

# 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 2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 31 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 2022 年 08 月 29 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 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 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
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 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
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 .....	12
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 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	37
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 .....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49

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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	49
7.11 本基金投资股指期货的投资政策 .....	49
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.13 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## §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联接基金
基金简称	景顺长城中证 500ETF 联接
场内简称	无
基金主代码	001455
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 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	62,904,547.80 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

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
基金管理人名称	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，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	本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标。当本基金申购、赎回和买卖目标 ETF，或基金自身的申购、赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金管理人会在 10 个交易日内对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。在正常情况下，本基金力争相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，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。本基金为股票型指数基金，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，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

#### 2.2.1 目标基金产品说明

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	杨崑阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	95566
	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		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	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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
---------------	-------------------------------------

本期已实现收益	222,086.52
本期利润	-7,989,974.39
加权平均基金份额本期利润	-0.1190
本期加权平均净值利润率	-12.84%
本期基金份额净值增长率	-10.85%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2022年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-3,461,736.08
期末可供分配基金份额利润	-0.0550
期末基金资产净值	59,442,811.72
期末基金份额净值	0.945
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2022年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-5.50%

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

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，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。

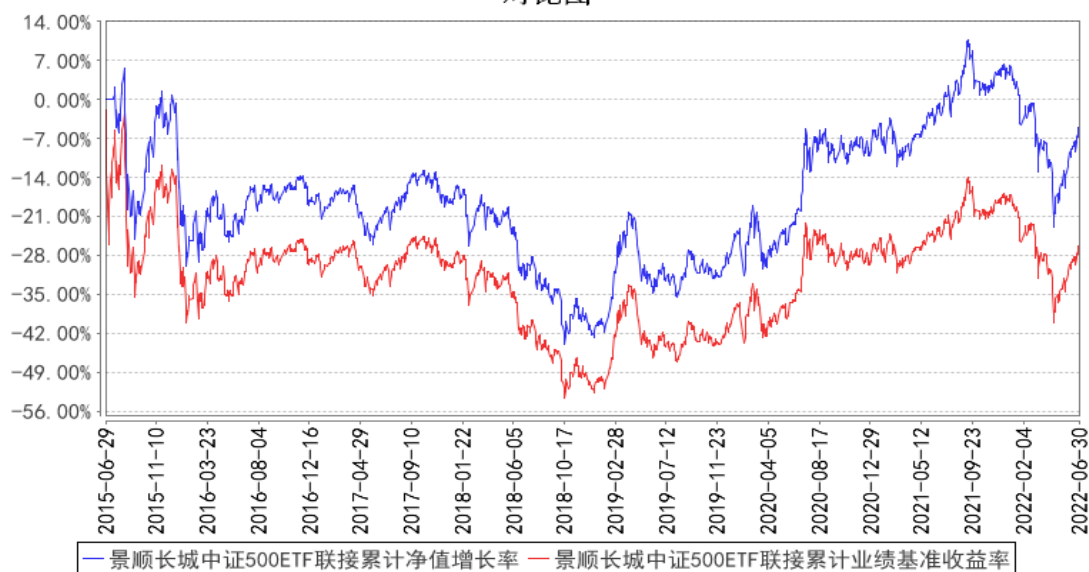
## 3.2 基金净值表现

### 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	7.26%	1.03%	6.74%	1.05%	0.52%	-0.02%
过去三个月	2.94%	1.61%	1.99%	1.66%	0.95%	-0.05%
过去六个月	-10.85%	1.50%	-11.65%	1.55%	0.80%	-0.05%
过去一年	-4.64%	1.23%	-4.83%	1.26%	0.19%	-0.03%
过去三年	37.55%	1.24%	29.13%	1.28%	8.42%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-5.50%	1.43%	-26.75%	1.58%	21.25%	-0.15%

### 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联接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：本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的建仓期为自 2015 年 6 月 29 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“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2022年6月30日，本公司旗下共管理150只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配



置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张晓南	本基金的基金经理	2020 年 4 月 15 日	-	12 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 与创新投资部基金经理。具有 12 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联接基金基金合同》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 27 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

2022 年 6 月工业增加值当月同比增长 3.90%，前值 0.70%，上海疫情对二季度经济造成的影响已经基本恢复；当月环比增长 0.84%，在 4 月和 5 月大幅波动后仍然平稳增长。6 月 PMI 指数为 50.20，从 4 月的 47.40 向上恢复，预计后续将延续 50 以上景气度。6 月 PPI 同比增长 6.10%，前值 6.40%，环比增长 0.00%；CPI 同比增长 2.50%，前值 2.10%，环比增长 0.00%，全球滞涨风险有所回落。6 月 M2 同比增长 11.40%，M1 同比增长 5.80%，社会融资规模存量同比增长 10.80%，基本可控且处于良性增长态势。5 月末外汇储备 3.07 万亿美元。今年上半年经济整体呈现 V 型态势，一季度全球经济在原本疫情冲击外受到俄乌冲突这一突发事件的影响，双方的相互制裁令全球风险偏好快速下降，对大宗商品及全球商贸活动的影响令滞涨风险再次出现；同时国内受到境外输入疫情的影响加大，深圳、上海等地经济活动受到了极大影响，国内市场对疫情的担忧再次出现。本次上海疫情自 3 月底开始发酵，后续对周边及相关产业链形成了较大范围的冲击，此次疫情对经济的影响超出了此前的市场预期，相当多重要产品供应链出现问题。随着国内疫情的好转，国内经济生产走势再次验证了市场韧性，可以看到后续多个经济指标出现明显好转，预计国内经济后续将再次回到之前的稳健增长曲线。由于一季度整体市场较差，即使二季度市场略有回暖，上半年主流市场指数仍然呈现跌势，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-6.63%、-13.20%、-9.22%、-12.30%、-15.41%和-20.92%。

