

# 景顺长城创业板综指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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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>	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	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	12
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	12
<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	14
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>	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</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 .....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城创业板综指增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城创业板综指增强	
基金主代码	008072	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	273,593,321.60 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城创业板综指增强 A	景顺长城创业板综指增强 C
下属分级基金的交易代码	008072	019239
报告期末下属分级基金的份额总额	152,929,187.17 份	120,664,134.43 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 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。</p> <p>2、股票投资策略 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 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。</p> <p>4、股指期货、股票期权投资策略 本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。</p>
业绩比较基准	创业板综合指数收益率 × 95% + 商业银行活期存款利率(税后) × 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	王小飞
	联系电话	0755-82370388	021-60637103
	电子邮箱	investor@igwfm.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008888606	021-60637228
传真		0755-22381339	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518048	100033
法定代表人		叶才	张金良

## 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	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)	
	景顺长城创业板综指增强 A	景顺长城创业板综指增强 C
本期已实现收益	25,135,665.68	12,496,156.99
本期利润	36,355,636.43	18,164,087.33
加权平均基金份额 额本期利润	0.2287	0.2403
本期加权平均净 值利润率	15.29%	16.00%
本期基金份额净 值增长率	16.51%	16.28%
3.1.2 期末数据	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	

和指标			
期末可供分配利润	100,550,156.17		77,812,497.63
期末可供分配基金份额利润	0.6575		0.6449
期末基金资产净值	253,479,343.34		198,476,632.06
期末基金份额净值	1.6574		1.6448
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	65.74%		34.50%

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

景顺长城创业板综指增强 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	9.00%	1.03%	8.09%	1.09%	0.91%	-0.06%
过去三个月	9.38%	2.22%	5.60%	2.21%	3.78%	0.01%
过去六个月	16.51%	1.91%	8.47%	1.94%	8.04%	-0.03%
过去一年	52.92%	2.35%	39.45%	2.42%	13.47%	-0.07%
过去三年	10.56%	1.74%	-1.05%	1.77%	11.61%	-0.03%
自基金合同生效起至今	65.74%	1.68%	31.91%	1.70%	33.83%	-0.02%

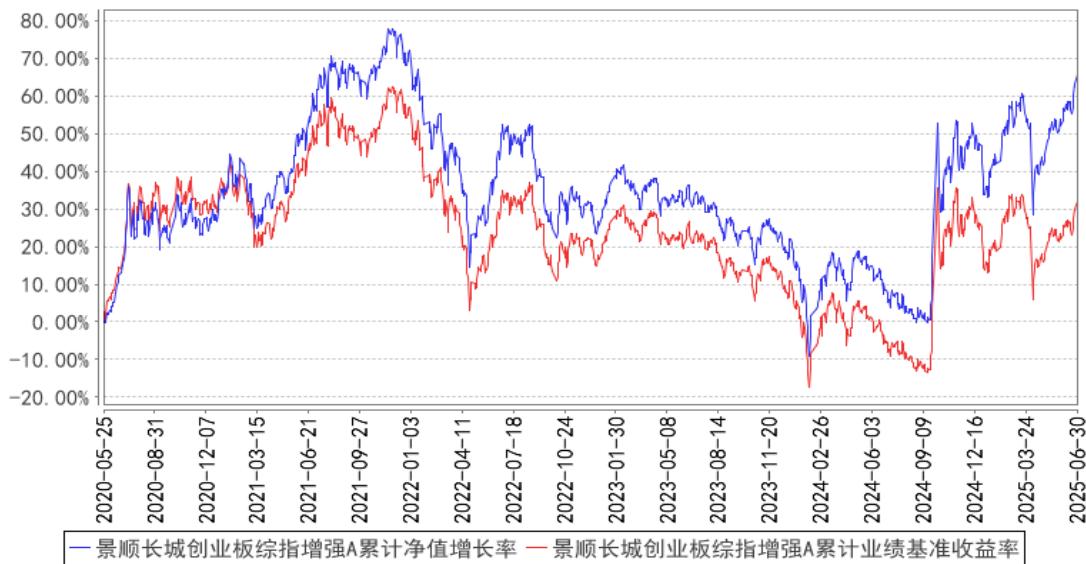
景顺长城创业板综指增强 C

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	8.96%	1.04%	8.09%	1.09%	0.87%	-0.05%
过去三个月	9.27%	2.22%	5.60%	2.21%	3.67%	0.01%
过去六个月	16.28%	1.91%	8.47%	1.94%	7.81%	-0.03%
过去一年	52.34%	2.35%	39.45%	2.42%	12.89%	-0.07%
自基金合同生效起至今	34.50%	2.03%	17.50%	2.08%	17.00%	-0.05%

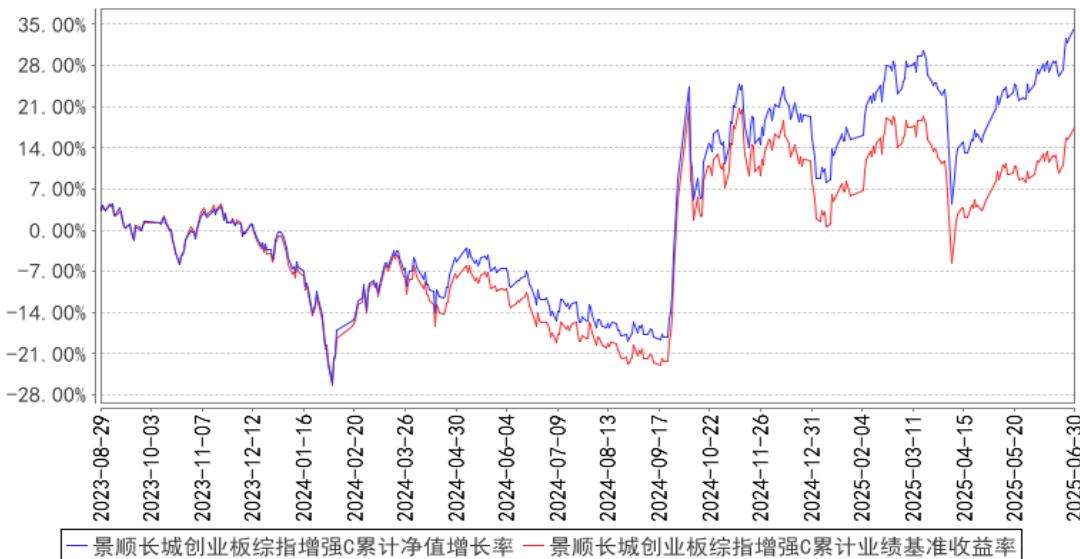
注：本基金于 2023 年 08 月 28 日增设 C 类基金份额，并于 2023 年 08 月 29 日开始对 C 类份额进行估值。

