

# 景顺长城量化精选股票型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	5
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	7
<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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<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	38
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	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60

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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
7.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	62
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.8 其他重大事件 .....	68
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>69</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 .....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
12.1 备查文件目录 .....	69
12.2 存放地点 .....	69
12.3 查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化精选股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化精选股票
场内简称	无
基金主代码	000978
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 4 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	388,246,994.26 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略：本基金股票资产占基金资产的比例范围为 80%-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：本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。</p> <p>3、债券投资策略：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>
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	本基金是一只股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，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。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	021-60637228
传真	0755-22381339	021-60635778

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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	李进	张金良

## 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)
本期已实现收益	-22,887,964.35
本期利润	-40,012,815.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0973
本期加权平均净值利润率	-6.79%
本期基金份额净值增长率	-7.29%
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	149,902,715.76
期末可供分配基金份额利润	0.3861
期末基金资产净值	538,149,710.02
期末基金份额净值	1.386
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	44.37%

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。

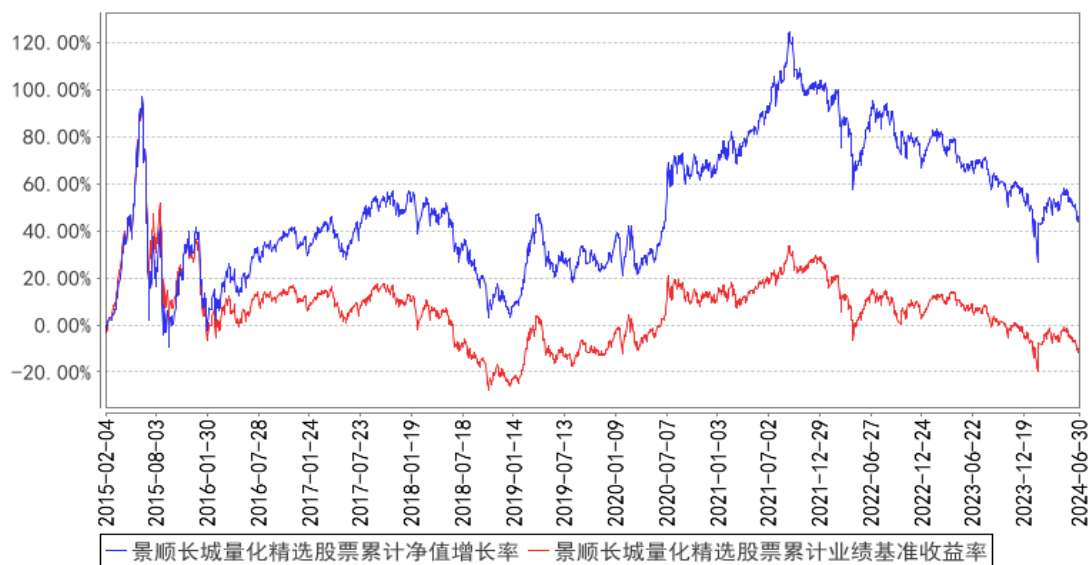
## 3.2 基金净值表现

### 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	-5.46%	0.90%	-6.55%	0.91%	1.09%	-0.01%
过去三个月	-4.15%	1.02%	-6.16%	1.09%	2.01%	-0.07%
过去六个月	-7.29%	1.45%	-8.46%	1.53%	1.17%	-0.08%
过去一年	-14.39%	1.16%	-16.71%	1.21%	2.32%	-0.05%
过去三年	-25.28%	1.12%	-26.01%	1.14%	0.73%	-0.02%
自基金合同生效起至今	44.37%	1.63%	-11.38%	1.52%	55.75%	0.11%

### 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

景顺长城量化精选股票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：本基金股票资产占基金资产的比例范围为 80%–95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%–20%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0–3%，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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的建仓期为自 2015 年 2 月 4 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		
黎海威	本基金的基金经理	2015年2月4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、《景顺长城量化精选股票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，本基金份额净值增长率为-7.29%，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。风格上，估值和成长相对均衡的中盘股以及细分行业的龙头股仍然值得期待。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

#### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：景顺长城量化精选股票型证券投资基金

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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	35,029,595.78	55,181,942.69
结算备付金		8,698,188.56	1,899,530.45
存出保证金		668,868.87	74,555.94

交易性金融资产	6.4.7.2	497,093,201.15	582,831,920.60
其中：股票投资		497,093,201.15	582,546,901.66
基金投资		-	-
债券投资		-	285,018.94
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		73,462.56	190,996.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		541,563,316.92	640,178,946.43
<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		0.73	16,690,183.74
应付赎回款		472,918.20	399,356.66
应付管理人报酬		545,681.40	610,918.28
应付托管费		90,946.91	101,819.71
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		14,323.38	0.58
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,289,736.28	1,849,215.04
负债合计		3,413,606.90	19,651,494.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	388,246,994.26	415,192,185.69
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	149,902,715.76	205,335,266.73
净资产合计		538,149,710.02	620,527,452.42

负债和净资产总计		541,563,316.92	640,178,946.43
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.386 元，基金份额总额 388,246,994.26 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化精选股票型证券投资基金

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>		-35,790,600.11	6,266,790.77
1. 利息收入		124,540.81	119,286.99
其中：存款利息收入	6.4.7.13	124,540.81	119,286.99
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）		-18,867,402.35	-12,178,095.13
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-28,721,180.39	-20,262,275.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	72,197.44	313,941.23
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	1,743,139.19	-
股利收益	6.4.7.19	8,038,441.41	7,770,239.52
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	-17,124,851.64	18,228,415.34
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	77,113.07	97,183.57
<b>减：二、营业总支出</b>		4,222,215.88	6,308,898.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,522,562.90	5,312,401.13
其中：暂估管理人报酬		-	-

2. 托管费	6.4.10.2.2	587,093.81	885,400.12
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		6,279.53	0.77
8. 其他费用	6.4.7.23	106,279.64	111,096.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-40,012,815.99	-42,107.85
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-40,012,815.99	-42,107.85
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-40,012,815.99	-42,107.85

### 6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城量化精选股票型证券投资基金

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、上期期末净资产	415,192,185.69	-	205,335,266.73	620,527,452.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	415,192,185.69	-	205,335,266.73	620,527,452.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-26,945,191.43	-	-55,432,550.97	-82,377,742.40
（一）、综合收益总额	-	-	-40,012,815.99	-40,012,815.99
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	-26,945,191.43	-	-15,419,734.98	-42,364,926.41

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	35,617,723.03	-	14,087,088.16	49,704,811.19
2. 基金赎回款	-62,562,914.46	-	-29,506,823.14	-92,069,737.60
(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	388,246,994.26	-	149,902,715.76	538,149,710.02
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	456,489,143.72	-	287,658,215.06	744,147,358.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	456,489,143.72	-	287,658,215.06	744,147,358.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-66,531,638.49	-	-46,363,592.80	-112,895,231.29
(一)、综合收益总额	-	-	-42,107.85	-42,107.85
(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)	-66,531,638.49	-	-46,321,484.95	-112,853,123.44
其中：1. 基金申购款	23,570,587.54	-	16,211,566.39	39,782,153.93
2. 基金赎回款	-90,102,226.03	-	-62,533,051.34	-152,635,277.37
(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	389,957,505.23	-	241,294,622.26	631,252,127.49

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

景顺长城量化精选股票型证券投资基金（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[2014]1366 号文《关于准予景顺长城量化精选股票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《景顺长城量化精选股票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 2015 年 2 月 4 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 1,407,431,598.88 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 442,601.36 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,407,874,200.24 元，折合 1,407,874,200.24 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 80%-95%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-20%，其中权证资产占基金资产净值的比例范围为 0-3%，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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。



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	35,029,595.78
等于：本金	35,026,527.94
加：应计利息	3,067.84
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	35,029,595.78

## 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	526,256,862.57	-	497,093,201.15	-29,163,661.42
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	526,256,862.57	-	497,093,201.15	-29,163,661.42

## 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	5,192,160.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	5,192,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,192,160.00	-	-	-

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	5.00	4,917,600.00	-274,560.00
合计				-274,560.00
减：可抵销期货 暂收款				-274,560.00
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	389.29
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,190,365.33
其中：交易所市场	2,190,365.33
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	98,981.66
合计	2,289,736.28

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	415,192,185.69	415,192,185.69
本期申购	35,617,723.03	35,617,723.03
本期赎回（以“-”号填列）	-62,562,914.46	-62,562,914.46
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	388,246,994.26	388,246,994.26

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	319,075,109.08	-113,739,842.35	205,335,266.73
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	319,075,109.08	-113,739,842.35	205,335,266.73
本期利润	-22,887,964.35	-17,124,851.64	-40,012,815.99
本期基金份额交易产生的变动数	-18,549,716.37	3,129,981.39	-15,419,734.98
其中：基金申购款	24,954,226.23	-10,867,138.07	14,087,088.16
基金赎回款	-43,503,942.60	13,997,119.46	-29,506,823.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	277,637,428.36	-127,734,712.60	149,902,715.76

