

长城中证 500 指数增强型 证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：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：2019 年 8 月 27 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 08 月 23 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 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

为了更好地为投资者提供理财服务，经与本基金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，本基金管理人自 2019 年 5 月 9 日起为本基金增设 C 类基金份额。同时，本基金管理人对基金合同进行了相应的修改，修改的具体内容详见本管理人于 2019 年 5 月 9 日发布的《关于长城中证 500 指数增强型证券投资基金增设 C 类基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	61
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.....	62
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.....	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	63
§8 基金份额持有人信息.....	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	66
§9 开放式基金份额变动.....	67
§10 重大事件揭示.....	68
10.1 基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	68
10.4 基金投资策略的改变.....	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	68
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.....	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	68
10.8 其他重大事件.....	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	75

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	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
§12 备查文件目录.....	77
12.1 备查文件目录.....	77
12.2 存放地点.....	77
12.3 查阅方式.....	77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	长城中证 500 指数增强	
基金主代码	006048	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 8 月 13 日	
基金管理人	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	86,341,877.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码:	006048	007413
报告期末下属分级基金的份额总额	85,135,113.84 份	1,206,763.63 份

注：本基金自 2019 年 5 月 9 日起增设 C 类基金份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数，分享中国经济的长期增长，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金为增强型指数基金，股票投资以中证 500 指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对稳定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

注：本基金自 2019 年 5 月 9 日起增设 C 类基金份额。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长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	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096

传真	0755-23982328	010-66275853
注册地址	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	518026	100033
法定代表人	王军	田国立

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 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

基金级别	长城中证 500 指数增强 A	长城中证 500 指数增强 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,186,955.90	2,011.57
本期利润	3,109,381.91	26,394.85
加权平均基金份额本期利润	0.0923	0.0586
本期加权平均净值利润率	9.75%	6.19%
本期基金份额净值增长率	22.23%	2.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-20,350,716.46	-61,583.27
期末可供分配基金份额利润	-0.2390	-0.0510
期末基金资产净值	82,574,264.51	1,169,533.08
期末基金份额净值	0.9699	0.9691
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-2.80%	2.99%

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

②上述基金业绩指标不包括持有人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“期末可供分配利润”的计算方法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。

④本基金自 2019 年 5 月 9 日起增设 C 类基金份额。

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

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

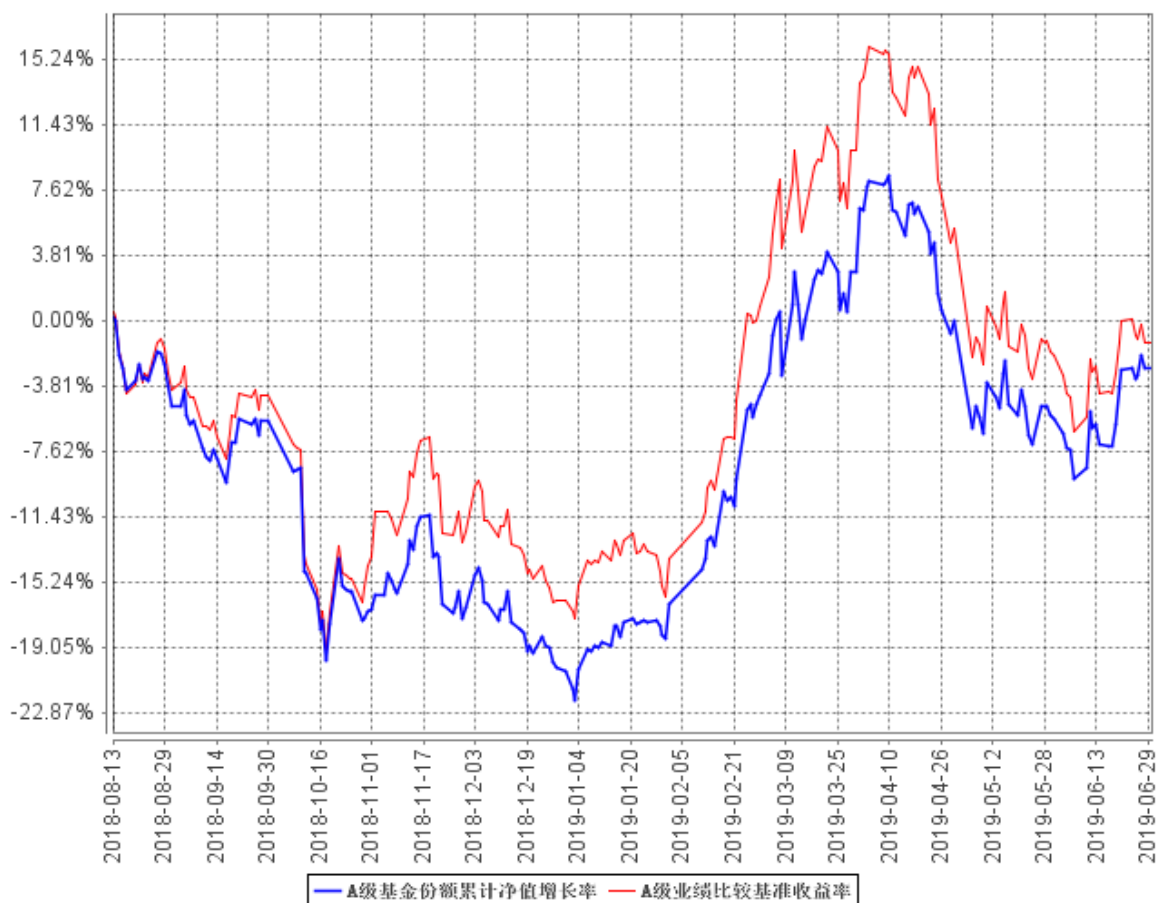
过去一个月	3.10%	1.27%	0.75%	1.32%	2.35%	-0.05%
过去三个月	-5.49%	1.58%	-10.21%	1.72%	4.72%	-0.14%
过去六个月	22.23%	1.55%	17.87%	1.70%	4.36%	-0.15%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	-2.80%	1.50%	-1.35%	1.63%	-1.45%	-0.13%