### 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

景顺长城创业板综指增强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



### 景顺长城创业板综指增强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和股票期权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 2020 年 5 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 2023 年 8 月 28 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	2020 年 5 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。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；  
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《景顺长城创业板综指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 16.51%，业绩比较基准收益率为 8.47%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 16.28%，业绩比较基准收益率为 8.47%。

### 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。

本基金是以创业板综合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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金管理法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：景顺长城创业板综指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	32,739,659.33	15,996,571.67
结算备付金		3,891,087.39	1,912,039.36
存出保证金		801,603.74	313,730.72
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	421,492,245.02	256,461,096.28
其中：股票投资		421,476,043.95	256,461,096.28
基金投资		-	-
债券投资		16,201.07	-
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		21, 577. 12	827, 589. 85
应收股利		-	-
应收申购款		7, 945, 755. 02	1, 043, 388. 03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		466, 891, 927. 62	276, 554, 415. 91
<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		-	-
应付赎回款		13, 915, 715. 01	2, 261, 568. 58
应付管理人报酬		411, 758. 10	283, 559. 56
应付托管费		68, 626. 35	47, 259. 96
应付销售服务费		57, 846. 83	15, 632. 12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		18, 453. 25	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 9	463, 552. 68	300, 198. 06
负债合计		14, 935, 952. 22	2, 908, 218. 28
<b>净资产：</b>			
实收基金	6. 4. 7. 10	273, 593, 321. 60	192, 542, 163. 54
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	178, 362, 653. 80	81, 104, 034. 09
净资产合计		451, 955, 975. 40	273, 646, 197. 63
负债和净资产总计		466, 891, 927. 62	276, 554, 415. 91

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日， 基金份额总额 273, 593, 321. 60 份， 其中本基金 A 类份额净值人民币 1. 6574 元， 基金份额 152, 929, 187. 17 份； 本基金 C 类份额净值人民币 1. 6448 元， 基金份额 120, 664, 134. 43 份。

## 6. 2 利润表

会计主体： 景顺长城创业板综指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>		57,252,833.51	-27,870,602.14
1. 利息收入		62,051.40	42,321.83
其中：存款利息收入	6.4.7.13	62,051.40	42,321.83
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“-” 号填列）		39,952,909.26	-26,177,054.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	36,225,749.11	-28,091,022.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	43,612.85	-
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	463,552.49	-158,916.55
股利收益	6.4.7.19	3,219,994.81	2,072,884.75
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	16,889,033.12	-1,882,385.50
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	348,839.73	146,515.80
<b>减：二、营业总支出</b>		2,733,109.75	1,675,763.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,074,034.21	1,248,879.61
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	345,672.39	208,146.54
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	221,005.84	35,217.37
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		2,812.24	-

8. 其他费用	6. 4. 7. 23	89, 585. 07	183, 520. 12
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		54, 519, 723. 76	-29, 546, 365. 78
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		54, 519, 723. 76	-29, 546, 365. 78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		54, 519, 723. 76	-29, 546, 365. 78

### 6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城创业板综指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	192, 542, 163. 54	-	81, 104, 034. 09	273, 646, 197. 63
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	192, 542, 163. 54	-	81, 104, 034. 09	273, 646, 197. 63
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	81, 051, 158. 06	-	97, 258, 619. 71	178, 309, 777. 77
(一)、综合收益总额	-	-	54, 519, 723. 76	54, 519, 723. 76
(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)	81, 051, 158. 06	-	42, 738, 895. 95	123, 790, 054. 01
其中：1. 基金申购款	304, 003, 836. 98	-	152, 774, 828. 55	456, 778, 665. 53
2. 基金赎回款	-222, 952, 678. 92	-	-110, 035, 932. 60	-332, 988, 611. 52
(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	273,593,321.60	-	178,362,653.80	451,955,975.40
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日				
项目	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	195,122,390.49	-	43,167,136.97	238,289,527.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	195,122,390.49	-	43,167,136.97	238,289,527.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-11,898,664.72	-	-27,864,564.16	-39,763,228.88
(一)、综合收益总额	-	-	-29,546,365.78	-29,546,365.78
(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)	-11,898,664.72	-	1,681,801.62	-10,216,863.10
其中：1. 基金申购款	78,739,959.70	-	9,343,114.02	88,083,073.72
2. 基金赎回款	-90,638,624.42	-	-7,661,312.40	-98,299,936.82
(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	-	-	-	-

益				
四、本期期末净资产	183, 223, 725. 77	-	15, 302, 572. 81	198, 526, 298. 58

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

景顺长城创业板综指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[2019]1751 号文《关于准予景顺长城创业板综指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《景顺长城创业板综指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 2020 年 5 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 378, 916, 925. 46 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 110, 530. 58 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 379, 027, 456. 04 元，折合 379, 027, 456. 04 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《景顺长城创业板综指增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城创业板综指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建设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 2023 年 8 月 28 日起对景顺长城创业板综指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或注册发行的股票及存托凭证）、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、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、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。

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和股票期权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：创业板综合指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×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	32,739,659.33
等于： 本金	32,736,988.91
加： 应计利息	2,670.42
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	32,739,659.33

