

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型  
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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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>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	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
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>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金	
基金简称	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数	
场内简称	无	
基金主代码	003318	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 3 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	734,951,274.32 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 行业中性低波动指数 A	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 C
下属分级基金的交易代码	003318	019359
报告期末下属分级基金的份额总额	713,983,058.32 份	20,968,216.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资方式，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	<p>本基金采用被动式指数化投资方法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。</p> <p>当预期成份股发生调整或成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或者因法律法规限制时，或其他原因导致无法有效负责和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，对投资组合管理进行适当性变更和调整，力争降低跟踪误差。在正常情况下，本基金力争相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。</p>
业绩比较基准	95%×中证 500 行业中性低波动指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，通过跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

## 2.3 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳	朱萍
	联系电话	0755-82370388	021-31888888
	电子邮箱	investor@igwfm.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		4008888606	95528
传真		0755-22381339	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		518048	200126
法定代表人		李进	张为忠

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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 行业中性低波动指数 A	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 C
本期已实现收益	-39,728,909.60	-1,512,141.08
本期利润	-63,403,001.67	639,368.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0882	0.0231
本期加权平均净值利润率	-6.72%	1.75%
本期基金份额净值	-6.74%	-6.82%

值增长率		
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	175,494,761.69	5,113,127.24
期末可供分配基金份额利润	0.2458	0.2439
期末基金资产净值	889,477,820.01	26,081,343.24
期末基金份额净值	1.2457	1.2438
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	24.57%	-11.20%

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 行业中性低波动指数 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	-6.44%	0.83%	-7.16%	0.85%	0.72%	-0.02%
过去三个月	-5.31%	1.01%	-6.34%	1.02%	1.03%	-0.01%
过去六个月	-6.74%	1.43%	-7.82%	1.45%	1.08%	-0.02%
过去一年	-10.99%	1.10%	-12.70%	1.12%	1.71%	-0.02%
过去三年	-3.49%	1.04%	-10.24%	1.05%	6.75%	-0.01%

自基金合同生效起 至今	24.57%	1.13%	-2.40%	1.14%	26.97%	-0.01%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

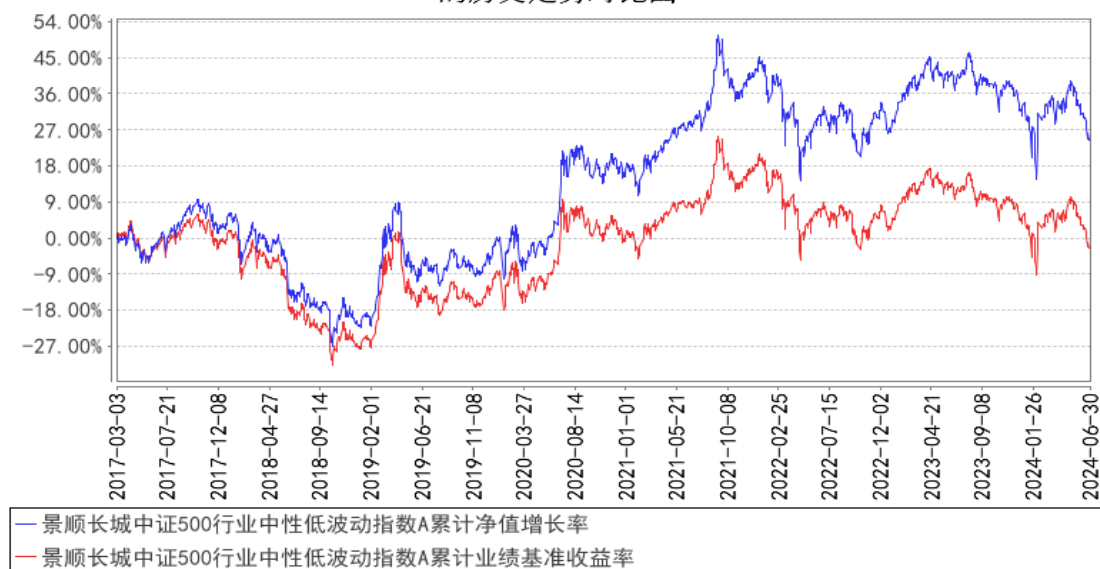
景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 C

