

景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式 指数证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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	48
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	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500 增强策略 ETF
场内简称	500ETF 增强
基金主代码	159610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 13 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	481,568,207.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 1 月 10 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金，在力求有效跟踪标的指数的基础上，通过主动化投资管理，力争获取超越指数表现的投资收益。
投资策略	1、股票投资策略 本基金作为增强型的指数基金，一方面采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数，另一方面采用主动量化模型调整投资组合力求超越标的指数表现。 2、股指期货投资策略 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。 3、股票期权投资策略 本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。 4、存托凭证投资策略 本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，通过定性和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的，以更好地实现投资目标。 5、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。 6、可转换债券投资策略和可交换债券投资策略 基金管理人根据定期公布的宏观和金融数据以及对宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，判断下一阶段的市场走势，分析可转换债券和可交换债券的股性和债性的相对价值。 7、融资及转融通证券出借业务投资策略

	本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	郭明
	联系电话	0755-82370388	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008888606	95588
传真		0755-22381339	(010) 66105798
注册地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		叶才	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,305,082.30
本期利润	21,672,638.03
加权平均基金份额本期利润	0.0367
本期加权平均净值利润率	4.36%
本期基金份额净值增长率	3.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	-64,420,584.66
期末可供分配基金份额利润	-0.1338
期末基金资产净值	421,720,224.54
期末基金份额净值	0.8757
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-12.43%

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。

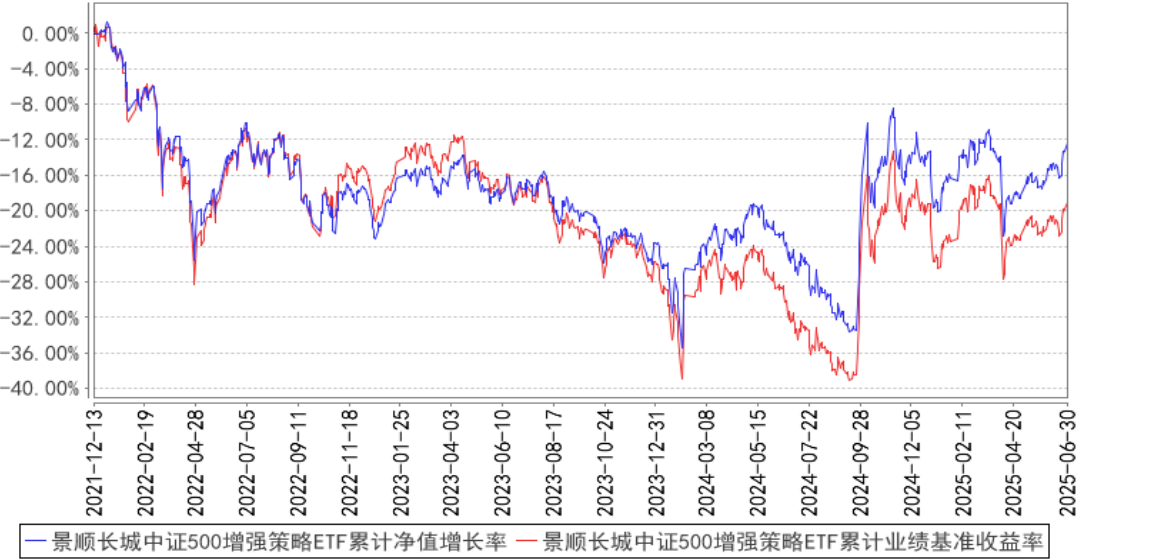
3.2 基金净值表现

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	5.57%	0.75%	4.31%	0.79%	1.26%	-0.04%
过去三个月	2.49%	1.47%	0.98%	1.50%	1.51%	-0.03%
过去六个月	3.82%	1.29%	3.31%	1.36%	0.51%	-0.07%
过去一年	17.29%	1.64%	19.68%	1.72%	-2.39%	-0.08%
过去三年	-1.60%	1.27%	-8.35%	1.35%	6.75%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-12.43%	1.30%	-19.04%	1.39%	6.61%	-0.09%

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增强策略ETF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：基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2021 年 12 月 13 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 2025 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 199 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		
金璜	本基金的基金助理	2024 年 5 月 22 日	-	9 年	工学硕士，CFA。曾任美国 AltfestPersonalWealthManagement（艾福斯特个人财富管理）投资部量化研究员，Morgan Stanley（美国摩根士丹利）风险管理部信用风险分析员。2018 年 7 月加入本公司，历任风险管理部经理、ETF 与创新投资部研究员、ETF 与创新投资部基金经理助理，自 2023 年 9 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 9 年证券、基金行业从业经验。
张晓南	本基金的基金经理	2024 年 5 月 30 日	-	15 年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 15 年证券、基金行业从业经验。
郭琳	本基金的基金经理	2024 年 7 月 20 日	-	11 年	理学硕士。曾任大成国际资产管理有限公司投资研究部高级研究员。2016 年 8 月加入本公司，历任研究部研究员、专户投资部投资经理、研究部基金经理助理，自 2022 年 7 月起担任股票投资部基金经理，现任研究部基金经理。具有 11 年证券、基金行业从业经验。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 5 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的同日反向交易。