上半年海外最重要的事件是俄乌冲突的爆发，在这种灰犀牛事件的影响下，全球投资者风险厌恶程度快速上升，由于对能源、粮食等大宗商品的供给担忧，全球大宗商品价格出现了比较大的波动，同时叠加美国中期选举的临近，当前全球主要经济体未来的政策不确定性进一步增加。虽然 5 月份美联储议息会议之后，市场对于美联储可以实现“软着陆”的信心有所增强，但 6 月中旬以来，随着通胀数据的超预期走高、经济数据的全面走弱，市场对于美联储牺牲需求被动加快收紧以及经济“硬着陆”担忧加剧，各市场波动明显加大。

而在国内方面，3 月底开始发酵的上海疫情对周边以及产业链相关地区、企业的冲击和对国内经济的影响超出了此前市场预期。在上海逐步复商复市，相关产业链及工商企业逐步恢复正常

后，政策方面对于稳定经济大盘诉求更是明显提升，近期疫情的影响大概率也可以告一段落。虽然当前国内还有部分地区存在零星疫情，但是当前最新版防疫政策已经根据新的病毒流行株特征进行了修订，预计后续将更好的兼顾疫情防护与经济增长的关系，国内经济走势将持续稳中向好。

本基金是景顺长城中证 500ETF 的联接基金，主要投资于景顺长城中证 500ETF。报告期内，本基金结合申购赎回情况进行日常操作，力争控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低的水平上。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2022 年上半年，本基金份额净值增长率为-10.85%，业绩比较基准收益率为-11.65%。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 0.35%以内，跟踪误差（年化）控制在 4%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 2022 年下半年，疫情仍将是影响全球经济活动的最大变量，在 Omicron 不同变异株的影响下，大部分经济体短时间内无法做到对病毒感染的有效控制，全球产能恢复的速度在当前时点仍然无法明确预见，且 COVID-19 的长期影响也开始显现。在这种情况下，更加凸显了国内疫情防控的前瞻性和先进性，今年上半年上海疫情的快速控制和疫情后恢复也凸显了“中国制造”的韧性，预计后续国内企业仍将为全球工业品和消费品的生产做出卓越的贡献，全球市场地位有望后续持续提升。在整体经济复苏的基础上，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。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估

值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人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联接基金（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联接基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,732,576.63	4,634,907.90
结算备付金		4.62	3,941.01
存出保证金		3,135.79	12,774.58
交易性金融资产	6.4.7.2	55,913,186.37	69,179,257.40
其中：股票投资		1,131,186.37	768,457.40
基金投资		54,782,000.00	68,410,800.00
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	158,964.40
应收股利		-	-
应收申购款		69,537.00	55,358.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	440.07
资产总计		59,718,440.41	74,045,644.04
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		50.44	-
应付赎回款		188,141.29	661,832.06

应付管理人报酬		1,955.88	2,313.70
应付托管费		391.19	462.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	85,089.89	204,422.98
负债合计		275,628.69	869,031.48
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	62,904,547.80	69,060,282.72
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-3,461,736.08	4,116,329.84
净资产合计		59,442,811.72	73,176,612.56
负债和净资产总计		59,718,440.41	74,045,644.04

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.945 元，基金份额总额 62,904,547.80 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联接基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 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
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-7,894,242.77	6,285,208.73
1. 利息收入		7,039.37	9,331.25
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,039.37	9,331.03
债券利息收入		-	0.22
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）		296,243.32	647,468.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-354,380.76	182,457.83
基金投资收益	6.4.7.11	636,816.73	452,621.13
债券投资收益	6.4.7.12	278.32	121.41
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-

股利收益	6.4.7.14	13,529.03	12,268.43
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-8,212,060.91	5,592,790.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	14,535.45	35,618.14
<b>减：二、营业总支出</b>		95,731.62	133,242.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,786.23	15,639.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,557.23	3,127.80
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	80,388.16	114,475.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-7,989,974.39	6,151,966.42
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-7,989,974.39	6,151,966.42
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-7,989,974.39	6,151,966.42

### 6.3 净资产（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联接基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	69,060,282.72	-	4,116,329.84	73,176,612.56
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产（基金净值）	69,060,282.72	-	4,116,329.84	73,176,612.56
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,155,734.92	-	-7,578,065.92	-13,733,800.84
（一）、综合收益总额	-	-	-7,989,974.39	-7,989,974.39
（二）、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）	-6,155,734.92	-	411,908.47	-5,743,826.45
其中：1. 基金申购款	9,716,466.96	-	-750,103.49	8,966,363.47
2. 基金赎回款	-15,872,201.88	-	1,162,011.96	-14,710,189.92
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	62,904,547.80	-	-3,461,736.08	59,442,811.72
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	84,497,470.31	-	-6,629,858.54	77,867,611.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	84,497,470.31	-	-6,629,858.54	77,867,611.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,496,931.44	-	5,842,369.42	10,339,300.86
（一）、综合收益总额	-	-	6,151,966.42	6,151,966.42
（二）、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）	4,496,931.44	-	-309,597.00	4,187,334.44
其中：1. 基金申购款	46,373,774.75	-	-2,685,272.83	43,688,501.92
2. 基金赎回款	-41,876,843.31	-	2,375,675.83	-39,501,167.48



(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	88,994,401.75	-	-787,489.12	88,206,912.63

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：

<u>康乐</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</u>
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联接基金(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[2015]899 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联接基金募集的批复》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联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,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 213,813,305.77 元,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(2015)第 720 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联接基金基金合同》于 2015 年 6 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 213,867,925.87 份基金份额,其中认购资金利息折合 54,620.10 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。

