

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 24 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 20 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 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500ETF
场内简称	景顺 500
基金主代码	159935
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 26 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	104,572,956.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 1 月 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以中证 500 指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证 500 指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66594319

电子邮箱	investor@igwfm.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	4008888606	95566
传真	0755-22381339	010-66594942
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	丁益	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	-115,548.05
本期利润	27,289,988.80
加权平均基金份额本期利润	0.2260
本期加权平均净值利润率	14.87%
本期基金份额净值增长率	12.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	67,636,608.06
期末可供分配基金份额利润	0.6468
期末基金资产净值	172,209,564.06
期末基金份额净值	1.6468
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	64.68%

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

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

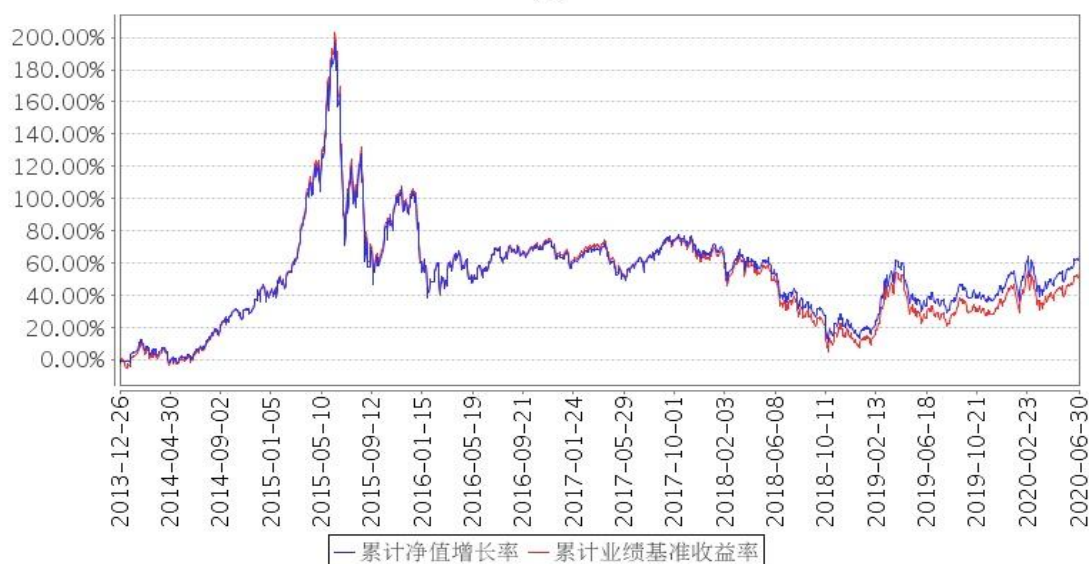
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.65%	0.86%	8.47%	0.88%	0.18%	-0.02%
过去三个月	16.89%	1.10%	16.32%	1.13%	0.57%	-0.03%
过去六个月	12.19%	1.74%	11.33%	1.79%	0.86%	-0.05%
过去一年	19.45%	1.42%	18.46%	1.46%	0.99%	-0.04%
过去三年	2.31%	1.43%	-4.46%	1.47%	6.77%	-0.04%
自基金合同生效起至今	64.68%	1.72%	53.98%	1.75%	10.70%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：本基金的投资组合比例为：本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的建仓期为自 2013 年 12 月 26 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投

投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“公司”或“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。

截至2020年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理96只开放式基金，包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金（LOF）、景顺长城新兴成长混合型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金（QDII）、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深300指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证TMT150交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享

回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金、景顺长城绩优成长混合型证券投资基金、景顺长城中短债债券型证券投资基金、景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型证券投资基金、景顺长城稳健养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城创新成长混合型证券投资基金、景顺长城景泰纯利债券型证券投资基金、景顺长城养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城品质成长混合型证券投资基金、景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、景顺长城泰申回报混合型证券投资基金、景顺长城科技创新混合型证券投资基金、景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景泰裕利纯债债券型证券投资基金、景顺长城核心优选一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城创业板综指增强型证券投资基金、景顺长城成长领航混合型证券投资基金、景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺

长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

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		
曾理	本基金的基金经理	2018 年 10 月 13 日	2020 年 4 月 14 日	6	工学硕士。曾任职于腾讯计算机系统有限公司信息安全部产品策略岗位。2014 年 8 月加入本公司，历任量化及 ETF 投资部量化程序员、量化及指数投资部基金经理助理，自 2018 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理。
张 晓 南	本基金的基金经理	2020 年 4 月 15 日	-	10	经济学硕士，CFA，FRM。曾先后担任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理；2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 投资部基金经理。

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”为根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”为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运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金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 18 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在交易所证券临近交易日同向交易和银行间债券 5 日内反向交易，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。

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

2020 年 5 月工业增加值当月同比 4.40%，前值 3.90%，复苏态势愈加明显。6 月 PMI 指数继续回升至 50.90，在 4 月、5 月下降后开始上升。5 月 PPI 同比-3.70%，环比-0.4%，跌幅扩大；5 月 CPI 同比上涨 2.40%，前值 3.30%，环比-0.8%，基本保持稳定。5 月 M2 同比增速 11.10%，M1 同比增速 6.80%，社会融资规模存量同比增长 3.24%，增速维持平稳。5 月末外汇储备 3.1 万亿美元。一季度受到新冠疫情的突发影响，A 股市场呈现出先跌后涨再跌的走势。二季度在“外防输入、内防反弹”的总体抗疫框架下，国内疫情基本得到控制，经济复苏态势明显。在此期间，上证综指、沪深 300、中证 500 和创业板指数收益率为 8.64%、13.33%、16.65%和 31.05%，行情分化较为明显。

随着新冠疫情在国内逐步得到控制，对国内经济冲击的影响也在逐渐减弱。从最近披露的各种宏观数据来看，基本经济形势已经开始逐渐好转，同时相关政策逐步发力，通过保障生产、促进消费等措施加快经济复苏。当前国外疫情仍未得到有效控制，且后续短期疫情消除的可能性不大，在严格防止疫情反弹并通过境外反向输入的考虑下，相关国家疫情对我国外需的冲击较大，部分加大了经济复苏的难度。今年《政府工作报告》未再提及 GDP 增长目标，取而代之的是把“六稳”、“六保”放在首位，尤其是将稳就业保民生放在首位，根本上也要求促进经济回稳、增长。同时叠加更为积极的财政政策和灵活适度的货币政策，全力为疫情后经济修复保驾护航。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年上半年，本基金份额净值增长率为 12.19%，业绩比较基准收益率为 11.33%。报告期内，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，跟踪误差（年化）控制在 2%以内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，短期疫情在全球蔓延的拐点暂未到来，外需的快速下落和部分产业链受外部较大冲击，对经济有较大影响。但随着《政府工作报告》的逐渐落实，积极财政政策的陆续出台和灵活货币政策的持续宽松，对经济有托底作用，稳就业保民生仍是政策底线。同时对资本市场的改革明确了目标，在科创板试点增量注册制改革的经验积累上，创业板试点存量市场的注册制改革，为全市场分阶段实现注册制改革目标迈出重要一步。中长期来看，虽然疫情对上半年全球经济基本面造成较负面的影响，但考虑到中国在世界产业链中的重要地位，及疫情在中国政府强有力的防控措施下已得到控制，难以对中国中长期经济发展趋势形成实质性影响。我们对市场仍保持乐观，在整体经济复苏加快的基础上，资本市场仍有强大的吸引力。我们继续看好成长股在市场复苏阶段的表现，后续现金流好、股息率高、行业稳定增长且公司地位明确的股票更有优势。