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

上半年 A 股市场一波三折：开年第一天大跌后，受到科技板块的带动出现起色，但 4 月再次因美国新一届政府关税政策的影响出现较大下跌，后续则随着关税谈判的进行逐渐企稳回升，最终录得个位数涨幅。主要宽基指数有一定程度分化，宽基指数涨跌幅及排序为：中证 500 (3.31%) > 科创 50 (1.46%) > 沪深 300 (0.03%) > 创业板 50 (-0.43%)。市值维度，总体表现出小盘占优特征，规模指数涨跌幅及排序为：中证 2000 (15.24%) > 中证 1000 (6.69%) > 中证 500 (3.31%) > 沪深 300 (0.03%)。风格维度，中信风格指数涨跌幅及排序为：成长 (7.51%) > 金融 (7.34%) > 周期 (6.57%) > 消费 (1.19%) > 稳定 (-1.06%)。行业维度，中信证券一级行业指数涨跌幅前五为：综合金融 (33.09%) > 有色金属 (18.22%) > 银行 (15.90%) > 传媒 (14.10%) > 国防军工 (13.99%)，后五为：煤炭 (-10.77%) < 房地产 (-5.97%) < 食品饮料 (-5.87%) < 石油石化 (-4.13%) < 交通运输 (-1.33%)。

宏观数据层面，2025 年 6 月工业增加值同比增长 6.8%，前值 5.8%；6 月社会消费品零售总额

同比增长 4.8%，前值 6.4%。通胀指标：6 月 PPI 同比-3.6%，前值-3.3%；6 月 CPI 同比 0.1%，前值-0.1%。货币金融指标：6 月 M2 同比增长 8.3%，前值 7.9%；6 月社会融资规模同比增长 8.9%，前值 8.7%。总体来看，增长斜率保持稳定，继续保持良好的复苏态势，同时通胀仍处在低位区间运行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 3.82%，业绩比较基准收益率为 3.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益市场的长期趋势反映上市公司总体盈利能力的逐步提升，背后的驱动力是经济长期增长动能以及科技升级、产业升级带来的生产力提升。二季度宏观经济整体延续较强韧性，生产端的表现依旧强劲，需求端表现有所分化，出口在关税的冲击扰动下有所回落，消费在以旧换新政策的支持下延续亮眼表现，而投资则在二季度以来逐月降温，房地产重现新一轮下行压力，总体价格则延续低迷表现。在经济数据总体韧性较强的背景下，金融数据表现相对较弱，指向目前经济内生动能仍有待进一步加强。当前中国经济有望在宏观政策加力下进一步复苏，财政政策和货币政策的协同发力将继续为经济提供支撑，内需对经济的拉动作用将更加显著。在经济复苏大背景下，权益市场配置价值凸显。在科技领先但市场仍未确定明显主线时，宽基指数仍是较优选择。

本基金采用指数增强策略进行组合管理，在严格控制跟踪误差和跟踪偏离度的基础上，力争获取相对基准指数的超额收益。在报告期内，本基金结合申购赎回情况、标的指数成分调整情况、投资策略的动态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以及指数增强策略的实施。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,947,661.48	5,569,545.51
结算备付金		2,144,081.54	5,053,825.93
存出保证金		179,311.09	206,150.35
交易性金融资产	6.4.7.2	416,941,451.71	681,281,676.30
其中：股票投资		416,917,550.14	681,281,676.30
基金投资		-	-
债券投资		23,901.57	-
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		3,953,327.11	3,883,661.85
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		427,165,832.93	695,994,859.94
负 债 和 净 资 产			
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,802,719.60	3,613,600.77
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		174,027.48	307,053.57
应付托管费		34,805.51	61,410.73
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,434,055.80	1,559,671.69
负债合计		5,445,608.39	5,541,736.76
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	481,568,207.00	818,568,207.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-59,847,982.46	-128,115,083.82
净资产合计		421,720,224.54	690,453,123.18
负债和净资产总计		427,165,832.93	695,994,859.94

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.8757 元，基金份额总额 481,568,207.00 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		23,326,625.00	-9,780,225.70
1. 利息收入		12,087.58	32,065.76
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,087.58	32,065.76
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）		-833,426.15	7,043,864.36
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,112,100.33	-1,762,612.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	113,353.81	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	4,165,320.37	8,806,476.92
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	23,977,720.33	-16,804,824.74
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	170,243.24	-51,331.08
减：二、营业总支出		1,653,986.97	1,985,725.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,237,310.32	1,509,490.48
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	247,462.08	301,898.07
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		0.33	-
8. 其他费用	6.4.7.23	169,214.24	174,337.25
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		21,672,638.03	-11,765,951.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		21,672,638.03	-11,765,951.50
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		21,672,638.03	-11,765,951.50