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	-6.45%	0.83%	-7.16%	0.85%	0.71%	-0.02%
过去三个月	-5.36%	1.00%	-6.34%	1.02%	0.98%	-0.02%
过去六个月	-6.82%	1.43%	-7.82%	1.45%	1.00%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	-11.20%	1.18%	-12.14%	1.20%	0.94%	-0.02%

注：本基金自 2023 年 9 月 11 日起增设 C 类基金份额，并于 2023 年 9 月 12 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行业中性低波动指数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行业中性低波动指数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：本基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不得低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的建仓期为自 2017 年 3 月 3 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 2023 年 9 月 11 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		
曾理	本基金的基金经理	2019 年 7 月 16 日	-	10 年	工学硕士。曾任腾讯计算机系统有限公司信息安全部产品策略岗。2014 年 8 月加入本公司，担任量化及指数投资部量化程序员，自 2018 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理。具有 10 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遵规守信情况的说明

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 行业中性低波动指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 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 行业中性低波动指数 A 类份额净值增长率为-6.74%，业绩比较基准收益率为-7.82%。

2024 年上半年，景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 C 类份额净值增长率为-6.82%，业绩比较基准收益率为-7.82%。

#### 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。

本基金采用完全复制中证 500 行业中性低波动指数的方法进行组合管理，严格按照最小化跟踪偏离的策略，力争使基金收益和指数收益一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况，根据指数成份股及其权重变化定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现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

本报告期内，由景顺长城基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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 行业中性低波动指数型证券投资基金

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	70,118,337.57	62,987,929.01
结算备付金		4,269,359.51	453,828.95
存出保证金		86,798.64	18,738.23
交易性金融资产	6.4.7.2	842,701,690.37	906,287,655.83
其中：股票投资		842,701,690.37	906,287,655.83
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	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		-	150,173.55
应收股利		-	-

应收申购款		794,381.26	765,342.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	687.06
资产总计		917,970,567.35	970,664,354.96
<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		4.40	-
应付赎回款		1,127,780.13	1,374,823.12
应付管理人报酬		387,158.96	413,434.99
应付托管费		77,431.77	82,687.02
应付销售服务费		4,445.22	687.61
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	40.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	814,583.62	930,804.57
负债合计		2,411,404.10	2,802,477.99
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	734,951,274.32	724,602,314.63
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	180,607,888.93	243,259,562.34
净资产合计		915,559,163.25	967,861,876.97
负债和净资产总计		917,970,567.35	970,664,354.96

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 734,951,274.32 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 1.2457 元，基金份额 713,983,058.32 份；本基金 C 类份额净值人民币 1.2438 元，基金份额 20,968,216.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金

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>		-59,589,629.48	104,922,513.95
1. 利息收入		154,039.59	1,495,204.93
其中：存款利息收入	6.4.7.13	153,669.12	118,792.13

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		370.47	1,376,412.80
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-38,312,925.92	34,361,019.29
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-50,622,557.26	21,319,704.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
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	1,615,411.72	-
股利收益	6.4.7.19	10,694,219.62	13,041,315.20
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	-21,522,582.44	68,988,246.50
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	91,839.29	78,043.23
<b>减：二、营业总支出</b>		3,174,003.64	3,270,907.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,437,157.10	2,545,409.33
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	487,431.38	509,081.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	35,055.95	-
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		6,643.09	4,955.48
8. 其他费用	6.4.7.23	207,716.12	211,460.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-62,763,633.12	101,651,606.81
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-62,763,633.12	101,651,606.81
<b>五、其他综合收益的税后</b>		-	-

