

---

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券  
投资基金联接基金 2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 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	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	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.....	48
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.....	48
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	48
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.13 投资组合报告附注.....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>54</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	景顺长城中证 500ETF 联接
场内简称	无
基金主代码	001455
交易代码	001455
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	455,061,800.14 份
基金合同存续期	不定期

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159935
交易代码	159935
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 26 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 1 月 21 日
基金管理人名称	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 以达到投资目标。当本基金申购、赎回和买卖目标 ETF，或基金自身的申购、赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，基金管理人会在 10 个工作日内对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。在正常情况下，本基金力争相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，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。本基金为股票型指数基金，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中预期风险较高、预期收益较高的品种。

#### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
------	---------------------------

投资策略	本基金以中证 500 指数为标的指数，采用完全复制法，即以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。在因特殊情况（包括但不限于成份股停牌、流动性不足、法律法规限制、其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等）导致无法获得足够数量的股票时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代或者采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
业绩比较基准	中证 500 指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	景顺长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95566
传真	0755-22381339	010-66594942
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	丁益	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号 嘉里建设广场第一座 21 层

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)
本期已实现收益	-395,803.84
本期利润	42,339,497.34
加权平均基金份额本期利润	0.0975
本期加权平均净值利润率	14.16%
本期基金份额净值增长率	18.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-142,509,760.99
期末可供分配基金份额利润	-0.3132
期末基金资产净值	312,552,039.15
期末基金份额净值	0.687
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-31.30%

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后三位，小数点后第四位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

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

#### 3.2 基金净值表现

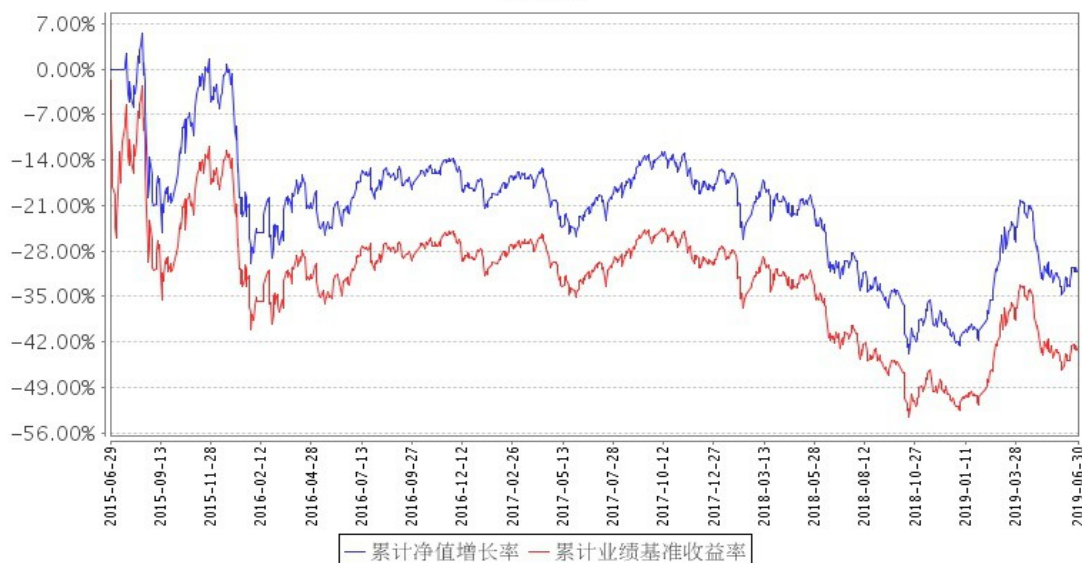
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.03%	1.26%	0.75%	1.32%	0.28%	-0.06%
过去三个月	-9.13%	1.64%	-10.21%	1.72%	1.08%	-0.08%
过去六个月	18.45%	1.62%	17.87%	1.70%	0.58%	-0.08%
过去一年	-2.55%	1.54%	-4.70%	1.60%	2.15%	-0.06%
过去三年	-14.45%	1.20%	-18.00%	1.25%	3.55%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-31.30%	1.55%	-43.28%	1.77%	11.98%	-0.22%



### 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500ETF联接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:本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,同时不低于非现金基金资产的80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的建仓期为自2015年6月29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“公司”或“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。

截至2019年6月30日,景顺长城基金管理有限公司旗下共管理75只开放式基金,包括景顺长城景系列开放式证券投资基金、景顺长城内需增长混合型证券投资基金、景顺长城鼎益混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城资源垄断混合型证券投资基金(LOF)、景顺长城新兴成长混合型证券投资

基金、景顺长城内需增长贰号混合型证券投资基金、景顺长城精选蓝筹混合型证券投资基金、景顺长城公司治理混合型证券投资基金、景顺长城能源基建混合型证券投资基金、景顺长城中小盘混合型证券投资基金、景顺长城稳定收益债券型证券投资基金、景顺长城大中华混合型证券投资基金、景顺长城核心竞争力混合型证券投资基金、景顺长城优信增利债券型证券投资基金、景顺长城支柱产业混合型证券投资基金、景顺长城品质投资混合型证券投资基金、景顺长城四季金利债券型证券投资基金、景顺长城策略精选灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景兴信用纯债债券型证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、景顺长城景颐双利债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、景顺长城成长之星股票型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城优质成长股票型证券投资基金、景顺长城优势企业混合型证券投资基金、景顺长城鑫月薪定期支付债券型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城研究精选股票型证券投资基金、景顺长城景丰货币市场基金、景顺长城中国回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化精选股票型证券投资基金、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪港深精选股票型证券投资基金、景顺长城领先回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 TMT150 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城安享回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城泰和回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景瑞收益定期开放债券型证券投资基金、景顺长城改革机遇灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景颐宏利债券型证券投资基金、景顺长城景盛双息收益债券型证券投资基金、景顺长城低碳科技主题灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城环保优势股票型证券投资基金、景顺长城量化新动力股票型证券投资基金、景顺长城景盈双利债券型证券投资基金、景顺长城景泰汇利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城顺益回报混合型证券投资基金、景顺长城泰安回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰丰利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景颐丰利债券型证券投资基金、景顺长城政策性金融债债券型证券投资基金、景顺长城中证 500 行业中性低波动指数型证券投资基金、景顺长城沪港深领先科技股票型证券投资基金、景顺长城景瑞睿利回报定期开放混合型证券投资基金、景顺长城睿成灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城景泰稳利定期开放债券型证券投资基金、景顺长城量化平衡灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城泰恒回报灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城量化小盘股票型证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金、景顺长城 MSCI 中国 A 股国际通指数增强型证券投资基金、景顺长城量化先锋混合型证券投资基金、景顺长城景泰聚利纯债债券型证券投资基金、景顺长城景泰鑫利纯债债券型证券投资

