

景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基  
金  
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 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 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58

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 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
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 .....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
7.12 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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 .....	60
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
10.4 基金投资策略的改变 .....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
10.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</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 .....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
12.1 备查文件目录 .....	67
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	景顺长城中证 500 指数增强	
场内简称	无	
基金主代码	006682	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 3 月 25 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	915,778,263.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交 易代码	006682	016935
报告期末下属分级 基金的份额总额	899,084,122.12 份	16,694,141.09 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法追求超越标的指数的业绩水平。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为指数基金，股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p> <p>4、权证、股指期货投资策略</p> <p>本基金可投资权证、股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融</p>

	<p>产品。</p> <p>本基金对权证的分析判断主要从市场环境、时机、权证定价、市场供求、发行人资质、交易冲击等方面综合考量，运用权证定价模型计算权证当前的合理价格。本基金适时选择具有相对优势的权证并制定相应的投资计划。</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>5、中小企业私募债券的投资策略</p> <p>对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金将加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66596688
	电子邮箱	investor@igwfm.com	fxjd_hq@bank-of-china.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	葛海蛟

### 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(2024年1月1日-2024年6月30日)		
	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C	
本期已实现收益	-32,291,226.46	-1,614,804.00	
本期利润	-63,135,632.63	226,867.38	
加权平均基金份额本期利润	-0.0681	0.0108	
本期加权平均净值利润率	-5.59%	0.90%	
本期基金份额净值增长率	-5.31%	-5.49%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)		
	期末可供分配利润	167,572,667.81	2,987,293.51
	期末可供分配基金份额利润	0.1864	0.1789
	期末基金资产净值	1,066,656,789.93	19,681,434.60
	期末基金份额净值	1.1863	1.1789
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)		
	基金份额累计净值增长率	18.63%	-17.58%

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四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

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

低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.41%	0.91%	-6.55%	0.91%	1.14%	0.00%
过去三个月	-3.82%	1.04%	-6.16%	1.09%	2.34%	-0.05%
过去六个月	-5.31%	1.47%	-8.46%	1.53%	3.15%	-0.06%
过去一年	-12.60%	1.18%	-16.71%	1.21%	4.11%	-0.03%
过去三年	-22.80%	1.13%	-26.01%	1.14%	3.21%	-0.01%
自基金合同生效起至今	18.63%	1.23%	-10.97%	1.23%	29.60%	0.00%

景顺长城中证 500 指数增强 C

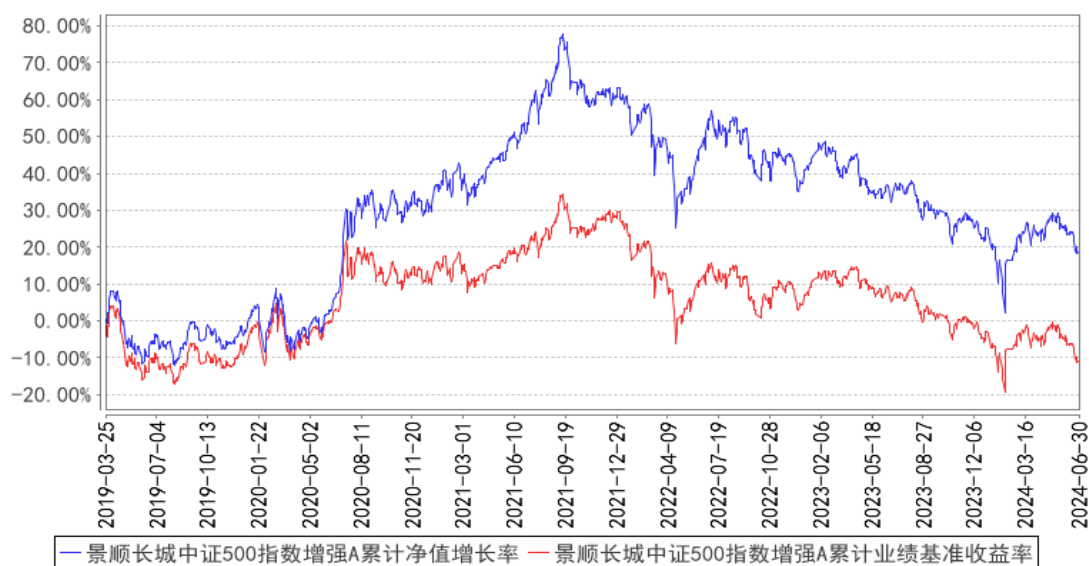
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-5.44%	0.91%	-6.55%	0.91%	1.11%	0.00%
过去三个月	-3.91%	1.04%	-6.16%	1.09%	2.25%	-0.05%
过去六个月	-5.49%	1.47%	-8.46%	1.53%	2.97%	-0.06%
过去一年	-12.96%	1.18%	-16.71%	1.21%	3.75%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-17.58%	1.04%	-16.20%	1.06%	-1.38%	-0.02%

注：本基金于 2022 年 10 月 27 日增设 C 类份额，并于 2022 年 10 月 28 日开始对 C 类份额进行估值。

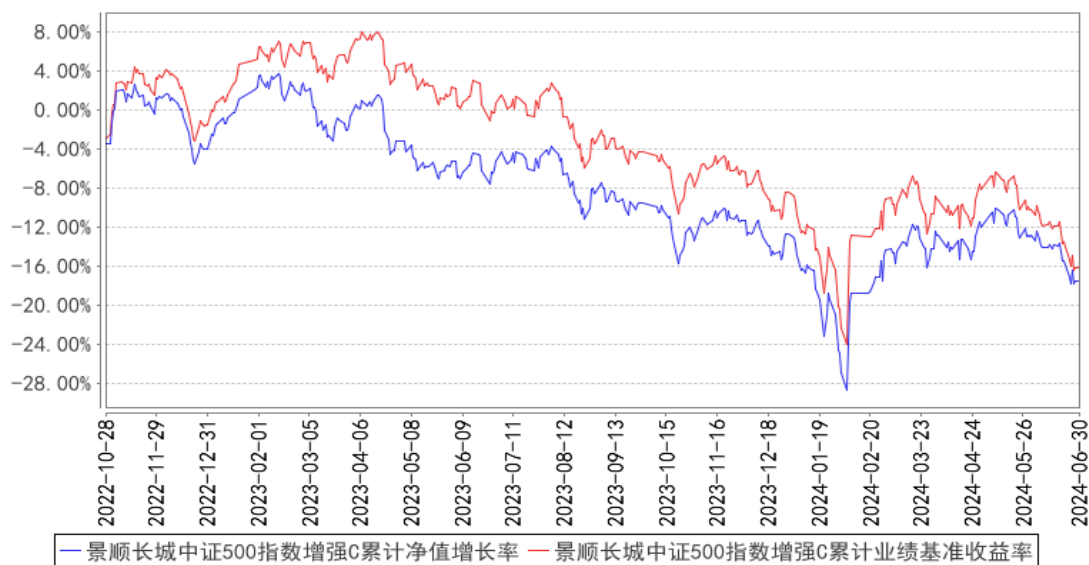


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城中证500指数增强A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



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



注：基金的投资组合比例为：股票投资比例范围为基金资产的 90%—95%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5% 其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的建仓期为自 2019 年 3 月 25 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2022 年 10 月 27 日起增设 C 类基金份额。