净额			
六、综合收益总额		-62,763,633.12	101,651,606.81

### 6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金

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	724,602,314.63	-	243,259,562.34	967,861,876.97
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	724,602,314.63	-	243,259,562.34	967,861,876.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,348,959.69	-	-62,651,673.41	-52,302,713.72
（一）、综合收益总额	-	-	-62,763,633.12	-62,763,633.12
（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）	10,348,959.69	-	111,959.71	10,460,919.40
其中：1. 基金申购款	220,436,630.70	-	66,595,566.66	287,032,197.36
2. 基金赎回款	-210,087,671.01	-	-66,483,606.95	-276,571,277.96
（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	734,951,274.32	-	180,607,888.93	915,559,163.25



资产	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	788,739,292.34	-	212,723,834.52	1,001,463,126.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	788,739,292.34	-	212,723,834.52	1,001,463,126.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-81,796,629.20	-	69,718,774.13	-12,077,855.07
（一）、综合收益总额	-	-	101,651,606.81	101,651,606.81
（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）	-81,796,629.20	-	-31,932,832.68	-113,729,461.88
其中：1. 基金申购款	53,445,864.98	-	20,892,601.36	74,338,466.34
2. 基金赎回款	-135,242,494.18	-	-52,825,434.04	-188,067,928.22
（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	706,942,663.14	-	282,442,608.65	989,385,271.79

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 行业中性低波动指数型证券投资基金（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[2016]1781 号文《关于准予景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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 行业中性低波动指数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 2017 年 3 月 3 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 200,182,368.91 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 67,894.80 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 200,250,263.71 元，折合 200,250,263.71 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金基金合同》和《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金招募说明书》的约定，经与基金托管人上海浦东发展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 2023 年 9 月 11 日起对景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数成份股及其备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于国内依法上市的非成份股（包含创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、银行存款、同业存单、债券、债券回购、权证、股指期货、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具以及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。

本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不得低于基金资产的 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 行业中性低波动指数收益率×95%+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	70,118,337.57
等于：本金	70,112,255.93
加：应计利息	6,081.64
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	70,118,337.57

#### 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	944,264,541.87	-	842,701,690.37	-101,562,851.50
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	944,264,541.87	-	842,701,690.37	-101,562,851.50

#### 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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 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	1,636.09
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	658,521.39
其中：交易所市场	658,521.39
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,426.14
应付指数使用费	50,000.00
合计	814,583.62

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 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	721,357,224.72	721,357,224.72
本期申购	93,032,889.32	93,032,889.32
本期赎回 (以“-”号填列)	-100,407,055.72	-100,407,055.72
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	713,983,058.32	713,983,058.32

## 景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 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	3,245,089.91	3,245,089.91
本期申购	127,403,741.38	127,403,741.38
本期赎回 (以“-”号填列)	-109,680,615.29	-109,680,615.29
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	20,968,216.00	20,968,216.00

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 行业中性低波动指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	407,782,242.71	-165,609,146.11	242,173,096.60
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	407,782,242.71	-165,609,146.11	242,173,096.60
本期利润	-39,728,909.60	-23,674,092.07	-63,403,001.67
本期基金份额交易产生的变动数	-4,446,349.46	1,171,016.22	-3,275,333.24
其中：基金申购款	51,135,124.58	-22,717,225.75	28,417,898.83
基金赎回款	-55,581,474.04	23,888,241.97	-31,693,232.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	363,606,983.65	-188,112,221.96	175,494,761.69



## 景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,831,324.15	-744,858.41	1,086,465.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,831,324.15	-744,858.41	1,086,465.74
本期利润	-1,512,141.08	2,151,509.63	639,368.55
本期基金份额交易产生的变动数	10,316,351.92	-6,929,058.97	3,387,292.95
其中：基金申购款	71,539,079.14	-33,361,411.31	38,177,667.83
基金赎回款	-61,222,727.22	26,432,352.34	-34,790,374.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,635,534.99	-5,522,407.75	5,113,127.24

## 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	115,015.27
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	38,203.80
其他	450.05
合计	153,669.12

## 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	-50,622,557.26
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	-50,622,557.26

## 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	481,463,038.69
减：卖出股票成本总额	530,866,119.01

减：交易费用	1,219,476.94
买卖股票差价收入	-50,622,557.26

#### 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

无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

#### 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	1,615,411.72

#### 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	10,694,219.62
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	10,694,219.62