本基金是景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是主要采用完全复制法实现对中证 500 指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%,年化跟踪误差控制在 4%以内。

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联接基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为目标 ETF 基金份额、标的指数成

份股及备选成份股。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%，同时不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款。本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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)。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数 X95%+银行活期存款税后利率 X5%。

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 2022 年 8 月 29 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》、本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 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和净资产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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分

类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以

发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况

下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度可比期间的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 4,634,907.90 元、3,941.01 元、12,774.58 元、440.07 元、158,964.40 元和 55,358.68 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 4,635,340.37 元、3,942.81 元、12,780.38 元、0.00 元、158,964.40 元和 55,358.68 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 69,179,257.40 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 69,179,257.40 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 661,832.06 元、2,313.70 元、462.74 元、

42,538.25 元和 1,884.73 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 661,832.06 元、2,313.70 元、462.74 元、42,538.25 元和 1,884.73 元。

于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	3,732,576.63
等于：本金	3,732,238.90
加：应计利息	337.73
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1 个月（含）-3 个月	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,732,576.63

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,098,738.40	-	1,131,186.37	32,447.97
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	50,046,291.36	-	54,782,000.00	4,735,708.64
其他	-	-	-	-
合计	51,145,029.76	-	55,913,186.37	4,768,156.61

注：于本期末，基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金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

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元



项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	500.84
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,245.89
其中：交易所市场	5,245.89
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	85,089.89

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,060,282.72	69,060,282.72
本期申购	9,716,466.96	9,716,466.96
本期赎回（以“-”号填列）	-15,872,201.88	-15,872,201.88
本期末	62,904,547.80	62,904,547.80

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 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
本期期初	-919,806.61	5,036,136.45	4,116,329.84
本期利润	222,086.52	-8,212,060.91	-7,989,974.39
本期基金份额交易产生的变动数	65,605.13	346,303.34	411,908.47
其中：基金申购款	-92,969.02	-657,134.47	-750,103.49
基金赎回款	158,574.15	1,003,437.81	1,162,011.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-632,114.96	-2,829,621.12	-3,461,736.08

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,881.47
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	48.16
其他	109.74
合计	7,039.37

**6.4.7.10 股票投资收益****6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-267,257.94
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-87,122.82
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-354,380.76

**6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	7,012,794.24
减：卖出股票成本总额	7,264,023.78
减：交易费用	16,028.40
买卖股票差价收入	-267,257.94

**6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
申购基金份额总额	1,778,200.00
减：现金支付申购款总额	59,322.32
减：申购股票成本总额	1,806,000.50
减：交易费用	-
申购差价收入	-87,122.82

**6.4.7.11 基金投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	7,787,149.39
减：卖出/赎回基金成本总额	7,150,067.14
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	265.52
基金投资收益	636,816.73

### 6.4.7.12 债券投资收益

#### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	277.99
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	278.32

#### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,478.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,200.00
减：应计利息总额	0.33
减：交易费用	0.06
买卖债券差价收入	277.99

### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,529.03
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	13,529.03

### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-8,212,060.91
股票投资	45,383.95
债券投资	-
资产支持证券投资	-

基金投资	-8,257,444.86
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	-8,212,060.91

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	13,642.54
基金转换费收入	892.91
合计	14,535.45

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,045.00
合计	80,388.16

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

投资基金(“目标 ETF”)
----------------

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	4,979,284.64	56.01	10,773,508.09	49.57

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022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	4,637.92	56.01	2,996.38	57.12
关联方名称	上年度可比期间 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	10,035.70	49.58	7,130.12	51.00

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,786.23	15,639.15
其中：支付销售机构的客户维护费	62,323.86	81,007.82

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取 0)的 0.50%年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

$$\text{日管理人报酬} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值}) \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,557.23	3,127.80

注:本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费,支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数,则取零)的 0.10%年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

$$\text{日托管费} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值}) \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	3,732,576.63	6,881.47	5,644,369.58	9,052.04

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

1、于本报告期末，本基金持有 28,000,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 91.58%(2021 年 12 月 31 日：本基金持有 31,000,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 92.34%)。

2、于本报告期末，本基金持有 100 股的长城证券普通股，成本总额为人民币 1,035.00 元，估值总额为人民币 1,016.00 元，占基金资产净值的比例为 0.002%(2021 年 12 月 31 日：本基金持有 100 股的长城证券（证券代码：002939）普通股，成本总额为人民币 1,372.00 元，估值总额为人民币 1,295.00 元，占基金资产净值的比例为 0.002%)。

#### 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(2022 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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
002670	国盛金控	2022 年 6 月 1 日	重大事项停牌	9.60	2022 年 7 月 14 日	9.99	800	7,677.22	7,680.00	-