### 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	395,373,023.31	-	421,476,043.95	26,103,020.64
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	16,200.00	1.07	16,201.07
	银行间市场	-	-	-
	合计	16,200.00	1.07	16,201.07
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	395,389,223.31	1.07	421,492,245.02	26,103,020.64

### 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	5,965,514.28	-	-	-
其中：股指期货投资	5,965,514.28	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,965,514.28	-	-	-

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
IM2507	IM2507	5.00	6,289,400.00	323,885.72
合计				323,885.72
减：可抵销期货暂收款				323,885.72
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	3,943.94
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	385,224.98
其中：交易所市场	385,224.98
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,383.76
合计	463,552.68

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

## 景顺长城创业板综指增强 A

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	160,670,838.03	160,670,838.03
本期申购	65,695,635.17	65,695,635.17
本期赎回(以“-”号填列)	-73,437,286.03	-73,437,286.03
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	152,929,187.17	152,929,187.17

## 景顺长城创业板综指增强 C

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	31,871,325.51	31,871,325.51
本期申购	238,308,201.81	238,308,201.81
本期赎回(以“-”号填列)	-149,515,392.89	-149,515,392.89
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	120,664,134.43	120,664,134.43

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

## 景顺长城创业板综指增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	83,589,615.24	-15,698,375.84	67,891,239.40
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	83,589,615.24	-15,698,375.84	67,891,239.40
本期利润	25,135,665.68	11,219,970.75	36,355,636.43
本期基金份额交易产生的变动数	-4,505,192.38	808,472.72	-3,696,719.66
其中：基金申购款	39,113,401.52	-6,906,768.48	32,206,633.04
基金赎回款	-43,618,593.90	7,715,241.20	-35,903,352.70
本期已分配利润	-	-	-

本期末	104,220,088.54	-3,669,932.37	100,550,156.17
-----	----------------	---------------	----------------

## 景顺长城创业板综指增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,332,036.23	-3,119,241.54	13,212,794.69
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	16,332,036.23	-3,119,241.54	13,212,794.69
本期利润	12,496,156.99	5,667,930.34	18,164,087.33
本期基金份额交易产生的变动数	51,966,190.32	-5,530,574.71	46,435,615.61
其中：基金申购款	140,738,136.06	-20,169,940.55	120,568,195.51
基金赎回款	-88,771,945.74	14,639,365.84	-74,132,579.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,794,383.54	-2,981,885.91	77,812,497.63

## 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	42,958.00
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	18,633.92
其他	459.48
合计	62,051.40

## 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	36,225,749.11
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	36,225,749.11

## 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	1,286,053,185.39

减：卖出股票成本总额	1, 248, 489, 245. 02
减：交易费用	1, 338, 191. 26
买卖股票差价收入	36, 225, 749. 11

#### 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	39. 96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	43, 572. 89
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	43, 612. 85

##### 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	231, 922. 50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	188, 300. 00
减：应计利息总额	40. 26
减：交易费用	9. 35
买卖债券差价收入	43, 572. 89

#### 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	463,552.49

### 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	3,219,994.81
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	3,219,994.81

### 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	16,490,020.96
股票投资	16,490,020.96
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	408,445.72
权证投资	-
期货投资	408,445.72
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	9,433.56
合计	16,889,033.12

### 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	341,504.98
基金转换费收入	7,334.75

合计	348,839.73
----	------------

#### 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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,948.01
指数使用费	13,253.30
合计	89,585.07

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 0.02% 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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	380,911,844.57	14.20	46,862,096.28	4.95

#### 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	74,283.94	14.20	74,283.94	19.28
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 (%)
长城证券	44,328.35	4.95	44,328.35	10.44

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	2,074,034.21	1,248,879.61

其中：应支付销售机构的客户维护费	838,108.84	496,652.36
应支付基金管理人的净管理费	1,235,925.37	752,227.25

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	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	345,672.39	208,146.54

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 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		
	景顺长城创业板综指 增强 A	景顺长城创业板综指 增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	27,402.97	27,402.97
中国建设银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	27,402.97	27,402.97
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		
	景顺长城创业板综指 增强 A	景顺长城创业板综指 增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	175.55	175.55
中国建设银行	-	-	-

长城证券	-	-	-
合计	-	175.55	175.55

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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}.$$

#### 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
中国建设银行-活期	32,739,659.33	42,958.00	13,838,416.00	26,777.22

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	268	7,370.00	15,058.92	-
301458	钧崴电子	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	-
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	2025	1-6个	新股	-	77.87	52	-	4,049.24	转增

	景光 电	年5月 28日	月(含)	流通 受限						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	187	7,465.04	8,456.14	-
301501	恒鑫生活	2025年6月6日	1-6个月(含)	新股流通受限	-	45.22	84	-	3,798.48	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	泰禾股份	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	-
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	-
6.4.12.1.2 受限证券类别: 债券										
证券	证	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值	备注

代码	券 名 称	认购 日	期	受限 类型	价格	估值 单价	(单 位: 张)	成本总额	总额	
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	162	16,200.00	16,201.07	-

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

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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	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
----------------------	--------	------------	-------------	----------	-------	-----	----

