

# 景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

## 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 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
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
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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 .....	44
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 .....	44
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 .....	44
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 .....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	46
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
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 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500 指数增强
场内简称	无
基金主代码	006682
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 3 月 25 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	360,334,537.23 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>4、权证、股指期货投资策略</p> <p>本基金可投资权证、股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。</p> <p>本基金对权证的分析判断主要从市场环境、时机、权证定价、市场供求、发行人资质、交易冲击等方面综合考量，运用权证定价模型计算权证当前的合理价格。本基金适时选择具有相对优势的权证并制定相应的投资计划。</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，</p>

	<p>主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>5、中小企业私募债券的投资策略</p> <p>对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金会加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	86,155,265.35
本期利润	61,616,024.45
加权平均基金份额本期利润	0.1029
本期加权平均净值利润率	10.27%
本期基金份额净值增长率	10.44%
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	26,421,422.82
期末可供分配基金份额利润	0.0733
期末基金资产净值	395,167,752.62
期末基金份额净值	1.0966
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	9.66%

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

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

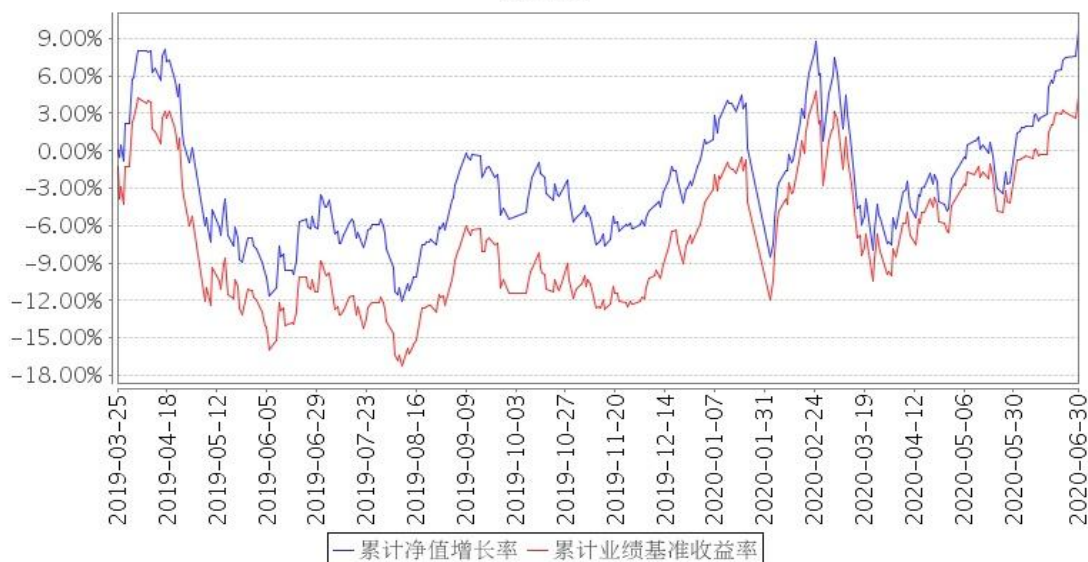
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	11.61%	0.90%	8.04%	0.84%	3.57%	0.06%
过去三个月	18.38%	1.11%	15.47%	1.08%	2.91%	0.03%
过去六个月	10.44%	1.74%	10.84%	1.70%	-0.40%	0.04%
过去一年	16.90%	1.39%	17.63%	1.39%	-0.73%	0.00%
自基金合同生效起至今	9.66%	1.44%	4.30%	1.47%	5.36%	-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500指数增强累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5% 其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2019 年 3 月 25 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 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、景顺长城中小板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		
黎海威	本基金的基金经理、公司副总经理、量化及指数投资部投资总监	2019年3月25日	-	17	经济学硕士，CFA。曾担任美国穆迪 KMV 公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，担任量化及ETF投资部投资总监，自2013年10月起担任量化及指数投资部基金经理，现担任公司副总经理兼量化及指数投资部总监兼

					量化及指数投资部基金经理。
徐喻军	本基金的基金经理、量化及指数投资部总监助理	2019 年 3 月 25 日	-	10	理学硕士，CFA。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员。2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员；自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理，现担任量化及指数投资部总监助理兼基金经理。

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合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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