### 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2024年6月30日，本公司旗下共管理184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		
徐喻军	本基金的基金经理	2019年3月25日	-	14年	理学硕士，CFA。曾任安信证券风险管理部风险管理专员。2012年3月加入本公司，担任量化及ETF投资部ETF专员，自2014年4月起担任量化及指数投资部基金经理。具有14年证券、基金行业从业经验。
黎海威	本基金的基金经理	2019年3月25日	-	21年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪KMV公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，自2013年10月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有21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 指数增强型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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 9 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

2024 年上半年，国内经济在经历了一季度的亮眼开局之后出现一定的边际走弱，较强的出口数据带动工业生产保持韧性，内需在地产持续下行、居民预期偏弱的背景下仍旧疲弱。从数据来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 50.4、49.5、49.5，5、6 两月 PMI 重新跌入收缩区间。今年前 6 个月工业增加值累计同比增长 6.0%，其中 6 月份工业增加值当月同比增长 5.3%，经济延续弱复苏的格局。6 月 CPI 同比上升 0.2%，环比下降 0.2%；PPI 同比下降 0.8%，环比下降 0.2%，价格类指标依旧偏弱。6 月 M2 同比增长 6.2%，M1 同比下降 5.0%，信贷需求仍然偏弱；6 月末外汇储备

3.22 万亿美元，汇率短期承压。整体而言，国内经济依然处于弱复苏的态势，“稳增长”政策的效果正在逐步显现。上半年 A 股市场震荡调整，结构有所分化，上证指数下跌 0.25%，沪深 300 指数上涨 0.89%，创业板指数下跌 10.99%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，景顺长城中证 500 指数增强 A 份额净值增长率为-5.31%，业绩比较基准收益率为-8.46%。

2024 年上半年，景顺长城中证 500 指数增强 C 份额净值增长率为-5.49%，业绩比较基准收益率为-8.46%。

#### 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 2024 年下半年，海外方面，美联储的货币政策依然是市场关注的热点，但其对国内资本市场的边际影响明显降低。国内方面，我们认为三季度国内经济环比二季度大概率能够边际回升，前期政策的累积效应以及新的“稳增长”政策对经济形成一定支撑；新“国九条”的推出将会改善股市微观供需结构，并进一步提升 A 股市场的投资价值。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行

业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“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 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	69,673,837.67	85,998,122.11
结算备付金		12,454,360.83	6,109,366.10
存出保证金		2,412,970.12	1,407,917.41
交易性金融资产	6.4.7.2	1,007,675,380.09	1,120,766,411.00
其中：股票投资		1,007,675,380.09	1,120,579,398.63
基金投资		-	-
债券投资		-	187,012.37
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	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		6,122.67	-
应收股利		-	-
应收申购款		239,739.85	319,983.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,092,462,411.23	1,214,601,800.18
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		1.72	14,218,471.35
应付赎回款		749,261.85	704,956.77

应付管理人报酬		1,109,211.96	1,196,275.90
应付托管费		184,868.65	199,379.32
应付销售服务费		6,778.79	1,088.75
应付投资顾问费		-	-
应交税费		72,248.62	0.36
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	4,001,815.11	3,375,896.62
负债合计		6,124,186.70	19,696,069.07
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	915,778,263.21	953,799,133.20
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	170,559,961.32	241,106,597.91
净资产合计		1,086,338,224.53	1,194,905,731.11
负债和净资产总计		1,092,462,411.23	1,214,601,800.18

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 915,778,263.21 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.1863 元，基金份额 899,084,122.12 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.1789 元，基金份额 16,694,141.09 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-54,590,564.45	9,062,725.78
1. 利息收入		239,621.81	259,102.48
其中：存款利息收入	6.4.7.13	239,621.81	259,102.48
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-25,889,127.99	-39,227,246.01
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-44,687,476.38	-55,604,173.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	35,488.78	629,549.58
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	2,504,585.12	-188,977.68
股利收益	6.4.7.19	16,258,274.49	15,936,355.34
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）	6.4.7.20	-29,002,734.79	47,444,283.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	61,676.52	586,585.86
<b>减：二、营业总支出</b>		8,318,200.80	11,102,405.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,893,782.31	9,302,573.17
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,148,963.75	1,550,428.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	51,276.37	4,610.37
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		9,031.23	908.91
8. 其他费用	6.4.7.23	215,147.14	243,883.88
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-62,908,765.25	-2,039,679.41
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-62,908,765.25	-2,039,679.41
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-62,908,765.25	-2,039,679.41

### 6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	953,799,133.20	-	241,106,597.91	1,194,905,731.11



资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	953,799,133.20	-	241,106,597.91	1,194,905,731.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-38,020,869.99	-	-70,546,636.59	-108,567,506.58
(一)、综合收益总额	-	-	-62,908,765.25	-62,908,765.25
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-38,020,869.99	-	-7,637,871.34	-45,658,741.33
其中：1. 基金申购款	61,075,510.56	-	11,881,163.99	72,956,674.55
2. 基金赎回款	-99,096,380.55	-	-19,519,035.33	-118,615,415.88
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	915,778,263.21	-	170,559,961.32	1,086,338,224.53
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1,239,871,872.18	-	461,814,100.92	1,701,685,973.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,239,871,872.18	-	461,814,100.92	1,701,685,973.10
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-275,519,952.64	-	-117,073,148.24	-392,593,100.88
(一)、综合收益总额	-	-	-2,039,679.41	-2,039,679.41
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-275,519,952.64	-	-115,033,468.83	-390,553,421.47
其中：1. 基金申购款	60,457,397.49	-	24,830,943.87	85,288,341.36
2. 基金赎回款	-335,977,350.13	-	-139,864,412.70	-475,841,762.83
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	964,351,919.54	-	344,740,952.68	1,309,092,872.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1897 号文《关于准予景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国

证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集。基金合同于 2019 年 3 月 25 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,507,912,000.78 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 967,567.93 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,508,879,568.71 元，折合 1,508,879,568.71 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的约定，经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2022 年 10 月 27 日起对景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

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

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

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

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 2024 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办

法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、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。

#### 6.4.5 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

无。

##### 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

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### (2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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

### （3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### （4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息

所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	69,673,837.67
等于：本金	69,667,792.82
加：应计利息	6,044.85
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	69,673,837.67

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,061,064,873.23	-	1,007,675,380.09	-53,389,493.14

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,061,064,873.23	-	1,007,675,380.09	-53,389,493.14

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	19,733,720.00	-	-	-
其中：股指期货投资	19,733,720.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	19,733,720.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2407	IC2407	19.00	18,686,880.00	-1,046,840.00
合计				-1,046,840.00
减：可抵销期货暂收款				-1,046,840.00
净额				-

注：（1）衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收

款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

(2) 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 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

本基金本报告期末的买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元



项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	581.16
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,844,321.69
其中：交易所市场	3,844,321.69
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	106,912.26
应付指数使用费	50,000.00
合计	4,001,815.11

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 景顺长城中证 500 指数增强 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	951,133,966.87	951,133,966.87
本期申购	25,673,258.09	25,673,258.09
本期赎回（以“-”号填列）	-77,723,102.84	-77,723,102.84
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	899,084,122.12	899,084,122.12

##### 景顺长城中证 500 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,665,166.33	2,665,166.33
本期申购	35,402,252.47	35,402,252.47
本期赎回（以“-”号填列）	-21,373,277.71	-21,373,277.71
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	16,694,141.09	16,694,141.09