日							
资产							
货币资金	32,739,659.33	-	-	-	-	-	32,739,659.33
结算备付金	3,891,087.39	-	-	-	-	-	3,891,087.39
存出保证金	46,875.74	-	-	-	-	754,728.00	801,603.74
交易性金融资产				-16,201.07	421,476,043.95	421,492,245.02	
应收申购款		-	-	-	-	7,945,755.02	7,945,755.02
应收清算款		-	-	-	-	21,577.12	21,577.12
资产总计	36,677,622.46	-	-	-16,201.07	430,198,104.09	466,891,927.62	
负债							
应付赎回款		-	-	-	-	13,915,715.01	13,915,715.01
应付管理人报酬		-	-	-	-	411,758.10	411,758.10
应付托管费		-	-	-	-	68,626.35	68,626.35
应付销售服务费		-	-	-	-	57,846.83	57,846.83
应交税费		-	-	-	-	18,453.25	18,453.25
其他负债		-	-	-	-	463,552.68	463,552.68
负债总计		-	-	-	-	14,935,952.22	14,935,952.22
利率敏感度缺口	36,677,622.46			-16,201.07		-	-
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	15,996,571.67	-	-	-	-	-	15,996,571.67
结算备付金	1,912,039.36	-	-	-	-	-	1,912,039.36
存出保证金	27,852.32	-	-	-	-	285,878.40	313,730.72
交易性金融资产					-256,461,096.28	256,461,096.28	
应收申购款		-	-	-	-	1,043,388.03	1,043,388.03
应收清算款		-	-	-	-	827,589.85	827,589.85
资产总计	17,936,463.35	-	-	-	-	258,617,952.56	276,554,415.91
负债							
应付赎回款		-	-	-	-	2,261,568.58	2,261,568.58
应付管理人报酬		-	-	-	-	283,559.56	283,559.56
应付托管费		-	-	-	-	47,259.96	47,259.96
应付销售服务费		-	-	-	-	15,632.12	15,632.12
其他负债		-	-	-	-	300,198.06	300,198.06
负债总计		-	-	-	-	2,908,218.28	2,908,218.28
利率敏感度缺口	17,936,463.35	-	-	-	-	-	-

口							
---	--	--	--	--	--	--	--

#### 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	421,476,043.95	93.26	256,461,096.28	93.72
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	421,476,043.95	93.26	256,461,096.28	93.72

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	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）

	动	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%	34,688,305.71	17,825,882.38
	沪深300指数下降5%	-34,688,305.71	-17,825,882.38

#### 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	421,307,154.11	256,294,944.87
第二层次	16,201.07	-
第三层次	168,889.84	166,151.41
合计	421,492,245.02	256,461,096.28

###### 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	421,476,043.95	90.27
	其中：股票	421,476,043.95	90.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,201.07	0.00
	其中：债券	16,201.07	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	36,630,746.72	7.85
8	其他各项资产	8,768,935.88	1.88
9	合计	466,891,927.62	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	6,114,868.00	1.35
B	采矿业	92,460.00	0.02
C	制造业	309,890,140.22	68.57
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	9,035,853.00	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,371,964.55	11.15

J	金融业	11,967,718.58	2.65
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,902,278.90	1.08
M	科学研究和技术服务业	11,500,531.70	2.54
N	水利、环境和公共设施管理业	3,123,055.00	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,536,071.68	0.78
R	文化、体育和娱乐业	8,848,039.00	1.96
S	综合	-	-
	合计	419,382,980.63	92.79

### 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	2,072,188.00	0.46
C	制造业	17,243.32	0.00
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	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,388.00	0.00
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	2,093,063.32	0.46

### 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	300750	宁德时代	139,414	35,162,999.08	7.78
2	300059	东方财富	425,156	9,833,858.28	2.18
3	300124	汇川技术	146,800	9,478,876.00	2.10
4	300760	迈瑞医疗	34,100	7,663,975.00	1.70
5	300274	阳光电源	111,980	7,588,884.60	1.68
6	300308	中际旭创	43,440	6,336,158.40	1.40
7	300433	蓝思科技	259,600	5,789,080.00	1.28
8	300476	胜宏科技	40,900	5,496,142.00	1.22
9	300017	网宿科技	446,500	4,786,480.00	1.06
10	300502	新易盛	35,020	4,448,240.40	0.98
11	300825	阿尔特	343,300	3,711,073.00	0.82
12	300207	欣旺达	181,600	3,642,896.00	0.81
13	300573	兴齐眼药	69,672	3,608,312.88	0.80
14	300232	洲明科技	462,500	3,348,500.00	0.74
15	300231	银信科技	271,800	3,345,858.00	0.74
16	300662	科锐国际	111,700	3,318,607.00	0.73
17	300762	上海瀚讯	141,500	3,202,145.00	0.71
18	300014	亿纬锂能	69,300	3,174,633.00	0.70
19	300267	尔康制药	980,500	3,078,770.00	0.68
20	300498	温氏股份	176,500	3,014,620.00	0.67
21	300365	恒华科技	442,100	2,913,439.00	0.64
22	300627	华测导航	82,899	2,901,465.00	0.64
23	300251	光线传媒	131,300	2,661,451.00	0.59
24	300373	扬杰科技	50,900	2,641,710.00	0.58
25	301080	百普赛斯	36,900	2,639,457.00	0.58
26	300316	晶盛机电	97,200	2,638,980.00	0.58
27	300015	爱尔眼科	207,916	2,594,791.68	0.57
28	300383	光环新网	180,400	2,579,720.00	0.57
29	300748	金力永磁	108,200	2,579,488.00	0.57
30	300857	协创数据	29,900	2,573,194.00	0.57
31	300119	瑞普生物	130,200	2,528,484.00	0.56
32	301031	中熔电气	31,032	2,471,698.80	0.55
33	300035	中科电气	146,300	2,469,544.00	0.55