#### 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	64,966.29
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	58,966.95
其他	607.57
合计	124,540.81

#### 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	-28,721,180.39
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	-28,721,180.39

##### 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	2,301,277,099.64

减：卖出股票成本总额	2,324,246,099.09
减：交易费用	5,752,180.94
买卖股票差价收入	-28,721,180.39

#### 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	85.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	72,111.77
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	72,197.44

##### 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	524,239.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	452,000.00
减：应计利息总额	107.03
减：交易费用	20.89
买卖债券差价收入	72,111.77

#### 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	1,743,139.19

## 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	8,038,441.41
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	8,038,441.41

## 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	-16,850,291.64
股票投资	-16,850,291.64
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	-274,560.00
权证投资	-
期货投资	-274,560.00
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	-17,124,851.64

## 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	76,423.02
基金转换费收入	690.05
合计	77,113.07

#### 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	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	2,277.77
其他	360.00
存托服务费	160.21
合计	106,279.64

#### 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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	415,083,692.67	9.11	624,568.46	0.01

## 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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
长城证券	392,608.59	9.11	392,576.98	17.92
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	占期末应付佣金总量的比例 (%)
长城证券	581.65	0.01	581.65	0.02

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	3,522,562.90	5,312,401.13
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,106,336.77	1,756,221.62
应支付基金管理人的净管理费	2,416,226.13	3,556,179.51

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月

月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

根据《景顺长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 22 日起，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 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
当期发生的基金应支付的托管费	587,093.81	885,400.12

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

根据《景顺长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 22 日起，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

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

#### 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
中国建设银行-活期	35,029,595.78	64,966.29	44,656,655.73	81,701.62

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	华阳智能	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	-
301536	星宸科技	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	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-

		日		受限						
603285	键邦股份	2024年 6月28日	6个月	新股 流通 受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
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	中创股份	2024年 3月6日	6个月	新股 流通 受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
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：0.05%）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过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	35,029,595.78	-	-	-	-	-	35,029,595.78
结算备付金	8,698,188.56	-	-	-	-	-	8,698,188.56
存出保证金	78,756.87	-	-	-	-	590,112.00	668,868.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-	497,093,201.15	497,093,201.15
应收申购款	-	-	-	-	-	73,462.56	73,462.56
资产总计	43,806,541.21	-	-	-	-	497,756,775.71	541,563,316.92
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	472,918.20	472,918.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	545,681.40	545,681.40

应付托管费	-	-	-	-	-	90,946.91	90,946.91
应付清算款	-	-	-	-	-	0.73	0.73
应交税费	-	-	-	-	-	14,323.38	14,323.38
其他负债	-	-	-	-	-	2,289,736.28	2,289,736.28
负债总计	-	-	-	-	-	3,413,606.90	3,413,606.90
利率敏感度缺口	43,806,541.21	-	-	-	-	-	-
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	55,181,942.69	-	-	-	-	-	55,181,942.69
结算备付金	1,899,530.45	-	-	-	-	-	1,899,530.45
存出保证金	74,555.94	-	-	-	-	-	74,555.94
交易性金融资产	-	-	-	262,017.23	23,001.71	582,546,901.66	582,831,920.60
应收申购款	-	-	-	-	-	190,996.75	190,996.75
资产总计	57,156,029.08	-	-	262,017.23	23,001.71	582,737,898.41	640,178,946.43
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	399,356.66	399,356.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	610,918.28	610,918.28
应付托管费	-	-	-	-	-	101,819.71	101,819.71
应付清算款	-	-	-	-	-	16,690,183.74	16,690,183.74
应交税费	-	-	-	-	-	0.58	0.58
其他负债	-	-	-	-	-	1,849,215.04	1,849,215.04
负债总计	-	-	-	-	-	19,651,494.01	19,651,494.01
利率敏感度缺口	57,156,029.08	-	-	262,017.23	23,001.71	-	-

#### 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：0.05%），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	497,093,201.15	92.37	582,546,901.66	93.88
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	497,093,201.15	92.37	582,546,901.66	93.88

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%	36,855,494.89	25,317,765.09
	沪深 300 指数下降 5%	-36,855,494.89	-25,317,765.09

#### 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	496,824,463.45	581,525,697.65
第二层次	55,385.83	310,077.10
第三层次	213,351.87	996,145.85
合计	497,093,201.15	582,831,920.60

## 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	497,093,201.15	91.79
	其中：股票	497,093,201.15	91.79
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	43,727,784.34	8.07
8	其他各项资产	742,331.43	0.14
9	合计	541,563,316.92	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	1,539,600.52	0.29
B	采矿业	29,995,215.73	5.57
C	制造业	312,955,357.80	58.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,934,480.92	3.15
E	建筑业	5,470,964.65	1.02
F	批发和零售业	7,203,170.50	1.34
G	交通运输、仓储和邮政业	12,227,691.32	2.27
H	住宿和餐饮业	184,966.02	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,795,472.67	6.47
J	金融业	44,024,169.97	8.18
K	房地产业	6,681,783.79	1.24
L	租赁和商务服务业	2,533,484.11	0.47
M	科学研究和技术服务业	2,871,750.31	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	910,168.00	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	4,984,080.00	0.93
R	文化、体育和娱乐业	12,699,008.04	2.36
S	综合	1,081,836.80	0.20
	合计	497,093,201.15	92.37

### 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	600177	雅戈尔	766,720	5,459,046.40	1.01
2	601058	赛轮轮胎	362,800	5,079,200.00	0.94
3	300207	欣旺达	329,172	4,993,539.24	0.93
4	600066	宇通客车	190,800	4,922,640.00	0.91
5	600096	云天化	247,081	4,798,313.02	0.89
6	603160	汇顶科技	66,056	4,541,350.00	0.84
7	000728	国元证券	716,314	4,340,862.84	0.81
8	000630	铜陵有色	1,173,523	4,236,418.03	0.79
9	002008	大族激光	203,575	4,234,360.00	0.79
10	300144	宋城演艺	519,849	4,174,387.47	0.78
11	300251	光线传媒	488,789	4,110,715.49	0.76
12	600143	金发科技	616,994	4,078,330.34	0.76
13	300394	天孚通信	45,988	4,066,258.96	0.76
14	601108	财通证券	611,245	4,040,329.45	0.75
15	002128	电投能源	189,663	4,001,889.30	0.74
16	300724	捷佳伟创	72,328	3,906,435.28	0.73
17	600529	山东药玻	149,092	3,777,991.28	0.70
18	600642	申能股份	413,886	3,654,613.38	0.68
19	600901	江苏金租	717,284	3,622,284.20	0.67
20	601717	郑煤机	244,680	3,621,264.00	0.67
21	300002	神州泰岳	440,735	3,578,768.20	0.67
22	600566	济川药业	112,563	3,569,372.73	0.66
23	002558	巨人网络	372,980	3,520,931.20	0.65
24	601615	明阳智能	372,834	3,519,552.96	0.65
25	000155	川能动力	326,000	3,511,020.00	0.65
26	300390	天华新能	201,116	3,455,172.88	0.64
27	000887	中鼎股份	276,378	3,382,866.72	0.63
28	601128	常熟银行	441,445	3,341,738.65	0.62
29	601665	齐鲁银行	678,538	3,331,621.58	0.62
30	603501	韦尔股份	32,926	3,271,856.62	0.61
31	600862	中航高科	173,228	3,253,221.84	0.60
32	688188	柏楚电子	17,626	3,252,878.30	0.60
33	600737	中粮糖业	336,143	3,223,611.37	0.60
34	000738	航发控制	159,892	3,209,032.44	0.60
35	300760	迈瑞医疗	10,800	3,141,828.00	0.58
36	601318	中国平安	74,222	3,069,821.92	0.57
37	600985	淮北矿业	182,672	3,057,929.28	0.57
38	002340	格林美	479,289	3,053,070.93	0.57
39	002557	洽洽食品	108,185	3,049,735.15	0.57
40	000563	陕国投 A	1,095,583	3,012,853.25	0.56
41	603317	天味食品	264,011	3,012,365.51	0.56
42	002019	亿帆医药	243,444	3,008,967.84	0.56