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	343,921,689.93	-103,474,525.67	240,447,164.26
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	343,921,689.93	-103,474,525.67	240,447,164.26
本期利润	-32,291,226.46	-30,844,406.17	-63,135,632.63
本期基金份额交易产生的变动数	-16,208,108.77	6,469,244.95	-9,738,863.82
其中：基金申购款	7,935,082.23	-2,793,794.66	5,141,287.57
基金赎回款	-24,143,191.00	9,263,039.61	-14,880,151.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	295,422,354.70	-127,849,686.89	167,572,667.81

景顺长城中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	949,471.42	-290,037.77	659,433.65
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	949,471.42	-290,037.77	659,433.65
本期利润	-1,614,804.00	1,841,671.38	226,867.38
本期基金份额交易产生的变动数	6,022,806.48	-3,921,814.00	2,100,992.48
其中：基金申购款	11,905,835.29	-5,165,958.87	6,739,876.42
基金赎回款	-5,883,028.81	1,244,144.87	-4,638,883.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,357,473.90	-2,370,180.39	2,987,293.51

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	129,522.36
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	109,044.12
其他	1,055.33
合计	239,621.81

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-44,687,476.38
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	-44,687,476.38

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	3,858,945,050.85
减：卖出股票成本总额	3,893,959,181.08
减：交易费用	9,673,346.15
买卖股票差价收入	-44,687,476.38

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	22.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	35,466.36
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	35,488.78

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	222,510.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	187,000.00

本总额	
减：应计利息总额	35.36
减：交易费用	8.90
买卖债券差价收入	35,466.36

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	2,504,585.12

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,258,274.49
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	16,258,274.49

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-28,138,774.79

股票投资	-28,138,774.79
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	-863,960.00
权证投资	-
期货投资	-863,960.00
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	-29,002,734.79

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	59,889.75
基金转换费收入	1,786.77
合计	61,676.52

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	47,239.92
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	7,901.16
指数使用费	100,000.00
存托服务费	333.72
合计	215,147.14

#### 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、基金销售机构

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	194,401,130.26	2.54	602,092,893.06	5.23

#### 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 2024年1月1日至2024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	183,888.14	2.54	117,399.03	3.05
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	560,729.96	5.23	-	-

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,893,782.31	9,302,573.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,983,956.61	2,521,275.32
应支付基金管理人的净管理费	4,909,825.70	6,781,297.85

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,148,963.75	1,550,428.86

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	41,373.43	41,373.43
中国银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	41,373.43	41,373.43
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	7.27	7.27
中国银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	7.27	7.27

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	69,673,837.67	129,522.36	82,742,210.24	163,479.83

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。



## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间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

无。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

## 6.4.12 期末（2024 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	受限期	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
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024年6月3日	1-6个月（含）	新股流通受限	-	15.25	40	-	610.00	转增股
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

	能									
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024年5月22日	1-6个月(含)	新股流通受限	-	91.24	43	-	3,923.32	转增股
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月以上	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦	2024年6月	6个月	新股流通	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-

	股份	28 日		受限						
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创	2024 年 3 月	6 个月	新股流通	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

	股份	6 日		受限						
688709	成都 华微	2024 年 1 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投

资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：0.02%）。

#### 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 2024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							
货币资金	69,673,837.67	-	-	-	-	-	69,673,837.67
结算备付	12,454,360.83	-	-	-	-	-	12,454,360.83

金							
存出保证金	170,544.52	-	-	-	-	2,242,425.60	2,412,970.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-1,007,675,380.09	1,007,675,380.09
应收申购款	-	-	-	-	-	239,739.85	239,739.85
应收清算款	-	-	-	-	-	6,122.67	6,122.67
资产总计	82,298,743.02	-	-	-	-	-1,010,163,668.21	1,092,462,411.23
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	749,261.85	749,261.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,109,211.96	1,109,211.96
应付托管费	-	-	-	-	-	184,868.65	184,868.65
应付清算款	-	-	-	-	-	1.72	1.72
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,778.79	6,778.79
应交税费	-	-	-	-	-	72,248.62	72,248.62
其他负债	-	-	-	-	-	4,001,815.11	4,001,815.11
负债总计	-	-	-	-	-	6,124,186.70	6,124,186.70
利率敏感度缺口	82,298,743.02	-	-	-	-	-	-
上年度末 2023 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							
货币资金	85,998,122.11	-	-	-	-	-	85,998,122.11
结算备付金	6,109,366.10	-	-	-	-	-	6,109,366.10
存出保证金	108,413.41	-	-	-	-	1,299,504.00	1,407,917.41
交易性金融资产	-	-	-178,011.70	9,000.67	1,120,579,398.63	-	1,120,766,411.00
应收申购款	-	-	-	-	-	319,983.56	319,983.56
资产总计	92,215,901.62	-	-178,011.70	9,000.67	1,122,198,886.19	-	1,214,601,800.18
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	704,956.77	704,956.77
应付管理	-	-	-	-	-	1,196,275.90	1,196,275.90

人报酬							
应付托管费						199,379.32	199,379.32
应付清算款						14,218,471.35	14,218,471.35
应付销售服务费						1,088.75	1,088.75
应交税费						0.36	0.36
其他负债						3,375,896.62	3,375,896.62
负债总计						19,696,069.07	19,696,069.07
利率敏感度缺口	92,215,901.62			-178,011.70	9,000.67		

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.00%（上年度末：0.02%），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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。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。

#### 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	1,007,675,380.09	92.76	1,120,579,398.63	93.78
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	1,007,675,380.09	92.76	1,120,579,398.63	93.78

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注：6.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.13.4.3.2 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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	75,544,461.93	50,225,737.60
	沪深 300 指数下降 5%	-75,544,461.93	-50,225,737.60

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,007,406,642.39	1,119,459,532.19
第二层次	55,385.83	212,070.53
第三层次	213,351.87	1,094,808.28
合计	1,007,675,380.09	1,120,766,411.00

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**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	1,007,675,380.09	92.24
	其中：股票	1,007,675,380.09	92.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	82,128,198.50	7.52
8	其他各项资产	2,658,832.64	0.24
9	合计	1,092,462,411.23	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	3,778,759.00	0.35

B	采矿业	47,494,836.30	4.37
C	制造业	544,915,904.36	50.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,615,781.00	3.55
E	建筑业	5,574,899.00	0.51
F	批发和零售业	3,083,319.72	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	12,571,895.00	1.16
H	住宿和餐饮业	265,525.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,062,984.97	4.61
J	金融业	75,970,048.75	6.99
K	房地产业	7,668,433.00	0.71
L	租赁和商务服务业	3,093,251.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	716,272.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	1,823,388.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,751,277.00	0.62
R	文化、体育和娱乐业	28,260,404.50	2.60
S	综合	2,980,032.00	0.27
	合计	833,627,010.60	76.74

### 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	11,387,128.00	1.05
C	制造业	107,408,908.14	9.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,815,408.00	0.44
E	建筑业	1,845,982.00	0.17
F	批发和零售业	6,325,261.00	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	1,341,558.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,350,265.95	2.33

J	金融业	8,945,297.40	0.82
K	房地产业	161,212.00	0.01
L	租赁和商务服务业	856,153.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	2,459,728.00	0.23
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	2,192,930.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	958,538.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	174,048,369.49	16.02

