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
2020年中期报告

2020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：2020年8月24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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 20 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 7

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

§4 管理人报告 8

4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 12
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 13
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 14

§5 托管人报告 14

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14

6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 18

§7 投资组合报告 36

7.1 期末基金资产组合情况 36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 36
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 37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50

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 50
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 50
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 50
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 50
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 50
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 51
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 51
7.13 投资组合报告附注 51

§8 基金份额持有人信息 52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 52
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 52

§9 开放式基金份额变动 52

§10 重大事件揭示 53

10.1 基金份额持有人大会决议 53
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 53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 53
10.4 基金投资策略的改变 53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 53
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 53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 53
10.8 其他重大事件 55

§11 影响投资者决策的其他重要信息 58

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 58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 59

§12 备查文件目录 59

12.1 备查文件目录 59
12.2 存放地点 59
12.3 查阅方式 59

§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
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	216,857,367.88 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
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 个交易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	许俊
	联系电话	0755-82370388	010-66594319
	电子邮箱	investor@igwfmc.com	fcid@bankofchina.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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfmc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-19,710,834.76
本期利润	25,430,899.22
加权平均基金份额本期利润	0.0977
本期加权平均净值利润率	12.97%
本期基金份额净值增长率	11.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-40,539,902.04
期末可供分配基金份额利润	-0.1869
期末基金资产净值	176,317,465.84
期末基金份额净值	0.813
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-18.70%

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。

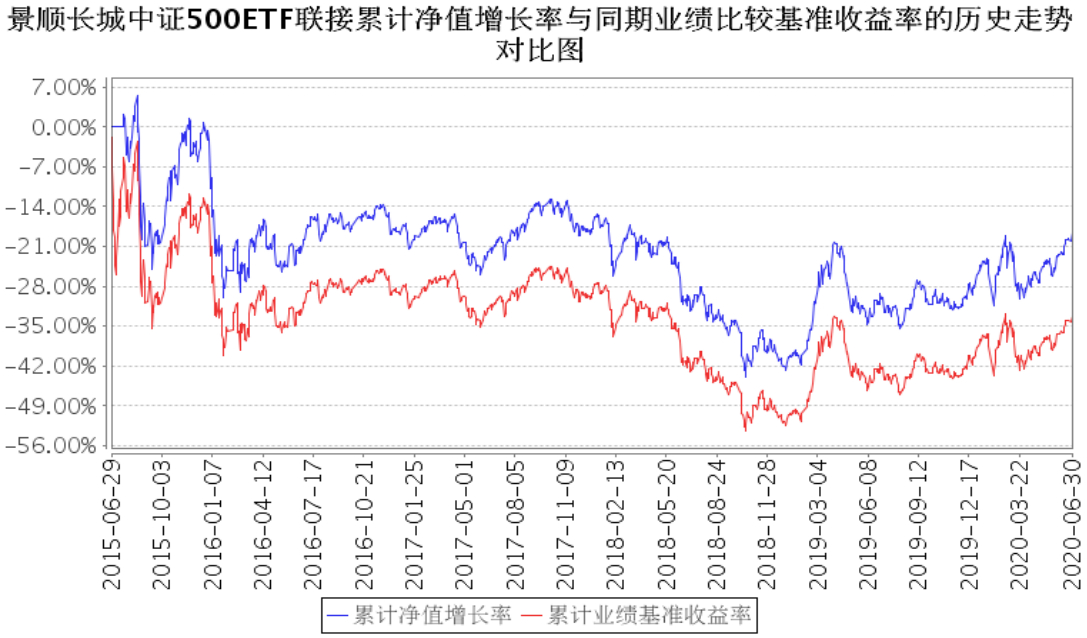
3.2 基金净值表现

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	8.11%	0.82%	8.04%	0.84%	0.07%	-0.02%
过去三个月	15.81%	1.06%	15.47%	1.08%	0.34%	-0.02%
过去六个月	11.68%	1.62%	10.84%	1.70%	0.84%	-0.08%

过去一年	18.34%	1.33%	17.63%	1.39%	0.71%	-0.06%
过去三年	2.14%	1.34%	-3.82%	1.39%	5.96%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-18.70%	1.51%	-33.28%	1.70%	14.58%	-0.19%

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



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 2020 年 6 月 30 日，景顺长城基金管理有限公司旗下共管理 96 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(QDII)、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、景顺长城绩优成长混合型证券投资基金、景顺长城中短债债券型证券投资基金、景顺长城中证沪港深红利成长低波动指数型证券投资基金、景顺长城稳健养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城创新成长混合型证券投资基金、景顺长城景泰纯利债券型证券投资基金、景顺长城养老目标日期 2045 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、景顺长城弘利 39 个月定期开放债券型证券投资基金、景顺长城品质成长混合型证券投资基金、景顺长城量化对冲策略三个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、景顺长城泰申回报混合型证券投资基金、景顺长城科技创新混合型证券投资基金、景顺长城价值领航两年持有期混合型证券投资基金、景顺长城景泰裕利纯债债券型证券投资基金、景顺长城核心优选一年持有期混合型证券投资基金、景顺长城中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金、景顺长城创业板综指增强型证券投资基金、景顺长城成长领航混合型证券投资基金、景顺长城景颐嘉利 6 个月持有期债券型证券投资基金、景顺长城中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、景顺长城科技创新三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金。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 13 日	2020 年 4 月 14 日	6	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。
张晓南	本基金的基金经理	2020 年 4 月 15 日	-	10	经济学硕士，CFA，FRM。曾先后担任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理；2020 年 2 月加入本公司，自 2020 年 4 月起担任 ETF 投资部基金经理。

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。

4.1.3 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》、《证券投资基金销售管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城中证 500 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 18 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交易所证券临近交易日同向交易和银行间债券 5 日内反向交易，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。

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

2020 年 5 月工业增加值当月同比 4.40%，前值 3.90%，复苏态势愈加明显。6 月 PMI 指数继续回升至 50.90，在 4 月、5 月下降后开始上升。5 月 PPI 同比-3.70%，环比-0.4%，跌幅扩大；5 月 CPI 同比上涨 2.40%，前值 3.30%，环比-0.8%，基本保持稳定。5 月 M2 同比增速 11.10%，M1 同比增速 6.80%，社会融资规模存量同比增长 3.24%，增速维持平稳。5 月末外汇储备 3.1 万亿美元。一季度受到新冠疫情的突发影响，A 股市场呈现出先跌后涨再跌的走势。二季度在“外防输入、内防反弹”的总体抗疫框架下，国内疫情基本得到控制，经济复苏态势明显。在此期间，上证综指、沪深 300、中证 500 和创业板指数收益率为 8.64%、13.33%、16.65%和 31.05%，行情分化较为明显。