本基金采用完全复制中证 500 指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员

会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,149,598.91	7,332,740.29
结算备付金		-	-
存出保证金		3,335.99	1,964.20
交易性金融资产	6.4.7.2	168,352,762.28	307,454,312.49
其中：股票投资		168,352,762.28	307,454,312.49
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		-	525,661.12
应收利息	6.4.7.5	352.32	1,676.32
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		172,506,049.50	315,316,354.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		303.58	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		70,162.70	129,450.24
应付托管费		14,032.52	25,890.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	52,478.77	85,384.44
应交税费		0.27	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	159,507.60	110,000.00
负债合计		296,485.44	350,724.73
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	104,572,956.00	214,572,956.00
未分配利润	6.4.7.10	67,636,608.06	100,392,673.69
所有者权益合计		172,209,564.06	314,965,629.69
负债和所有者权益总计		172,506,049.50	315,316,354.42

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6468 元，基金份额总额 104,572,956.00 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		28,100,422.58	45,280,992.33
1. 利息收入		14,302.13	23,096.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,290.97	23,084.22
债券利息收入		11.16	11.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		680,343.60	-10,398,168.81
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-561,082.17	-13,082,742.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	20,400.03	5,769.34
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,221,025.74	2,678,803.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	27,405,536.85	55,655,002.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	240.00	1,062.00
减：二、费用		810,433.78	1,193,403.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	455,272.03	692,409.07

2. 托管费	6.4.10.2.2	91,054.41	138,481.82
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	104,146.62	135,391.40
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.03	0.03
7. 其他费用	6.4.7.19	159,960.69	227,121.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,289,988.80	44,087,588.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,289,988.80	44,087,588.52

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	214,572,956.00	100,392,673.69	314,965,629.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	27,289,988.80	27,289,988.80
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）	-110,000,000.00	-60,046,054.43	-170,046,054.43
其中：1. 基金申购款	10,000,000.00	4,595,358.75	14,595,358.75
2. 基金赎回款	-120,000,000.00	-64,641,413.18	-184,641,413.18
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	104,572,956.00	67,636,608.06	172,209,564.06

项目	上年度可比期间		
	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
权益(基金净值)			
一、期初所有者权益(基金净值)	196,572,956.00	29,840,747.62	226,413,703.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	44,087,588.52	44,087,588.52
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)	14,000,000.00	5,794,461.89	19,794,461.89
其中：1. 基金申购款	14,000,000.00	5,794,461.89	19,794,461.89
2. 基金赎回款	-	-	-
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)	210,572,956.00	79,722,798.03	290,295,754.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1501 号《关于核准景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资

金利息共募集人民币 512,538,347.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 887 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 12 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 512,572,956.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 34,609.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股,投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、一级市场新股或增发的股票、衍生工具(股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“景顺长城中证 500ETF 联接基金”)。景顺长城中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2020 年 8 月 20 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	4,149,598.91
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 个月至 1 年	-
存款期限 1 年以上	-
其他存款	-
合计	4,149,598.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	164,139,079.30	168,352,762.28	4,213,682.98
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	164,139,079.30	168,352,762.28	4,213,682.98

注：于 2020 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从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 2020年6月30日
应收活期存款利息	350.97
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	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	1.35
合计	352.32

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	52,478.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	52,478.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

应付证券出借违约金	-
预提费用	89,507.60
应付指数使用费	70,000.00
合计	159,507.60

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	214,572,956.00	214,572,956.00
本期申购	10,000,000.00	10,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-120,000,000.00	-120,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	104,572,956.00	104,572,956.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	229,676,971.97	-129,284,298.28	100,392,673.69
本期利润	-115,548.05	27,405,536.85	27,289,988.80
本期基金份额交易产生的变动数	-117,619,583.69	57,573,529.26	-60,046,054.43
其中：基金申购款	10,249,434.04	-5,654,075.29	4,595,358.75
基金赎回款	-127,869,017.73	63,227,604.55	-64,641,413.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	111,941,840.23	-44,305,232.17	67,636,608.06

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	活期存款利息收入	13,636.89
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	630.54	
其他	23.54	
合计	14,290.97	

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,322,101.94
股票投资收益——赎回差价收入	-4,883,184.11
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	-561,082.17

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	33,806,874.53
减：卖出股票成本总额	29,484,772.59
买卖股票差价收入	4,322,101.94

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	184,641,413.18
减：现金支付赎回款总额	1,679,888.18
减：赎回股票成本总额	187,844,709.11
赎回差价收入	-4,883,184.11

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	67,011.47
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	46,600.00
减：应收利息总额	11.44
买卖债券差价收入	20,400.03

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,221,025.74

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	1,221,025.74

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	27,405,536.85
股票投资	27,405,536.85
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	27,405,536.85

注：本基金本报告期公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益0.00元。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	240.00
合计	240.00

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	104,146.62
银行间市场交易费用	-
合计	104,146.62

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	453.09
指数使用费	70,000.00
合计	159,960.69

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付；标的指数许可使用费方面，本基金当季日均基金资产净值大于人民币 5000 万元时，许可使用基点费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 35,000 元；当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用基点费的收取下限。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
长城证券股份有限公司(“长城证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (“景顺长城中证 500ETF 联接基金”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	23,106,902.60	33.51	38,384,100.29	43.34

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内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 2020年1月1日至2020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	21,520.00	33.51	15,380.05	29.31
关联方名称	上年度可比期间 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	35,745.67	43.34	34,881.22	43.22

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 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	455,272.03	692,409.07
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年
----	------------------------	----------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	91,054.41	138,481.82

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X0.10%/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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
景顺长城中证 500ETF 联接基 金	100,000,000.00	95.63	210,000,000.00	97.87

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国银行	4,149,598.91	13,636.89	6,534,574.43	22,451.80
------	--------------	-----------	--------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末(2020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
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股流通受限	5.00	6.54	18,060	90,300.00	118,112.40	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601880	大连	2020年	重大事	1.72	2020	1.89	105,799	272,310.14	181,974.28	-