6 月国内工业增加值累计同比下降 1.3%，4-6 月 PMI 数据分别为 50.8、50.6、50.9，呈现出匀速修复的状态。6 月 PPI 同比下跌 3.0%，环比上升 0.4%；CPI 同比上涨 2.5%，环比下跌 0.1%，CPI 同比在猪肉价格的带动下趋于下行，而 PPI 同比可能已在 5 月份见底，后续将进入缓慢的修复过程。6 月 M2 同比增速 11.1%，M1 同比增速 6.5%，在央行等部门积极的支持政策下，信贷社融数据保持稳定，6 月社融增速 12.8%。6 月末外汇储备 3.1 万亿美元，汇率维持平稳。新冠肺炎疫情成为 2020 年最大的黑天鹅事件，全球权益市场波动加大，综合来看上半年 A 股市场表现分化明显，上证综指下跌 2.15%，沪深 300 上涨 1.64%，而以医药和科技为代表的创业板指表现强势，上涨 35.6%。

##### 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 10.44%，业绩比较基准收益率为 10.84%。

#### 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 2020 年下半年，当前整体宏观场景已由“衰退”转向“复苏”，二季度实际 GDP 增速反弹至 3.2%，预计三季度将进一步修复至潜在增速附近，其中基建投资将进一步明显发力，政府债券继续发行也将带动社融等指标继续上行，但经济修复需要一个过程，国际协作、各国财政刺激以及国内逆周期政策方向，将是后续跟踪重点。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购

赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	29,114,482.07	61,964,398.22
结算备付金		1,719,337.50	2,457,732.07
存出保证金		475,615.03	79,703.26
交易性金融资产	6.4.7.2	373,949,979.51	1,015,682,341.59
其中：股票投资		373,949,979.51	1,015,352,341.59
基金投资		-	-
债券投资		-	330,000.00
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		7,270,383.73	-
应收利息	6.4.7.5	3,930.68	13,647.04
应收股利		-	-
应收申购款		310,936.13	276,445.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		412,844,664.65	1,080,474,267.52
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		15,695,527.06	6,756,203.99
应付管理人报酬		436,911.77	1,089,567.25
应付托管费		72,818.66	181,594.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,236,586.91	1,575,651.62
应交税费		2.75	0.53
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	235,064.88	164,143.15
负债合计		17,676,912.03	9,767,161.08
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	360,334,537.23	1,078,300,882.08
未分配利润	6.4.7.10	34,833,215.39	-7,593,775.64
所有者权益合计		395,167,752.62	1,070,707,106.44
负债和所有者权益总计		412,844,664.65	1,080,474,267.52

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0966 元，基金份额总额 360,334,537.23 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 3 月 25 日（基金合 同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		71,251,619.21	-64,170,660.23
1. 利息收入		152,219.44	372,829.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	152,088.50	372,829.13
债券利息收入		130.94	-
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）		94,563,782.40	-14,529,493.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	90,236,481.99	-32,508,667.45
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.13	312,187.72	-
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	4,015,112.69	17,979,173.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-24,539,240.90	-51,058,839.75
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	1,074,858.27	1,044,844.01
减：二、费用		9,635,594.76	10,108,959.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,622,380.22	4,306,742.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	603,730.06	717,790.36
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	5,192,611.41	4,957,794.37
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.48	-
7. 其他费用	6.4.7.19	216,872.59	126,632.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		61,616,024.45	-74,279,619.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		61,616,024.45	-74,279,619.42

### 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 指数增强型证券投资基金

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）	1,078,300,882.08	-7,593,775.64	1,070,707,106.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	61,616,024.45	61,616,024.45
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）	-717,966,344.85	-19,189,033.42	-737,155,378.27



其中：1. 基金申购款	74,126,456.06	-1,364,545.92	72,761,910.14
2. 基金赎回款	-792,092,800.91	-17,824,487.50	-809,917,288.41
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）	360,334,537.23	34,833,215.39	395,167,752.62
项目	上年度可比期间 2019年3月25日（基金合同生效日）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）	1,508,879,568.71	-	1,508,879,568.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-74,279,619.42	-74,279,619.42
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）	-206,929,552.60	-6,228,872.07	-213,158,424.67
其中：1. 基金申购款	67,114,201.88	-3,629,860.97	63,484,340.91
2. 基金赎回款	-274,043,754.48	-2,599,011.10	-276,642,765.58
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）	1,301,950,016.11	-80,508,491.49	1,221,441,524.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2018]1897 号文《关于准予景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，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 指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人于 2019 年 2 月 21 日至 2019 年 3 月 20 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普