随着新冠疫情在国内逐步得到控制，对国内经济冲击的影响也在逐渐减弱。从最近披露的各种宏观数据来看，基本经济形势已经开始逐渐好转，同时相关政策逐步发力，通过保障生产、促进消费等措施加快经济复苏。当前国外疫情仍未得到有效控制，且后续短期疫情消除的可能性不大，在严格防止疫情反弹并通过境外反向输入的考虑下，相关国家疫情对我国外需的冲击较大，部分加大了经济复苏的难度。今年《政府工作报告》未再提及 GDP 增长目标，取而代之的是把“六稳”、“六保”放在首位，尤其是将稳就业保民生放在首位，根本上也要求促进经济回稳、增长。同时叠加更为积极的财政政策和灵活适度的货币政策，全力为疫情后经济修复保驾护航。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2020 年上半年，本基金份额净值增长率为 11.68%，业绩比较基准收益率为 10.84%。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

展望下半年，短期疫情在全球蔓延的拐点暂未到来，外需的快速下落和部分产业链受外部较大冲击，对经济有较大影响。但随着《政府工作报告》的逐渐落实，积极财政政策的陆续出台和灵活货币政策的持续宽松，对经济有托底作用，稳就业保民生仍是政策底线。同时对资本市场的改革明确了目标，在科创板试点增量注册制改革的经验积累上，创业板试点存量市场的注册制改革，为全市场分阶段实现注册制改革目标迈出重要一步。中长期来看，虽然疫情对上半年全球经

济基本面造成较负面的影响，但考虑到中国在世界产业链中的重要地位，及疫情在中国政府强有力的防控措施下已得到控制，难以对中国中长期经济发展趋势形成实质性影响。我们对市场仍保持乐观，在整体经济复苏加快的基础上，资本市场仍有强大的吸引力。我们继续看好成长股在市场复苏阶段的表现，后续现金流好、股息率高、行业稳定增长且公司地位明确的股票更有优势。

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。

4.6 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	9,857,044.06	20,294,463.45
结算备付金		51,430.19	-
存出保证金		74,093.23	3,764.05
交易性金融资产	6.4.7.2	166,542,317.75	308,259,000.00
其中：股票投资		1,862,317.75	-
基金投资		164,680,000.00	308,259,000.00
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		1,396,594.79	31,295.10
应收利息	6.4.7.5	903.98	4,201.92
应收股利		-	-
应收申购款		275,656.81	262,715.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		178,198,040.81	328,855,440.10
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 6 月 30 日**	**上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,653,318.48	729,523.25
应付管理人报酬		4,744.28	9,883.34
应付托管费		948.86	1,976.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	10,273.92	7,883.52
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	211,289.43	177,417.29
负债合计		1,880,574.97	926,684.08
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	216,857,367.88	450,384,432.71
未分配利润	6.4.7.10	-40,539,902.04	-122,455,676.69
所有者权益合计		176,317,465.84	327,928,756.02
负债和所有者权益总计		178,198,040.81	328,855,440.10

注： 报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.813 元，基金份额总额 216,857,367.88 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年

		6 月 30 日	6 月 30 日
一、收入		25,933,661.63	42,552,961.83
1.利息收入		66,623.71	71,137.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	66,623.46	71,137.50
债券利息收入		0.25	0.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-19,337,754.18	-344,455.14
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-725,951.39	-421,928.41
基金投资收益	6.4.7.13	-18,629,444.08	-
债券投资收益	6.4.7.14	437.76	167.57
资产支持证券投资收益		-	-
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	17,203.53	77,305.70
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	45,141,733.98	42,735,301.18
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	63,058.12	90,977.93
减：二、费用		502,762.41	213,464.49
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	52,535.74	60,484.77
2．托管费	6.4.10.2.2	10,507.11	12,096.89
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.19	350,537.03	43,013.18
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	89,182.53	97,869.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,430,899.22	42,339,497.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,430,899.22	42,339,497.34

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	450,384,432.71	-122,455,676.69	327,928,756.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,430,899.22	25,430,899.22
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）	-233,527,064.83	56,484,875.43	-177,042,189.40
其中：1.基金申购款	40,226,421.54	-10,168,981.31	30,057,440.23
2.基金赎回款	-273,753,486.37	66,653,856.74	-207,099,629.63
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）	216,857,367.88	-40,539,902.04	176,317,465.84
项目	上年度可比期间 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

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《关于核准景顺长城中证 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 2020 年 8 月 20 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<年度报告和中期报告>》、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 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及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、债券的差价收入，股票的股息、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)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	9,857,044.06
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	9,857,044.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,816,801.03	1,862,317.75	45,516.72
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		167,443,883.66	164,680,000.00	-2,763,883.66
其他		-	-	-
合计		169,260,684.69	166,542,317.75	-2,718,366.94

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	873.92
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	-
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	-
应收出借证券利息	-
其他	30.06
合计	903.98

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	10,273.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,273.92

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,267.95
应付证券出借违约金	-
预提费用	207,021.48
合计	211,289.43

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	450,384,432.71	450,384,432.71
本期申购	40,226,421.54	40,226,421.54
本期赎回（以“-”号填列）	-273,753,486.37	-273,753,486.37
- 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	216,857,367.88	216,857,367.88

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	-39,367,170.01	-83,088,506.68	-122,455,676.69
本期利润	-19,710,834.76	45,141,733.98	25,430,899.22
本期基金份额交易产生的变动数	29,587,831.19	26,897,044.24	56,484,875.43
其中：基金申购款	-5,162,647.24	-5,006,334.07	-10,168,981.31
基金赎回款	34,750,478.43	31,903,378.31	66,653,856.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-29,490,173.58	-11,049,728.46	-40,539,902.04

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	66,032.09
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	115.26
其他	476.11
合计	66,623.46

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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-41,435.17
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-684,516.22
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-725,951.39

