电	196,300	1,205,282.00	0.19

158	300919	中伟股份	36,600	1,203,408.00	0.19
159	601608	中信重工	274,100	1,197,817.00	0.19
160	603529	爱玛科技	34,600	1,190,240.00	0.19
161	603160	汇顶科技	16,700	1,186,201.00	0.19
162	002262	恩华药业	56,700	1,178,226.00	0.19
163	603225	新凤鸣	110,100	1,172,565.00	0.18
164	300212	易华录	53,300	1,159,808.00	0.18
165	600928	西安银行	294,400	1,154,048.00	0.18
166	600258	首旅酒店	80,800	1,141,704.00	0.18
167	603979	金诚信	24,500	1,137,780.00	0.18
168	601158	重庆水务	244,000	1,132,160.00	0.18
169	688475	萤石网络	35,805	1,128,573.60	0.18
170	688819	天能股份	39,900	1,107,624.00	0.17
171	000009	中国宝安	124,500	1,105,560.00	0.17
172	600906	财达证券	161,600	1,102,112.00	0.17
173	300002	神州泰岳	92,300	1,089,140.00	0.17
174	601965	中国汽研	61,300	1,088,075.00	0.17
175	002078	太阳纸业	80,000	1,076,800.00	0.17
176	600008	首创环保	351,300	1,060,926.00	0.17
177	601001	晋控煤业	86,300	1,054,586.00	0.17
178	688120	华海清科	6,248	1,054,037.60	0.17
179	600521	华海药业	56,200	1,047,006.00	0.16
180	000729	燕京啤酒	78,300	1,012,419.00	0.16
181	000563	陕国投 A	281,500	1,004,955.00	0.16
182	603290	斯达半导	12,300	999,621.00	0.16
183	002025	航天电器	19,400	997,354.00	0.16
184	002409	雅克科技	17,900	978,951.00	0.15
185	002185	华天科技	96,100	970,610.00	0.15
186	600739	辽宁成大	87,500	962,500.00	0.15
187	688772	珠海冠宇	67,094	958,773.26	0.15
188	603233	大参林	58,600	955,180.00	0.15
189	300001	特锐德	39,800	954,006.00	0.15
190	301308	江波龙	10,900	953,641.00	0.15
191	000060	中金岭南	205,000	938,900.00	0.15
192	600655	豫园股份	167,457	929,386.35	0.15
193	603486	科沃斯	15,600	908,388.00	0.14
194	601016	节能风电	313,800	906,882.00	0.14
195	002080	中材科技	46,200	900,900.00	0.14
196	600361	创新新材	223,500	891,765.00	0.14
197	688235	百济神州	3,800	887,832.00	0.14
198	688234	天岳先进	15,100	884,105.00	0.14
199	601162	天风证券	176,900	872,117.00	0.14
200	688100	威胜信息	23,500	870,675.00	0.14

201	600863	内蒙华电	209,000	858,990.00	0.13
202	002966	苏州银行	97,500	856,050.00	0.13
203	688072	拓荆科技	5,532	850,323.72	0.13
204	601128	常熟银行	113,634	837,482.58	0.13
205	600879	航天电子	79,800	835,506.00	0.13
206	000921	海信家电	32,500	835,250.00	0.13
207	002318	久立特材	35,200	823,328.00	0.13
208	600380	健康元	73,400	809,602.00	0.13
209	688180	君实生物	23,821	809,437.58	0.13
210	300024	机器人	46,900	805,742.00	0.13
211	002044	美年健康	156,000	801,840.00	0.13
212	300735	光弘科技	31,700	795,670.00	0.13
213	600688	上海石化	276,000	786,600.00	0.12
214	688520	神州细胞	13,000	778,050.00	0.12
215	002281	光迅科技	15,700	774,324.00	0.12
216	002572	索菲亚	55,100	771,951.00	0.12
217	002673	西部证券	97,300	766,724.00	0.12
218	300115	长盈精密	35,800	766,120.00	0.12
219	689009	九号公司	12,902	763,411.34	0.12
220	300474	景嘉微	10,100	737,300.00	0.12
221	688728	格科微	47,800	736,120.00	0.12
222	000429	粤高速 A	55,100	734,483.00	0.12
223	601333	广深铁路	254,000	734,060.00	0.12
224	600583	海油工程	134,400	733,824.00	0.12
225	002120	韵达股份	108,600	727,620.00	0.11
226	002429	兆驰股份	166,000	727,080.00	0.11
227	688538	和辉光电	310,700	727,038.00	0.11
228	600392	盛和资源	54,900	723,033.00	0.11
229	688017	绿的谐波	5,604	699,883.56	0.11
230	600298	安琪酵母	19,900	699,883.00	0.11
231	000887	中鼎股份	39,300	691,287.00	0.11
232	688561	奇安信	20,300	689,794.00	0.11
233	300458	全志科技	17,200	682,668.00	0.11
234	000066	中国长城	46,100	682,280.00	0.11
235	688183	生益电子	13,300	680,960.00	0.11
236	601577	长沙银行	68,500	680,890.00	0.11
237	688278	特宝生物	9,358	674,805.38	0.11
238	000559	万向钱潮	88,100	673,965.00	0.11
239	601866	中远海发	271,000	669,370.00	0.11
240	688052	纳芯微	3,800	663,062.00	0.10
241	002603	以岭药业	46,600	657,060.00	0.10
242	002299	圣农发展	45,800	654,482.00	0.10
243	300803	指南针	8,075	651,329.50	0.10