34	301236	软通动力	43,900	2,398,696.00	0.53
35	300113	顺网科技	120,400	2,379,104.00	0.53
36	300432	富临精工	181,260	2,369,068.20	0.52
37	300002	神州泰岳	200,700	2,368,260.00	0.52
38	300009	安科生物	277,800	2,325,186.00	0.51
39	301004	嘉益股份	35,000	2,318,050.00	0.51
40	300850	新强联	64,300	2,303,226.00	0.51
41	300088	长信科技	384,900	2,294,004.00	0.51
42	300415	伊之密	113,700	2,291,055.00	0.51
43	300677	英科医疗	96,415	2,283,107.20	0.51
44	300735	光弘科技	90,200	2,264,020.00	0.50
45	300185	通裕重工	789,091	2,256,800.26	0.50
46	300134	大富科技	183,700	2,246,651.00	0.50
47	300666	江丰电子	30,300	2,245,230.00	0.50
48	300990	同飞股份	44,900	2,240,510.00	0.50
49	300708	聚灿光电	183,700	2,204,400.00	0.49
50	300048	合康新能	374,500	2,198,315.00	0.49
51	300900	广联航空	90,500	2,196,435.00	0.49
52	300812	易天股份	94,900	2,193,139.00	0.49
53	301526	国际复材	599,300	2,181,452.00	0.48
54	300731	科创新源	72,200	2,178,274.00	0.48
55	300684	中石科技	91,200	2,177,856.00	0.48
56	300182	捷成股份	392,600	2,163,226.00	0.48
57	300027	华谊兄弟	804,300	2,155,524.00	0.48
58	300041	回天新材	228,800	2,155,296.00	0.48
59	300168	万达信息	279,400	2,142,998.00	0.47
60	300779	惠城环保	12,000	2,141,880.00	0.47
61	300590	移为通信	164,600	2,141,446.00	0.47
62	300393	中来股份	371,100	2,137,536.00	0.47
63	300803	指南针	26,455	2,133,860.30	0.47
64	300973	立高食品	43,700	2,131,249.00	0.47
65	300497	富祥药业	236,600	2,127,034.00	0.47
66	300406	九强生物	150,000	2,122,500.00	0.47
67	300079	数码视讯	362,300	2,119,455.00	0.47
68	300303	聚飞光电	333,800	2,116,292.00	0.47
69	300562	乐心医疗	143,400	2,115,150.00	0.47
70	300219	鸿利智汇	313,500	2,106,720.00	0.47
71	300743	天地数码	104,700	2,096,094.00	0.46
72	300369	绿盟科技	269,600	2,094,792.00	0.46
73	300162	雷曼光电	275,600	2,094,560.00	0.46
74	301318	维海德	61,600	2,084,544.00	0.46
75	300026	红日药业	564,600	2,083,374.00	0.46
76	300845	捷安高科	186,320	2,083,057.60	0.46

77	301248	杰创智能	83,600	2,079,968.00	0.46
78	300154	瑞凌股份	230,900	2,078,100.00	0.46
79	300510	金冠股份	452,600	2,072,908.00	0.46
80	301356	天振股份	116,480	2,072,179.20	0.46
81	300319	麦捷科技	192,600	2,068,524.00	0.46
82	300138	晨光生物	170,400	2,065,248.00	0.46
83	301029	怡合达	89,500	2,045,970.00	0.45
84	300967	晓鸣股份	110,500	2,044,250.00	0.45
85	300266	兴源环境	696,500	2,033,780.00	0.45
86	300091	金通灵	677,800	2,026,622.00	0.45
87	300296	利亚德	331,900	2,024,590.00	0.45
88	301265	华新环保	196,900	2,008,380.00	0.44
89	300158	振东制药	455,600	2,004,640.00	0.44
90	300777	中简科技	55,000	1,993,750.00	0.44
91	300363	博腾股份	116,400	1,988,112.00	0.44
92	300115	长盈精密	91,400	1,955,960.00	0.43
93	300979	华利集团	37,100	1,950,347.00	0.43
94	300181	佐力药业	112,000	1,940,960.00	0.43
95	301062	上海艾录	221,100	1,910,304.00	0.42
96	300183	东软载波	113,500	1,907,935.00	0.42
97	300926	博俊科技	71,200	1,884,664.00	0.42
98	300705	九典制药	120,400	1,874,628.00	0.41
99	301396	宏景科技	30,140	1,871,995.40	0.41
100	300416	苏试试验	130,100	1,864,333.00	0.41
101	301095	广立微	33,100	1,861,544.00	0.41
102	300470	中密控股	49,200	1,809,084.00	0.40
103	300893	松原安全	73,600	1,804,672.00	0.40
104	300458	全志科技	45,350	1,799,941.50	0.40
105	300236	上海新阳	46,000	1,784,800.00	0.39
106	301107	瑜欣电子	59,900	1,782,025.00	0.39
107	300080	易成新能	425,700	1,779,426.00	0.39
108	300475	香农芯创	49,800	1,774,374.00	0.39
109	300639	凯普生物	299,200	1,735,360.00	0.38
110	301510	固高科技	57,500	1,727,875.00	0.38
111	301060	兰卫医学	177,800	1,715,770.00	0.38
112	300261	雅本化学	238,900	1,708,135.00	0.38
113	300140	节能环保	270,000	1,665,900.00	0.37
114	300655	晶瑞电材	166,400	1,665,664.00	0.37
115	300738	奥飞数据	79,500	1,663,935.00	0.37
116	300199	翰宇药业	97,600	1,615,280.00	0.36
117	300674	宇信科技	50,700	1,535,703.00	0.34
118	300105	龙源技术	192,500	1,484,175.00	0.33
119	300871	回盛生物	70,700	1,477,630.00	0.33