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	818,568,207.00	-	-128,115,083.82	690,453,123.18

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	818,568,207.00	-	-128,115,083.82	690,453,123.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-337,000,000.00	-	68,267,101.36	-268,732,898.64
(一)、综合收益总额	-	-	21,672,638.03	21,672,638.03
(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)	-337,000,000.00	-	46,594,463.33	-290,405,536.67
其中：1. 基金申购款	262,000,000.00	-	-41,661,617.22	220,338,382.78
2. 基金赎回款	-599,000,000.00	-	88,256,080.55	-510,743,919.45
(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	481,568,207.00	-	-59,847,982.46	421,720,224.54
项目	上年度可比期间 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	591,568,207.00	-	-139,972,894.62	451,595,312.38
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	591,568,207.00	-	-139,972,894.62	451,595,312.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	344,000,000.00	-	-97,065,551.54	246,934,448.46
(一)、综合收益总额	-	-	-11,765,951.50	-11,765,951.50
(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)	344,000,000.00	-	-85,299,600.04	258,700,399.96
其中：1. 基金申购款	667,000,000.00	-	-164,650,127.27	502,349,872.73
2. 基金赎回款	-323,000,000.00	-	79,350,527.23	-243,649,472.77
(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	935,568,207.00	-	-237,038,446.16	698,529,760.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>康乐</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]3579 号《关于准予景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，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 增强策略交易型开放式指数证

券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式指数基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,499,494,370.00 元（含募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2021）第 1141 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,499,568,207.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 73,837.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2021]第 1362 号文审核同意，本基金 1,499,568,207.00 份基金份额于 2022 年 1 月 10 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是有效跟踪标的指数中证 500 指数的基础上，通过主动化投资管理，力争获取超越指数表现的投资收益。本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证，下同），此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、衍生工具（股指期货、股票期权等）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、公开发行的次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、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）。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不得超过 6.5%。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

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 2025 年 8 月 27 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、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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 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）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征增值税试点的通知》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附加。

（2）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[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。

（3）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，（如有）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，（如有）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。

（4）印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	3,947,661.48
等于：本金	3,947,289.60
加：应计利息	371.88
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	-
存款期限 3 个月（含）至 1 年	-
存款期限 1 年（含）以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,947,661.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		395,998,500.94	-	416,917,550.14	20,919,049.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	23,900.00	1.57	23,901.57	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	23,900.00	1.57	23,901.57	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		396,022,400.94	1.57	416,941,451.71	20,919,049.20

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

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 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	226,675.78
其中：交易所市场	226,675.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	168,603.31
应退替代款	1,038,776.71
合计	1,434,055.80

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	818,568,207.00	818,568,207.00
本期申购	262,000,000.00	262,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-599,000,000.00	-599,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	481,568,207.00	481,568,207.00

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	-107,044,476.59	-21,070,607.23	-128,115,083.82
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-107,044,476.59	-21,070,607.23	-128,115,083.82
本期利润	-2,305,082.30	23,977,720.33	21,672,638.03
本期基金份额交易产生的变动数	44,928,974.23	1,665,489.10	46,594,463.33
其中：基金申购款	-34,769,908.00	-6,891,709.22	-41,661,617.22
基金赎回款	79,698,882.23	8,557,198.32	88,256,080.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-64,420,584.66	4,572,602.20	-59,847,982.46

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,971.96
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	3,666.60
其他	449.02
合计	12,087.58

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,700,240.45
股票投资收益——赎回差价收入	588,140.12

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	-5,112,100.33

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	1,254,926,240.28
减：卖出股票成本总额	1,259,383,076.05
减：交易费用	1,243,404.68
买卖股票差价收入	-5,700,240.45

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	510,743,919.45
减：现金支付赎回款总额	243,593,270.45
减：赎回股票成本总额	266,562,508.88
减：交易费用	-
赎回差价收入	588,140.12

6.4.7.14.4 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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	92.68
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	113,261.13
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	113,353.81

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,083,397.54

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	970,000.00
减：应计利息总额	93.85
减：交易费用	42.56
买卖债券差价收入	113,261.13

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

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,165,320.37
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	4,165,320.37

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	23,977,720.33
股票投资	23,977,720.33
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	23,977,720.33

注：公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	170,243.24
合计	170,243.24

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申赎本基金时，补入（卖出）被替代成分券的实际买入（卖出）成本与申赎确认日估值的差额，或强制退款的被替代成分券在强制退款计算日与申赎确认日估值的差额。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	270.00
IOPV 数据费	9,916.99
注册登记费	74,383.76
存托服务费	340.93
合计	169,214.24

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	252,362,020.51	10.62	-	-

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	49,209.59	10.62	49,209.59	21.71
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-

注：（1）上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

（2）上年度可比期间该类佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

（3）根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，本报告期内被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,237,310.32	1,509,490.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	309,695.96	253,251.70
应支付基金管理人的净管理费	927,614.36	1,256,238.78