43	300357	我武生物	148,300	2,998,626.00	0.56
44	600299	安迪苏	306,002	2,968,219.40	0.55
45	300502	新易盛	28,083	2,964,160.65	0.55
46	002138	顺络电子	106,402	2,921,798.92	0.54
47	601636	旗滨集团	452,167	2,916,477.15	0.54
48	600867	通化东宝	344,809	2,886,051.33	0.54
49	603885	吉祥航空	261,600	2,874,984.00	0.53
50	688002	睿创微纳	102,489	2,866,617.33	0.53
51	002001	新和成	146,060	2,804,352.00	0.52
52	000758	中色股份	543,300	2,759,964.00	0.51
53	002497	雅化集团	308,716	2,753,746.72	0.51
54	603727	博迈科	201,200	2,647,792.00	0.49
55	002507	涪陵榨菜	214,171	2,623,594.75	0.49
56	600909	华安证券	611,944	2,576,284.24	0.48
57	300244	迪安诊断	214,411	2,572,932.00	0.48
58	601688	华泰证券	207,504	2,570,974.56	0.48
59	600820	隧道股份	393,122	2,567,086.66	0.48
60	600582	天地科技	365,447	2,517,929.83	0.47
61	300017	网宿科技	316,190	2,497,901.00	0.46
62	688516	奥特维	59,737	2,497,603.97	0.46
63	000027	深圳能源	340,716	2,487,226.80	0.46
64	002276	万马股份	341,600	2,449,272.00	0.46
65	300896	爱美客	13,640	2,347,444.00	0.44
66	603882	金域医学	84,000	2,283,960.00	0.42
67	002237	恒邦股份	195,196	2,246,705.96	0.42
68	002185	华天科技	269,288	2,194,697.20	0.41
69	000725	京东方 A	524,135	2,143,712.15	0.40
70	603658	安图生物	45,721	2,106,366.47	0.39
71	002966	苏州银行	275,582	2,066,865.00	0.38
72	601077	渝农商行	407,393	2,045,112.86	0.38
73	688372	伟测科技	50,700	1,994,031.00	0.37
74	000997	新大陆	143,352	1,994,026.32	0.37
75	002351	漫步者	151,608	1,993,645.20	0.37
76	688008	澜起科技	34,722	1,984,709.52	0.37
77	600933	爱柯迪	133,200	1,970,028.00	0.37
78	002517	恺英网络	202,481	1,933,693.55	0.36
79	300373	扬杰科技	49,686	1,932,785.40	0.36
80	002706	良信股份	274,800	1,885,128.00	0.35
81	001914	招商积余	188,058	1,884,341.16	0.35
82	300638	广和通	109,234	1,867,901.40	0.35
83	000550	江铃汽车	85,119	1,847,933.49	0.34
84	002540	亚太科技	334,563	1,769,838.27	0.33
85	002301	齐心集团	362,917	1,752,889.11	0.33



86	600352	浙江龙盛	203,382	1,747,051.38	0.32
87	002152	广电运通	165,768	1,733,933.28	0.32
88	000683	远兴能源	238,659	1,649,133.69	0.31
89	002595	豪迈科技	42,552	1,624,209.84	0.30
90	002727	一心堂	107,600	1,623,684.00	0.30
91	002223	鱼跃医疗	42,276	1,589,577.60	0.30
92	601233	桐昆股份	98,237	1,567,862.52	0.29
93	300866	安克创新	21,843	1,555,440.03	0.29
94	603606	东方电缆	31,500	1,537,515.00	0.29
95	688120	华海清科	8,109	1,537,304.22	0.29
96	601990	南京证券	195,743	1,503,306.24	0.28
97	600916	中国黄金	156,100	1,501,682.00	0.28
98	600988	赤峰黄金	90,481	1,478,459.54	0.27
99	002106	莱宝高科	135,038	1,471,914.20	0.27
100	688234	天岳先进	31,278	1,467,563.76	0.27
101	000830	鲁西化工	126,328	1,464,141.52	0.27
102	603893	瑞芯微	24,682	1,460,433.94	0.27
103	688772	珠海冠宇	97,701	1,455,744.90	0.27
104	603267	鸿远电子	42,214	1,439,497.40	0.27
105	688371	菲沃泰	143,003	1,435,750.12	0.27
106	002384	东山精密	69,186	1,432,150.20	0.27
107	300130	新国都	85,734	1,426,613.76	0.27
108	002928	华夏航空	224,648	1,424,268.32	0.26
109	600398	海澜之家	153,667	1,419,883.08	0.26
110	600282	南钢股份	284,914	1,418,871.72	0.26
111	600489	中金黄金	95,804	1,417,899.20	0.26
112	300054	鼎龙股份	62,500	1,417,500.00	0.26
113	002064	华峰化学	197,658	1,417,207.86	0.26
114	600885	宏发股份	49,900	1,381,232.00	0.26
115	600060	海信视像	55,657	1,376,954.18	0.26
116	600348	华阳股份	138,100	1,375,476.00	0.26
117	002739	万达电影	112,357	1,358,396.13	0.25
118	002410	广联达	141,716	1,357,639.28	0.25
119	002833	弘亚数控	73,900	1,347,936.00	0.25
120	601216	君正集团	364,307	1,344,292.83	0.25
121	300003	乐普医疗	90,400	1,341,536.00	0.25
122	002195	岩山科技	519,589	1,304,168.39	0.24
123	000703	恒逸石化	183,835	1,303,390.15	0.24
124	002563	森马服饰	222,282	1,291,458.42	0.24
125	600377	宁沪高速	99,984	1,259,798.40	0.23
126	601231	环旭电子	78,280	1,256,394.00	0.23
127	688036	传音控股	16,352	1,251,582.08	0.23
128	600848	上海临港	132,332	1,205,544.52	0.22

129	001872	招商港口	62,600	1,205,050.00	0.22
130	600511	国药股份	39,048	1,202,287.92	0.22
131	601127	赛力斯	13,086	1,192,396.32	0.22
132	002158	汉钟精机	71,100	1,188,792.00	0.22
133	600380	健康元	106,170	1,185,918.90	0.22
134	600649	城投控股	356,633	1,184,021.56	0.22
135	002240	盛新锂能	86,300	1,158,146.00	0.22
136	600517	国网英大	266,912	1,155,728.96	0.21
137	600050	中国联通	245,774	1,155,137.80	0.21
138	002831	裕同科技	45,010	1,151,805.90	0.21
139	600970	中材国际	95,200	1,148,112.00	0.21
140	002487	大金重工	50,100	1,146,288.00	0.21
141	002683	广东宏大	56,905	1,145,497.65	0.21
142	603816	顾家家居	35,400	1,143,066.00	0.21
143	601958	金钼股份	109,111	1,135,845.51	0.21
144	002353	杰瑞股份	32,376	1,135,750.08	0.21
145	000513	丽珠集团	30,266	1,126,197.86	0.21
146	688063	派能科技	28,160	1,118,233.60	0.21
147	300001	特锐德	55,573	1,118,128.76	0.21
148	600663	陆家嘴	125,900	1,110,438.00	0.21
149	002738	中矿资源	41,195	1,104,026.00	0.21
150	600329	达仁堂	33,730	1,092,514.70	0.20
151	600673	东阳光	153,670	1,081,836.80	0.20
152	300226	上海钢联	62,400	1,057,056.00	0.20
153	300212	易华录	62,400	1,050,192.00	0.20
154	300383	光环新网	120,640	1,019,408.00	0.19
155	603185	弘元绿能	59,367	1,014,582.03	0.19
156	300037	新宙邦	34,874	996,001.44	0.19
157	600801	华新水泥	71,556	983,895.00	0.18
158	689009	九号公司	26,724	983,710.44	0.18
159	603589	口子窖	24,637	965,524.03	0.18
160	002028	思源电气	14,016	937,670.40	0.17
161	600967	内蒙一机	130,158	937,137.60	0.17
162	000636	风华高科	71,300	931,178.00	0.17
163	601168	西部矿业	50,940	914,373.00	0.17
164	300073	当升科技	26,600	912,646.00	0.17
165	601000	唐山港	194,166	912,580.20	0.17
166	000878	云南铜业	72,744	906,390.24	0.17
167	000060	中金岭南	213,191	903,929.84	0.17
168	000958	电投产融	244,201	893,775.66	0.17
169	300285	国瓷材料	50,017	892,803.45	0.17
170	600755	厦门国贸	123,180	883,200.60	0.16
171	000600	建投能源	140,000	882,000.00	0.16

172	601098	中南传媒	70,421	874,628.82	0.16
173	600925	苏能股份	171,600	866,580.00	0.16
174	603596	伯特利	22,059	858,095.10	0.16
175	603056	德邦股份	65,300	855,430.00	0.16
176	600699	均胜电子	57,634	854,135.88	0.16
177	300529	健帆生物	31,154	847,700.34	0.16
178	601019	山东出版	66,400	784,848.00	0.15
179	601666	平煤股份	69,710	780,752.00	0.15
180	600549	厦门钨业	45,204	779,769.00	0.14
181	600938	中国海油	23,600	778,800.00	0.14
182	000818	航锦科技	35,200	777,216.00	0.14
183	002422	科伦药业	25,443	771,686.19	0.14
184	000423	东阿阿胶	12,253	767,037.80	0.14
185	688169	石头科技	1,900	745,940.00	0.14
186	002465	海格通信	70,900	734,524.00	0.14
187	688349	三一重能	29,500	732,780.00	0.14
188	000039	中集集团	78,900	730,614.00	0.14
189	002572	索菲亚	47,300	725,109.00	0.13
190	600704	物产中大	165,328	717,523.52	0.13
191	002120	韵达股份	91,900	711,306.00	0.13
192	688800	瑞可达	25,000	702,000.00	0.13
193	002594	比亚迪	2,800	700,700.00	0.13
194	688099	晶晨股份	11,767	698,018.44	0.13
195	600760	中航沈飞	17,400	697,740.00	0.13
196	600406	国电南瑞	27,855	695,260.80	0.13
197	688114	华大智造	14,608	692,565.28	0.13
198	600161	天坛生物	28,203	688,153.20	0.13
199	688550	瑞联新材	29,560	685,496.40	0.13
200	600039	四川路桥	86,800	684,852.00	0.13
201	601975	招商南油	190,500	683,895.00	0.13
202	600893	航发动力	18,643	681,401.65	0.13
203	603826	坤彩科技	23,478	680,157.66	0.13
204	000975	银泰黄金	41,692	679,162.68	0.13
205	600956	新天绿能	83,124	679,123.08	0.13
206	002436	兴森科技	65,800	679,056.00	0.13
207	300567	精测电子	12,000	678,120.00	0.13
208	600032	浙江新能	92,600	674,128.00	0.13
209	002500	山西证券	143,310	673,557.00	0.13
210	002048	宁波华翔	51,000	659,940.00	0.12
211	300433	蓝思科技	36,063	658,149.75	0.12
212	300850	新强联	43,455	652,694.10	0.12
213	600765	中航重机	31,861	649,964.40	0.12
214	600580	卧龙电驱	53,400	648,810.00	0.12