长城中证 500 指数增强 C

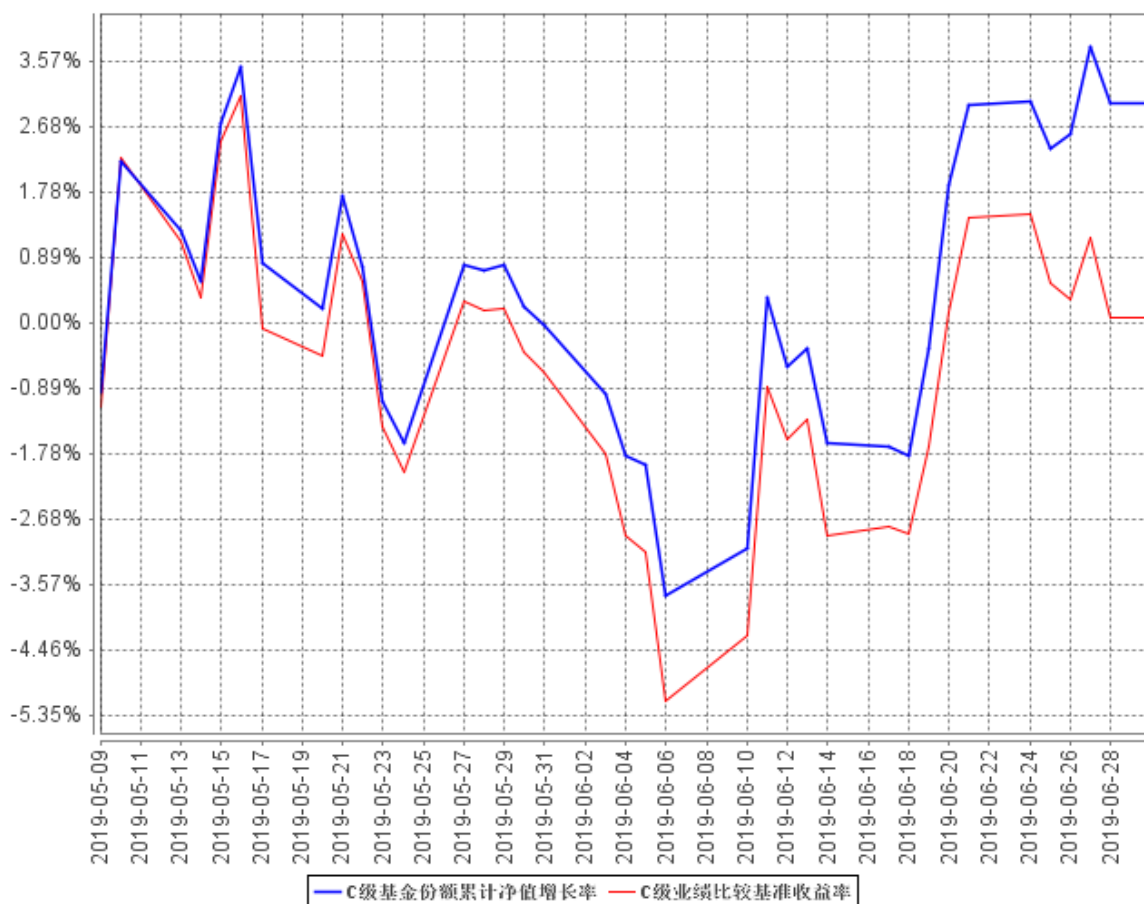
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	3.01%	1.27%	0.75%	1.32%	2.26%	-0.05%
过去三个月	2.99%	1.38%	0.07%	1.45%	2.92%	-0.07%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
今年以来	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	2.99%	1.38%	0.07%	1.45%	2.92%	-0.07%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①本基金合同规定基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产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后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

②本基金的建仓期为自基金转型之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

③本基金转型日期为 2018 年 8 月 13 日，截止本报告期末，基金转型未满一年。

④本基金自 2019 年 5 月 9 日起增设 C 类基金份额。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司管理的基金有：长城品牌优选混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)、长城安心回报混合型证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎保本混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城久信债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城收益宝货币市场基

金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
雷俊	量化与指数投资部总经理，长城中证 500 指数增强型、长城久泰沪深 300 指数、长城创业板指数、长城核心优选混合、长城量化精选股票的基金经理	2018 年 11 月 30 日	-	11 年	北京大学理学学士、工学硕士。曾就职于南方基金管理有限公司，2017 年 11 月进入长城基金管理有限公司，现任量化与指数投资部总经理。
王卫林	长城久泰沪深 300 指数和长城中证 500 指数增强基金的基金经理助理	2018 年 8 月 13 日	-	3 年	男，华中科技大学船舶与海洋工程学士、北京大学金融信息工程硕士。曾就职于南方基金管理有限公司。2018 年 1 月进入长城基金管理有限公司，曾任量化研究员、“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”的基金经理助理。

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《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，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金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% 的现象。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股波动较去年明显放大，在一季度单边上涨后二季度开始调整，A 股市场窄幅震荡；但市场关注点聚焦上市公司基本面，好公司涨幅较大；报告期内基金超额收益表现突出，量化模型表现符合预期。

报告期内，本基金已开始相关股指期货投资运作，根据股指期货的升贴水情况，采用部分股指期货替代现货策略，追求确定性的超额收益，优化流动性管理，提高资金使用效率。

本基金基于长城基金量化投资研究平台的研究成果，采用量化多因子模型，基于上市公司的历史数据，借助数量化的技术手段，寻找对股票收益有预测性的指标作为因子；在组合层面上，根据基准指数的特点严格控制行业偏离以及个股偏离，并在综合考虑预期风险和收益水平基础上进行组合权重优化，力争有效跟踪基准指数的同时获取超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率 A 级为 22.23%、同期业绩比较基准为 17.87%，C 级为 2.99%，同期业绩比较基准为 0.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一方面由于中美贸易摩擦的长期性，下半年的经济走势也有很大的不确定性，未来短期一段时间继续震荡的可能性更大，上涨和下跌的空间都比较有限，基本面优质的个股有结构性的机会；另一方面，随着逐渐与国际市场接轨，增量的海外资金配置需求增大，从更长的周期看，A 股的长期投资价值凸现，中长期有很大的投资机会。

本基金在投资运作时将继续坚持量化指数增强投资风格，力争在保持较低跟踪误差的同时获取更大的超额回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的从业经验，具有良好的专业能力，并能相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员，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，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金自 2019 年 01 月 28 日起至 2019 年 04 月 08 日止连续 45 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元，自 2019 年 04 月 18 日起至 2019 年 06 月 20 日止连续 42 个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,410,427.77	995,674.59
结算备付金		833,827.04	76,212.72
存出保证金		762,522.18	10,547.02
交易性金融资产	6.4.7.2	74,232,310.07	14,045,692.97
其中：股票投资		74,232,310.07	14,045,692.97
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,147.82	254.10
应收股利		-	-
应收申购款		3,867,483.38	17,078.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		87,108,718.26	15,145,460.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,158,968.79	-
应付赎回款		6,557.40	1,344.25
应付管理人报酬		37,957.19	12,997.42
应付托管费		5,693.59	1,949.61
应付销售服务费		173.90	-
应付交易费用	6.4.7.7	40,683.28	29,988.06

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	114,886.52	238,493.86
负债合计		3,364,920.67	284,773.20
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	71,558,010.50	15,475,892.60
未分配利润	6.4.7.10	12,185,787.09	-615,205.68
所有者权益合计		83,743,797.59	14,860,686.92
负债和所有者权益总计		87,108,718.26	15,145,460.12

注：（1）报告截止日 2019 年 06 月 30 日，A 类份额单位净值为 0.9699 元，A 类份额总额为 85,135,113.84 份，C 类份额单位净值为 0.9691 元，C 类份额总额为 1,206,763.63 份。

（2）本基金基金合同于 2018 年 8 月 13 日生效。

6.2 利润表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		3,616,781.05
1.利息收入		26,050.58
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18,351.63
债券利息收入		1.76
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		7,697.19
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,266,113.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,820,714.19
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	4.44
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-29,359.81
股利收益	6.4.7.16	474,754.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	946,809.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-

列)		
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	377,807.71
减：二、费用		481,004.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	156,446.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	23,466.99
3. 销售服务费		182.12
4. 交易费用	6.4.7.19	184,149.36
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		218.38
7. 其他费用	6.4.7.20	116,540.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,135,776.76
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,135,776.76

本基金合同于 2018 年 8 月 13 日（基金合同生效日）生效，因此，无上年度可比期间财务数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	15,475,892.60	-615,205.68	14,860,686.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,135,776.76	3,135,776.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	56,082,117.90	9,665,216.01	65,747,333.91
其中：1.基金申购款	123,056,505.71	17,071,765.32	140,128,271.03
2.基金赎回款	-66,974,387.81	-7,406,549.31	-74,380,937.12

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	71,558,010.50	12,185,787.09	83,743,797.59