注：本基金截至 2022 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%。

于本报告期末，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（上年度末：同）。



### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金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 2022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	3,732,576.63	-	-	-	-	-	3,732,576.63
结算备付金	4.62	-	-	-	-	-	4.62
存出保证金	3,135.79	-	-	-	-	-	3,135.79
交易性金融资产	-	-	-	-	-	55,913,186.37	55,913,186.37
应收申购款	-	-	-	-	-	69,537.00	69,537.00
资产总计	3,735,717.04	-	-	-	-	55,982,723.37	59,718,440.41
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	188,141.29	188,141.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,955.88	1,955.88
应付托管费	-	-	-	-	-	391.19	391.19
应付证券清算款	-	-	-	-	-	50.44	50.44
其他负债	-	-	-	-	-	85,089.89	85,089.89
负债总计	-	-	-	-	-	275,628.69	275,628.69
利率敏感度缺口	3,735,717.04	-	-	-	-	-	-
上年度末 2021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	4,634,907.90	-	-	-	-	4,634,907.90
结算备付金	3,941.01	-	-	-	-	3,941.01
存出保证金	12,774.58	-	-	-	-	12,774.58
交易性金融资产	-	-	-	-	69,179,257.40	69,179,257.40
应收利息	-	-	-	-	440.07	440.07
应收申购款	-	-	-	-	55,358.68	55,358.68
应收证券清算款	-	-	-	-	158,964.40	158,964.40
资产总计	4,651,623.49	-	-	-	69,394,020.55	74,045,644.04
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	661,832.06	661,832.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,313.70	2,313.70
应付托管费	-	-	-	-	462.74	462.74
应付交易费用	-	-	-	-	42,538.25	42,538.25
其他负债	-	-	-	-	161,884.73	161,884.73
负债总计	-	-	-	-	869,031.48	869,031.48
利率敏感度缺口	4,651,623.49	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有债券资产（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	1,131,186.37	1.90	768,457.40	1.05
交易性金融资产—基金投资	54,782,000.00	92.16	68,410,800.00	93.49

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	55,913,186.37	94.06	69,179,257.40	94.54

#### 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	2,724,130.86	2,258,131.12
	沪深 300 指数下降 5%	-2,724,130.86	-2,258,131.12

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	55,905,506.37	69,176,245.40
第二层次	7,680.00	3,012.00
第三层次	-	-
合计	55,913,186.37	69,179,257.40

###### 6.4.14.2.2 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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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工具(2021 年 12 月 31 日:同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,131,186.37	1.89
	其中:股票	1,131,186.37	1.89
2	基金投资	54,782,000.00	91.73
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	3,732,581.25	6.25
8	其他各项资产	72,672.79	0.12
9	合计	59,718,440.41	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	---------	---------------

A	农、林、牧、渔业	7,360.00	0.01
B	采矿业	38,289.00	0.06
C	制造业	739,518.32	1.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,099.00	0.05
E	建筑业	12,022.00	0.02
F	批发和零售业	28,888.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	21,414.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	85,864.00	0.14
J	金融业	88,738.05	0.15
K	房地产业	19,686.00	0.03
L	租赁和商务服务业	11,451.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	26,148.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	5,028.00	0.01
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	10,487.00	0.02
S	综合	7,194.00	0.01
	合计	1,131,186.37	1.90

### 7.2.2 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

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	688390	固德威	200	62,602.00	0.11
2	300769	德方纳米	100	40,868.00	0.07
3	605117	德业股份	100	27,989.00	0.05
4	600563	法拉电子	100	20,516.00	0.03
5	688099	晶晨股份	200	20,200.00	0.03
6	688122	西部超导	200	18,440.00	0.03
7	603345	安井食品	100	16,787.00	0.03
8	603605	珀莱雅	100	16,518.00	0.03
9	002756	永兴材料	100	15,221.00	0.03
10	688180	君实生物	200	15,068.00	0.03
11	688777	中控技术	200	14,552.00	0.02
12	603026	石大胜华	100	14,535.00	0.02
13	603267	鸿远电子	100	13,433.00	0.02

14	600486	扬农化工	100	13,328.00	0.02
15	600522	中天科技	500	11,550.00	0.02
16	603127	昭衍新药	100	11,380.00	0.02
17	601615	明阳智能	300	10,140.00	0.02
18	002407	多氟多	200	9,782.00	0.02
19	300073	当升科技	100	9,034.00	0.02
20	300724	捷佳伟创	100	8,935.00	0.02
21	603613	国联股份	100	8,860.00	0.01
22	600141	兴发集团	200	8,798.00	0.01
23	300390	天华超净	100	8,740.00	0.01
24	300363	博腾股份	100	7,799.00	0.01
25	002670	国盛金控	800	7,680.00	0.01
26	600256	广汇能源	700	7,378.00	0.01
27	300676	华大基因	100	7,170.00	0.01
28	300012	华测检测	300	6,963.00	0.01
29	600732	爱旭股份	200	6,604.00	0.01
30	002497	雅化集团	200	6,530.00	0.01
31	600765	中航重机	200	6,436.00	0.01
32	600096	云天化	200	6,296.00	0.01
33	002240	盛新锂能	100	6,036.00	0.01
34	300699	光威复材	100	5,887.00	0.01
35	600157	永泰能源	3,700	5,883.00	0.01
36	603589	口子窖	100	5,861.00	0.01
37	600885	宏发股份	140	5,859.00	0.01
38	603517	绝味食品	100	5,782.00	0.01
39	002557	洽洽食品	100	5,693.00	0.01
40	000009	中国宝安	400	5,396.00	0.01
41	603939	益丰药房	100	5,283.00	0.01
42	300037	新宙邦	100	5,256.00	0.01
43	603456	九洲药业	100	5,170.00	0.01
44	002180	纳思达	100	5,062.00	0.01
45	600298	安琪酵母	100	4,875.00	0.01
46	000988	华工科技	200	4,634.00	0.01
47	002384	东山精密	200	4,586.00	0.01
48	600392	盛和资源	200	4,520.00	0.01
49	601058	赛轮轮胎	400	4,508.00	0.01
50	000999	华润三九	100	4,500.00	0.01
51	600487	亨通光电	300	4,362.00	0.01
52	601555	东吴证券	620	4,296.60	0.01
53	002268	卫士通	100	4,291.00	0.01
54	603077	和邦生物	1,000	4,260.00	0.01
55	600499	科达制造	200	4,128.00	0.01