#### 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	-21,522,582.44
股票投资	-21,522,582.44
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-21,522,582.44

#### 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	90,970.60
基金转换费收入	868.69
合计	91,839.29

#### 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	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,289.98
指数使用费	100,000.00
合计	207,716.12

## 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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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	110,496,149.74	11.40	-	-

#### 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	104,517.45	11.40	6,284.58	0.95
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	-	-	-	-

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	2,437,157.10	2,545,409.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	953,474.22	1,053,382.76
应支付基金管理人的净管理费	1,483,682.88	1,492,026.57

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	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	487,431.38	509,081.84

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

##### 6.4.10.2.3 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 行业中性低波动指数 A	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 C	合计

景顺长城基金管理有限公司	-	21,521.46	21,521.46
浦发银行	-	-	-
长城证券	-	-	-
合计	-	21,521.46	21,521.46

注：(1) 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 0.20% 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：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.20%/当年天数。

(2) 自 2023 年 9 月 11 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原有基金份额转为 A 类基金份额。

#### 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自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自有资金投资本基金。

##### 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
浦发银行-活期	70,118,337.57	115,015.27	68,497,218.67	114,288.61

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金因指数投资而持有的股东长城证券的证券持仓数量为 939,000 股，期末账面价值为人民币 6,291,300.00 元，占净资产的比例为 0.69%。（于 2023 年 12 月 31 日，本基金因指数投资而持有的股东长城证券的证券持仓数量为 835,100 股，期末账面价值为人民币 6,680,800.00 元，占净资产的比例为 0.69%。）

#### 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	2024年5月	6个月	新股流通	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-

	真空	28 日		受限						
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	-
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	-
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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：同）。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式

借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	70,118,337.57	-	-	-	-	-	70,118,337.57
结算备付金	4,269,359.51	-	-	-	-	-	4,269,359.51
存出保证金	86,798.64	-	-	-	-	-	86,798.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-842,701,690.37	842,701,690.37
应收申购款	-	-	-	-	-	794,381.26	794,381.26

资产总计	74,474,495.72	-	-	-	-	-843,496,071.63	917,970,567.35
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,127,780.13	1,127,780.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	387,158.96	387,158.96
应付托管费	-	-	-	-	-	77,431.77	77,431.77
应付清算款	-	-	-	-	-	4.40	4.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,445.22	4,445.22
其他负债	-	-	-	-	-	814,583.62	814,583.62
负债总计	-	-	-	-	-	2,411,404.10	2,411,404.10
利率敏感度缺口	74,474,495.72	-	-	-	-	-	-
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	62,987,929.01	-	-	-	-	-	62,987,929.01
结算备付金	453,828.95	-	-	-	-	-	453,828.95
存出保证金	18,738.23	-	-	-	-	-	18,738.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-906,287,655.83	906,287,655.83
应收申购款	-	-	-	-	-	765,342.33	765,342.33
应收清算款	-	-	-	-	-	150,173.55	150,173.55
其他资产	-	-	-	-	-	687.06	687.06
资产总计	63,460,496.19	-	-	-	-	-907,203,858.77	970,664,354.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,374,823.12	1,374,823.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	413,434.99	413,434.99
应付托管费	-	-	-	-	-	82,687.02	82,687.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-	687.61	687.61
应交税费	-	-	-	-	-	40.68	40.68
其他负债	-	-	-	-	-	930,804.57	930,804.57
负债总计	-	-	-	-	-	2,802,477.99	2,802,477.99
利率敏感度缺口	63,460,496.19	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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	842,701,690.37	92.04	906,287,655.83	93.64
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	842,701,690.37	92.04	906,287,655.83	93.64

#### 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%	58,034,232.41	29,100,716.84
	沪深 300 指数下降 5%	-58,034,232.41	-29,100,716.84

#### 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	842,450,743.67	905,183,327.69
第二层次	55,385.83	25,058.16
第三层次	195,560.87	1,079,269.98
合计	842,701,690.37	906,287,655.83