	港	6月22日	项停牌		年7月8日					
002470	金正 大	2020年 6月30日	重大事 项停牌	2.27	2020 年7月 1日	2.16	56,100	319,123.26	127,347.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，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

截止本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进

行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金未持有除国债、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（上年末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日

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。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	4,149,598.91	-	-	-	-	-	4,149,598.91
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	3,335.99	-	-	-	-	-	3,335.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	168,352,762.28	168,352,762.28
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	352.32	352.32
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,152,934.90	-	-	-	-	168,353,114.60	172,506,049.50
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	70,162.70	70,162.70
应付托管费	-	-	-	-	-	14,032.52	14,032.52
应付证券清算款	-	-	-	-	-	303.58	303.58
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	52,478.77	52,478.77
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.27	0.27
其他负债	-	-	-	-	-	159,507.60	159,507.60
负债总计	-	-	-	-	-	296,485.44	296,485.44
利率敏感度缺口	4,152,934.90	-	-	-	-	-	-
上年度末 2019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	7,332,740.29	-	-	-	-	-	7,332,740.29
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	1,964.20	-	-	-	-	-	1,964.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	307,454,312.49	307,454,312.49
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	1,676.32	1,676.32
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	525,661.12	525,661.12
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,334,704.49	-	-	-	-	307,981,649.93	315,316,354.42
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	129,450.24	129,450.24
应付托管费	-	-	-	-	-	25,890.05	25,890.05
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	85,384.44	85,384.44
应付利息	-	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	350,724.73	350,724.73
利率敏感度缺口	7,334,704.49	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有债券资产（上年末：同），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。本基金持有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，所面临的重大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。

经测算本基金面临的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 2020年6月30日		上年度末 2019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	168,352,762.28	97.76	307,454,312.49	97.62
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	168,352,762.28	97.76	307,454,312.49	97.62

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		
	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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	8,960,892.87	15,800,299.75
	沪深 300 指数下降 5%	-8,960,892.87	-15,800,299.75

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 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属于第一层次的余额为 167,888,812.88 元，属于第二层次的余额为 463,949.40 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 307,447,734.45 元，第二层次 6,578.04 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31

日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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。

(2)基金申购款

于 2020 年上半年，本基金申购基金份额的对价总额为 14,595,358.75 元(2019 年上半年：19,794,461.89 元)，其中包括以股票支付的申购款 14,482,320.00 元和以现金支付的申购款 113,038.75 元(2019 年上半年：其中包括以股票支付的申购款 19,536,787.00 元和以现金支付的申购款 257,674.89 元)。

(3)除公允价值和基金申购款外，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	168,352,762.28	97.59
	其中：股票	168,352,762.28	97.59
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	4,149,598.91	2.41
8	其他各项资产	3,688.31	0.00
9	合计	172,506,049.50	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	1,484,497.00	0.86
B	采矿业	3,991,286.07	2.32
C	制造业	98,127,779.51	56.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	3,852,308.30	2.24

	业		
E	建筑业	2,187,364.88	1.27
F	批发和零售业	9,205,361.97	5.35
G	交通运输、仓储和邮政业	3,550,929.11	2.06
H	住宿和餐饮业	610,258.00	0.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,919,212.37	10.99
J	金融业	8,617,086.03	5.00
K	房地产业	5,946,959.26	3.45
L	租赁和商务服务业	3,452,883.62	2.01
M	科学研究和技术服务业	1,195,996.50	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	1,623,929.00	0.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	171,561.60	0.10
Q	卫生和社会工作	1,174,150.00	0.68
R	文化、体育和娱乐业	2,595,615.21	1.51
S	综合	1,459,261.80	0.85
	合计	168,166,440.23	97.65

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	161,458.16	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,097.57	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	186,322.05	0.11

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	300253	卫宁健康	56,169	1,288,516.86	0.75
2	002127	南极电商	59,500	1,259,615.00	0.73
3	002821	凯莱英	4,800	1,166,400.00	0.68
4	600201	生物股份	37,987	1,057,558.08	0.61
5	002185	华天科技	76,600	1,036,398.00	0.60
6	300088	长信科技	86,052	963,782.40	0.56
7	600739	辽宁成大	50,600	957,858.00	0.56
8	300558	贝达药业	6,800	951,864.00	0.55
9	002439	启明星辰	22,600	950,782.00	0.55
10	600529	山东药玻	15,700	910,600.00	0.53
11	002131	利欧股份	235,773	910,083.78	0.53
12	600079	人福医药	32,800	892,816.00	0.52
13	300012	华测检测	44,900	887,224.00	0.52
14	002385	大北农	96,900	882,759.00	0.51
15	300285	国瓷材料	25,800	864,558.00	0.50
16	600298	安琪酵母	17,300	856,004.00	0.50
17	600521	华海药业	24,600	834,678.00	0.48
18	603444	吉比特	1,500	823,515.00	0.48
19	002465	海格通信	62,200	804,868.00	0.47
20	600161	天坛生物	17,622	798,805.26	0.46
21	600143	金发科技	59,800	787,566.00	0.46
22	002075	沙钢股份	61,400	767,500.00	0.45
23	002074	国轩高科	28,300	759,572.00	0.44
24	000009	中国宝安	89,080	758,070.80	0.44

25	603517	绝味食品	10,700	756,918.00	0.44
26	300496	中科创达	9,700	753,690.00	0.44
27	002212	南洋股份	28,200	749,556.00	0.44
28	601099	太平洋	234,400	743,048.00	0.43
29	002223	鱼跃医疗	20,226	736,226.40	0.43
30	002273	水晶光电	42,724	732,289.36	0.43
31	300595	欧普康视	10,500	728,070.00	0.42
32	000636	风华高科	24,643	719,329.17	0.42
33	300207	欣旺达	37,600	710,640.00	0.41
34	601128	常熟银行	94,300	708,193.00	0.41
35	300482	万孚生物	6,800	707,200.00	0.41
36	300418	昆仑万维	27,700	691,392.00	0.40
37	600426	华鲁恒升	39,056	690,510.08	0.40
38	300315	掌趣科技	93,800	687,554.00	0.40
39	002507	涪陵榨菜	18,700	673,387.00	0.39
40	300357	我武生物	10,700	666,075.00	0.39
41	000988	华工科技	27,159	663,494.37	0.39
42	603882	金域医学	7,400	662,300.00	0.38
43	002340	格林美	132,742	659,727.74	0.38
44	603939	益丰药房	7,240	658,840.00	0.38
45	002414	高德红外	22,210	650,308.80	0.38
46	000975	银泰黄金	41,224	646,392.32	0.38
47	300212	易华录	11,500	644,000.00	0.37
48	300168	万达信息	28,900	637,823.00	0.37
49	600699	均胜电子	26,780	637,631.80	0.37
50	300271	华宇软件	22,400	631,904.00	0.37
51	002373	千方科技	26,000	623,740.00	0.36
52	002353	杰瑞股份	19,900	616,900.00	0.36
53	600885	宏发股份	15,320	614,638.40	0.36
54	000547	航天发展	44,600	609,682.00	0.35
55	601799	星宇股份	4,800	609,600.00	0.35
56	600132	重庆啤酒	8,300	605,900.00	0.35
57	002156	通富微电	24,100	603,705.00	0.35
58	002603	以岭药业	19,100	595,729.00	0.35
59	000513	丽珠集团	12,303	590,667.03	0.34
60	002019	亿帆医药	25,600	588,032.00	0.34
61	300024	机器人	42,600	582,342.00	0.34
62	002797	第一创业	83,600	578,512.00	0.34
63	300009	安科生物	31,860	570,294.00	0.33
64	300316	晶盛机电	22,900	566,546.00	0.33
65	000750	国海证券	130,190	565,024.60	0.33
66	300017	网宿科技	66,300	562,887.00	0.33