基金、景顺长城智能生活混合型证券投资基金、景顺长城中证 500 指数增强型证券投资基金、景顺长城集英成长两年定期开放混合型证券投资基金、景顺长城量化港股通股票型证券投资基金、景顺长城景泰盈利纯债债券型证券投资基金。其中景顺长城景系列开放式证券投资基金下设景顺长城优选混合型证券投资基金、景顺长城货币市场证券投资基金、景顺长城动力平衡证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾理	本基金的基金经理	2018 年 10 月 12 日	-	5	工学硕士。曾任职于腾讯计算机系统有限公司信息安全部产品策略岗位。2014 年 8 月加入本公司，历任量化及 ETF 投资部量化程序员、量化及指数投资部基金经理助理自 2018 年 10 月起担任量化及指数投资部基金经理。
徐喻军	本基金的基金经理、量化及指数投资部总监助理	2015 年 6 月 29 日	-	9	理学硕士。曾担任安信证券风险管理部风险管理专员 2012 年 3 月加入本公司，担任量化及 ETF 投资部 ETF 专员；自 2014 年 4 月起担任量化及指数投资部基金经理现担任量化及指数投资部总监助理兼基金经理。

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”为根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”为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。

#### 4.2 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》、《证券投资基金销售管理办法》和《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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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，本基金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 57 次，为公司旗下管理的量化产品因申购赎回情况不一致依据产品合同约定进行的仓位调整，公司旗下指数基金因指数成份股调整，以及量化产品和指数增强基金根据产品合同约定通过量化模型交易从而与其他组合发生的反向交易。投资组合间虽然存在临近交易日同向交易行为，但结合交易时机及市场交易价格波动分析表明投资组合间不存在不公平交易和利益输送的可能性。投资组合间虽然存在相邻反向异常交易，经分析为投资组合开放期内投资者连续赎回导致的被动行为，非不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2019 年 6 月工业增加值累计增长 6.0%，增速持平，6 月 PMI 指数环比下降至 49.4，经济经历短期企稳后再度显示出疲态。6 月 PPI 同比 0%，环比下跌 0.3%；6 月 CPI 同比上涨 2.7%，环比下跌 0.1%，通胀预期维持平稳。6 月 M2 同比增速 8.5%，M1 同比增速 4.4%，社会融资规模存量同比增长 10.9%，增速维持平稳。6 月末外汇储备 3.1 万亿美元，受贸易摩擦影响，汇率波动加大。今年初在稳增长和宽信用的金融政策引导下，市场情绪较为乐观，A 股迎来一波明显的估值修复行情。2 季度开始，中美贸易摩擦的加剧和美国对华为等公司的禁令，超出市场预期，引发投资者对贸易摩擦和科技竞争的担忧，对企业基本面悲观预期加重，市场在冲高后加速回落进入震荡调整阶段。上半年上证综指、沪深 300 和创业板指数分别上涨 19.45%，27.07% 和 20.87%。

本基金是景顺长城中证 500ETF 的联接基金，主要投资于景顺长城中证 500ETF。报告期内，本基金根据申赎情况进行日常操作，力争控制跟踪误差和跟踪偏离度在较低的水平上。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019 年上半年，本基金份额净值增长率为 18.45%，业绩比较基准收益率为 17.87%。报告期内，

本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，跟踪误差（年化）控制在 4% 以内。

#### 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 2019 年下半年，全球经济面临增长放缓的风险，国内经济仍然存在下行压力。但随着中美贸易摩擦走向缓和，可能会有最终方案落地。宽信用和稳增长货币政策延续，基建投资反弹，房地产投资增速回升，减税降费的实施，对经济基本面有较强支持。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在供给侧改革和产业升级的背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前市场整体估值仍然处于合理位置，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。

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

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

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

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	20,362,675.51	16,503,302.90
结算备付金		54,077.80	-
存出保证金		17,826.92	3,776.12
交易性金融资产	6.4.7.2	292,122,839.06	221,145,600.00
其中：股票投资		8,090,039.06	-
基金投资		284,032,800.00	221,145,600.00

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,701.53	3,262.05
应收股利		-	-
应收申购款		394,002.36	136,335.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		312,955,123.18	237,792,276.82
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2019年6月30日</b>	<b>2018年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		272,861.49	37,629.24
应付管理人报酬		11,488.08	6,580.62
应付托管费		2,297.63	1,316.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	18,716.66	1,995.07
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	97,720.17	360,105.14
负债合计		403,084.03	407,626.20
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	455,061,800.14	409,185,188.58
未分配利润	6.4.7.10	-142,509,760.99	-171,800,537.96
所有者权益合计		312,552,039.15	237,384,650.62
负债和所有者权益总计		312,955,123.18	237,792,276.82

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.687 元，基金份额总额 455,061,800.14 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2019年1月1日至2019年 6月30日	2018年1月1日至2018 年6月30日
一、收入		42,552,961.83	-45,579,757.73
1. 利息收入		71,137.86	62,183.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	71,137.50	62,183.84
债券利息收入		0.36	-
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）		-344,455.14	-970,187.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-421,928.41	-254,419.15
基金投资收益	6.4.7.13	-	-719,476.92
债券投资收益	6.4.7.14	167.57	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	77,305.70	3,708.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	42,735,301.18	-44,697,632.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	90,977.93	25,878.76
减：二、费用		213,464.49	268,413.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	60,484.77	44,097.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,096.89	8,819.42
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	43,013.18	35,998.53
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	97,869.65	179,498.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		42,339,497.34	-45,848,170.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		42,339,497.34	-45,848,170.96

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：景顺长城中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2019年1月1日至2019年6月30日

单位：人民币元



项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	409,185,188.58	-171,800,537.96	237,384,650.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	42,339,497.34	42,339,497.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	45,876,611.56	-13,048,720.37	32,827,891.19
其中：1. 基金申购款	115,021,470.90	-31,949,863.84	83,071,607.06
2. 基金赎回款	-69,144,859.34	18,901,143.47	-50,243,715.87
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	455,061,800.14	-142,509,760.99	312,552,039.15
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	389,944,230.17	-69,373,919.69	320,570,310.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-45,848,170.96	-45,848,170.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	9,361,407.75	-2,488,924.06	6,872,483.69
其中：1. 基金申购款	43,390,613.49	-9,384,222.88	34,006,390.61
2. 基金赎回款	-34,029,205.74	6,895,298.82	-27,133,906.92
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	399,305,637.92	-117,711,014.71	281,594,623.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

康乐

吴建军

邵媛媛

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(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[2015]899 号《关于准予景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,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 213,813,305.77 元,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(2015)第 720 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 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2015 年 6 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 213,867,925.87 份基金份额,其中认购资金利息折合 54,620.10 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金是景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是主要采用完全复制法实现对中证 500 指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35%,年化跟踪误差控制在 4%以内。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%,同时不低于非现金基金资产的 80%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款。本基金可少量投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数 X95%+银行活期存款税后利率 X5%。

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 2019 年 8 月 21 日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2019 年半年度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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **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。

#### **6.4.5 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 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, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税, 对金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及

利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	20,362,675.51
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月至1年	-
存款期限1年以上	-
其他存款	-
合计	20,362,675.51