56	600233	圆通速递	200	4,078.00	0.01
57	002353	杰瑞股份	100	4,030.00	0.01
58	000983	山西焦煤	300	4,017.00	0.01
59	601108	财通证券	500	3,935.00	0.01
60	000630	铜陵有色	1,200	3,912.00	0.01
61	002385	大北农	500	3,905.00	0.01
62	002185	华天科技	400	3,752.00	0.01
63	601077	渝农商行	1,000	3,700.00	0.01
64	002508	老板电器	100	3,603.00	0.01
65	300285	国瓷材料	100	3,592.00	0.01
66	600399	抚顺特钢	200	3,580.00	0.01
67	002028	思源电气	100	3,566.00	0.01
68	000783	长江证券	600	3,558.00	0.01
69	601168	西部矿业	300	3,549.00	0.01
70	601162	天风证券	1,100	3,498.00	0.01
71	002625	光启技术	200	3,454.00	0.01
72	002507	涪陵榨菜	100	3,452.00	0.01
73	600418	江淮汽车	200	3,432.00	0.01
74	002326	永太科技	100	3,293.00	0.01
75	002797	第一创业	500	3,205.00	0.01
76	600988	赤峰黄金	200	3,190.00	0.01
77	600039	四川路桥	300	3,159.00	0.01
78	000831	五矿稀土	100	3,125.00	0.01
79	600497	驰宏锌锗	600	3,114.00	0.01
79	600705	中航产融	900	3,114.00	0.01
80	600348	华阳股份	200	3,092.00	0.01
81	300144	宋城演艺	200	3,070.00	0.01
82	601128	常熟银行	400	3,056.00	0.01
83	000932	华菱钢铁	600	3,054.00	0.01
84	300088	长信科技	400	2,968.00	0.00
85	601699	潞安环能	200	2,924.00	0.00
86	000519	中兵红箭	100	2,915.00	0.00
87	601872	招商轮船	500	2,880.00	0.00
88	002624	完美世界	200	2,874.00	0.00
89	600143	金发科技	300	2,856.00	0.00
90	000738	航发控制	100	2,810.00	0.00
90	600862	中航高科	100	2,810.00	0.00
91	000039	中集集团	200	2,770.00	0.00
92	002572	索菲亚	100	2,750.00	0.00
93	002465	海格通信	300	2,727.00	0.00
93	600170	上海建工	900	2,727.00	0.00
94	002138	顺络电子	100	2,725.00	0.00



95	600109	国金证券	300	2,700.00	0.00
96	002056	横店东磁	100	2,662.00	0.00
97	000629	攀钢钒钛	700	2,660.00	0.00
97	601696	中银证券	200	2,660.00	0.00
98	600177	雅戈尔	400	2,652.00	0.00
99	600160	巨化股份	200	2,630.00	0.00
100	002673	西部证券	400	2,616.00	0.00
101	600153	建发股份	200	2,614.00	0.00
102	300058	蓝色光标	400	2,612.00	0.00
103	600859	王府井	100	2,598.00	0.00
104	002223	鱼跃医疗	100	2,566.00	0.00
105	600704	物产中大	500	2,565.00	0.00
106	601636	旗滨集团	200	2,550.00	0.00
107	601990	南京证券	300	2,502.00	0.00
108	000728	国元证券	400	2,488.00	0.00
109	002078	太阳纸业	200	2,462.00	0.00
110	002603	以岭药业	100	2,430.00	0.00
111	002273	水晶光电	200	2,422.00	0.00
112	002372	伟星新材	100	2,404.00	0.00
113	601016	节能风电	500	2,400.00	0.00
114	000547	航天发展	200	2,388.00	0.00
115	601577	长沙银行	300	2,379.00	0.00
116	002092	中泰化学	300	2,328.00	0.00
117	601997	贵阳银行	400	2,324.00	0.00
118	300026	红日药业	300	2,310.00	0.00
119	600516	方大炭素	300	2,280.00	0.00
120	000878	云南铜业	200	2,278.00	0.00
121	600642	申能股份	400	2,272.00	0.00
122	600521	华海药业	100	2,270.00	0.00
123	002506	协鑫集成	600	2,232.00	0.00
124	600415	小商品城	400	2,228.00	0.00
125	300296	利亚德	300	2,190.00	0.00
126	000750	国海证券	600	2,178.00	0.00
127	300146	汤臣倍健	100	2,165.00	0.00
128	002183	怡亚通	300	2,163.00	0.00
129	600549	厦门钨业	100	2,162.00	0.00
130	600637	东方明珠	300	2,145.00	0.00
131	300017	网宿科技	400	2,144.00	0.00
132	002131	利欧股份	1,100	2,134.00	0.00
133	601005	重庆钢铁	1,100	2,101.00	0.00
134	300383	光环新网	200	2,084.00	0.00
135	002936	郑州银行	770	2,071.30	0.00

