

# 景顺长城 ESG 量化股票型证券投资基金 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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

<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	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	62
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</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 .....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城 ESG 量化股票型证券投资基金	
基金简称	景顺长城 ESG 量化股票	
基金主代码	014634	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 6 月 6 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	84,564,078.92 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 ESG 量化股票 A	景顺长城 ESG 量化股票 C
下属分级基金的交易代码	014634	014635
报告期末下属分级基金的份额总额	60,401,060.03 份	24,163,018.89 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过量化模型精选符合 ESG 要求的股票，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金依据定期公布的宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，运用宏观经济模型（MEM）做出对于宏观经济的评价，结合基金合同、投资制度的要求提出资产配置建议，经投资决策委员会审核后形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）ESG 股票的界定</p> <p>ESG 是从环境、社会责任、公司治理等维度对企业进行的综合评价，具体来看 ESG 投资重点关注环境（Environmental）、社会（Social）、公司治理（Governance）等方面。</p> <p>（2）量化投资策略</p> <p>以符合 ESG 要求的股票为投资标的，采用公司自建的量化多因子及 ESG 因子模型进行量化基本面投资。</p> <p>（3）存托凭证投资策略</p> <p>本基金的存托凭证投资将根据本基金的投资目标和上述境内上市交易的股票投资策略，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。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策</p>

	<p>略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。</p> <p>6、股票期权投资策略</p> <p>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。</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。</p> <p>8、参与融资业务的投资策略</p> <p>本基金参与融资业务将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用融资发掘可能的增值机会。</p> <p>9、信用衍生品投资策略</p> <p>本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。</p>
业绩比较基准	沪深 300ESG 基准指数收益率 $\times 90\%$ + 商业银行活期存款利率(税后) $\times 10\%$
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳	任航
	联系电话	0755-82370388	010-66060069
	电子邮箱	investor@igwfm.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008888606	95599
传真		0755-22381339	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		叶才	谷澍

## 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	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	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
和指标	景顺长城 ESG 量化股票 A	景顺长城 ESG 量化股票 C
本期已实现收益	1, 553, 187. 38	540, 465. 81
本期利润	957, 945. 16	326, 268. 51
加权平均基金份 额本期利润	0. 0153	0. 0131
本期加权平均净 值利润率	1. 69%	1. 47%
本期基金份额净 值增长率	1. 79%	1. 50%
3.1.2 期末数据	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
和指标		
期末可供分配利 润	-6, 603, 815. 60	-3, 038, 197. 10
期末可供分配基 金份额利润	-0. 1093	-0. 1257
期末基金资产净 值	56, 246, 357. 89	22, 089, 861. 32
期末基金份额净 值	0. 9312	0. 9142
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	-6. 88%	-8. 58%

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

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

数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

景顺长城 ESG 量化股票 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	2.41%	0.49%	1.36%	0.48%	1.05%	0.01%
过去三个月	1.33%	1.01%	0.07%	0.93%	1.26%	0.08%
过去六个月	1.79%	0.92%	-0.57%	0.88%	2.36%	0.04%
过去一年	11.69%	1.24%	11.20%	1.22%	0.49%	0.02%
过去三年	-10.08%	0.98%	-10.24%	0.98%	0.16%	0.00%
自基金合同生效起至今	-6.88%	0.97%	-2.82%	0.98%	-4.06%	-0.01%

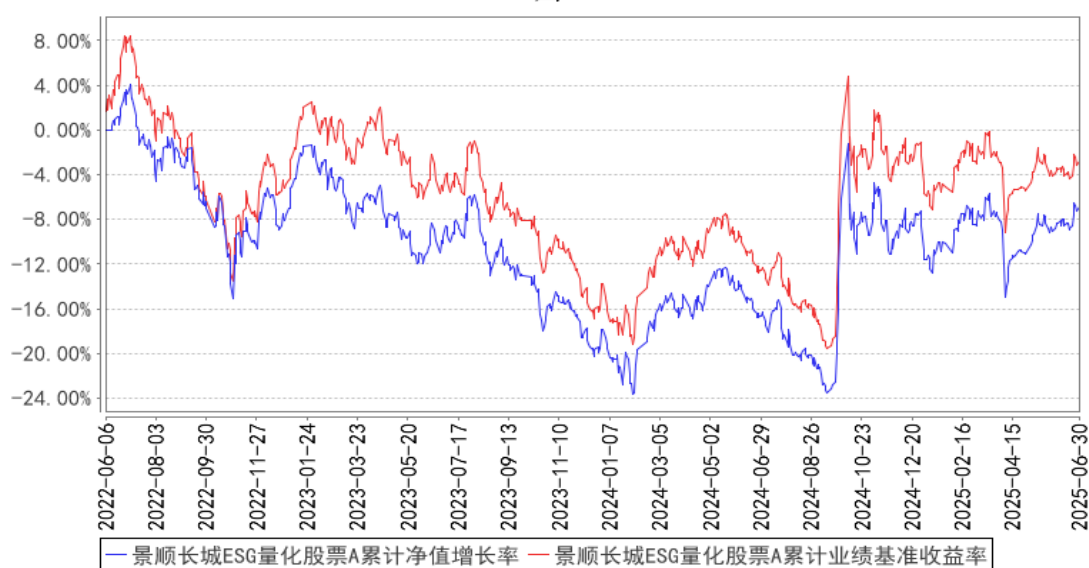
景顺长城 ESG 量化股票 C

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	2.36%	0.49%	1.36%	0.48%	1.00%	0.01%
过去三个月	1.17%	1.01%	0.07%	0.93%	1.10%	0.08%
过去六个月	1.50%	0.92%	-0.57%	0.88%	2.07%	0.04%
过去一年	11.03%	1.24%	11.20%	1.22%	-0.17%	0.02%
过去三年	-11.68%	0.98%	-10.24%	0.98%	-1.44%	0.00%
自基金合同生效起至今	-8.58%	0.97%	-2.82%	0.98%	-5.76%	-0.01%