### 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	600096	云天化	563,400	10,941,228.00	1.01
2	600177	雅戈尔	1,527,500	10,875,800.00	1.00
3	601058	赛轮轮胎	680,700	9,529,800.00	0.88
4	300251	光线传媒	1,117,600	9,399,016.00	0.87
5	603160	汇顶科技	135,000	9,281,250.00	0.85
6	600143	金发科技	1,396,000	9,227,560.00	0.85
7	300207	欣旺达	607,400	9,214,258.00	0.85
8	600066	宇通客车	339,982	8,771,535.60	0.81
9	002128	电投能源	414,300	8,741,730.00	0.80
10	300144	宋城演艺	1,088,100	8,737,443.00	0.80
11	000027	深圳能源	1,184,500	8,646,850.00	0.80
12	000155	川能动力	796,000	8,572,920.00	0.79
13	300054	鼎龙股份	376,388	8,536,479.84	0.79
14	000728	国元证券	1,385,150	8,394,009.00	0.77
15	600582	天地科技	1,180,200	8,131,578.00	0.75
16	000630	铜陵有色	2,226,200	8,036,582.00	0.74
17	600909	华安证券	1,900,900	8,002,789.00	0.74
18	300502	新易盛	75,200	7,937,360.00	0.73
19	300724	捷佳伟创	145,800	7,874,658.00	0.72

20	002008	大族激光	360,500	7,498,400.00	0.69
21	600901	江苏金租	1,482,076	7,484,483.80	0.69
22	601108	财通证券	1,085,450	7,174,824.50	0.66
23	000887	中鼎股份	580,700	7,107,768.00	0.65
24	002019	亿帆医药	572,200	7,072,392.00	0.65
25	002465	海格通信	673,900	6,981,604.00	0.64
26	002340	格林美	1,090,500	6,946,485.00	0.64
27	600642	申能股份	781,400	6,899,762.00	0.64
28	002138	顺络电子	250,450	6,877,357.00	0.63
29	600529	山东药玻	268,600	6,806,324.00	0.63
30	603882	金城医学	248,300	6,751,277.00	0.62
31	300002	神州泰岳	827,300	6,717,676.00	0.62
32	601717	郑煤机	453,600	6,713,280.00	0.62
33	002558	巨人网络	710,300	6,705,232.00	0.62
34	601615	明阳智能	703,900	6,644,816.00	0.61
35	600566	济川药业	201,000	6,373,710.00	0.59
36	600737	中粮糖业	653,300	6,265,147.00	0.58
37	600862	中航高科	333,000	6,253,740.00	0.58
38	300383	光环新网	732,300	6,187,935.00	0.57
39	002152	广电运通	589,400	6,165,124.00	0.57
40	601636	旗滨集团	950,500	6,130,725.00	0.56
41	601665	齐鲁银行	1,227,700	6,028,007.00	0.55
42	000830	鲁西化工	512,900	5,944,511.00	0.55
43	300357	我武生物	291,900	5,902,218.00	0.54
44	002557	洽洽食品	209,000	5,891,710.00	0.54
45	300394	天孚通信	66,020	5,837,488.40	0.54
46	603317	天味食品	495,840	5,657,534.40	0.52
47	300390	天华新能	326,610	5,611,159.80	0.52
48	002497	雅化集团	625,100	5,575,892.00	0.51
49	688188	柏楚电子	30,160	5,566,028.00	0.51
50	601168	西部矿业	304,014	5,457,051.30	0.50
51	688002	睿创微纳	190,900	5,339,473.00	0.49
52	688772	珠海冠宇	355,235	5,293,001.50	0.49
53	600985	淮北矿业	315,500	5,281,470.00	0.49
54	002966	苏州银行	691,000	5,182,500.00	0.48
55	688120	华海清科	27,247	5,165,486.26	0.48
56	600299	安迪苏	509,500	4,942,150.00	0.45
57	000997	新大陆	344,800	4,796,168.00	0.44
58	002185	华天科技	587,600	4,788,940.00	0.44
59	601077	渝农商行	945,600	4,746,912.00	0.44
60	002384	东山精密	228,300	4,725,810.00	0.44
61	300373	扬杰科技	117,800	4,582,420.00	0.42
62	000738	航发控制	227,700	4,569,939.00	0.42

63	600765	中航重机	223,100	4,551,240.00	0.42
64	002507	涪陵榨菜	371,130	4,546,342.50	0.42
65	002958	青农商行	1,688,300	4,524,644.00	0.42
66	601233	桐昆股份	279,588	4,462,224.48	0.41
67	600885	宏发股份	157,900	4,370,672.00	0.40
68	603893	瑞芯微	73,800	4,366,746.00	0.40
69	300001	特锐德	209,000	4,205,080.00	0.39
70	601231	环旭电子	261,500	4,197,075.00	0.39
71	688234	天岳先进	89,000	4,175,880.00	0.38
72	600352	浙江龙盛	482,200	4,142,098.00	0.38
73	600970	中材国际	339,200	4,090,752.00	0.38
74	600867	通化东宝	485,000	4,059,450.00	0.37
75	600398	海澜之家	436,600	4,034,184.00	0.37
76	601128	常熟银行	530,285	4,014,257.45	0.37
77	002223	鱼跃医疗	106,100	3,989,360.00	0.37
78	600699	均胜电子	266,620	3,951,308.40	0.36
79	688516	奥特维	93,420	3,905,890.20	0.36
80	688169	石头科技	9,900	3,886,740.00	0.36
81	002353	杰瑞股份	110,600	3,879,848.00	0.36
82	603606	东方电缆	78,800	3,846,228.00	0.35
83	000039	中集集团	413,000	3,824,380.00	0.35
84	601990	南京证券	495,900	3,808,512.00	0.35
85	601666	平煤股份	335,200	3,754,240.00	0.35
86	000683	远兴能源	539,900	3,730,709.00	0.34
87	300003	乐普医疗	248,900	3,693,676.00	0.34
88	002738	中矿资源	135,400	3,628,720.00	0.33
89	300285	国瓷材料	200,800	3,584,280.00	0.33
90	002739	万达电影	295,750	3,575,617.50	0.33
91	002595	豪迈科技	93,400	3,565,078.00	0.33
92	002064	华峰化学	496,300	3,558,471.00	0.33
93	600348	华阳股份	355,500	3,540,780.00	0.33
94	603885	吉祥航空	321,200	3,529,988.00	0.32
95	000703	恒逸石化	495,000	3,509,550.00	0.32
96	000960	锡业股份	224,900	3,483,701.00	0.32
97	601216	君正集团	939,900	3,468,231.00	0.32
98	001872	招商港口	177,500	3,416,875.00	0.31
99	603816	顾家家居	105,800	3,416,282.00	0.31
100	300866	安克创新	47,873	3,409,036.33	0.31
101	002472	双环传动	154,600	3,404,292.00	0.31
102	300529	健帆生物	123,400	3,357,714.00	0.31
103	600549	厦门钨业	194,400	3,353,400.00	0.31
104	600282	南钢股份	662,300	3,298,254.00	0.30
105	603589	口子窖	84,000	3,291,960.00	0.30