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	247,462.08	301,898.07

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

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均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
中国工商银行－活期	3,947,661.48	7,971.96	10,792,580.90	16,887.20

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

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2025 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

001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301275	汉朔科技	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
301458	钧崴电子	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	41.90	77.87	130	5,447.00	10,123.10	-
301479	弘景光电	2025 年 5 月 28 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	-	77.87	52	-	4,049.24	转增股
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股流通受限	39.92	45.22	241	9,620.72	10,898.02	-
301501	恒鑫生活	2025 年 6 月 6 日	1-6 个月(含)	新股流通受限	-	45.22	108	-	4,883.76	转增股
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-

301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025年3月26日	6个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025年4月10日	6个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股流通受限	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301678	新恒汇	2025年6月13日	6个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025年5月12日	6个月	新股流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025年5月27日	6个月	新股流通受限	46.50	42.85	210	9,765.00	8,998.50	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025年4月9日	6个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603202	天	2025	6个月	新股	93.50	90.66	74	6,919.00	6,708.84	-

	有为	年4月16日		流通受限						
603210	泰鸿万立	2025年4月1日	6个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025年3月4日	6个月	新股流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603400	华之杰	2025年6月12日	6个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	汇通控股	2025年2月25日	6个月	新股流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025年1月20日	6个月	新股流通受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688583	思看科技	2025年1月8日	6个月	新股流通受限	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-
688583	思看科技	2025年6月19日	1个月内(含)	新股流通受限	-	79.68	52	-	4,143.36	转增股
688757	胜科纳米	2025年3月18日	6个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025年1月2日	6个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025年6月4日	6个月	新股流通受限	47.27	124.16	370	17,489.90	45,939.20	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券	成功认购	受限期	流通受限	认购价格	期末估值	数量(单)	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	日		类型		单价	位： 张)			
123257	安 克 转 债	2025 年 6 月 16 日	1 个月 内 (含)	新债 未上 市	100.00	100.01	239	23,900.00	23,901.57	-

注：以上限售股的实际流通日期以上市公司的公告为准。

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 2025 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 2025 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，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.01%（上年度末：0.00%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	3,947,661.48	-	-	-	-	-	3,947,661.48
结算备付金	2,144,081.54	-	-	-	-	-	2,144,081.54
存出保证金	179,311.09	-	-	-	-	-	179,311.09
交易性金融资产	-	-	-	-23,901.57	416,917,550.14	416,941,451.71	
应收清算款	-	-	-	-	3,953,327.11	3,953,327.11	
资产总计	6,271,054.11	-	-	-23,901.57	420,870,877.25	427,165,832.93	
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	174,027.48	174,027.48	
应付托管费	-	-	-	-	34,805.51	34,805.51	
应付清算款	-	-	-	-	3,802,719.60	3,802,719.60	
其他负债	-	-	-	-	1,434,055.80	1,434,055.80	
负债总计	-	-	-	-	5,445,608.39	5,445,608.39	
利率敏感度缺口	6,271,054.11	-	-	-23,901.57	-	-	
上年度末 2024 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	5,569,545.51	-	-	-	-	-	5,569,545.51
结算备付金	5,053,825.93	-	-	-	-	-	5,053,825.93
存出保证金	206,150.35	-	-	-	-	-	206,150.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-681,281,676.30	681,281,676.30	
应收清算款	-	-	-	-	3,883,661.85	3,883,661.85	
资产总计	10,829,521.79	-	-	-	-685,165,338.15	695,994,859.94	
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	307,053.57	307,053.57	
应付托管费	-	-	-	-	61,410.73	61,410.73	
应付清算款	-	-	-	-	3,613,600.77	3,613,600.77	
其他负债	-	-	-	-	1,559,671.69	1,559,671.69	
负债总计	-	-	-	-	5,541,736.76	5,541,736.76	
利率敏感度缺口	10,829,521.79	-	-	-	-	-	

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 0.01%（上年度末：0.00%），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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	416,917,550.14	98.86	681,281,676.30	98.67
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	416,917,550.14	98.86	681,281,676.30	98.67

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	24,077,429.40	37,887,038.96
	沪深 300 指数下降 5%	-24,077,429.40	-37,887,038.96

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	416,556,196.58	680,883,736.01
第二层次	23,901.57	27,736.50
第三层次	361,353.56	370,203.79
合计	416,941,451.71	681,281,676.30

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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	416,917,550.14	97.60
	其中：股票	416,917,550.14	97.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,901.57	0.01
	其中：债券	23,901.57	0.01
	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	6,091,743.02	1.43
8	其他各项资产	4,132,638.20	0.97
9	合计	427,165,832.93	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	-	-
B	采矿业	5,472,130.50	1.30
C	制造业	226,053,690.06	53.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,912,691.00	3.30
E	建筑业	3,029,598.00	0.72
F	批发和零售业	14,565,508.00	3.45
G	交通运输、仓储和邮政业	3,388,440.00	0.80
H	住宿和餐饮业	2,558,943.00	0.61
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,554,542.51	7.01
J	金融业	45,081,268.50	10.69
K	房地产业	9,466,924.00	2.24
L	租赁和商务服务业	529,137.00	0.13
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	5,188,776.00	1.23
S	综合	2,011,990.00	0.48
	合计	360,813,638.57	85.56