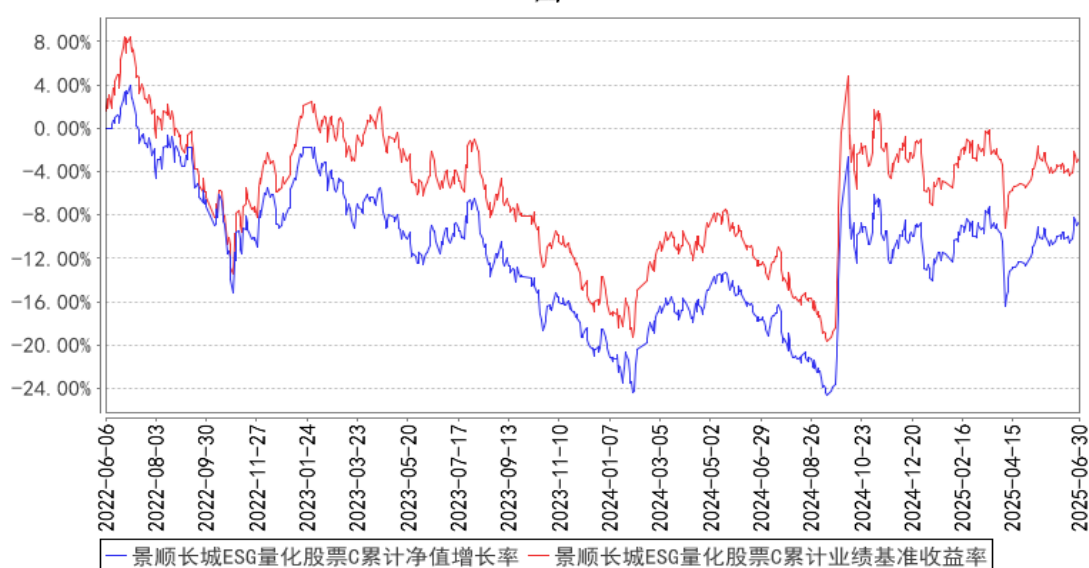


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

景顺长城ESG量化股票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ESG量化股票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：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，投资于 ESG 股票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、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的建仓期为自 2022 年 6 月 6 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		
黎海威	本基金的基金经理	2022年6月6日	—	22年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪KMV公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，自2013年10月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有22年证券、基金行业从业经验。
周春泉	本基金的基金经理	2022年6月6日	—	13年	管理学博士，CFA。曾任海通国际证券集团资产管理部量化分析师、股票衍生品部量化分析师、资产管理部分析师，中泰金融国际有限公司资产管理部副总裁、基金经理。2018年10月加入本公司，担任专户投资部投资经理，自2021年1月起担任量化及指数投资部基金经理。具有13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 ESG 量化股票型证券投资基  
金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，  
在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，  
未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及  
基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少  
的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 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

2025 年上半年，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。从数据来看，4-6

月国内制造业 PMI 依次为 49.0、49.5、49.7，经济景气指数呈现逐步抬升的趋势。今年前 5 个月工业增加值累计同比 6.3%，其中 5 月份工业增加值当月同比增长 5.8%，经济呈现出较强的韧性。5 月 PPI 同比下降 3.3%，环比下降 0.4%；CPI 同比下滑 0.1%，环比下降 0.2%，价格类指数整体偏弱。5 月 M2 同比增长 7.9%，M1 同比增长 2.3%，信贷需求依然较弱；5 月末外汇储备 3.28 万亿美元，人民币汇率维持强势。整体来看，国内经济数据虽然边际有所走弱，但整体依然维持较强的韧性，经济动能的切换提升了权益市场的估值水平。上半年 A 股市场震荡上行，上证综指上涨 2.76%，沪深 300 上涨 0.03%，创业板指上涨 0.53%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 1.79%，业绩比较基准收益率为-0.57%。

本报告期内，本基金 C 类份额净值增长率为 1.50%，业绩比较基准收益率为-0.57%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，外需在抢出口效应退潮后可能会进一步降温回落，内需补贴政策的支持下可能对经济形成一定支撑，海外环境依然面临一定的不确定性。同时随着经济动能的转换，新质生产力相关产业有望迎来快速发展，权益市场依然具有较多结构性的投资机会。个股层面相对充裕的流动性环境，市场层面相对分散的结构化行情，这对于我们量化选股模型是相对有利的。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。

本基金是以 300ESG 为基准的 ESG 主题基金，选股模型综合考虑 ESG 与基本面等传统因素，风格上维持 ESG、价值和成长之间的平衡，同时关注 ESG 绩效领先、现金流良好和内生成长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主，以期产生持续稳定的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信

息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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 ESG 量化股票型证券投资基金

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	7,159,939.86	6,248,305.91
结算备付金		469,702.04	441,766.53
存出保证金		7,146.19	17,796.38
交易性金融资产	6.4.7.2	71,013,822.37	75,984,268.80
其中：股票投资		71,012,583.52	75,984,268.80
基金投资		-	-
债券投资		1,238.85	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		199.85	211.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		78,650,810.31	82,692,349.13
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
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		-	-
应付赎回款		72,588.58	326,886.94
应付管理人报酬		76,688.31	83,996.45
应付托管费		12,781.42	13,999.40
应付销售服务费		10,746.99	11,684.59
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	141,785.80	162,542.98
负债合计		314,591.10	599,110.36
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	84,564,078.92	90,126,809.39
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-6,227,859.71	-8,033,570.62
净资产合计		78,336,219.21	82,093,238.77
负债和净资产总计		78,650,810.31	82,692,349.13

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 84,564,078.92 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 0.9312 元，基金份额 60,401,060.03 份；本基金 C 类份额净值人民币 0.9142 元，基金份额 24,163,018.89 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城 ESG 量化股票型证券投资基金

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		1,959,708.10	2,389,694.83
1. 利息收入		13,540.26	15,632.11
其中：存款利息收入	6.4.7.13	13,540.26	15,632.11
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）		2,754,123.70	592,440.24

其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,806,263.46	-426,862.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	340.05	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
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	947,520.19	1,019,302.71
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	-809,439.52	1,781,140.83
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	1,483.66	481.65
<b>减：二、营业总支出</b>		675,494.43	819,022.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	470,502.78	556,727.44
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	78,417.21	92,787.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	66,218.03	78,304.64
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	60,356.41	91,202.82
<b>三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)</b>		1,284,213.67	1,570,672.08
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		1,284,213.67	1,570,672.08
<b>五、其他综合收益的税后净 额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,284,213.67	1,570,672.08

### 6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城 ESG 量化股票型证券投资基金

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	90,126,809.39	-	-8,033,570.62	82,093,238.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	90,126,809.39	-	-8,033,570.62	82,093,238.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,562,730.47	-	1,805,710.91	-3,757,019.56
(一)、综合收益总额	-	-	1,284,213.67	1,284,213.67
(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)	-5,562,730.47	-	521,497.24	-5,041,233.23
其中：1. 基金申购款	403,293.30	-	-31,626.62	371,666.68
2. 基金赎回款	-5,966,023.77	-	553,123.86	-5,412,899.91
(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	84,564,078.92	-	-6,227,859.71	78,336,219.21
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	125,856,983.94	-	-22,656,788.67	103,200,195.27
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	125,856,983.94	-	-22,656,788.67	103,200,195.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-28,589,937.85	-	6,206,526.74	-22,383,411.11
(一)、综合收益总额	-	-	1,570,672.08	1,570,672.08
(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)	-28,589,937.85	-	4,635,854.66	-23,954,083.19
其中：1. 基金申购款	369,534.98	-	-64,787.55	304,747.43
2. 基金赎回款	-28,959,472.83	-	4,700,642.21	-24,258,830.62
(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	97,267,046.09	-	-16,450,261.93	80,816,784.16

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 ESG 量化股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系根据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]3888 号文《关于准予景顺长城 ESG 量化股票型

证券投资基金注册的批复》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 ESG 量化股票型证券投资基金基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2022 年 6 月 6 日正式生效。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 215,731,603.21 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 79,538.19 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 215,811,141.40 元，折合 215,811,141.40 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《景顺长城 ESG 量化股票型证券投资基金基金合同》和《景顺长城 ESG 量化股票型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取前端认购/申购费用，且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费，而是从本类别基金资产净值中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。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。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（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）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换公司债）、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、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，投资于 ESG 股票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、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300ESG 基准指数收益率×90%+商业银行活期存款利率（税后）×10%。

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	7,159,939.86
等于：本金	7,159,341.70
加：应计利息	598.16
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	7,159,939.86