244	301267	华夏眼科	33,900	649,863.00	0.10
245	601918	新集能源	100,500	649,230.00	0.10
246	300595	欧普康视	40,600	619,962.00	0.10
247	601717	中创智领	37,300	619,926.00	0.10
248	688065	凯赛生物	13,124	618,140.40	0.10
249	601665	齐鲁银行	97,800	618,096.00	0.10
250	601019	山东出版	64,500	610,815.00	0.10
251	603899	晨光股份	21,000	608,790.00	0.10
252	600580	卧龙电驱	30,720	607,334.40	0.10
253	603345	安井食品	7,500	603,150.00	0.09
254	600511	国药股份	20,300	591,948.00	0.09
255	601598	中国外运	118,400	583,712.00	0.09
256	000932	华菱钢铁	130,100	572,440.00	0.09
257	002385	大北农	140,900	569,236.00	0.09
258	002353	杰瑞股份	16,100	563,500.00	0.09
259	600763	通策医疗	13,621	562,274.88	0.09
260	600497	驰宏锌锗	106,100	561,269.00	0.09
261	601399	国机重装	185,700	557,100.00	0.09
262	300763	锦浪科技	9,700	556,683.00	0.09
263	603786	科博达	10,000	554,100.00	0.09
264	601636	旗滨集团	110,000	551,100.00	0.09
265	688385	复旦微电	11,100	546,897.00	0.09
266	601966	玲珑轮胎	36,700	538,389.00	0.08
267	000528	柳工	55,200	530,472.00	0.08
268	601139	深圳燃气	82,800	526,608.00	0.08
269	600528	中铁工业	70,500	520,290.00	0.08
270	300251	光线传媒	25,400	514,858.00	0.08
271	688281	华秦科技	8,500	514,335.00	0.08
272	000703	恒逸石化	85,100	500,388.00	0.08
273	688295	中复神鹰	23,900	497,120.00	0.08
274	688521	芯原股份	5,073	489,544.50	0.08
275	300058	蓝色光标	74,400	488,064.00	0.08
276	000738	航发控制	23,517	487,977.75	0.08
277	300957	贝泰妮	10,800	477,576.00	0.08
278	603228	景旺电子	11,400	476,976.00	0.07
279	603707	健友股份	42,600	474,990.00	0.07
280	688676	金盘科技	14,100	471,645.00	0.07
281	000032	深桑达 A	23,000	465,290.00	0.07
282	001286	陕西能源	53,300	463,710.00	0.07
283	603816	顾家家居	17,900	456,808.00	0.07
284	000967	盈峰环境	65,600	455,920.00	0.07
285	601933	永辉超市	91,900	450,310.00	0.07
286	603565	中谷物流	46,700	445,985.00	0.07

287	600801	华新水泥	37,600	445,184.00	0.07
288	600566	济川药业	16,900	444,977.00	0.07
289	002261	拓维信息	14,200	439,490.00	0.07
290	600325	华发股份	90,100	438,787.00	0.07
291	601061	中信金属	55,400	438,214.00	0.07
292	600516	方大炭素	92,700	430,128.00	0.07
293	300346	南大光电	13,500	427,140.00	0.07
294	600329	达仁堂	12,800	427,008.00	0.07
295	600808	马钢股份	123,500	426,075.00	0.07
296	600098	广州发展	68,100	425,625.00	0.07
297	300073	当升科技	9,700	425,539.00	0.07
298	603927	中科软	22,000	425,480.00	0.07
299	002608	江苏国信	57,500	421,475.00	0.07
300	600995	南网储能	43,000	420,540.00	0.07
301	600707	彩虹股份	64,600	417,316.00	0.07
302	601106	中国一重	148,600	416,080.00	0.07
303	001696	宗申动力	18,400	413,080.00	0.06
304	603129	春风动力	1,900	411,350.00	0.06
305	600271	航天信息	44,300	409,332.00	0.06
306	600153	建发股份	38,900	403,393.00	0.06
307	002851	麦格米特	8,000	401,120.00	0.06
308	601997	贵阳银行	64,100	399,984.00	0.06
309	600970	中材国际	46,300	397,254.00	0.06
310	603885	吉祥航空	29,400	396,018.00	0.06
311	603728	鸣志电器	6,800	390,796.00	0.06
312	001213	中铁特货	96,100	390,166.00	0.06
313	000537	中绿电	46,000	384,560.00	0.06
314	000591	太阳能	86,400	379,296.00	0.06
315	600170	上海建工	158,200	378,098.00	0.06
316	688172	燕东微	18,500	363,710.00	0.06
317	002465	海格通信	25,600	356,864.00	0.06
318	600925	苏能股份	67,500	353,025.00	0.06
319	600208	衢州发展	118,200	349,872.00	0.05
320	000513	丽珠集团	9,700	349,588.00	0.05
321	600927	永安期货	23,500	348,035.00	0.05
322	002195	岩山科技	59,300	333,859.00	0.05
323	002372	伟星新材	32,200	333,592.00	0.05
324	688297	中无人机	6,200	331,080.00	0.05
325	000629	钒钛股份	129,000	330,240.00	0.05
326	603650	彤程新材	10,200	327,930.00	0.05
327	600529	山东药玻	14,800	327,672.00	0.05
328	601155	新城控股	23,900	326,952.00	0.05
329	002958	青农商行	89,200	322,012.00	0.05

330	002085	万丰奥威	20,200	320,978.00	0.05
331	300748	金力永磁	13,200	314,688.00	0.05
332	688568	中科星图	8,700	313,287.00	0.05
333	300136	信维通信	13,900	311,360.00	0.05
334	600398	海澜之家	43,800	304,848.00	0.05
335	002130	沃尔核材	12,700	302,514.00	0.05
336	002064	华峰化学	45,300	299,433.00	0.05
337	000709	河钢股份	134,700	290,952.00	0.05
338	600737	中粮糖业	30,600	289,170.00	0.05
339	688375	国博电子	4,800	288,048.00	0.05
340	688778	厦钨新能	5,100	285,192.00	0.04
341	600363	联创光电	4,800	279,984.00	0.04
342	002653	海思科	6,600	278,652.00	0.04
343	600060	海信视像	12,100	278,542.00	0.04
344	603179	新泉股份	5,800	272,426.00	0.04
345	000400	许继电气	12,400	269,948.00	0.04
346	603737	三棵树	7,280	268,268.00	0.04
347	688248	南网科技	8,500	267,410.00	0.04
348	300070	碧水源	59,200	266,400.00	0.04
349	002507	涪陵榨菜	20,800	266,032.00	0.04
350	600390	五矿资本	44,000	256,520.00	0.04
351	002294	信立泰	5,300	250,849.00	0.04
352	603000	人民网	12,400	250,604.00	0.04
353	600373	中文传媒	23,600	242,372.00	0.04
354	300757	罗博特科	1,600	239,952.00	0.04
355	300679	电连技术	5,000	226,900.00	0.04
356	601666	平煤股份	30,400	225,264.00	0.04
357	002738	中矿资源	6,900	221,904.00	0.03
358	002568	百润股份	8,600	220,246.00	0.03
359	002444	巨星科技	8,500	216,835.00	0.03
360	300857	协创数据	2,500	215,150.00	0.03
361	002152	广电运通	15,800	212,352.00	0.03
362	600171	上海贝岭	6,100	208,925.00	0.03
363	301498	乖宝宠物	1,800	196,866.00	0.03
364	301165	锐捷网络	3,200	196,672.00	0.03
365	300677	英科医疗	8,300	196,544.00	0.03
366	300724	捷佳伟创	3,600	195,480.00	0.03
367	688525	佰维存储	2,900	195,460.00	0.03
368	300751	迈为股份	2,700	187,812.00	0.03
369	603606	东方电缆	3,600	186,156.00	0.03
370	600282	南钢股份	43,700	183,540.00	0.03
371	002430	杭氧股份	9,100	176,722.00	0.03
372	002756	永兴材料	5,300	168,275.00	0.03