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	169,043,606.33
减：卖出股票成本总额	169,085,041.50

买卖股票差价收入	-41,435.17

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 2020年1月1日至2020年6月30日
申购基金份额总额	14,595,400.00
减：现金支付申购款总额	113,038.75
减：申购股票成本总额	15,166,877.47
申购差价收入	-684,516.22

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	184,641,413.18
减：卖出/赎回基金成本总额	203,270,857.26
基金投资收益	-18,629,444.08

6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,438.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,000.00
减：应收利息总额	0.25
买卖债券差价收入	437.76

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	17,203.53
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	17,203.53

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	45,141,733.98
股票投资	45,516.72
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	45,096,217.26
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	45,141,733.98

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	60,049.52
基金转换费收入	3,008.60
合计	63,058.12

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

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	344,667.33
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	5,869.70
其中：申购费	453.38
赎回费	5,416.32
合计	350,537.03

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,161.05
合计	89,182.53

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	77,932,054.47	45.27	16,979,343.57	45.87

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 2020年1月1日至2020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	72,580.31	45.27	4,651.13	45.27
关联方名称	上年度可比期间 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

注：1.上述佣金按市场佣金率计算。

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	52,535.74	60,484.77
其中：支付销售机构的客户维护费	93,363.38	88,682.05

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)X0.50%/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

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,507.11	12,096.89

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，则取零)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)X0.10%/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 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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

6.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	9,857,044.06	66,032.09	20,362,675.51	70,654.14

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有 100,000,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其份额的比例为 95.63%(2019 年 12 月 31 日：本基金持有 210,000,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 97.87%)。

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(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002500	山西证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 10 日	配股流通受限	5.00	6.54	330	1,650.00	2,158.20	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601880	大连港	2020 年 6 月 22 日	重大事项停牌	1.72	2020 年 7 月 8 日	1.89	3,100	5,302.00	5,332.00	-
002470	金正大	2020 年 6 月 30 日	重大事项停牌	2.27	2020 年 7 月 1 日	2.16	1,100	2,505.94	2,497.00	-

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，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和资

产支持证券（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时间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 2020 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	9,857,044.06	-	-	-	-	-	9,857,044.06
结算备付金	51,430.19	-	-	-	-	-	51,430.19
存出保证金	74,093.23	-	-	-	-	-	74,093.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	166,542,317.75	166,542,317.75
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	903.98	903.98
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	275,656.81	275,656.81
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,396,594.79	1,396,594.79
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	9,982,567.48	-	-	-	-	168,215,473.33	178,198,040.81
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,653,318.48	1,653,318.48

应付管理人报酬		-	-	-	-	4,744.28	4,744.28
应付托管费		-	-	-	-	948.86	948.86
应付证券清算款		-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款		-	-	-	-	-	-
应付销售服务费		-	-	-	-	-	-
应付交易费用		-	-	-	-	10,273.92	10,273.92
应付利息		-	-	-	-	-	-
应付利润		-	-	-	-	-	-
应交税费		-	-	-	-	-	-
其他负债		-	-	-	-	211,289.43	211,289.43
负债总计		-	-	-	-	1,880,574.97	1,880,574.97
利率敏感度缺口	9,982,567.48	-	-	-	-	-	-
上年度末 2019 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							
银行存款	20,294,463.45	-	-	-	-	-	20,294,463.45
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	3,764.05	-	-	-	-	-	3,764.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	308,259,000.00	308,259,000.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	4,201.92	4,201.92
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	262,715.58	262,715.58
应收证券清算款	-	-	-	-	-	31,295.10	31,295.10
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	20,298,227.50	-	-	-	-	308,557,212.60	328,855,440.10
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	729,523.25	729,523.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	9,883.34	9,883.34
应付托管费	-	-	-	-	-	1,976.68	1,976.68
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,883.52	7,883.52
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	177,417.29	177,417.29
负债总计	-	-	-	-	-	926,684.08	926,684.08
利率敏感度缺口	20,298,227.50	-	-	-	-	-	-

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，所面临的最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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019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	1,862,317.75	1.06	-	-
交易性金融资产—基金投资	164,680,000.00	93.40	308,259,000.00	94.00
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	166,542,317.75	94.46	308,259,000.00	94.00

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

	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 （2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日 ）
分析	沪深 300 指数上升 5%	8,528,618.05	15,275,267.97
	沪深 300 指数下降 5%	-8,528,618.05	-15,275,267.97

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 2020 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 166,532,330.55 元，第二层次的余额为 9,987.20 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 308,259,000.00 元，无第二或第三层次)。

(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和债券，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和债券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，确定相关股票和债券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 2020 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(2019 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)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	1,862,317.75	1.05
	其中：股票	1,862,317.75	1.05
2	基金投资	164,680,000.00	92.41
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	9,908,474.25	5.56
8	其他各项资产	1,747,248.81	0.98
9	合计	178,198,040.81	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	15,795.00	0.01
B	采矿业	41,533.50	0.02
C	制造业	1,113,352.25	0.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,772.40	0.02
E	建筑业	24,690.00	0.01
F	批发和零售业	111,007.40	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	40,796.80	0.02
H	住宿和餐饮业	5,849.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	191,537.80	0.11
J	金融业	85,784.00	0.05
K	房地产业	62,188.60	0.04
L	租赁和商务服务业	36,541.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	12,705.00	0.01

N	水利、环境和公共设施管理业	17,325.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,656.00	0.00
Q	卫生和社会工作	16,010.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	29,092.00	0.02
S	综合	14,682.00	0.01
	合计	1,862,317.75	1.06