#### 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		67,867,813.31	-	71,012,583.52	3,144,770.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	900.00	0.36	1,238.85	338.49
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	900.00	0.36	1,238.85	338.49
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		67,868,713.31	0.36	71,013,822.37	3,145,108.70

#### 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 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	87,697.23
其中：交易所市场	87,697.23
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	54,088.57
合计	141,785.80

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

景顺长城 ESG 量化股票 A

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	64,739,077.30	64,739,077.30
本期申购	285,456.86	285,456.86
本期赎回（以“-”号填列）	-4,623,474.13	-4,623,474.13
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	60,401,060.03	60,401,060.03

景顺长城 ESG 量化股票 C

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	25,387,732.09	25,387,732.09
本期申购	117,836.44	117,836.44
本期赎回（以“-”号填列）	-1,342,549.64	-1,342,549.64
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	24,163,018.89	24,163,018.89

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 ESG 量化股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,691,711.22	3,177,068.97	-5,514,642.25
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-8,691,711.22	3,177,068.97	-5,514,642.25
本期利润	1,553,187.38	-595,242.22	957,945.16
本期基金份额交易产生的变动数	534,708.24	-132,713.29	401,994.95
其中：基金申购款	-34,432.10	14,094.58	-20,337.52
基金赎回款	569,140.34	-146,807.87	422,332.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,603,815.60	2,449,113.46	-4,154,702.14

景顺长城 ESG 量化股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,746,692.20	1,227,763.83	-2,518,928.37
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-

本期期初	-3,746,692.20	1,227,763.83	-2,518,928.37
本期利润	540,465.81	-214,197.30	326,268.51
本期基金份额交易产生的变动数	168,029.29	-48,527.00	119,502.29
其中：基金申购款	-16,077.78	4,788.68	-11,289.10
基金赎回款	184,107.07	-53,315.68	130,791.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,038,197.10	965,039.53	-2,073,157.57

#### 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	11,059.58
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	2,465.97
其他	14.71
合计	13,540.26

#### 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	1,806,263.46
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	1,806,263.46

##### 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	167,626,640.54
减：卖出股票成本总额	165,565,732.51
减：交易费用	254,644.57
买卖股票差价收入	1,806,263.46

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	339.36
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	340.05

##### 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	1,339.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,000.00
减：应计利息总额	0.33
减：交易费用	0.05
买卖债券差价收入	339.36

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

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	947,520.19
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	947,520.19

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	-809,439.52
股票投资	-809,778.01
债券投资	338.49
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	-809,439.52

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	849.02
基金转换费收入	634.64
合计	1,483.66

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	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	1,767.52
存托服务费	0.32
合计	60,356.41

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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

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

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股票交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

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
----	----	---------

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	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	470,502.78	556,727.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	225,849.78	263,452.34
应支付基金管理人的净管理费	244,653.00	293,275.10

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	78,417.21	92,787.85

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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 ESG 量化股 票 A	景顺长城 ESG 量化股 票 C	合计
景顺长城基金管理有限公司	-	506.15	506.15
中国农业银行	-	54,121.22	54,121.22
长城证券	-	-	-
合计	-	54,627.37	54,627.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	景顺长城 ESG 量化股 票 A	景顺长城 ESG 量化股 票 C	合计
景顺长城基金管理有限公	-	469.09	469.09

司			
中国农业银行	-	64,063.43	64,063.43
长城证券	-	-	-
合计	-	64,532.52	64,532.52

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60% 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×0.60%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间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
中国农业银行－活期	7,159,939.86	11,059.58	7,411,922.86	11,482.34

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或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

#### 6.4.12 期末（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

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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同责任，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 0.00%（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组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该

上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日内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 个工作日内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，并按照合约规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	7,159,939.86	-	-	-	-	-	7,159,939.86
结算备付金	469,702.04	-	-	-	-	-	469,702.04
存出保证金	7,146.19	-	-	-	-	-	7,146.19
交易性金融资产	-	-	-	-	1,238.85	71,012,583.52	71,013,822.37
应收申购款	-	-	-	-	-	199.85	199.85
资产总计	7,636,788.09	-	-	-	1,238.85	71,012,783.37	78,650,810.31
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	72,588.58	72,588.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	76,688.31	76,688.31
应付托管费	-	-	-	-	-	12,781.42	12,781.42
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,746.99	10,746.99
其他负债	-	-	-	-	-	141,785.80	141,785.80
负债总计	-	-	-	-	-	314,591.10	314,591.10
利率敏感度缺口	7,636,788.09	-	-	-	1,238.85	-	-
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	6,248,305.91	-	-	-	-	-	6,248,305.91
结算备付金	441,766.53	-	-	-	-	-	441,766.53
存出保证金	17,796.38	-	-	-	-	-	17,796.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-	75,984,268.80	75,984,268.80
应收申购款	-	-	-	-	-	211.51	211.51
资产总计	6,707,868.82	-	-	-	-	75,984,480.31	82,692,349.13
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	326,886.94	326,886.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	83,996.45	83,996.45
应付托管费	-	-	-	-	-	13,999.40	13,999.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,684.59	11,684.59
其他负债	-	-	-	-	-	162,542.98	162,542.98
负债总计	-	-	-	-	-	599,110.36	599,110.36
利率敏感度缺口	6,707,868.82	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.00%（上年度末：0.00%），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	71,012,583.52	90.65	75,984,268.80	92.56
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	71,012,583.52	90.65	75,984,268.80	92.56

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%	3,366,928.08	3,605,756.32
	沪深 300 指数下降 5%	-3,366,928.08	-3,605,756.32

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	71,013,822.37	75,876,690.80
第二层次	-	107,578.00
第三层次	-	-
合计	71,013,822.37	75,984,268.80

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	71,012,583.52	90.29
	其中：股票	71,012,583.52	90.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,238.85	0.00
	其中：债券	1,238.85	0.00
	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	7,629,641.90	9.70
8	其他各项资产	7,346.04	0.01
9	合计	78,650,810.31	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	238,442.00	0.30
B	采矿业	2,631,782.80	3.36
C	制造业	39,283,187.12	50.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,678,522.00	4.70
E	建筑业	1,196,301.00	1.53
F	批发和零售业	702,598.00	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	1,608,040.00	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,196,897.00	4.08
J	金融业	16,451,668.80	21.00
K	房地产业	527,856.00	0.67
L	租赁和商务服务业	482,642.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	711,815.80	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	1,275.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	4,413.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	297,143.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	71,012,583.52	90.65