##### 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	842,701,690.37	91.80
	其中：股票	842,701,690.37	91.80
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	74,387,697.08	8.10
8	其他各项资产	881,179.90	0.10
9	合计	917,970,567.35	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	5,697,488.36	0.62
B	采矿业	31,346,161.00	3.42
C	制造业	519,306,301.23	56.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,951,588.00	4.36
E	建筑业	12,543,557.90	1.37
F	批发和零售业	40,638,007.20	4.44
G	交通运输、仓储和邮政业	19,972,178.00	2.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,120,504.33	5.80
J	金融业	84,697,936.39	9.25
K	房地产业	9,169,860.62	1.00
L	租赁和商务服务业	7,266,432.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,669,602.00	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	14,065,032.86	1.54
S	综合	-	-
	合计	842,444,649.89	92.01



## 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	210,059.46	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,981.02	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	257,040.48	0.03

## 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	688538	和辉光电	4,759,814	9,424,431.72	1.03
2	688387	信科移动	1,825,800	9,202,032.00	1.01
3	002128	电投能源	432,000	9,115,200.00	1.00
4	600131	国网信通	509,300	8,591,891.00	0.94
5	600925	苏能股份	1,687,900	8,523,895.00	0.93
6	002508	老板电器	379,300	8,382,530.00	0.92

7	603712	七一二	447,300	8,136,387.00	0.89
8	002185	华天科技	957,088	7,800,267.20	0.85
9	603816	顾家家居	240,900	7,778,661.00	0.85
10	002203	海亮股份	966,300	7,711,074.00	0.84
11	600497	驰宏锌锗	1,419,900	7,582,266.00	0.83
12	002532	天山铝业	926,600	7,514,726.00	0.82
13	605358	立昂微	322,344	7,459,040.16	0.81
14	600549	厦门钨业	430,400	7,424,400.00	0.81
15	000878	云南铜业	594,500	7,407,470.00	0.81
16	600352	浙江龙盛	858,900	7,377,951.00	0.81
17	002958	青农商行	2,738,100	7,338,108.00	0.80
18	603160	汇顶科技	106,600	7,328,750.00	0.80
19	300373	扬杰科技	187,100	7,278,190.00	0.79
20	002936	郑州银行	4,177,300	7,226,729.00	0.79
21	600157	永泰能源	6,109,300	7,208,974.00	0.79
22	600967	内蒙一机	991,212	7,136,726.40	0.78
23	688220	翱捷科技	190,221	7,125,678.66	0.78
24	000630	铜陵有色	1,957,000	7,064,770.00	0.77
25	600060	海信视像	284,900	7,048,426.00	0.77
26	601997	贵阳银行	1,330,260	7,010,470.20	0.77
27	601866	中远海发	2,716,700	7,009,086.00	0.77
28	002138	顺络电子	250,600	6,881,476.00	0.75
29	688172	燕东微	421,900	6,826,342.00	0.75
30	002202	金风科技	1,014,000	6,814,080.00	0.74
31	601212	白银有色	2,418,400	6,723,152.00	0.73
32	600170	上海建工	3,097,900	6,660,485.00	0.73
33	601990	南京证券	859,500	6,600,960.00	0.72
34	000623	吉林敖东	481,920	6,457,728.00	0.71
35	600177	雅戈尔	906,800	6,456,416.00	0.71
36	000050	深天马 A	883,900	6,434,792.00	0.70
37	601216	君正集团	1,733,600	6,396,984.00	0.70
38	600038	中直股份	155,600	6,396,716.00	0.70
39	002028	思源电气	95,100	6,362,190.00	0.69
40	601179	中国西电	790,600	6,356,424.00	0.69
41	600959	江苏有线	2,406,876	6,354,152.64	0.69
42	000738	航发控制	314,184	6,305,672.88	0.69
43	002939	长城证券	939,000	6,291,300.00	0.69
44	002223	鱼跃医疗	166,300	6,252,880.00	0.68
45	600517	国网英大	1,441,093	6,239,932.69	0.68
46	601231	环旭电子	387,300	6,216,165.00	0.68
47	600298	安琪酵母	221,411	6,184,009.23	0.68
48	002595	豪迈科技	161,265	6,155,485.05	0.67
49	600871	石化油服	3,520,000	6,124,800.00	0.67