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	002821	凯莱英	100	24,300.00	0.01
2	300253	卫宁健康	620	14,222.80	0.01
3	300558	贝达药业	100	13,998.00	0.01
4	002127	南极电商	600	12,702.00	0.01
5	601799	星宇股份	100	12,700.00	0.01
6	600529	山东药玻	200	11,600.00	0.01
7	600201	生物股份	400	11,136.00	0.01
8	002185	华天科技	800	10,824.00	0.01
9	300482	万孚生物	100	10,400.00	0.01
10	603659	璞泰来	100	10,302.00	0.01
11	300088	长信科技	900	10,080.00	0.01
12	300285	国瓷材料	300	10,053.00	0.01
13	002385	大北农	1,100	10,021.00	0.01
14	603883	老百姓	100	10,004.00	0.01
15	600298	安琪酵母	200	9,896.00	0.01
16	300012	华测检测	500	9,880.00	0.01
17	000513	丽珠集团	200	9,602.00	0.01
18	600739	辽宁成大	500	9,465.00	0.01
19	002131	利欧股份	2,400	9,264.00	0.01
20	600859	王府井	200	9,110.00	0.01
21	603939	益丰药房	100	9,100.00	0.01
22	600161	天坛生物	200	9,066.00	0.01
23	603882	金域医学	100	8,950.00	0.01
24	000636	风华高科	300	8,757.00	0.00
25	600521	华海药业	250	8,482.50	0.00
26	002439	启明星辰	200	8,414.00	0.00
27	600486	扬农化工	100	8,250.00	0.00

28	600079	人福医药	300	8,166.00	0.00
29	600511	国药股份	200	8,134.00	0.00
30	002074	国轩高科	300	8,052.00	0.00
31	600885	宏发股份	200	8,024.00	0.00
32	002212	南洋股份	300	7,974.00	0.00
33	600143	金发科技	600	7,902.00	0.00
34	300496	中科创达	100	7,770.00	0.00
35	002465	海格通信	600	7,764.00	0.00
36	000009	中国宝安	900	7,659.00	0.00
37	601099	太平洋	2,400	7,608.00	0.00
38	300207	欣旺达	400	7,560.00	0.00
39	002156	通富微电	300	7,515.00	0.00
40	601128	常熟银行	1,000	7,510.00	0.00
41	002075	沙钢股份	600	7,500.00	0.00
42	300418	昆仑万维	300	7,488.00	0.00
43	300630	普利制药	100	7,395.00	0.00
44	300315	掌趣科技	1,000	7,330.00	0.00
45	000988	华工科技	300	7,329.00	0.00
46	600132	重庆啤酒	100	7,300.00	0.00
47	002223	鱼跃医疗	200	7,280.00	0.00
48	002507	涪陵榨菜	200	7,202.00	0.00
49	002373	千方科技	300	7,197.00	0.00
50	600699	均胜电子	300	7,143.00	0.00
51	600801	华新水泥	300	7,113.00	0.00
52	603517	绝味食品	100	7,074.00	0.00
53	600426	华鲁恒升	400	7,072.00	0.00
54	002396	星网锐捷	200	7,066.00	0.00
55	300244	迪安诊断	200	7,060.00	0.00
56	002340	格林美	1,400	6,958.00	0.00
57	300595	欧普康视	100	6,934.00	0.00
58	002019	亿帆医药	300	6,891.00	0.00
59	002273	水晶光电	400	6,856.00	0.00
60	000547	航天发展	500	6,835.00	0.00
61	300474	景嘉微	100	6,730.00	0.00
62	300168	万达信息	300	6,621.00	0.00
63	002281	光迅科技	200	6,572.00	0.00
64	000021	深科技	300	6,549.00	0.00
65	002030	达安基因	240	6,547.20	0.00
66	002250	联化科技	300	6,540.00	0.00
67	600380	健康元	400	6,496.00	0.00
68	603707	健友股份	100	6,457.00	0.00
69	000975	银泰黄金	400	6,272.00	0.00

70	600779	水井坊	100	6,242.00	0.00
71	002603	以岭药业	200	6,238.00	0.00
72	002797	第一创业	900	6,228.00	0.00
73	300357	我武生物	100	6,225.00	0.00
74	300618	寒锐钴业	100	6,202.00	0.00
75	002353	杰瑞股份	200	6,200.00	0.00
76	600563	法拉电子	100	6,180.00	0.00
77	001914	招商积余	200	6,146.00	0.00
78	000050	深天马 A	400	6,144.00	0.00
79	002920	德赛西威	100	6,133.00	0.00
80	600895	张江高科	300	6,111.00	0.00
81	600037	歌华有线	400	6,080.00	0.00
82	000750	国海证券	1,400	6,076.00	0.00
83	002382	蓝帆医疗	200	6,022.00	0.00
84	300017	网宿科技	700	5,943.00	0.00
85	002294	信立泰	200	5,932.00	0.00
86	600667	太极实业	500	5,910.00	0.00
87	600845	宝信软件	100	5,908.00	0.00
88	002195	二三四五	2,100	5,901.00	0.00
89	300010	立思辰	300	5,871.00	0.00
90	002414	高德红外	200	5,856.00	0.00
91	000999	华润三九	200	5,838.00	0.00
92	002925	盈趣科技	100	5,794.00	0.00
93	603858	步长制药	200	5,770.00	0.00
94	300274	阳光电源	400	5,756.00	0.00
95	002078	太阳纸业	600	5,712.00	0.00
96	300070	碧水源	700	5,684.00	0.00
97	300271	华宇软件	200	5,642.00	0.00
98	300212	易华录	100	5,600.00	0.00
99	601689	拓普集团	200	5,580.00	0.00
100	300024	机器人	400	5,468.00	0.00
101	300058	蓝色光标	700	5,460.00	0.00
102	600410	华胜天成	400	5,440.00	0.00
103	002557	洽洽食品	100	5,419.00	0.00
104	300009	安科生物	300	5,370.00	0.00
105	601880	大连港	3,100	5,332.00	0.00
106	600642	申能股份	900	5,319.00	0.00
107	002926	华西证券	500	5,315.00	0.00
108	002690	美亚光电	100	5,260.00	0.00
109	002174	游族网络	200	5,216.00	0.00
110	000630	铜陵有色	2,700	5,211.00	0.00
111	600126	杭钢股份	500	5,200.00	0.00