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	1,561,592.00	0.37
B	采矿业	3,407,392.00	0.81
C	制造业	33,653,006.47	7.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,620,761.00	0.38
E	建筑业	841,500.00	0.20
F	批发和零售业	2,244.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,682,220.00	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,438,698.56	0.82
J	金融业	6,665,944.00	1.58
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	889,149.54	0.21
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	2,341,404.00	0.56
S	综合	-	-
	合计	56,103,911.57	13.30

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	601555	东吴证券	818,984	7,166,110.00	1.70
2	300476	胜宏科技	48,600	6,530,868.00	1.55
3	000783	长江证券	934,000	6,472,620.00	1.53
4	300803	指南针	79,625	6,422,552.50	1.52
5	600549	厦门钨业	292,900	6,127,468.00	1.45
6	000623	吉林敖东	343,930	5,829,613.50	1.38
7	300604	长川科技	126,300	5,672,133.00	1.34
8	600582	天地科技	914,800	5,479,652.00	1.30
9	600132	重庆啤酒	97,600	5,377,760.00	1.28
10	601991	大唐发电	1,695,700	5,375,369.00	1.27
11	000825	太钢不锈	1,474,500	5,293,455.00	1.26
12	603858	步长制药	317,800	5,161,072.00	1.22
13	601568	北元集团	1,239,800	5,145,170.00	1.22
14	600704	物产中大	973,100	5,128,237.00	1.22
15	600959	江苏有线	1,455,400	5,006,576.00	1.19
16	601061	中信金属	628,500	4,971,435.00	1.18
17	002624	完美世界	313,400	4,754,278.00	1.13
18	688213	思特威	45,658	4,667,160.76	1.11
19	600956	新天绿能	604,100	4,663,652.00	1.11
20	688582	芯动联科	65,879	4,427,068.80	1.05
21	003022	联泓新科	275,900	4,367,497.00	1.04
22	600737	中粮糖业	455,100	4,300,695.00	1.02
23	000009	中国宝安	480,700	4,268,616.00	1.01
24	002414	高德红外	410,500	4,207,625.00	1.00
25	600873	梅花生物	375,400	4,013,026.00	0.95
26	600848	上海临港	427,700	3,879,239.00	0.92
27	600685	中船防务	137,300	3,733,187.00	0.89
28	603228	景旺电子	88,900	3,719,576.00	0.88
29	600352	浙江龙盛	365,600	3,714,496.00	0.88
30	000878	云南铜业	289,300	3,679,896.00	0.87
31	300373	扬杰科技	70,900	3,679,710.00	0.87
32	603087	甘李药业	66,900	3,664,782.00	0.87
33	689009	九号公司	58,916	3,486,059.72	0.83
34	000988	华工科技	73,800	3,469,338.00	0.82
35	600498	烽火通信	156,900	3,299,607.00	0.78
36	688002	睿创微纳	47,266	3,295,385.52	0.78
37	002261	拓维信息	106,200	3,286,890.00	0.78
38	002410	广联达	244,800	3,282,768.00	0.78
39	000987	越秀资本	473,200	3,246,152.00	0.77

40	600325	华发股份	665,900	3,242,933.00	0.77
41	000831	中国稀土	88,600	3,200,232.00	0.76
42	601456	国联民生	307,900	3,186,765.00	0.76
43	000893	亚钾国际	103,500	3,119,490.00	0.74
44	600970	中材国际	353,100	3,029,598.00	0.72
45	000959	首钢股份	870,500	2,959,700.00	0.70
46	688235	百济神州	12,576	2,938,256.64	0.70
47	600109	国金证券	334,300	2,931,811.00	0.70
48	600909	华安证券	497,100	2,898,093.00	0.69
49	603893	瑞芯微	18,700	2,839,782.00	0.67
50	600884	杉杉股份	298,700	2,825,702.00	0.67
51	002080	中材科技	144,600	2,819,700.00	0.67
52	301165	锐捷网络	45,000	2,765,700.00	0.66
53	603816	顾家家居	107,700	2,748,504.00	0.65
54	002353	杰瑞股份	75,300	2,635,500.00	0.62
55	300251	光线传媒	129,900	2,633,073.00	0.62
56	688568	中科星图	72,716	2,618,503.16	0.62
57	300765	新诺威	50,600	2,615,514.00	0.62
58	600258	首旅酒店	181,100	2,558,943.00	0.61
59	000021	深科技	136,500	2,558,010.00	0.61
60	688520	神州细胞	42,289	2,530,996.65	0.60
61	688608	恒玄科技	7,259	2,525,986.82	0.60
62	688120	华海清科	14,704	2,480,564.80	0.59
63	300454	深信服	26,300	2,476,934.00	0.59
64	300037	新宙邦	69,500	2,446,400.00	0.58
65	300573	兴齐眼药	45,500	2,356,445.00	0.56
66	600901	江苏金租	388,300	2,353,098.00	0.56
67	601155	新城控股	171,400	2,344,752.00	0.56
68	600131	国网信通	129,600	2,293,920.00	0.54
69	002281	光迅科技	45,800	2,258,856.00	0.54
70	688122	西部超导	43,339	2,248,427.32	0.53
71	600578	京能电力	499,800	2,244,102.00	0.53
72	002294	信立泰	47,300	2,238,709.00	0.53
73	601216	君正集团	401,200	2,214,624.00	0.53
74	000951	中国重汽	123,400	2,169,372.00	0.51
75	605358	立昂微	92,500	2,155,250.00	0.51
76	603565	中谷物流	225,000	2,148,750.00	0.51
77	600764	中国海防	62,900	2,138,600.00	0.51
78	002603	以岭药业	151,200	2,131,920.00	0.51
79	600998	九州通	409,900	2,106,886.00	0.50
80	600563	法拉电子	19,300	2,105,437.00	0.50
81	002850	科达利	18,500	2,093,645.00	0.50
82	000039	中集集团	264,400	2,078,184.00	0.49