50	000563	陕国投 A	2,206,418	6,067,649.50	0.66
51	603858	步长制药	400,300	6,064,545.00	0.66
52	000728	国元证券	997,600	6,045,456.00	0.66
53	000559	万向钱潮	1,343,171	5,990,542.66	0.65
54	002152	广电运通	571,300	5,975,798.00	0.65
55	600582	天地科技	855,200	5,892,328.00	0.64
56	600820	隧道股份	900,930	5,883,072.90	0.64
57	002506	协鑫集成	3,030,400	5,878,976.00	0.64
58	000009	中国宝安	682,000	5,865,200.00	0.64
59	688349	三一重能	235,379	5,846,814.36	0.64
60	601568	北元集团	1,572,080	5,832,416.80	0.64
61	000703	恒逸石化	819,100	5,807,419.00	0.63
62	600056	中国医药	573,663	5,805,469.56	0.63
63	000636	风华高科	441,100	5,760,766.00	0.63
64	600909	华安证券	1,365,000	5,746,650.00	0.63
65	600927	永安期货	515,300	5,745,595.00	0.63
66	300296	利亚德	1,271,200	5,720,400.00	0.62
67	601198	东兴证券	718,400	5,718,464.00	0.62
68	601058	赛轮轮胎	407,100	5,699,400.00	0.62
69	600598	北大荒	456,164	5,697,488.36	0.62
70	688425	铁建重工	1,546,900	5,692,592.00	0.62
71	600637	东方明珠	935,361	5,686,994.88	0.62
72	000400	许继电气	164,900	5,674,209.00	0.62
73	002507	涪陵榨菜	462,710	5,668,197.50	0.62
74	601399	国机重装	2,179,000	5,621,820.00	0.61
75	600885	宏发股份	203,020	5,619,593.60	0.61
76	600109	国金证券	744,200	5,618,710.00	0.61
77	002064	华峰化学	780,900	5,599,053.00	0.61
78	000039	中集集团	604,400	5,596,744.00	0.61
79	600879	航天电子	718,000	5,578,860.00	0.61
80	002025	航天电器	120,100	5,570,238.00	0.61
81	600008	首创环保	2,074,300	5,559,124.00	0.61
82	300146	汤臣倍健	405,400	5,493,170.00	0.60
83	600998	九州通	1,100,198	5,368,966.24	0.59
84	600873	梅花生物	532,600	5,336,652.00	0.58
85	603156	养元饮品	249,800	5,313,246.00	0.58
86	002340	格林美	826,200	5,262,894.00	0.57
87	002984	森麒麟	217,600	5,241,984.00	0.57
88	601608	中信重工	1,375,600	5,241,036.00	0.57
89	000513	丽珠集团	140,500	5,228,005.00	0.57
90	300144	宋城演艺	649,600	5,216,288.00	0.57
91	002056	横店东磁	418,000	5,212,460.00	0.57
92	601966	玲珑轮胎	283,700	5,211,569.00	0.57