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,446,275.88	8,090,039.06	-356,236.82
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
交易所市场	-	-	-

债券	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		351,549,658.40	284,032,800.00	-67,516,858.40
其他		-	-	-
合计		359,995,934.28	292,122,839.06	-67,873,095.22

注：于本期末，基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	3,672.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	21.87
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	7.20
合计	3,701.53

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日

交易所市场应付交易费用	18,716.66
银行间市场应付交易费用	-
合计	18,716.66

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	922.04
预提费用	96,798.13
合计	97,720.17

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	409,185,188.58	409,185,188.58
本期申购	115,021,470.90	115,021,470.90
本期赎回（以“-”号填列）	-69,144,859.34	-69,144,859.34
- 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	455,061,800.14	455,061,800.14

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 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	-34,643,094.30	-137,157,443.66	-171,800,537.96
本期利润	-395,803.84	42,735,301.18	42,339,497.34
本期基金份额交易产生的变动数	-3,879,904.75	-9,168,815.62	-13,048,720.37
其中：基金申购款	-9,744,434.32	-22,205,429.52	-31,949,863.84
基金赎回款	5,864,529.57	13,036,613.90	18,901,143.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-38,918,802.89	-103,590,958.10	-142,509,760.99

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	70,654.14
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	413.31
其他	70.05
合计	71,137.50

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	93,360.53
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-515,288.94
合计	-421,928.41

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	4,341,526.40
减：卖出股票成本总额	4,248,165.87
买卖股票差价收入	93,360.53

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
申购基金份额总额	19,794,600.00
减：现金支付申购款总额	257,674.89
减：申购股票成本总额	20,052,214.05
申购差价收入	-515,288.94

### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

### 6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,567.93
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）	1,400.00

成本总额	
减：应收利息总额	0.36
买卖债券差价收入	167.57

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	77,305.70
基金投资产生的股利收益	-
合计	77,305.70

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	42,735,301.18
股票投资	-356,236.82
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	43,091,538.00
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	42,735,301.18

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	88,113.05
基金转换费收入	2,864.88
合计	90,977.93

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的25%归入基金资产。



**6.4.7.19 交易费用**

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	42,061.51
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	951.67
其中：申购费	951.67
赎回费	-
合计	43,013.18

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	67,045.35
银行划款手续费	871.52
其他	200.00
合计	97,869.65

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东
景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（“目标 ETF”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	16,979,343.57	45.87	11,472,173.90	47.10

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期内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 2019年1月1日至2019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	15,815.64	45.88	8,576.66	45.82
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	10,684.60	47.10	3,192.15	45.98

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

**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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	60,484.77	44,097.05
其中：支付销售机构的客户维护费	88,682.05	72,089.95

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人景顺长城基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩

余部分(若为负数, 则取 0)的 0.50%年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬 = (前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) × 0.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	12,096.89		8,819.42	

注: 本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费, 支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数, 则取 0)的 0.10%年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。其计算公式为:

日托管费 = (前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应的资产净值) × 0.10% / 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 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

除基金管理人之外, 本基金的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	20,362,675.51	70,654.14	17,877,709.90	61,870.52

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管, 按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 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。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

#### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 206,000,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为 97.83%(2018 年 12 月 31 日：本基金持有 192,000,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 97.67%)。

#### 6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费(元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	676,850.06	730,669.30
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	135,370.09	146,133.86

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末(2019 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本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

截止本报告期末，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

截止本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 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員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%。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券（上年末：同）。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过由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 2019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							
银行存款	20,362,675.51	-	-	-	-	-	20,362,675.51
结算备付金	54,077.80	-	-	-	-	-	54,077.80
存出保证金	17,826.92	-	-	-	-	-	17,826.92
交易性金融资产	-	-	-	-	-	292,122,839.06	292,122,839.06
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	3,701.53	3,701.53
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	394,002.36	394,002.36
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	20,434,580.23	-	-	-	-	292,520,542.95	312,955,123.18
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	272,861.49	272,861.49
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,488.08	11,488.08
应付托管费	-	-	-	-	-	2,297.63	2,297.63
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	18,716.66	18,716.66
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	97,720.17	97,720.17
负债总计	-	-	-	-	-	403,084.03	403,084.03
利率敏感度缺口	20,434,580.23	-	-	-	-	-	-
上年度末	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

2018 年 12 月 31 日			年		上		
资产							
银行存款	16,503,302.90	-	-	-	-	-	16,503,302.90
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	3,776.12	-	-	-	-	-	3,776.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	221,145,600.00	221,145,600.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	3,262.05	3,262.05
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	136,335.75	136,335.75
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	16,507,079.02	-	-	-	-	221,285,197.80	237,792,276.82
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	37,629.24	37,629.24
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,580.62	6,580.62
应付托管费	-	-	-	-	-	1,316.13	1,316.13
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,995.07	1,995.07
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	360,105.14	360,105.14
负债总计	-	-	-	-	-	407,626.20	407,626.20
利率敏感度缺口	16,507,079.02	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有债券资产（上年末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：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。本基金持有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，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。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。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 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 2019年6月30日		上年度末 2018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	8,090,039.06	2.59	-	-
交易性金融资产—基金投资	284,032,800.00	90.88	221,145,600.00	93.16
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	292,122,839.06	93.46	221,145,600.00	93.16

#### 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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	14,418,798.59	10,434,236.19
	沪深 300 指数下降 5%	-14,418,798.59	-10,434,236.19

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 292,122,839.06 元，无属于第二和第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 221,145,600.00 元，无属于第二和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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	8,090,039.06	2.59
	其中：股票	8,090,039.06	2.59
2	基金投资	284,032,800.00	90.76
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,416,753.31	6.52
8	其他各项资产	415,530.81	0.13
9	合计	312,955,123.18	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	95,427.00	0.03
B	采矿业	267,499.20	0.09
C	制造业	4,497,200.56	1.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	265,369.60	0.08
E	建筑业	154,525.20	0.05
F	批发和零售业	436,148.10	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	277,939.20	0.09
H	住宿和餐饮业	36,360.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	772,199.80	0.25
J	金融业	370,815.60	0.12
K	房地产业	372,865.20	0.12
L	租赁和商务服务业	104,250.30	0.03
M	科学研究和技术服务业	10,386.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	70,622.30	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	29,763.00	0.01
Q	卫生和社会工作	41,859.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	170,649.00	0.05
S	综合	116,160.00	0.04
	合计	8,090,039.06	2.59