120	300592	华凯易佰	130,400	1,467,000.00	0.32
121	300888	稳健医疗	34,800	1,430,280.00	0.32
122	300740	水羊股份	81,600	1,366,800.00	0.30
123	300919	中伟股份	41,280	1,357,286.40	0.30
124	301128	强瑞技术	26,200	1,331,484.00	0.29
125	301052	果麦文化	32,600	1,330,080.00	0.29
126	300879	大叶股份	33,500	1,315,880.00	0.29
127	300305	裕兴股份	204,100	1,302,158.00	0.29
128	301380	挖金客	35,415	1,299,022.20	0.29
129	300217	东方电热	245,900	1,295,893.00	0.29
130	300443	金雷股份	57,300	1,294,980.00	0.29
131	300101	振芯科技	57,200	1,294,436.00	0.29
132	301330	熵基科技	47,740	1,290,412.20	0.29
133	301078	孩子王	97,400	1,273,018.00	0.28
134	300702	天宇股份	54,600	1,269,996.00	0.28
135	300988	津荣天宇	59,200	1,262,736.00	0.28
136	301338	凯格精机	26,200	1,250,002.00	0.28
137	300866	安克创新	10,810	1,228,016.00	0.27
138	301558	三态股份	134,700	1,213,647.00	0.27
139	300212	易华录	55,000	1,196,800.00	0.26
140	300024	机器人	69,600	1,195,728.00	0.26
141	301230	泓博医药	34,500	1,187,490.00	0.26
142	301058	中粮科工	106,000	1,162,820.00	0.26
143	300129	泰胜风能	158,600	1,127,646.00	0.25
144	300355	蒙草生态	256,300	1,089,275.00	0.24
145	300757	罗博特科	7,100	1,064,787.00	0.24
146	300703	创源股份	50,300	1,064,348.00	0.24
147	300761	立华股份	56,200	1,055,998.00	0.23
148	300229	拓尔思	57,100	1,052,924.00	0.23
149	300596	利安隆	35,700	1,027,089.00	0.23
150	300049	福瑞股份	31,500	1,021,545.00	0.23
151	300019	硅宝科技	50,300	992,922.00	0.22
152	301103	何氏眼科	42,400	941,280.00	0.21
153	301221	光庭信息	18,000	935,460.00	0.21
154	300922	天秦装备	32,700	913,638.00	0.20
155	300647	超频三	136,300	881,861.00	0.20
156	300453	三鑫医疗	104,600	842,030.00	0.19
157	300616	尚品宅配	63,600	837,612.00	0.19
158	300083	创世纪	101,300	832,686.00	0.18
159	300996	普联软件	54,520	819,435.60	0.18
160	300222	科大智能	80,200	817,238.00	0.18
161	301302	华如科技	29,500	811,545.00	0.18
162	300132	青松股份	135,600	810,888.00	0.18

163	300796	贝斯美	76,800	791,808.00	0.18
164	301102	兆讯传媒	71,200	777,504.00	0.17
165	300223	北京君正	11,200	775,040.00	0.17
166	301220	亚香股份	17,200	772,280.00	0.17
167	301216	万凯新材	60,500	754,435.00	0.17
168	300226	上海钢联	31,800	726,312.00	0.16
169	300755	华致酒行	37,600	725,680.00	0.16
170	300450	先导智能	29,100	723,135.00	0.16
171	300724	捷佳伟创	13,300	722,190.00	0.16
172	302132	中航成飞	7,900	694,726.00	0.15
173	300533	冰川网络	20,700	691,587.00	0.15
174	301090	华润材料	90,300	679,959.00	0.15
175	300054	鼎龙股份	23,700	679,716.00	0.15
176	301171	易点天下	25,400	678,942.00	0.15
177	300447	全信股份	42,800	670,676.00	0.15
178	300320	海达股份	65,900	655,046.00	0.14
179	300520	科大国创	26,200	649,760.00	0.14
180	300418	昆仑万维	17,400	585,162.00	0.13
181	300699	光威复材	18,400	582,728.00	0.13
182	300065	海兰信	32,300	578,170.00	0.13
183	300790	宇瞳光学	26,300	549,933.00	0.12
184	300559	佳发教育	45,600	538,080.00	0.12
185	300693	盛弘股份	17,500	524,300.00	0.12
186	300918	南山智尚	27,000	519,210.00	0.11
187	300945	曼卡龙	23,200	514,808.00	0.11
188	300685	艾德生物	23,200	499,496.00	0.11
189	300525	博思软件	34,000	495,040.00	0.11
190	301367	瑞迈特	5,680	477,688.00	0.11
191	300869	康泰医学	32,600	467,484.00	0.10
192	301369	联动科技	8,700	467,277.00	0.10
193	300285	国瓷材料	26,700	463,245.00	0.10
194	300360	炬华科技	29,000	456,750.00	0.10
195	300339	润和软件	8,900	452,387.00	0.10
196	300395	菲利华	8,800	449,680.00	0.10
197	300384	三联虹普	25,200	443,268.00	0.10
198	300454	深信服	4,500	423,810.00	0.09
199	300031	宝通科技	15,600	390,468.00	0.09
200	300644	南京聚隆	14,200	379,282.00	0.08
201	301178	天亿马	8,100	378,270.00	0.08
202	300442	润泽科技	7,500	371,475.00	0.08
203	300788	中信出版	11,300	362,504.00	0.08
204	300203	聚光科技	16,300	360,719.00	0.08
205	300184	力源信息	35,800	351,556.00	0.08

206	300547	川环科技	11,500	347,530.00	0.08
207	300257	开山股份	33,600	338,352.00	0.07
208	300331	苏大维格	14,200	321,346.00	0.07
209	300456	赛微电子	18,200	312,858.00	0.07
210	300179	四方达	29,300	299,153.00	0.07
211	300567	精测电子	4,400	266,684.00	0.06
212	300570	太辰光	2,500	240,950.00	0.05
213	300732	设研院	32,600	235,372.00	0.05
214	300452	山河药辅	15,100	185,277.00	0.04
215	300264	佳创视讯	27,400	174,812.00	0.04
216	300188	国投智能	12,500	172,500.00	0.04
217	300228	富瑞特装	21,400	166,706.00	0.04
218	300298	三诺生物	6,700	151,353.00	0.03
219	300496	中科创达	2,300	131,606.00	0.03
220	300820	英杰电气	2,800	128,380.00	0.03
221	300146	汤臣倍健	10,300	115,772.00	0.03
222	301327	华宝新能	2,116	108,677.76	0.02
223	300577	开润股份	5,100	104,499.00	0.02
224	300661	圣邦股份	1,330	96,784.10	0.02
225	300759	康龙化成	3,800	93,252.00	0.02
226	300148	天舟文化	18,400	93,104.00	0.02
227	300139	晓程科技	4,600	92,460.00	0.02
228	300474	景嘉微	1,200	87,600.00	0.02
229	300085	银之杰	1,900	83,714.00	0.02
230	300346	南大光电	2,640	83,529.60	0.02
231	300364	中文在线	3,100	82,150.00	0.02
232	300170	汉得信息	4,700	80,887.00	0.02
233	300928	华安鑫创	2,400	80,280.00	0.02
234	301308	江波龙	900	78,741.00	0.02
235	300409	道氏技术	4,600	77,924.00	0.02
236	300741	华宝股份	4,100	77,449.00	0.02
237	300999	金龙鱼	2,600	76,778.00	0.02
238	300598	诚迈科技	1,800	76,590.00	0.02
239	301039	中集车辆	9,400	76,422.00	0.02
240	300620	光库科技	1,600	75,376.00	0.02
241	300286	安科瑞	3,300	74,481.00	0.02
242	300633	开立医疗	2,500	74,300.00	0.02
243	300624	万兴科技	1,195	74,149.75	0.02
244	300791	仙乐健康	3,100	73,811.00	0.02
245	301316	慧博云通	1,700	73,236.00	0.02
246	300925	法本信息	2,900	73,022.00	0.02
247	300403	汉字集团	4,800	72,912.00	0.02
248	300769	德方纳米	2,200	72,644.00	0.02