136	600867	通化东宝	200	2,068.00	0.00
137	600026	中远海能	200	2,066.00	0.00
138	002212	天融信	200	2,030.00	0.00
138	600008	首创环保	700	2,030.00	0.00
139	002195	二三四五	900	2,025.00	0.00
140	300024	机器人	200	2,016.00	0.00
141	000050	深天马 A	200	1,994.00	0.00
142	002439	启明星辰	100	1,993.00	0.00
143	002958	青农商行	600	1,992.00	0.00
144	600369	西南证券	500	1,985.00	0.00
145	600166	福田汽车	700	1,981.00	0.00
146	000807	云铝股份	200	1,976.00	0.00
147	600027	华电国际	500	1,965.00	0.00
148	600801	华新水泥	100	1,951.00	0.00
149	000975	银泰黄金	200	1,948.00	0.00
150	600879	航天电子	300	1,947.00	0.00
151	600546	山煤国际	100	1,946.00	0.00
152	600372	中航电子	100	1,939.00	0.00
152	601992	金隅集团	700	1,939.00	0.00
153	000729	燕京啤酒	200	1,932.00	0.00
153	600208	新湖中宝	700	1,932.00	0.00
154	000778	新兴铸管	400	1,928.00	0.00
155	000027	深圳能源	300	1,923.00	0.00
156	000400	许继电气	100	1,920.00	0.00
157	002299	圣农发展	100	1,918.00	0.00
158	002065	东华软件	300	1,896.00	0.00
159	300168	万达信息	200	1,888.00	0.00
160	002444	巨星科技	100	1,884.00	0.00
161	000636	风华高科	100	1,879.00	0.00
162	000970	中科三环	100	1,878.00	0.00
163	002422	科伦药业	100	1,870.00	0.00
164	002152	广电运通	200	1,854.00	0.00
165	002249	大洋电机	300	1,842.00	0.00
166	600820	隧道股份	300	1,836.00	0.00
167	002966	苏州银行	300	1,830.00	0.00
168	600236	桂冠电力	300	1,827.00	0.00
169	600863	内蒙华电	500	1,825.00	0.00
170	000887	中鼎股份	100	1,824.00	0.00
171	600909	华安证券	400	1,820.00	0.00
172	601607	上海医药	100	1,808.00	0.00
173	601866	中远海发	600	1,800.00	0.00
174	600673	东阳光	200	1,798.00	0.00

175	000060	中金岭南	400	1,784.00	0.00
176	601198	东兴证券	200	1,780.00	0.00
177	300253	卫宁健康	200	1,756.00	0.00
178	300001	特锐德	100	1,731.00	0.00
179	002244	滨江集团	200	1,730.00	0.00
179	600066	宇通客车	200	1,730.00	0.00
180	000830	鲁西化工	100	1,729.00	0.00
181	600839	四川长虹	600	1,728.00	0.00
182	002500	山西证券	300	1,722.00	0.00
183	002030	达安基因	100	1,719.00	0.00
184	000656	金科股份	600	1,716.00	0.00
185	600155	华创阳安	200	1,696.00	0.00
186	002505	鹏都农牧	500	1,695.00	0.00
187	300136	信维通信	100	1,685.00	0.00
188	000960	锡业股份	100	1,677.00	0.00
189	000998	隆平高科	100	1,666.00	0.00
190	300182	捷成股份	300	1,650.00	0.00
191	600875	东方电气	100	1,645.00	0.00
192	600409	三友化工	200	1,638.00	0.00
193	002250	联化科技	100	1,637.00	0.00
194	000825	太钢不锈	300	1,635.00	0.00
195	600959	江苏有线	500	1,630.00	0.00
196	002408	齐翔腾达	200	1,622.00	0.00
197	600528	中铁工业	200	1,610.00	0.00
198	002127	南极电商	300	1,602.00	0.00
199	300418	昆仑万维	100	1,600.00	0.00
199	600079	人福医药	100	1,600.00	0.00
200	002153	石基信息	100	1,587.00	0.00
201	000709	河钢股份	700	1,582.00	0.00
202	600282	南钢股份	500	1,575.00	0.00
203	600482	中国动力	100	1,571.00	0.00
203	600699	均胜电子	100	1,571.00	0.00
204	002926	华西证券	200	1,568.00	0.00
205	600022	山东钢铁	900	1,566.00	0.00
205	600297	广汇汽车	600	1,566.00	0.00
206	300070	碧水源	300	1,563.00	0.00
207	002701	奥瑞金	300	1,560.00	0.00
208	688009	中国通号	344	1,558.32	0.00
209	002156	通富微电	100	1,540.00	0.00
210	000598	兴蓉环境	300	1,533.00	0.00
210	000883	湖北能源	300	1,533.00	0.00
211	601880	辽港股份	900	1,530.00	0.00

212	600808	马钢股份	400	1,516.00	0.00
213	600325	华发股份	200	1,514.00	0.00
214	600782	新钢股份	300	1,512.00	0.00
215	600755	厦门国贸	200	1,500.00	0.00
216	000012	南玻 A	200	1,484.00	0.00
216	002002	鸿达兴业	400	1,484.00	0.00
217	600056	中国医药	100	1,482.00	0.00
218	000623	吉林敖东	100	1,476.00	0.00
218	600598	北大荒	100	1,476.00	0.00
218	600667	太极实业	200	1,476.00	0.00
219	600390	五矿资本	300	1,467.00	0.00
220	600739	辽宁成大	100	1,458.00	0.00
221	600985	淮北矿业	100	1,456.00	0.00
222	600498	烽火通信	100	1,448.00	0.00
223	600580	卧龙电驱	100	1,442.00	0.00
224	000987	越秀金控	205	1,441.15	0.00
225	601717	郑煤机	100	1,441.00	0.00
226	002266	浙富控股	300	1,437.00	0.00
227	002128	电投能源	100	1,432.00	0.00
228	601179	中国西电	300	1,404.00	0.00
229	000686	东北证券	200	1,398.00	0.00
229	002019	亿帆医药	100	1,398.00	0.00
230	600567	山鹰国际	500	1,385.00	0.00
231	002390	信邦制药	200	1,382.00	0.00
232	002739	万达电影	100	1,365.00	0.00
232	600216	浙江医药	100	1,365.00	0.00
233	600848	上海临港	100	1,356.00	0.00
234	000540	中天金融	700	1,351.00	0.00
235	002124	天邦食品	200	1,344.00	0.00
236	000785	居然之家	300	1,335.00	0.00
237	600500	中化国际	200	1,330.00	0.00
238	600572	康恩贝	300	1,329.00	0.00
239	000997	新大陆	100	1,321.00	0.00
239	600827	百联股份	100	1,321.00	0.00
240	000690	宝新能源	300	1,314.00	0.00
241	002532	天山铝业	200	1,306.00	0.00
242	600728	佳都科技	200	1,292.00	0.00
243	601000	唐山港	500	1,290.00	0.00
244	000898	鞍钢股份	400	1,288.00	0.00
245	601568	北元集团	200	1,268.00	0.00
246	600597	光明乳业	100	1,263.00	0.00
247	002511	中顺洁柔	100	1,252.00	0.00