112	002152	广电运通	400	5,176.00	0.00
113	600879	航天电子	800	5,152.00	0.00
114	601233	桐昆股份	400	5,104.00	0.00
115	603866	桃李面包	100	5,089.00	0.00
116	300113	顺网科技	200	5,080.00	0.00
117	600884	杉杉股份	425	5,010.75	0.00
118	002399	海普瑞	200	5,008.00	0.00
119	000998	隆平高科	300	4,995.00	0.00
120	603806	福斯特	100	4,991.00	0.00
121	002138	顺络电子	200	4,990.00	0.00
122	300316	晶盛机电	200	4,948.00	0.00
123	600415	小商品城	1,000	4,870.00	0.00
124	600535	天士力	300	4,866.00	0.00
125	600811	东方集团	1,100	4,862.00	0.00
126	002572	索菲亚	200	4,834.00	0.00
127	600598	北大荒	300	4,830.00	0.00
128	000401	冀东水泥	300	4,812.00	0.00
129	600155	华创阳安	400	4,796.00	0.00
130	000997	新 大 陆	300	4,794.00	0.00
131	600315	上海家化	100	4,790.00	0.00
132	002013	中航机电	600	4,740.00	0.00
133	000623	吉林敖东	300	4,719.00	0.00
134	000739	普洛药业	200	4,658.00	0.00
135	002080	中材科技	300	4,650.00	0.00
136	300115	长盈精密	200	4,570.00	0.00
137	600728	佳都科技	500	4,555.00	0.00
138	603816	顾家家居	100	4,501.00	0.00
139	000028	国药一致	100	4,501.00	0.00
140	600804	鹏博士	500	4,490.00	0.00
141	002511	中顺洁柔	200	4,460.00	0.00
142	600418	江淮汽车	500	4,415.00	0.00
143	600528	中铁工业	500	4,410.00	0.00
144	600460	士兰微	300	4,404.00	0.00
145	002368	太极股份	100	4,369.00	0.00
146	300251	光线传媒	400	4,364.00	0.00
147	600827	百联股份	300	4,335.00	0.00
148	300002	神州泰岳	700	4,333.00	0.00
149	600167	联美控股	300	4,302.00	0.00
150	002387	维信诺	300	4,284.00	0.00
151	002268	卫 士 通	200	4,268.00	0.00
152	000878	云南铜业	400	4,244.00	0.00
153	600325	华发股份	600	4,236.00	0.00

154	300001	特锐德	200	4,188.00	0.00
155	000158	常山北明	400	4,176.00	0.00
156	000581	威孚高科	200	4,136.00	0.00
157	600959	江苏有线	1,100	4,136.00	0.00
158	600909	华安证券	600	4,098.00	0.00
159	002028	思源电气	200	4,092.00	0.00
160	601168	西部矿业	700	4,060.00	0.00
161	600260	凯乐科技	300	4,056.00	0.00
162	000564	供销大集	900	4,041.00	0.00
163	601966	玲珑轮胎	200	4,040.00	0.00
164	603000	人民网	200	3,966.00	0.00
165	600820	隧道股份	700	3,955.00	0.00
166	002081	金 螳 螂	500	3,930.00	0.00
167	002595	豪迈科技	200	3,892.00	0.00
168	600446	金证股份	200	3,880.00	0.00
169	600733	北汽蓝谷	600	3,858.00	0.00
170	002124	天邦股份	300	3,855.00	0.00
171	600572	康恩贝	700	3,850.00	0.00
172	603712	七一二	100	3,838.00	0.00
173	600704	物产中大	900	3,789.00	0.00
174	600497	驰宏锌锗	1,100	3,784.00	0.00
175	600256	广汇能源	1,400	3,780.00	0.00
176	600839	四川长虹	1,300	3,731.00	0.00
177	002242	九阳股份	100	3,727.00	0.00
178	000681	视觉中国	200	3,724.00	0.00
179	300166	东方国信	300	3,723.00	0.00
180	600021	上海电力	500	3,700.00	0.00
181	002217	合力泰	700	3,675.00	0.00
182	002670	国盛金控	400	3,660.00	0.00
183	600060	海信视像	300	3,645.00	0.00
184	300296	利亚德	600	3,642.00	0.00
185	600008	首创股份	1,200	3,612.00	0.00
186	002233	塔牌集团	300	3,609.00	0.00
187	600094	大名城	600	3,570.00	0.00
188	600549	厦门钨业	300	3,552.00	0.00
189	600567	山鹰纸业	1,200	3,540.00	0.00
190	600875	东方电气	400	3,540.00	0.00
191	600373	中文传媒	300	3,534.00	0.00
192	000027	深圳能源	760	3,526.40	0.00
193	603228	景旺电子	100	3,519.00	0.00
194	002221	东华能源	400	3,516.00	0.00
195	002203	海亮股份	400	3,500.00	0.00

196	600273	嘉化能源	400	3,496.00	0.00
197	600881	亚泰集团	1,200	3,492.00	0.00
198	600171	上海贝岭	200	3,476.00	0.00
199	600673	东阳光	500	3,455.00	0.00
200	000090	天健集团	500	3,455.00	0.00
201	600718	东软集团	300	3,450.00	0.00
202	600160	巨化股份	500	3,445.00	0.00
203	002317	众生药业	200	3,432.00	0.00
204	000729	燕京啤酒	500	3,425.00	0.00
205	000960	锡业股份	400	3,424.00	0.00
206	000869	张 裕Ａ	100	3,415.00	0.00
207	601179	中国西电	700	3,388.00	0.00
208	600862	中航高科	200	3,384.00	0.00
209	002709	天赐材料	100	3,379.00	0.00
210	002056	横店东磁	300	3,375.00	0.00
211	600580	卧龙电驱	300	3,372.00	0.00
212	000060	中金岭南	900	3,348.00	0.00
213	300026	红日药业	600	3,312.00	0.00
214	600755	厦门国贸	500	3,300.00	0.00
215	002648	卫星石化	200	3,254.00	0.00
216	600195	中牧股份	200	3,246.00	0.00
217	002085	万丰奥威	500	3,240.00	0.00
218	600026	中远海能	500	3,230.00	0.00
219	600282	南钢股份	1,000	3,230.00	0.00
220	002004	华邦健康	600	3,228.00	0.00
221	000800	一汽解放	300	3,222.00	0.00
222	002407	多氟多	300	3,192.00	0.00
223	600643	爱建集团	400	3,180.00	0.00
224	601098	中南传媒	300	3,174.00	0.00
225	600316	洪都航空	200	3,160.00	0.00
226	002807	江阴银行	800	3,144.00	0.00
227	000501	鄂武商Ａ	200	3,136.00	0.00
228	601005	重庆钢铁	2,100	3,129.00	0.00
229	600729	重庆百货	100	3,122.00	0.00
230	600515	海航基础	600	3,120.00	0.00
231	600967	内蒙一机	300	3,117.00	0.00
232	600737	中粮糖业	400	3,112.00	0.00
233	002048	宁波华翔	200	3,088.00	0.00
234	000778	新兴铸管	900	3,087.00	0.00
235	002745	木林森	200	3,082.00	0.00
236	601869	长飞光纤	100	3,081.00	0.00
237	600258	首旅酒店	200	3,074.00	0.00