373	600598	北大荒	11,200	161,504.00	0.03
374	603338	浙江鼎力	3,200	151,680.00	0.02
375	603556	海兴电力	5,900	150,273.00	0.02
376	601212	白银有色	46,900	146,797.00	0.02
377	603659	璞泰来	7,500	140,850.00	0.02
378	603868	飞科电器	3,900	139,893.00	0.02
379	601156	东航物流	10,400	136,136.00	0.02
380	301358	湖南裕能	4,300	134,117.00	0.02
381	600968	海油发展	32,800	133,824.00	0.02
382	605358	立昂微	5,500	128,150.00	0.02
383	600126	杭钢股份	13,100	117,900.00	0.02
384	600435	北方导航	7,400	115,366.00	0.02
385	300676	华大基因	2,200	109,494.00	0.02
386	603568	伟明环保	5,500	104,940.00	0.02
387	000958	电投产融	15,300	104,652.00	0.02
388	002065	东华软件	10,600	101,760.00	0.02
389	601611	中国核建	11,000	101,090.00	0.02
390	002423	中粮资本	8,000	97,840.00	0.02
391	688032	禾迈股份	950	94,867.00	0.01
392	002831	裕同科技	4,000	93,680.00	0.01
393	600132	重庆啤酒	1,600	88,160.00	0.01
394	002439	启明星辰	5,200	83,148.00	0.01
395	000021	深科技	4,100	76,834.00	0.01
396	003022	联泓新科	4,700	74,401.00	0.01
397	688301	奕瑞科技	840	73,592.40	0.01
398	600872	中炬高新	3,800	72,200.00	0.01
399	300487	蓝晓科技	1,400	70,420.00	0.01
400	600612	老凤祥	1,400	69,650.00	0.01
401	300529	健帆生物	2,800	60,396.00	0.01
402	000898	鞍钢股份	26,000	60,320.00	0.01
403	002508	老板电器	3,000	57,030.00	0.01
404	002432	九安医疗	1,500	54,645.00	0.01
405	000539	粤电力 A	11,200	50,848.00	0.01
406	600895	张江高科	1,900	48,830.00	0.01
407	002984	森麒麟	2,600	48,750.00	0.01
408	000831	中国稀土	1,300	46,956.00	0.01
409	002563	森马服饰	6,900	36,294.00	0.01
410	002203	海亮股份	3,500	36,120.00	0.01
411	600754	锦江酒店	1,600	35,904.00	0.01
412	000883	湖北能源	7,700	34,727.00	0.01
413	002007	华兰生物	2,200	34,474.00	0.01
414	600095	湘财股份	3,400	34,102.00	0.01
415	600985	淮北矿业	3,000	34,020.00	0.01

416	000062	深圳华强	1,100	29,546.00	0.00
417	000997	新大陆	800	25,904.00	0.00
418	300142	沃森生物	1,900	20,900.00	0.00
419	688363	华熙生物	400	20,540.00	0.00
420	601858	中国科传	900	17,505.00	0.00
421	300390	天华新能	900	17,163.00	0.00
422	300765	新诺威	300	15,507.00	0.00
423	601928	凤凰传媒	1,200	13,404.00	0.00
424	000636	风华高科	800	10,992.00	0.00
425	301301	川宁生物	700	8,428.00	0.00

### 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	002384	东山精密	61,900	2,337,963.00	0.37
2	688185	康希诺	26,996	1,609,771.48	0.25
3	603444	吉比特	5,300	1,600,335.00	0.25
4	002625	光启技术	37,700	1,507,246.00	0.24
5	600418	江淮汽车	35,700	1,431,213.00	0.22
6	300369	绿盟科技	159,100	1,236,207.00	0.19
7	300447	全信股份	78,300	1,226,961.00	0.19
8	601766	中国中车	171,100	1,204,544.00	0.19
9	688711	宏微科技	67,000	1,178,530.00	0.19
10	601211	国泰海通	57,300	1,097,868.00	0.17
11	300706	阿石创	46,900	1,078,700.00	0.17
12	688558	国盛智科	42,000	1,060,080.00	0.17
13	000100	TCL 科技	243,100	1,052,623.00	0.17
14	688786	悦安新材	44,800	1,043,840.00	0.16
15	301221	光庭信息	19,200	997,824.00	0.16
16	688088	虹软科技	20,600	993,950.00	0.16
17	603005	晶方科技	34,500	979,455.00	0.15
18	002284	亚太股份	88,000	972,400.00	0.15
19	600958	东方证券	99,200	960,256.00	0.15
20	600219	南山铝业	247,800	949,074.00	0.15
21	300009	安科生物	110,200	922,374.00	0.14
22	688484	南芯科技	23,000	909,650.00	0.14
23	002600	领益智造	104,500	897,655.00	0.14
24	001227	兰州银行	354,200	885,500.00	0.14
25	688259	创耀科技	21,200	840,580.00	0.13
26	688095	福昕软件	12,351	838,756.41	0.13
27	603288	海天味业	21,100	821,001.00	0.13
28	603306	华懋科技	18,700	813,450.00	0.13
29	600266	城建发展	177,400	805,396.00	0.13
30	600482	中国动力	33,300	768,231.00	0.12

31	002091	江苏国泰	105,400	766,258.00	0.12
32	002001	新和成	35,800	761,466.00	0.12
33	600694	大商股份	40,560	752,388.00	0.12
34	688256	寒武纪	1,200	721,800.00	0.11
35	603766	隆鑫通用	54,200	691,592.00	0.11
36	688787	海天瑞声	6,400	679,552.00	0.11
37	688258	卓易信息	13,971	676,615.53	0.11
38	002649	博彦科技	44,700	649,491.00	0.10
39	300231	银信科技	51,500	633,965.00	0.10
40	301080	百普赛斯	8,700	622,311.00	0.10
41	302132	中航成飞	7,000	615,580.00	0.10
42	002151	北斗星通	21,100	605,359.00	0.10
43	688668	鼎通科技	9,680	604,612.80	0.09
44	688039	当虹科技	18,100	594,042.00	0.09
45	688286	敏芯股份	8,339	589,483.91	0.09
46	600519	贵州茅台	400	563,808.00	0.09
47	601688	华泰证券	30,800	548,548.00	0.09
48	600064	南京高科	71,100	548,181.00	0.09
49	603601	再升科技	133,900	543,634.00	0.09
50	688343	云天励飞	10,700	528,794.00	0.08
51	002373	千方科技	55,000	511,500.00	0.08
52	601126	四方股份	31,200	507,624.00	0.08
53	688313	仕佳光子	13,100	498,455.00	0.08
54	002466	天齐锂业	15,000	480,600.00	0.08
55	300750	宁德时代	1,900	479,218.00	0.08
56	600335	国机汽车	74,200	478,590.00	0.08
57	601989	中国重工	103,000	477,920.00	0.08
58	300298	三诺生物	21,000	474,390.00	0.07
59	688201	信安世纪	36,400	471,380.00	0.07
60	601899	紫金矿业	24,000	468,000.00	0.07
61	300409	道氏技术	27,500	465,850.00	0.07
62	300866	安克创新	4,073	462,692.80	0.07
63	000402	金融街	163,200	460,224.00	0.07
64	001203	大中矿业	47,400	447,930.00	0.07
65	000725	京东方 A	111,700	445,683.00	0.07
66	002028	思源电气	6,100	444,751.00	0.07
67	002048	宁波华翔	23,700	436,317.00	0.07
68	688508	芯朋微	7,800	435,396.00	0.07
69	603636	南威软件	33,200	419,648.00	0.07
70	688195	腾景科技	9,200	414,000.00	0.07
71	603993	洛阳钼业	48,800	410,896.00	0.06
72	002407	多氟多	33,700	410,803.00	0.06
73	601336	新华保险	6,900	403,650.00	0.06