### 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	000860	顺鑫农业	1,160	54,114.00	0.02
2	002405	四维图新	3,300	53,130.00	0.02
3	600872	中炬高新	1,200	51,396.00	0.02
4	002157	正邦科技	2,700	44,982.00	0.01
5	002439	启明星辰	1,500	40,350.00	0.01
6	300450	先导智能	1,200	40,320.00	0.01
7	000066	中国长城	3,900	40,092.00	0.01
8	002049	紫光国微	900	39,699.00	0.01
9	600739	辽宁成大	2,700	39,258.00	0.01
10	002195	二三四五	9,860	38,355.40	0.01
11	300253	卫宁健康	2,700	38,286.00	0.01
12	600298	安琪酵母	1,200	37,956.00	0.01
13	600201	生物股份	2,400	37,656.00	0.01
14	002127	南极电商	3,300	37,092.00	0.01
15	000401	冀东水泥	2,100	36,981.00	0.01
16	600895	张江高科	1,800	36,936.00	0.01
17	002463	沪电股份	2,700	36,774.00	0.01
18	600183	生益科技	2,400	36,120.00	0.01
19	002506	协鑫集成	5,400	36,072.00	0.01
20	600642	申能股份	6,000	36,060.00	0.01
21	000333	美的集团	691	35,835.26	0.01
22	600426	华鲁恒升	2,400	35,664.00	0.01
23	000975	银泰资源	2,700	35,613.00	0.01
24	300383	光环新网	2,100	35,217.00	0.01
25	002129	中环股份	3,600	35,136.00	0.01
26	000623	吉林敖东	2,100	34,419.00	0.01
27	002465	海格通信	3,600	34,344.00	0.01
28	002340	格林美	7,200	33,912.00	0.01
29	603369	今世缘	1,200	33,468.00	0.01
30	600536	中国软件	600	32,202.00	0.01
31	000750	国海证券	6,300	31,689.00	0.01
32	002384	东山精密	2,100	30,597.00	0.01
33	002075	沙钢股份	3,900	30,576.00	0.01
34	600779	水井坊	600	30,492.00	0.01
35	000998	隆平高科	2,100	30,408.00	0.01
36	002299	圣农发展	1,200	30,384.00	0.01
37	600801	华新水泥	1,480	29,970.00	0.01
38	600745	闻泰科技	900	29,898.00	0.01
39	600460	士兰微	1,800	29,880.00	0.01

40	600161	天坛生物	1,180	29,795.00	0.01
41	600879	航天电子	4,800	29,568.00	0.01
42	002223	鱼跃医疗	1,200	29,544.00	0.01
43	002821	凯莱英	300	29,424.00	0.01
44	002268	卫士通	1,200	29,340.00	0.01
45	002500	山西证券	3,600	29,160.00	0.01
46	002385	大北农	5,400	28,566.00	0.01
47	002797	第一创业	4,500	28,530.00	0.01
48	000988	华工科技	1,800	28,476.00	0.01
49	002926	华西证券	2,700	28,350.00	0.01
50	000723	美锦能源	2,700	28,215.00	0.01
51	600325	华发股份	3,600	28,116.00	0.01
52	600848	上海临港	900	28,017.00	0.01
53	002572	索菲亚	1,500	27,840.00	0.01
54	601128	常熟银行	3,600	27,792.00	0.01
55	600528	中铁工业	2,400	27,768.00	0.01
56	600497	驰宏锌锗	5,400	27,432.00	0.01
57	300168	万达信息	2,100	27,237.00	0.01
58	600584	长电科技	2,100	26,985.00	0.01
59	601168	西部矿业	4,200	26,796.00	0.01
60	000778	新兴铸管	6,000	26,640.00	0.01
61	600763	通策医疗	300	26,577.00	0.01
62	600392	盛和资源	2,400	26,544.00	0.01
63	600820	隧道股份	4,200	26,502.00	0.01
64	002916	深南电路	260	26,499.20	0.01
65	000686	东北证券	3,000	26,430.00	0.01
66	000999	华润三九	900	26,406.00	0.01
67	002092	中泰化学	3,300	26,268.00	0.01
68	600673	东阳光	3,300	25,905.00	0.01
69	600549	厦门钨业	1,800	25,758.00	0.01
70	600410	华胜天成	2,400	25,752.00	0.01
71	000009	中国宝安	4,500	25,695.00	0.01
72	002373	千方科技	1,500	25,650.00	0.01
73	600699	均胜电子	1,200	25,632.00	0.01
74	600909	华安证券	3,900	25,506.00	0.01
75	600875	东方电气	2,400	25,488.00	0.01
76	000997	新大陆	1,500	25,335.00	0.01
77	000060	中金岭南	5,400	25,326.00	0.01
77	601005	重庆钢铁	12,600	25,326.00	0.01
78	000690	宝新能源	3,900	25,116.00	0.01
79	002372	伟星新材	1,440	25,056.00	0.01

80	600572	康恩贝	3,900	24,960.00	0.01
81	600166	福田汽车	10,200	24,174.00	0.01
82	600376	首开股份	2,700	24,111.00	0.01
83	600959	江苏有线	5,400	24,030.00	0.01
84	600260	凯乐科技	1,200	23,976.00	0.01
85	600839	四川长虹	8,100	23,895.00	0.01
86	300009	安科生物	1,500	23,850.00	0.01
87	002281	光迅科技	900	23,832.00	0.01
88	601866	中远海发	8,700	23,664.00	0.01
89	002074	国轩高科	1,800	23,598.00	0.01
90	600022	山东钢铁	14,100	23,547.00	0.01
91	002387	维信诺	1,800	23,490.00	0.01
92	000960	锡业股份	2,100	23,457.00	0.01
93	600811	东方集团	6,300	23,436.00	0.01
94	603517	绝味食品	600	23,346.00	0.01
95	600755	厦门国贸	2,700	23,301.00	0.01
96	601333	广深铁路	7,200	23,256.00	0.01
97	600567	山鹰纸业	6,900	23,253.00	0.01
98	600718	东软集团	1,800	23,076.00	0.01
99	000039	中集集团	2,160	23,068.80	0.01
100	000547	航天发展	2,400	22,944.00	0.01
101	000830	鲁西化工	2,100	22,848.00	0.01
102	600266	北京城建	2,820	22,729.20	0.01
103	002670	国盛金控	1,800	22,680.00	0.01
104	600804	鹏博士	3,000	22,560.00	0.01
105	002078	太阳纸业	3,300	22,473.00	0.01
106	600881	亚泰集团	6,900	22,425.00	0.01
107	002191	劲嘉股份	1,800	22,338.00	0.01
108	000581	威孚高科	1,200	22,272.00	0.01
109	601872	招商轮船	5,100	22,236.00	0.01
110	600845	宝信软件	780	22,214.40	0.01
111	600079	人福医药	2,100	22,050.00	0.01
112	600885	宏发股份	900	21,870.00	0.01
113	603077	和邦生物	11,400	21,660.00	0.01
114	300001	特锐德	1,200	21,624.00	0.01
115	600258	首旅酒店	1,200	21,576.00	0.01
115	600435	北方导航	2,400	21,576.00	0.01
116	002217	合力泰	3,900	21,567.00	0.01
117	600037	歌华有线	2,100	21,525.00	0.01
118	600808	马钢股份	6,300	21,483.00	0.01
119	601699	潞安环能	2,700	21,438.00	0.01