83	300136	信维通信	90,800	2,033,920.00	0.48
84	600673	东阳光	173,000	2,011,990.00	0.48
85	688183	生益电子	39,161	2,005,043.20	0.48
86	600988	赤峰黄金	79,500	1,977,960.00	0.47
87	002130	沃尔核材	82,800	1,972,296.00	0.47
88	600348	华阳股份	295,200	1,966,032.00	0.47
89	600298	安琪酵母	55,900	1,966,003.00	0.47
90	002926	华西证券	212,700	1,901,538.00	0.45
91	600392	盛和资源	143,000	1,883,310.00	0.45
92	002837	英维克	63,150	1,876,186.50	0.44
93	600060	海信视像	79,400	1,827,788.00	0.43
94	000729	燕京啤酒	138,500	1,790,805.00	0.42
95	000932	华菱钢铁	406,300	1,787,720.00	0.42
96	002821	凯莱英	19,300	1,703,225.00	0.40
97	002532	天山铝业	204,200	1,696,902.00	0.40
98	300395	菲利华	33,200	1,696,520.00	0.40
99	002595	豪迈科技	28,600	1,693,692.00	0.40
100	002085	万丰奥威	106,500	1,692,285.00	0.40
101	603129	春风动力	7,600	1,645,400.00	0.39
102	601158	重庆水务	351,200	1,629,568.00	0.39
103	600486	扬农化工	26,700	1,548,600.00	0.37
104	002155	湖南黄金	85,610	1,528,138.50	0.36
105	603605	珀莱雅	17,700	1,465,383.00	0.35
106	002670	国盛金控	96,900	1,458,345.00	0.35
107	300763	锦浪科技	25,200	1,446,228.00	0.34
108	600499	科达制造	144,900	1,420,020.00	0.34
109	688772	珠海冠宇	97,933	1,399,462.57	0.33
110	688676	金盘科技	41,187	1,377,705.15	0.33
111	601921	浙版传媒	170,100	1,371,006.00	0.33
112	600398	海澜之家	195,500	1,360,680.00	0.32
113	601231	环旭电子	90,600	1,325,478.00	0.31
114	603379	三美股份	27,200	1,308,864.00	0.31
115	000062	深圳华强	48,500	1,302,710.00	0.31
116	601665	齐鲁银行	204,100	1,289,912.00	0.31
117	000429	粤高速 A	93,000	1,239,690.00	0.29
118	600801	华新水泥	103,400	1,224,256.00	0.29
119	601019	山东出版	125,100	1,184,697.00	0.28
120	688052	纳芯微	6,691	1,167,512.59	0.28
121	001696	宗申动力	51,500	1,156,175.00	0.27
122	603737	三棵树	30,680	1,130,558.00	0.27
123	603338	浙江鼎力	22,900	1,085,460.00	0.26
124	603233	大参林	64,800	1,056,240.00	0.25
125	688114	华大智造	15,789	1,023,600.87	0.24

126	603529	爱玛科技	28,500	980,400.00	0.23
127	002831	裕同科技	38,800	908,696.00	0.22
128	601997	贵阳银行	140,400	876,096.00	0.21
129	001389	广合科技	12,700	746,379.00	0.18
130	600928	西安银行	155,500	609,560.00	0.14
131	000415	渤海租赁	158,900	529,137.00	0.13