248	600060	海信视像	100	1,250.00	0.00
249	600895	张江高科	100	1,245.00	0.00
250	601718	际华集团	400	1,240.00	0.00
251	600380	健康元	100	1,235.00	0.00
252	601106	中国一重	400	1,228.00	0.00
253	601456	国联证券	100	1,227.00	0.00
254	600195	中牧股份	100	1,226.00	0.00
255	002110	三钢闽光	200	1,218.00	0.00
256	002155	湖南黄金	100	1,214.00	0.00
257	002468	申通快递	100	1,192.00	0.00
258	600998	九州通	100	1,191.00	0.00
259	000402	金融街	200	1,190.00	0.00
260	000559	万向钱潮	200	1,188.00	0.00
261	000021	深科技	100	1,164.00	0.00
262	002203	海亮股份	100	1,155.00	0.00
263	603225	新凤鸣	100	1,154.00	0.00
264	002429	兆驰股份	300	1,152.00	0.00
265	600718	东软集团	100	1,151.00	0.00
266	601860	紫金银行	400	1,148.00	0.00
267	600871	石化油服	600	1,134.00	0.00
268	600811	东方集团	400	1,132.00	0.00
269	000488	晨鸣纸业	200	1,128.00	0.00
270	002004	华邦健康	200	1,116.00	0.00
271	002373	千方科技	100	1,112.00	0.00
272	600064	南京高科	100	1,100.00	0.00
273	000990	诚志股份	100	1,095.00	0.00
274	600271	航天信息	100	1,094.00	0.00
275	601333	广深铁路	500	1,090.00	0.00
276	601778	晶科科技	200	1,080.00	0.00
277	002191	劲嘉股份	100	1,072.00	0.00
278	000401	冀东水泥	100	1,052.00	0.00
279	600535	天士力	100	1,051.00	0.00
280	600446	金证股份	100	1,038.00	0.00
280	600517	国网英大	200	1,038.00	0.00
281	600663	陆家嘴	100	1,036.00	0.00
282	300115	长盈精密	100	1,031.00	0.00
283	600901	江苏租赁	200	1,026.00	0.00
284	600021	上海电力	100	1,025.00	0.00
285	600126	杭钢股份	200	1,024.00	0.00
286	002081	金螳螂	200	1,016.00	0.00
286	002939	长城证券	100	1,016.00	0.00
286	601200	上海环境	100	1,016.00	0.00

287	000967	盈峰环境	200	1,012.00	0.00
287	300072	海新能科	200	1,012.00	0.00
288	300009	安科生物	100	1,011.00	0.00
289	600373	中文传媒	100	999.00	0.00
290	600376	首开股份	200	982.00	0.00
291	002174	游族网络	100	977.00	0.00
291	002745	木林森	100	977.00	0.00
292	601991	大唐发电	400	972.00	0.00
293	600307	酒钢宏兴	500	970.00	0.00
294	600970	中材国际	100	969.00	0.00
295	600582	天地科技	200	956.00	0.00
295	601118	海南橡胶	200	956.00	0.00
296	002382	蓝帆医疗	100	955.00	0.00
297	000959	首钢股份	200	952.00	0.00
298	600398	海澜之家	200	950.00	0.00
299	300251	光线传媒	100	947.00	0.00
300	601098	中南传媒	100	944.00	0.00
301	600037	歌华有线	100	939.00	0.00
302	000563	陕国投 A	300	936.00	0.00
302	600707	彩虹股份	200	936.00	0.00
303	002221	东华能源	100	931.00	0.00
304	002416	爱施德	100	930.00	0.00
305	300166	东方国信	100	922.00	0.00
306	600201	生物股份	100	916.00	0.00
307	000961	中南建设	300	915.00	0.00
308	600967	内蒙一机	100	912.00	0.00
309	002146	荣盛发展	300	909.00	0.00
310	000930	中粮科技	100	904.00	0.00
311	600906	财达证券	100	899.00	0.00
312	002233	塔牌集团	100	885.00	0.00
313	601958	金钼股份	100	884.00	0.00
314	000671	阳光城	400	876.00	0.00
315	000415	渤海租赁	400	868.00	0.00
316	600435	北方导航	100	862.00	0.00
317	601969	海南矿业	100	859.00	0.00
318	002434	万里扬	100	855.00	0.00
319	601611	中国核建	100	839.00	0.00
320	600623	华谊集团	100	830.00	0.00
321	600556	天下秀	100	823.00	0.00
322	300376	易事特	100	812.00	0.00
323	600120	浙江东方	200	802.00	0.00
323	600717	天津港	200	802.00	0.00