215	688220	翱捷科技	17,205	644,499.30	0.12
216	000712	锦龙股份	85,300	639,750.00	0.12
217	600598	北大荒	50,914	635,915.86	0.12
218	002140	东华科技	81,900	634,725.00	0.12
219	600546	山煤国际	43,200	631,584.00	0.12
220	000598	兴蓉环境	82,931	623,641.12	0.12
221	002472	双环传动	28,200	620,964.00	0.12
222	600941	中国移动	5,700	612,750.00	0.11
223	002850	科达利	8,000	611,040.00	0.11
224	002252	上海莱士	78,100	610,742.00	0.11
225	603305	旭升集团	57,663	608,921.28	0.11
226	000987	越秀资本	121,905	604,648.80	0.11
227	600483	福能股份	51,500	600,490.00	0.11
228	600584	长电科技	18,800	596,148.00	0.11
229	000999	华润三九	13,510	575,255.80	0.11
230	603568	伟明环保	27,400	563,892.00	0.10
231	300872	天阳科技	42,400	561,800.00	0.10
232	600183	生益科技	26,400	555,984.00	0.10
233	603368	柳药集团	31,214	546,245.00	0.10
234	300366	创意信息	74,743	541,139.32	0.10
235	002736	国信证券	62,198	540,500.62	0.10
236	600481	双良节能	113,798	531,436.66	0.10
237	603737	三棵树	14,500	525,915.00	0.10
238	002262	恩华药业	22,063	523,775.62	0.10
239	300474	景嘉微	8,280	523,544.40	0.10
240	002423	中粮资本	69,500	520,555.00	0.10
241	002068	黑猫股份	73,100	519,010.00	0.10
242	600019	宝钢股份	77,788	517,290.20	0.10
243	603515	欧普照明	29,488	511,321.92	0.10
244	002791	坚朗五金	18,929	489,693.23	0.09
245	002203	海亮股份	61,294	489,126.12	0.09
246	002415	海康威视	15,600	482,196.00	0.09
247	603939	益丰药房	19,635	482,039.25	0.09
248	300379	东方通	58,962	476,412.96	0.09
249	002299	圣农发展	34,800	474,672.00	0.09
250	600499	科达制造	56,200	473,766.00	0.09
251	000568	泸州老窖	3,300	473,517.00	0.09
252	601816	京沪高铁	87,900	472,023.00	0.09
253	603444	吉比特	2,636	469,234.36	0.09
254	601997	贵阳银行	88,096	464,265.92	0.09
255	688475	萤石网络	13,600	463,896.00	0.09
256	600062	华润双鹤	23,606	462,205.48	0.09
257	002192	融捷股份	15,286	458,885.72	0.09

258	002583	海能达	111,987	455,787.09	0.08
259	002180	纳思达	17,224	455,058.08	0.08
260	002273	水晶光电	26,640	452,347.20	0.08
261	002958	青农商行	166,715	446,796.20	0.08
262	300408	三环集团	15,300	446,607.00	0.08
263	601928	凤凰传媒	40,724	446,335.04	0.08
264	603132	金徽股份	32,416	446,044.16	0.08
265	688180	君实生物	15,295	444,319.75	0.08
266	688122	西部超导	11,592	444,205.44	0.08
267	688200	华峰测控	4,782	438,748.50	0.08
268	688276	百克生物	15,381	436,358.97	0.08
269	300168	万达信息	91,143	432,929.25	0.08
270	600535	天士力	34,082	428,751.56	0.08
271	601899	紫金矿业	24,400	428,708.00	0.08
272	002056	横店东磁	33,724	420,538.28	0.08
273	002294	信立泰	15,727	418,810.01	0.08
274	600390	五矿资本	102,092	413,472.60	0.08
275	601966	玲珑轮胎	22,440	412,222.80	0.08
276	600021	上海电力	41,134	406,815.26	0.08
277	601598	中国外运	72,155	406,232.65	0.08
278	688521	芯原股份	15,179	406,038.25	0.08
279	300253	卫宁健康	68,767	405,725.30	0.08
280	600141	兴发集团	21,141	403,370.28	0.07
281	000066	中国长城	45,721	400,058.75	0.07
282	600395	盘江股份	66,500	399,665.00	0.07
283	002444	巨星科技	15,900	392,730.00	0.07
284	002624	完美世界	51,452	391,035.20	0.07
285	600418	江淮汽车	24,482	387,794.88	0.07
286	601456	国联证券	40,200	387,528.00	0.07
287	300298	三诺生物	15,258	386,637.72	0.07
288	600158	中体产业	49,910	383,807.90	0.07
289	002498	汉缆股份	115,400	379,666.00	0.07
290	002244	滨江集团	51,900	376,794.00	0.07
291	600498	烽火通信	23,557	374,556.30	0.07
292	300384	三联虹普	28,194	369,905.28	0.07
293	688586	江航装备	39,325	365,722.50	0.07
294	300772	运达股份	37,685	361,776.00	0.07
295	688095	福昕软件	7,893	361,578.33	0.07
296	600718	东软集团	43,428	359,149.56	0.07
297	688233	神工股份	18,590	358,229.30	0.07
298	002508	老板电器	16,200	358,020.00	0.07
299	600435	北方导航	41,500	357,730.00	0.07
300	601139	深圳燃气	53,163	355,128.84	0.07

301	000050	深天马 A	48,518	353,211.04	0.07
302	600559	老白干酒	19,400	352,692.00	0.07
303	002385	大北农	91,267	351,377.95	0.07
304	603000	人民网	17,500	349,825.00	0.07
305	000682	东方电子	31,200	344,448.00	0.06
306	002372	伟星新材	22,200	342,324.00	0.06
307	002635	安洁科技	22,100	341,224.00	0.06
308	603013	亚普股份	25,100	338,097.00	0.06
309	000596	古井贡酒	1,600	337,712.00	0.06
310	300741	华宝股份	22,100	336,804.00	0.06
311	300620	光库科技	9,100	334,698.00	0.06
312	603517	绝味食品	21,662	333,594.80	0.06
313	300888	稳健医疗	13,000	328,900.00	0.06
314	603456	九洲药业	23,960	328,731.20	0.06
315	001203	大中矿业	34,000	326,740.00	0.06
316	002155	湖南黄金	18,000	325,800.00	0.06
317	600459	贵研铂业	23,947	323,523.97	0.06
318	600315	上海家化	18,166	322,991.48	0.06
319	300861	美畅股份	16,524	319,739.40	0.06
320	002429	兆驰股份	66,387	319,321.47	0.06
321	601628	中国人寿	10,243	318,045.15	0.06
322	300085	银之杰	39,300	317,544.00	0.06
323	002179	中航光电	8,300	315,815.00	0.06
324	688207	格灵深瞳	27,421	314,518.87	0.06
325	688029	南微医学	5,091	313,401.96	0.06
326	002532	天山铝业	38,418	311,569.98	0.06
327	002550	千红制药	57,700	311,003.00	0.06
328	002153	石基信息	53,879	308,726.67	0.06
329	300659	中孚信息	23,734	307,829.98	0.06
330	688016	心脉医疗	3,132	307,092.60	0.06
331	603688	石英股份	10,364	306,878.04	0.06
332	000960	锡业股份	19,800	306,702.00	0.06
333	301236	软通动力	8,700	306,327.00	0.06
334	603393	新天然气	8,800	305,712.00	0.06
335	000988	华工科技	10,153	303,879.29	0.06
336	600188	兖矿能源	13,063	296,921.99	0.06
337	000567	海德股份	52,889	296,707.29	0.06
338	002475	立讯精密	7,500	294,825.00	0.05
339	300088	长信科技	62,500	293,750.00	0.05
340	300009	安科生物	34,365	293,477.10	0.05
341	600399	抚顺特钢	52,037	292,968.31	0.05
342	603008	喜临门	16,800	291,144.00	0.05
343	002078	太阳纸业	20,800	290,160.00	0.05