74	301078	孩子王	30,600	399,942.00	0.06
75	301060	兰卫医学	41,100	396,615.00	0.06
76	603259	药明康德	5,700	396,435.00	0.06
77	688126	沪硅产业	20,800	389,376.00	0.06
78	605376	博迁新材	10,100	387,133.00	0.06
79	003816	中国广核	106,100	386,204.00	0.06
80	600350	山东高速	35,700	380,562.00	0.06
81	300498	温氏股份	22,200	379,176.00	0.06
82	600073	光明肉业	50,500	372,690.00	0.06
83	603267	鸿远电子	7,400	371,998.00	0.06
84	688311	盟升电子	8,636	371,779.80	0.06
85	002206	海利得	72,700	371,497.00	0.06
86	603327	福蓉科技	39,810	368,242.50	0.06
87	002891	中宠股份	5,900	365,033.00	0.06
88	600866	星湖科技	51,600	356,556.00	0.06
89	300777	中简科技	9,700	351,625.00	0.06
90	300308	中际旭创	2,400	350,064.00	0.05
91	688089	嘉必优	13,900	349,585.00	0.05
92	301236	软通动力	6,300	344,232.00	0.05
93	601939	建设银行	35,400	334,176.00	0.05
94	600276	恒瑞医药	6,400	332,160.00	0.05
95	000999	华润三九	10,590	331,255.20	0.05
96	603171	税友股份	7,600	326,116.00	0.05
97	300045	华力创通	16,900	322,621.00	0.05
98	688233	神工股份	10,063	319,701.51	0.05
99	000498	山东路桥	53,500	314,580.00	0.05
100	688012	中微公司	1,719	313,373.70	0.05
101	601881	中国银河	18,200	312,130.00	0.05
102	000938	紫光股份	13,000	311,870.00	0.05
103	600926	杭州银行	18,500	311,170.00	0.05
104	002249	大洋电机	46,700	307,286.00	0.05
105	603588	高能环境	54,100	305,124.00	0.05
106	688209	英集芯	16,400	302,908.00	0.05
107	688266	泽璟制药	2,800	301,028.00	0.05
108	000712	锦龙股份	22,900	300,677.00	0.05
109	600710	苏美达	31,200	299,832.00	0.05
110	600011	华能国际	41,700	297,738.00	0.05
111	603665	康隆达	11,800	292,404.00	0.05
112	600729	重庆百货	9,700	289,351.00	0.05
113	603199	九华旅游	7,900	286,296.00	0.04
114	002099	海翔药业	51,900	285,450.00	0.04
115	600100	同方股份	39,100	283,084.00	0.04
116	688685	迈信林	5,000	279,250.00	0.04

117	603456	九洲药业	18,200	276,822.00	0.04
118	603788	宁波高发	17,400	276,138.00	0.04
119	601567	三星医疗	12,300	275,766.00	0.04
120	605305	中际联合	9,500	263,910.00	0.04
121	600377	宁沪高速	17,000	260,780.00	0.04
122	600216	浙江医药	17,500	258,825.00	0.04
123	688326	经纬恒润	2,900	258,796.00	0.04
124	603138	海量数据	17,500	252,350.00	0.04
125	300737	科顺股份	52,100	251,122.00	0.04
126	300769	德方纳米	7,600	250,952.00	0.04
127	600027	华电国际	45,800	250,526.00	0.04
128	688223	晶科能源	48,200	250,158.00	0.04
129	300151	昌红科技	20,300	249,893.00	0.04
130	603501	豪威集团	1,900	242,535.00	0.04
131	300222	科大智能	22,600	230,294.00	0.04
132	300785	值得买	7,200	229,176.00	0.04
133	600183	生益科技	7,600	229,140.00	0.04
134	002896	中大力德	3,900	225,849.00	0.04
135	600429	三元股份	49,900	225,049.00	0.04
136	300319	麦捷科技	20,800	223,392.00	0.04
137	605080	浙江自然	8,000	222,400.00	0.03
138	000011	深物业 A	25,800	218,010.00	0.03
139	603966	法兰泰克	23,300	216,224.00	0.03
140	601963	重庆银行	19,800	215,028.00	0.03
141	300365	恒华科技	32,500	214,175.00	0.03
142	688015	交控科技	10,200	212,568.00	0.03
143	002128	电投能源	10,704	211,725.12	0.03
144	688207	格灵深瞳	13,900	209,890.00	0.03
145	601678	滨化股份	50,500	209,070.00	0.03
146	000630	铜陵有色	61,800	206,412.00	0.03
147	002032	苏泊尔	3,900	204,321.00	0.03
148	002589	瑞康医药	68,700	203,352.00	0.03
149	002283	天润工业	33,900	202,044.00	0.03
150	002330	得利斯	44,000	201,520.00	0.03
151	603011	合锻智能	12,900	200,982.00	0.03
152	002662	峰璟股份	57,500	196,650.00	0.03
153	002516	旷达科技	37,900	195,185.00	0.03
154	600416	湘电股份	14,300	192,192.00	0.03
155	002344	海宁皮城	44,200	191,828.00	0.03
156	300787	海能实业	13,720	190,022.00	0.03
157	600338	西藏珠峰	17,100	189,639.00	0.03
158	002382	蓝帆医疗	32,700	183,120.00	0.03
159	600446	金证股份	9,600	182,112.00	0.03