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,200	4,510,464.00	5.76
2	600036	招商银行	69,400	3,188,930.00	4.07
3	300750	宁德时代	12,300	3,102,306.00	3.96
4	600900	长江电力	54,800	1,651,672.00	2.11
5	601166	兴业银行	65,900	1,538,106.00	1.96
6	000333	美的集团	21,300	1,537,860.00	1.96
7	002594	比亚迪	4,100	1,360,831.00	1.74
8	600276	恒瑞医药	23,800	1,235,220.00	1.58
9	601398	工商银行	146,900	1,114,971.00	1.42
10	601211	国泰海通	49,200	942,672.00	1.20
11	601318	中国平安	15,800	876,584.00	1.12
12	000725	京东方 A	211,600	844,284.00	1.08
13	600887	伊利股份	29,900	833,612.00	1.06
14	601328	交通银行	102,000	816,000.00	1.04
15	601668	中国建筑	136,200	785,874.00	1.00
16	600919	江苏银行	62,000	740,280.00	0.95
17	688008	澜起科技	7,900	647,800.00	0.83
18	603259	药明康德	9,000	625,950.00	0.80
19	601899	紫金矿业	31,800	620,100.00	0.79
20	600030	中信证券	22,100	610,402.00	0.78
21	002230	科大讯飞	12,200	584,136.00	0.75
22	000651	格力电器	11,900	534,548.00	0.68
23	002475	立讯精密	15,300	530,757.00	0.68
24	000858	五 粮 液	4,400	523,160.00	0.67
25	000001	平安银行	41,600	502,112.00	0.64
26	600690	海尔智家	20,000	495,600.00	0.63
27	688012	中微公司	2,700	492,210.00	0.63
28	601658	邮储银行	89,200	487,924.00	0.62
29	600000	浦发银行	34,200	474,696.00	0.61
30	601939	建设银行	48,200	455,008.00	0.58
31	601988	中国银行	79,900	449,038.00	0.57
32	002352	顺丰控股	9,000	438,840.00	0.56

33	603993	洛阳钼业	50,600	426,052.00	0.54
34	600660	福耀玻璃	7,300	416,173.00	0.53
35	601600	中国铝业	56,700	399,168.00	0.51
36	600050	中国联通	71,200	380,208.00	0.49
37	601088	中国神华	9,200	372,968.00	0.48
38	300124	汇川技术	5,400	348,678.00	0.45
39	300308	中际旭创	2,340	341,312.40	0.44
40	601766	中国中车	46,900	330,176.00	0.42
41	000538	云南白药	5,900	329,161.00	0.42
42	002415	海康威视	11,700	324,441.00	0.41
43	002142	宁波银行	11,700	320,112.00	0.41
44	601169	北京银行	46,700	318,961.00	0.41
45	601009	南京银行	26,200	304,444.00	0.39
46	600352	浙江龙盛	29,600	300,736.00	0.38
47	601229	上海银行	27,800	294,958.00	0.38
48	300760	迈瑞医疗	1,300	292,175.00	0.37
49	601989	中国重工	62,400	289,536.00	0.37
50	600482	中国动力	12,500	288,375.00	0.37
51	000100	TCL 科技	66,300	287,079.00	0.37
52	688041	海光信息	2,000	282,580.00	0.36
53	600031	三一重工	15,500	278,225.00	0.36
54	300627	华测导航	7,680	268,800.00	0.34
55	600309	万华化学	4,900	265,874.00	0.34
56	601728	中国电信	34,300	265,825.00	0.34
57	601319	中国人保	30,200	263,042.00	0.34
58	601816	京沪高铁	45,200	259,900.00	0.33
59	600803	新奥股份	13,700	258,930.00	0.33
60	601688	华泰证券	14,500	258,245.00	0.33
61	603799	华友钴业	6,900	255,438.00	0.33
62	000157	中联重科	34,000	245,820.00	0.31
63	600885	宏发股份	10,840	241,840.40	0.31
64	600183	生益科技	8,000	241,200.00	0.31
65	688256	寒武纪	400	240,600.00	0.31
66	601919	中远海控	15,900	239,136.00	0.31
67	000039	中集集团	30,000	235,800.00	0.30
68	601991	大唐发电	70,400	223,168.00	0.28
69	600926	杭州银行	12,900	216,978.00	0.28
70	000338	潍柴动力	14,000	215,320.00	0.27
71	000630	铜陵有色	64,300	214,762.00	0.27
72	600938	中国海油	8,100	211,491.00	0.27
73	300274	阳光电源	3,100	210,087.00	0.27
74	000708	中信特钢	17,700	208,152.00	0.27
75	600219	南山铝业	54,200	207,586.00	0.26



76	300661	圣邦股份	2,830	205,939.10	0.26
77	600104	上汽集团	12,800	205,440.00	0.26
78	002466	天齐锂业	6,400	205,056.00	0.26
79	688111	金山办公	700	196,035.00	0.25
80	002001	新 和 成	9,200	195,684.00	0.25
81	601888	中国中免	3,200	195,104.00	0.25
82	600011	华能国际	27,300	194,922.00	0.25
83	601100	恒立液压	2,700	194,400.00	0.25
84	300866	安克创新	1,710	194,256.00	0.25
85	002624	完美世界	12,800	194,176.00	0.25
86	688271	联影医疗	1,500	191,610.00	0.24
87	000999	华润三九	5,989	187,335.92	0.24
88	600196	复星医药	7,400	185,666.00	0.24
89	600188	兖矿能源	15,140	184,253.80	0.24
90	600019	宝钢股份	27,900	183,861.00	0.23
91	600578	京能电力	40,800	183,192.00	0.23
92	002371	北方华创	400	176,884.00	0.23
93	002008	大族激光	7,200	175,464.00	0.22
94	600588	用友网络	13,100	175,147.00	0.22
95	603939	益丰药房	7,100	173,737.00	0.22
96	601818	光大银行	41,700	173,055.00	0.22
97	002340	格林美	27,200	172,720.00	0.22
98	600941	中国移动	1,500	168,825.00	0.22
99	002028	思源电气	2,300	167,693.00	0.21
100	603288	海天味业	4,300	167,313.00	0.21
101	600096	云天化	7,500	164,775.00	0.21
102	600905	三峡能源	38,400	163,584.00	0.21
103	601390	中国中铁	28,900	162,129.00	0.21
104	000776	广发证券	9,500	159,695.00	0.20
105	000063	中兴通讯	4,800	155,952.00	0.20
106	600875	东方电气	9,300	155,682.00	0.20
107	600958	东方证券	15,800	152,944.00	0.20
108	300498	温氏股份	8,800	150,304.00	0.19
109	688981	中芯国际	1,700	149,889.00	0.19
110	603296	华勤技术	1,800	145,224.00	0.19
111	600685	中船防务	5,300	144,107.00	0.18
112	601881	中国银河	8,400	144,060.00	0.18
113	601857	中国石油	16,500	141,075.00	0.18
114	603501	豪威集团	1,100	140,415.00	0.18
115	002202	金风科技	13,500	138,375.00	0.18
116	600018	上港集团	23,700	135,327.00	0.17
117	600025	华能水电	14,100	134,655.00	0.17
118	000938	紫光股份	5,600	134,344.00	0.17