106	300073	当升科技	95,700	3,283,467.00	0.30
107	002683	广东宏大	163,000	3,281,190.00	0.30
108	000636	风华高科	251,200	3,280,672.00	0.30
109	002563	森马服饰	561,200	3,260,572.00	0.30
110	002195	岩山科技	1,298,700	3,259,737.00	0.30
111	000878	云南铜业	257,800	3,212,188.00	0.30
112	600060	海信视像	128,400	3,176,616.00	0.29
113	002517	恺英网络	328,500	3,137,175.00	0.29
114	688063	派能科技	78,955	3,135,303.05	0.29
115	600848	上海临港	338,900	3,087,379.00	0.28
116	600483	福能股份	263,000	3,066,580.00	0.28
117	002831	裕同科技	118,700	3,037,533.00	0.28
118	600517	国网英大	699,100	3,027,103.00	0.28
119	601958	金钼股份	286,700	2,984,547.00	0.27
120	600673	东阳光	423,300	2,980,032.00	0.27
121	002240	盛新锂能	221,800	2,976,556.00	0.27
122	603658	安图生物	64,400	2,966,908.00	0.27
123	600380	健康元	264,900	2,958,933.00	0.27
124	603456	九洲药业	214,800	2,947,056.00	0.27
125	002487	大金重工	128,800	2,946,944.00	0.27
126	688114	华大智造	61,700	2,925,197.00	0.27
127	600329	达仁堂	89,500	2,898,905.00	0.27
128	600755	厦门国贸	401,400	2,878,038.00	0.26
129	600377	宁沪高速	228,200	2,875,320.00	0.26
130	600663	陆家嘴	325,300	2,869,146.00	0.26
131	000060	中金岭南	663,700	2,814,088.00	0.26
132	601019	山东出版	236,800	2,798,976.00	0.26
133	600925	苏能股份	552,700	2,791,135.00	0.26
134	600801	华新水泥	202,200	2,780,250.00	0.26
135	300212	易华录	164,200	2,763,486.00	0.25
136	002153	石基信息	479,400	2,746,962.00	0.25
137	601456	国联证券	281,600	2,714,624.00	0.25
138	300017	网宿科技	339,200	2,679,680.00	0.25
139	600988	赤峰黄金	161,700	2,642,178.00	0.24
140	002056	横店东磁	211,800	2,641,146.00	0.24
141	000818	航锦科技	119,400	2,636,352.00	0.24
142	000958	电投产融	720,200	2,635,932.00	0.24
143	000563	陕国投 A	946,600	2,603,150.00	0.24
144	603185	弘元绿能	151,200	2,584,008.00	0.24
145	688349	三一重能	101,700	2,526,228.00	0.23
146	603305	旭升集团	237,200	2,504,832.00	0.23
147	601118	海南橡胶	549,100	2,498,405.00	0.23
148	600580	卧龙电驱	198,300	2,409,345.00	0.22

149	600546	山煤国际	164,700	2,407,914.00	0.22
150	002423	中粮资本	320,800	2,402,792.00	0.22
151	600038	中直股份	58,200	2,392,602.00	0.22
152	603826	坤彩科技	82,460	2,388,866.20	0.22
153	002850	科达利	31,000	2,367,780.00	0.22
154	689009	九号公司	62,728	2,309,017.68	0.21
155	600032	浙江新能	313,600	2,283,008.00	0.21
156	600511	国药股份	74,028	2,279,322.12	0.21
157	300037	新宙邦	79,700	2,276,232.00	0.21
158	002500	山西证券	483,100	2,270,570.00	0.21
159	600435	北方导航	260,500	2,245,510.00	0.21
160	002444	巨星科技	87,200	2,153,840.00	0.20
161	688475	萤石网络	61,900	2,111,409.00	0.19
162	600967	内蒙一机	291,100	2,095,920.00	0.19
163	600109	国金证券	277,000	2,091,350.00	0.19
164	600498	烽火通信	123,200	1,958,880.00	0.18
165	000537	中绿电	201,900	1,924,107.00	0.18
166	688099	晶晨股份	32,146	1,906,900.72	0.18
167	603568	伟明环保	88,600	1,823,388.00	0.17
168	002572	索菲亚	113,900	1,746,087.00	0.16
169	002244	滨江集团	235,800	1,711,908.00	0.16
170	601858	中国科传	85,900	1,642,408.00	0.15
171	000423	东阿阿胶	25,900	1,621,340.00	0.15
172	600563	法拉电子	20,800	1,584,544.00	0.15
173	002436	兴森科技	152,600	1,574,832.00	0.14
174	002791	坚朗五金	60,200	1,557,374.00	0.14
175	600956	新天绿能	190,200	1,553,934.00	0.14
176	300009	安科生物	173,700	1,483,398.00	0.14
177	002372	伟星新材	91,800	1,415,556.00	0.13
178	601928	凤凰传媒	124,700	1,366,712.00	0.13
179	688220	翱捷科技	36,400	1,363,544.00	0.13
180	002262	恩华药业	57,400	1,362,676.00	0.13
181	002028	思源电气	20,200	1,351,380.00	0.12
182	603517	绝味食品	86,400	1,330,560.00	0.12
183	300888	稳健医疗	51,900	1,313,070.00	0.12
184	688180	君实生物	44,181	1,283,458.05	0.12
185	603737	三棵树	35,200	1,276,704.00	0.12
186	000933	神火股份	62,900	1,272,467.00	0.12
187	600528	中铁工业	168,500	1,233,420.00	0.11
188	603596	伯特利	30,900	1,202,010.00	0.11
189	002156	通富微电	52,900	1,184,431.00	0.11
190	600820	隧道股份	177,400	1,158,422.00	0.11
191	603156	养元饮品	54,201	1,152,855.27	0.11



192	300567	精测电子	20,400	1,152,804.00	0.11
193	601966	玲珑轮胎	57,800	1,061,786.00	0.10
194	300595	欧普康视	67,400	1,056,832.00	0.10
195	002430	杭氧股份	47,000	1,045,750.00	0.10
196	603218	日月股份	101,200	1,039,324.00	0.10
197	688029	南微医学	16,500	1,015,740.00	0.09
198	000050	深天马 A	133,500	971,880.00	0.09
199	000598	兴蓉环境	124,100	933,232.00	0.09
200	002120	韵达股份	120,000	928,800.00	0.09
201	000513	丽珠集团	24,700	919,087.00	0.08
202	300114	中航电测	18,400	832,600.00	0.08
203	002429	兆驰股份	167,200	804,232.00	0.07
204	600839	四川长虹	168,000	754,320.00	0.07
205	601098	中南传媒	59,600	740,232.00	0.07
206	688777	中控技术	19,300	727,610.00	0.07
207	300012	华测检测	71,200	716,272.00	0.07
208	000883	湖北能源	115,700	695,357.00	0.06
209	688200	华峰测控	7,356	674,913.00	0.06
210	600126	杭钢股份	163,000	669,930.00	0.06
211	002625	光启技术	38,300	664,505.00	0.06
212	688521	芯原股份	24,775	662,731.25	0.06
213	000778	新兴铸管	189,300	658,764.00	0.06
214	002299	圣农发展	47,900	653,356.00	0.06
215	300253	卫宁健康	109,300	644,870.00	0.06
216	603444	吉比特	3,600	640,836.00	0.06
217	600598	北大荒	50,200	626,998.00	0.06
218	600535	天士力	49,800	626,484.00	0.06
219	601608	中信重工	153,300	584,073.00	0.05
220	002984	森麒麟	23,800	573,342.00	0.05
221	603056	德邦股份	42,800	560,680.00	0.05
222	601298	青岛港	56,900	543,964.00	0.05
223	600497	驰宏锌锗	100,800	538,272.00	0.05
224	002653	海思科	15,800	485,060.00	0.04
225	601139	深圳燃气	72,400	483,632.00	0.04
226	601577	长沙银行	53,400	436,812.00	0.04
227	002078	太阳纸业	30,200	421,290.00	0.04
228	002532	天山铝业	51,900	420,909.00	0.04
229	300677	英科医疗	15,500	415,555.00	0.04
230	600271	航天信息	56,350	414,736.00	0.04
231	601000	唐山港	81,600	383,520.00	0.04
232	601997	贵阳银行	69,300	365,211.00	0.03
233	603345	安井食品	4,900	364,119.00	0.03
234	300474	景嘉微	5,700	360,411.00	0.03