344	603156	养元饮品	13,531	287,804.37	0.05
345	603565	中谷物流	32,500	284,050.00	0.05
346	000030	富奥股份	57,700	283,307.00	0.05
347	600500	中化国际	80,900	282,341.00	0.05
348	601877	正泰电器	14,795	281,992.70	0.05
349	600968	海油发展	67,963	280,007.56	0.05
350	600126	杭钢股份	68,119	279,969.09	0.05
351	601601	中国太保	9,913	276,176.18	0.05
352	000537	中绿电	28,600	272,558.00	0.05
353	000029	深深房 A	25,300	268,939.00	0.05
354	002625	光启技术	15,500	268,925.00	0.05
355	603218	日月股份	26,000	267,020.00	0.05
356	600482	中国动力	13,656	266,018.88	0.05
357	688311	盟升电子	12,980	265,960.20	0.05
358	002414	高德红外	44,727	263,442.03	0.05
359	605090	九丰能源	9,000	261,000.00	0.05
360	603583	捷昌驱动	12,716	259,152.08	0.05
361	601298	青岛港	27,100	259,076.00	0.05
362	600025	华能水电	23,700	255,486.00	0.05
363	000739	普洛药业	18,500	251,045.00	0.05
364	603203	快克智能	10,500	247,590.00	0.05
365	600497	驰宏锌锗	46,163	246,510.42	0.05
366	000933	神火股份	12,171	246,219.33	0.05
367	600845	宝信软件	7,700	245,861.00	0.05
368	600674	川投能源	13,100	245,625.00	0.05
369	600521	华海药业	14,163	241,479.15	0.04
370	300122	智飞生物	8,600	241,058.00	0.04
371	000967	盈峰环境	56,600	239,418.00	0.04
372	300751	迈为股份	2,000	238,960.00	0.04
373	603010	万盛股份	26,500	238,765.00	0.04
374	002091	江苏国泰	34,700	236,307.00	0.04
375	601228	广州港	76,800	234,240.00	0.04
376	600873	梅花生物	23,332	233,786.64	0.04
377	688005	容百科技	10,025	233,382.00	0.04
378	300973	立高食品	8,300	233,147.00	0.04
379	688567	孚能科技	24,209	232,406.40	0.04
380	603707	健友股份	19,500	231,660.00	0.04
381	600325	华发股份	35,502	230,763.00	0.04
382	603123	翠微股份	38,763	230,252.22	0.04
383	688520	神州细胞	5,800	228,230.00	0.04
384	002531	天顺风能	25,300	226,182.00	0.04
385	601118	海南橡胶	49,600	225,680.00	0.04
386	688348	昱能科技	3,778	222,902.00	0.04

387	688777	中控技术	5,900	222,430.00	0.04
388	603986	兆易创新	2,300	219,926.00	0.04
389	002123	梦网科技	31,131	218,850.93	0.04
390	688297	中无人机	6,484	214,166.52	0.04
391	601336	新华保险	7,100	213,213.00	0.04
392	301238	瑞泰新材	14,200	212,574.00	0.04
393	688275	万润新能	7,200	211,824.00	0.04
394	300624	万兴科技	3,967	210,528.69	0.04
395	000400	许继电气	6,088	209,488.08	0.04
396	603728	鸣志电器	5,200	209,196.00	0.04
397	002352	顺丰控股	5,838	208,358.22	0.04
398	002139	拓邦股份	19,300	204,966.00	0.04
399	300363	博腾股份	17,120	204,584.00	0.04
400	688578	艾力斯	3,200	203,968.00	0.04
401	300136	信维通信	10,400	203,632.00	0.04
402	603355	莱克电气	9,400	203,040.00	0.04
403	603533	掌阅科技	10,858	202,718.86	0.04
404	688387	信科移动	39,800	200,592.00	0.04
405	000612	焦作万方	30,600	198,900.00	0.04
406	600323	瀚蓝环境	9,500	198,550.00	0.04
407	603380	易德龙	9,800	196,784.00	0.04
408	600219	南山铝业	51,059	194,534.79	0.04
409	300498	温氏股份	9,763	193,502.66	0.04
410	002824	和胜股份	15,100	192,676.00	0.04
411	600332	白云山	6,543	191,906.19	0.04
412	688025	杰普特	4,720	190,640.80	0.04
413	600732	爱旭股份	20,900	189,145.00	0.04
414	688167	炬光科技	3,422	188,210.00	0.03
415	300438	鹏辉能源	10,200	187,068.00	0.03
416	300114	中航电测	4,100	185,525.00	0.03
417	002466	天齐锂业	6,200	185,442.00	0.03
418	600754	锦江酒店	8,049	184,966.02	0.03
419	603936	博敏电子	21,800	183,120.00	0.03
420	601608	中信重工	47,960	182,727.60	0.03
421	603019	中科曙光	4,400	182,600.00	0.03
422	300750	宁德时代	1,000	180,030.00	0.03
423	688213	思特威	3,700	179,450.00	0.03
424	688033	天宜上佳	29,400	176,400.00	0.03
425	601991	大唐发电	58,193	175,160.93	0.03
426	601577	长沙银行	21,263	173,931.34	0.03
427	603678	火炬电子	6,900	170,361.00	0.03
428	688072	拓荆科技	1,411	169,475.21	0.03
429	300699	光威复材	6,772	168,148.76	0.03



430	600637	东方明珠	27,571	167,631.68	0.03
431	600210	紫江企业	31,500	167,580.00	0.03
432	600095	湘财股份	27,999	166,874.04	0.03
433	600641	万业企业	14,189	166,720.75	0.03
434	605589	圣泉集团	8,200	166,378.00	0.03
435	600415	小商品城	22,300	165,466.00	0.03
436	688281	华秦科技	1,980	164,973.60	0.03
437	600271	航天信息	22,147	163,001.92	0.03
438	600309	万华化学	2,000	161,720.00	0.03
439	300494	盛天网络	16,000	160,800.00	0.03
440	000034	神州数码	6,989	159,978.21	0.03
441	600155	华创云信	26,981	159,457.71	0.03
442	300012	华测检测	15,816	159,108.96	0.03
443	600150	中国船舶	3,900	158,769.00	0.03
444	603379	三美股份	4,043	158,243.02	0.03
445	600895	张江高科	8,557	158,133.36	0.03
446	000783	长江证券	32,688	157,883.04	0.03
447	600057	厦门象屿	23,163	157,508.40	0.03
448	601222	林洋能源	25,100	157,377.00	0.03
449	002865	钧达股份	4,100	157,358.00	0.03
450	688388	嘉元科技	16,000	156,000.00	0.03
451	301268	铭利达	10,000	155,500.00	0.03
452	000009	中国宝安	18,016	154,937.60	0.03
453	603982	泉峰汽车	19,300	154,400.00	0.03
454	300059	东方财富	14,382	151,873.92	0.03
455	600316	洪都航空	9,093	151,216.59	0.03
456	605555	德昌股份	8,100	150,741.00	0.03
457	002768	国恩股份	8,000	149,600.00	0.03
458	300369	绿盟科技	29,200	149,212.00	0.03
459	601827	三峰环境	17,400	147,726.00	0.03
460	600519	贵州茅台	100	146,739.00	0.03
461	603878	武进不锈	22,300	145,842.00	0.03
462	000883	湖北能源	24,100	144,841.00	0.03
463	601865	福莱特	7,200	144,720.00	0.03
464	600572	康恩贝	32,300	144,381.00	0.03
465	600660	福耀玻璃	3,000	143,700.00	0.03
466	000333	美的集团	2,200	141,900.00	0.03
467	601369	陕鼓动力	17,003	136,364.06	0.03
468	000921	海信家电	4,200	135,408.00	0.03
469	603600	永艺股份	12,963	135,333.72	0.03
470	600989	宝丰能源	7,761	134,498.13	0.02
471	600879	航天电子	17,100	132,867.00	0.02
472	000408	藏格矿业	5,486	132,048.02	0.02