119	603195	公牛集团	2,760	133,170.00	0.17
120	600704	物产中大	25,100	132,277.00	0.17
121	600688	上海石化	46,400	132,240.00	0.17
122	600015	华夏银行	16,700	132,097.00	0.17
123	688169	石头科技	840	131,502.00	0.17
124	601916	浙商银行	38,400	130,176.00	0.17
125	000895	双汇发展	5,300	129,373.00	0.17
126	000792	盐湖股份	7,500	128,100.00	0.16
127	002436	兴森科技	9,600	127,104.00	0.16
128	000568	泸州老窖	1,100	124,740.00	0.16
129	300024	机器人	7,200	123,696.00	0.16
130	300014	亿纬锂能	2,700	123,687.00	0.16
131	000975	山金国际	6,400	121,216.00	0.15
132	603160	汇顶科技	1,700	120,751.00	0.15
133	601099	太平洋	30,700	120,651.00	0.15
134	600795	国电电力	24,800	120,032.00	0.15
135	688185	康希诺	2,000	119,260.00	0.15
136	600886	国投电力	8,000	117,920.00	0.15
137	688220	翱捷科技	1,500	117,450.00	0.15
138	300433	蓝思科技	5,200	115,960.00	0.15
138	603899	晨光股份	4,000	115,960.00	0.15
139	600176	中国巨石	10,000	114,000.00	0.15
140	002532	天山铝业	13,700	113,847.00	0.15
141	601456	国联民生	10,800	111,780.00	0.14
142	600406	国电南瑞	4,900	109,809.00	0.14
143	601168	西部矿业	6,500	108,095.00	0.14
144	002027	分众传媒	14,800	108,040.00	0.14
145	002422	科伦药业	3,000	107,760.00	0.14
146	600115	中国东航	26,200	105,586.00	0.13
147	300182	捷成股份	19,000	104,690.00	0.13
148	601568	北元集团	25,200	104,580.00	0.13
149	001227	兰州银行	41,700	104,250.00	0.13
150	603858	步长制药	6,300	102,312.00	0.13
151	601225	陕西煤业	5,300	101,972.00	0.13
152	000807	云铝股份	6,300	100,674.00	0.13
153	301526	国际复材	27,600	100,464.00	0.13
154	600160	巨化股份	3,500	100,380.00	0.13
155	002463	沪电股份	2,300	97,934.00	0.13
156	600150	中国船舶	3,000	97,620.00	0.12
157	000963	华东医药	2,400	96,864.00	0.12
158	688126	沪硅产业	5,100	95,472.00	0.12
159	300316	晶盛机电	3,500	95,025.00	0.12
160	688172	燕东微	4,800	94,368.00	0.12

161	600732	爱旭股份	7,200	94,320.00	0.12
162	601127	赛力斯	700	94,024.00	0.12
163	003816	中国广核	25,800	93,912.00	0.12
164	000060	中金岭南	20,300	92,974.00	0.12
165	601877	正泰电器	4,100	92,947.00	0.12
166	603019	中科曙光	1,300	91,520.00	0.12
167	600873	梅花生物	8,500	90,865.00	0.12
168	000415	渤海租赁	27,200	90,576.00	0.12
169	000727	冠捷科技	37,000	89,910.00	0.11
170	603179	新泉股份	1,900	89,243.00	0.11
171	600809	山西汾酒	500	88,195.00	0.11
172	002252	上海莱士	12,700	87,249.00	0.11
173	002384	东山精密	2,300	86,871.00	0.11
174	000166	申万宏源	17,300	86,846.00	0.11
175	000878	云南铜业	6,800	86,496.00	0.11
176	600460	士兰微	3,400	84,388.00	0.11
177	002236	大华股份	5,300	84,164.00	0.11
178	300979	华利集团	1,600	84,112.00	0.11
179	002714	牧原股份	2,000	84,020.00	0.11
180	600390	五矿资本	14,400	83,952.00	0.11
181	601669	中国电建	17,000	82,790.00	0.11
182	601868	中国能建	37,100	82,733.00	0.11
183	002600	领益智造	9,600	82,464.00	0.11
184	002414	高德红外	8,000	82,000.00	0.10
185	600436	片仔癀	400	80,004.00	0.10
186	003031	中瓷电子	1,500	79,815.00	0.10
187	688469	芯联集成	16,600	79,182.00	0.10
188	002314	南山控股	29,900	78,637.00	0.10
189	688100	威胜信息	2,100	77,805.00	0.10
190	002151	北斗星通	2,700	77,463.00	0.10
191	300408	三环集团	2,300	76,820.00	0.10
192	000408	藏格矿业	1,800	76,806.00	0.10
193	603601	再升科技	18,900	76,734.00	0.10
194	600177	雅戈尔	10,500	76,650.00	0.10
195	600089	特变电工	6,400	76,352.00	0.10
196	000977	浪潮信息	1,500	76,320.00	0.10
197	601336	新华保险	1,300	76,050.00	0.10
198	601006	大秦铁路	11,500	75,900.00	0.10
199	601898	中煤能源	6,900	75,486.00	0.10
200	688266	泽璟制药	700	75,257.00	0.10
201	000050	深天马 A	8,800	74,976.00	0.10
202	600166	福田汽车	27,500	74,525.00	0.10
203	002648	卫星化学	4,300	74,519.00	0.10

204	002081	金 螳 螂	21,700	74,431.00	0.10
205	688188	柏楚电子	560	73,729.60	0.09
206	000069	华侨城 A	32,600	73,350.00	0.09
207	002385	大北农	18,100	73,124.00	0.09
208	603766	隆鑫通用	5,700	72,732.00	0.09
209	601838	成都银行	3,600	72,360.00	0.09
210	300857	协创数据	840	72,290.40	0.09
211	601333	广深铁路	25,000	72,250.00	0.09
212	601098	中南传媒	5,500	72,160.00	0.09
213	688036	传音控股	900	71,730.00	0.09
214	601126	四方股份	4,400	71,588.00	0.09
215	000829	天音控股	7,000	71,470.00	0.09
216	688739	成大生物	2,700	71,280.00	0.09
217	600064	南京高科	9,200	70,932.00	0.09
218	000959	首钢股份	20,800	70,720.00	0.09
219	600380	健康元	6,400	70,592.00	0.09
220	600299	安迪苏	7,300	70,445.00	0.09
221	000027	深圳能源	11,000	70,180.00	0.09
222	300888	稳健医疗	1,700	69,870.00	0.09
223	688608	恒玄科技	200	69,596.00	0.09
224	600027	华电国际	12,700	69,469.00	0.09
225	688146	中船特气	2,400	69,384.00	0.09
226	300442	润泽科技	1,400	69,342.00	0.09
226	300769	德方纳米	2,100	69,342.00	0.09
227	600863	内蒙华电	16,800	69,048.00	0.09
228	600928	西安银行	17,500	68,600.00	0.09
229	600016	民生银行	14,400	68,400.00	0.09
230	600663	陆家嘴	7,700	68,222.00	0.09
231	300298	三诺生物	3,000	67,770.00	0.09
232	603833	欧派家居	1,200	67,740.00	0.09
233	002138	顺络电子	2,400	67,488.00	0.09
234	688120	华海清科	400	67,480.00	0.09
235	002739	万达电影	5,900	67,437.00	0.09
236	300737	科顺股份	13,900	66,998.00	0.09
237	000066	中国长城	4,500	66,600.00	0.09
238	300166	东方国信	6,100	66,490.00	0.08
239	002294	信立泰	1,400	66,262.00	0.08
240	300072	海新能科	18,700	66,011.00	0.08
241	601825	沪农商行	6,800	65,960.00	0.08
242	603565	中谷物流	6,900	65,895.00	0.08
243	600085	同仁堂	1,800	64,908.00	0.08
244	600246	万通发展	10,600	64,766.00	0.08
245	300229	拓尔思	3,500	64,540.00	0.08