120	603000	人民网	1,200	21,396.00	0.01
121	600160	巨化股份	3,000	21,330.00	0.01
122	002038	双鹭药业	900	21,204.00	0.01
123	600521	华海药业	1,500	21,150.00	0.01
124	603939	益丰药房	300	20,997.00	0.01
125	002273	水晶光电	1,800	20,844.00	0.01
126	600021	上海电力	2,400	20,832.00	0.01
126	600737	中粮糖业	2,400	20,832.00	0.01
127	002353	杰瑞股份	900	20,790.00	0.01
128	002371	北方华创	300	20,775.00	0.01
129	600094	大名城	3,300	20,757.00	0.01
130	300207	欣旺达	1,800	20,736.00	0.01
131	300315	掌趣科技	6,000	20,700.00	0.01
132	002221	东华能源	2,400	20,664.00	0.01
133	300027	华谊兄弟	4,200	20,622.00	0.01
134	002607	中公教育	1,500	20,595.00	0.01
135	600466	蓝光发展	3,300	20,526.00	0.01
136	002589	瑞康医药	2,700	20,493.00	0.01
137	000970	中科三环	1,800	20,430.00	0.01
138	002002	鸿达兴业	3,300	20,427.00	0.01
139	002174	游族网络	1,200	20,256.00	0.01
140	600967	内蒙一机	1,800	20,160.00	0.01
141	600143	金发科技	4,106	20,119.40	0.01
142	600643	爱建集团	2,100	20,118.00	0.01
143	000983	西山煤电	3,300	19,998.00	0.01
144	600282	南钢股份	5,700	19,950.00	0.01
145	000513	丽珠集团	600	19,938.00	0.01
146	000729	燕京啤酒	3,000	19,920.00	0.01
147	000732	泰禾集团	1,200	19,800.00	0.01
148	600863	内蒙华电	6,300	19,782.00	0.01
149	300088	长信科技	3,900	19,734.00	0.01
150	002085	万丰奥威	2,700	19,656.00	0.01
151	300274	阳光电源	2,100	19,635.00	0.01
152	002690	美亚光电	600	19,560.00	0.01
153	600171	上海贝岭	1,200	19,500.00	0.01
154	002131	利欧股份	10,200	19,482.00	0.01
155	600026	中远海能	3,000	19,470.00	0.01
156	600064	南京高科	1,800	19,278.00	0.01
157	000878	云南铜业	1,800	19,134.00	0.01
158	002110	三钢闽光	2,050	19,065.00	0.01
159	300316	晶盛机电	1,500	19,035.00	0.01

160	601098	中南传媒	1,500	18,960.00	0.01
161	002399	海普瑞	900	18,891.00	0.01
162	600648	外高桥	900	18,882.00	0.01
163	600373	中文传媒	1,500	18,840.00	0.01
163	601106	中国一重	6,000	18,840.00	0.01
164	601100	恒立液压	600	18,828.00	0.01
165	601718	际华集团	4,800	18,768.00	0.01
166	002440	闰土股份	1,500	18,690.00	0.01
166	600315	上海家化	600	18,690.00	0.01
167	000089	深圳机场	2,100	18,669.00	0.01
168	000563	陕国投 A	4,200	18,648.00	0.01
169	600388	龙净环保	1,500	18,585.00	0.01
170	601118	海南橡胶	3,600	18,540.00	0.01
171	002152	广电运通	2,700	18,495.00	0.01
172	300166	东方国信	1,500	18,435.00	0.01
173	002019	亿帆医药	1,500	18,375.00	0.01
174	000883	湖北能源	4,200	18,228.00	0.01
175	002368	太极股份	600	18,180.00	0.01
176	600380	健康元	2,100	18,165.00	0.01
177	000636	风华高科	1,500	18,150.00	0.01
178	600729	重庆百货	600	18,144.00	0.01
179	601231	环旭电子	1,500	18,075.00	0.01
180	000559	万向钱潮	3,000	17,940.00	0.01
181	000598	兴蓉环境	3,900	17,745.00	0.01
182	000826	启迪桑德	1,500	17,685.00	0.01
183	600827	百联股份	1,800	17,658.00	0.01
184	603883	老百姓	300	17,544.00	0.01
185	002233	塔牌集团	1,500	17,520.00	0.01
186	600039	四川路桥	4,800	17,472.00	0.01
187	600649	城投控股	2,700	17,469.00	0.01
188	000681	视觉中国	900	17,442.00	0.01
189	000877	天山股份	1,500	17,430.00	0.01
190	600748	上实发展	2,100	17,409.00	0.01
191	601000	唐山港	6,300	17,325.00	0.01
192	002414	高德红外	900	17,280.00	0.01
193	300182	捷成股份	3,900	17,199.00	0.01
194	000932	华菱钢铁	3,580	17,076.60	0.01
195	600008	首创股份	4,800	16,896.00	0.01
196	600633	浙数文化	1,800	16,830.00	0.01
197	000027	深圳能源	2,700	16,740.00	0.01
198	601179	中国西电	4,500	16,650.00	0.01



199	002250	联化科技	1,500	16,635.00	0.01
200	600782	新钢股份	3,300	16,500.00	0.01
201	603501	韦尔股份	300	16,473.00	0.01
202	000758	中色股份	3,000	16,470.00	0.01
203	600486	扬农化工	300	16,410.00	0.01
204	601678	滨化股份	2,400	16,224.00	0.01
205	600056	中国医药	1,200	16,188.00	0.01
206	300133	华策影视	2,400	16,152.00	0.01
207	600155	华创阳安	1,200	16,116.00	0.01
208	600598	北大荒	1,500	16,095.00	0.01
209	600167	联美控股	1,520	16,081.60	0.01
210	000488	晨鸣纸业	3,000	16,080.00	0.01
210	000738	航发控制	1,200	16,080.00	0.01
211	002004	华邦健康	3,300	16,038.00	0.01
212	000008	神州高铁	4,200	15,834.00	0.01
213	002183	怡亚通	3,300	15,741.00	0.01
214	603885	吉祥航空	1,200	15,720.00	0.01
215	600348	阳泉煤业	2,700	15,687.00	0.01
215	600500	中化国际	2,100	15,687.00	0.01
216	002266	浙富控股	3,300	15,675.00	0.01
217	600777	新潮能源	7,500	15,600.00	0.00
218	601608	中信重工	3,600	15,552.00	0.00
219	600060	海信电器	1,800	15,516.00	0.00
220	600418	江淮汽车	3,000	15,480.00	0.00
221	000807	云铝股份	3,300	15,477.00	0.00
222	300418	昆仑万维	1,200	15,444.00	0.00
223	600970	中材国际	2,400	15,432.00	0.00
224	000031	大悦城	2,400	15,408.00	0.00
225	000685	中山公用	1,800	15,372.00	0.00
225	300058	蓝色光标	3,600	15,372.00	0.00
226	600216	浙江医药	1,500	15,360.00	0.00
227	600158	中体产业	1,500	15,345.00	0.00
228	601966	玲珑轮胎	900	15,300.00	0.00
229	300244	迪安诊断	900	15,282.00	0.00
229	600409	三友化工	2,700	15,282.00	0.00
230	600138	中青旅	1,200	15,228.00	0.00
231	600823	世茂股份	3,300	15,213.00	0.00
232	600525	长园集团	2,400	15,168.00	0.00
233	600580	卧龙电驱	1,800	15,138.00	0.00
234	600062	华润双鹤	1,200	15,132.00	0.00
235	002640	跨境通	1,800	14,994.00	0.00