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	688347	华虹公司	34,271	1,881,820.61	0.45
2	600732	爱旭股份	143,600	1,881,160.00	0.45
3	600760	中航沈飞	30,200	1,770,324.00	0.42
4	600919	江苏银行	142,200	1,697,868.00	0.40
5	300750	宁德时代	6,700	1,689,874.00	0.40
6	002352	顺丰控股	34,500	1,682,220.00	0.40
7	601208	东材科技	173,200	1,641,936.00	0.39
8	600027	华电国际	296,300	1,620,761.00	0.38
9	600989	宝丰能源	100,300	1,618,842.00	0.38
10	688717	艾罗能源	29,833	1,605,910.39	0.38
11	002959	小熊电器	33,900	1,574,316.00	0.37
12	002946	新乳业	83,500	1,567,295.00	0.37
13	605296	神农集团	50,800	1,561,592.00	0.37
14	601077	渝农商行	213,100	1,521,534.00	0.36
15	601595	上海电影	51,100	1,514,604.00	0.36
16	002311	海大集团	25,700	1,505,763.00	0.36
17	688266	泽璟制药	13,635	1,465,898.85	0.35
18	300740	水羊股份	84,400	1,413,700.00	0.34
19	688025	杰普特	14,106	1,008,579.00	0.24
20	002916	深南电路	8,700	937,947.00	0.22
21	688627	精智达	10,616	934,314.16	0.22
22	688127	蓝特光学	35,551	914,016.21	0.22
23	688365	光云科技	59,873	911,267.06	0.22
24	603993	洛阳钼业	107,700	906,834.00	0.22
25	601336	新华保险	15,500	906,750.00	0.22
26	688390	固德威	20,495	890,507.75	0.21
27	688088	虹软科技	18,382	886,931.50	0.21
28	000534	万泽股份	59,200	883,264.00	0.21
29	300253	卫宁健康	83,300	882,980.00	0.21
30	002967	广电计量	49,100	863,669.00	0.20
31	603986	兆易创新	6,800	860,404.00	0.20
32	601899	紫金矿业	44,100	859,950.00	0.20
33	001301	尚太科技	17,400	848,424.00	0.20
34	601939	建设银行	89,800	847,712.00	0.20

35	601881	中国银河	49,400	847,210.00	0.20
36	601319	中国人保	97,000	844,870.00	0.20
37	601898	中煤能源	77,100	843,474.00	0.20
38	600039	四川路桥	85,000	841,500.00	0.20
39	688332	中科蓝讯	8,111	836,081.88	0.20
40	000708	中信特钢	70,400	827,904.00	0.20
41	600066	宇通客车	33,300	827,838.00	0.20
42	300364	中文在线	31,200	826,800.00	0.20
43	600961	株冶集团	73,900	826,202.00	0.20
44	002980	华盛昌	40,420	815,675.60	0.19
45	301367	瑞迈特	9,600	807,360.00	0.19
46	002128	电投能源	40,300	797,134.00	0.19
47	002364	中恒电气	51,600	791,544.00	0.19
48	603039	泛微网络	13,600	757,520.00	0.18
49	300633	开立医疗	23,300	692,476.00	0.16
50	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
51	688775	影石创新	370	45,939.20	0.01
52	301458	钧崑电子	701	23,911.11	0.01
53	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.01
54	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
55	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
56	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
57	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
58	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
59	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
60	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
61	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
62	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
63	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
64	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
65	603049	中策橡胶	210	8,998.50	0.00
66	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
67	603202	天有为	74	6,708.84	0.00
68	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
69	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
70	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
71	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
72	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
73	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
74	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
75	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
76	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
77	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00

78	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
79	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	300604	长川科技	9,653,573.00	1.40
2	600988	赤峰黄金	9,184,191.00	1.33
3	002056	横店东磁	9,136,970.00	1.32
4	600298	安琪酵母	8,288,997.00	1.20
5	601555	东吴证券	8,203,551.64	1.19
6	600398	海澜之家	8,190,519.00	1.19
7	688617	惠泰医疗	8,029,687.03	1.16
8	601990	南京证券	7,600,628.00	1.10
9	600060	海信视像	7,418,160.00	1.07
10	002624	完美世界	7,286,150.00	1.06
11	300803	指南针	7,151,542.00	1.04
12	605358	立昂微	7,039,460.00	1.02
13	002138	顺络电子	6,851,079.00	0.99
14	600325	华发股份	6,836,340.00	0.99
15	688425	铁建重工	6,583,035.42	0.95
16	601866	中远海发	6,572,333.00	0.95
17	002409	雅克科技	6,339,958.00	0.92
18	600536	中国软件	6,284,065.00	0.91
19	300476	胜宏科技	6,256,036.00	0.91
20	600582	天地科技	6,001,687.00	0.87

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	600143	金发科技	16,501,000.00	2.39
2	600096	云天化	15,590,517.88	2.26
3	601168	西部矿业	14,210,191.00	2.06
4	600008	首创环保	13,201,679.00	1.91
5	600380	健康元	12,508,599.32	1.81
6	601665	齐鲁银行	11,911,289.00	1.73
7	600418	江淮汽车	11,479,506.00	1.66
8	688425	铁建重工	10,832,069.83	1.57
9	601866	中远海发	10,553,182.00	1.53
10	601997	贵阳银行	9,311,548.00	1.35