235	600873	梅花生物	35,700	357,714.00	0.03
236	600704	物产中大	79,300	344,162.00	0.03
237	600008	首创环保	126,500	339,020.00	0.03
238	601016	节能风电	112,400	336,076.00	0.03
239	600004	白云机场	35,100	332,748.00	0.03
240	603087	甘李药业	7,100	328,872.00	0.03
241	600170	上海建工	151,500	325,725.00	0.03
242	000921	海信家电	10,100	325,624.00	0.03
243	300296	利亚德	71,000	319,500.00	0.03
244	002508	老板电器	14,400	318,240.00	0.03
245	600707	彩虹股份	46,100	313,941.00	0.03
246	601399	国机重装	120,200	310,116.00	0.03
247	002203	海亮股份	38,800	309,624.00	0.03
248	000739	普洛药业	22,600	306,682.00	0.03
249	002414	高德红外	51,800	305,102.00	0.03
250	600612	老凤祥	5,200	302,588.00	0.03
251	002690	美亚光电	18,200	300,300.00	0.03
252	603707	健友股份	24,300	288,684.00	0.03
253	000967	盈峰环境	67,700	286,371.00	0.03
254	600764	中国海防	14,500	284,635.00	0.03
255	600315	上海家化	15,900	282,702.00	0.03
256	001203	大中矿业	28,700	275,807.00	0.03
257	601568	北元集团	73,900	274,169.00	0.03
258	003022	联泓新科	19,900	272,829.00	0.03
259	600095	湘财股份	45,100	268,796.00	0.02
260	600258	首旅酒店	21,500	265,525.00	0.02
261	603786	科博达	4,100	263,015.00	0.02
262	688276	百克生物	8,700	246,819.00	0.02
263	603883	老百姓	13,260	243,453.60	0.02
264	688213	思特威	4,900	237,650.00	0.02
265	688153	唯捷创芯	6,400	236,800.00	0.02
266	688348	昱能科技	4,000	236,000.00	0.02
267	300803	指南针	6,200	225,742.00	0.02
268	002155	湖南黄金	12,300	222,630.00	0.02
269	600153	建发股份	24,100	215,213.00	0.02
270	688281	华秦科技	2,520	209,966.40	0.02
271	000009	中国宝安	23,600	202,960.00	0.02
272	003031	中瓷电子	4,380	202,531.20	0.02
273	601991	大唐发电	67,100	201,971.00	0.02
274	603000	人民网	10,000	199,900.00	0.02
275	300699	光威复材	7,660	190,197.80	0.02
276	600316	洪都航空	11,000	182,930.00	0.02
277	688567	孚能科技	18,100	173,760.00	0.02

278	600859	王府井	13,300	156,142.00	0.01
279	688387	信科移动	30,900	155,736.00	0.01
280	600416	湘电股份	15,000	149,100.00	0.01
281	688375	国博电子	2,100	148,344.00	0.01
282	603179	新泉股份	3,000	117,720.00	0.01
283	600500	中化国际	26,200	91,438.00	0.01
284	600062	华润双鹤	4,100	80,278.00	0.01
285	600637	东方明珠	11,000	66,880.00	0.01
286	002608	江苏国信	5,600	43,400.00	0.00
287	600998	九州通	6,900	33,672.00	0.00
288	600827	百联股份	3,600	26,568.00	0.00
289	000959	首钢股份	6,300	17,136.00	0.00
290	688017	绿的谐波	200	16,420.00	0.00
291	300558	贝达药业	400	13,020.00	0.00
292	002025	航天电器	200	9,276.00	0.00
293	688778	厦钨新能	200	6,248.00	0.00
294	600959	江苏有线	300	792.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300760	迈瑞医疗	20,800	6,050,928.00	0.56
2	000758	中色股份	1,057,400	5,371,592.00	0.49
3	603501	韦尔股份	53,600	5,326,232.00	0.49
4	002001	新和成	268,700	5,159,040.00	0.47
5	601688	华泰证券	252,700	3,130,953.00	0.29
6	603267	鸿远电子	84,600	2,884,860.00	0.27
7	300379	东方通	342,060	2,763,844.80	0.25
8	300896	爱美客	15,600	2,684,760.00	0.25
9	601318	中国平安	64,700	2,675,992.00	0.25
10	688371	菲沃泰	258,330	2,593,633.20	0.24
11	002276	万马股份	351,100	2,517,387.00	0.23
12	688372	伟测科技	61,600	2,422,728.00	0.22
13	002237	恒邦股份	208,600	2,400,986.00	0.22
14	000725	京东方 A	570,400	2,332,936.00	0.21
15	688388	嘉元科技	237,500	2,315,625.00	0.21
16	002301	齐心集团	473,500	2,287,005.00	0.21
17	600933	爱柯迪	148,700	2,199,273.00	0.20
18	688008	澜起科技	37,942	2,168,764.72	0.20
19	300244	迪安诊断	179,800	2,157,600.00	0.20
20	000600	建投能源	342,100	2,155,230.00	0.20
21	600584	长电科技	67,400	2,137,254.00	0.20
22	688800	瑞可达	76,100	2,136,888.00	0.20
23	600406	国电南瑞	85,100	2,124,096.00	0.20

24	002410	广联达	219,740	2,105,109.20	0.19
25	300872	天阳科技	158,600	2,101,450.00	0.19
26	002727	一心堂	139,200	2,100,528.00	0.19
27	002594	比亚迪	8,300	2,077,075.00	0.19
28	002179	中航光电	54,500	2,073,725.00	0.19
29	000712	锦龙股份	274,900	2,061,750.00	0.19
30	300366	创意信息	282,800	2,047,472.00	0.19
31	002180	纳思达	77,400	2,044,908.00	0.19
32	600718	东软集团	246,800	2,041,036.00	0.19
33	600161	天坛生物	83,280	2,032,032.00	0.19
34	601877	正泰电器	102,400	1,951,744.00	0.18
35	600941	中国移动	17,600	1,892,000.00	0.17
36	300850	新强联	124,100	1,863,982.00	0.17
37	000999	华润三九	41,900	1,784,102.00	0.16
38	600395	盘江股份	294,200	1,768,142.00	0.16
39	002706	良信股份	252,700	1,733,522.00	0.16
40	600916	中国黄金	176,900	1,701,778.00	0.16
41	000612	焦作万方	260,100	1,690,650.00	0.16
42	002833	弘亚数控	90,700	1,654,368.00	0.15
43	000550	江铃汽车	75,700	1,643,447.00	0.15
44	600760	中航沈飞	40,600	1,628,060.00	0.15
45	600366	宁波韵升	293,700	1,533,114.00	0.14
46	300168	万达信息	315,700	1,499,575.00	0.14
47	300130	新国都	85,100	1,416,064.00	0.13
48	002252	上海莱士	180,800	1,413,856.00	0.13
49	002158	汉钟精机	83,500	1,396,120.00	0.13
50	688036	传音控股	18,160	1,389,966.40	0.13
51	002192	融捷股份	45,600	1,368,912.00	0.13
52	600019	宝钢股份	200,400	1,332,660.00	0.12
53	688311	盟升电子	64,100	1,313,409.00	0.12
54	002466	天齐锂业	43,400	1,298,094.00	0.12
55	301238	瑞泰新材	85,300	1,276,941.00	0.12
56	603533	掌阅科技	66,200	1,235,954.00	0.11
57	603328	依顿电子	155,600	1,223,016.00	0.11
58	603132	金徽股份	87,900	1,209,504.00	0.11
59	603393	新天然气	34,800	1,208,952.00	0.11
60	605589	圣泉集团	58,900	1,195,081.00	0.11
61	688233	神工股份	61,092	1,177,242.84	0.11
62	000923	河钢资源	63,600	1,095,192.00	0.10
63	603368	柳药集团	62,100	1,086,750.00	0.10
64	300751	迈为股份	9,000	1,075,320.00	0.10
65	600039	四川路桥	133,500	1,053,315.00	0.10
66	002318	久立特材	44,900	1,047,517.00	0.10