238	002375	亚厦股份	300	3,066.00	0.00
239	000089	深圳机场	400	3,064.00	0.00
240	600039	四川路桥	800	3,056.00	0.00
241	002458	益生股份	200	3,054.00	0.00
242	603338	浙江鼎力	40	3,030.80	0.00
243	600435	北方导航	400	3,024.00	0.00
244	603486	科沃斯	100	3,021.00	0.00
245	000877	天山股份	200	3,020.00	0.00
246	600776	东方通信	200	3,018.00	0.00
247	603568	伟明环保	130	3,016.00	0.00
248	000629	攀钢钒钛	1,500	3,015.00	0.00
249	600259	广晟有色	100	3,000.00	0.00
250	000830	鲁西化工	400	2,984.00	0.00
251	600053	九鼎投资	100	2,984.00	0.00
252	600597	光明乳业	200	2,972.00	0.00
253	600649	城投控股	500	2,970.00	0.00
254	002429	兆驰股份	600	2,970.00	0.00
255	600633	浙数文化	300	2,934.00	0.00
256	000970	中科三环	300	2,934.00	0.00
257	600376	首开股份	500	2,930.00	0.00
258	601118	海南橡胶	600	2,916.00	0.00
259	600064	南京高科	300	2,916.00	0.00
260	300133	华策影视	400	2,900.00	0.00
261	000039	中集集团	400	2,892.00	0.00
262	600166	福田汽车	1,600	2,880.00	0.00
263	002839	张家港行	500	2,880.00	0.00
264	002506	协鑫集成	1,100	2,871.00	0.00
265	601975	招商南油	1,200	2,868.00	0.00
266	600808	马钢股份	1,100	2,838.00	0.00
267	000690	宝新能源	600	2,832.00	0.00
268	600056	中国医药	200	2,830.00	0.00
269	600648	外高桥	200	2,828.00	0.00
270	000519	中兵红箭	300	2,826.00	0.00
271	600645	中源协和	100	2,825.00	0.00
272	600392	盛和资源	400	2,820.00	0.00
273	000983	西山煤电	750	2,812.50	0.00
274	601106	中国一重	1,000	2,810.00	0.00
275	300134	大富科技	200	2,796.00	0.00
276	300182	捷成股份	700	2,793.00	0.00
277	600557	康缘药业	200	2,784.00	0.00
278	600754	锦江酒店	100	2,775.00	0.00
279	000598	兴蓉环境	600	2,760.00	0.00

280	002831	裕同科技	100	2,751.00	0.00
281	600120	浙江东方	400	2,748.00	0.00
282	002440	闰土股份	300	2,742.00	0.00
283	603515	欧普照明	100	2,737.00	0.00
284	000930	中粮科技	400	2,732.00	0.00
285	000738	航发控制	200	2,730.00	0.00
286	002010	传化智联	500	2,720.00	0.00
287	002092	中泰化学	600	2,718.00	0.00
288	601333	广深铁路	1,200	2,700.00	0.00
289	600466	蓝光发展	500	2,695.00	0.00
290	000415	渤海租赁	900	2,682.00	0.00
291	002183	怡 亚 通	500	2,680.00	0.00
292	002191	劲嘉股份	300	2,673.00	0.00
293	300324	旋极信息	400	2,664.00	0.00
294	002110	三钢闽光	400	2,664.00	0.00
295	002653	海思科	100	2,661.00	0.00
296	000402	金 融 街	400	2,656.00	0.00
297	000825	太钢不锈	800	2,656.00	0.00
298	601718	际华集团	800	2,656.00	0.00
299	600062	华润双鹤	200	2,644.00	0.00
300	600388	龙净环保	300	2,640.00	0.00
301	000400	许继电气	200	2,640.00	0.00
302	000807	云铝股份	600	2,616.00	0.00
303	002434	万里扬	300	2,604.00	0.00
304	000563	陕国投Ａ	700	2,597.00	0.00
305	002640	跨境通	400	2,596.00	0.00
306	600022	山东钢铁	2,000	2,580.00	0.00
307	000959	首钢股份	600	2,580.00	0.00
308	601866	中远海发	1,400	2,576.00	0.00
309	300180	华峰超纤	300	2,568.00	0.00
310	002038	双鹭药业	200	2,562.00	0.00
311	600566	济川药业	100	2,546.00	0.00
312	000031	大悦城	500	2,545.00	0.00
313	601860	紫金银行	600	2,538.00	0.00
314	000990	诚志股份	200	2,538.00	0.00
315	002064	华峰氨纶	500	2,535.00	0.00
316	600500	中化国际	500	2,530.00	0.00
317	000528	柳 工	400	2,524.00	0.00
318	000078	海王生物	600	2,514.00	0.00
319	000012	南 玻Ａ	500	2,510.00	0.00
320	603077	和邦生物	1,900	2,508.00	0.00
321	000712	锦龙股份	200	2,500.00	0.00