249	300358	楚天科技	9,300	72,540.00	0.02
250	300206	理邦仪器	6,000	72,120.00	0.02
251	300057	万顺新材	13,100	71,395.00	0.02
252	300706	阿石创	3,100	71,300.00	0.02
253	300659	中孚信息	4,900	71,246.00	0.02
254	300787	海能实业	5,124	70,967.40	0.02
255	300707	威唐工业	5,100	70,431.00	0.02
256	300785	值得买	2,200	70,026.00	0.02
257	300700	岱勒新材	6,200	69,812.00	0.02
258	300986	志特新材	5,520	69,552.00	0.02
259	300558	贝达药业	1,100	63,745.00	0.01
260	300556	丝路视觉	2,800	55,636.00	0.01
261	300976	达瑞电子	1,060	52,777.40	0.01
262	300058	蓝色光标	7,940	52,086.40	0.01
263	300446	航天智造	3,000	51,960.00	0.01
264	300643	万通智控	2,400	51,312.00	0.01
265	300618	寒锐钴业	1,400	50,008.00	0.01
266	300160	秀强股份	8,800	49,456.00	0.01
267	300648	星云股份	1,400	48,384.00	0.01
268	300439	美康生物	4,600	48,254.00	0.01
269	300284	苏交科	5,300	48,230.00	0.01
270	300957	贝泰妮	1,000	44,220.00	0.01
271	300323	华灿光电	5,700	43,605.00	0.01
272	300548	长芯博创	500	33,385.00	0.01
273	300378	鼎捷数智	900	32,940.00	0.01
274	300766	每日互动	900	31,446.00	0.01
275	300077	国民技术	1,200	30,720.00	0.01
276	300438	鹏辉能源	1,100	30,371.00	0.01
277	300095	华伍股份	2,900	30,044.00	0.01
278	300607	拓斯达	878	29,931.02	0.01
279	301063	海锅股份	1,000	29,780.00	0.01
280	300037	新宙邦	800	28,160.00	0.01
281	300795	米奥会展	1,870	27,769.50	0.01
282	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.01
283	300012	华测检测	2,000	23,380.00	0.01
284	300903	科翔股份	1,900	22,059.00	0.00
285	300566	激智科技	1,100	21,439.00	0.00
286	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
287	301275	汉朔科技	268	15,058.92	0.00
288	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
289	301501	恒鑫生活	271	12,254.62	0.00
290	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
291	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00

292	300328	宜安科技	900	10,413.00	0.00
293	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
294	300255	常山药业	200	9,322.00	0.00
295	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
296	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
297	300782	卓胜微	100	7,137.00	0.00
298	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
299	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
300	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
301	300580	贝斯特	200	4,914.00	0.00
302	300842	帝科股份	100	4,383.00	0.00
303	300408	三环集团	100	3,340.00	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	600547	山东黄金	30,900	986,637.00	0.22
2	002155	湖南黄金	36,160	645,456.00	0.14
3	600489	中金黄金	17,300	253,099.00	0.06
4	000975	山金国际	4,300	81,442.00	0.02
5	001337	四川黄金	2,200	53,306.00	0.01
6	600988	赤峰黄金	2,100	52,248.00	0.01
7	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
8	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
9	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
10	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
11	600641	万业企业	100	1,388.00	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	300750	宁德时代	18,079,159.50	6.61
2	300124	汇川技术	13,349,798.00	4.88
3	300476	胜宏科技	13,150,831.00	4.81
4	300308	中际旭创	10,710,971.00	3.91
5	300433	蓝思科技	9,311,428.00	3.40
6	300274	阳光电源	8,570,386.55	3.13
7	300760	迈瑞医疗	8,531,799.00	3.12
8	300251	光线传媒	8,489,860.00	3.10
9	300502	新易盛	8,004,321.00	2.93
10	300048	合康新能	7,932,644.00	2.90
11	300979	华利集团	7,538,021.00	2.75

12	300643	万通智控	7,255,394.00	2.65
13	300232	洲明科技	7,173,290.00	2.62
14	300442	润泽科技	6,796,299.00	2.48
15	300850	新强联	6,614,731.40	2.42
16	300316	晶盛机电	6,548,817.00	2.39
17	300779	惠城环保	6,524,271.00	2.38
18	300033	同花顺	6,461,838.00	2.36
19	300015	爱尔眼科	6,383,806.35	2.33
20	300866	安克创新	6,314,187.40	2.31
21	300328	宜安科技	6,298,628.00	2.30
22	300857	协创数据	6,182,615.80	2.26
23	300115	长盈精密	6,166,204.54	2.25
24	300027	华谊兄弟	6,084,278.00	2.22
25	301004	嘉益股份	6,072,630.20	2.22
26	300845	捷安高科	6,033,237.50	2.20
27	300113	顺网科技	5,957,123.00	2.18
28	300498	温氏股份	5,945,073.80	2.17
29	300014	亿纬锂能	5,884,141.00	2.15
30	300123	亚光科技	5,866,578.00	2.14
31	300017	网宿科技	5,826,418.00	2.13
32	300454	深信服	5,777,801.00	2.11
33	300570	太辰光	5,770,522.00	2.11
34	300002	神州泰岳	5,758,236.00	2.10
35	300382	斯莱克	5,756,450.00	2.10
36	300573	兴齐眼药	5,715,530.80	2.09
37	300101	振芯科技	5,628,635.00	2.06
38	300267	尔康制药	5,564,415.00	2.03
39	300162	雷曼光电	5,558,065.00	2.03
40	300762	上海瀚讯	5,532,399.00	2.02
41	300745	欣锐科技	5,484,811.00	2.00