246	600675	中华企业	22,300	64,224.00	0.08
247	002701	奥瑞金	10,700	63,665.00	0.08
248	002597	金禾实业	2,700	63,585.00	0.08
249	600335	国机汽车	9,800	63,210.00	0.08
250	688001	华兴源创	2,500	63,175.00	0.08
251	601012	隆基绿能	4,200	63,084.00	0.08
252	601998	中信银行	7,400	62,900.00	0.08
253	000089	深圳机场	9,100	62,790.00	0.08
254	601799	星宇股份	500	62,500.00	0.08
255	601901	方正证券	7,900	62,489.00	0.08
256	601111	中国国航	7,900	62,331.00	0.08
257	600008	首创环保	20,600	62,212.00	0.08
258	000528	柳 工	6,400	61,504.00	0.08
259	000686	东北证券	8,000	61,040.00	0.08
260	603893	瑞芯微	400	60,744.00	0.08
261	300738	奥飞数据	2,900	60,697.00	0.08
262	601665	齐鲁银行	9,600	60,672.00	0.08
263	300054	鼎龙股份	2,100	60,228.00	0.08
264	600418	江淮汽车	1,500	60,135.00	0.08
265	600167	联美控股	10,700	60,134.00	0.08
266	601601	中国太保	1,600	60,016.00	0.08
267	002345	潮宏基	4,100	59,983.00	0.08
268	600751	海航科技	18,100	59,368.00	0.08
269	002050	三花智控	2,200	58,036.00	0.07
270	600547	山东黄金	1,800	57,474.00	0.07
271	300115	长盈精密	2,600	55,640.00	0.07
272	601727	上海电气	7,400	54,686.00	0.07
273	300777	中简科技	1,500	54,375.00	0.07
274	002155	湖南黄金	3,000	53,550.00	0.07
275	600338	西藏珠峰	4,800	53,232.00	0.07
276	002416	爱施德	4,400	52,888.00	0.07
277	002311	海大集团	900	52,731.00	0.07
278	002032	苏 泊 尔	1,000	52,390.00	0.07
279	300140	节能环保	8,400	51,828.00	0.07
280	600362	江西铜业	2,200	51,546.00	0.07
281	002421	达实智能	15,200	51,072.00	0.07
282	600305	恒顺醋业	6,600	51,018.00	0.07
283	002988	豪美新材	1,300	49,400.00	0.06
284	688009	中国通号	9,500	48,830.00	0.06
285	300168	万达信息	6,300	48,321.00	0.06
286	002815	崇达技术	4,200	47,586.00	0.06
287	300358	楚天科技	6,100	47,580.00	0.06
288	002429	兆驰股份	10,800	47,304.00	0.06

289	688235	百济神州	200	46,728.00	0.06
290	605499	东鹏饮料	140	43,967.00	0.06
291	601778	晶科科技	14,600	43,362.00	0.06
292	600866	星湖科技	6,200	42,842.00	0.05
293	002489	浙江永强	11,700	42,822.00	0.05
294	600489	中金黄金	2,900	42,427.00	0.05
295	600862	中航高科	1,600	41,728.00	0.05
296	300383	光环新网	2,900	41,470.00	0.05
297	600143	金发科技	4,000	41,240.00	0.05
298	600703	三安光电	3,300	40,986.00	0.05
299	688213	思特威	400	40,888.00	0.05
300	688095	福昕软件	600	40,746.00	0.05
301	600724	宁波富达	8,900	40,495.00	0.05
302	600416	湘电股份	3,000	40,320.00	0.05
303	601515	东峰集团	10,500	40,110.00	0.05
304	688202	美迪西	1,100	39,523.00	0.05
305	002948	青岛银行	7,900	39,342.00	0.05
306	600750	江中药业	1,800	39,294.00	0.05
307	300134	大富科技	3,200	39,136.00	0.05
308	600266	城建发展	8,600	39,044.00	0.05
309	300655	晶瑞电材	3,900	39,039.00	0.05
310	002664	信质集团	2,100	38,787.00	0.05
311	600582	天地科技	6,400	38,336.00	0.05
312	301236	软通动力	700	38,248.00	0.05
313	002653	海思科	900	37,998.00	0.05
314	600770	综艺股份	7,100	37,630.00	0.05
315	603011	合锻智能	2,400	37,392.00	0.05
316	300586	美联新材	3,500	37,345.00	0.05
317	300059	东方财富	1,600	37,008.00	0.05
318	601633	长城汽车	1,700	36,516.00	0.05
319	601828	美凯龙	12,600	36,414.00	0.05
320	002185	华天科技	3,500	35,350.00	0.05
321	600828	茂业商业	9,100	35,126.00	0.04
322	000733	振华科技	700	35,035.00	0.04
323	300896	爱美客	200	34,962.00	0.04
324	688233	神工股份	1,100	34,947.00	0.04
325	300267	尔康制药	10,900	34,226.00	0.04
326	601636	旗滨集团	6,800	34,068.00	0.04
327	002075	沙钢股份	5,800	33,756.00	0.04
328	000719	中原传媒	2,700	33,507.00	0.04
329	688508	芯朋微	600	33,492.00	0.04
330	688396	华润微	700	33,012.00	0.04
331	688472	阿特斯	3,600	32,940.00	0.04

332	600028	中国石化	5,800	32,712.00	0.04
333	600035	楚天高速	7,700	32,648.00	0.04
334	600098	广州发展	5,200	32,500.00	0.04
335	601138	工业富联	1,500	32,070.00	0.04
336	300394	天孚通信	400	31,936.00	0.04
337	688321	微芯生物	1,300	30,914.00	0.04
338	002920	德赛西威	300	30,639.00	0.04
339	601158	重庆水务	6,600	30,624.00	0.04
340	600075	新疆天业	7,200	30,456.00	0.04
341	603444	吉比特	100	30,195.00	0.04
342	000661	长春高新	300	29,754.00	0.04
343	300759	康龙化成	1,200	29,448.00	0.04
344	002249	大洋电机	4,400	28,952.00	0.04
345	002516	旷达科技	5,600	28,840.00	0.04
346	002625	光启技术	700	27,986.00	0.04
347	600499	科达制造	2,800	27,440.00	0.04
348	300033	同花顺	100	27,301.00	0.03
349	600674	川投能源	1,700	27,268.00	0.03
350	300476	胜宏科技	200	26,876.00	0.03
351	000423	东阿阿胶	500	26,150.00	0.03
352	603966	法兰泰克	2,800	25,984.00	0.03
353	300502	新易盛	200	25,404.00	0.03
354	688668	鼎通科技	400	24,984.00	0.03
355	002262	恩华药业	1,200	24,936.00	0.03
356	600066	宇通客车	1,000	24,860.00	0.03
357	300271	华宇软件	3,000	24,480.00	0.03
358	600989	宝丰能源	1,500	24,210.00	0.03
359	002847	盐津铺子	300	24,120.00	0.03
360	600012	皖通高速	1,400	23,772.00	0.03
361	300821	东岳硅材	2,900	22,794.00	0.03
362	600415	小商品城	1,100	22,748.00	0.03
363	300832	新产业	400	22,688.00	0.03
364	002818	富森美	1,800	22,464.00	0.03
365	601058	赛轮轮胎	1,700	22,304.00	0.03
366	000623	吉林敖东	1,300	22,035.00	0.03
367	001979	招商蛇口	2,500	21,925.00	0.03
368	300474	景嘉微	300	21,900.00	0.03
369	300232	洲明科技	3,000	21,720.00	0.03
370	600585	海螺水泥	1,000	21,470.00	0.03
371	688037	芯源微	200	21,440.00	0.03
372	002558	巨人网络	900	21,195.00	0.03
373	600332	白云山	800	21,088.00	0.03
374	300373	扬杰科技	400	20,760.00	0.03