67	002250	联化科技	25,774	561,873.20	0.33
68	600801	华新水泥	23,651	560,765.21	0.33
69	002174	游族网络	21,400	558,112.00	0.32
70	002138	顺络电子	22,300	556,385.00	0.32
71	600315	上海家化	11,600	555,640.00	0.32
72	000021	深科技	25,430	555,136.90	0.32
73	600895	张江高科	27,200	554,064.00	0.32
74	002195	二三四五	196,922	553,350.82	0.32
75	603858	步长制药	19,000	548,150.00	0.32
76	002557	洽洽食品	10,100	547,319.00	0.32
77	600380	健康元	33,592	545,534.08	0.32
78	603233	大参林	6,716	545,473.52	0.32
79	600859	王府井	11,964	544,960.20	0.32
80	000050	深天马 A	35,400	543,744.00	0.32
81	002572	索菲亚	22,400	541,408.00	0.31
82	000401	冀东水泥	33,317	534,404.68	0.31
83	300070	碧水源	65,800	534,296.00	0.31
84	002152	广电运通	41,200	533,128.00	0.31
85	002030	达安基因	19,409	529,477.52	0.31
86	300058	蓝色光标	67,300	524,940.00	0.30
87	000998	隆平高科	31,500	524,475.00	0.30
88	600667	太极实业	44,000	520,080.00	0.30
89	600410	华胜天成	38,223	519,832.80	0.30
90	600486	扬农化工	6,300	519,750.00	0.30
91	600845	宝信软件	8,790	519,313.20	0.30
92	300244	迪安诊断	14,500	511,850.00	0.30
93	002500	山西证券	78,260	511,820.40	0.30
94	603338	浙江鼎力	6,700	507,659.00	0.29
95	002078	太阳纸业	53,226	506,711.52	0.29
96	000623	吉林敖东	31,600	497,068.00	0.29
97	600642	申能股份	84,100	497,031.00	0.29
98	600535	天士力	30,600	496,332.00	0.29
99	000630	铜陵有色	257,100	496,203.00	0.29
100	600155	华创阳安	41,300	495,187.00	0.29
101	002396	星网锐捷	14,000	494,620.00	0.29
102	002013	中航机电	62,200	491,380.00	0.29
103	600037	歌华有线	32,300	490,960.00	0.29
104	002690	美亚光电	9,300	489,180.00	0.28
105	600153	建发股份	60,100	486,810.00	0.28
106	002511	中顺洁柔	21,800	486,140.00	0.28
107	300274	阳光电源	33,720	485,230.80	0.28
108	600126	杭钢股份	46,640	485,056.00	0.28

109	600879	航天电子	75,192	484,236.48	0.28
110	601233	桐昆股份	37,900	483,604.00	0.28
111	603707	健友股份	7,400	477,818.00	0.28
112	300010	立思辰	24,400	477,508.00	0.28
113	002926	华西证券	44,800	476,224.00	0.28
114	600415	小商品城	96,000	467,520.00	0.27
115	002382	蓝帆医疗	15,400	463,694.00	0.27
116	000739	普洛药业	19,900	463,471.00	0.27
117	002281	光迅科技	13,969	459,021.34	0.27
118	600884	杉杉股份	38,744	456,791.76	0.27
119	603659	璞泰来	4,400	453,288.00	0.26
120	300251	光线传媒	41,500	452,765.00	0.26
121	001914	招商积余	14,600	448,658.00	0.26
122	600216	浙江医药	23,100	444,906.00	0.26
123	600811	东方集团	100,450	443,989.00	0.26
124	600167	联美控股	30,940	443,679.60	0.26
125	600728	佳都科技	48,200	439,102.00	0.25
126	002268	卫士通	20,420	435,762.80	0.25
127	300001	特锐德	20,800	435,552.00	0.25
128	600804	鹏博士	48,500	435,530.00	0.25
129	002028	思源电气	21,120	432,115.20	0.25
130	300115	长盈精密	18,880	431,408.00	0.25
131	600779	水井坊	6,900	430,698.00	0.25
132	000581	威孚高科	20,500	423,940.00	0.25
133	600909	华安证券	61,800	422,094.00	0.25
134	600511	国药股份	10,186	414,264.62	0.24
135	000686	东北证券	48,900	413,205.00	0.24
136	600325	华发股份	58,512	413,094.72	0.24
137	002294	信立泰	13,900	412,274.00	0.24
138	601689	拓普集团	14,720	410,688.00	0.24
139	300002	神州泰岳	65,800	407,302.00	0.24
140	600528	中铁工业	46,000	405,720.00	0.24
141	600460	士兰微	27,342	401,380.56	0.23
142	600446	金证股份	20,500	397,700.00	0.23
143	002242	九阳股份	10,649	396,888.23	0.23
144	000997	新大陆	24,752	395,536.96	0.23
145	600733	北汽蓝谷	61,000	392,230.00	0.23
146	600418	江淮汽车	44,362	391,716.46	0.23
147	603883	老百姓	3,900	390,156.00	0.23
148	600959	江苏有线	102,700	386,152.00	0.22
149	601168	西部矿业	66,200	383,960.00	0.22
150	600827	百联股份	26,500	382,925.00	0.22