67	300085	银之杰	129,600	1,047,168.00	0.10
68	605090	九丰能源	35,600	1,032,400.00	0.10
69	603123	翠微股份	170,000	1,009,800.00	0.09
70	601127	赛力斯	10,900	993,208.00	0.09
71	600893	航发动力	27,100	990,505.00	0.09
72	603565	中谷物流	110,900	969,266.00	0.09
73	002997	瑞鹄模具	29,700	949,509.00	0.09
74	600223	福瑞达	130,900	925,463.00	0.09
75	002106	莱宝高科	84,100	916,690.00	0.08
76	002801	微光股份	48,000	910,080.00	0.08
77	002540	亚太科技	170,600	902,474.00	0.08
78	002635	安洁科技	56,400	870,816.00	0.08
79	300494	盛天网络	84,700	851,235.00	0.08
80	600150	中国船舶	20,300	826,413.00	0.08
81	688207	格灵深瞳	69,400	796,018.00	0.07
82	600050	中国联通	161,000	756,700.00	0.07
83	603960	克来机电	33,600	708,960.00	0.07
84	000503	国新健康	100,400	669,668.00	0.06
85	002123	梦网科技	91,200	641,136.00	0.06
86	688518	联赢激光	38,100	636,270.00	0.06
87	002048	宁波华翔	47,300	612,062.00	0.06
88	002068	黑猫股份	80,900	574,390.00	0.05
89	300122	智飞生物	19,200	538,176.00	0.05
90	300659	中孚信息	40,100	520,097.00	0.05
91	300638	广和通	30,400	519,840.00	0.05
92	003029	吉大正元	29,200	519,468.00	0.05
93	600158	中体产业	67,000	515,230.00	0.05
94	300226	上海钢联	30,000	508,200.00	0.05
95	688550	瑞联新材	21,700	503,223.00	0.05
96	688072	拓荆科技	4,032	484,283.52	0.04
97	002351	漫步者	33,900	445,785.00	0.04
98	300133	华策影视	72,200	443,308.00	0.04
99	688123	聚辰股份	7,100	431,893.00	0.04
100	688095	福昕软件	9,400	430,614.00	0.04
101	300408	三环集团	13,300	388,227.00	0.04
102	300740	水羊股份	26,000	381,680.00	0.04
103	001338	永顺泰	37,200	364,560.00	0.03
104	688578	艾力斯	5,700	363,318.00	0.03
105	600845	宝信软件	11,300	360,809.00	0.03
106	601117	中国化学	43,200	355,968.00	0.03
107	000567	海德股份	62,640	351,410.40	0.03
108	300662	科锐国际	21,000	338,730.00	0.03
109	600732	爱旭股份	36,700	332,135.00	0.03

110	300707	威唐工业	22,600	279,788.00	0.03
111	600489	中金黄金	18,000	266,400.00	0.02
112	600989	宝丰能源	14,800	256,484.00	0.02
113	000034	神州数码	10,800	247,212.00	0.02
114	601319	中国人保	46,500	239,475.00	0.02
115	000975	银泰黄金	14,300	232,947.00	0.02
116	000935	四川双马	19,300	231,793.00	0.02
117	601668	中国建筑	43,600	231,516.00	0.02
118	600276	恒瑞医药	6,000	230,760.00	0.02
119	600011	华能国际	23,500	226,070.00	0.02
120	601916	浙商银行	81,700	225,492.00	0.02
121	000821	京山轻机	19,900	225,467.00	0.02
122	000786	北新建材	7,600	225,416.00	0.02
123	002422	科伦药业	7,400	224,442.00	0.02
124	000930	中粮科技	43,800	220,314.00	0.02
125	688025	杰普特	5,400	218,106.00	0.02
126	600623	华谊集团	37,600	217,328.00	0.02
127	002928	华夏航空	33,800	214,292.00	0.02
128	600645	中源协和	13,100	210,910.00	0.02
129	300832	新产业	3,100	209,064.00	0.02
130	603806	福斯特	13,860	203,742.00	0.02
131	688176	亚虹医药	39,413	201,400.43	0.02
132	600458	时代新材	19,700	198,970.00	0.02
133	601601	中国太保	7,000	195,020.00	0.02
134	300679	电连技术	4,600	185,058.00	0.02
135	002803	吉宏股份	16,100	179,193.00	0.02
136	601609	金田股份	29,900	169,234.00	0.02
137	688088	虹软科技	5,700	164,502.00	0.02
138	688798	艾为电子	2,900	164,198.00	0.02
139	001213	中铁特货	40,000	158,000.00	0.01
140	002140	东华科技	19,900	154,225.00	0.01
141	002271	东方雨虹	11,300	139,442.00	0.01
142	600636	国新文化	18,100	135,750.00	0.01
143	600037	歌华有线	21,400	127,972.00	0.01
144	002516	旷达科技	34,600	125,944.00	0.01
145	601778	晶科科技	51,700	117,876.00	0.01
146	688167	炬光科技	2,100	115,500.00	0.01
147	688111	金山办公	500	113,750.00	0.01
148	601633	长城汽车	4,400	111,320.00	0.01
149	600482	中国动力	5,600	109,088.00	0.01
150	603330	天洋新材	21,400	102,506.00	0.01
151	002544	普天科技	5,400	100,926.00	0.01
152	603348	文灿股份	3,500	96,915.00	0.01

153	001914	招商积余	9,500	95,190.00	0.01
154	688680	海优新材	3,100	89,094.00	0.01
155	600559	老白干酒	4,900	89,082.00	0.01
156	605116	奥锐特	3,500	87,605.00	0.01
157	002768	国恩股份	4,400	82,280.00	0.01
158	688733	壹石通	5,400	80,730.00	0.01
159	688031	星环科技	2,100	77,091.00	0.01
160	600803	新奥股份	3,600	74,880.00	0.01
161	601101	昊华能源	8,100	74,439.00	0.01
162	688018	乐鑫科技	720	71,049.60	0.01
163	603489	八方股份	2,500	67,450.00	0.01
164	603297	永新光学	1,100	66,539.00	0.01
165	601628	中国人寿	2,100	65,205.00	0.01
166	002371	北方华创	200	63,978.00	0.01
167	688256	寒武纪	299	59,402.33	0.01
168	688082	盛美上海	700	59,157.00	0.01
169	600201	生物股份	7,900	56,959.00	0.01
170	688012	中微公司	400	56,504.00	0.01
171	300820	英杰电气	1,300	51,142.00	0.00
172	688560	明冠新材	4,800	51,120.00	0.00
173	601800	中国交建	5,700	50,958.00	0.00
174	688787	海天瑞声	900	49,392.00	0.00
175	603690	至纯科技	2,120	48,781.20	0.00
176	300666	江丰电子	1,000	47,560.00	0.00
177	688596	正帆科技	1,400	46,200.00	0.00
178	600641	万业企业	3,900	45,825.00	0.00
179	688630	芯碁微装	700	43,799.00	0.00
180	603583	捷昌驱动	2,100	42,798.00	0.00
181	601865	福莱特	2,000	40,200.00	0.00
182	688037	芯源微	444	39,516.00	0.00
183	002611	东方精工	7,200	37,800.00	0.00
184	300887	谱尼测试	5,000	37,000.00	0.00
185	301239	普瑞眼科	1,000	35,330.00	0.00
186	688330	宏力达	1,685	34,357.15	0.00
187	688776	国光电气	600	33,240.00	0.00
188	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
189	300571	平治信息	1,400	29,316.00	0.00
190	300566	激智科技	2,000	27,980.00	0.00
191	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
192	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
193	000100	TCL 科技	5,000	21,600.00	0.00
194	000029	深深房 A	1,900	20,197.00	0.00
195	000727	冠捷科技	9,800	20,188.00	0.00