324	000031	大悦城	200	800.00	0.00
325	000156	华数传媒	100	797.00	0.00
326	601598	中国外运	200	776.00	0.00
327	600968	海油发展	300	774.00	0.00
328	000089	深圳机场	100	772.00	0.00
329	600095	湘财股份	100	769.00	0.00
330	000685	中山公用	100	768.00	0.00
331	001965	招商公路	100	763.00	0.00
332	601608	中信重工	200	758.00	0.00
333	600006	东风汽车	100	755.00	0.00
334	600737	中粮糖业	100	752.00	0.00
335	600167	联美控股	100	749.00	0.00
336	000937	冀中能源	100	746.00	0.00
337	000718	苏宁环球	200	736.00	0.00
338	600928	西安银行	200	734.00	0.00
338	601228	广州港	200	734.00	0.00
339	002948	青岛银行	200	724.00	0.00
340	601928	凤凰传媒	100	715.00	0.00
341	000717	韶钢松山	200	700.00	0.00
342	600507	方大特钢	100	699.00	0.00
343	002387	维信诺	100	672.00	0.00
344	002423	中粮资本	100	671.00	0.00
345	000528	柳工	100	651.00	0.00
346	002010	传化智联	100	643.00	0.00
347	003035	南网能源	100	635.00	0.00
348	000158	常山北明	100	600.00	0.00
349	601187	厦门银行	100	596.00	0.00
350	002563	森马服饰	100	592.00	0.00
351	600339	中油工程	200	578.00	0.00
352	600787	中储股份	100	569.00	0.00
353	601298	青岛港	100	547.00	0.00
354	600350	山东高速	100	525.00	0.00
355	001227	兰州银行	100	492.00	0.00
356	600823	世茂股份	100	298.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603444	吉比特	183,292.00	0.25
2	688390	固德威	116,126.00	0.16
3	688185	康希诺	77,209.14	0.11

4	605117	德业股份	46,110.00	0.06
5	300751	迈为股份	39,000.00	0.05
6	688256	寒武纪	38,574.00	0.05
7	300763	锦浪科技	37,699.00	0.05
8	300769	德方纳米	36,800.00	0.05
9	603605	珀莱雅	36,268.00	0.05
10	603290	斯达半导	33,727.00	0.05
11	688536	思瑞浦	28,929.20	0.04
12	688521	芯原股份	27,701.36	0.04
13	603026	石大胜华	26,929.00	0.04
14	603267	鸿远电子	25,690.00	0.04
15	688208	道通科技	24,982.00	0.03
16	600563	法拉电子	18,060.00	0.02
17	688122	西部超导	17,932.00	0.02
18	688180	君实生物	16,676.00	0.02
19	688777	中控技术	15,998.00	0.02
20	600141	兴发集团	15,333.00	0.02

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	603444	吉比特	178,290.00	0.24
2	300751	迈为股份	97,462.00	0.13
3	688185	康希诺	77,210.90	0.11
4	688390	固德威	63,280.00	0.09
5	600522	中天科技	47,584.00	0.07
6	600256	广汇能源	43,043.00	0.06
7	601615	明阳智能	42,719.00	0.06
8	300763	锦浪科技	41,860.00	0.06
9	600486	扬农化工	40,972.00	0.06
10	600885	宏发股份	40,335.00	0.06
11	603613	国联股份	39,397.60	0.05
12	688256	寒武纪	38,744.00	0.05
13	603290	斯达半导	38,160.00	0.05
14	300037	新宙邦	37,919.40	0.05
15	600157	永泰能源	36,877.00	0.05
16	300474	景嘉微	36,766.00	0.05
17	000733	振华科技	35,753.00	0.05
18	000009	中国宝安	35,671.00	0.05
19	002353	杰瑞股份	34,629.00	0.05
20	002340	格林美	34,514.00	0.05



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	1,877,653.30
卖出股票收入（成交）总额	7,012,794.24

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投资。

### 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投资。

### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	股票型指数基金	交易型开放式 (ETF)	景顺长城基金管理有限公司	54,782,000.00	92.16

### 7.11 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和交易成本。

### 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.12.1 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。

### 7.12.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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。

#### 7.13.2 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。

#### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,135.79
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	69,537.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,672.79

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.13.6 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 (%)

8,722	7,212.17	0.00	0.00	62,904,547.80	100.00
-------	----------	------	------	---------------	--------

## 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	6,230.25	0.009904

## 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（2015年6月29日） 基金份额总额	213,867,925.87
本报告期期初基金份额总额	69,060,282.72
本报告期基金总申购份额	9,716,466.96
减：本报告期基金总赎回份额	15,872,201.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	62,904,547.80

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

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	4,979,284.64	56.01	4,637.92	56.01	-
中国银河证券股份有限公司	1	3,910,739.90	43.99	3,642.03	43.99	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
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	2	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1,478.38	100.00	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-01
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行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	2022-01-01
3	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	2022-01-07
4	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	2022-01-20
5	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 2021 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-24
7	关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份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	2022-01-25
8	景顺长城基金管理有限公司关于投资旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-27
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	2022-02-18
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	2022-02-25
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	2022-03-04
12	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 2021 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
14	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京晟视天下基金销售有限公司和北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-01
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机升级的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08
16	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	2022-04-12
17	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	2022-04-16
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22

	停机维护的公告		
20	景顺长城基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
21	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 2022 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-22
22	景顺长城基金管理有限公司关于终止上海朝阳永续基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-27
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	2022-04-29
24	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	2022-05-06
25	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	2022-05-12
26	景顺长城基金管理有限公司关于暂停腾元基金、汇付基金、南京途牛和有鱼基金办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-26
27	关于旗下部分基金新增攀赢基金为销售机构并开通基金定期定额投资业务、基金转换业务及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-26
28	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 2022 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-27
29	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基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-27
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	2022-06-10
31	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-22
32	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信百信银行为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”及参加申购、定期定额投资申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-23
33	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	2022-06-24

## §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 交易型开放式指数证券投资基金联接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联接基金基金合同》；

3、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；

4、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

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

2022 年 8 月 31 日