151	000999	华润三九	13,100	382,389.00	0.22
152	600256	广汇能源	141,300	381,510.00	0.22
153	002317	众生药业	22,173	380,488.68	0.22
154	600598	北大荒	23,600	379,960.00	0.22
155	002368	太极股份	8,680	379,229.20	0.22
156	000878	云南铜业	35,700	378,777.00	0.22
157	603605	珀莱雅	2,100	378,042.00	0.22
158	600260	凯乐科技	27,731	374,923.12	0.22
159	603000	人民网	18,900	374,787.00	0.22
160	300296	利亚德	61,500	373,305.00	0.22
161	002387	维信诺	26,100	372,708.00	0.22
162	603806	福斯特	7,462	372,428.42	0.22
163	600820	隧道股份	65,200	368,380.00	0.21
164	002081	金螳螂	46,800	367,848.00	0.21
165	600704	物产中大	87,300	367,533.00	0.21
166	600839	四川长虹	127,100	364,777.00	0.21
167	600497	驰宏锌锗	105,900	364,296.00	0.21
168	300630	普利制药	4,900	362,355.00	0.21
169	002670	国盛金控	39,601	362,349.15	0.21
170	300166	东方国信	29,118	361,354.38	0.21
171	600673	东阳光	51,700	357,247.00	0.21
172	002920	德赛西威	5,800	355,714.00	0.21
173	000564	供销大集	79,000	354,710.00	0.21
174	002080	中材科技	22,800	353,400.00	0.21
175	600008	首创股份	116,800	351,568.00	0.20
176	603866	桃李面包	6,900	351,141.00	0.20
177	600549	厦门钨业	29,400	348,096.00	0.20
178	300618	寒锐钴业	5,600	347,312.00	0.20
179	600572	康恩贝	63,099	347,044.50	0.20
180	000158	常山北明	33,210	346,712.40	0.20
181	300113	顺网科技	13,600	345,440.00	0.20
182	600718	东软集团	30,000	345,000.00	0.20
183	002221	东华能源	39,004	342,845.16	0.20
184	600875	东方电气	38,700	342,495.00	0.20
185	601179	中国西电	70,700	342,188.00	0.20
186	002124	天邦股份	26,600	341,810.00	0.20
187	601966	玲珑轮胎	16,900	341,380.00	0.20
188	002217	合力泰	64,900	340,725.00	0.20
189	000729	燕京啤酒	49,300	337,705.00	0.20
190	600171	上海贝岭	19,302	335,468.76	0.19
191	000800	一汽解放	31,200	335,088.00	0.19
192	600021	上海电力	45,200	334,480.00	0.19

193	600060	海信视像	27,500	334,125.00	0.19
194	600881	亚泰集团	112,710	327,986.10	0.19
195	600567	山鹰纸业	111,100	327,745.00	0.19
196	600754	锦江酒店	11,800	327,450.00	0.19
197	600094	大名城	55,000	327,250.00	0.19
198	002831	裕同科技	11,820	325,168.20	0.19
199	300026	红日药业	58,902	325,139.04	0.19
200	000877	天山股份	21,495	324,574.50	0.19
201	002056	横店东磁	28,564	321,345.00	0.19
202	600160	巨化股份	46,620	321,211.80	0.19
203	000060	中金岭南	86,100	320,292.00	0.19
204	600862	中航高科	18,900	319,788.00	0.19
205	002709	天赐材料	9,420	318,301.80	0.18
206	600597	光明乳业	21,200	315,032.00	0.18
207	603228	景旺电子	8,952	315,020.88	0.18
208	600026	中远海能	48,170	311,178.20	0.18
209	002429	兆驰股份	62,500	309,375.00	0.18
210	600645	中源协和	10,930	308,772.50	0.18
211	002399	海普瑞	12,300	307,992.00	0.18
212	600580	卧龙电驱	27,277	306,593.48	0.18
213	600967	内蒙一机	29,401	305,476.39	0.18
214	600392	盛和资源	43,295	305,229.75	0.18
215	000629	攀钢钒钛	151,200	303,912.00	0.18
216	300133	华策影视	41,900	303,775.00	0.18
217	603568	伟明环保	13,015	301,948.00	0.18
218	601005	重庆钢铁	201,900	300,831.00	0.17
219	600273	嘉化能源	34,300	299,782.00	0.17
220	000090	天健集团	43,370	299,686.70	0.17
221	603712	七一二	7,800	299,364.00	0.17
222	000960	锡业股份	34,700	297,032.00	0.17
223	002458	益生股份	19,400	296,238.00	0.17
224	002085	万丰奥威	45,700	296,136.00	0.17
225	002648	卫星石化	18,200	296,114.00	0.17
226	002233	塔牌集团	24,581	295,709.43	0.17
227	600039	四川路桥	77,139	294,670.98	0.17
228	002807	江阴银行	74,880	294,278.40	0.17
229	600755	厦门国贸	44,502	293,713.20	0.17
230	000970	中科三环	29,900	292,422.00	0.17
231	002203	海亮股份	33,400	292,250.00	0.17
232	600563	法拉电子	4,719	291,634.20	0.17
233	600282	南钢股份	90,200	291,346.00	0.17
234	000598	兴蓉环境	63,100	290,260.00	0.17

235	002004	华邦健康	53,610	288,421.80	0.17
236	600166	福田汽车	159,900	287,820.00	0.17
237	300324	旋极信息	42,932	285,927.12	0.17
238	600195	中牧股份	17,556	284,933.88	0.17
239	600737	中粮糖业	36,600	284,748.00	0.17
240	000778	新兴铸管	82,800	284,004.00	0.16
241	601118	海南橡胶	58,400	283,824.00	0.16
242	002110	三钢闽光	42,550	283,383.00	0.16
243	600258	首旅酒店	18,400	282,808.00	0.16
244	300474	景嘉微	4,200	282,660.00	0.16
245	600064	南京高科	29,058	282,443.76	0.16
246	000690	宝新能源	59,651	281,552.72	0.16
247	600466	蓝光发展	52,020	280,387.80	0.16
248	600566	济川药业	11,000	280,060.00	0.16
249	603816	顾家家居	6,220	279,962.20	0.16
250	601975	招商南油	117,100	279,869.00	0.16
251	002925	盈趣科技	4,800	278,112.00	0.16
252	000400	许继电气	20,994	277,120.80	0.16
253	002635	安洁科技	11,050	275,145.00	0.16
254	002506	协鑫集成	105,400	275,094.00	0.16
255	000089	深圳机场	35,700	273,462.00	0.16
256	000738	航发控制	20,000	273,000.00	0.16
257	002745	木林森	17,700	272,757.00	0.16
258	000402	金融街	41,000	272,240.00	0.16
259	002048	宁波华翔	17,611	271,913.84	0.16
260	600515	海航基础	52,200	271,440.00	0.16
261	600808	马钢股份	104,900	270,642.00	0.16
262	000967	盈峰环境	32,700	269,775.00	0.16
263	300182	捷成股份	67,600	269,724.00	0.16
264	002092	中泰化学	59,500	269,535.00	0.16
265	600435	北方导航	35,520	268,531.20	0.16
266	002038	双鹭药业	20,850	267,088.50	0.16
267	002183	怡亚通	49,700	266,392.00	0.15
268	000983	西山煤电	70,750	265,312.50	0.15
269	601106	中国一重	94,400	265,264.00	0.15
270	601860	紫金银行	62,600	264,798.00	0.15
271	002595	豪迈科技	13,600	264,656.00	0.15
272	600643	爱建集团	33,278	264,560.10	0.15
273	000681	视觉中国	14,200	264,404.00	0.15
274	600120	浙江东方	38,464	264,247.68	0.15
275	000039	中集集团	36,460	263,605.80	0.15
276	002191	劲嘉股份	29,574	263,504.34	0.15