93	601233	桐昆股份	325,900	5,201,364.00	0.57
94	601567	三星医疗	148,600	5,201,000.00	0.57
95	601106	中国一重	2,245,400	5,186,874.00	0.57
96	601880	辽港股份	4,216,400	5,186,172.00	0.57
97	600529	山东药玻	203,900	5,166,826.00	0.56
98	600271	航天信息	694,900	5,114,464.00	0.56
99	688819	天能股份	212,916	5,080,175.76	0.55
100	600143	金发科技	763,300	5,045,413.00	0.55
101	600521	华海药业	295,600	5,039,980.00	0.55
102	300009	安科生物	588,900	5,029,206.00	0.55
103	603077	和邦生物	3,015,300	4,975,245.00	0.54
104	600499	科达制造	581,200	4,899,516.00	0.54
105	600739	辽宁成大	583,700	4,885,569.00	0.53
106	600380	健康元	429,924	4,802,251.08	0.52
107	002065	东华软件	1,062,000	4,800,240.00	0.52
108	688561	奇安信	201,900	4,768,878.00	0.52
109	603568	伟明环保	226,900	4,669,602.00	0.51
110	601615	明阳智能	494,400	4,667,136.00	0.51
111	600663	陆家嘴	528,191	4,658,644.62	0.51
112	600096	云天化	239,300	4,647,206.00	0.51
113	601098	中南传媒	371,183	4,610,092.86	0.50
114	002078	太阳纸业	329,900	4,602,105.00	0.50
115	300383	光环新网	544,600	4,601,870.00	0.50
116	600486	扬农化工	80,860	4,564,547.00	0.50
117	002195	岩山科技	1,805,600	4,532,056.00	0.50
118	600208	新湖中宝	2,855,200	4,511,216.00	0.49
119	600655	豫园股份	870,300	4,482,045.00	0.49
120	000156	华数传媒	699,550	4,393,174.00	0.48
121	601016	节能风电	1,443,600	4,316,364.00	0.47
122	002268	电科网安	300,547	4,276,783.81	0.47
123	603233	大参林	298,100	4,262,830.00	0.47
124	000883	湖北能源	708,400	4,257,484.00	0.47
125	601019	山东出版	358,600	4,238,652.00	0.46
126	600867	通化东宝	506,326	4,237,948.62	0.46
127	000423	东阿阿胶	66,720	4,176,672.00	0.46
128	000027	深圳能源	570,900	4,167,570.00	0.46
129	601158	重庆水务	851,400	4,086,720.00	0.45
130	601228	广州港	1,333,600	4,067,480.00	0.44
131	600098	广州发展	630,000	4,032,000.00	0.44
132	603883	老百姓	218,790	4,016,984.40	0.44
133	603939	益丰药房	162,700	3,994,285.00	0.44
134	601933	永辉超市	1,585,800	3,932,784.00	0.43
135	000591	太阳能	834,800	3,931,908.00	0.43

136	600516	方大炭素	906,101	3,905,295.31	0.43
137	600704	物产中大	896,100	3,889,074.00	0.42
138	600566	济川药业	122,600	3,887,646.00	0.42
139	000709	河钢股份	1,993,000	3,866,420.00	0.42
140	601992	金隅集团	2,725,600	3,734,072.00	0.41
141	600377	宁沪高速	294,400	3,709,440.00	0.41
142	000785	居然之家	1,526,500	3,709,395.00	0.41
143	600022	山东钢铁	3,027,400	3,693,428.00	0.40
144	600755	厦门国贸	496,100	3,557,037.00	0.39
145	000401	冀东水泥	869,600	3,530,576.00	0.39
146	300054	鼎龙股份	152,100	3,449,628.00	0.38
147	600282	南钢股份	668,200	3,327,636.00	0.36
148	600901	江苏金租	630,240	3,182,712.00	0.35
149	000959	首钢股份	1,078,817	2,934,382.24	0.32
150	000958	电投产融	653,400	2,391,444.00	0.26

### 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	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
2	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
3	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
4	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
5	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
6	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
7	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
8	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
9	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
10	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
11	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
12	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
13	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
14	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
15	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
16	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
17	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
18	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
19	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
20	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
21	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
22	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
23	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
24	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
25	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00

26	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
27	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	688387	信科移动	9,375,247.11	0.97
2	002508	老板电器	9,103,774.00	0.94
3	603816	顾家家居	8,339,602.00	0.86
4	600060	海信视像	7,834,017.00	0.81
5	002936	郑州银行	7,727,664.00	0.80
6	002202	金风科技	7,569,437.00	0.78
7	688172	燕东微	7,561,477.16	0.78
8	002532	天山铝业	7,332,898.00	0.76
9	601212	白银有色	7,059,571.00	0.73
10	688349	三一重能	6,795,863.32	0.70
11	601990	南京证券	6,767,931.00	0.70
12	002138	顺络电子	6,657,016.00	0.69
13	002223	鱼跃医疗	6,580,600.00	0.68
14	600056	中国医药	6,100,289.95	0.63
15	600909	华安证券	6,063,881.00	0.63
16	600927	永安期货	6,006,954.00	0.62
17	603858	步长制药	5,961,438.00	0.62
18	601231	环旭电子	5,943,707.00	0.61
19	600109	国金证券	5,926,351.70	0.61
20	002025	航天电器	5,905,491.00	0.61