注：本基金合同于 2018 年 8 月 13 日（基金合同生效日）生效，因此，无上年度可比期间财务数据。

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：

_____ 王军	_____ 熊科金	_____ 赵永强
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

长城中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），是根据中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）2018 年 5 月 15 日证监许可[2018]820 号文“关于准予长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金变更注册的批复”及原长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金（以下简称“久兆中小板基金”）基金份额持有人大会 2018 年 7 月 5 日决议通过的《关于长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，由原久兆中小板基金转型而来。原久兆中小板基金为契约型开放式基金，于深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易上市，存续期限不定，首次募集规模为 965,942,785.13 份基金份额。根据深交所深证上[2018]346 号《终止上市通知书》，自 2018 年 8 月 6 日起，久兆中小板基金之中小 300A 份额、中小 300B 份额终止上市。根据久兆中小板基金基金份额持有人大会的授权，管理人自 2018 年 8 月 6 日至 2018 年 8 月 13 日对久兆中小板基金实施转型与基金份额转换。基金份额转换于 2018 年 8 月 13 日完成，久兆中小板基金正式转型成为“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”，原《长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金基金合同》终止，《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

久兆中小板基金之中小 300A 份额、中小 300B 份额终止上市后，基金管理人于 2018 年 8 月 6 日(份额转换起始日)将中小 300A 份额与中小 300B 份额转换为久兆 300 份额的场内份额；于 2018 年 8 月 13 日(份额转换基准日)将久兆 300 份额的场内份额、久兆 300 份额的场外份额转换为份额净值为 1.0000 元的本基金基金份额。基金份额转换后，本基金份额数保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位截位，由此产生的计算误差归入基金财产。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、权证、股指期货及法律法规或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相关规定)。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产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后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2019 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券(股票)交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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，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，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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	7,410,427.77
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	7,410,427.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	74,193,141.58	74,232,310.07	39,168.49
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	74,193,141.58	74,232,310.07	39,168.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 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	4,913,060.00	-	-	
-股指期货	4,913,060.00			
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，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。

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

注：本基金本期末各项买入返售金融资产余额均为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,834.14
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	301.68
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	12.00
合计	2,147.82

注：其他为应收交易所结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	40,683.28
银行间市场应付交易费用	-
合计	40,683.28

注：应付交易所市场交易费用均为应付佣金。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10.13
预提费用	14,876.39
应付指数使用费	100,000.00
合计	114,886.52

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长城中证 500 指数增强 A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,728,350.38	15,475,892.60
本期申购	147,349,119.02	121,762,179.35
本期赎回(以“-”号填列)	-80,942,355.56	-66,886,825.08
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	85,135,113.84	70,351,246.87

金额单位：人民币元

长城中证 500 指数增强 C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	1,294,326.36	1,294,326.36
本期赎回(以“-”号填列)	-87,562.73	-87,562.73
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,206,763.63	1,206,763.63

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

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	-6,392,084.86	5,776,879.18	-615,205.68
本期利润	2,186,955.90	922,426.01	3,109,381.91
本期基金份额交易产生的变动数	-16,145,587.50	25,874,428.91	9,728,841.41
其中：基金申购款	-40,487,578.32	57,625,895.74	17,138,317.42
基金赎回款	24,341,990.82	-31,751,466.83	-7,409,476.01

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-20,350,716.46	32,573,734.10	12,223,017.64

单位：人民币元

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	-	-	-
本期利润	2,011.57	24,383.28	26,394.85
本期基金份额交易产生的变动数	-63,594.84	-30.56	-63,625.40
其中：基金申购款	-68,051.38	1,499.28	-66,552.10
基金赎回款	4,456.54	-1,529.84	2,926.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-61,583.27	24,352.72	-37,230.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,248.44
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	2,984.75
其他	118.44
合计	18,351.63

注：其他为申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	100,899,284.37
减：卖出股票成本总额	99,078,570.18
买卖股票差价收入	1,820,714.19

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	13,006.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	13,000.00
减：应收利息总额	1.76
买卖债券差价收入	4.44

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益/损失。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019年1月1日至2019年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	-29,359.81

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	474,754.65
基金投资产生的股利收益	-
合计	474,754.65

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	953,469.29
——股票投资	953,469.29

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-6,660.00
——权证投资	-
3. 其他	-
减： 应税金融商品公允价值变动产生的预 估增值税	-
合计	946,809.29

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	348,395.53
转出基金补偿收入 A006048	29,412.18
合计	377,807.71

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	184,149.36
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	184,149.36

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	14,876.39

信息披露费	-
银行费用	1,664.31
指数使用费	100,000.00
合计	116,540.70

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金财务报表批准日，本基金无需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

本基金本报告期无与对本基金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。

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
长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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”）	基金管理人股东、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人股东

注：以下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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	258,840,003.08	100.00%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	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 成交总额的比例
长城证券	13,006.20	100.00%	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
长城证券	21,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	59,869.47	100.00%	40,683.28	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和证券交易所买（卖）证管费等）。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	156,446.74
其中：支付销售机构的客户维护费	43,383.80

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	23,466.99

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金关联方于本期未获得销售服务费。本基金于 2019 年 5 月 9 日起增设 C 类份额，无上年度可比期间数据。

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

注：本基金于本期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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本期未运用固有资金投资于本基金份额，于期末亦未持有本基金份额。本基金基金合同于 2018 年 8 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于期末未持有本基金份额。本基金基金合同于 2018 年 8 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	7,410,427.77	15,248.44

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。本基金基金合同于 2018 年 8 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期未在承销期内直接购入关联方承销证券。本基金基金合同于 2018 年 8 月 13 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 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	可流通日	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
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,299	32,174.54	32,174.54	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有因暂时停牌等流通受限的股票。

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 2019 年 6 月 30 日止，本基金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为 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金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为 0.00 元，无质押证券。

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。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由风险控制委员会，投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部，以及相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的 10%。

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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另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。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现

金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款及存出保证金等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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							
银行存款	7,410,427.77	-	-	-	-	-	7,410,427.77
结算备付金	833,827.04	-	-	-	-	-	833,827.04
存出保证金	762,522.18	-	-	-	-	-	762,522.18
交易性金融资产	-	-	-	-	-	74,232,310.07	74,232,310.07
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	2,147.82	2,147.82
应收申购款	-	-	-	-	-	3,867,483.38	3,867,483.38
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,006,776.99	-	-	-	-	78,101,941.27	87,108,718.26
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,158,968.79	3,158,968.79
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,557.40	6,557.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	37,957.19	37,957.19
应付托管费	-	-	-	-	-	5,693.59	5,693.59
应付销售服务费	-	-	-	-	-	173.90	173.90
应付交易费用	-	-	-	-	-	40,683.28	40,683.28
其他负债	-	-	-	-	-	114,886.52	114,886.52

负债总计	-	-	-	-	-	3,364,920.67	3,364,920.67
利率敏感度缺口	9,006,776.99	-	-	-	-	-	-
上年度末 2018 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							
银行存款	995,674.59	-	-	-	-	-	995,674.59
结算备付金	76,212.72	-	-	-	-	-	76,212.72
存出保证金	10,547.02	-	-	-	-	-	10,547.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	14,045,692.97	14,045,692.97
应收利息	-	-	-	-	-	254.10	254.10
应收申购款	-	-	-	-	-	17,078.72	17,078.72
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,082,434.33	-	-	-	-	14,063,025.79	15,145,460.12
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,344.25	1,344.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,997.42	12,997.42
应付托管费	-	-	-	-	-	1,949.61	1,949.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	29,988.06	29,988.06
其他负债	-	-	-	-	-	238,493.86	238,493.86
负债总计	-	-	-	-	-	284,773.20	284,773.20
利率敏感度缺口	1,082,434.33	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末及上年度末均未持有交易性债券投资。因此在其它变量不变的假设下，利率发生合理、可能变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对本期末及上年度末基金资产净值无重大影响。