322	002470	*ST 金正	1,100	2,497.00	0.00
323	601615	明阳智能	200	2,490.00	0.00
324	002424	贵州百灵	300	2,490.00	0.00
325	002635	安洁科技	100	2,490.00	0.00
326	603355	莱克电气	100	2,489.00	0.00
327	002936	郑州银行	720	2,476.80	0.00
328	000967	盈峰环境	300	2,475.00	0.00
329	601958	金钼股份	400	2,472.00	0.00
330	000488	晨鸣纸业	500	2,470.00	0.00
331	000883	湖北能源	700	2,464.00	0.00
332	600908	无锡银行	500	2,455.00	0.00
333	600158	中体产业	300	2,454.00	0.00
334	601000	唐山港	1,100	2,453.00	0.00
335	600782	新钢股份	600	2,448.00	0.00
336	600675	中华企业	600	2,442.00	0.00
337	000559	万向钱潮	500	2,420.00	0.00
338	601200	上海环境	200	2,400.00	0.00
339	600694	大商股份	100	2,399.00	0.00
340	002444	巨星科技	200	2,376.00	0.00
341	002155	湖南黄金	300	2,364.00	0.00
342	601717	郑煤机	400	2,356.00	0.00
343	000887	中鼎股份	300	2,355.00	0.00
344	000987	越秀金控	200	2,332.00	0.00
345	603650	彤程新材	100	2,327.00	0.00
346	002372	伟星新材	200	2,326.00	0.00
347	002266	浙富控股	600	2,322.00	0.00
348	000685	中山公用	300	2,310.00	0.00
349	002390	信邦制药	500	2,280.00	0.00
350	002583	海能达	300	2,277.00	0.00
351	000932	华菱钢铁	600	2,262.00	0.00
352	603888	新华网	100	2,236.00	0.00
353	000826	启迪环境	300	2,226.00	0.00
354	600312	平高电气	300	2,226.00	0.00
355	000301	东方盛虹	400	2,224.00	0.00
356	000061	农 产 品	300	2,223.00	0.00
357	002867	周大生	100	2,217.00	0.00
358	600863	内蒙华电	900	2,214.00	0.00
359	000898	鞍钢股份	900	2,205.00	0.00
360	603198	迎驾贡酒	100	2,177.00	0.00
361	002625	光启技术	300	2,175.00	0.00
362	000156	华数传媒	200	2,166.00	0.00
363	002500	山西证券	330	2,158.20	0.00

364	603379	三美股份	100	2,147.00	0.00
365	002589	瑞康医药	400	2,144.00	0.00
366	300072	三聚环保	500	2,140.00	0.00
367	002244	滨江集团	500	2,135.00	0.00
368	600777	新潮能源	1,400	2,128.00	0.00
369	002563	森马服饰	300	2,115.00	0.00
370	600970	中材国际	400	2,112.00	0.00
371	002701	奥瑞金	500	2,095.00	0.00
372	000758	中色股份	500	2,090.00	0.00
373	603328	依顿电子	200	2,086.00	0.00
374	600507	方大特钢	400	2,076.00	0.00
375	300459	金科文化	600	2,070.00	0.00
376	000008	神州高铁	700	2,058.00	0.00
377	601608	中信重工	600	2,052.00	0.00
378	600765	中航重机	200	2,044.00	0.00
379	601928	凤凰传媒	300	2,040.00	0.00
380	000732	泰禾集团	400	2,036.00	0.00
381	002505	大康农业	900	2,025.00	0.00
382	002815	崇达技术	100	2,023.00	0.00
383	600338	西藏珠峰	200	2,000.00	0.00
384	600640	号百控股	100	1,995.00	0.00
385	600138	中青旅	200	1,974.00	0.00
386	002503	搜于特	700	1,967.00	0.00
387	600717	天津港	440	1,944.80	0.00
388	601598	中国外运	600	1,938.00	0.00
389	600216	浙江医药	100	1,926.00	0.00
390	002302	西部建设	200	1,920.00	0.00
391	002419	天虹股份	200	1,910.00	0.00
392	600073	上海梅林	200	1,898.00	0.00
393	600545	卓郎智能	400	1,892.00	0.00
394	000046	泛海控股	500	1,885.00	0.00
395	600478	科力远	400	1,884.00	0.00
396	601865	福莱特	100	1,880.00	0.00
397	600751	海航科技	600	1,878.00	0.00
398	600409	三友化工	400	1,864.00	0.00
399	002408	齐翔腾达	300	1,863.00	0.00
400	000813	德展健康	300	1,860.00	0.00
401	601611	中国核建	300	1,854.00	0.00
402	000025	特 力Ａ	100	1,833.00	0.00
403	601228	广州港	600	1,824.00	0.00
404	603885	吉祥航空	200	1,820.00	0.00
405	600291	西水股份	200	1,810.00	0.00

406	002249	大洋电机	500	1,805.00	0.00
407	002002	鸿达兴业	500	1,805.00	0.00
408	000553	安道麦 A	200	1,804.00	0.00
409	600141	兴发集团	200	1,790.00	0.00
410	600823	世茂股份	400	1,788.00	0.00
411	002093	国脉科技	200	1,770.00	0.00
412	600582	天地科技	600	1,758.00	0.00
413	600017	日照港	700	1,743.00	0.00
414	002946	新乳业	100	1,735.00	0.00
415	600329	中新药业	100	1,732.00	0.00
416	002665	首航高科	700	1,708.00	0.00
417	601678	滨化股份	400	1,696.00	0.00
418	600307	酒钢宏兴	1,100	1,694.00	0.00
419	600835	上海机电	100	1,693.00	0.00
420	600348	阳泉煤业	400	1,688.00	0.00
421	600125	铁龙物流	300	1,674.00	0.00
422	603377	东方时尚	100	1,656.00	0.00
423	600277	亿利洁能	500	1,630.00	0.00
424	603233	大参林	20	1,624.40	0.00
425	000543	皖能电力	400	1,608.00	0.00
426	600869	智慧能源	400	1,600.00	0.00
427	600639	浦东金桥	100	1,598.00	0.00
428	600901	江苏租赁	300	1,563.00	0.00
429	300376	易事特	300	1,560.00	0.00
430	600985	淮北矿业	200	1,558.00	0.00
431	002128	露天煤业	200	1,550.00	0.00
432	603766	隆鑫通用	400	1,548.00	0.00
433	000718	苏宁环球	500	1,545.00	0.00
434	600664	哈药股份	500	1,540.00	0.00
435	002491	通鼎互联	300	1,536.00	0.00
436	600748	上实发展	300	1,533.00	0.00
437	000600	建投能源	300	1,527.00	0.00
438	002948	青岛银行	300	1,527.00	0.00
439	300197	铁汉生态	600	1,524.00	0.00
440	000717	韶钢松山	400	1,520.00	0.00
441	000537	广宇发展	200	1,460.00	0.00
442	002051	中工国际	200	1,456.00	0.00
443	001872	招商港口	100	1,455.00	0.00
444	000062	深圳华强	100	1,454.00	0.00
445	603556	海兴电力	100	1,444.00	0.00
446	600770	综艺股份	300	1,440.00	0.00
447	002416	爱施德	200	1,436.00	0.00