11	601555	东吴证券	9,265,994.70	1.34
12	600325	华发股份	9,141,057.00	1.32
13	000050	深天马 A	9,046,478.00	1.31
14	002056	横店东磁	8,957,799.00	1.30
15	603979	金诚信	8,751,403.50	1.27
16	002926	华西证券	8,655,554.00	1.25
17	600549	厦门钨业	8,521,554.00	1.23
18	601001	晋控煤业	8,486,167.60	1.23
19	600060	海信视像	8,403,706.00	1.22
20	601933	永辉超市	8,360,011.00	1.21

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,123,255,797.14
卖出股票收入（成交）总额	1,254,926,240.28

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	23,901.57	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	23,901.57	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123257	安克转债	239	23,901.57	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证监会的处罚。

胜宏科技(惠州)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方海关的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内未出现被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	179,311.09
2	应收清算款	3,953,327.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	4,132,638.20
---	----	--------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
7,609	63,289.29	128,532,041.00	26.69	353,036,166.00	73.31

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国人寿保险股份有限公司	76,131,200.00	15.81
2	沈文荣	11,184,217.00	2.32
3	方正证券股份有限公司	5,758,267.00	1.20
4	招商证券股份有限公司	4,514,515.00	0.94
5	江西省拾壹号职业年金计划—光大银行	3,392,400.00	0.70
6	内蒙古自治区捌号职业年金计划—光大银行	3,370,300.00	0.70
7	吴广君	3,008,845.00	0.62
8	邹明刚	3,000,700.00	0.62
9	福建省壹号职业年金计划—工商银行	2,550,900.00	0.53

10	新疆维吾尔自治区柴 号职业年金计划—光 大银行	2,545,700.00	0.53
----	-------------------------------	--------------	------

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

8.3 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	289,200.00	0.060054

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	—
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 12 月 13 日） 基金份额总额	1,499,568,207.00
本报告期期初基金份额总额	818,568,207.00
本报告期基金总申购份额	262,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	599,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	481,568,207.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

1、本基金管理人于 2025 年 4 月 2 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任卫学文先生担任本公司副总经理。

2、本基金管理人于 2025 年 5 月 30 日发布公告，因李进董事长任期届满，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。本基金管理人于 2025 年 8 月 6 日发布公告，经景顺长城基金管理有限公司董事会审议通过，聘任叶才先生担任本公司董事长。本基金管理人于 2025 年 8 月 15 日发布公告，经深圳市市场监督管理局核准，景顺长城基金管理有限公司法定代表人变更为叶才先生。

有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券股份有限公司	4	1,439,048,736.66	60.55	280,609.81	60.55	未变更
东方财富证券股份有限公司	2	276,164,366.32	11.62	53,853.04	11.62	未变更
华泰证券股份有限公司	2	255,285,203.47	10.74	49,790.72	10.74	未变更
长城证券股份有限公司	1	252,362,020.51	10.62	49,209.59	10.62	未变更
中信证券股份有限公司	5	83,089,357.19	3.50	16,203.36	3.50	未变更
中国国际金融股份有限公司	2	68,920,832.77	2.90	13,439.85	2.90	未变更

申万宏源证券有限公司	1	1, 829, 608. 25	0. 08	356. 77	0. 08	未变更
北京证券有限责任公司	2	-	-	-	-	未变更
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东方证券股份有限公司	3	-	-	-	-	未变更
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
高盛（中国）证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国都证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国联民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更

民生证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	未变 更
平安证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	未变 更
太平洋证券 股份有限公 司	1	-	-	-	-	未变 更
天风证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	未变 更
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	未变 更
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
中航证券有 限公司	2	-	-	-	-	未变 更
中泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	未变 更
中信建投证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	未变 更
中银国际证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
中邮证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	未变 更

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合
规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商
进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期 权证 成交总 额的比

						例 (%)
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	992,096.71	91.57	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	91,300.83	8.43	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
北京证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

公司						
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

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	关于不法分子冒用景顺长城基金 APP 及员工名义进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 3 日
2	关于不法分子冒用景顺长城基金 APP 及员工名义进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 3 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 6 日
4	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 22 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 22 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西部证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 1 月 24 日

7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江海证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 6 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 2 月 25 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 19 日
10	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
12	景顺长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 31 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 2 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增甬兴证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 11 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 14 日
16	关于景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 15 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 15 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 22 日
19	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 22 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 4 月 23 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 12 日
22	关于不法分子冒用景顺长城基金及股东方 APP 进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 20 日
23	关于不法分子冒用景顺长城基金及股东方 APP 进行非法活动的澄清公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 20 日
24	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 24 日

25	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 24 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 30 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东莞证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 6 月 9 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20250101-20250223	191,246,300.00	-	115,115,100.00	76,131,200.00	15.81
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险： 1、大额申购风险 在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险： （1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险； （2）如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； （3）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； （4）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动； （5）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略； （6）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。 本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日