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证 500 指数成份股和备选成份股的资产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后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金本报告期末面临的整体其他价格风险列示如下：

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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	74,232,310.07	88.64	14,045,692.97	94.52
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	74,232,310.07	88.64	14,045,692.97	94.52

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时		
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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%		3,801,065.44
沪深 300 指数下降 5%		-3,801,065.44	-749,197.26

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析，上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、存出保证金、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2019 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 74,200,135.53 元，划分为第二层次的余额为人民币 32,174.54 元，无划分为第三层次的余额。

公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	74,232,310.07	85.22
	其中：股票	74,232,310.07	85.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,244,254.81	9.46
8	其他各项资产	4,632,153.38	5.32
9	合计	87,108,718.26	100.00

7.2 期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,200,168.00	1.43
B	采矿业	1,369,011.00	1.63
C	制造业	28,971,693.38	34.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,332,170.70	2.78
E	建筑业	1,747,538.00	2.09
F	批发和零售业	2,560,620.00	3.06
G	交通运输、仓储和邮政业	2,425,408.20	2.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,616,228.10	6.71
J	金融业	4,600,036.00	5.49
K	房地产业	3,990,119.80	4.76
L	租赁和商务服务业	547,456.10	0.65

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	898,890.40	1.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,213,732.00	1.45
Q	卫生和社会工作	1,249,119.00	1.49
R	文化、体育和娱乐业	1,818,562.48	2.17
S	综合	1,137,321.00	1.36
	合计	61,678,074.16	73.65

7.2.1 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	116,025.00	0.14
B	采矿业	335,727.90	0.40
C	制造业	7,432,476.43	8.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	612,845.56	0.73
E	建筑业	319,127.00	0.38
F	批发和零售业	468,215.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	416,262.20	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	649,471.76	0.78
J	金融业	905,161.54	1.08
K	房地产业	270,332.00	0.32
L	租赁和商务服务业	30,301.12	0.04
M	科学研究和技术服务业	211,436.40	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	316,002.00	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	125,552.00	0.15
Q	卫生和社会工作	250,300.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	95,000.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	12,554,235.91	14.99

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	占基金资产净值比例（%）
1	002195	二三四五	367,050	1,427,824.50	1.70
2	002419	天虹股份	103,900	1,356,934.00	1.62
3	002353	杰瑞股份	56,200	1,298,220.00	1.55
4	000686	东北证券	143,800	1,266,878.00	1.51
5	600763	通策医疗	14,100	1,249,119.00	1.49
6	600580	卧龙电驱	145,200	1,221,132.00	1.46
7	002607	中公教育	88,400	1,213,732.00	1.45
8	002299	圣农发展	47,400	1,200,168.00	1.43
9	600026	中远海能	184,300	1,196,107.00	1.43
10	601098	中南传媒	93,300	1,179,312.00	1.41
11	600845	宝信软件	39,670	1,129,801.60	1.35
12	601100	恒立液压	32,900	1,032,402.00	1.23
13	600779	水井坊	20,200	1,026,564.00	1.23
14	603444	吉比特	4,800	1,007,808.00	1.20
15	000543	皖能电力	208,300	981,093.00	1.17
16	600673	东阳光	123,060	966,021.00	1.15
17	603369	今世缘	34,600	964,994.00	1.15
18	600466	蓝光发展	151,300	941,086.00	1.12
19	000600	建投能源	134,617	901,933.90	1.08
20	603568	伟明环保	41,770	898,890.40	1.07
21	002701	奥瑞金	191,600	894,772.00	1.07
22	000877	天山股份	76,400	887,768.00	1.06
23	600266	北京城建	109,680	884,020.80	1.06
24	600970	中材国际	137,100	881,553.00	1.05
25	601000	唐山港	318,400	875,600.00	1.05
26	600409	三友化工	154,600	875,036.00	1.04
27	600699	均胜电子	40,602	867,258.72	1.04
28	002051	中工国际	75,500	865,985.00	1.03

29	600376	首开股份	96,900	865,317.00	1.03
30	600643	爱建集团	89,600	858,368.00	1.02
31	000513	丽珠集团	25,740	855,340.20	1.02
32	600745	闻泰科技	25,600	850,432.00	1.02
33	600563	法拉电子	20,600	848,102.00	1.01
34	002028	思源电气	84,324	839,867.04	1.00
35	000528	柳工	126,100	839,826.00	1.00
36	002463	沪电股份	60,500	824,010.00	0.98
37	600633	浙数文化	87,400	817,190.00	0.98
38	002128	露天煤业	92,700	801,855.00	0.96
39	002797	第一创业	125,400	795,036.00	0.95
40	002332	仙琚制药	115,200	778,752.00	0.93
41	000501	鄂武商 A	71,800	771,850.00	0.92
42	002745	木林森	65,300	765,316.00	0.91
43	603198	迎驾贡酒	41,000	734,310.00	0.88
44	002399	海普瑞	34,800	730,452.00	0.87
45	600801	华新水泥	35,960	728,190.00	0.87
46	300088	长信科技	139,100	703,846.00	0.84
47	002916	深南电路	6,600	672,672.00	0.80
48	000999	华润三九	22,300	654,282.00	0.78
49	000031	大悦城	99,600	639,432.00	0.76
50	002048	宁波华翔	58,200	629,724.00	0.75
51	002440	闰土股份	49,300	614,278.00	0.73
52	600282	南钢股份	170,400	596,400.00	0.71
53	000878	云南铜业	55,000	584,650.00	0.70
54	603328	依顿电子	55,900	574,093.00	0.69
55	002818	富森美	42,670	547,456.10	0.65
56	002242	九阳股份	26,200	545,222.00	0.65
57	002635	安洁科技	39,200	528,808.00	0.63
58	002250	联化科技	46,900	520,121.00	0.62
59	600169	太原重工	176,900	472,323.00	0.56
60	300253	卫宁健康	33,300	472,194.00	0.56
61	002152	广电运通	66,600	456,210.00	0.54
62	600325	华发股份	58,000	452,980.00	0.54
63	603659	璞泰来	9,600	451,392.00	0.54
64	600053	九鼎投资	19,300	449,690.00	0.54
65	300383	光环新网	26,300	441,051.00	0.53
66	600511	国药股份	18,800	431,836.00	0.52
67	300207	欣旺达	36,200	417,024.00	0.50

68	002233	塔牌集团	33,400	390,112.00	0.47
69	600757	长江传媒	55,800	379,998.00	0.45
70	002690	美亚光电	10,800	352,080.00	0.42
71	000563	陕国投 A	76,300	338,772.00	0.40
72	600348	阳泉煤业	56,000	325,360.00	0.39
73	300168	万达信息	24,700	320,359.00	0.38
74	600350	山东高速	65,744	315,571.20	0.38
75	000778	新兴铸管	59,200	262,848.00	0.31
76	600373	中文传媒	20,600	258,736.00	0.31
77	601717	郑煤机	44,300	252,953.00	0.30
78	000987	越秀金控	26,600	239,932.00	0.29
79	000547	航天发展	24,500	234,220.00	0.28
80	000738	航发控制	15,900	213,060.00	0.25
81	600971	恒源煤电	34,680	202,878.00	0.24
82	601003	柳钢股份	33,700	195,123.00	0.23
83	000027	深圳能源	31,300	194,060.00	0.23
84	600064	南京高科	17,200	184,212.00	0.22
85	000009	中国宝安	30,000	171,300.00	0.20
86	000712	锦龙股份	13,100	168,204.00	0.20
87	002500	山西证券	20,600	166,860.00	0.20
88	000750	国海证券	32,800	164,984.00	0.20
89	000690	宝新能源	25,300	162,932.00	0.19
90	601128	常熟银行	19,600	151,312.00	0.18
91	002110	三钢闽光	13,050	121,365.00	0.14
92	002129	中环股份	11,300	110,288.00	0.13
93	002273	水晶光电	9,300	107,694.00	0.13
94	600312	平高电气	13,700	105,353.00	0.13
95	600167	联美控股	8,710	92,151.80	0.11
96	002812	恩捷股份	1,200	56,100.00	0.07
97	002382	蓝帆医疗	3,400	46,988.00	0.06
98	002191	劲嘉股份	3,200	39,712.00	0.05
99	002223	鱼跃医疗	1,600	39,392.00	0.05
100	002821	凯莱英	400	39,232.00	0.05
101	601168	西部矿业	6,100	38,918.00	0.05
102	600486	扬农化工	700	38,290.00	0.05
103	600611	大众交通	8,200	38,130.00	0.05
104	603816	顾家家居	960	30,643.20	0.04
105	600657	信达地产	5,600	23,072.00	0.03
106	002489	浙江永强	5,800	19,372.00	0.02