473	600707	彩虹股份	19,343	131,725.83	0.02
474	603087	甘李药业	2,800	129,696.00	0.02
475	300142	沃森生物	11,300	128,594.00	0.02
476	601858	中国科传	6,700	128,104.00	0.02
477	003040	楚天龙	10,400	127,920.00	0.02
478	301239	普瑞眼科	3,600	127,188.00	0.02
479	300458	全志科技	5,400	126,954.00	0.02
480	002648	卫星化学	7,039	126,561.22	0.02
481	300346	南大光电	4,300	122,937.00	0.02
482	600458	时代新材	12,100	122,210.00	0.02
483	300853	申昊科技	8,400	122,136.00	0.02
484	000778	新兴铸管	35,008	121,827.84	0.02
485	601609	金田股份	21,522	121,814.52	0.02
486	300048	合康新能	26,109	120,884.67	0.02
487	601668	中国建筑	22,752	120,813.12	0.02
488	600803	新奥股份	5,800	120,640.00	0.02
489	002901	大博医疗	4,600	118,818.00	0.02
490	002320	海峡股份	23,000	118,680.00	0.02
491	688518	联赢激光	7,100	118,570.00	0.02
492	600373	中文传媒	7,878	116,909.52	0.02
493	002979	雷赛智能	6,400	116,480.00	0.02
494	600480	凌云股份	11,800	115,994.00	0.02
495	601163	三角轮胎	7,600	115,672.00	0.02
496	601568	北元集团	31,057	115,221.47	0.02
497	003022	联泓新科	8,400	115,164.00	0.02
498	300598	诚迈科技	4,083	114,650.64	0.02
499	300418	昆仑万维	3,546	114,323.04	0.02
500	300677	英科医疗	4,243	113,754.83	0.02
501	300183	东软载波	9,816	113,669.28	0.02
502	601607	上海医药	5,900	112,749.00	0.02
503	603209	兴通股份	8,000	110,720.00	0.02
504	601016	节能风电	36,500	109,135.00	0.02
505	002997	瑞鹄模具	3,400	108,698.00	0.02
506	002608	江苏国信	13,947	108,089.25	0.02
507	601700	风范股份	24,250	106,457.50	0.02
508	000825	太钢不锈	31,443	106,277.34	0.02
509	300547	川环科技	6,500	106,275.00	0.02
510	600645	中源协和	6,600	106,260.00	0.02
511	002156	通富微电	4,733	105,971.87	0.02
512	000729	燕京啤酒	12,000	105,960.00	0.02
513	002318	久立特材	4,500	104,985.00	0.02
514	300460	惠伦晶体	12,100	103,213.00	0.02
515	603610	麒盛科技	10,400	102,752.00	0.02

516	001338	永顺泰	10,300	100,940.00	0.02
517	002409	雅克科技	1,588	99,901.08	0.02
518	300748	金力永磁	7,700	99,792.00	0.02
519	300679	电连技术	2,478	99,689.94	0.02
520	000559	万向钱潮	22,282	99,377.72	0.02
521	605116	奥锐特	3,955	98,993.65	0.02
522	002765	蓝黛科技	21,000	98,700.00	0.02
523	601633	长城汽车	3,900	98,670.00	0.02
524	688003	天准科技	3,000	98,280.00	0.02
525	688153	唯捷创芯	2,638	97,606.00	0.02
526	600276	恒瑞医药	2,520	96,919.20	0.02
527	601916	浙商银行	34,904	96,335.04	0.02
528	688088	虹软科技	3,300	95,238.00	0.02
529	000166	申万宏源	22,024	94,923.44	0.02
530	000786	北新建材	3,200	94,912.00	0.02
531	300911	亿田智能	3,700	94,128.00	0.02
532	002027	分众传媒	15,436	93,542.16	0.02
533	603096	新经典	5,500	92,950.00	0.02
534	000930	中粮科技	18,451	92,808.53	0.02
535	002690	美亚光电	5,600	92,400.00	0.02
536	688617	惠泰医疗	200	91,220.00	0.02
537	603786	科博达	1,416	90,836.40	0.02
538	603960	克来机电	4,300	90,730.00	0.02
539	600037	歌华有线	15,130	90,477.40	0.02
540	603883	老百姓	4,892	89,817.12	0.02
541	603466	风语筑	10,500	89,670.00	0.02
542	600502	安徽建工	20,851	89,659.30	0.02
543	002673	西部证券	14,400	89,136.00	0.02
544	601778	晶科科技	38,900	88,692.00	0.02
545	603296	华勤技术	1,600	88,368.00	0.02
546	601101	昊华能源	9,400	86,386.00	0.02
547	603179	新泉股份	2,200	86,328.00	0.02
548	000821	京山轻机	7,600	86,108.00	0.02
549	002453	华软科技	20,063	86,070.27	0.02
550	603806	福斯特	5,838	85,818.60	0.02
551	601187	厦门银行	16,100	85,813.00	0.02
552	600623	华谊集团	14,845	85,804.10	0.02
553	300740	水羊股份	5,800	85,144.00	0.02
554	601138	工业富联	3,100	84,940.00	0.02
555	603297	永新光学	1,400	84,686.00	0.02
556	301058	中粮科工	8,900	84,283.00	0.02
557	003029	吉大正元	4,700	83,613.00	0.02
558	603345	安井食品	1,100	81,741.00	0.02

559	001213	中铁特货	20,600	81,370.00	0.02
560	605117	德业股份	1,084	80,584.56	0.01
561	600636	国新文化	10,724	80,430.00	0.01
562	002100	天康生物	11,595	80,353.35	0.01
563	002463	沪电股份	2,200	80,300.00	0.01
564	300548	博创科技	4,100	79,909.00	0.01
565	605016	百龙创园	3,920	79,850.40	0.01
566	600583	海油工程	13,400	79,194.00	0.01
567	688018	乐鑫科技	800	78,944.00	0.01
568	002430	杭氧股份	3,522	78,364.50	0.01
569	603977	国泰集团	7,600	77,292.00	0.01
570	300308	中际旭创	560	77,212.80	0.01
571	688779	长远锂科	16,668	77,172.84	0.01
572	300676	华大基因	2,200	77,022.00	0.01
573	000935	四川双马	6,400	76,864.00	0.01
574	600690	海尔智家	2,700	76,626.00	0.01
575	601828	美凯龙	29,982	76,454.10	0.01
576	601800	中国交建	8,500	75,990.00	0.01
577	603856	东宏股份	7,400	75,332.00	0.01
578	002003	伟星股份	5,900	74,045.00	0.01
579	688017	绿的谐波	900	73,890.00	0.01
580	601766	中国中车	9,800	73,598.00	0.01
581	600888	新疆众和	10,401	73,535.07	0.01
582	003031	中瓷电子	1,560	72,134.40	0.01
583	002053	云南能投	5,885	71,149.65	0.01
584	603979	金诚信	1,400	70,742.00	0.01
585	300065	海兰信	10,558	69,788.38	0.01
586	601689	拓普集团	1,300	69,693.00	0.01
587	300364	中文在线	3,200	69,056.00	0.01
588	002737	葵花药业	2,943	68,807.34	0.01
589	600810	神马股份	11,011	68,268.20	0.01
590	688111	金山办公	300	68,250.00	0.01
591	000338	潍柴动力	4,200	68,208.00	0.01
592	603993	洛阳钼业	8,000	68,000.00	0.01
593	002163	海南发展	12,400	67,952.00	0.01
594	601156	东航物流	3,300	67,155.00	0.01
595	688123	聚辰股份	1,100	66,913.00	0.01
596	002050	三花智控	3,500	66,780.00	0.01
597	000425	徐工机械	9,200	65,780.00	0.01
598	600369	西南证券	18,332	65,628.56	0.01
599	001308	康冠科技	2,900	65,250.00	0.01
600	002171	楚江新材	9,896	65,214.64	0.01
601	603112	华翔股份	6,200	65,162.00	0.01

602	300824	北鼎股份	8,900	64,525.00	0.01
603	600618	氯碱化工	7,332	64,374.96	0.01
604	002837	英维克	3,000	64,170.00	0.01
605	002516	旷达科技	17,621	64,140.44	0.01
606	601319	中国人保	12,341	63,556.15	0.01
607	002884	凌霄泵业	3,300	63,360.00	0.01
608	600742	一汽富维	8,500	63,325.00	0.01
609	600662	外服控股	15,685	62,896.85	0.01
610	603032	德新科技	5,500	62,865.00	0.01
611	603259	药明康德	1,600	62,704.00	0.01
612	688630	芯碁微装	1,000	62,570.00	0.01
613	600486	扬农化工	1,100	62,095.00	0.01
614	603298	杭叉集团	3,160	62,062.40	0.01
615	301061	匠心家居	1,310	61,517.60	0.01
616	600757	长江传媒	7,600	61,256.00	0.01
617	002782	可立克	5,500	60,940.00	0.01
618	300979	华利集团	1,000	60,850.00	0.01
619	300832	新产业	900	60,696.00	0.01
620	603338	浙江鼎力	1,000	60,420.00	0.01
621	688232	新点软件	3,016	59,475.52	0.01
622	688176	亚虹医药	11,564	59,092.04	0.01
623	600416	湘电股份	5,924	58,884.56	0.01
624	688259	创耀科技	1,463	58,461.48	0.01
625	603997	继峰股份	5,700	58,311.00	0.01
626	603239	浙江仙通	4,200	57,582.00	0.01
627	688680	海优新材	2,000	57,480.00	0.01
628	002555	三七互娱	4,400	57,420.00	0.01
629	603129	春风动力	400	56,936.00	0.01
630	688598	金博股份	2,000	56,600.00	0.01
631	002773	康弘药业	2,600	56,290.00	0.01
632	603505	金石资源	2,000	55,860.00	0.01
633	000915	华特达因	1,839	55,464.24	0.01
634	600129	太极集团	1,900	54,948.00	0.01
635	603877	太平鸟	4,000	54,920.00	0.01
636	300515	三德科技	5,500	54,285.00	0.01
637	002544	普天科技	2,900	54,201.00	0.01
638	600007	中国国贸	2,389	52,462.44	0.01
639	002398	垒知集团	14,100	52,452.00	0.01
640	603579	荣泰健康	3,380	52,254.80	0.01
641	600201	生物股份	7,200	51,912.00	0.01
642	688031	星环科技	1,400	51,394.00	0.01
643	000913	钱江摩托	3,200	50,432.00	0.01
644	603489	八方股份	1,849	49,886.02	0.01