160	000895	双汇发展	7,400	180,634.00	0.03
161	601100	恒立液压	2,500	180,000.00	0.03
162	300624	万兴科技	2,900	179,945.00	0.03
163	300048	合康新能	30,500	179,035.00	0.03
164	002690	美亚光电	10,600	178,822.00	0.03
165	002511	中顺洁柔	26,600	178,752.00	0.03
166	300767	震安科技	13,700	178,511.00	0.03
167	300741	华宝股份	9,300	175,677.00	0.03
168	301327	华宝新能	3,360	172,569.60	0.03
169	002174	游族网络	14,200	172,246.00	0.03
170	688023	安恒信息	3,000	170,220.00	0.03
171	002413	雷科防务	29,400	169,932.00	0.03
172	688699	明微电子	5,200	168,376.00	0.03
173	002543	万和电气	15,000	166,650.00	0.03
174	300894	火星人	12,900	165,507.00	0.03
175	000006	深振业 A	25,300	163,185.00	0.03
176	600718	东软集团	16,600	161,850.00	0.03
177	300661	圣邦股份	2,210	160,821.70	0.03
178	603811	诚意药业	17,400	160,602.00	0.03
179	002081	金螳螂	46,800	160,524.00	0.03
180	603678	火炬电子	4,200	159,726.00	0.03
181	600660	福耀玻璃	2,800	159,628.00	0.03
182	688288	鸿泉物联	5,400	156,654.00	0.02
183	600308	华泰股份	45,500	155,610.00	0.02
184	000651	格力电器	3,400	152,728.00	0.02
185	002687	乔治白	32,800	152,192.00	0.02
186	300182	捷成股份	26,900	148,219.00	0.02
187	688536	思瑞浦	1,063	147,459.36	0.02
188	603609	禾丰股份	17,300	142,898.00	0.02
189	688472	阿特斯	15,500	141,825.00	0.02
190	002648	卫星化学	8,000	138,640.00	0.02
191	600179	安通控股	49,800	137,448.00	0.02
192	603186	华正新材	4,500	135,810.00	0.02
193	300267	尔康制药	42,500	133,450.00	0.02
194	300428	立中集团	7,300	133,006.00	0.02
195	002985	北摩高科	4,300	130,075.00	0.02
196	000726	鲁泰 A	20,400	129,336.00	0.02
197	002463	沪电股份	3,000	127,740.00	0.02
198	002314	南山控股	48,500	127,555.00	0.02
199	300928	华安鑫创	3,800	127,110.00	0.02
200	002955	鸿合科技	5,100	125,307.00	0.02
201	600198	大唐电信	14,500	123,830.00	0.02
202	300662	科锐国际	4,147	123,207.37	0.02

203	603050	科林电气	7,200	118,512.00	0.02
204	000600	建投能源	16,700	115,397.00	0.02
205	688029	南微医学	1,703	115,037.65	0.02
206	300762	上海瀚讯	5,000	113,150.00	0.02
207	002866	传艺科技	6,100	112,179.00	0.02
208	600996	贵广网络	13,400	111,756.00	0.02
209	601369	陕鼓动力	12,700	111,379.00	0.02
210	300101	振芯科技	4,900	110,887.00	0.02
211	300636	同和药业	14,300	109,824.00	0.02
212	603730	岱美股份	19,300	109,817.00	0.02
213	300206	理邦仪器	9,100	109,382.00	0.02
214	300219	鸿利智汇	16,200	108,864.00	0.02
215	600662	外服控股	21,100	107,821.00	0.02
216	300408	三环集团	3,200	106,880.00	0.02
217	002881	美格智能	2,300	106,720.00	0.02
218	600050	中国联通	19,900	106,266.00	0.02
219	301381	赛维时代	5,300	105,735.00	0.02
220	688369	致远互联	4,000	105,560.00	0.02
221	002949	华阳国际	7,800	105,144.00	0.02
222	002489	浙江永强	28,700	105,042.00	0.02
223	600751	海航科技	31,900	104,632.00	0.02
224	600963	岳阳林纸	23,500	104,105.00	0.02
225	002475	立讯精密	3,000	104,070.00	0.02
226	300442	润泽科技	2,100	104,013.00	0.02
227	002345	潮宏基	7,100	103,873.00	0.02
228	002243	力合科创	12,400	101,184.00	0.02
229	605117	德业股份	1,900	100,054.00	0.02
230	601628	中国人寿	2,400	98,856.00	0.02
231	000727	冠捷科技	39,900	96,957.00	0.02
232	000813	德展健康	30,000	96,600.00	0.02
233	688037	芯源微	900	96,480.00	0.02
234	600433	冠豪高新	31,300	96,091.00	0.02
235	300363	博腾股份	5,600	95,648.00	0.02
236	601882	海天精工	5,000	95,500.00	0.02
237	600501	航天晨光	4,500	92,205.00	0.01
238	300647	超频三	14,100	91,227.00	0.01
239	688663	新风光	3,300	88,935.00	0.01
240	600559	老白干酒	5,300	88,775.00	0.01
241	603296	华勤技术	1,100	88,748.00	0.01
242	002234	民和股份	10,800	88,020.00	0.01
243	300355	蒙草生态	20,700	87,975.00	0.01
244	002853	皮阿诺	6,400	87,744.00	0.01
245	603056	德邦股份	5,500	87,560.00	0.01

246	000553	安道麦 A	12,100	87,362.00	0.01
247	603392	万泰生物	1,400	85,400.00	0.01
248	600869	远东股份	16,700	84,836.00	0.01
249	002597	金禾实业	3,600	84,780.00	0.01
250	300586	美联新材	7,900	84,293.00	0.01
251	688403	汇成股份	8,100	84,159.00	0.01
252	300014	亿纬锂能	1,800	82,458.00	0.01
253	600489	中金黄金	5,600	81,928.00	0.01
254	300232	洲明科技	11,300	81,812.00	0.01
255	000061	农产品	12,700	81,153.00	0.01
256	688001	华兴源创	3,200	80,864.00	0.01
257	300770	新媒股份	2,000	79,980.00	0.01
258	300446	航天智造	4,600	79,672.00	0.01
259	600305	恒顺醋业	10,300	79,619.00	0.01
260	002818	富森美	6,300	78,624.00	0.01
261	600770	综艺股份	14,800	78,440.00	0.01
262	600742	富维股份	8,200	77,982.00	0.01
263	688116	天奈科技	1,700	77,809.00	0.01
264	688238	和元生物	12,400	76,880.00	0.01
265	600331	宏达股份	8,700	75,951.00	0.01
266	300525	博思软件	5,200	75,712.00	0.01
267	600588	用友网络	5,600	74,872.00	0.01
268	000063	中兴通讯	2,300	74,727.00	0.01
269	600537	亿晶光电	25,300	74,382.00	0.01
270	300996	普联软件	4,940	74,248.20	0.01
271	000030	富奥股份	12,600	74,214.00	0.01
272	601515	东峰集团	19,400	74,108.00	0.01
273	002252	上海莱士	10,700	73,509.00	0.01
274	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
275	002869	金溢科技	2,900	69,397.00	0.01
276	601600	中国铝业	9,700	68,288.00	0.01
277	002219	新里程	31,000	68,200.00	0.01
278	301367	瑞迈特	800	67,280.00	0.01
278	600597	光明乳业	8,000	67,280.00	0.01
279	601127	赛力斯	500	67,160.00	0.01
280	300284	苏交科	7,300	66,430.00	0.01
281	600864	哈投股份	11,000	65,670.00	0.01
282	600491	龙元建设	17,800	65,504.00	0.01
283	688085	三友医疗	3,400	65,382.00	0.01
284	688008	澜起科技	793	65,026.00	0.01
285	600025	华能水电	6,800	64,940.00	0.01
286	301031	中熔电气	800	63,720.00	0.01
287	600207	安彩高科	13,200	62,832.00	0.01