107	300450	先导智能	400	13,440.00	0.02
108	002092	中泰化学	1,500	11,940.00	0.01
109	002503	搜于特	1,400	3,850.00	0.00
110	000860	顺鑫农业	60	2,799.00	0.00
111	603025	大豪科技	54	552.96	0.00
112	601928	凤凰传媒	64	516.48	0.00
113	002254	泰和新材	47	497.26	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	占基金资产净值比例（%）
1	002563	森马服饰	47,200	522,032.00	0.62
2	000596	古井贡酒	2,500	296,275.00	0.35
3	603882	金域医学	4,600	157,780.00	0.19
4	600086	东方金钰	35,800	157,520.00	0.19
5	603313	梦百合	8,600	148,694.00	0.18
6	002832	比音勒芬	3,100	147,777.00	0.18
7	600461	洪城水业	23,400	147,420.00	0.18
8	601377	兴业证券	21,800	146,932.00	0.18
9	600109	国金证券	15,100	146,772.00	0.18
10	603605	珀莱雅	2,200	145,596.00	0.17
11	002803	吉宏股份	7,100	144,911.00	0.17
12	000157	中联重科	24,000	144,240.00	0.17
13	601788	光大证券	12,600	143,892.00	0.17
14	002398	建研集团	22,400	143,808.00	0.17
15	002851	麦格米特	7,250	143,332.50	0.17
16	603588	高能环境	13,400	142,978.00	0.17
17	601919	中远海控	28,400	142,568.00	0.17
18	002727	一心堂	5,000	142,450.00	0.17
19	002511	中顺洁柔	11,600	142,448.00	0.17
20	600720	祁连山	16,200	142,398.00	0.17
21	000425	徐工机械	31,900	142,274.00	0.17
22	002120	韵达股份	4,610	142,080.20	0.17
23	300572	安车检测	3,040	141,056.00	0.17
24	600170	上海建工	37,200	139,872.00	0.17
25	600025	华能水电	34,028	138,493.96	0.17
26	603737	三棵树	3,180	138,457.20	0.17

27	002478	常宝股份	22,800	137,940.00	0.16
28	600997	开滦股份	22,400	137,088.00	0.16
29	600987	航民股份	20,700	136,827.00	0.16
30	300130	新国都	8,600	136,740.00	0.16
31	300567	精测电子	2,600	136,552.00	0.16
32	002020	京新药业	11,800	135,936.00	0.16
33	002595	豪迈科技	6,400	134,464.00	0.16
34	600919	江苏银行	18,400	133,584.00	0.16
35	002099	海翔药业	18,700	132,770.00	0.16
36	300482	万孚生物	3,500	131,950.00	0.16
37	001965	招商公路	15,800	131,614.00	0.16
38	000951	中国重汽	8,100	130,005.00	0.16
39	300285	国瓷材料	7,600	129,276.00	0.15
40	300045	华力创通	14,400	128,736.00	0.15
41	603711	香飘飘	3,700	125,689.00	0.15
42	300338	开元股份	11,200	125,552.00	0.15
43	000783	长江证券	15,800	123,398.00	0.15
44	002555	三七互娱	9,100	123,305.00	0.15
45	600383	金地集团	10,300	122,879.00	0.15
46	300559	佳发教育	5,180	122,817.80	0.15
47	002541	鸿路钢构	15,400	121,814.00	0.15
48	603368	柳药股份	3,700	121,656.00	0.15
49	601666	平煤股份	28,900	120,802.00	0.14
50	300735	光弘科技	7,000	119,560.00	0.14
51	002648	卫星石化	8,000	119,040.00	0.14
52	002683	宏大爆破	10,000	117,000.00	0.14
53	002746	仙坛股份	7,500	116,025.00	0.14
54	002301	齐心集团	10,000	115,900.00	0.14
55	603160	汇顶科技	800	111,040.00	0.13
56	002675	东诚药业	10,000	109,200.00	0.13
57	600570	恒生电子	1,600	109,040.00	0.13
58	600578	京能电力	33,500	108,540.00	0.13
59	603638	艾迪精密	4,800	108,000.00	0.13
60	002402	和而泰	11,400	107,958.00	0.13
61	300146	汤臣倍健	5,500	106,700.00	0.13
62	300596	利安隆	3,500	106,400.00	0.13
63	000498	山东路桥	19,700	104,607.00	0.12
64	300132	青松股份	9,600	104,448.00	0.12
65	600372	中航电子	7,000	103,880.00	0.12

66	300212	易华录	4,200	102,900.00	0.12
67	300590	移为通信	3,000	102,600.00	0.12
68	002841	视源股份	1,300	100,763.00	0.12
69	002322	理工环科	8,000	100,640.00	0.12
70	002698	博实股份	11,000	99,440.00	0.12
71	600606	绿地控股	14,100	96,303.00	0.11
72	601900	南方传媒	10,000	95,000.00	0.11
73	600926	杭州银行	11,400	94,962.00	0.11
74	300699	光威复材	2,900	94,830.00	0.11
75	300575	中旗股份	3,300	94,248.00	0.11
76	300529	健帆生物	1,500	93,525.00	0.11
77	300347	泰格医药	1,200	92,520.00	0.11
78	000967	盈峰环境	12,100	89,540.00	0.11
79	603817	海峡环保	10,800	83,700.00	0.10
80	300190	维尔利	10,800	83,484.00	0.10
81	000728	国元证券	9,100	83,447.00	0.10
82	000799	酒鬼酒	3,200	80,800.00	0.10
83	603218	日月股份	4,000	77,600.00	0.09
84	601933	永辉超市	7,600	77,596.00	0.09
85	000923	河北宣工	4,400	75,284.00	0.09
86	601117	中国化学	12,400	74,648.00	0.09
87	300599	雄塑科技	6,800	74,392.00	0.09
88	300031	宝通科技	6,000	74,160.00	0.09
89	002533	金杯电工	14,400	73,872.00	0.09
90	600681	百川能源	9,540	70,977.60	0.08
91	600456	宝钛股份	3,100	70,711.00	0.08
92	603886	元祖股份	2,600	68,874.00	0.08
93	600655	豫园股份	8,300	67,977.00	0.08
94	603339	四方科技	4,400	67,672.00	0.08
95	603018	中设集团	5,432	67,628.40	0.08
96	002798	帝欧家居	3,500	64,085.00	0.08
97	600886	国投电力	8,200	63,714.00	0.08
98	603661	恒林股份	1,909	62,748.83	0.07
99	002080	中材科技	6,900	62,514.00	0.07
100	002406	远东传动	10,200	61,200.00	0.07
101	000739	普洛药业	6,200	60,946.00	0.07
102	300320	海达股份	12,800	60,928.00	0.07
103	600704	物产中大	10,800	58,536.00	0.07
104	601799	星宇股份	700	55,272.00	0.07