236	600120	浙江东方	1,170	14,905.80	0.00
237	000301	东方盛虹	2,700	14,823.00	0.00
238	600754	锦江股份	600	14,784.00	0.00
239	600507	方大特钢	1,500	14,670.00	0.00
240	600277	亿利洁能	3,000	14,610.00	0.00
241	000887	中鼎股份	1,500	14,385.00	0.00
242	002407	多氟多	1,200	14,208.00	0.00
243	300113	顺网科技	900	14,112.00	0.00
244	300010	立思辰	1,500	14,085.00	0.00
245	601958	金钼股份	2,100	14,070.00	0.00
246	601880	大连港	6,600	14,058.00	0.00
247	002812	恩捷股份	300	14,025.00	0.00
248	002701	奥瑞金	3,000	14,010.00	0.00
249	600307	酒钢宏兴	6,900	14,007.00	0.00
250	601611	中国核建	1,800	14,004.00	0.00
251	000528	柳工	2,100	13,986.00	0.00
252	300134	大富科技	900	13,977.00	0.00
253	002603	以岭药业	1,200	13,896.00	0.00
254	600717	天津港	2,160	13,867.20	0.00
255	600312	平高电气	1,800	13,842.00	0.00
256	600073	上海梅林	1,500	13,800.00	0.00
257	600511	国药股份	600	13,782.00	0.00
258	002051	中工国际	1,200	13,764.00	0.00
259	000813	德展健康	1,800	13,716.00	0.00
260	002244	滨江集团	3,300	13,695.00	0.00
261	002056	横店东磁	1,800	13,680.00	0.00
262	600859	王府井	900	13,671.00	0.00
263	600664	哈药股份	3,300	13,662.00	0.00
264	600125	铁龙物流	2,100	13,545.00	0.00
265	000090	天健集团	2,730	13,486.20	0.00
266	300026	红日药业	3,900	13,455.00	0.00
267	600478	科力远	2,400	13,416.00	0.00
268	600557	康缘药业	900	13,374.00	0.00
269	002302	西部建设	1,200	13,368.00	0.00
270	002665	首航节能	3,900	13,221.00	0.00
271	000156	华数传媒	1,200	13,212.00	0.00
272	002176	江特电机	2,700	13,149.00	0.00
273	300002	神州泰岳	3,300	13,134.00	0.00
274	002470	金正大	3,600	13,104.00	0.00
275	002426	胜利精密	5,100	13,056.00	0.00
276	603233	大参林	290	13,050.00	0.00

277	002128	露天煤业	1,500	12,975.00	0.00
278	300197	铁汉生态	3,600	12,924.00	0.00
279	600597	光明乳业	1,200	12,900.00	0.00
280	600316	洪都航空	900	12,879.00	0.00
281	002030	达安基因	1,200	12,876.00	0.00
282	603228	景旺电子	320	12,803.20	0.00
283	600884	杉杉股份	1,200	12,780.00	0.00
284	002317	众生药业	1,500	12,765.00	0.00
285	600759	洲际油气	3,300	12,738.00	0.00
286	300115	长盈精密	1,200	12,588.00	0.00
287	000028	国药一致	300	12,549.00	0.00
288	000727	华东科技	6,000	12,540.00	0.00
289	000078	海王生物	3,600	12,528.00	0.00
290	002242	九阳股份	600	12,486.00	0.00
291	000926	福星股份	1,800	12,456.00	0.00
292	600582	天地科技	3,600	12,420.00	0.00
293	600751	海航科技	3,900	12,402.00	0.00
294	600563	法拉电子	300	12,351.00	0.00
295	600141	兴发集团	1,200	12,336.00	0.00
296	002212	南洋股份	900	12,330.00	0.00
297	600565	迪马股份	3,300	12,309.00	0.00
298	600575	皖江物流	4,200	12,306.00	0.00
299	600017	日照港	3,900	12,285.00	0.00
300	000021	深科技	1,500	12,195.00	0.00
301	002358	森源电气	1,200	12,180.00	0.00
302	002285	世联行	2,700	12,177.00	0.00
303	300324	旋极信息	2,100	12,159.00	0.00
304	002491	通鼎互联	1,500	12,135.00	0.00
305	601928	凤凰传媒	1,500	12,105.00	0.00
306	600259	广晟有色	300	12,090.00	0.00
307	002280	联络互动	3,300	12,078.00	0.00
308	002573	清新环境	1,500	12,075.00	0.00
309	600291	西水股份	1,200	12,072.00	0.00
310	600770	综艺股份	1,800	12,024.00	0.00
311	600267	海正药业	1,200	12,000.00	0.00
312	601717	郑煤机	2,100	11,991.00	0.00
313	002444	巨星科技	1,200	11,976.00	0.00
313	603888	新华网	600	11,976.00	0.00
314	000717	韶钢松山	2,700	11,961.00	0.00
315	002028	思源电气	1,200	11,952.00	0.00
316	002424	贵州百灵	1,200	11,856.00	0.00

317	600908	无锡银行	2,100	11,844.00	0.00
318	601200	上海环境	870	11,840.70	0.00
319	600499	科达洁能	2,700	11,826.00	0.00
320	002839	张家港行	2,100	11,823.00	0.00
321	002505	大康农业	6,000	11,820.00	0.00
322	002419	天虹股份	900	11,754.00	0.00
323	002249	大洋电机	2,700	11,718.00	0.00
324	601019	山东出版	1,500	11,670.00	0.00
325	000959	首钢股份	3,300	11,616.00	0.00
326	000519	中兵红箭	1,500	11,595.00	0.00
327	600317	营口港	4,200	11,592.00	0.00
328	000712	锦龙股份	900	11,556.00	0.00
329	000006	深振业 A	2,100	11,445.00	0.00
330	000718	苏宁环球	3,300	11,418.00	0.00
331	000158	常山北明	2,100	11,382.00	0.00
332	000980	众泰汽车	2,700	11,367.00	0.00
333	002807	江阴银行	2,420	11,325.60	0.00
334	000543	皖能电力	2,400	11,304.00	0.00
335	601869	长飞光纤	300	11,250.00	0.00
336	002366	台海核电	1,200	11,232.00	0.00
337	600611	大众交通	2,400	11,160.00	0.00
338	002093	国脉科技	1,200	11,148.00	0.00
339	600765	中航重机	1,200	11,076.00	0.00
340	002390	信邦制药	2,100	11,067.00	0.00
341	603806	福斯特	300	11,019.00	0.00
342	000012	南玻 A	2,640	10,982.40	0.00
343	600901	江苏租赁	1,800	10,962.00	0.00
344	601326	秦港股份	3,000	10,890.00	0.00
345	300308	中际旭创	320	10,876.80	0.00
346	000400	许继电气	1,200	10,872.00	0.00
347	600151	航天机电	2,100	10,815.00	0.00
348	600862	中航高科	1,200	10,788.00	0.00
349	603198	迎驾贡酒	600	10,746.00	0.00
350	002831	裕同科技	560	10,735.20	0.00
351	300055	万邦达	1,500	10,695.00	0.00
352	002431	棕榈股份	2,700	10,665.00	0.00
353	600993	马应龙	600	10,590.00	0.00
354	002745	木林森	900	10,548.00	0.00
355	600169	太原重工	3,900	10,413.00	0.00
356	600645	中源协和	600	10,386.00	0.00
357	300376	易事特	2,100	10,353.00	0.00