277	000830	鲁西化工	35,307	263,390.22	0.15
278	600373	中文传媒	22,300	262,694.00	0.15
279	601333	广深铁路	116,700	262,575.00	0.15
280	600376	首开股份	44,700	261,942.00	0.15
281	000825	太钢不锈	78,500	260,620.00	0.15
282	601098	中南传媒	24,600	260,268.00	0.15
283	600633	浙数文化	26,500	259,170.00	0.15
284	600388	龙净环保	29,400	258,720.00	0.15
285	600649	城投控股	43,500	258,390.00	0.15
286	000415	渤海租赁	86,500	257,770.00	0.15
287	600729	重庆百货	8,200	256,004.00	0.15
288	600675	中华企业	62,800	255,596.00	0.15
289	002372	伟星新材	21,960	255,394.80	0.15
290	000563	陕国投 A	68,730	254,988.30	0.15
291	000930	中粮科技	37,288	254,677.04	0.15
292	600056	中国医药	17,998	254,671.70	0.15
293	601866	中远海发	137,800	253,552.00	0.15
294	002407	多氟多	23,700	252,168.00	0.15
295	600776	东方通信	16,700	252,003.00	0.15
296	002839	张家港行	43,400	249,984.00	0.15
297	300180	华峰超纤	29,200	249,952.00	0.15
298	002815	崇达技术	12,300	248,829.00	0.14
299	601718	际华集团	74,500	247,340.00	0.14
300	000012	南玻 A	49,204	247,004.08	0.14
301	002010	传化智联	45,100	245,344.00	0.14
302	600022	山东钢铁	189,810	244,854.90	0.14
303	002064	华峰氨纶	48,100	243,867.00	0.14
304	000501	鄂武商 A	15,529	243,494.72	0.14
305	603077	和邦生物	183,843	242,672.76	0.14
306	600266	城建发展	47,640	241,534.80	0.14
307	002640	跨境通	37,100	240,779.00	0.14
308	000932	华菱钢铁	63,700	240,149.00	0.14
309	600500	中化国际	47,090	238,275.40	0.14
310	002375	亚厦股份	23,100	236,082.00	0.14
311	002583	海能达	31,100	236,049.00	0.14
312	000883	湖北能源	67,000	235,840.00	0.14
313	601699	潞安环能	42,300	235,611.00	0.14
314	000807	云铝股份	54,000	235,440.00	0.14
315	000685	中山公用	30,544	235,188.80	0.14
316	601615	明阳智能	18,700	232,815.00	0.14
317	600062	华润双鹤	17,540	231,878.80	0.13
318	000559	万向钱潮	47,900	231,836.00	0.13

319	000301	东方盛虹	41,600	231,296.00	0.13
320	000028	国药一致	5,138	231,261.38	0.13
321	600316	洪都航空	14,600	230,680.00	0.13
322	000078	海王生物	54,950	230,240.50	0.13
323	603486	科沃斯	7,620	230,200.20	0.13
324	000959	首钢股份	53,500	230,050.00	0.13
325	002244	滨江集团	53,824	229,828.48	0.13
326	601000	唐山港	103,011	229,714.53	0.13
327	002936	郑州银行	66,660	229,310.40	0.13
328	000519	中兵红箭	24,327	229,160.34	0.13
329	002155	湖南黄金	29,000	228,520.00	0.13
330	000027	深圳能源	49,120	227,916.80	0.13
331	000528	柳工	35,900	226,529.00	0.13
332	000488	晨鸣纸业	45,795	226,227.30	0.13
333	600782	新钢股份	55,000	224,400.00	0.13
334	000031	大悦城	43,857	223,232.13	0.13
335	600908	无锡银行	44,700	219,477.00	0.13
336	000987	越秀金控	18,700	218,042.00	0.13
337	600640	号百控股	10,928	218,013.60	0.13
338	002440	闰土股份	23,700	216,618.00	0.13
339	002444	巨星科技	18,211	216,346.68	0.13
340	002266	浙富控股	55,845	216,120.15	0.13
341	600777	新潮能源	140,700	213,864.00	0.12
342	601717	郑煤机	36,110	212,687.90	0.12
343	002625	光启技术	28,900	209,525.00	0.12
344	600073	上海梅林	22,000	208,780.00	0.12
345	600312	平高电气	27,900	207,018.00	0.12
346	000156	华数传媒	19,100	206,853.00	0.12
347	000898	鞍钢股份	84,400	206,780.00	0.12
348	300459	金科文化	59,598	205,613.10	0.12
349	601608	中信重工	60,100	205,542.00	0.12
350	000758	中色股份	49,100	205,238.00	0.12
351	002390	信邦制药	44,800	204,288.00	0.12
352	601958	金钼股份	33,000	203,940.00	0.12
353	002701	奥瑞金	48,420	202,879.80	0.12
354	002434	万里扬	23,300	202,244.00	0.12
355	600138	中青旅	20,426	201,604.62	0.12
356	300072	三聚环保	47,100	201,588.00	0.12
357	000046	泛海控股	53,200	200,564.00	0.12
358	000887	中鼎股份	25,400	199,390.00	0.12
359	002424	贵州百灵	24,000	199,200.00	0.12
360	600291	西水股份	22,000	199,100.00	0.12

361	002563	森马服饰	28,200	198,810.00	0.12
362	000008	神州高铁	67,500	198,450.00	0.12
363	600409	三友化工	42,394	197,556.04	0.11
364	600765	中航重机	19,189	196,111.58	0.11
365	600863	内蒙华电	79,600	195,816.00	0.11
366	600557	康缘药业	14,034	195,353.28	0.11
367	600751	海航科技	62,200	194,686.00	0.11
368	601228	广州港	63,700	193,648.00	0.11
369	600507	方大特钢	37,232	193,234.08	0.11
370	002002	鸿达兴业	53,377	192,690.97	0.11
371	000712	锦龙股份	15,400	192,500.00	0.11
372	600259	广晟有色	6,400	192,000.00	0.11
373	600639	浦东金桥	12,012	191,951.76	0.11
374	002505	大康农业	85,170	191,632.50	0.11
375	600970	中材国际	36,250	191,400.00	0.11
376	002589	瑞康医药	35,570	190,655.20	0.11
377	601200	上海环境	15,740	188,880.00	0.11
378	603885	吉祥航空	20,700	188,370.00	0.11
379	600158	中体产业	23,001	188,148.18	0.11
380	600835	上海机电	11,094	187,821.42	0.11
381	600545	卓郎智能	39,395	186,338.35	0.11
382	000826	启迪环境	24,900	184,758.00	0.11
383	300134	大富科技	13,200	184,536.00	0.11
384	600717	天津港	41,392	182,952.64	0.11
385	000813	德展健康	29,500	182,900.00	0.11
386	600648	外高桥	12,900	182,406.00	0.11
387	601880	大连港	105,799	181,974.28	0.11
388	603198	迎驾贡酒	8,300	180,691.00	0.10
389	600478	科力远	38,100	179,451.00	0.10
390	002249	大洋电机	49,657	179,261.77	0.10
391	601928	凤凰传媒	26,000	176,800.00	0.10
392	601598	中国外运	54,700	176,681.00	0.10
393	600348	阳泉煤业	41,700	175,974.00	0.10
394	002503	搜于特	62,198	174,776.38	0.10
395	600125	铁龙物流	31,287	174,581.46	0.10
396	603377	东方时尚	10,360	171,561.60	0.10
397	600823	世茂股份	38,300	171,201.00	0.10
398	000732	泰禾集团	33,600	171,024.00	0.10
399	601611	中国核建	27,400	169,332.00	0.10
400	600329	中新药业	9,755	168,956.60	0.10
401	002665	首航高科	69,135	168,689.40	0.10
402	002302	西部建设	17,500	168,000.00	0.10