645	300661	圣邦股份	600	49,668.00	0.01
646	600648	外高桥	5,600	49,616.00	0.01
647	600859	王府井	4,197	49,272.78	0.01
648	002441	众业达	6,500	49,270.00	0.01
649	603127	昭衍新药	3,641	48,316.07	0.01
650	002317	众生药业	4,200	48,006.00	0.01
651	600900	长江电力	1,658	47,949.36	0.01
652	300663	科蓝软件	4,843	47,800.41	0.01
653	603708	家家悦	5,800	47,038.00	0.01
654	603258	电魂网络	2,900	46,835.00	0.01
655	688385	复旦微电	1,479	46,411.02	0.01
656	000657	中钨高新	5,074	46,376.36	0.01
657	688981	中芯国际	1,000	46,100.00	0.01
658	688798	艾为电子	800	45,296.00	0.01
659	600817	宇通重工	5,500	45,100.00	0.01
660	300161	华中数控	2,000	44,980.00	0.01
661	300803	指南针	1,200	43,692.00	0.01
662	600998	九州通	8,821	43,046.48	0.01
663	002095	生意宝	3,500	42,840.00	0.01
664	603595	东尼电子	2,063	42,477.17	0.01
665	688082	盛美上海	497	42,001.47	0.01
666	605128	上海沿浦	1,500	41,835.00	0.01
667	002215	诺普信	5,566	41,466.70	0.01
668	600640	国脉文化	3,900	40,365.00	0.01
669	300499	高澜股份	3,700	40,108.00	0.01
670	300887	谱尼测试	5,300	39,220.00	0.01
671	300769	德方纳米	1,343	37,872.60	0.01
672	688551	科威尔	1,200	37,800.00	0.01
673	300759	康龙化成	2,000	37,160.00	0.01
674	600170	上海建工	17,165	36,904.75	0.01
675	000661	长春高新	400	36,708.00	0.01
676	002960	青鸟消防	2,900	36,656.00	0.01
677	002756	永兴材料	1,000	35,780.00	0.01
678	600839	四川长虹	7,953	35,708.97	0.01
679	688032	禾迈股份	298	34,204.44	0.01
680	601890	亚星锚链	4,800	33,840.00	0.01
681	605305	中际联合	1,300	33,527.00	0.01
682	600206	有研新材	3,700	32,930.00	0.01
683	688185	康希诺	800	32,872.00	0.01
684	002866	传艺科技	2,543	32,728.41	0.01
685	002371	北方华创	100	31,989.00	0.01
686	002025	航天电器	677	31,399.26	0.01
687	300820	英杰电气	796	31,314.64	0.01

688	688023	安恒信息	769	30,767.69	0.01
689	605333	沪光股份	1,100	30,635.00	0.01
690	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.01
691	603100	川仪股份	1,300	30,563.00	0.01
692	603299	苏盐井神	3,200	30,400.00	0.01
693	688787	海天瑞声	551	30,238.88	0.01
694	603529	爱玛科技	1,100	30,063.00	0.01
695	600586	金晶科技	5,100	29,580.00	0.01
696	002600	领益智造	4,088	29,106.56	0.01
697	300666	江丰电子	600	28,536.00	0.01
698	300783	三只松鼠	1,300	28,431.00	0.01
699	688778	厦钨新能	900	28,116.00	0.01
700	688665	四方光电	1,000	27,740.00	0.01
701	002996	顺博合金	4,740	27,729.00	0.01
702	603690	至纯科技	1,200	27,612.00	0.01
703	688733	壹石通	1,800	26,910.00	0.01
704	688596	正帆科技	800	26,400.00	0.00
705	688525	佰维存储	400	25,660.00	0.00
706	300773	拉卡拉	2,000	24,860.00	0.00
707	300504	天邑股份	2,000	24,380.00	0.00
708	002212	天融信	5,000	24,350.00	0.00
709	000902	新洋丰	2,043	24,250.41	0.00
710	600814	杭州解百	4,100	24,190.00	0.00
711	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
712	603738	泰晶科技	1,700	23,188.00	0.00
713	000503	国新健康	3,400	22,678.00	0.00
714	002925	盈趣科技	1,773	22,463.91	0.00
715	603195	公牛集团	290	22,364.80	0.00
716	300451	创业慧康	6,400	22,144.00	0.00
717	001236	弘业期货	3,100	22,041.00	0.00
718	603040	新坐标	1,100	21,923.00	0.00
719	688012	中微公司	155	21,895.30	0.00
720	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
721	600639	浦东金桥	2,100	21,441.00	0.00
722	605111	新洁能	700	21,413.00	0.00
723	688158	优刻得	2,087	21,350.01	0.00
724	688728	格科微	1,700	20,587.00	0.00
725	002957	科瑞技术	1,500	20,340.00	0.00
726	601698	中国卫通	1,400	19,726.00	0.00
727	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
728	300745	欣锐科技	1,343	19,419.78	0.00
729	000651	格力电器	493	19,335.46	0.00
730	300559	佳发教育	2,000	19,140.00	0.00

731	603158	腾龙股份	2,700	19,008.00	0.00
732	300595	欧普康视	1,200	18,816.00	0.00
733	000401	冀东水泥	4,500	18,270.00	0.00
734	601006	大秦铁路	2,500	17,900.00	0.00
735	688037	芯源微	200	17,800.00	0.00
736	603191	望变电气	1,200	17,760.00	0.00
737	600835	上海机电	1,500	17,265.00	0.00
738	300568	星源材质	2,100	17,220.00	0.00
739	000058	深赛格	3,200	17,184.00	0.00
740	601919	中远海控	1,108	17,162.92	0.00
741	601186	中国铁建	1,967	16,857.19	0.00
742	603138	海量数据	1,600	16,768.00	0.00
743	002373	千方科技	1,847	16,752.29	0.00
744	605007	五洲特纸	1,289	16,280.07	0.00
745	300662	科锐国际	1,000	16,130.00	0.00
746	688560	明冠新材	1,504	16,017.60	0.00
747	603225	新凤鸣	1,024	15,964.16	0.00
748	000601	韶能股份	4,300	15,867.00	0.00
749	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
750	605222	起帆电缆	1,000	15,340.00	0.00
751	002446	盛路通信	2,700	15,255.00	0.00
752	300049	福瑞股份	300	15,102.00	0.00
753	002897	意华股份	400	15,064.00	0.00
754	600536	中国软件	500	14,960.00	0.00
755	002396	星网锐捷	1,088	14,372.48	0.00
756	600787	中储股份	2,981	14,338.61	0.00
757	002533	金杯电工	1,428	14,208.60	0.00
758	603217	元利科技	1,000	14,100.00	0.00
759	002653	海思科	459	14,091.30	0.00
760	002481	双塔食品	3,600	13,932.00	0.00
761	600528	中铁工业	1,900	13,908.00	0.00
762	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
763	300707	威唐工业	1,100	13,618.00	0.00
764	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
765	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
766	601155	新城控股	1,500	13,305.00	0.00
767	000539	粤电力A	2,500	12,700.00	0.00
768	688177	百奥泰	600	12,672.00	0.00
769	300193	佳士科技	1,700	12,614.00	0.00
770	603966	法兰泰克	1,800	12,366.00	0.00
771	002408	齐翔腾达	2,200	12,320.00	0.00
772	300682	朗新集团	1,426	12,135.26	0.00
773	300571	平治信息	574	12,019.56	0.00