105	600663	陆家嘴	3,300	51,150.00	0.06
106	300725	药石科技	800	49,864.00	0.06
107	600760	中航沈飞	1,300	37,739.00	0.05
108	603587	地素时尚	1,600	36,384.00	0.04
109	600217	中再资环	5,000	36,150.00	0.04
110	601236	红塔证券	9,299	32,174.54	0.04
111	300782	卓胜微	223	24,289.16	0.03
112	600968	海油发展	6,378	22,641.90	0.03
113	603867	新化股份	696	17,963.76	0.02
114	300662	科锐国际	500	17,710.00	0.02
115	300780	德恩精工	573	16,960.80	0.02
116	603217	元利科技	244	16,406.56	0.02
117	601698	中国卫通	4,176	16,369.92	0.02
118	603915	国茂股份	652	15,172.04	0.02
119	300594	朗进科技	306	13,497.66	0.02
120	300781	因赛集团	276	12,591.12	0.02
121	000333	美的集团	230	11,927.80	0.01
122	603429	集友股份	80	2,048.00	0.00
123	002734	利民股份	90	1,346.40	0.00
124	300569	天能重工	50	583.00	0.00
125	300448	浩云科技	36	239.04	0.00
126	600600	青岛啤酒	4	199.72	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	002195	二三四五	2,360,790.00	15.89
2	002028	思源电气	1,657,779.08	11.16
3	002463	沪电股份	1,590,882.00	10.71
4	600970	中材国际	1,543,187.00	10.38
5	002353	杰瑞股份	1,527,142.00	10.28
6	601100	恒立液压	1,444,530.00	9.72

7	600266	北京城建	1,419,329.80	9.55
8	002399	海普瑞	1,416,374.00	9.53
9	600643	爱建集团	1,384,332.00	9.32
10	002419	天虹股份	1,372,072.00	9.23
11	603568	伟明环保	1,356,589.80	9.13
12	000686	东北证券	1,352,399.00	9.10
13	002299	圣农发展	1,348,231.00	9.07
14	002128	露天煤业	1,305,606.00	8.79
15	600779	水井坊	1,297,107.00	8.73
16	002701	奥瑞金	1,286,061.00	8.65
17	000877	天山股份	1,285,504.50	8.65
18	603444	吉比特	1,268,700.00	8.54
19	600580	卧龙电驱	1,267,375.00	8.53
20	002916	深南电路	1,265,565.60	8.52
21	600699	均胜电子	1,241,342.00	8.35
22	002607	中公教育	1,227,493.31	8.26
23	600466	蓝光发展	1,221,654.00	8.22
24	600763	通策医疗	1,215,662.40	8.18
25	000513	丽珠集团	1,193,154.40	8.03
26	600026	中远海能	1,179,375.00	7.94
27	601098	中南传媒	1,172,445.00	7.89
28	002332	仙琚制药	1,162,499.00	7.82
29	002563	森马服饰	1,154,253.00	7.77
30	000975	银泰资源	1,146,982.00	7.72
31	300253	卫宁健康	1,139,567.00	7.67
32	603369	今世缘	1,138,970.00	7.66
33	000031	大悦城	1,121,828.00	7.55
34	600845	宝信软件	1,091,940.00	7.35
35	000878	云南铜业	1,084,154.00	7.30
36	000543	皖能电力	1,050,776.00	7.07
37	300383	光环新网	1,047,644.00	7.05
38	300166	东方国信	1,043,352.00	7.02
39	002233	塔牌集团	1,040,999.00	7.01
40	600801	华新水泥	1,037,750.00	6.98
41	002242	九阳股份	1,033,193.00	6.95
42	600563	法拉电子	1,023,080.00	6.88

43	600511	国药股份	1,004,108.00	6.76
44	000528	柳 工	1,002,021.00	6.74
45	600673	东阳光	1,000,344.40	6.73
46	600901	江苏租赁	976,840.00	6.57
47	300088	长信科技	976,510.00	6.57
48	600053	九鼎投资	975,835.00	6.57
49	603328	依顿电子	968,074.00	6.51
50	002690	美亚光电	924,470.00	6.22
51	002818	富森美	924,036.30	6.22
52	600777	新潮能源	920,419.00	6.19
53	000600	建投能源	910,293.45	6.13
54	600409	三友化工	890,569.00	5.99
55	601000	唐山港	889,528.00	5.99
56	002635	安洁科技	878,560.00	5.91
57	600376	首开股份	863,994.00	5.81
58	002051	中工国际	862,594.00	5.80
59	600745	闻泰科技	858,218.00	5.78
60	002250	联化科技	856,936.16	5.77
61	603816	顾家家居	855,033.00	5.75
62	600633	浙数文化	853,675.00	5.74
63	600125	铁龙物流	852,525.00	5.74
64	600169	太原重工	840,876.00	5.66
65	002129	中环股份	812,084.00	5.46
66	002797	第一创业	800,152.00	5.38
67	603806	福斯特	791,005.00	5.32
68	000887	中鼎股份	780,162.00	5.25
69	600312	平高电气	763,796.00	5.14
70	002745	木林森	763,005.00	5.13
71	603198	迎驾贡酒	762,181.00	5.13
72	600657	信达地产	762,083.00	5.13
73	000501	鄂武商 A	759,567.00	5.11
74	600808	马钢股份	759,486.00	5.11
75	600611	大众交通	757,805.00	5.10
76	600388	龙净环保	754,573.00	5.08
77	600316	洪都航空	744,877.00	5.01
78	600649	城投控股	731,932.00	4.93

79	600282	南钢股份	728,730.00	4.90
80	002174	游族网络	717,868.00	4.83
81	603659	璞泰来	698,744.00	4.70
82	000860	顺鑫农业	693,865.00	4.67
83	002152	广电运通	691,464.00	4.65
84	603658	安图生物	688,229.00	4.63
85	600143	金发科技	673,931.00	4.53
86	000090	天健集团	671,809.00	4.52
87	000027	深圳能源	659,805.00	4.44
88	002127	南极电商	645,594.00	4.34
89	002048	宁波华翔	644,774.00	4.34
90	002004	华邦健康	631,462.00	4.25
91	000999	华润三九	628,513.00	4.23
92	601717	郑煤机	622,643.00	4.19
93	002440	闰土股份	616,890.00	4.15
94	603766	隆鑫通用	613,345.00	4.13
95	600820	隧道股份	612,555.00	4.12
96	002254	泰和新材	610,991.61	4.11
97	000848	承德露露	598,785.00	4.03
98	600600	青岛啤酒	593,351.24	3.99
99	603883	老百姓	591,229.00	3.98
100	002444	巨星科技	574,146.00	3.86
101	002155	湖南黄金	562,362.00	3.78
102	600565	迪马股份	555,139.00	3.74
103	600307	酒钢宏兴	553,628.00	3.73
104	300347	泰格医药	546,879.00	3.68
105	600885	宏发股份	546,777.00	3.68
106	601168	西部矿业	541,065.00	3.64
107	600373	中文传媒	506,397.00	3.41
108	601128	常熟银行	500,789.00	3.37
109	600567	山鹰纸业	498,006.00	3.35
110	600073	上海梅林	495,799.00	3.34
111	000778	新兴铸管	488,752.00	3.29
112	603877	太平鸟	477,936.74	3.22
113	000596	古井贡酒	477,837.00	3.22
114	002110	三钢闽光	472,909.00	3.18