通合伙)验证并出具安永华明(2019)验字第 60467014\_H01 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2019 年 3 月 25 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 1,507,912,000.78 元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币 967,567.93 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 1,508,879,568.71 元,折合 1,508,879,568.71 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,注册登记机构为本基金管理人,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成分股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款,以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。

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

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

#### 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,在具体会计估值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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会和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 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 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金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 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税及附加、企业所得税

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。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、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。管理人应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。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。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》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：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。

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

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

### (3) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	29,114,482.07
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	29,114,482.07

### 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	343,980,192.65	373,949,979.51	29,969,786.86
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	343,980,192.65	373,949,979.51	29,969,786.86

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

#### 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

本基金于本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末无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	3,041.66
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	696.33
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	192.69
合计	3,930.68

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末的其他资产余额为零。

#### 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	1,236,586.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,236,586.91

## 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	30,638.74
应付证券出借违约金	-
预提费用	104,426.14
应付指数使用费	100,000.00
合计	235,064.88

## 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	1,078,300,882.08	1,078,300,882.08
本期申购	74,126,456.06	74,126,456.06
本期赎回（以“-”号填列）	-792,092,800.91	-792,092,800.91
- 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	360,334,537.23	360,334,537.23

注：本报告期申购份额包含基金转入份额；本报告期赎回份额包含基金转出份额。

## 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	-57,856,637.67	50,262,862.03	-7,593,775.64
本期利润	86,155,265.35	-24,539,240.90	61,616,024.45
本期基金份额交易产生的变动数	-1,877,204.86	-17,311,828.56	-19,189,033.42
其中：基金申购款	1,076,995.19	-2,441,541.11	-1,364,545.92
基金赎回款	-2,954,200.05	-14,870,287.45	-17,824,487.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,421,422.82	8,411,792.57	34,833,215.39

## 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	131,348.36
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	17,772.77
其他	2,967.37
合计	152,088.50

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	1,932,979,311.86
减：卖出股票成本总额	1,842,742,829.87
买卖股票差价收入	90,236,481.99

## 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	1,139,039.96
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	826,700.00
减：应收利息总额	152.24
买卖债券差价收入	312,187.72

## 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具收益。

## 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	4,015,112.69
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	4,015,112.69

## 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	-24,539,240.90
股票投资	-24,539,240.90
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	-24,539,240.90

#### 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	1,054,776.77
基金转换费收入	20,081.50
合计	1,074,858.27

#### 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	5,192,611.41
银行间市场交易费用	-
合计	5,192,611.41

#### 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	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	12,446.45
指数使用费	100,000.00
合计	216,872.59

#### 6.4.7.20 分部报告

截至本报告期末，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，本基金无需作披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，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、注册登记人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金销售机构
景顺长城资产管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年3月25日（基金合同生效日） 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	5,849,485.22	0.19	-	-

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期和上年度可比期间均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	5,447.53	0.19	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年3月25日（基金合同生效日）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	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

#### 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 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,622,380.22	4,306,742.01
其中：支付销售机构的客户维护费	1,284,817.72	1,586,726.60

注：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 3 月 25 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	603,730.06	717,790.36

注：基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

##### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

## 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

## 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

## 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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 (%)
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	4,959,825.41	1.38	-	-

## 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3月25日(基金合同生效日)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	29,114,482.07	131,348.36	73,402,385.90	338,943.69

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，并按银行间同业利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间在承销期内均未重大参与关联方承销的证券投资。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期末进行利润分配。

## 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
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	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688157	松井股份	2020年5月29日	2020年12月9日	新股流通受限	34.48	86.64	3,402	117,300.96	294,749.28	注
688158	优刻得	2020年1月10日	2020年7月20日	新股流通受限	33.23	68.38	20,700	687,861.00	1,415,466.00	-
688178	万德斯	2020年1月6日	2020年7月14日	新股流通受限	25.20	39.90	3,704	93,340.80	147,789.60	-
688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新股流通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-

688398	赛特新材	2020年 2月3 日	2020 年8月 11日	新股流 通受限	24.12	54.47	3,246	78,293.52	176,809.62	-
688528	秦川物联	2020年 6月19 日	2020 年7月 1日	新股流 通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688568	中科星图	2020年 6月30 日	2020 年7月 8日	新股流 通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688600	皖仪科技	2020年 6月23 日	2020 年7月 3日	新股流 通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

注：该股票的限售期限为自上市公司首次公开发行并上市之日起 6 个月，“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有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，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末持有的证券未参与转融通证券出借业务。

#### 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发行的证券，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：0.03%）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

持续的监测和分析。

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

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过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	29,114,482.07	-	-	-	-	-	29,114,482.07
结算备付金	1,719,337.50	-	-	-	-	-	1,719,337.50
存出保证金	475,615.03	-	-	-	-	-	475,615.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	373,949,979.51	373,949,979.51
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	3,930.68	3,930.68
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	310,936.13	310,936.13
应收证券清算款	-	-	-	-	-	7,270,383.73	7,270,383.73
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	31,309,434.60	-	-	-	-	381,535,230.05	412,844,664.65
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	15,695,527.06	15,695,527.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	436,911.77	436,911.77
应付托管费	-	-	-	-	-	72,818.66	72,818.66
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	-	-	-	-	-	1,236,586.91	1,236,586.91
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	2.75	2.75
其他负债	-	-	-	-	-	235,064.88	235,064.88
负债总计	-	-	-	-	-	17,676,912.03	17,676,912.03
利率敏感度缺口	31,309,434.60	-	-	-	-	-	-



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	61,964,398.22	-	-	-	-	-	61,964,398.22
结算备付金	2,457,732.07	-	-	-	-	-	2,457,732.07
存出保证金	79,703.26	-	-	-	-	-	79,703.26
交易性金融资产	-	-	-	-	330,000.00	1,015,352,341.59	1,015,682,341.59
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	13,647.04	13,647.04
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	276,445.34	276,445.34
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	64,501,833.55	-	-	-	330,000.00	1,015,642,433.97	1,080,474,267.52
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,756,203.99	6,756,203.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,089,567.25	1,089,567.25
应付托管费	-	-	-	-	-	181,594.54	181,594.54
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	-	-	-	-	-	1,575,651.62	1,575,651.62
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	0.53	0.53
其他负债	-	-	-	-	-	164,143.15	164,143.15
负债总计	-	-	-	-	-	9,767,161.08	9,767,161.08
利率敏感度缺口	64,501,833.55	-	-	-	330,000.00	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.00%（上年末：0.03%），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，所面临的最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	373,949,979.51	94.63	1,015,352,341.59	94.83
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	373,949,979.51	94.63	1,015,352,341.59	94.83

##### 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%	20,664,433.84	50,278,277.75
	沪深 300 指数下降 5%	-20,664,433.84	-50,278,277.75

## 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. 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。

### 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、买入返售金融资产、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 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划分为第一层次的余额为人民币 371,182,721.60 元，划分为第二层次的余额为人民币 2,767,257.91 元，无划分为第三层次的余额。（于 2019 年 12 月 31 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 1,011,467,328.26 元，划分为第二层次的余额为人民币 4,215,013.33 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

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、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或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 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；本基金本报告期无净转入（转出）第三层次。

(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。

### 3. 财务报表的批准

本财务报表已于 2020 年 8 月 20 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	373,949,979.51	90.58
	其中：股票	373,949,979.51	90.58
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	30,833,819.57	7.47
8	其他各项资产	8,060,865.57	1.95
9	合计	412,844,664.65	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	18,324.00	0.00
B	采矿业	14,409,641.75	3.65
C	制造业	183,857,442.21	46.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,685,331.00	0.68
E	建筑业	6,515,704.00	1.65
F	批发和零售业	10,242,240.04	2.59
G	交通运输、仓储和邮政业	9,635,832.00	2.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,934,964.89	8.59
J	金融业	11,524,993.00	2.92
K	房地产业	18,761,186.72	4.75
L	租赁和商务服务业	3,294,252.75	0.83
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共	2,664,000.00	0.67

	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	1,888,450.00	0.48
R	文化、体育和娱乐业	12,269,427.64	3.10
S	综合	3,016,700.30	0.76
	合计	314,718,490.30	79.64

### 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	60,444.00	0.02
C	制造业	45,349,451.90	11.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,769,457.42	1.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,519,881.00	0.38
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,621,346.97	1.17
J	金融业	2,750,352.00	0.70
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	147,789.60	0.04
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	59,231,489.21	14.99

### 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	603444	吉比特	15,331	8,416,872.31	2.13
2	600125	铁龙物流	1,435,400	8,009,532.00	2.03
3	000932	华菱钢铁	2,052,840	7,739,206.80	1.96
4	000488	晨鸣纸业	1,560,250	7,707,635.00	1.95
5	600064	南京高科	781,000	7,591,320.00	1.92
6	300133	华策影视	1,026,000	7,438,500.00	1.88
7	002128	露天煤业	936,897	7,260,951.75	1.84
8	000738	航发控制	525,944	7,179,135.60	1.82
9	603233	大参林	80,032	6,500,199.04	1.64
10	600486	扬农化工	74,600	6,154,500.00	1.56
11	600325	华发股份	858,812	6,063,212.72	1.53
12	002583	海能达	778,107	5,905,832.13	1.49
13	600909	华安证券	854,800	5,838,284.00	1.48
14	300558	贝达药业	39,100	5,473,218.00	1.39
15	600201	生物股份	195,300	5,437,152.00	1.38
16	002080	中材科技	342,740	5,312,470.00	1.34
17	002019	亿帆医药	224,500	5,156,765.00	1.30
18	601615	明阳智能	386,131	4,807,330.95	1.22
19	002797	第一创业	664,900	4,601,108.00	1.16
20	002223	鱼跃医疗	125,300	4,560,920.00	1.15
21	002028	思源电气	217,810	4,456,392.60	1.13
22	300274	阳光电源	308,300	4,436,437.00	1.12
23	600298	安琪酵母	86,510	4,280,514.80	1.08
24	600985	淮北矿业	540,600	4,211,274.00	1.07
25	600216	浙江医药	218,600	4,210,236.00	1.07
26	603556	海兴电力	287,762	4,155,283.28	1.05
27	600633	浙数文化	421,178	4,119,120.84	1.04
28	002920	德赛西威	66,452	4,075,501.16	1.03
29	300115	长盈精密	177,230	4,049,705.50	1.02
30	300459	金科文化	1,123,500	3,876,075.00	0.98
31	600195	中牧股份	238,300	3,867,609.00	0.98
32	002414	高德红外	130,380	3,817,526.40	0.97
33	300482	万孚生物	36,600	3,806,400.00	0.96
34	002353	杰瑞股份	122,010	3,782,310.00	0.96
35	000050	深天马A	244,300	3,752,448.00	0.95
36	600521	华海药业	110,015	3,732,808.95	0.94
37	600039	四川路桥	959,900	3,666,818.00	0.93

38	002244	滨江集团	789,100	3,369,457.00	0.85
39	002174	游族网络	118,300	3,085,264.00	0.78
40	002387	维信诺	211,600	3,021,648.00	0.76
41	300058	蓝色光标	373,225	2,911,155.00	0.74
42	603866	桃李面包	57,100	2,905,819.00	0.74
43	000009	中国宝安	337,900	2,875,529.00	0.73
44	300496	中科创达	35,700	2,773,890.00	0.70
45	601200	上海环境	222,000	2,664,000.00	0.67
46	600875	东方电气	272,200	2,408,970.00	0.61
47	002156	通富微电	93,467	2,341,348.35	0.59
48	000156	华数传媒	214,400	2,321,952.00	0.59
49	000887	中鼎股份	291,400	2,287,490.00	0.58
50	002048	宁波华翔	142,800	2,204,832.00	0.56
51	300418	昆仑万维	87,500	2,184,000.00	0.55
52	300315	掌趣科技	290,774	2,131,373.42	0.54
53	002217	合力泰	396,600	2,082,150.00	0.53
54	600862	中航高科	122,700	2,076,084.00	0.53
55	603000	人民网	102,400	2,030,592.00	0.51
56	000600	建投能源	392,800	1,999,352.00	0.51
57	600507	方大特钢	376,048	1,951,689.12	0.49
58	000739	普洛药业	83,000	1,933,070.00	0.49
59	002138	顺络电子	76,900	1,918,655.00	0.49
60	002124	天邦股份	149,200	1,917,220.00	0.49
61	000975	银泰黄金	121,200	1,900,416.00	0.48
62	603882	金域医学	21,100	1,888,450.00	0.48
63	002382	蓝帆医疗	62,000	1,866,820.00	0.47
64	600153	建发股份	223,100	1,807,110.00	0.46
65	600060	海信视像	144,547	1,756,246.05	0.44
66	600529	山东药玻	30,200	1,751,600.00	0.44
67	600466	蓝光发展	322,300	1,737,197.00	0.44
68	002603	以岭药业	54,800	1,709,212.00	0.43
69	600380	健康元	100,900	1,638,616.00	0.41
70	002375	亚厦股份	158,000	1,614,760.00	0.41
71	600804	鹏博士	178,871	1,606,261.58	0.41
72	002640	跨境通	238,100	1,545,269.00	0.39
73	600161	天坛生物	33,700	1,527,621.00	0.39
74	600782	新钢股份	367,100	1,497,768.00	0.38
75	002557	洽洽食品	27,400	1,484,806.00	0.38
76	601689	拓普集团	53,200	1,484,280.00	0.38
77	300168	万达信息	66,400	1,465,448.00	0.37
78	600699	均胜电子	61,300	1,459,553.00	0.37
79	000400	许继电气	110,200	1,454,640.00	0.37

80	000012	南玻A	287,900	1,445,258.00	0.37
81	601717	郑煤机	234,000	1,378,260.00	0.35
82	600566	济川药业	54,125	1,378,022.50	0.35
83	002399	海普瑞	52,700	1,319,608.00	0.33
84	601811	新华文轩	128,992	1,311,848.64	0.33
85	000090	天健集团	178,600	1,234,126.00	0.31
86	601098	中南传媒	113,150	1,197,127.00	0.30
87	300316	晶盛机电	45,800	1,133,092.00	0.29
88	600908	无锡银行	221,100	1,085,601.00	0.27
89	002444	巨星科技	90,700	1,077,516.00	0.27
90	000581	威孚高科	51,903	1,073,354.04	0.27
91	300088	长信科技	94,400	1,057,280.00	0.27
92	601598	中国外运	322,200	1,040,706.00	0.26
93	002185	华天科技	76,800	1,039,104.00	0.26
94	600338	西藏珠峰	103,700	1,037,000.00	0.26
95	603228	景旺电子	28,000	985,320.00	0.25
96	002385	大北农	95,100	866,361.00	0.22
97	000528	柳工	135,900	857,529.00	0.22
98	000547	航天发展	58,208	795,703.36	0.20
99	002064	华峰氨纶	155,900	790,413.00	0.20
100	600845	宝信软件	12,500	738,500.00	0.19
101	000930	中粮科技	103,649	707,922.67	0.18
102	002709	天赐材料	20,700	699,453.00	0.18
103	300010	立思辰	35,100	686,907.00	0.17
104	600008	首创股份	227,900	685,979.00	0.17
105	300253	卫宁健康	28,101	644,636.94	0.16
106	002273	水晶光电	32,725	560,906.50	0.14
107	300009	安科生物	26,900	481,510.00	0.12
108	000990	诚志股份	37,255	472,765.95	0.12
109	002491	通鼎互联	74,400	380,928.00	0.10
110	002233	塔牌集团	30,100	362,103.00	0.09
111	300207	欣旺达	18,898	357,172.20	0.09
112	002635	安洁科技	13,500	336,150.00	0.09
113	600026	中远海能	51,300	331,398.00	0.08
114	002434	万里扬	38,000	329,840.00	0.08
115	002396	星网锐捷	9,100	321,503.00	0.08
116	002127	南极电商	15,075	319,137.75	0.08
117	002821	凯莱英	1,100	267,300.00	0.07
118	600667	太极实业	22,600	267,132.00	0.07
119	600350	山东高速	41,400	254,196.00	0.06
120	002589	瑞康医药	44,400	237,984.00	0.06
121	002390	信邦制药	45,600	207,936.00	0.05



122	603317	天味食品	3,285	182,580.30	0.05
123	000078	海王生物	36,200	151,678.00	0.04
124	600673	东阳光	20,430	141,171.30	0.04
125	002407	多氟多	10,900	115,976.00	0.03
126	600410	华胜天成	6,800	92,480.00	0.02
127	603328	依顿电子	6,900	71,967.00	0.02
128	002818	富森美	5,200	63,960.00	0.02
129	600446	金证股份	2,162	41,942.80	0.01
130	300017	网宿科技	4,900	41,601.00	0.01
131	002458	益生股份	1,200	18,324.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300185	通裕重工	2,173,700	4,260,452.00	1.08
2	603313	梦百合	143,400	3,374,202.00	0.85
3	600655	豫园股份	338,100	2,995,566.00	0.76
4	600459	贵研铂业	88,100	2,626,261.00	0.66
5	603611	诺力股份	110,600	2,373,476.00	0.60
6	603363	傲农生物	90,900	2,124,333.00	0.54
7	603566	普莱柯	72,800	2,015,832.00	0.51
8	000538	云南白药	20,800	1,951,248.00	0.49
9	300552	万集科技	44,040	1,875,223.20	0.47
10	601137	博威合金	118,900	1,859,596.00	0.47
11	300059	东方财富	90,780	1,833,756.00	0.46
12	002601	龙麟佰利	98,640	1,824,840.00	0.46
13	300424	航新科技	131,800	1,763,484.00	0.45
14	002897	意华股份	46,600	1,596,050.00	0.40
15	000034	神州数码	65,163	1,586,067.42	0.40
16	002605	姚记科技	41,200	1,565,600.00	0.40
17	002459	晶澳科技	81,200	1,524,936.00	0.39
18	601872	招商轮船	260,700	1,519,881.00	0.38
19	603596	伯特利	40,600	1,429,120.00	0.36
20	688158	优刻得	20,700	1,415,466.00	0.36
21	002869	金溢科技	20,300	1,341,424.00	0.34
22	300119	瑞普生物	59,600	1,332,060.00	0.34
23	300607	拓斯达	27,520	1,119,788.80	0.28
24	600114	东睦股份	106,400	1,104,432.00	0.28
25	603533	掌阅科技	28,000	1,067,640.00	0.27
26	601336	新华保险	20,700	916,596.00	0.23
27	002214	大立科技	31,800	896,124.00	0.23
28	002216	三全食品	35,900	858,010.00	0.22

29	002384	东山精密	27,600	826,620.00	0.21
30	600867	通化东宝	46,500	810,495.00	0.21
31	300097	智云股份	43,700	708,377.00	0.18
32	600745	闻泰科技	5,300	667,535.00	0.17
33	601058	赛轮轮胎	187,100	660,463.00	0.17
34	000823	超声电子	43,900	610,649.00	0.15
35	002567	唐人神	50,800	483,616.00	0.12
36	603799	华友钴业	10,800	419,688.00	0.11
37	603068	博通集成	4,500	362,610.00	0.09
38	300497	富祥药业	17,200	336,604.00	0.09
39	002489	浙江永强	80,900	321,982.00	0.08
40	688157	松井股份	3,402	294,749.28	0.07
41	300433	蓝思科技	9,600	269,184.00	0.07
42	002697	红旗连锁	17,200	187,824.00	0.05
43	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.05
44	688398	赛特新材	3,246	176,809.62	0.04
45	002734	利民股份	10,800	161,676.00	0.04
46	002301	齐心集团	9,700	159,274.00	0.04
47	688178	万德斯	3,704	147,789.60	0.04
48	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.03
49	300360	炬华科技	11,200	108,864.00	0.03
50	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.03
51	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.03
52	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.03
53	300118	东方日升	6,700	100,500.00	0.03
54	603601	再升科技	7,300	95,630.00	0.02
55	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
56	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
57	002100	天康生物	4,700	75,670.00	0.02
58	000555	神州信息	4,700	72,286.00	0.02
59	601808	中海油服	4,600	60,444.00	0.02
60	300623	捷捷微电	1,680	50,484.00	0.01
61	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
62	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
63	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
64	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
65	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
66	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
67	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
68	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
69	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	000488	晨鸣纸业	19,271,746.50	1.80
2	600718	东软集团	18,391,871.32	1.72
3	002414	高德红外	17,616,646.81	1.65
4	000878	云南铜业	17,367,512.29	1.62
5	002583	海能达	16,343,490.12	1.53
6	600166	福田汽车	15,922,635.94	1.49
7	002462	嘉事堂	15,299,466.00	1.43
8	000690	宝新能源	14,859,503.55	1.39
9	000932	华菱钢铁	14,117,740.00	1.32
10	300034	钢研高纳	13,729,472.00	1.28
11	002366	台海核电	13,593,798.48	1.27
12	002092	中泰化学	12,942,267.45	1.21
13	300115	长盈精密	12,941,009.32	1.21
14	000581	威孚高科	12,304,910.51	1.15
15	600584	长电科技	12,023,398.55	1.12
16	002048	宁波华翔	11,431,075.92	1.07
17	300014	亿纬锂能	11,069,125.94	1.03
18	300002	神州泰岳	10,975,634.48	1.03
19	300058	蓝色光标	10,778,083.63	1.01
20	002353	杰瑞股份	10,678,613.35	1.00

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	000878	云南铜业	39,294,809.89	3.67
2	002439	启明星辰	33,245,421.17	3.10
3	600801	华新水泥	28,886,525.13	2.70
4	002463	沪电股份	28,251,338.15	2.64
5	600008	首创股份	27,655,480.06	2.58
6	600745	闻泰科技	27,553,423.79	2.57
7	600373	中文传媒	27,536,763.60	2.57
8	000488	晨鸣纸业	25,969,880.25	2.43
9	002028	思源电气	25,498,864.07	2.38
10	600763	通策医疗	24,946,123.87	2.33
11	603517	绝味食品	24,662,513.20	2.30
12	603444	吉比特	23,006,765.76	2.15
13	600466	蓝光发展	22,919,069.32	2.14

14	600970	中材国际	22,703,285.67	2.12
15	601699	潞安环能	22,667,247.95	2.12
16	600282	南钢股份	22,398,237.00	2.09
17	600643	爱建集团	22,349,621.65	2.09
18	600901	江苏租赁	21,592,841.94	2.02
19	600779	水井坊	21,308,292.23	1.99
20	300130	新国都	21,295,389.84	1.99

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	1,225,879,708.69
卖出股票收入（成交）总额	1,932,979,311.86

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，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 7.11.2 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、处罚的情形

1、内蒙古霍林河露天煤业股份有限公司（以下简称“露天煤业”，股票代码：002128）控股子公司内蒙古霍煤鸿骏铝电有限责任公司于 2019 年 8 月 15 日收到霍林郭勒市环境保护局（霍环罚决〔2019〕18 号）。其因违反《中华人民共和国大气污染防治法》，被处以 112375 元罚款。

露天煤业控股子公司扎鲁特旗扎哈淖尔煤业有限公司收到了内蒙古煤矿安全监察局赤峰监察分局《行政处罚决定书》（蒙煤安监赤罚【2019】38006 号）。其因违反《安全生产法》、《煤矿安全规程》，被处以 103000 元罚款。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对露天煤业进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	475,615.03
2	应收证券清算款	7,270,383.73
3	应收股利	-
4	应收利息	3,930.68
5	应收申购款	310,936.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,060,865.57

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

**7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

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 (%)
9,514	37,874.14	29,327,095.88	8.14	331,007,441.35	91.86

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	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	106,394.15	0.03

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

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

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日 (2019 年 3 月 25 日) 基金份额总额	1,508,879,568.71
本报告期期初基金份额总额	1,078,300,882.08
本报告期基金总申购份额	74,126,456.06
减：本报告期基金总赎回份额	792,092,800.91
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	360,334,537.23

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 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	
华泰证券股份有限公司	1	916,152,297.35	29.10%	853,212.90	29.10%	-
东吴证券股份有限公司	1	453,663,731.05	14.41%	422,498.29	14.41%	-
中国国际金融股份有限公司	1	422,641,982.65	13.42%	393,607.84	13.42%	-
广发证券股份有限公司	2	316,894,491.68	10.07%	295,127.50	10.07%	-
中泰证券股份有限公司	1	284,597,456.73	9.04%	265,048.41	9.04%	本期新增
东方证券股份有限公司	2	205,627,590.36	6.53%	191,504.81	6.53%	-
海通证券股份有限公司	3	163,970,804.54	5.21%	152,703.07	5.21%	-
浙商证券股份有限公司	1	129,883,955.75	4.13%	120,960.96	4.13%	-
国盛证券有限责任公司	1	121,174,607.88	3.85%	112,852.01	3.85%	-
招商证券股份有限公司	2	98,249,424.57	3.12%	91,501.08	3.12%	-
华西证券股份有限公司	1	11,651,342.72	0.37%	10,850.97	0.37%	本期新增
东兴证券股份有限公司	1	10,617,565.16	0.34%	9,888.49	0.34%	-
平安证券股份有限公司	1	7,302,844.24	0.23%	6,801.30	0.23%	-
长城证券股份有限公司	2	5,849,485.22	0.19%	5,447.53	0.19%	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
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
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	422,502.30	37.09%	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	716,537.66	62.91%	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 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
2	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
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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
8	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
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 10 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 10 日
11	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
12	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
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 25 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司基金转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 25 日

15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 25 日
16	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
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 31 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东方财富证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 3 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券股份有限公司为销售机构并开通基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 3 日
20	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
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万联证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 10 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 10 日
23	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
24	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 20 日
25	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 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
26	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
27	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的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 29 日
28	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
29	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2020 年 5 月 6 日

	部分基金参加中信证券华南股份有限公司申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	网站	
30	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信证券华南股份有限公司为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 6 日
31	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
32	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
33	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司基金申购及转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 6 月 1 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2020 年 8 月 24 日