403	300376	易事特	32,200	167,440.00	0.10
404	600582	天地科技	57,100	167,303.00	0.10
405	600307	酒钢宏兴	108,600	167,244.00	0.10
406	002901	大博医疗	1,400	167,006.00	0.10
407	000061	农产品	22,400	165,984.00	0.10
408	000990	诚志股份	12,900	163,701.00	0.10
409	002867	周大生	7,300	161,841.00	0.09
410	600748	上实发展	31,646	161,711.06	0.09
411	000718	苏宁环球	52,000	160,680.00	0.09
412	603888	新华网	7,150	159,874.00	0.09
413	600017	日照港	64,080	159,559.20	0.09
414	600141	兴发集团	17,820	159,489.00	0.09
415	600901	江苏租赁	30,600	159,426.00	0.09
416	000717	韶钢松山	41,900	159,220.00	0.09
417	002544	杰赛科技	12,100	159,115.00	0.09
418	000062	深圳华强	10,850	157,759.00	0.09
419	000543	皖能电力	39,241	157,748.82	0.09
420	601678	滨化股份	37,124	157,405.76	0.09
421	000869	张裕A	4,600	157,090.00	0.09
422	002093	国脉科技	17,591	155,680.35	0.09
423	002419	天虹股份	16,300	155,665.00	0.09
424	600277	亿利洁能	47,500	154,850.00	0.09
425	002128	露天煤业	19,931	154,465.25	0.09
426	600664	哈药股份	50,070	154,215.60	0.09
427	600869	智慧能源	38,472	153,888.00	0.09
428	002416	爱施德	21,340	153,221.20	0.09
429	000848	承德露露	21,825	152,775.00	0.09
430	300257	开山股份	11,573	151,259.11	0.09
431	002408	齐翔腾达	24,163	150,052.23	0.09
432	002653	海思科	5,500	146,355.00	0.08
433	300197	铁汉生态	56,800	144,272.00	0.08
434	002948	青岛银行	28,300	144,047.00	0.08
435	603328	依顿电子	13,800	143,934.00	0.08
436	603515	欧普照明	5,240	143,418.80	0.08
437	600565	迪马股份	51,100	142,569.00	0.08
438	000553	安道麦A	15,800	142,516.00	0.08
439	603983	丸美股份	1,600	137,648.00	0.08
440	603650	彤程新材	5,900	137,293.00	0.08
441	000537	广宇发展	18,800	137,240.00	0.08
442	603056	德邦股份	10,100	136,653.00	0.08
443	603766	隆鑫通用	35,148	136,022.76	0.08
444	600350	山东高速	22,100	135,694.00	0.08

445	601019	山东出版	21,300	133,125.00	0.08
446	002491	通鼎互联	26,000	133,120.00	0.08
447	600787	中储股份	30,224	132,683.36	0.08
448	600339	中油工程	58,100	131,887.00	0.08
449	600053	九鼎投资	4,400	131,296.00	0.08
450	600770	综艺股份	27,100	130,080.00	0.08
451	601869	长飞光纤	4,200	129,402.00	0.08
452	601139	深圳燃气	19,900	129,350.00	0.08
453	603317	天味食品	2,320	128,945.60	0.07
454	002470	*ST 金正	56,100	127,347.00	0.07
455	000600	建投能源	25,000	127,250.00	0.07
456	600338	西藏珠峰	12,520	125,200.00	0.07
457	002051	中工国际	16,940	123,323.20	0.07
458	601016	节能风电	57,700	122,324.00	0.07
459	600657	信达地产	29,510	121,581.20	0.07
460	600694	大商股份	5,000	119,950.00	0.07
461	600985	淮北矿业	15,000	116,850.00	0.07
462	002285	世联行	41,703	116,351.37	0.07
463	002118	紫鑫药业	26,120	115,972.80	0.07
464	600707	彩虹股份	25,200	114,912.00	0.07
465	600428	中远海特	36,743	113,168.44	0.07
466	603786	科博达	1,500	113,025.00	0.07
467	600006	东风汽车	27,900	112,437.00	0.07
468	600575	淮河能源	53,700	112,233.00	0.07
469	000937	冀中能源	36,700	110,834.00	0.06
470	601865	福莱特	5,700	107,160.00	0.06
471	600757	长江传媒	20,669	105,205.21	0.06
472	601801	皖新传媒	18,900	105,084.00	0.06
473	600996	贵广网络	14,200	101,246.00	0.06
474	600874	创业环保	15,079	100,124.56	0.06
475	600623	华谊集团	19,200	99,072.00	0.06
476	603556	海兴电力	6,730	97,181.20	0.06
477	002941	新疆交建	6,700	94,805.00	0.06
478	600058	五矿发展	14,900	89,996.00	0.05
479	603868	飞科电器	1,700	83,861.00	0.05
480	000785	居然之家	10,000	79,200.00	0.05
481	601003	柳钢股份	17,700	78,411.00	0.05
482	600903	贵州燃气	7,700	75,768.00	0.04
483	601127	小康股份	9,000	74,790.00	0.04
484	002946	新乳业	4,200	72,870.00	0.04
485	000025	特力A	3,955	72,495.15	0.04
486	600335	国机汽车	15,151	69,997.62	0.04