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	601665	齐鲁银行	10,886,032.00	1.12
2	600299	安迪苏	9,788,276.50	1.01
3	002673	西部证券	8,973,933.00	0.93
4	002032	苏泊尔	8,768,626.35	0.91
5	002465	海格通信	8,697,085.36	0.90
6	601717	郑煤机	8,506,074.80	0.88
7	002128	电投能源	8,287,555.52	0.86
8	000060	中金岭南	8,124,162.00	0.84
9	000783	长江证券	7,934,519.00	0.82
10	601098	中南传媒	7,797,163.00	0.81

11	688728	格科微	7,579,264.24	0.78
12	300529	健帆生物	7,540,301.72	0.78
13	603355	莱克电气	7,465,750.00	0.77
14	002797	第一创业	7,404,566.58	0.77
15	600985	淮北矿业	7,307,013.00	0.75
16	601108	财通证券	7,220,239.00	0.75
17	600271	航天信息	7,141,879.00	0.74
18	600597	光明乳业	7,002,189.00	0.72
19	600161	天坛生物	6,904,825.00	0.71
20	002399	海普瑞	6,822,754.29	0.70

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	488,802,735.99
卖出股票收入（成交）总额	481,463,038.69

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	86,798.64
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	794,381.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	881,179.90

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	新股流通受限
2	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股流通受限
3	603350	安乃达	21,608.56	0.00	新股流通受限
4	688709	成都华微	19,635.55	0.00	新股流通受限
5	301536	星宸科技	15,521.87	0.00	新股流通受限



7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 行业中性低波动指数 A	64,934	10,995.52	49,417,902.50	6.92	664,565,155.82	93.08
景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 C	2,028	10,339.36	17,659,725.94	84.22	3,308,490.06	15.78
合计	66,962	10,975.65	67,077,628.44	9.13	667,873,645.88	90.87

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 行业中性低波动指数 A	26,619.43	0.003728
	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 C	9.97	0.000048
	合计	26,629.40	0.003623

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 行业中性低波动指数 A	—
	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数 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 行业中性 低波动指数 A	0~10
	景顺长城中证 500 行业中性 低波动指数 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 行业中性低波动 指数 A	景顺长城中证 500 行业中性低波动 指数 C
基金合同生效日 (2017 年 3 月 3 日) 基金份额总额	200,250,263.71	-
本报告期期初基金份 额总额	721,357,224.72	3,245,089.91
本报告期基金总申购 份额	93,032,889.32	127,403,741.38
减：本报告期基金总 赎回份额	100,407,055.72	109,680,615.29
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	713,983,058.32	20,968,216.00

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

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 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 (%)	
国金证券股份有限公司	2	394,978,741.57	40.76	373,598.30	40.76	本期报告新增 2 个
招商证券股份有限公司	2	292,674,832.75	30.20	276,841.45	30.20	-
长城证券股份有限公司	2	110,496,149.74	11.40	104,517.45	11.40	-
开源证券股份有限公司	1	80,977,843.50	8.36	76,594.40	8.36	-
粤开证券股份有限公司	2	73,133,933.29	7.55	69,181.54	7.55	-
中泰证券股份有限公司	1	14,696,347.00	1.52	13,899.68	1.52	-
光大证券股份有限公司	1	2,010,066.70	0.21	1,901.31	0.21	-

信达证券股份有限公司	1	9,424.99	0.00	8.91	0.00	-
中信建投证券股份有限公司	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(%)
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
粤开证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## 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	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金 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
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
5	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
6	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
7	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

8	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华福证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 10 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
13	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金 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
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信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 21 日
15	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
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广发银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 31 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 31 日
18	景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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
19	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
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	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中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《景顺长城中证 500 行业中性低波动指数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