358	600787	中储股份	1,800	10,314.00	0.00
359	603816	顾家家居	320	10,214.40	0.00
360	002672	东江环保	900	10,206.00	0.00
361	000564	供销大集	3,900	10,179.00	0.00
362	600978	宜华生活	2,700	10,152.00	0.00
363	002332	仙琚制药	1,500	10,140.00	0.00
364	000600	建投能源	1,500	10,050.00	0.00
365	000848	承德露露	1,200	9,996.00	0.00
366	600835	上海机电	600	9,960.00	0.00
367	000990	诚志股份	600	9,846.00	0.00
368	600393	粤泰股份	2,100	9,765.00	0.00
368	601311	骆驼股份	900	9,765.00	0.00
369	002048	宁波华翔	900	9,738.00	0.00
370	600639	浦东金桥	600	9,702.00	0.00
371	000501	鄂武商 A	900	9,675.00	0.00
371	603515	欧普照明	300	9,675.00	0.00
372	000869	张裕 A	300	9,636.00	0.00
373	600006	东风汽车	1,800	9,594.00	0.00
374	601016	节能风电	3,600	9,576.00	0.00
375	300266	兴源环境	2,100	9,534.00	0.00
376	300287	飞利信	2,400	9,528.00	0.00
377	002254	泰和新材	900	9,522.00	0.00
378	002815	崇达技术	600	9,354.00	0.00
379	600458	时代新材	900	9,351.00	0.00
380	000937	冀中能源	2,400	9,264.00	0.00
381	601689	拓普集团	600	9,192.00	0.00
382	600623	华谊集团	1,200	9,168.00	0.00
382	603377	东方时尚	600	9,168.00	0.00
383	002503	搜于特	3,300	9,075.00	0.00
384	300297	蓝盾股份	1,500	9,045.00	0.00
385	600416	湘电股份	1,500	9,030.00	0.00
386	300159	新研股份	1,800	8,964.00	0.00
387	002375	亚厦股份	1,500	8,865.00	0.00
388	603766	隆鑫通用	2,100	8,799.00	0.00
389	600329	中新药业	600	8,574.00	0.00
390	600545	卓郎智能	1,200	8,532.00	0.00
391	603056	德邦股份	600	8,448.00	0.00
392	600694	大商股份	300	8,373.00	0.00
393	600195	中牧股份	600	8,310.00	0.00
394	000537	广宇发展	1,200	8,304.00	0.00
395	002382	蓝帆医疗	600	8,292.00	0.00

396	300199	翰宇药业	900	8,253.00	0.00
397	601001	大同煤业	1,800	8,226.00	0.00
398	600757	长江传媒	1,200	8,172.00	0.00
399	002434	万里扬	1,200	8,148.00	0.00
400	002512	达华智能	1,800	8,136.00	0.00
400	600869	智慧能源	1,800	8,136.00	0.00
401	002635	安洁科技	600	8,094.00	0.00
402	002118	紫鑫药业	1,200	8,088.00	0.00
403	000426	兴业矿业	1,500	8,055.00	0.00
404	002509	天广中茂	3,900	8,034.00	0.00
405	600640	号百控股	600	8,028.00	0.00
406	002489	浙江永强	2,400	8,016.00	0.00
407	000541	佛山照明	1,500	7,860.00	0.00
407	601127	小康股份	600	7,860.00	0.00
408	600903	贵州燃气	600	7,818.00	0.00
409	002544	杰赛科技	600	7,800.00	0.00
409	002941	新疆交建	300	7,800.00	0.00
410	002948	青岛银行	1,200	7,716.00	0.00
411	002517	恺英网络	2,400	7,656.00	0.00
412	002681	奋达科技	1,800	7,632.00	0.00
413	600058	五矿发展	900	7,605.00	0.00
414	000062	深圳华强	570	7,575.30	0.00
415	000536	华映科技	3,000	7,560.00	0.00
416	600707	彩虹股份	1,500	7,515.00	0.00
417	600874	创业环保	900	7,461.00	0.00
418	600657	信达地产	1,800	7,416.00	0.00
419	600098	广州发展	1,200	7,392.00	0.00
420	002707	众信旅游	1,200	7,284.00	0.00
421	002709	天赐材料	300	7,260.00	0.00
422	600971	恒源煤电	1,240	7,254.00	0.00
423	601801	皖新传媒	1,200	7,212.00	0.00
424	600350	山东高速	1,500	7,200.00	0.00
425	002251	步步高	900	7,173.00	0.00
426	600750	江中药业	550	7,155.50	0.00
427	002437	誉衡药业	1,800	7,110.00	0.00
428	002344	海宁皮城	1,500	6,990.00	0.00
428	600053	九鼎投资	300	6,990.00	0.00
429	000829	天音控股	1,200	6,984.00	0.00
430	601003	柳钢股份	1,200	6,948.00	0.00
431	300459	金科文化	1,200	6,828.00	0.00
431	601139	深圳燃气	1,200	6,828.00	0.00