115	600971	恒源煤电	466,961.00	3.14
116	600348	阳泉煤业	465,554.00	3.13
117	000401	冀东水泥	463,893.00	3.12
118	300058	蓝色光标	461,404.00	3.10
119	600325	华发股份	459,940.00	3.10
120	600167	联美控股	452,336.00	3.04
121	601689	拓普集团	449,019.00	3.02
122	002244	滨江集团	448,306.00	3.02
123	002344	海宁皮城	443,391.00	2.98
124	300244	迪安诊断	436,532.00	2.94
125	002507	涪陵榨菜	435,034.00	2.93
126	000656	金科股份	432,711.00	2.91
127	300207	欣旺达	425,205.00	2.86
128	000987	越秀金控	420,017.00	2.83
129	000049	德赛电池	419,184.00	2.82
130	600160	巨化股份	418,709.00	2.82
131	600575	皖江物流	412,960.00	2.78
132	000563	陕国投 A	399,380.00	2.69
133	600872	中炬高新	386,886.00	2.60
134	002831	裕同科技	378,168.00	2.54
135	002368	太极股份	378,012.00	2.54
136	600639	浦东金桥	374,938.00	2.52
137	600757	长江传媒	373,246.00	2.51
138	300168	万达信息	368,345.00	2.48
139	600366	宁波韵升	366,027.00	2.46
140	002500	山西证券	364,567.51	2.45
141	601928	凤凰传媒	362,257.00	2.44
142	600884	杉杉股份	359,162.00	2.42
143	600056	中国医药	354,685.00	2.39
144	300146	汤臣倍健	352,662.00	2.37
145	000547	航天发展	340,126.00	2.29
146	603866	桃李面包	334,136.00	2.25
147	601019	山东出版	325,761.00	2.19
148	600350	山东高速	324,197.92	2.18
149	002308	威创股份	313,962.00	2.11
150	600811	东方集团	312,483.00	2.10

151	000061	农产品	300,183.00	2.02
-----	--------	-----	------------	------

买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	000975	银泰资源	1,414,152.00	9.52
2	300166	东方国信	1,240,158.00	8.35
3	600125	铁龙物流	1,122,940.00	7.56
4	002463	沪电股份	1,114,849.00	7.50
5	600777	新潮能源	1,073,563.00	7.22
6	000887	中鼎股份	1,030,928.00	6.94
7	600388	龙净环保	1,019,273.00	6.86
8	600970	中材国际	969,941.19	6.53
9	002127	南极电商	942,190.00	6.34
10	600901	江苏租赁	913,893.00	6.15
11	300383	光环新网	905,024.00	6.09
12	603658	安图生物	890,855.00	5.99
13	600312	平高电气	866,132.00	5.83
14	000860	顺鑫农业	848,392.00	5.71
15	002028	思源电气	837,913.00	5.64
16	603816	顾家家居	825,727.00	5.56
17	603806	福斯特	825,174.00	5.55
18	000848	承德露露	823,892.00	5.54
19	600885	宏发股份	793,201.00	5.34
20	002233	塔牌集团	792,223.00	5.33
21	002242	九阳股份	786,801.00	5.29
22	600808	马钢股份	783,380.00	5.27
23	000656	金科股份	783,315.00	5.27
24	600649	城投控股	783,114.00	5.27
25	600611	大众交通	782,421.00	5.27
26	600801	华新水泥	749,496.00	5.04
27	603568	伟明环保	742,392.00	5.00
28	600160	巨化股份	739,631.00	4.98
29	601689	拓普集团	732,259.00	4.93
30	002195	二三四五	724,811.00	4.88

31	002444	巨星科技	722,978.00	4.87
32	002174	游族网络	705,057.00	4.74
33	002916	深南电路	701,462.00	4.72
34	600143	金发科技	696,289.00	4.69
35	002004	华邦健康	693,874.00	4.67
36	000878	云南铜业	674,426.00	4.54
37	601168	西部矿业	674,185.00	4.54
38	600657	信达地产	673,176.00	4.53
39	600053	九鼎投资	669,654.00	4.51
40	002129	中环股份	663,686.00	4.47
41	300058	蓝色光标	657,144.00	4.42
42	603883	老百姓	656,609.00	4.42
43	300253	卫宁健康	654,297.00	4.40
44	600316	洪都航空	644,552.00	4.34
45	000049	德赛电池	643,606.00	4.33
46	601717	郑煤机	638,621.00	4.30
47	601928	凤凰传媒	631,160.00	4.25
48	600056	中国医药	628,666.00	4.23
49	002563	森马服饰	624,405.00	4.20
50	002254	泰和新材	617,379.00	4.15
51	600565	迪马股份	595,674.00	4.01
52	002583	海能达	594,908.00	4.00
53	000090	天健集团	594,620.00	4.00
54	600266	北京城建	593,271.20	3.99
55	002690	美亚光电	592,055.90	3.98
56	603766	隆鑫通用	586,700.00	3.95
57	600511	国药股份	583,714.00	3.93
58	603328	依顿电子	565,891.00	3.81
59	600820	隧道股份	564,144.00	3.80
60	600600	青岛啤酒	549,508.00	3.70
61	002299	圣农发展	536,306.00	3.61
62	002399	海普瑞	534,493.00	3.60
63	002155	湖南黄金	525,928.00	3.54
64	600643	爱建集团	517,819.00	3.48
65	002244	滨江集团	513,879.00	3.46
66	002128	露天煤业	510,029.00	3.43
67	600073	上海梅林	504,830.00	3.40
68	600307	酒钢宏兴	499,309.00	3.36

69	603877	太平鸟	477,862.00	3.22
70	000877	天山股份	469,378.00	3.16
71	600567	山鹰纸业	461,851.00	3.11
72	002332	仙琚制药	457,380.00	3.08
73	603444	吉比特	456,309.00	3.07
74	600366	宁波韵升	450,223.00	3.03
75	300347	泰格医药	449,254.00	3.02
76	600575	皖江物流	448,033.00	3.01
77	000027	深圳能源	443,195.00	2.98
78	300088	长信科技	439,710.00	2.96
79	601100	恒立液压	430,872.00	2.90
80	300244	迪安诊断	420,730.00	2.83
81	603659	璞泰来	413,965.00	2.79
82	601128	常熟银行	413,899.00	2.79
83	002507	涪陵榨菜	411,427.00	2.77
84	002344	海宁皮城	409,877.00	2.76
85	002701	奥瑞金	409,336.00	2.75
86	000031	大悦城	403,470.00	2.72
87	002635	安洁科技	393,899.00	2.65
88	600422	昆药集团	392,926.00	2.64
89	600884	杉杉股份	392,357.00	2.64
90	000528	柳工	388,756.00	2.62
91	000401	冀东水泥	387,139.00	2.61
92	002368	太极股份	384,001.00	2.58
93	600872	中炬高新	382,618.00	2.57
94	002640	跨境通	374,766.00	2.52
95	002818	富森美	371,137.70	2.50
96	002831	裕同科技	365,584.00	2.46
97	600169	太原重工	362,598.00	2.44
98	000513	丽珠集团	357,001.00	2.40
99	002250	联化科技	353,230.00	2.38
100	600466	蓝光发展	349,074.00	2.35
101	000977	浪潮信息	347,580.00	2.34
102	002353	杰瑞股份	345,956.00	2.33
103	600639	浦东金桥	344,326.00	2.32
104	600699	均胜电子	340,200.00	2.29
105	601019	山东出版	337,614.00	2.27
106	300133	华策影视	333,122.00	2.24