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交量），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	300476	胜宏科技	12,286,613.00	4.49
2	300308	中际旭创	9,651,505.30	3.53
3	300750	宁德时代	8,598,286.80	3.14
4	300643	万通智控	8,328,143.00	3.04
5	300251	光线传媒	7,747,511.00	2.83
6	300124	汇川技术	7,727,332.00	2.82
7	300866	安克创新	7,696,856.00	2.81
8	300328	宜安科技	7,250,611.00	2.65

9	300033	同花顺	7,232,394.00	2.64
10	300760	迈瑞医疗	7,164,727.00	2.62
11	300048	合康新能	6,775,179.00	2.48
12	300502	新易盛	6,726,465.80	2.46
13	300433	蓝思科技	6,565,896.00	2.40
14	300570	太辰光	6,545,385.00	2.39
15	300123	亚光科技	6,506,882.60	2.38
16	300442	润泽科技	6,245,410.00	2.28
17	300015	爱尔眼科	6,134,716.00	2.24
18	300979	华利集团	6,117,399.00	2.24
19	300745	欣锐科技	6,054,368.00	2.21
20	300850	新强联	5,768,566.09	2.11
21	300454	深信服	5,760,732.00	2.11
22	300648	星云股份	5,695,366.00	2.08
23	300610	晨化股份	5,674,305.00	2.07
24	300765	新诺威	5,651,820.60	2.07
25	300986	志特新材	5,644,128.00	2.06
26	301078	孩子王	5,616,426.00	2.05
27	300587	天铁科技	5,527,671.00	2.02
28	300700	岱勒新材	5,487,069.00	2.01

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交量），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	1,397,014,171.73
卖出股票收入（成交）总额	1,286,053,185.39

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）	16,201.07	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,201.07	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	162	16,201.07	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。

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	801,603.74

2	应收清算款	21,577.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,945,755.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,768,935.88

#### 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(%)
景顺长城创业板综指增强 A	17,162	8,910.92	1,696,114.46	1.11	151,233,072.71	98.89
景顺长城创业板综指增强 C	8,477	14,234.30	29,754,320.65	24.66	90,909,813.78	75.34
合计	25,639	10,670.98	31,450,435.11	11.50	242,142,886.49	88.50

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	景顺长城创业板综指增强 A	89,550.25	0.058557
	景顺长城创业板综指增强 C	191.28	0.000159
	合计	89,741.53	0.032801

## 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

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

项目	景顺长城创业板综指增强 A	景顺长城创业板综指增强 C
基金合同生效日 (2020 年 5 月 25 日)	379,027,456.04	-
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	160,670,838.03	31,871,325.51
本报告期基金总申购份额	65,695,635.17	238,308,201.81
减：本报告期基金总赎回份额	73,437,286.03	149,515,392.89
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	152,929,187.17	120,664,134.43

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：

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。

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：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

### 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 (%)	
国信证券 股份有限 公司	2	1,745,207,099.64	65.06	340,333.66	65.06	未变 更
长城证券 股份有限 公司	2	380,911,844.57	14.20	74,283.94	14.20	未变 更
中信建投 证券股份 有限公司	1	332,438,002.38	12.39	64,833.79	12.39	未变 更
东方财富 证券股份 有限公司	2	178,324,144.39	6.65	34,774.39	6.65	未变 更
中国国际 金融股份 有限公司	1	45,439,944.00	1.69	8,861.76	1.69	未变 更
中信证券 股份有限 公司	4	12,122.00	0.00	2.37	0.00	未变 更
渤海证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
长江证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
东北证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
东方证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
方正证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
光大证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	未变 更
广发证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
国联民生	1	-	-	-	-	未变

证券股份有限公司						更
国泰海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
华源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增2个
汇丰前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
摩根大通证券(中国)有限公司	1	-	-	-	-	本期报告新增1个
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
湘财证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
浙商证券	2	-	-	-	-	未变

股份有限公司						更
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	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(%)
国信证券股份有限公司	61,069.16	26.33	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	170,853.34	73.67	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

长江证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国联民生 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华金证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华源证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
摩根大通证券(中国)有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## 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	景顺长城创业板综指增强型证券投资基 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	关于景顺长城创业板综指增强型证券投资基新增五矿证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 17 日

8	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销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025年2月21日
9	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
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	景顺长城创业板综指增强型证券投资基金管理合同（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2025年3月19日
13	景顺长城创业板综指增强型证券投资基金管理托管协议（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2025年3月19日
14	景顺长城创业板综指增强型证券投资基金管理 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
15	景顺长城创业板综指增强型证券投资基金管理产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2025年3月21日
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	景顺长城创业板综指增强型证券投资基金管理 2024 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025年3月28日
18	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
19	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
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	景顺长城创业板综指增强型证券投资基金管理 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	中国证监会指定报刊及	2025年5月20日

	东方 APP 进行非法活动的澄清公告	网站	
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
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下 部分基金新增华宝证券为销售机构的 公告	中国证监会指定报刊及 网站	2025 年 6 月 19 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

无。

### 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创业板综指增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城创业板综指增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城创业板综指增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城创业板综指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