288	002858	力盛体育	4,700	62,604.00	0.01
289	601727	上海电气	8,400	62,076.00	0.01
290	601919	中远海控	4,100	61,664.00	0.01
291	600817	宇通重工	5,100	60,384.00	0.01
292	002131	利欧股份	17,100	59,850.00	0.01
293	600999	招商证券	3,400	59,806.00	0.01
294	002437	誉衡药业	20,800	59,280.00	0.01
295	688589	力合微	2,760	59,036.40	0.01
296	603681	永冠新材	3,900	58,383.00	0.01
297	688499	利元亨	1,400	58,254.00	0.01
298	002075	沙钢股份	10,000	58,200.00	0.01
299	600850	电科数字	2,400	58,056.00	0.01
300	688025	杰普特	800	57,200.00	0.01
301	300456	赛微电子	3,300	56,727.00	0.01
302	603726	朗迪集团	3,500	56,665.00	0.01
303	000977	浪潮信息	1,100	55,968.00	0.01
304	600320	振华重工	12,700	55,499.00	0.01
305	300203	聚光科技	2,500	55,325.00	0.01
306	601288	农业银行	9,300	54,684.00	0.01
307	300168	万达信息	7,100	54,457.00	0.01
308	600828	茂业商业	14,100	54,426.00	0.01
309	000761	本钢板材	14,900	53,640.00	0.01
310	300821	东岳硅材	6,800	53,448.00	0.01
311	002988	豪美新材	1,400	53,200.00	0.01
312	688031	星环科技	1,100	51,293.00	0.01
313	002698	博实股份	3,300	51,282.00	0.01
314	688187	时代电气	1,200	51,180.00	0.01
315	600036	招商银行	1,100	50,545.00	0.01
316	002829	星网宇达	2,300	50,186.00	0.01
317	002421	达实智能	14,800	49,728.00	0.01
318	000720	新能泰山	14,200	49,558.00	0.01
319	300185	通裕重工	17,200	49,192.00	0.01
320	002459	晶澳科技	4,900	48,902.00	0.01
321	603330	天洋新材	7,200	48,816.00	0.01
322	688133	泰坦科技	2,100	48,342.00	0.01
323	001965	招商公路	4,000	48,000.00	0.01
324	688678	福立旺	2,500	47,600.00	0.01
325	002390	信邦制药	13,500	46,980.00	0.01
326	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
327	002245	蔚蓝锂芯	3,600	46,188.00	0.01
328	002428	云南锗业	2,300	45,770.00	0.01
329	605138	盛泰集团	6,800	45,560.00	0.01
330	601298	青岛港	5,200	45,188.00	0.01

331	603833	欧派家居	800	45,160.00	0.01
332	600990	四创电子	1,600	44,864.00	0.01
333	300602	飞荣达	2,100	44,541.00	0.01
334	605136	丽人丽妆	4,100	44,075.00	0.01
335	600775	南京熊猫	4,000	43,560.00	0.01
336	688305	科德数控	780	43,531.80	0.01
337	603429	集友股份	4,600	43,102.00	0.01
338	600120	浙江东方	7,000	42,350.00	0.01
339	300305	裕兴股份	6,500	41,470.00	0.01
340	603527	众源新材	3,800	41,306.00	0.01
341	600929	雪天盐业	8,000	40,480.00	0.01
342	000690	宝新能源	8,800	40,040.00	0.01
343	688768	容知日新	900	39,951.00	0.01
344	600246	万通发展	6,400	39,104.00	0.01
345	300154	瑞凌股份	4,300	38,700.00	0.01
346	301122	采纳股份	1,800	38,448.00	0.01
347	603867	新化股份	1,500	38,370.00	0.01
348	600975	新五丰	6,300	38,115.00	0.01
349	002218	拓日新能	11,500	37,260.00	0.01
350	002378	章源钨业	4,700	37,177.00	0.01
351	600642	申能股份	4,300	36,980.00	0.01
352	300439	美康生物	3,500	36,715.00	0.01
353	688515	裕太微	400	36,640.00	0.01
354	600217	中再资环	8,100	36,288.00	0.01
355	300779	惠城环保	200	35,698.00	0.01
356	300990	同飞股份	700	34,930.00	0.01
357	002702	海欣食品	8,300	34,694.00	0.01
358	002726	龙大美食	5,800	33,756.00	0.01
359	600703	三安光电	2,600	32,292.00	0.01
360	300520	科大国创	1,300	32,240.00	0.01
361	688599	天合光能	2,200	31,966.00	0.01
362	000807	云铝股份	2,000	31,960.00	0.01
363	300639	凯普生物	5,500	31,900.00	0.01
364	002351	漫步者	2,400	31,488.00	0.00
365	603076	乐惠国际	1,000	31,210.00	0.00
366	002453	华软科技	5,100	31,110.00	0.00
367	600400	红豆股份	13,300	30,324.00	0.00
368	603607	京华激光	1,200	29,532.00	0.00
369	603639	海利尔	2,100	29,505.00	0.00
370	600169	太原重工	12,000	29,040.00	0.00
371	603600	永艺股份	2,700	28,728.00	0.00
372	000829	天音控股	2,800	28,588.00	0.00
373	002063	远光软件	4,800	28,560.00	0.00