196	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
197	603032	德新科技	1,500	17,145.00	0.00
198	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
199	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
200	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
201	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
202	600810	神马股份	2,100	13,020.00	0.00
203	605208	永茂泰	2,000	12,460.00	0.00
204	002215	诺普信	1,600	11,920.00	0.00
205	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
206	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
207	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
208	600662	外服控股	2,300	9,223.00	0.00
209	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
210	002171	楚江新材	1,200	7,908.00	0.00
211	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
212	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
213	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
214	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
215	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
216	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
217	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
218	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
219	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
220	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
221	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
222	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
223	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
224	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
225	601890	亚星锚链	400	2,820.00	0.00
226	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
227	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
228	002773	康弘药业	100	2,165.00	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	601233	桐昆股份	25,202,969.12	2.11
2	000933	神火股份	20,512,247.00	1.72
3	600566	济川药业	20,272,419.00	1.70
4	002422	科伦药业	20,015,016.00	1.68
5	603927	中科软	18,473,968.62	1.55



6	002465	海格通信	18,340,842.00	1.53
7	601058	赛轮轮胎	17,654,469.00	1.48
8	300251	光线传媒	17,597,352.20	1.47
9	002384	东山精密	17,045,027.00	1.43
10	000630	铜陵有色	16,679,174.00	1.40
11	002244	滨江集团	16,403,529.00	1.37
12	002739	万达电影	16,139,082.00	1.35
13	688188	柏楚电子	16,042,962.22	1.34
14	603185	弘元绿能	15,990,623.01	1.34
15	002273	水晶光电	15,351,549.00	1.28
16	600985	淮北矿业	15,336,071.00	1.28
17	600177	雅戈尔	15,106,645.44	1.26
18	601198	东兴证券	15,060,400.64	1.26
19	603517	绝味食品	15,042,932.36	1.26
20	600096	云天化	14,916,604.20	1.25

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	002422	科伦药业	23,596,188.00	1.97
2	002273	水晶光电	21,725,411.81	1.82
3	601233	桐昆股份	21,482,566.60	1.80
4	000933	神火股份	21,071,540.00	1.76
5	603927	中科软	20,479,578.00	1.71
6	000581	威孚高科	19,657,135.00	1.65
7	603185	弘元绿能	18,883,005.77	1.58
8	601198	东兴证券	18,796,844.96	1.57
9	600580	卧龙电驱	17,707,733.82	1.48
10	002025	航天电器	17,500,872.00	1.46
11	600066	宇通客车	17,206,202.00	1.44
12	601168	西部矿业	16,790,529.00	1.41
13	000932	华菱钢铁	16,556,155.00	1.39
14	002244	滨江集团	16,398,339.00	1.37
15	000630	铜陵有色	16,336,642.00	1.37
16	002739	万达电影	16,105,342.00	1.35
17	601555	东吴证券	15,825,521.00	1.32
18	601058	赛轮轮胎	15,783,794.76	1.32
19	300363	博腾股份	15,518,958.50	1.30
20	600153	建发股份	15,378,853.00	1.29

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	3,809,193,937.33
卖出股票收入（成交）总额	3,858,945,050.85

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 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

#### 7.11.2 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

华泰证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局、中国人民银行分支行的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,412,970.12
2	应收清算款	6,122.67
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	239,739.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,658,832.64

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)

景顺长城 中证 500 指数增强 A	54,766	16,416.83	476,389,344.97	52.99	422,694,777.15	47.01
景顺长城 中证 500 指数增强 C	211	79,119.15	14,290,860.87	85.60	2,403,280.22	14.40
合计	54,977	16,657.48	490,680,205.84	53.58	425,098,057.37	46.42

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	景顺长城中证 500 指数增强 A	114,308.51	0.012714
	景顺长城中证 500 指数增强 C	92.77	0.000556
	合计	114,401.28	0.012492

### 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	景顺长城中证 500 指数增强 A	—
	景顺长城中证 500 指数增强 C	—
	合计	—
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城中证 500 指数增强 A	0~10
	景顺长城中证 500 指数增强 C	—
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城中证 500 指数增强 A	景顺长城中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2019 年 3 月 25 日) 基金份额总额	1,508,879,568.71	—
本报告期期初基金份额总额	951,133,966.87	2,665,166.33
本报告期基金总申购份额	25,673,258.09	35,402,252.47

减：本报告期基金总赎回份额	77,723,102.84	21,373,277.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	899,084,122.12	16,694,141.09

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：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

#### 10.6.2 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，本基金的托管人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 (%)	
招商证券股份有限公司	2	1,303,072,348.18	17.00	1,232,569.47	17.00	-
华泰证券股份有限公司	1	1,042,949,877.57	13.60	986,515.46	13.60	-
东方证券股份有限公司	2	928,874,933.33	12.12	878,624.21	12.12	-
德邦证券股份有限公司	1	834,880,644.07	10.89	789,727.43	10.89	-
海通证券股份有限公司	2	611,761,905.86	7.98	578,667.72	7.98	-
华西证券股份有限公司	1	597,958,789.85	7.80	565,617.63	7.80	-
浙商证券股份有限公司	1	550,372,757.27	7.18	520,601.18	7.18	-
中国银河证券股份有限公司	1	494,293,526.35	6.45	467,553.77	6.45	-
中国国际金融股份有限公司	1	493,667,186.54	6.44	466,965.16	6.44	-
国盛证券有限责任公司	1	259,464,973.23	3.38	245,413.57	3.38	-
长城证券股份有限公司	3	194,401,130.26	2.54	183,888.14	2.54	-
中泰证券股份有限公司	1	156,659,726.62	2.04	148,186.69	2.04	-
信达证券股份有限公司	1	120,714,785.94	1.57	114,184.88	1.57	-

广发证券股份有限公司	2	77,645,742.57	1.01	73,445.46	1.01	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-

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 (%)
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	222,510.62	100.00	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-



长城证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
信达证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 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	-	-	-	-	-	-
华宝证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
平安证 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调整适用“养老金客户费率优惠”的养老	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月10日

	金客户范围的公告		
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 22 日
3	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 22 日
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	2024 年 3 月 22 日
5	关于警惕假冒景顺长城基金 APP 开展诈骗活动的声明	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 27 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
7	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
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	2024 年 4 月 13 日
9	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	2024 年 4 月 15 日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
11	景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
12	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	2024 年 5 月 24 日
13	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	2024 年 5 月 31 日
14	景顺长城中证 500 指数增强型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	2024 年 6 月 14 日
15	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	2024 年 6 月 21 日
16	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	2024 年 6 月 29 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101-20240630	354,322,713.06	0.00	0.00	354,322,713.06	38.69
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

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日