432	002920	德赛西威	300	6,720.00	0.00
433	600428	中远海特	1,800	6,660.00	0.00
434	300257	开山股份	600	6,648.00	0.00
435	603568	伟明环保	305	6,563.60	0.00
436	002818	富森美	510	6,543.30	0.00
437	000552	靖远煤电	2,400	6,504.00	0.00
437	601615	明阳智能	600	6,504.00	0.00
438	600996	贵广网络	600	6,468.00	0.00
439	601777	力帆股份	1,500	6,435.00	0.00
440	600335	国机汽车	900	6,228.00	0.00
441	000587	金洲慈航	2,400	6,192.00	0.00
442	603328	依顿电子	600	6,162.00	0.00
443	000766	通化金马	900	6,120.00	0.00
444	002936	郑州银行	1,200	6,096.00	0.00
445	600939	重庆建工	1,200	5,868.00	0.00
446	002482	广田集团	1,200	5,832.00	0.00
447	002416	爱施德	900	5,625.00	0.00
448	600126	杭钢股份	1,200	5,472.00	0.00
449	000987	越秀金控	600	5,412.00	0.00
450	002699	美盛文化	900	5,400.00	0.00
451	601969	海南矿业	900	5,292.00	0.00
452	600179	ST安通	1,800	5,274.00	0.00
453	002946	新乳业	300	4,542.00	0.00
454	600280	中央商场	1,200	4,308.00	0.00
455	600338	西藏珠峰	240	4,195.20	0.00
456	603556	海兴电力	300	4,146.00	0.00
457	601068	中铝国际	600	4,140.00	0.00
458	603225	新凤鸣	320	3,996.80	0.00
459	000761	本钢板材	900	3,870.00	0.00
460	601811	新华文轩	300	3,663.00	0.00
461	600985	淮北矿业	300	3,402.00	0.00
462	600917	重庆燃气	300	2,088.00	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	300347	泰格医药	204,164.00	0.09
2	600201	生物股份	162,467.00	0.07
3	300146	汤臣倍健	158,317.00	0.07

4	002410	广联达	155,009.00	0.07
5	000860	顺鑫农业	146,987.00	0.06
6	600872	中炬高新	146,686.00	0.06
7	000656	金科股份	145,331.00	0.06
8	600426	华鲁恒升	142,254.00	0.06
9	002129	中环股份	142,249.00	0.06
10	600600	青岛啤酒	141,358.00	0.06
11	600256	广汇能源	141,312.00	0.06
12	600779	水井坊	141,237.00	0.06
13	000750	国海证券	140,772.00	0.06
14	002195	二三四五	140,388.00	0.06
15	600895	张江高科	138,340.00	0.06
16	300253	卫宁健康	137,646.00	0.06
17	300383	光环新网	137,139.00	0.06
18	000623	吉林敖东	136,381.00	0.06
19	002049	紫光国微	135,418.00	0.06
20	002439	启明星辰	129,193.00	0.05

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	300347	泰格医药	75,976.00	0.03
2	002410	广联达	57,150.00	0.02
3	600600	青岛啤酒	55,455.00	0.02
4	300146	汤臣倍健	52,291.00	0.02
5	000418	小天鹅 A	49,770.39	0.02
6	000656	金科股份	49,760.00	0.02
7	600256	广汇能源	46,296.00	0.02
8	002507	涪陵榨菜	45,702.00	0.02
9	000596	古井贡酒	41,787.00	0.02
10	002064	华峰氨纶	34,742.00	0.01
11	603658	安图生物	31,376.00	0.01
12	002013	中航机电	31,310.00	0.01
13	000025	特力 A	31,293.20	0.01
14	603899	晨光文具	30,988.00	0.01
15	600655	豫园股份	30,055.00	0.01
16	600779	水井坊	27,606.00	0.01
17	000930	中粮生化	25,205.00	0.01
18	601598	XD 中国外	24,734.00	0.01
19	002583	海能达	24,677.00	0.01



20	603355	莱克电气	23,655.00	0.01
----	--------	------	-----------	------

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	32,746,655.80
卖出股票收入(成交)总额	4,341,526.40

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	股票型指数基金	交易型开放式(ETF)	景顺长城基金管理有限公司	284,032,800.00	90.88

### 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.11.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的频率和交易成本。

## 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12.3 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。

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1

1、正邦科技股份有限公司（以下简称“正邦科技”，股票代码：002157）下属公司肇东正邦养殖有限公司配套的环境保护设施未进行验收擅自进行投产，并且向厂区草地排放养殖废水，排放废水 COD 超过《农田灌溉水质标准》(GB5084-2005)中旱作限制要求。肇东正邦养殖有限公司配套的环境保护污水处理设施未运行，氧化塘防渗膜破损严重，企业向场区北侧草甸排放未经处理的污水。于 2018 年 7 月 20 日收到肇东市环境保护局处罚决定书，责令其自接到决定书之日起 10 日内超标废水抽回氧化塘待处理，90 日内完成环保设施的修复并完成验收；罚款人民币合计壹佰万元整，责令改正违法行为，立即制定环保整改计划。

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正邦科技进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.13.2

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。

### 7.13.3 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	17,826.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,701.53
5	应收申购款	394,002.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	415,530.81
---	----	------------

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 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。

#### 7.13.6 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 (%)
17,465	26,055.64	310,781,812.59	68.29	144,279,987.55	31.71

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,795.28	0.00

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年6月29日）基金份额总额	213,867,925.87
本报告期期初基金份额总额	409,185,188.58
本报告期基金总申购份额	115,021,470.90
减：本报告期基金总赎回份额	69,144,859.34
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	455,061,800.14

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人无重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼，报告期内基金管理人无涉及基金财产的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员、托管人托管业务部门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	
海通证券股份有限公司	3	18,586,771.65	50.21%	17,310.64	50.21%	-
长城证券股份有限公司	3	16,979,343.57	45.87%	15,815.64	45.88%	-
中信建投证券股份有限公司	2	1,448,420.20	3.91%	1,348.83	3.91%	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	本期新增
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注:基金专用交易单元的选择标准和程序如下:

1) 选择标准:

- a、资金实力雄厚, 信誉良好;
- b、财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定;
- c、经营行为规范, 最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚;
- d、内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足本基金运作高度保密的要求;
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务, 包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求, 提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后, 确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证成交总	成交金额	占当期基金成交总

		额的比例		额的比例		额的比例		额的比例
海通证券股份有限公司	1,567.93	100.00%	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年第 4 季度报告	证券时报	2019-01-21
2	景顺长城基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	证券时报	2019-01-30
3	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	证券时报	2019-02-01
4	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年第 1 号更新招募说明书摘要	证券时报	2019-02-12
5	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年第 1 号更新招募说明书	证券时报	2019-02-12

6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-02-23
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳盈信基金销售有限公司基金转换费率优惠活动的公告	证券时报	2019-02-27
8	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年年度报告	证券时报	2019-03-26
9	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018 年年度报告摘要	证券时报	2019-03-26
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报	2019-04-01
11	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-04-03
12	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	证券时报	2019-04-04
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加玄元保险基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报	2019-04-04
14	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险为销售机构并开通基金“定期定额投资业务”和基金转换业务的公告	证券时报	2019-04-04
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-04-08
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-04-11
17	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	证券时报	2019-04-16
18	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2019 年第 1 季度报告	证券时报	2019-04-20
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-05-09
20	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	证券时报	2019-05-13
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国民生银行直销银行“基金通”平台基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报	2019-05-16
22	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-05-20
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	证券时报	2019-06-04
24	景顺长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报	2019-06-15
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告	证券时报	2019-06-21
26	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	证券时报	2019-06-25
27	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统中国工商银行渠道暂停服务的公告	证券时报	2019-06-26
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行基金定期定额投资申购费率优惠活动的公告	证券时报	2019-06-27

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集注册的文件；

2、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

3、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；

4、《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

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

2019 年 8 月 23 日