374	300105	龙源技术	3,700	28,527.00	0.00
375	002727	一心堂	1,600	26,144.00	0.00
376	688355	明志科技	1,482	26,038.74	0.00
377	300825	阿尔特	2,400	25,944.00	0.00
378	600713	南京医药	5,100	25,806.00	0.00
379	603236	移远通信	300	25,740.00	0.00
380	600738	丽尚国潮	4,300	24,940.00	0.00
381	300320	海达股份	2,500	24,850.00	0.00
382	600826	兰生股份	3,000	24,600.00	0.00
383	605111	新洁能	800	24,592.00	0.00
384	688401	路维光电	700	24,290.00	0.00
385	300900	广联航空	1,000	24,270.00	0.00
386	301069	凯盛新材	1,500	24,165.00	0.00
387	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
388	300510	金冠股份	5,200	23,816.00	0.00
389	002286	保龄宝	2,100	23,793.00	0.00
390	000657	中钨高新	2,000	23,720.00	0.00
391	300183	东软载波	1,400	23,534.00	0.00
392	002585	双星新材	4,300	23,478.00	0.00
393	300423	昇辉科技	3,300	23,232.00	0.00
394	300059	东方财富	1,000	23,130.00	0.00
395	001322	箭牌家居	2,700	22,815.00	0.00
396	300497	富祥药业	2,500	22,475.00	0.00
397	300559	佳发教育	1,900	22,420.00	0.00
398	601519	大智慧	2,200	22,418.00	0.00
399	600961	株冶集团	2,000	22,360.00	0.00
400	603987	康德莱	2,900	22,330.00	0.00
401	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
402	002664	信质集团	1,200	22,164.00	0.00
403	603633	徕木股份	2,500	21,725.00	0.00
404	603237	五芳斋	1,300	21,723.00	0.00
405	688202	美迪西	600	21,558.00	0.00
406	603488	展鹏科技	2,600	21,450.00	0.00
407	300813	泰林生物	1,000	21,410.00	0.00
408	603535	嘉诚国际	2,000	21,280.00	0.00
409	300598	诚迈科技	500	21,275.00	0.00
410	601279	英利汽车	5,200	20,748.00	0.00
411	002096	易普力	1,600	19,856.00	0.00
412	300158	振东制药	4,500	19,800.00	0.00
413	301039	中集车辆	2,400	19,512.00	0.00
414	300124	汇川技术	300	19,371.00	0.00
415	600783	鲁信创投	1,500	18,750.00	0.00
416	600386	北巴传媒	4,100	18,737.00	0.00

417	600346	恒力石化	1,300	18,538.00	0.00
418	601908	京运通	5,400	18,090.00	0.00
419	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
420	600809	山西汾酒	100	17,639.00	0.00
421	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
422	300266	兴源环境	5,800	16,936.00	0.00
423	603049	中策橡胶	379	16,240.15	0.00
424	605068	明新旭腾	900	16,173.00	0.00
425	601398	工商银行	2,100	15,939.00	0.00
426	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
427	300433	蓝思科技	700	15,610.00	0.00
428	300119	瑞普生物	800	15,536.00	0.00
429	300403	汉宇集团	1,000	15,190.00	0.00
430	300134	大富科技	1,200	14,676.00	0.00
431	300613	富瀚微	300	14,664.00	0.00
432	002734	利民股份	800	14,640.00	0.00
433	688197	首药控股	400	14,480.00	0.00
434	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
435	600481	双良节能	2,900	13,978.00	0.00
436	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
437	300274	阳光电源	200	13,554.00	0.00
438	603931	格林达	500	13,310.00	0.00
439	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
440	601003	柳钢股份	3,700	13,024.00	0.00
441	300072	海新能科	3,600	12,708.00	0.00
442	300738	奥飞数据	600	12,558.00	0.00
443	601068	中铝国际	2,700	12,339.00	0.00
444	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
445	688179	阿拉丁	960	12,211.20	0.00
446	603006	联明股份	1,000	12,180.00	0.00
447	603202	天有为	131	11,876.46	0.00
448	600724	宁波富达	2,600	11,830.00	0.00
449	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
450	603086	先达股份	1,200	11,760.00	0.00
451	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
452	688146	中船特气	400	11,564.00	0.00
453	300406	九强生物	800	11,320.00	0.00
454	603039	泛微网络	200	11,140.00	0.00
455	603466	风语筑	1,100	11,099.00	0.00
456	000401	冀东水泥	2,500	10,950.00	0.00
457	000425	徐工机械	1,400	10,878.00	0.00
458	600031	三一重工	600	10,770.00	0.00
459	600071	凤凰光学	500	10,680.00	0.00

460	000521	长虹美菱	1,500	10,410.00	0.00
461	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
462	300587	天铁科技	1,400	10,094.00	0.00
463	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
464	688176	亚虹医药	1,100	9,757.00	0.00
465	688070	纵横股份	200	9,660.00	0.00
466	605006	山东玻纤	1,400	9,408.00	0.00
467	688636	智明达	274	9,258.46	0.00
468	300229	拓尔思	500	9,220.00	0.00
469	601865	福莱特	600	9,126.00	0.00
470	688063	派能科技	200	9,016.00	0.00
471	000818	航锦科技	400	9,000.00	0.00
472	002446	盛路通信	1,200	8,856.00	0.00
473	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
474	002158	汉钟精机	500	8,690.00	0.00
475	300358	楚天科技	1,100	8,580.00	0.00
476	603378	亚士创能	1,400	8,484.00	0.00
477	600887	伊利股份	300	8,364.00	0.00
478	002285	世联行	3,600	8,208.00	0.00
479	603040	新坐标	200	8,034.00	0.00
480	603690	至纯科技	320	7,996.80	0.00
481	002560	通达股份	1,000	7,900.00	0.00
482	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
483	300725	药石科技	200	7,740.00	0.00
484	300755	华致酒行	400	7,720.00	0.00
485	688596	正帆科技	226	7,665.92	0.00
486	300666	江丰电子	100	7,410.00	0.00
487	603799	华友钴业	200	7,404.00	0.00
488	000803	山高环能	1,200	7,392.00	0.00
489	002705	新宝股份	500	7,350.00	0.00
490	000157	中联重科	1,000	7,230.00	0.00
491	300475	香农芯创	200	7,126.00	0.00
492	688315	诺禾致源	500	7,060.00	0.00
493	002368	太极股份	300	7,026.00	0.00
494	600641	万业企业	500	6,940.00	0.00
495	300648	星云股份	200	6,912.00	0.00
496	600584	长电科技	200	6,738.00	0.00
497	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
498	603628	清源股份	500	6,105.00	0.00
499	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
500	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
501	000676	智度股份	600	5,472.00	0.00
502	000935	四川双马	300	5,466.00	0.00