487	601969	海南矿业	14,200	69,296.00	0.04
488	603355	莱克电气	2,700	67,203.00	0.04
489	601512	中新集团	5,600	64,400.00	0.04
490	002818	富森美	5,180	63,714.00	0.04
491	603379	三美股份	2,880	61,833.60	0.04
492	603225	新凤鸣	5,872	58,602.56	0.03
493	601811	新华文轩	5,400	54,918.00	0.03
494	002423	中粮资本	6,300	54,810.00	0.03
495	001872	招商港口	3,600	52,380.00	0.03
496	603025	大豪科技	6,453	46,913.31	0.03
497	600917	重庆燃气	6,500	46,410.00	0.03
498	601068	中铝国际	10,700	41,837.00	0.02
499	603256	宏和科技	3,300	37,752.00	0.02
500	002957	科瑞技术	1,400	33,460.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603087	甘李药业	538	53,961.40	0.03
2	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.02
3	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.02
4	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
5	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
6	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
7	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.01
8	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
9	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
10	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
11	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	002185	华天科技	1,068,347.00	0.34
2	300558	贝达药业	827,029.00	0.26
3	600529	山东药玻	809,477.00	0.26
4	300357	我武生物	693,337.00	0.22
5	300595	欧普康视	666,723.00	0.21
6	300482	万孚生物	665,389.00	0.21
7	300496	中科创达	651,628.00	0.21
8	300271	华宇软件	621,609.00	0.20

9	002156	通富微电	610,314.00	0.19
10	300017	网宿科技	601,753.00	0.19
11	002557	洽洽食品	595,620.00	0.19
12	300024	机器人	581,022.00	0.18
13	300212	易华录	562,580.00	0.18
14	600667	太极实业	550,594.00	0.17
15	600153	建发股份	548,924.00	0.17
16	300070	碧水源	548,134.00	0.17
17	002138	顺络电子	548,001.00	0.17
18	300088	长信科技	538,761.00	0.17
19	000630	铜陵有色	517,858.00	0.16
20	002396	星网锐捷	495,013.00	0.16

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600745	闻泰科技	1,510,191.00	0.48
2	300014	亿纬锂能	1,483,956.73	0.47
3	002371	北方华创	1,349,033.72	0.43
4	002129	中环股份	1,169,708.00	0.37
5	600763	通策医疗	1,156,213.00	0.37
6	600584	长电科技	1,128,365.84	0.36
7	002384	东山精密	1,117,108.07	0.35
8	300529	健帆生物	1,073,310.80	0.34
9	002463	沪电股份	1,031,877.67	0.33
10	300383	光环新网	1,005,677.00	0.32
11	002049	紫光国微	979,608.00	0.31
12	002812	恩捷股份	886,539.50	0.28
13	600536	中国软件	838,664.87	0.27
14	000066	中国长城	826,331.16	0.26
15	002065	东华软件	783,521.00	0.25
16	601100	恒立液压	724,295.00	0.23
17	601872	招商轮船	633,273.00	0.20
18	002180	纳思达	592,510.00	0.19
19	603444	吉比特	590,546.00	0.19
20	300308	中际旭创	571,500.40	0.18

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	36,340,074.64
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	33,806,874.53
--------------	---------------

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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、处罚处罚的情形

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在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	3,335.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	352.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,688.31

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

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
276	378,887.52	2,000,000.00	1.91	2,572,956.00	2.46

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
景顺长城中证 500 交易型开放式指数证 券投资基金联接基金	100,000,000.00	95.63

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国银行股份有限公司—景顺 长城中证 500 交易型开放式指 数证券投资基金联接基金	100,000,000	95.63
2	中国证券金融股份有限公司	2,000,000	1.91
3	钱中明	570,681	0.55
4	叶剑霞	330,000	0.32
5	杜培新	129,500	0.12
6	孙飞	100,000	0.10
7	陈建仁	93,800	0.09
8	沈健美	78,000	0.07
9	陈伟国	66,501	0.06
10	曾宇锋	55,100	0.05
11	高伟煊	49,000	0.05

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

- 1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
- 2、本期末本基金的基金经理未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2013 年 12 月 26 日) 基金份额总额	512,572,956.00
本报告期期初基金份额总额	214,572,956.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	120,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少)	-

以“-”填列)	
本报告期末基金份额总额	104,572,956.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2020 年 1 月 22 日发布公告，因丁益董事长退休，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。

2、本基金管理人于 2020 年 3 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，聘任李黎女士担任本公司副总经理。

3、本基金管理人于 2020 年 5 月 28 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，同意吴建军先生辞去本公司首席信息官一职，聘任张明先生担任本公司首席信息官。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。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：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

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

本报告期内本基金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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门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	
东方证券股份有限公司	2	45,848,991.88	66.49%	42,699.32	66.49%	-
长城证券股份有限公司	3	23,106,902.60	33.51%	21,520.00	33.51%	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
中信建投证	2	-	-	-	-	-

券股份有限 公司						
中信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准：

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

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
东方证券股份 有限公司	67,011.47	100.00%	-	-	-	-
长城证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
华泰证券股份 有限公司						
华西证券股份 有限公司						
平安证券股份 有限公司						
信达证券股份 有限公司						
招商证券股份 有限公司						
浙商证券股份 有限公司						
中国国际金融 股份有限公司						
中国银河证券 股份有限公司						
中泰证券股份 有限公司						
中信建投证券 股份有限公司						
中信证券股份 有限公司						

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于调整景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费收费方案的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 15 日
2	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 15 日
3	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 15 日
4	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 21 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 21 日
6	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	2020 年 1 月 22 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于可对旗下交易型开放式指数证券投资基金	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 22 日

	设置赎回上限的公告		
8	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 30 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 31 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 2 月 3 日
11	景顺长城基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 2 月 6 日
12	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	2020 年 3 月 6 日
13	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 19 日
14	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 20 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 30 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 7 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 15 日
18	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 17 日
19	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 17 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 20 日
21	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 20 日
22	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道暂停支付	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 29 日

	的公告		
25	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道恢复支付的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 30 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 15 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（首席信息官）变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 28 日
28	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 30 日
29	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 30 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
本基金的联接基金	1	20200101-20200630	210,000,000.00	10,000,000.00	120,000,000.00	100,000,000.00	95.63

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

- (1) 基金在短期内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- (2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- (3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- (4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
- (5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
- (6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据中证指数有限公司下发的《关于国内市场 A 股 ETF 收费调整的通知》以及基金合同的有关规定，本公司决定自 2020 年第一季度起，对本基金的指数许可使用费收费方案进行调整，调整方案如下：本基金当季日均基金资产净值大于人民币 5000 万元时，许可使用基点费的收取下限调整为每季度人民币 3.5 万元（大写：叁万伍仟圆整），当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用基点费的收取下限。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 1 月 15 日发布的《关于调整景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费收费方案的公告》。

2、自 2020 年 2 月 3 日起，本基金可根据基金运作情况、市场变化、投资者需求等设置基金赎回上限，申购、赎回规则参照中国证券登记结算有限责任公司的规定，具体信息以基金管理人在证券交易所公告的申购赎回清单为准。有关详细信息参见本基金管理人于 2020 年 1 月 22 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于可对旗下交易型开放式指数证券投资基金设置赎回上限的公告》。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2020 年 8 月 24 日