774	002467	二六三	3,547	11,846.98	0.00
775	601137	博威合金	774	11,795.76	0.00
776	000623	吉林敖东	860	11,524.00	0.00
777	601886	江河集团	2,326	11,350.88	0.00
778	300113	顺网科技	1,100	11,264.00	0.00
779	300118	东方日升	929	11,240.90	0.00
780	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
781	300696	爱乐达	627	11,129.25	0.00
782	001269	欧晶科技	400	11,120.00	0.00
783	688776	国光电气	200	11,080.00	0.00
784	000848	承德露露	1,404	11,035.44	0.00
785	000723	美锦能源	2,243	10,676.68	0.00
786	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
787	000893	亚钾国际	634	10,245.44	0.00
788	000538	云南白药	200	10,230.00	0.00
789	002645	华宏科技	1,600	10,176.00	0.00
790	600741	华域汽车	609	9,975.42	0.00
791	000998	隆平高科	1,000	9,830.00	0.00
792	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
793	603590	康辰药业	382	9,756.28	0.00
794	000727	冠捷科技	4,686	9,653.16	0.00
795	300439	美康生物	1,021	9,352.36	0.00
796	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
797	300146	汤臣倍健	666	9,024.30	0.00
798	002803	吉宏股份	800	8,904.00	0.00
799	000560	我爱我家	4,000	8,880.00	0.00
800	300925	法本信息	876	8,838.84	0.00
801	002534	西子洁能	873	8,738.73	0.00
802	601377	兴业证券	1,707	8,637.42	0.00
803	688599	天合光能	508	8,595.36	0.00
804	605339	南侨食品	600	8,532.00	0.00
805	300398	飞凯材料	691	8,499.30	0.00
806	603983	丸美股份	300	8,259.00	0.00
807	000928	中钢国际	1,485	8,241.75	0.00
808	601811	新华文轩	567	7,943.67	0.00
809	600619	海立股份	1,500	7,755.00	0.00
810	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
811	601126	四方股份	401	7,707.22	0.00
812	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
813	600216	浙江医药	692	7,598.16	0.00
814	002993	奥海科技	200	7,440.00	0.00
815	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
816	000547	航天发展	1,216	7,125.76	0.00

817	688110	东芯股份	361	6,884.27	0.00
818	002245	蔚蓝锂芯	846	6,556.50	0.00
819	603681	永冠新材	500	6,375.00	0.00
820	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
821	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
822	600350	山东高速	660	5,841.00	0.00
823	001227	兰州银行	2,400	5,712.00	0.00
824	002149	西部材料	400	5,584.00	0.00
825	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
826	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
827	603906	龙蟠科技	700	5,453.00	0.00
828	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
829	601390	中国中铁	800	5,216.00	0.00
830	002249	大洋电机	1,066	5,042.18	0.00
831	600959	江苏有线	1,870	4,936.80	0.00
832	600928	西安银行	1,400	4,578.00	0.00
833	600109	国金证券	600	4,530.00	0.00
834	300296	利亚德	1,000	4,500.00	0.00
835	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
836	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
837	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
838	600984	建设机械	1,700	4,046.00	0.00
839	002829	星网宇达	300	4,017.00	0.00
840	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
841	002281	光迅科技	100	3,737.00	0.00
842	300532	今天国际	300	3,687.00	0.00
843	688289	圣湘生物	200	3,516.00	0.00
844	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
845	001205	盛航股份	200	3,232.00	0.00
846	600284	浦东建设	600	3,204.00	0.00
847	600522	中天科技	200	3,170.00	0.00
848	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
849	600008	首创环保	1,143	3,063.24	0.00
850	002073	软控股份	400	2,956.00	0.00
851	600114	东睦股份	200	2,878.00	0.00
852	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
853	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
854	003019	宸展光电	110	2,786.30	0.00
855	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
856	601311	骆驼股份	300	2,406.00	0.00
857	603927	中科软	100	1,809.00	0.00
858	000932	华菱钢铁	377	1,670.11	0.00
859	601398	工商银行	286	1,630.20	0.00

860	300323	华灿光电	321	1,396.35	0.00
861	002611	东方精工	200	1,050.00	0.00
862	600739	辽宁成大	100	837.00	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	13,035,871.00	2.10
2	002422	科伦药业	11,316,710.00	1.82
3	002384	东山精密	11,169,004.00	1.80
4	601058	赛轮轮胎	11,158,827.00	1.80
5	600582	天地科技	10,636,417.00	1.71
6	600566	济川药业	10,494,006.00	1.69
7	300394	天孚通信	10,302,093.98	1.66
8	600096	云天化	10,257,098.00	1.65
9	688188	柏楚电子	9,800,677.24	1.58
10	300724	捷佳伟创	9,307,625.00	1.50
11	601555	东吴证券	9,280,589.00	1.50
12	600066	宇通客车	9,015,701.00	1.45
13	002507	涪陵榨菜	8,667,723.70	1.40
14	002739	万达电影	8,557,710.00	1.38
15	600177	雅戈尔	8,523,021.72	1.37
16	600985	淮北矿业	8,338,496.00	1.34
17	000975	山金国际	8,323,015.00	1.34
18	002555	三七互娱	8,198,194.00	1.32
19	300390	天华新能	8,139,280.30	1.31
20	603160	汇顶科技	7,935,698.00	1.28

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	601233	桐昆股份	11,852,246.46	1.91
2	002422	科伦药业	11,826,947.47	1.91
3	002384	东山精密	11,313,937.50	1.82
4	601555	东吴证券	10,619,313.83	1.71
5	000581	威孚高科	9,179,852.80	1.48
6	600153	建发股份	9,143,671.47	1.47
7	002739	万达电影	9,111,399.13	1.47
8	600497	驰宏锌锗	9,102,372.56	1.47
9	603185	弘元绿能	9,028,139.44	1.45

10	000997	新大陆	9,023,855.55	1.45
11	000039	中集集团	8,854,881.00	1.43
12	600582	天地科技	8,849,998.15	1.43
13	600873	梅花生物	8,691,326.68	1.40
14	002025	航天电器	8,660,935.20	1.40
15	600066	宇通客车	8,591,057.00	1.38
16	002507	涪陵榨菜	8,508,628.89	1.37
17	002223	鱼跃医疗	8,324,567.07	1.34
18	002966	苏州银行	8,275,350.62	1.33
19	002555	三七互娱	8,273,460.00	1.33
20	601168	西部矿业	8,153,677.10	1.31

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	2,255,642,690.22
卖出股票收入（成交）总额	2,301,277,099.64

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和交易成本。

## 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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	668,868.87
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	73,462.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	742,331.43

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
115,600	3,358.54	93,626,018.41	24.12	294,620,975.85	75.88

### 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	95,801.12	0.024675

### 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 2 月 4 日) 基金份额总额	1,407,874,200.24
本报告期期初基金份额总额	415,192,185.69
本报告期基金总申购份额	35,617,723.03
减：本报告期基金总赎回份额	62,562,914.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	388,246,994.26

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

##### 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 (%)	
中信建投证券股份有限公司	2	555,382,380.42	12.19	525,341.90	12.19	-
广发证券股份有限公司	1	495,177,703.00	10.87	468,358.75	10.87	-
长城证券股份有限公司	2	415,083,692.67	9.11	392,608.59	9.11	-
西部证券股份有限公司	2	372,140,781.76	8.17	352,030.46	8.17	-
国投证券股份有限公司	1	318,546,649.24	6.99	301,324.56	6.99	-
国泰君安证券股份有限公司	1	303,224,911.37	6.66	286,828.48	6.66	-
浙商证券股份有限公司	2	259,448,521.18	5.70	245,407.67	5.70	本期报告新增2个

东方证券股份有限公司	1	244,833,601.06	5.37	231,592.09	5.37	-
长江证券股份有限公司	1	231,455,127.79	5.08	218,936.25	5.08	-
招商证券股份有限公司	1	229,361,023.94	5.03	216,957.49	5.03	-
国信证券股份有限公司	2	202,752,459.49	4.45	191,772.15	4.45	-
华创证券有限责任公司	1	183,657,280.53	4.03	173,718.84	4.03	-
中信证券股份有限公司	4	179,479,817.87	3.94	169,776.44	3.94	-
中国国际金融股份有限公司	1	138,700,155.78	3.04	131,204.00	3.04	-
东北证券股份有限公司	1	97,905,445.46	2.15	92,608.49	2.15	-
华金证券股份有限公司	2	96,937,280.94	2.13	91,694.32	2.13	-
东方财富证券股份有限公司	2	64,982,413.97	1.43	61,466.60	1.43	-
方正证券股份有限公司	1	63,246,650.52	1.39	59,826.09	1.39	-
天风证券股份有限公司	1	51,726,789.93	1.14	48,924.18	1.14	-
光大证券股份有限公司	2	45,061,330.20	0.99	42,623.73	0.99	-
汇丰前海证券有限责任公司	1	6,333,393.40	0.14	5,990.76	0.14	-
中泰证券股份有限	1	61,718.80	0.00	58.37	0.00	-



公司						
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近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。

### 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(%)
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	186,242.93	35.53	-	-	-	-

司						
长城证券股份有限公司	337,996.76	64.47	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 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”的养老金客户范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月10日
2	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京增财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	2024年1月19日
3	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
4	景顺长城量化精选股票型证券投资基金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
5	景顺长城基金管理有限公司关于终止华融融达期货股份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	2024年2月8日
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月22日
7	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
8	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
9	景顺长城量化精选股票型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月29日
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	2024年4月13日
11	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
12	景顺长城量化精选股票型证券投资基金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
13	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
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增汇丰银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月29日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国新证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年5月24日
16	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	2024年5月24日

	停机维护的公告	网站	
17	景顺长城量化精选股票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 5 月 25 日
18	景顺长城量化精选股票型证券投资基金 2024 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 25 日
19	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
20	景顺长城量化精选股票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
21	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
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	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

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量化精选股票型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城量化精选股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城量化精选股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城量化精选股票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。

2024 年 8 月 30 日