375	300395	菲利华	400	20,440.00	0.03
376	600535	天士力	1,300	20,345.00	0.03
377	002396	星网锐捷	900	20,205.00	0.03
378	600023	浙能电力	3,800	20,140.00	0.03
379	688343	云天励飞	400	19,768.00	0.03
380	300151	昌红科技	1,600	19,696.00	0.03
381	300236	上海新阳	500	19,400.00	0.02
382	600999	招商证券	1,100	19,349.00	0.02
383	300181	佐力药业	1,100	19,063.00	0.02
384	688281	华秦科技	300	18,153.00	0.02
385	300623	捷捷微电	600	17,880.00	0.02
386	600308	华泰股份	5,200	17,784.00	0.02
386	601155	新城控股	1,300	17,784.00	0.02
387	601598	中国外运	3,600	17,748.00	0.02
388	300999	金龙鱼	600	17,718.00	0.02
389	000426	兴业银锡	1,100	17,380.00	0.02
390	002153	石基信息	2,000	17,320.00	0.02
391	002841	视源股份	500	17,300.00	0.02
392	300393	中来股份	3,000	17,280.00	0.02
393	603236	移远通信	200	17,160.00	0.02
394	601608	中信重工	3,900	17,043.00	0.02
395	000029	深深房 A	900	16,938.00	0.02
396	301367	瑞迈特	200	16,820.00	0.02
397	600801	华新水泥	1,400	16,576.00	0.02
398	601628	中国人寿	400	16,476.00	0.02
399	002003	伟星股份	1,500	16,365.00	0.02
400	300369	绿盟科技	2,100	16,317.00	0.02
401	002405	四维图新	1,900	16,226.00	0.02
402	603308	应流股份	700	16,156.00	0.02
403	301031	中熔电气	200	15,930.00	0.02
404	688630	芯碁微装	200	15,874.00	0.02
405	600757	长江传媒	1,700	15,776.00	0.02
406	300573	兴齐眼药	300	15,537.00	0.02
407	688425	铁建重工	3,500	14,280.00	0.02
408	603005	晶方科技	500	14,195.00	0.02
409	300447	全信股份	900	14,103.00	0.02
410	300255	常山药业	300	13,983.00	0.02
411	603225	新凤鸣	1,300	13,845.00	0.02
412	601077	渝农商行	1,900	13,566.00	0.02
413	300418	昆仑万维	400	13,452.00	0.02
414	000933	神火股份	800	13,312.00	0.02
415	300741	华宝股份	700	13,223.00	0.02
416	688387	信科移动	2,300	12,995.00	0.02



417	002330	得利斯	2,800	12,824.00	0.02
418	601128	常熟银行	1,740	12,823.80	0.02
419	300624	万兴科技	200	12,410.00	0.02
420	002891	中宠股份	200	12,374.00	0.02
421	300401	花园生物	800	12,168.00	0.02
422	002468	申通快递	1,100	11,759.00	0.02
423	688023	安恒信息	200	11,348.00	0.01
424	002500	山西证券	1,900	11,096.00	0.01
425	603809	豪能股份	700	10,710.00	0.01
426	688179	阿拉丁	840	10,684.80	0.01
427	600498	烽火通信	500	10,515.00	0.01
428	688295	中复神鹰	500	10,400.00	0.01
429	000156	华数传媒	1,300	10,322.00	0.01
430	603529	爱玛科技	300	10,320.00	0.01
431	600163	中闽能源	2,000	10,240.00	0.01
432	300305	裕兴股份	1,600	10,208.00	0.01
433	688088	虹软科技	200	9,650.00	0.01
434	688475	萤石网络	300	9,456.00	0.01
435	601689	拓普集团	200	9,450.00	0.01
436	601377	兴业证券	1,500	9,285.00	0.01
437	301268	铭利达	500	9,275.00	0.01
438	002913	奥士康	300	8,823.00	0.01
439	603297	永新光学	100	8,735.00	0.01
440	301339	通行宝	480	8,222.40	0.01
441	603290	斯达半导	100	8,127.00	0.01
442	002453	华软科技	1,300	7,930.00	0.01
443	300755	华致酒行	400	7,720.00	0.01
444	600061	国投资本	1,000	7,520.00	0.01
445	601162	天风证券	1,500	7,395.00	0.01
446	600496	精工钢构	2,300	7,360.00	0.01
447	000676	智度股份	800	7,296.00	0.01
448	000553	安道麦 A	1,000	7,220.00	0.01
449	601066	中信建投	300	7,215.00	0.01
450	600600	青岛啤酒	100	6,946.00	0.01
451	600570	恒生电子	200	6,708.00	0.01
452	600996	贵广网络	800	6,672.00	0.01
453	002373	千方科技	700	6,510.00	0.01
454	000006	深振业 A	1,000	6,450.00	0.01
455	002755	奥赛康	400	6,392.00	0.01
456	300231	银信科技	500	6,155.00	0.01
457	601117	中国化学	800	6,136.00	0.01
458	300911	亿田智能	140	5,944.40	0.01
459	601933	永辉超市	1,200	5,880.00	0.01

460	601231	环旭电子	400	5,852.00	0.01
461	000617	中油资本	800	5,840.00	0.01
462	002312	川发龙蟒	500	5,740.00	0.01
463	603936	博敏电子	600	5,658.00	0.01
464	000720	新能泰山	1,600	5,584.00	0.01
465	601958	金钼股份	500	5,470.00	0.01
466	603596	伯特利	100	5,269.00	0.01
467	601279	英利汽车	1,300	5,187.00	0.01
468	002156	通富微电	200	5,124.00	0.01
469	002965	祥鑫科技	130	5,098.60	0.01
470	300723	一品红	100	5,012.00	0.01
471	300973	立高食品	100	4,877.00	0.01
472	002174	游族网络	400	4,852.00	0.01
473	002544	普天科技	200	4,690.00	0.01
474	000425	徐工机械	600	4,662.00	0.01
475	301316	慧博云通	100	4,308.00	0.01
476	603228	景旺电子	100	4,184.00	0.01
477	600501	航天晨光	200	4,098.00	0.01
478	600301	华锡有色	200	3,994.00	0.01
479	600490	鹏欣资源	900	3,951.00	0.01
480	601985	中国核电	400	3,728.00	0.00
481	002926	华西证券	400	3,576.00	0.00
482	300215	电科院	600	3,480.00	0.00
483	603063	禾望电气	100	3,386.00	0.00
484	002681	奋达科技	500	3,385.00	0.00
485	300183	东软载波	200	3,362.00	0.00
486	603999	读者传媒	500	3,305.00	0.00
487	003022	联泓新科	200	3,166.00	0.00
488	000420	吉林化纤	800	3,120.00	0.00
489	605296	神农集团	100	3,074.00	0.00
490	002985	北摩高科	100	3,025.00	0.00
491	600729	重庆百货	100	2,983.00	0.00
492	001203	大中矿业	300	2,835.00	0.00
493	300284	苏交科	300	2,730.00	0.00
493	600004	白云机场	300	2,730.00	0.00
494	605016	百龙创园	130	2,681.90	0.00
495	002545	东方铁塔	300	2,667.00	0.00
496	300015	爱尔眼科	200	2,496.00	0.00
497	002493	荣盛石化	300	2,484.00	0.00
498	600120	浙江东方	400	2,420.00	0.00
499	002611	东方精工	200	2,412.00	0.00
500	603327	福蓉科技	260	2,405.00	0.00
501	300287	飞利信	400	2,300.00	0.00