107	600779	水井坊	332,461.00	2.24
108	600167	联美控股	324,046.00	2.18
109	002308	威创股份	321,638.00	2.16
110	000778	新兴铸管	310,317.00	2.09
111	603019	中科曙光	310,051.00	2.09
112	600811	东方集团	308,458.00	2.08
113	600694	大商股份	303,850.92	2.04
114	603866	桃李面包	303,364.00	2.04
115	002038	双鹭药业	301,578.00	2.03
116	600256	广汇能源	300,742.00	2.02

卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	158,311,717.99
卖出股票收入（成交）总额	100,899,284.37

买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1907	IC1907	5	4,906,400.00	-6,660.00	<p>本基金在进行股指期货投资时，遵守法律法规的规定和基金合同的约定，符合既定的投资策略和投资目标。采用流动性好、交易活跃的期货合约，对现货资产进行部分对冲，以增厚整个组合的风险调整后的收益。基金管理人将充分考虑股指期货的收益特征、流动性以及风险特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的</p>

					杠杆作用， 以达到降低 投资组合的 整体风险的 目的
公允价值变动总额合计（元）					-6,660.00
股指期货投资本期收益（元）					-27,540.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-6,660.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金在进行股指期货投资时，遵守法律法规的规定和基金合同的约定，符合既定的投资策略和投资目标。采用流动性好、交易活跃的期货合约，对现货资产进行部分对冲，以增厚整个组合的风险调整后的收益。

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

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	762,522.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,147.82
5	应收申购款	3,867,483.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,632,153.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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

注：本基金本报告期末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

注：本基金本报告期末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

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
长城中证 500 指数增强 A	2,549	33,399.42	33,160,505.69	38.95%	51,974,608.15	61.05%
长城中证 500 指数增强 C	28	43,098.70	-	-	1,206,763.63	100.00%
合计	2,577	33,504.80	33,160,505.69	38.41%	53,181,371.78	61.59%

注：上述机构/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	长城中证 500 指数增强 A	209,128.55	0.2456%
	长城中证 500 指数增强 C	-	-
	合计	209,128.55	0.2422%

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金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）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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负责人持有本开放式基金	长城中证 500 指数增强 A	10~50
	长城中证 500 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	长城中证 500 指数增强 A	10~50
	长城中证 500 指数增强 C	0
	合计	10~50

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城中证 500 指数 增强 A	长城中证 500 指数 增强 C
基金合同生效日（2018 年 8 月 13 日）基 基金份额总额	19,420,400.59	-
本报告期期初基金份额总额	18,728,350.38	-
本报告期间基金总申购份额	147,349,119.02	1,294,326.36
减：本报告期间基金总赎回份额	80,942,355.56	87,562.73
本报告期间基金拆分变动份额（份额减 少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	85,135,113.84	1,206,763.63

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、基金管理人重大人事变动

自 2019 年 4 月 2 日起，沈阳女士担任长城基金管理有限公司副总经理，卢盛春先生不再担任长城基金管理有限公司副总经理。

自 2019 年 5 月 16 日起，赵建兴先生担任长城基金管理有限公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金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

本基金本报告期投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
长城证券	5	258,840,003.08	100.00%	59,869.47	100.00%	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

招商证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内共减少 5 个租用交易单元（西部证券减少 2 个交易单元，瑞银证券、九州证券、中投证券各减少 1 个交易单元），截止本报告期末共计 53 个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序 本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。

基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

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
长城证券	13,006.20	100.00%	21,000,000.00	100.00%	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

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	关于增加江苏银行为长城基金旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2019 年 1 月 7 日
2	长城基金管理有限公司关于	中国证券报、上海	2019 年 1 月 16 日

	旗下部分基金参与平安银行费率优惠的公告	证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	
3	长城基金管理有限公司关于参加奕丰基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 2 月 22 日
4	长城基金管理有限公司关于旗下基金持有的“信威集团”股票估值方法调整的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 2 月 22 日
5	长城基金管理有限公司关于参加泉州银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 3 月 1 日
6	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(长春高新)	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 3 月 5 日
7	关于参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 3 月 30 日
8	关于参与工商银行基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 4 月 1 日
9	长城基金管理有限公司关于参加方正证券费率优惠活动的公告(含认购、定投-放开折扣限制)	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 4 月 2 日
10	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(格力电器)	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 4 月 2 日
11	长城基金关于提请投资者及时更新过期身份证件或身份证明文件的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 4 月 4 日
12	长城基金管理有限公司关于变更公司副总经理的公告	证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 4 月 4 日
13	长城基金关于提请非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金	2019 年 4 月 12 日

		管理人网站	
14	长城基金管理有限公司关于参加深圳农村商业银行股份有限公司费率优惠活动的公告（含认购、定投-放开折扣限制）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站	2019 年 4 月 18 日
15	长城基金管理有限公司关于参加北京植信基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站	2019 年 4 月 19 日
16	长城基金关于增加万联证券股份有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换业务及参与其费率优惠活动的公告.	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站	2019 年 4 月 23 日
17	关于长城中证 500 指数增强型基金增设 C 类份额并相应修改基金合同条款的公告	中国证券报及本基金经理人网站	2019 年 5 月 9 日
18	关于增加新兰德、有鱼基金、民商基金等机构为长城中证 500 指数增强型证券投资基金 C 代销机构的公告	中国证券报及本基金经理人网站	2019 年 5 月 16 日
19	长城基金管理有限公司关于变更公司副总经理的公告（赵建兴）	证券日报及本基金经理人网站	2019 年 5 月 17 日
20	长城基金关于增加华瑞保险销售有限公司为旗下开放式基金代销机构及参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站	2019 年 5 月 24 日
21	关于增加凯石财富为长城中证 500 指数增强型证券投资基金 C 类份额代销机构并开通转换、定期定额投资业务的公告	中国证券报及本基金经理人网站	2019 年 5 月 30 日
22	长城基金关于增加西藏东方财富证券股份有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通转换业务及参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金经理人网站	2019 年 5 月 31 日
23	关于增加招商银行为长城中证 500 基金 C 类份额代销机构并开通转换、定投业务的公告	中国证券报及本基金经理人网站	2019 年 6 月 14 日
24	长城基金管理有限公司关于	中国证券报、上海	2019 年 6 月 18 日

	提醒客户更新、完善身份信息 的公告	证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	
25	长城基金管理有限公司关于 旗下部分公开募集证券投资 基金可投资于科创板股票 的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 6 月 26 日
26	长城基金管理有限公司关于 旗下基金持有的“中科曙光” 股票估值方法调整的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 6 月 26 日
27	长城基金关于旗下部分开放 式基金参与中国银行开展的 定期定额投资基金费率优惠 活动的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报及本基金 管理人网站	2019 年 6 月 27 日
28	关于增加植信基金为长城中 证 500 指数增强型证券投资 基金 C 类份额代销机构的公 告	中国证券报及本基 金管理人网站	2019 年 6 月 28 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	20190409-20190416	-	10,186,405.06	10,186,405.06	-	-
	2	20190409-20190416	-	10,186,405.06	10,186,405.06	-	-
	3	20190625-20190630	-	23,848,486.80	-	23,848,486.80	27.6210%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

1、流动性风险

本基金在短时间内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，从而可能会面临一定的流动性风险；

2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

若持有基金份额比例达到或超过 20%的单一投资者大额赎回引发了巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期支付赎回款项；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、基金净值波动风险

大额赎回会导致管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的需要，可能使基金资产净值受到不利影响；另一方面，由于基金净值估值四舍五入法或赎回费收入归基金资产的影响，大额赎回可能导致基金净值出现较大波动；

4、投资受限风险

大额赎回后若基金资产规模过小，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；

5、基金合同终止或转型风险

大额赎回可能会导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，根据基金合同的约定，将面临合同终止财产清算或转型风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会许可长城中证 500 指数增强型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn