

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 23 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 2021 年 08 月 19 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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	7
§ 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合规守信情况的说明	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的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
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
§ 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	36
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	50

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	50
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	51
§ 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	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	54
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	59
§ 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	扩位简称为景顺中证 500ETF，原场内简称为景顺 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	43,572,956.00 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
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
		许俊
		010-66594319
		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	李进	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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,949,060.92
本期利润	6,586,023.31
加权平均基金份额本期利润	0.1589
本期加权平均净值利润率	8.25%
本期基金份额净值增长率	8.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	45,372,931.69
期末可供分配基金份额利润	1.0413
期末基金资产净值	88,945,887.69
期末基金份额净值	2.0413
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	104.13%

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。

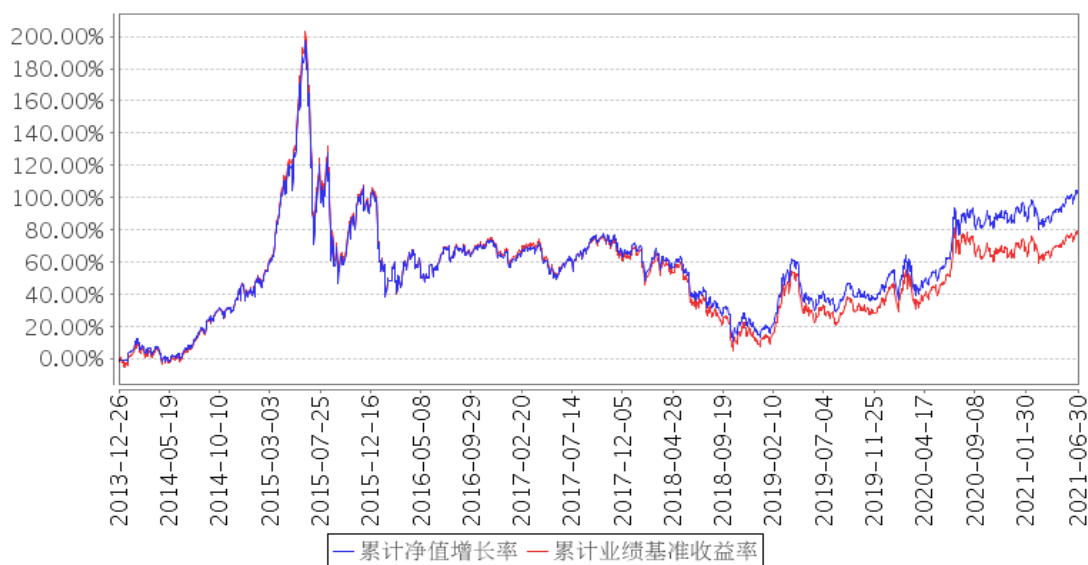
3.2 基金净值表现

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	1.73%	0.73%	1.18%	0.73%	0.55%	0.00%
过去三个月	10.06%	0.67%	8.86%	0.68%	1.20%	-0.01%
过去六个月	8.10%	0.98%	6.93%	0.99%	1.17%	-0.01%
过去一年	23.96%	1.22%	16.09%	1.25%	7.87%	-0.03%
过去三年	43.98%	1.44%	30.48%	1.48%	13.50%	-0.04%
自基金合同生效起至今	104.13%	1.66%	78.77%	1.69%	25.36%	-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2021年6月30日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理124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、景顺长城中小创精选股票型证券投资基金、景顺长城中证科技传媒通信150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、景顺长城中证科技传媒通信150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、景顺长城安鑫回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城弘远 66 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城价值稳进三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城竞争优势混合型证券投资基金、景顺长城景泰添利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、景顺长城价值边际灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城电子信息产业股票型证券投资基金、景顺长城消费精选混合型证券投资基金、景顺长城景颐招利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城顺鑫回报混合型证券投资基金、景顺长城

景泰宝利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城量化成长演化混合型证券投资基金、景顺长城泰祥回报混合型证券投资基金、景顺长城核心中景一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城泰保三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、景顺长城核心招景混合型证券投资基金、景顺长城景泰恒利一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城产业趋势混合型证券投资基金、景顺长城景泰益利纯债债券型证券投资基金、景顺长城成长龙头一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城品质长青混合型证券投资基金、景顺长城新能源产业股票型证券投资基金、景顺长城安泽回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城泰源回报混合型证券投资基金、景顺长城景骊成长混合型证券投资基金、景顺长城安盈回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景气成长混合型证券投资基金、景顺长城安益回报一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城颐心养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。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		
张晓南	本基金的基金经理	2020 年 4 月 15 日	-	11 年	经济学硕士，CFA，FRM。曾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。具有 11 年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 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 7 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

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

2021 年 6 月工业增加值当月同比 8.30%，前值 8.80%，受去年 1 季度疫情影响低基数所致，且去年低基数影响逐渐减弱，预期将很快回到长期均值；当月环比 0.56%，与之前基本持平，后疫情时代复苏趋势延续。6 月 PMI 指数为 50.90，维持在 50 以上，略有回调。6 月 PPI 同比 8.80%，前值 9.00%，环比 0.30%，通胀预期有所回落；CPI 同比 1.10%，前值 1.30%，环比-0.40%，基本保持稳定。6 月 M2 同比增速 8.60%，M1 同比增速 5.50%，社会融资规模存量同比增长 11.00%，增速逐渐降低至均衡水平。6 月末外汇储备 3.21 万亿美元。受到变异病毒影响，部分国家疫情出现反复，生产活动无法完全恢复，从而令国内二季度延续去年三季度开始的高复苏态势，当前工业生产基本恢复至疫情前水平。2021 年上半年市场各板块走势分化较大，创业板指和科创 50 表现出明显的成长性，代表传统经济的上证 50 表现较差；上证综指、深证成指、沪深 300、中证 500、创业板指和科创 50 的收益率分别为 3.40%、4.78%、0.24%、6.93%、17.22%和 14.01%，在去年四季度市场回暖后，一季度多数板块有所回调，二季度以芯片及新能源车为代表的科技板块显示出明显的盈利驱动复苏态势。

当前新冠疫情在国内已经得到控制，但全球抗疫形势仍不容乐观。随着病毒变种的逐渐出现，部分前期控制较好的国家疫情又出现了反复。当前英国已经处在第三波疫情爆发期；美国再次出现反弹；印度确诊病例虽较最高点回落，但仍居高不下；印尼成为亚洲除印度之外的又一病毒“培养皿”；日本急于举办奥运会，其国内管制放松令确诊数再次升高，奥运运动员的聚集可能导致新一轮世界疫情传播。

国内经济目前仍然能够享受到疫情红利，在全球主要经济体经济增长停滞甚至衰退的形势下，国内生产厂商在国内疫情结束较早、生产恢复较快的情形下，相当大一部分的填补了国内外需求缺口，且在国外尚未完全走出疫情影响前，这一趋势并不会发生转变。而在全球经济摆脱疫情影响后，国内生产厂商在全球供应链中的地位也会有所提高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2021 年上半年，本基金份额净值增长率为 8.10%，业绩比较基准收益率为 6.93%。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，疫情仍然在全球蔓延，且由于大部分国家疫苗接种率无法快速提升，疫情拐点仍未可见。全球产能恢复的速度在当前时点无法明确预见，而“中国制造”为全球工业品和消费品的生产做出了卓越的贡献，也为国内经济增长提供了坚实的基础。同时，近期发布的《中共中央、国务院关于支持浦东新区高水平改革开放、打造社会主义现代化建设引领区的意见》提出在全证券市场稳步实施以信息披露为核心的注册制、在科创板引入做市商制度，逐步完善金融基础设置和制度。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，我们对市场保持乐观。当前继续看好成长板块在全球经济复苏阶段的表现，后续成长性高、现金流好、行业竞争格局稳定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。在报告期内，本基金结合申购赎回情况，根据指数成份股及其权重变化定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,688,076.30	1,687,420.12
结算备付金		22,145.20	5,102.17
存出保证金		1,896.83	8,377.00
交易性金融资产	6.4.7.2	87,401,950.46	75,185,652.85
其中：股票投资		87,375,950.46	75,183,752.85
基金投资		-	-
债券投资		26,000.00	1,900.00
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		22,556.43	10,313.75
应收利息	6.4.7.5	153.01	164.29
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		89,136,778.23	76,897,030.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		35,973.19	32,176.94
应付托管费		7,194.64	6,435.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	30,899.84	39,468.13
应交税费		0.01	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	116,822.86	200,000.00
负债合计		190,890.54	278,080.45
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	43,572,956.00	40,572,956.00
未分配利润	6.4.7.10	45,372,931.69	36,045,993.73
所有者权益合计		88,945,887.69	76,618,949.73
负债和所有者权益总计		89,136,778.23	76,897,030.18

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0413 元，基金份额总额 43,572,956.00 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 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
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		7,032,371.86	28,100,422.58
1. 利息收入		2,797.84	14,302.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,782.84	14,290.97
债券利息收入		15.00	11.16
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）		5,391,546.32	680,343.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,660,223.11	-561,082.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	8,880.04	20,400.03
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	722,443.17	1,221,025.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,636,962.39	27,405,536.85
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	1,065.31	240.00
减：二、费用		446,348.55	810,433.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	197,704.37	455,272.03
2. 托管费	6.4.10.2.2	39,540.90	91,054.41
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	56,535.42	104,146.62
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
7. 其他费用	6.4.7.19	152,567.86	159,960.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,586,023.31	27,289,988.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,586,023.31	27,289,988.80

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	40,572,956.00	36,045,993.73	76,618,949.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,586,023.31	6,586,023.31
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）	3,000,000.00	2,740,914.65	5,740,914.65

其中：1. 基金申购款	6,000,000.00	5,524,809.97	11,524,809.97
2. 基金赎回款	-3,000,000.00	-2,783,895.32	-5,783,895.32
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)	43,572,956.00	45,372,931.69	88,945,887.69
项目	上年度可比期间 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、期末所有者权益(基金净值)	104,572,956.00	67,636,608.06	172,209,564.06

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及存托凭证)、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 2021 年 8 月 19 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 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止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和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

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,688,076.30
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	1,688,076.30

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	81,237,113.16	87,375,950.46	6,138,837.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	26,000.00	26,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	26,000.00	26,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	81,263,113.16	87,401,950.46	6,138,837.30

注：于 2021 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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	142.24
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	8.91
应收债券利息	1.14
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	0.72
合计	153.01

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	30,899.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	30,899.84

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 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	81,822.86
应付指数使用费	35,000.00
合计	116,822.86

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,572,956.00	40,572,956.00
本期申购	6,000,000.00	6,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,000,000.00	-3,000,000.00
- 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	43,572,956.00	43,572,956.00

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	57,017,150.04	-20,971,156.31	36,045,993.73
本期利润	4,949,060.92	1,636,962.39	6,586,023.31
本期基金份额交易产生的变动数	4,300,860.27	-1,559,945.62	2,740,914.65
其中：基金申购款	8,524,608.42	-2,999,798.45	5,524,809.97
基金赎回款	-4,223,748.15	1,439,852.83	-2,783,895.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	66,267,071.23	-20,894,139.54	45,372,931.69

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	2,553.86
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	200.23	
其他	28.75	
合计	2,782.84	

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,220,912.30
股票投资收益——赎回差价收入	439,310.81
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	4,660,223.11

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	18,713,507.52
减：卖出股票成本总额	14,492,595.22
买卖股票差价收入	4,220,912.30

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 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	5,783,895.32
减：现金支付赎回款总额	68,955.32
减：赎回股票成本总额	5,275,629.19
赎回差价收入	439,310.81

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	86,194.09
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	77,300.00
减：应收利息总额	14.05
买卖债券差价收入	8,880.04

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	722,443.17
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	722,443.17

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	1,636,962.39
股票投资	1,636,962.39
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	1,636,962.39

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 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,065.31
合计	1,065.31

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	56,535.42
银行间市场交易费用	-
合计	56,535.42

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	745.00
指数使用费	70,000.00
合计	152,567.86

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；本基金当季日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 3.5 万元，当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费无收取下限。

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**

于本报告期，并无与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	19,177,587.11	51.73	23,106,902.60	33.51

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 2021年1月1日至2021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	17,861.79	51.73	16,114.11	52.15
关联方名称	上年度可比期间 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

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月	2020年1月1日至2020年

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	197,704.37	455,272.03
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% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	39,540.90	91,054.41

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金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本报告期和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 2021年6月30日		上年度末 2020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	40,000,000.00	91.80	38,000,000.00	93.66

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 2021年1月1日至2021年6月30 日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	1,688,076.30	2,553.86	4,149,598.91	13,636.89

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(2021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
605287	德才股份	2021年6月 28日	2021年7 月6日	新股流 通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通日	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：张)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
113051	节能转债	2021年6月 22日	2021年7 月22日	新债流 通受限	100.00	100.00	260	26,000.00	26,000.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	11,242	178,437.50	633,486.70	-
600811	东方集团	2021年6月30日	重大事项停牌	3.05	2021年7月14日	3.36	42,350	188,800.54	129,167.50	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.03%（上年末：0.002%）。

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。

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

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约

规定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	1,688,076.30	-	-	-	-	-	1,688,076.30
结算备付金	22,145.20	-	-	-	-	-	22,145.20
存出保证金	1,896.83	-	-	-	-	-	1,896.83
交易性金融资产	-	-	-	-	26,000.00	87,375,950.46	87,401,950.46
应收利息	-	-	-	-	-	153.01	153.01
应收证券清算款	-	-	-	-	-	22,556.43	22,556.43
资产总计	1,712,118.33	-	-	-	26,000.00	87,398,659.90	89,136,778.23
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	35,973.19	35,973.19
应付托管费	-	-	-	-	-	7,194.64	7,194.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	30,899.84	30,899.84
应交税费	-	-	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	-	-	116,822.86	116,822.86
负债总计	-	-	-	-	-	190,890.54	190,890.54
利率敏感度缺口	1,712,118.33	-	-	-	26,000.00	-	-
上年度末 2020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	1,687,420.12	-	-	-	-	-	1,687,420.12
结算备付金	5,102.17	-	-	-	-	-	5,102.17
存出保证金	8,377.00	-	-	-	-	-	8,377.00
交易性金融资产	-	-	-	-	1,900.00	75,183,752.85	75,185,652.85
应收利息	-	-	-	-	-	164.29	164.29
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,313.75	10,313.75
资产总计	1,700,899.29	-	-	-	1,900.00	75,194,230.89	76,897,030.18
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,176.94	32,176.94
应付托管费	-	-	-	-	-	6,435.38	6,435.38
应付交易费用	-	-	-	-	-	39,468.13	39,468.13
其他负债	-	-	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	278,080.45	278,080.45
利率敏感度缺口	1,700,899.29	-	-	-	1,900.00	-	-

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 0.03%（上年末：0.0%），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 2021年6月30日		上年度末 2020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	87,375,950.46	98.24	75,183,752.85	98.13
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	87,375,950.46	98.24	75,183,752.85	98.13

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 (2021年6月30日)	上年度末 (2020年12月31日)
分析	沪深 300 指数上升 5%	2,821,545.41	3,812,371.55
	沪深 300 指数下降 5%	-2,821,545.41	-3,812,371.55

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 2021 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 86,602,281.82 元，属于第二层次的余额为 799,668.64 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 74,468,972.39 元，第二层次 716,680.46 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 2021 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(2020 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 2021 年上半年，本基金申购基金份额的对价总额为 11,524,809.97 元(2020 年上半年：14,595,358.75 元)，其中包括以股票支付的申购款 11,197,318.00 元和以现金支付的申购款 327,491.97 元(2020 年上半年：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)。

(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	87,375,950.46	98.02
	其中：股票	87,375,950.46	98.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	26,000.00	0.03
	其中：债券	26,000.00	0.03
	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	1,710,221.50	1.92
8	其他各项资产	24,606.27	0.03
9	合计	89,136,778.23	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	853,765.00	0.96
B	采矿业	3,031,043.75	3.41
C	制造业	55,303,658.61	62.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,102,408.95	2.36
E	建筑业	1,609,507.13	1.81
F	批发和零售业	2,969,685.62	3.34
G	交通运输、仓储和邮政业	1,681,897.52	1.89
H	住宿和餐饮业	463,160.00	0.52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,285,090.90	8.19
J	金融业	5,102,572.87	5.74
K	房地产业	2,841,621.07	3.19
L	租赁和商务服务业	1,151,214.80	1.29
M	科学研究和技术服务业	229,675.50	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	738,308.70	0.83
O	居民服务、修理和其他服务	-	-

	业		
P	教育	54,861.08	0.06
Q	卫生和社会工作	237,460.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	875,327.00	0.98
S	综合	768,505.60	0.86
	合计	87,299,764.10	98.15

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	13,558.42	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.01
E	建筑业	11,014.44	0.01
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	12,230.40	0.01
J	金融业	34,721.10	0.04
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	76,186.36	0.09

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	002709	天赐材料	8,184	872,250.72	0.98
2	000799	酒鬼酒	3,300	843,480.00	0.95

3	603486	科沃斯	3,320	757,225.60	0.85
4	600089	特变电工	53,000	681,050.00	0.77
5	000009	中国宝安	36,780	671,970.60	0.76
6	002074	国轩高科	14,700	640,332.00	0.72
7	002340	格林美	68,142	637,127.70	0.72
8	600460	士兰微	11,242	633,486.70	0.71
9	300285	国瓷材料	11,500	560,625.00	0.63
10	601233	桐昆股份	22,900	551,661.00	0.62
11	300207	欣旺达	15,700	511,192.00	0.57
12	002185	华天科技	31,300	481,707.00	0.54
13	600885	宏发股份	7,420	465,234.00	0.52
14	300316	晶盛机电	9,200	464,600.00	0.52
15	601636	旗滨集团	23,000	426,880.00	0.48
16	600733	北汽蓝谷	30,600	412,488.00	0.46
17	300037	新宙邦	4,100	410,410.00	0.46
18	300146	汤臣倍健	12,100	398,090.00	0.45
19	300253	卫宁健康	24,300	395,361.00	0.44
20	603737	三棵树	2,240	394,240.00	0.44
21	002648	卫星石化	9,840	385,629.60	0.43
22	002625	光启技术	18,500	384,985.00	0.43
23	002223	鱼跃医疗	10,026	382,291.38	0.43
24	600884	杉杉股份	16,244	378,810.08	0.43
25	601127	小康股份	5,600	373,352.00	0.42
26	603444	吉比特	700	371,000.00	0.42
27	600219	南山铝业	102,200	367,920.00	0.41
28	002353	杰瑞股份	8,200	366,540.00	0.41
29	002138	顺络电子	9,200	356,684.00	0.40
30	600779	水井坊	2,800	353,780.00	0.40
31	603589	口子窖	5,200	351,988.00	0.40
32	000547	航天发展	18,300	345,321.00	0.39
33	300699	光威复材	4,500	341,775.00	0.38
34	002797	第一创业	47,800	341,292.00	0.38
35	600704	物产中大	43,300	340,771.00	0.38
36	000988	华工科技	14,359	337,723.68	0.38
37	688099	晶晨股份	3,000	336,600.00	0.38
38	603893	瑞芯微	2,400	334,704.00	0.38
39	002444	巨星科技	9,811	334,358.88	0.38
40	002212	天融信	16,900	334,113.00	0.38
41	601099	太平洋	97,300	329,847.00	0.37
42	002422	科伦药业	16,300	325,185.00	0.37
43	601168	西部矿业	27,200	324,496.00	0.36
44	002385	大北农	47,200	320,960.00	0.36

45	688002	睿创微纳	3,200	319,456.00	0.36
46	600739	辽宁成大	15,300	318,393.00	0.36
47	000807	云铝股份	26,700	317,730.00	0.36
48	300308	中际旭创	8,200	315,864.00	0.36
49	002439	启明星辰	10,700	310,407.00	0.35
50	000636	风华高科	10,243	309,543.46	0.35
51	600862	中航高科	10,000	307,800.00	0.35
52	601117	中国化学	35,100	307,476.00	0.35
53	000830	鲁西化工	16,307	305,430.11	0.34
54	600563	法拉电子	1,919	303,892.84	0.34
55	600392	盛和资源	17,495	303,713.20	0.34
56	600486	扬农化工	2,700	301,779.00	0.34
57	002078	太阳纸业	22,426	299,387.10	0.34
58	600699	均胜电子	11,680	298,073.60	0.34
59	002030	达安基因	13,974	296,807.76	0.33
60	002180	纳思达	9,200	296,240.00	0.33
61	600754	锦江酒店	5,200	296,140.00	0.33
62	603605	珀莱雅	1,500	295,065.00	0.33
63	002250	联化科技	10,574	295,014.60	0.33
64	600315	上海家化	4,900	294,686.00	0.33
65	600068	葛洲坝	39,300	294,357.00	0.33
66	300088	长信科技	34,952	288,703.52	0.32
67	002507	涪陵榨菜	7,600	286,216.00	0.32
68	000630	铜陵有色	104,900	285,328.00	0.32
69	600201	生物股份	16,087	280,718.15	0.32
70	002013	中航机电	27,600	277,932.00	0.31
71	000039	中集集团	15,260	277,426.80	0.31
72	002075	沙钢股份	25,100	273,841.00	0.31
73	002127	南极电商	28,000	273,560.00	0.31
74	300223	北京君正	2,700	272,484.00	0.31
75	002028	思源电气	8,720	268,488.80	0.30
76	300001	特锐德	8,900	267,979.00	0.30
77	000513	丽珠集团	5,303	265,256.06	0.30
78	600177	雅戈尔	39,600	260,964.00	0.29
79	601997	贵阳银行	36,400	260,624.00	0.29
80	002511	中顺洁柔	9,400	258,970.00	0.29
81	601005	重庆钢铁	95,600	255,252.00	0.29
82	000021	深科技	13,330	255,136.20	0.29
83	002273	水晶光电	17,324	254,489.56	0.29
84	002299	圣农发展	10,600	253,128.00	0.28
85	600549	厦门钨业	12,100	252,043.00	0.28
86	002080	中材科技	9,600	251,232.00	0.28

87	002092	中泰化学	24,400	250,588.00	0.28
88	600988	赤峰黄金	16,600	248,834.00	0.28
89	002465	海格通信	26,300	248,798.00	0.28
90	000050	深天马 A	17,500	248,150.00	0.28
91	002603	以岭药业	8,500	247,860.00	0.28
92	000739	普洛药业	8,400	246,960.00	0.28
93	300168	万达信息	16,900	246,740.00	0.28
94	600171	上海贝岭	8,102	246,543.86	0.28
95	300482	万孚生物	3,800	245,822.00	0.28
96	600536	中国软件	4,300	244,799.00	0.28
97	300618	寒锐钴业	3,100	244,404.00	0.27
98	300357	我武生物	3,800	243,656.00	0.27
99	000825	太钢不锈	32,500	243,425.00	0.27
100	300009	安科生物	16,332	243,346.80	0.27
101	601128	常熟银行	39,100	242,420.00	0.27
102	600867	通化东宝	20,300	242,382.00	0.27
103	000983	山西焦煤	29,150	242,236.50	0.27
104	600516	方大炭素	32,500	241,800.00	0.27
105	600066	宇通客车	19,300	241,057.00	0.27
106	000998	隆平高科	15,000	240,600.00	0.27
107	600637	东方明珠	29,200	239,148.00	0.27
108	300244	迪安诊断	6,200	237,460.00	0.27
109	601689	拓普集团	6,320	236,557.60	0.27
110	300463	迈克生物	5,600	235,704.00	0.26
111	600316	洪都航空	6,100	234,728.00	0.26
112	600418	江淮汽车	18,862	234,454.66	0.26
113	600879	航天电子	30,992	233,059.84	0.26
114	600529	山东药玻	6,800	230,860.00	0.26
115	600369	西南证券	47,400	230,838.00	0.26
116	002152	广电运通	17,700	230,631.00	0.26
117	000723	美锦能源	30,500	230,580.00	0.26
118	000932	华菱钢铁	34,900	230,340.00	0.26
119	300070	碧水源	31,500	230,265.00	0.26
120	000750	国海证券	54,290	230,189.60	0.26
121	600827	百联股份	11,400	229,710.00	0.26
122	600380	健康元	16,692	229,181.16	0.26
123	600487	亨通光电	20,100	229,140.00	0.26
124	002156	通富微电	9,500	228,380.00	0.26
125	000960	锡业股份	14,200	227,626.00	0.26
126	300271	华宇软件	11,800	227,150.00	0.26
127	600166	福田汽车	65,600	226,320.00	0.25
128	300296	利亚德	28,900	225,998.00	0.25

129	002373	千方科技	13,500	225,450.00	0.25
130	002131	利欧股份	96,173	225,044.82	0.25
131	601615	明阳智能	13,900	225,041.00	0.25
132	000975	银泰黄金	23,654	224,949.54	0.25
133	600909	华安证券	40,220	224,025.40	0.25
134	603290	斯达半导	700	224,000.00	0.25
135	688208	道通科技	2,566	223,216.34	0.25
136	300383	光环新网	15,400	221,606.00	0.25
137	600038	中直股份	4,200	221,508.00	0.25
138	002572	索菲亚	9,100	220,220.00	0.25
139	002690	美亚光电	3,900	217,464.00	0.24
140	002926	华西证券	22,400	215,712.00	0.24
141	300474	景嘉微	2,200	215,424.00	0.24
142	600642	申能股份	35,000	214,900.00	0.24
143	601198	东兴证券	19,600	214,228.00	0.24
144	601866	中远海发	56,600	212,250.00	0.24
145	002065	东华软件	26,700	211,731.00	0.24
146	002294	信立泰	6,400	210,560.00	0.24
147	300115	长盈精密	10,216	210,449.60	0.24
148	603638	艾迪精密	4,840	207,490.80	0.23
149	600271	航天信息	15,800	205,874.00	0.23
150	603156	养元饮品	7,200	205,776.00	0.23
151	002500	山西证券	30,660	205,728.60	0.23
152	000623	吉林敖东	13,200	204,468.00	0.23
153	600998	九州通	13,300	204,421.00	0.23
154	600415	小商品城	39,100	201,365.00	0.23
155	600895	张江高科	11,000	200,970.00	0.23
156	601699	潞安环能	17,000	200,770.00	0.23
157	000012	南玻A	19,504	199,720.96	0.22
158	600153	建发股份	24,400	197,640.00	0.22
159	300630	普利制药	3,755	196,762.00	0.22
160	600188	兖州煤业	12,700	195,072.00	0.22
161	600256	广汇能源	57,800	192,474.00	0.22
162	600707	彩虹股份	20,400	191,964.00	0.22
163	600390	五矿资本	32,000	191,360.00	0.22
164	600667	太极实业	21,000	191,100.00	0.21
165	600535	天士力	12,900	191,049.00	0.21
166	300418	昆仑万维	11,600	190,008.00	0.21
167	600060	海信视像	11,200	189,280.00	0.21
168	300024	机器人	17,700	188,859.00	0.21
169	600008	首创环保	62,670	188,636.70	0.21
170	002670	国盛金控	16,501	187,946.39	0.21

171	600497	驰宏锌锗	43,500	187,485.00	0.21
172	002372	伟星新材	9,060	187,270.20	0.21
173	688029	南微医学	598	186,390.62	0.21
174	000027	深圳能源	20,320	186,334.40	0.21
175	600155	华创阳安	17,400	186,180.00	0.21
176	600208	新湖中宝	61,200	186,048.00	0.21
177	000878	云南铜业	14,500	186,035.00	0.21
178	002382	蓝帆医疗	8,900	185,565.00	0.21
179	002557	洽洽食品	4,300	185,330.00	0.21
180	603858	步长制药	8,100	182,169.00	0.20
181	002019	亿帆医药	10,500	181,125.00	0.20
182	600765	中航重机	7,989	180,950.85	0.20
183	600372	中航电子	10,900	180,395.00	0.20
184	002221	东华能源	16,404	179,623.80	0.20
185	300251	光线传媒	16,600	179,446.00	0.20
186	600141	兴发集团	9,520	179,261.60	0.20
187	000718	苏宁环球	21,600	179,064.00	0.20
188	600498	烽火通信	9,600	178,848.00	0.20
189	002174	游族网络	10,400	178,568.00	0.20
190	600511	国药股份	5,386	178,061.16	0.20
191	600409	三友化工	17,594	177,875.34	0.20
192	002683	宏大爆破	6,400	177,728.00	0.20
193	600170	上海建工	63,500	175,260.00	0.20
194	002966	苏州银行	23,800	174,930.00	0.20
195	002146	荣盛发展	31,000	174,840.00	0.20
196	002506	协鑫集成	50,000	174,000.00	0.20
197	002390	信邦制药	16,600	173,968.00	0.20
198	000997	新大陆	10,452	173,398.68	0.19
199	600875	东方电气	15,800	173,326.00	0.19
200	000401	冀东水泥	14,017	173,109.95	0.19
201	601717	郑煤机	14,810	172,240.30	0.19
202	300058	蓝色光标	28,400	171,820.00	0.19
203	002408	齐翔腾达	13,763	170,936.46	0.19
204	600160	巨化股份	19,220	169,904.80	0.19
205	600801	华新水泥	9,651	169,568.07	0.19
206	002958	青农商行	39,600	169,488.00	0.19
207	603260	合盛硅业	2,200	169,202.00	0.19
208	000686	东北证券	20,000	169,000.00	0.19
209	000738	航发控制	8,100	168,723.00	0.19
210	603866	桃李面包	5,380	167,856.00	0.19
211	688088	虹软科技	3,000	167,250.00	0.19
212	600258	首旅酒店	7,000	167,020.00	0.19

213	603707	健友股份	4,000	167,000.00	0.19
214	300315	掌趣科技	39,200	166,600.00	0.19
215	600663	陆家嘴	12,500	166,500.00	0.19
216	002195	二三四五	81,822	166,098.66	0.19
217	002268	卫士通	8,420	164,021.60	0.18
218	000540	中天金融	59,800	163,254.00	0.18
219	300017	网宿科技	27,800	162,630.00	0.18
220	600325	华发股份	24,112	162,514.88	0.18
221	603225	新凤鸣	7,972	161,831.60	0.18
222	688321	微芯生物	3,499	161,618.81	0.18
223	600732	爱旭股份	11,600	161,472.00	0.18
224	000060	中金岭南	35,600	160,912.00	0.18
225	601016	节能风电	42,900	160,446.00	0.18
226	601992	金隅集团	59,600	160,324.00	0.18
227	600027	华电国际	46,400	159,616.00	0.18
228	000961	中南建设	26,900	159,248.00	0.18
229	600567	山鹰国际	46,100	159,045.00	0.18
230	603712	七一二	4,400	158,840.00	0.18
231	002831	裕同科技	5,320	157,950.80	0.18
232	600859	王府井	5,464	157,800.32	0.18
233	603077	和邦生物	75,743	157,545.44	0.18
234	000158	常山北明	13,610	156,378.90	0.18
235	600282	南钢股份	43,900	156,284.00	0.18
236	002429	兆驰股份	25,700	155,999.00	0.18
237	002191	劲嘉股份	14,574	155,067.36	0.17
238	603883	老百姓	2,940	154,879.20	0.17
239	600500	中化国际	19,690	154,763.40	0.17
240	603927	中科软	3,600	154,620.00	0.17
241	601577	长沙银行	17,200	153,768.00	0.17
242	600216	浙江医药	9,600	153,696.00	0.17
243	600528	中铁工业	18,900	153,090.00	0.17
244	000671	阳光城	29,400	152,880.00	0.17
245	600839	四川长虹	52,500	152,775.00	0.17
246	000898	鞍钢股份	34,200	152,190.00	0.17
246	002595	豪迈科技	5,700	152,190.00	0.17
247	600737	中粮糖业	15,200	152,152.00	0.17
248	300212	易华录	5,640	151,772.40	0.17
249	002056	横店东磁	11,664	151,632.00	0.17
250	002081	金螳螂	19,100	151,272.00	0.17
251	600598	北大荒	10,100	151,096.00	0.17
252	603198	迎驾贡酒	3,400	150,620.00	0.17
253	000709	河钢股份	60,600	149,076.00	0.17

254	600728	佳都科技	20,000	148,200.00	0.17
255	002203	海亮股份	13,900	147,896.00	0.17
256	000581	威孚高科	7,100	147,893.00	0.17
257	600580	卧龙电驱	11,077	147,324.10	0.17
258	000999	华润三九	5,500	147,125.00	0.17
259	002124	天邦股份	20,960	146,929.60	0.17
260	002281	光迅科技	5,969	146,837.40	0.17
261	300182	捷成股份	29,400	146,706.00	0.16
262	600808	马钢股份	33,900	145,431.00	0.16
263	002010	传化智联	18,800	144,948.00	0.16
264	000729	燕京啤酒	20,000	144,800.00	0.16
265	000930	中粮科技	15,888	143,150.88	0.16
266	000488	晨鸣纸业	17,495	142,409.30	0.16
267	300166	东方国信	11,518	142,362.48	0.16
268	002387	维信诺	13,600	141,848.00	0.16
269	600820	隧道股份	26,800	141,772.00	0.16
270	002242	九阳股份	4,349	141,299.01	0.16
271	002396	星网锐捷	6,600	140,910.00	0.16
272	002745	木林森	10,500	140,700.00	0.16
273	002004	华邦健康	22,610	140,408.10	0.16
274	000629	攀钢钒钛	61,300	140,377.00	0.16
275	002048	宁波华翔	7,111	138,664.50	0.16
276	002563	森马服饰	11,500	137,425.00	0.15
277	600755	厦门国贸	16,702	137,123.42	0.15
278	600970	中材国际	14,850	136,174.50	0.15
279	300002	神州泰岳	28,000	135,800.00	0.15
280	600022	山东钢铁	78,110	134,349.20	0.15
281	603000	人民网	7,800	134,082.00	0.15
282	600398	海澜之家	18,500	133,940.00	0.15
283	600803	新奥股份	8,100	133,731.00	0.15
284	000598	兴蓉环境	25,600	133,376.00	0.15
285	600037	歌华有线	13,800	132,618.00	0.15
286	601106	中国一重	39,100	132,549.00	0.15
287	600881	亚泰集团	46,210	131,698.50	0.15
288	002925	盈趣科技	3,330	129,570.30	0.15
289	600811	东方集团	42,350	129,167.50	0.15
290	603885	吉祥航空	8,400	128,184.00	0.14
291	600039	四川路桥	20,439	128,152.53	0.14
292	002002	鸿达兴业	32,577	128,027.61	0.14
293	601880	辽港股份	74,599	127,564.29	0.14
294	000883	湖北能源	27,700	127,143.00	0.14
295	600348	华阳股份	17,100	126,882.00	0.14

296	000778	新兴铸管	34,100	126,852.00	0.14
297	000690	宝新能源	24,751	126,477.61	0.14
298	600260	凯乐科技	14,231	126,371.28	0.14
299	601456	国联证券	8,200	126,280.00	0.14
300	600782	新钢股份	22,600	126,108.00	0.14
301	000887	中鼎股份	10,400	125,632.00	0.14
302	600597	光明乳业	8,700	125,367.00	0.14
303	601118	海南橡胶	24,400	124,196.00	0.14
304	002701	奥瑞金	24,120	123,976.80	0.14
305	002249	大洋电机	23,557	123,674.25	0.14
306	002867	周大生	6,250	123,562.50	0.14
307	002705	新宝股份	4,700	123,375.00	0.14
308	600126	杭钢股份	24,040	123,325.20	0.14
309	600908	无锡银行	21,200	122,960.00	0.14
310	600967	内蒙一机	12,101	122,462.12	0.14
311	600645	中源协和	5,330	122,323.50	0.14
312	002085	万丰奥威	21,800	122,080.00	0.14
313	603568	伟明环保	5,345	122,026.35	0.14
314	600718	东软集团	12,400	121,272.00	0.14
315	600410	华胜天成	15,623	121,234.48	0.14
316	600026	中远海能	19,670	121,167.20	0.14
317	002183	怡亚通	21,100	120,903.00	0.14
318	601179	中国西电	29,200	120,304.00	0.14
319	603650	彤程新材	2,500	120,250.00	0.14
320	000528	柳工	14,600	119,720.00	0.13
321	600985	淮北矿业	9,700	118,437.00	0.13
322	600572	康恩贝	26,499	117,655.56	0.13
323	002110	三钢闽光	17,450	117,613.00	0.13
324	600167	联美控股	13,040	116,447.20	0.13
325	000877	天山股份	8,895	115,901.85	0.13
326	000970	中科三环	12,100	115,555.00	0.13
327	600446	金证股份	8,000	115,520.00	0.13
328	300072	三聚环保	20,100	115,374.00	0.13
329	002368	太极股份	5,751	115,365.06	0.13
330	000402	金融街	17,000	114,750.00	0.13
331	002266	浙富控股	22,945	114,495.55	0.13
332	601200	上海环境	9,540	114,193.80	0.13
333	600329	中新药业	4,055	113,904.95	0.13
334	600064	南京高科	12,258	113,876.82	0.13
335	002128	露天煤业	10,931	113,791.71	0.13
336	000089	深圳机场	14,600	113,442.00	0.13
337	000990	诚志股份	8,900	113,297.00	0.13

338	601598	中国外运	22,400	113,120.00	0.13
339	600517	国网英大	16,300	111,003.00	0.12
340	600158	中体产业	9,601	109,547.41	0.12
341	002985	北摩高科	1,120	109,200.00	0.12
342	300026	红日药业	25,602	108,808.50	0.12
343	000400	许继电气	8,594	108,800.04	0.12
344	003035	南网能源	10,800	107,352.00	0.12
345	000519	中兵红箭	9,927	106,417.44	0.12
346	300376	易事特	13,200	106,128.00	0.12
347	601718	际华集团	37,600	106,032.00	0.12
348	600120	浙江东方	24,713	105,771.64	0.12
349	601975	招商南油	49,100	105,074.00	0.12
350	000959	首钢股份	18,600	104,532.00	0.12
351	600195	中牧股份	8,708	104,147.68	0.12
352	600507	方大特钢	15,332	103,950.96	0.12
353	002233	塔牌集团	10,081	103,632.68	0.12
354	600307	酒钢宏兴	44,500	103,240.00	0.12
355	001914	招商积余	6,000	103,080.00	0.12
356	601333	广深铁路	48,500	102,820.00	0.12
357	000090	天健集团	18,570	102,692.10	0.12
358	600376	首开股份	18,300	102,480.00	0.12
359	000685	中山公用	12,544	102,359.04	0.12
360	002505	鹏都农牧	45,570	102,076.80	0.11
361	601000	唐山港	42,211	101,728.51	0.11
362	600435	北方导航	12,720	100,996.80	0.11
363	002440	闰土股份	11,400	100,890.00	0.11
364	000559	万向钱潮	18,700	99,297.00	0.11
365	600804	鹏博士	20,400	98,736.00	0.11
366	002839	张家港行	18,000	97,920.00	0.11
367	600643	爱建集团	13,878	96,868.44	0.11
368	600673	东阳光	21,500	96,535.00	0.11
369	300133	华策影视	16,200	95,904.00	0.11
370	603228	景旺电子	3,652	95,682.40	0.11
371	601860	紫金银行	26,100	94,743.00	0.11
372	600373	中文传媒	9,600	94,656.00	0.11
373	601991	大唐发电	35,400	93,456.00	0.11
374	000758	中色股份	19,600	93,100.00	0.10
375	601608	中信重工	24,800	92,752.00	0.10
376	600056	中国医药	7,598	92,315.70	0.10
377	002155	湖南黄金	11,900	92,225.00	0.10
378	002038	双鹭药业	8,750	92,137.50	0.10
379	000967	盈峰环境	13,400	92,058.00	0.10

380	600582	天地科技	23,500	91,650.00	0.10
381	002936	郑州银行	24,860	91,236.20	0.10
382	600266	城建发展	19,240	91,197.60	0.10
383	000563	陕国投 A	28,230	90,900.60	0.10
384	000681	视觉中国	7,000	90,510.00	0.10
385	600388	龙净环保	10,600	90,312.00	0.10
386	601098	中南传媒	10,200	89,964.00	0.10
387	300113	顺网科技	6,900	89,286.00	0.10
388	600095	湘财股份	7,600	88,996.00	0.10
389	601958	金钼股份	13,700	88,776.00	0.10
390	600131	国网信通	6,700	88,708.00	0.10
391	600928	西安银行	19,000	88,540.00	0.10
392	600901	江苏租赁	17,000	88,400.00	0.10
393	600062	华润双鹤	7,362	87,681.42	0.10
394	002416	爱施德	8,740	87,662.20	0.10
395	300180	华峰超纤	17,500	86,625.00	0.10
396	600959	江苏有线	28,400	86,620.00	0.10
397	300741	华宝股份	1,700	86,224.00	0.10
398	600649	城投控股	18,100	86,156.00	0.10
399	003022	联泓新科	2,800	85,960.00	0.10
400	600094	大名城	22,700	85,579.00	0.10
401	000415	渤海租赁	35,100	84,942.00	0.10
402	600764	中国海防	3,000	84,900.00	0.10
403	002458	益生股份	8,500	84,745.00	0.10
404	600259	广晟有色	2,500	84,525.00	0.10
405	002399	海普瑞	5,300	84,429.00	0.09
406	600776	东方通信	6,800	84,320.00	0.09
407	600006	东风汽车	11,400	83,220.00	0.09
408	601611	中国核建	11,300	81,586.00	0.09
409	600556	天下秀	7,700	81,312.00	0.09
410	600546	山煤国际	11,300	81,134.00	0.09
411	600717	天津港	20,530	80,477.60	0.09
412	300257	开山股份	5,573	80,084.01	0.09
413	002317	众生药业	9,273	79,840.53	0.09
414	600633	浙数文化	11,100	79,698.00	0.09
415	000717	韶钢松山	17,100	78,489.00	0.09
416	600648	外高桥	5,300	78,334.00	0.09
417	000028	国药一致	2,038	77,117.92	0.09
418	601928	凤凰传媒	10,800	77,112.00	0.09
419	002434	万里扬	9,500	77,045.00	0.09
420	600729	重庆百货	2,800	76,860.00	0.09
421	000078	海王生物	23,550	76,773.00	0.09

422	600021	上海电力	11,100	76,701.00	0.09
423	600863	内蒙华电	32,900	76,657.00	0.09
424	000501	鄂武商 A	6,529	76,389.30	0.09
425	601828	美凯龙	6,300	75,600.00	0.08
426	600968	海油发展	29,100	75,369.00	0.08
427	000062	深圳华强	4,450	75,249.50	0.08
428	002375	亚厦股份	9,500	75,240.00	0.08
429	002244	滨江集团	17,724	74,263.56	0.08
430	002424	贵州百灵	10,000	73,600.00	0.08
431	600835	上海机电	4,494	73,027.50	0.08
432	000869	张裕 A	1,900	70,566.00	0.08
433	600623	华谊集团	8,000	70,480.00	0.08
434	605358	立昂微	600	69,348.00	0.08
435	603355	莱克电气	1,100	68,453.00	0.08
436	600377	宁沪高速	7,000	68,320.00	0.08
437	600312	平高电气	11,600	67,744.00	0.08
438	600339	中油工程	23,800	67,592.00	0.08
439	600787	中储股份	12,524	66,752.92	0.08
440	002468	申通快递	8,700	66,294.00	0.07
441	600566	济川药业	3,700	66,230.00	0.07
442	000031	大悦城	18,357	66,085.20	0.07
443	600639	浦东金桥	4,812	65,683.80	0.07
444	002583	海能达	13,000	65,520.00	0.07
445	000826	启迪环境	12,200	65,270.00	0.07
446	600823	世茂股份	16,000	64,640.00	0.07
447	601969	海南矿业	5,500	63,965.00	0.07
448	601778	晶科科技	11,700	63,882.00	0.07
449	600466	蓝光发展	21,620	63,779.00	0.07
450	603317	天味食品	2,164	63,686.52	0.07
451	603888	新华网	2,950	62,451.50	0.07
452	601298	青岛港	9,900	61,182.00	0.07
453	002815	崇达技术	4,900	61,152.00	0.07
454	000156	华数传媒	7,900	60,909.00	0.07
455	002532	天山铝业	7,200	60,408.00	0.07
456	000937	冀中能源	15,100	59,343.00	0.07
457	603708	家家悦	3,400	59,058.00	0.07
458	002948	青岛银行	11,700	58,149.00	0.07
459	002635	安洁科技	3,950	57,788.50	0.06
460	000813	德展健康	12,700	57,658.00	0.06
461	000553	安道麦 A	6,200	57,474.00	0.06
462	002302	西部建设	7,200	56,880.00	0.06
463	601228	广州港	17,700	56,286.00	0.06

464	300010	豆神教育	9,900	56,133.00	0.06
465	600640	号百控股	4,528	55,196.32	0.06
466	603515	欧普照明	2,140	54,933.80	0.06
467	603377	东方时尚	5,132	54,861.08	0.06
468	600350	山东高速	8,900	54,735.00	0.06
469	001872	招商港口	3,200	54,144.00	0.06
470	601139	深圳燃气	8,200	53,792.00	0.06
471	600871	石化油服	26,900	52,993.00	0.06
472	000061	农产品	9,600	52,992.00	0.06
473	000046	泛海控股	22,100	50,830.00	0.06
474	002653	海思科	2,300	49,496.00	0.06
475	603056	德邦股份	4,400	48,356.00	0.05
476	603379	三美股份	2,580	48,271.80	0.05
477	601568	北元集团	5,600	47,936.00	0.05
478	603786	科博达	600	45,300.00	0.05
479	002419	天虹股份	6,800	44,608.00	0.05
480	002901	大博医疗	600	43,734.00	0.05
481	601003	柳钢股份	7,300	43,070.00	0.05
482	601512	中新集团	4,200	41,832.00	0.05
483	600657	信达地产	12,010	41,794.80	0.05
484	601869	长飞光纤	1,700	41,412.00	0.05
485	000537	广宇发展	7,900	41,317.00	0.05
486	601801	皖新传媒	8,500	40,120.00	0.05
487	601187	厦门银行	4,100	38,868.00	0.04
488	600917	重庆燃气	4,500	36,765.00	0.04
489	603983	丸美股份	700	36,477.00	0.04
490	002946	新乳业	2,400	36,360.00	0.04
491	603719	良品铺子	800	36,000.00	0.04
492	000732	泰禾集团	14,000	30,240.00	0.03
493	600903	贵州燃气	3,200	29,440.00	0.03
494	603868	飞科电器	600	25,236.00	0.03
495	002818	富森美	2,080	25,084.80	0.03
496	002423	中粮资本	2,600	23,530.00	0.03
497	603256	宏和科技	2,500	22,850.00	0.03
498	600956	新天绿能	1,900	22,249.00	0.03
499	601068	中铝国际	4,500	15,525.00	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	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.04

2	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.02
3	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
4	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
5	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01

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	000799	酒鬼酒	802,626.16	1.05
2	601636	旗滨集团	406,635.00	0.53
3	300253	卫宁健康	393,994.00	0.51
4	300037	新宙邦	387,067.00	0.51
5	002422	科伦药业	327,884.00	0.43
6	300308	中际旭创	327,294.00	0.43
7	002439	启明星辰	325,141.00	0.42
8	600177	雅戈尔	293,621.00	0.38
9	600988	赤峰黄金	275,076.00	0.36
10	600068	葛洲坝	273,098.00	0.36
11	600536	中国软件	272,916.00	0.36
12	002127	南极电商	261,493.00	0.34
13	600066	宇通客车	251,852.00	0.33
14	600637	东方明珠	251,358.00	0.33
15	600369	西南证券	242,708.00	0.32
16	601117	中国化学	241,307.00	0.31
17	002180	纳思达	238,752.00	0.31
18	300383	光环新网	238,704.00	0.31
19	600487	亨通光电	237,576.00	0.31
20	000723	美锦能源	224,315.00	0.29

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	300274	阳光电源	1,479,557.00	1.93
2	300012	华测检测	796,895.00	1.04
3	600426	华鲁恒升	738,140.10	0.96
4	300595	欧普康视	687,500.60	0.90
5	300496	中科创达	657,506.00	0.86
6	600132	重庆啤酒	602,803.00	0.79

7	603882	金域医学	602,288.00	0.79
8	600143	金发科技	533,252.00	0.70
9	603806	福斯特	515,453.06	0.67
10	002568	百润股份	472,703.00	0.62
11	601966	玲珑轮胎	441,765.00	0.58
12	600079	人福医药	419,589.00	0.55
13	601799	星宇股份	418,956.00	0.55
14	603345	安井食品	416,556.00	0.54
15	002791	坚朗五金	365,526.00	0.48
16	603816	顾家家居	360,767.00	0.47
17	002920	德赛西威	280,596.00	0.37
18	002064	华峰化学	261,273.00	0.34
19	000301	东方盛虹	239,509.00	0.31
20	603338	浙江鼎力	179,788.00	0.23

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	19,126,141.63
卖出股票收入（成交）总额	18,713,507.52

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	26,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,000.00	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113051	节能转债	260	26,000.00	0.03

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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

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	1,896.83
2	应收证券清算款	22,556.43

3	应收股利	-
4	应收利息	153.01
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,606.27

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	633,486.70	0.71	重大事项停牌

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	605287	德才股份	11,014.44	0.01	新股流通受限

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 (%)
389	112,012.74	0.00	0.00	3,572,956.00	8.20

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 (%)
中国银行股份有限公司一景	40,000,000.00	91.80

顺长城中证 500 交易型开放式指数投资基金联接基金		
----------------------------	--	--

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	40,000,000.00	91.80
2	陈建仁	1,751,050.00	4.02
3	钱中明	458,100.00	1.05
4	郝海燕	105,000.00	0.24
5	杜培新	102,700.00	0.24
6	沈健美	78,000.00	0.18
7	高伟焯	49,000.00	0.11
8	黄曼翔	44,300.00	0.10
9	孙飞	38,800.00	0.09
10	李杰	30,500.00	0.07
11	王仁	26,292.00	0.06

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	40,572,956.00
本报告期基金总申购份额	6,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	43,572,956.00

§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：

本基金管理人于 2021 年 3 月 30 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，聘任刘彦春先生担任本公司副总经理。

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

本基金本报告期末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	
长城证券股份有限公司	3	19,177,587.11	51.73%	17,861.79	51.73%	-
东方证券股份有限公司	2	17,896,542.42	48.27%	16,667.24	48.27%	-
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	2	-	-	-	-	-

限公司						
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	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
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：1、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，最近三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。

2、本基金本期交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券股份有限公司	24,641.00	28.59%	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	61,553.09	71.41%	-	-	-	-
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	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-08
2	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-15
3	景顺长城基金管理有限公司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 (ETF) 最小申购、赎回单位的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-20
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
5	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-21
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-05
7	景顺长城基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-09
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-02-25
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-12
10	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-20
11	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-26
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
15	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
16	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 号更新招募说明书(更新)	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29

17	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
18	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（基金合同更新）	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-29
19	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-30
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-02
21	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	2021-04-12
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-15
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-19
24	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-20
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
26	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-22
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-23
28	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
29	关于旗下部分基金新增中信证券（华南）为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-14
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-20
31	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
32	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-28
33	关于网络平台冒用“景顺长城基金”名义进行不法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-04
34	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-15
35	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-18

§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 (%)
本基金的联接基金	1	20210101-20210630	38,000,000.00	4,000,000.00	2,000,000.00	40,000,000.00	91.80

产品特有风险

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

1、大额申购风险

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

2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(3) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

(4) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(5) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(6) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开

募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》等法律法规及各基金基金合同、招募说明书及其更新等规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，我司对旗下包括本基金在内的 15 只基金的基金合同等法律文件进行修订。本次修订属于法律法规规定无需召开基金份额持有人大会的事项，修订自 2021 年 3 月 29 日起正式生效。有关详细信息参见本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分公募基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

§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

2021 年 8 月 23 日