503	300166	东方国信	500	5,450.00	0.00
504	600019	宝钢股份	800	5,272.00	0.00
505	600938	中国海油	200	5,222.00	0.00
506	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
507	605366	宏柏新材	800	5,008.00	0.00
508	002100	天康生物	800	4,952.00	0.00
509	300296	利亚德	800	4,880.00	0.00
510	002030	达安基因	800	4,840.00	0.00
511	601702	华峰铝业	300	4,767.00	0.00
512	603260	合盛硅业	100	4,740.00	0.00
513	300820	英杰电气	100	4,585.00	0.00
514	002315	焦点科技	100	4,569.00	0.00
515	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
516	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
517	688218	江苏北人	200	4,340.00	0.00
518	688722	同益中	200	4,254.00	0.00
519	002701	奥瑞金	700	4,165.00	0.00
520	300707	威唐工业	300	4,143.00	0.00
521	603708	家家悦	400	4,080.00	0.00
522	603359	东珠生态	600	3,912.00	0.00
523	003038	鑫铂股份	200	3,898.00	0.00
524	300236	上海新阳	100	3,880.00	0.00
525	600035	楚天高速	900	3,816.00	0.00
526	688020	方邦股份	100	3,787.00	0.00
527	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
528	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
529	600097	开创国际	300	3,132.00	0.00
530	688221	前沿生物	300	3,012.00	0.00
531	600160	巨化股份	100	2,868.00	0.00
532	002614	奥佳华	400	2,616.00	0.00
533	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
534	300271	华宇软件	300	2,448.00	0.00
535	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
536	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
537	002324	普利特	200	2,126.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601168	西部矿业	17,040,547.00	1.58
2	300476	胜宏科技	16,360,957.00	1.52
3	600988	赤峰黄金	15,057,694.00	1.40

4	688578	艾力斯	13,646,196.86	1.27
5	002340	格林美	13,527,599.77	1.26
6	600418	江淮汽车	13,295,433.00	1.24
7	002384	东山精密	13,026,199.90	1.21
8	000988	华工科技	12,256,256.00	1.14
9	002797	第一创业	11,978,967.00	1.11
10	688099	晶晨股份	11,753,049.07	1.09
11	600873	梅花生物	11,549,131.00	1.07
12	002273	水晶光电	11,221,834.00	1.04
13	000423	东阿阿胶	11,178,768.00	1.04
14	601990	南京证券	11,121,326.00	1.03
15	002410	广联达	11,031,043.00	1.03
16	002202	金风科技	11,006,913.95	1.02
17	600177	雅戈尔	10,832,377.00	1.01
18	603893	瑞芯微	10,820,510.00	1.01
19	002625	光启技术	10,694,372.00	0.99
20	600862	中航高科	10,668,122.00	0.99

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	21,065,206.00	1.96
2	300476	胜宏科技	20,204,507.00	1.88
3	002384	东山精密	16,648,504.00	1.55
4	300866	安克创新	16,528,347.00	1.54
5	600988	赤峰黄金	16,434,454.00	1.53
6	000423	东阿阿胶	15,096,114.00	1.40
7	002517	恺英网络	14,974,659.82	1.39
8	601168	西部矿业	14,904,699.00	1.39
9	601717	中创智领	14,521,641.00	1.35
10	002625	光启技术	14,011,780.34	1.30
11	688578	艾力斯	13,832,889.25	1.29
12	600096	云天化	13,714,570.00	1.28
13	000988	华工科技	13,413,245.76	1.25
14	000039	中集集团	13,242,651.50	1.23
15	300054	鼎龙股份	13,225,994.00	1.23
16	600498	烽火通信	13,154,642.00	1.22
17	600873	梅花生物	13,002,043.00	1.21
18	300002	神州泰岳	12,445,789.00	1.16
19	000729	燕京啤酒	12,341,558.00	1.15
20	688099	晶晨股份	12,281,803.27	1.14

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,067,413,165.07
卖出股票收入（成交）总额	3,524,411,528.36

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	4,050,823.01	0.64
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）	29,002.19	0.00
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	4,079,825.20	0.64

#### 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	019749	24 国债 15	40,000	4,050,823.01	0.64
2	123257	安克转债	160	16,001.05	0.00
3	118056	路维转债	130	13,001.14	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，降低股票仓位调整的频率、交易成

本和带来的跟踪误差，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。

苏州东山精密制造股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅的处罚。

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	2,071,973.91
2	应收清算款	2,975,514.71
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	79,458.07
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,126,946.69

### 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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

### 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
景顺长城中证 500 指数增强 A	43,291	10,243.97	84,593,890.10	19.08	358,877,605.51	80.92
景顺长城中证 500 指数增强 C	1,715	4,185.62	-	-	7,178,343.95	100.00
合计	45,006	10,013.11	84,593,890.10	18.77	366,055,949.46	81.23

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城中证 500 指数增强 A	124,395.93	0.028050
	景顺长城中证 500 指数增强 C	35.61	0.000496
	合计	124,431.54	0.027612

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门	景顺长城中证 500 指数增强 A	-

负责人持有本开放式基金	景顺长城中证 500 指数增强 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城中证 500 指数增强 A	10~50
	景顺长城中证 500 指数增强 C	-
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2019 年 3 月 25 日)	1,508,879,568.71	-
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	681,619,872.95	120,767,048.26
本报告期基金总申购份额	22,427,463.10	4,868,034.30
减：本报告期基金总赎回份额	260,575,840.44	118,456,738.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	443,471,495.61	7,178,343.95

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## § 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 (%)	
招商证券股份有限公司	2	2,834,679,416.52	43.01	552,782.04	43.01	未变更
中国银河证券股份有限公司	1	1,848,592,829.88	28.05	360,505.05	28.05	未变更
中国国际金融股份	1	715,859,738.86	10.86	139,594.08	10.86	未变更

有限公司						
华泰证券股份有限公司	1	528,458,845.73	8.02	103,049.49	8.02	未变更
长城证券股份有限公司	3	408,136,181.97	6.19	79,586.59	6.19	未变更
平安证券股份有限公司	1	134,748,153.01	2.04	26,276.08	2.04	未变更
中信建投证券股份有限公司	2	119,614,744.27	1.82	23,328.42	1.82	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
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
信达证券	1	-	-	-	-	未变

股份有限公司						更
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中信证券股份有限公司	4	-	-	-	-	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(%)
招商证券股份有限公司	299,614.37	64.88	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	149,551.18	32.39	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中信建投证券股份有限公司	12,600.44	2.73	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限	-	-	-	-	-	-

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	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 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
5	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
6	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销售机构的公告	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
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 17 日
9	景顺长城中证 500 指数增强型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
10	景顺长城中证 500 指数增强型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
11	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
12	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
13	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 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 指数增强型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 指数增强型证券投资基金 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银泰证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 7 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 7 日
21	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
22	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
23	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
24	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 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
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 4 月 23 日
26	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
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	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
29	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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20250101-20250325	177,445,330.48	-	177,445,330.48	-	-
	2	20250312-20250602	154,057,273.14	-	80,459,203.96	73,598,069.18	16.33

### 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 指数增强型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》;
- 3、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》;
- 4、《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》;
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 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