502	600961	株冶集团	200	2,236.00	0.00
503	600491	龙元建设	600	2,208.00	0.00
504	301267	华夏眼科	100	1,917.00	0.00
505	002735	王子新材	100	1,481.00	0.00
506	600207	安彩高科	300	1,428.00	0.00
507	600353	旭光电子	100	1,334.00	0.00
508	300355	蒙草生态	300	1,275.00	0.00
509	000810	创维数字	100	1,178.00	0.00
510	002585	双星新材	200	1,092.00	0.00
511	605136	丽人丽妆	100	1,075.00	0.00
512	600097	开创国际	100	1,044.00	0.00
513	300027	华谊兄弟	100	268.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601328	交通银行	1,648,573.00	2.01
2	600519	贵州茅台	1,366,007.00	1.66
3	600036	招商银行	1,343,624.00	1.64
4	300760	迈瑞医疗	1,241,795.00	1.51
5	601166	兴业银行	1,213,961.00	1.48
6	688111	金山办公	1,144,436.49	1.39
7	000651	格力电器	1,137,646.00	1.39
8	600900	长江电力	1,127,164.00	1.37
9	601398	工商银行	1,117,956.00	1.36
10	600887	伊利股份	1,010,000.00	1.23
11	600690	海尔智家	956,298.00	1.16
12	601211	国泰海通	947,259.00	1.15
13	688012	中微公司	941,026.00	1.15
14	002230	科大讯飞	926,935.00	1.13
15	688041	海光信息	917,417.04	1.12
16	601668	中国建筑	912,890.00	1.11
17	603501	豪威集团	849,726.00	1.04
18	002594	比亚迪	836,200.00	1.02
19	000725	京东方 A	826,731.00	1.01
20	600000	浦发银行	810,815.00	0.99

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	600900	长江电力	1,958,232.00	2.39
2	600887	伊利股份	1,689,244.00	2.06
3	600519	贵州茅台	1,512,574.00	1.84
4	300760	迈瑞医疗	1,448,767.00	1.76
5	603501	豪威集团	1,424,277.00	1.73
6	600030	中信证券	1,399,362.00	1.70
7	601318	中国平安	1,358,939.00	1.66
8	601328	交通银行	1,335,275.00	1.63
9	002594	比亚迪	1,276,131.00	1.55
10	000333	美的集团	1,223,804.00	1.49
11	600036	招商银行	1,175,787.00	1.43
12	300750	宁德时代	1,169,257.00	1.42
13	600276	恒瑞医药	1,131,745.00	1.38
14	002475	立讯精密	1,121,768.00	1.37
15	601166	兴业银行	1,084,482.00	1.32
16	600660	福耀玻璃	978,178.00	1.19
17	300308	中际旭创	942,286.00	1.15
18	601229	上海银行	924,667.00	1.13
19	300433	蓝思科技	924,473.00	1.13
20	300408	三环集团	915,428.00	1.12

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	161,403,825.24
卖出股票收入（成交）总额	167,626,640.54

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）	1,238.85	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,238.85	0.00

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	123255	鼎龙转债	9	1,238.85	0.00

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

本基金参与股指期货交易，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

（1）时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

（2）套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

（3）合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

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

本基金可投资国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方交通运输局的处罚。

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局地方分局的处罚。

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	7,146.19
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	199.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,346.04

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 ESG 量化 股票 A	1,671	36,146.65	4,290,796.78	7.10	56,110,263.25	92.90

景顺长城 ESG 量化股票 C	441	54,791.43	2,001,155.56	8.28	22,161,863.33	91.72
合计	2,112	40,039.81	6,291,952.34	7.44	78,272,126.58	92.56

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 ESG 量化股票 A	24.09	0.000040
	景顺长城 ESG 量化股票 C	58.77	0.000243
	合计	82.86	0.000098

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。
2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城 ESG 量化股票 A	景顺长城 ESG 量化股票 C
基金合同生效日 （2022 年 6 月 6 日） 基金份额总额	144,569,111.60	71,242,029.80
本报告期期初基金份额总额	64,739,077.30	25,387,732.09
本报告期基金总申购份额	285,456.86	117,836.44
减：本报告期基金总赎回份额	4,623,474.13	1,342,549.64
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	60,401,060.03	24,163,018.89

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：

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。

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：

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

### 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 (%)	
华创证券有限责任公司	1	61,788,767.10	18.78	28,113.69	18.78	未变更
华福证券有限责任公司	1	39,444,506.78	11.99	17,947.40	11.99	未变更
中国国际金融股份有限公司	2	34,961,713.70	10.63	15,907.31	10.63	未变更
东方证券股份有限公司	2	28,420,085.19	8.64	12,931.41	8.64	未变更
东北证券股份有限公司	2	27,287,045.61	8.29	12,415.23	8.29	未变更
光大证券股份有限公司	2	20,821,645.80	6.33	9,474.29	6.33	未变更
国泰海通证券股份有限公司	3	17,714,648.59	5.38	8,060.23	5.38	未变更
中信证券股份有限公司	6	14,314,170.00	4.35	6,512.39	4.35	未变更
招商证券股份有限公司	1	13,076,543.11	3.97	5,949.80	3.97	未变更
中国银河证券股份有限公司	2	12,604,222.76	3.83	5,734.89	3.83	未变更
民生证券股份有限公司	1	12,390,074.00	3.77	5,637.56	3.77	未变更
国投证券股份有限公司	1	10,711,431.00	3.26	4,873.85	3.26	未变更

天风证券股份有限公司	1	10,026,141.00	3.05	4,561.94	3.05	未变更
长江证券股份有限公司	2	9,027,856.29	2.74	4,107.64	2.74	未变更
华泰证券股份有限公司	1	5,647,610.73	1.72	2,569.68	1.72	未变更
国盛证券有限责任公司	1	4,164,364.00	1.27	1,894.56	1.27	未变更
国金证券股份有限公司	1	3,712,219.12	1.13	1,689.59	1.13	未变更
申万宏源证券有限公司	2	2,917,421.00	0.89	1,327.12	0.89	本期报告新增 1 个
长城证券股份有限公司	2	-	-	-	-	本期报告新增 1 个
诚通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
川财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	本期报告退租 1 个
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国信证券股份有限	2	-	-	-	-	本期报告

公司						新增 1 个
恒泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	本期 报告 退租 1 个
平安证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	未变 更
瑞银证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	未变 更
西南证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
兴业证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	未变 更
中信建投 证券股份 有限公司	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 (%)
华创证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1,339.74	100.00	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

证券有限 公司						
长城证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
诚通证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
川财证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券 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	-	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券 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	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 ESG 量化股票型证券投资基金 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
7	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
8	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
9	景顺长城 ESG 量化股票型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 3 月 28 日
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	景顺长城 ESG 量化股票型证券投资基金 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
16	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
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 5 月 12 日
18	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
19	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
20	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	中国证监会指定报刊及网站	2025 年 5 月 30 日

	告		
--	---	--	--

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

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日