448	600996	贵广网络	200	1,426.00	0.00
449	002941	新疆交建	100	1,415.00	0.00
450	000848	承德露露	200	1,400.00	0.00
451	600565	迪马股份	500	1,395.00	0.00
452	600707	彩虹股份	300	1,368.00	0.00
453	600339	中油工程	600	1,362.00	0.00
454	603056	德邦股份	100	1,353.00	0.00
455	002118	紫鑫药业	300	1,332.00	0.00
456	600874	创业环保	200	1,328.00	0.00
457	600787	中储股份	300	1,317.00	0.00
458	002544	杰赛科技	100	1,315.00	0.00
459	300257	开山股份	100	1,307.00	0.00
460	601139	深圳燃气	200	1,300.00	0.00
461	601016	节能风电	600	1,272.00	0.00
462	601019	山东出版	200	1,250.00	0.00
463	600657	信达地产	300	1,236.00	0.00
464	600428	中远海特	400	1,232.00	0.00
465	002818	富森美	100	1,230.00	0.00
466	600350	山东高速	200	1,228.00	0.00
467	600006	东风汽车	300	1,209.00	0.00
468	000937	冀中能源	400	1,208.00	0.00
469	600058	五矿发展	200	1,208.00	0.00
470	601512	中新集团	100	1,150.00	0.00
471	603256	宏和科技	100	1,144.00	0.00
472	002285	世联行	400	1,116.00	0.00
473	601801	皖新传媒	200	1,112.00	0.00
474	600575	淮河能源	500	1,045.00	0.00
475	600623	华谊集团	200	1,032.00	0.00
476	600757	长江传媒	200	1,018.00	0.00
477	601811	新华文轩	100	1,017.00	0.00
478	603225	新凤鸣	100	998.00	0.00
479	600903	贵州燃气	100	984.00	0.00
480	601969	海南矿业	200	976.00	0.00
481	600335	国机汽车	200	924.00	0.00
482	601003	柳钢股份	200	886.00	0.00
483	002423	中粮资本	100	870.00	0.00
484	000686	东北证券	100	845.00	0.00
485	601127	小康股份	100	831.00	0.00
486	600153	建发股份	100	810.00	0.00
487	000785	居然之家	100	792.00	0.00
488	603025	大豪科技	100	727.00	0.00
489	600917	重庆燃气	100	714.00	0.00

490	601699	潞安环能	100	557.00	0.00
491	600266	城建发展	80	405.60	0.00
492	601068	中铝国际	100	391.00	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	002821	凯莱英	35,499.00	0.01
2	300088	长信科技	23,887.00	0.01
3	002371	北方华创	23,318.00	0.01
4	000750	国海证券	22,291.00	0.01
5	600763	通策医疗	22,028.00	0.01
6	300529	健帆生物	20,501.00	0.01
7	600745	闻泰科技	20,300.00	0.01
8	300253	卫宁健康	18,922.00	0.01
9	002463	沪电股份	18,904.00	0.01
10	603939	益丰药房	18,899.00	0.01
11	600291	西水股份	18,028.00	0.01
12	300014	亿纬锂能	17,325.00	0.01
13	600201	生物股份	16,984.00	0.01
14	601799	星宇股份	16,978.00	0.01
15	300383	光环新网	16,758.00	0.01
16	002065	东华软件	16,679.00	0.01
17	300308	中际旭创	16,632.00	0.01
18	002384	东山精密	16,512.00	0.01
19	600409	三友化工	16,157.00	0.00
20	601099	太平洋	15,982.00	0.00

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	600745	闻泰科技	1,369,715.00	0.42
2	002371	北方华创	1,323,324.90	0.40
3	002384	东山精密	1,286,543.00	0.39
4	300088	长信科技	1,137,906.00	0.35
5	600584	长电科技	1,120,025.00	0.34
6	002463	沪电股份	1,058,462.00	0.32
7	300014	亿纬锂能	1,001,836.82	0.31
8	002065	东华软件	995,441.00	0.30
9	000066	中国长城	968,272.00	0.30

10	002812	恩捷股份	964,535.52	0.29
11	002129	中环股份	947,975.80	0.29
12	002049	紫光国微	940,689.00	0.29
13	601099	太平洋	939,181.00	0.29
14	600201	生物股份	932,207.00	0.28
15	300207	欣旺达	918,580.00	0.28
16	002821	凯莱英	890,903.00	0.27
17	601128	常熟银行	889,243.00	0.27
18	002465	海格通信	880,734.00	0.27
19	002340	格林美	879,344.00	0.27
20	002439	启明星辰	877,322.00	0.27

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	3,107,195.00
卖出股票收入（成交）总额	169,043,606.33

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	164,680,000.00	93.40

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

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

7.13.2 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。

7.13.3 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	74,093.23
2	应收证券清算款	1,396,594.79
3	应收股利	-
4	应收利息	903.98
5	应收申购款	275,656.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,747,248.81

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（%）
12,010	18,056.40	114,766,405.22	52.92	102,090,962.66	47.08

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	12,790.77	0.01

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	450,384,432.71
本报告期基金总申购份额	40,226,421.54
减：本报告期基金总赎回份额	273,753,486.37
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	216,857,367.88

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：

1、本基金管理人于 2020 年 1 月 22 日发布公告，因丁益董事长退休，由本公司总经理康乐先生代为履行本公司董事长一职。

2、本基金管理人于 2020 年 3 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，聘任李黎女士担任本公司副总经理。

3、本基金管理人于 2020 年 5 月 28 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，同意吴建军先生辞去本公司首席信息官一职，聘任张明先生担任本公司首席信息官。

上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。有关公告已在中国证监会指定的全国性报刊及指定互联网网站等媒介披露。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券股份有限公司	2	94,217,096.86	54.73%	87,746.07	54.73%	-
长城证券股份有限公司	2	77,932,054.47	45.27%	72,580.31	45.27%	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	本期新增
中信证券股份有限公司	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	1,438.01	100.00%	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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	中国证监会指定报刊及	2020 年 1 月 21 日

	证券投资基金联接基金 2019 年第 4 季度报告	网站	
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 21 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 22 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 30 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 1 月 31 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于调整旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 2 月 3 日
7	景顺长城基金管理有限公司及全资子公司投资旗下基金相关事宜的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 2 月 6 日
8	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	2020 年 3 月 6 日
9	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	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 19 日
10	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 20 日
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 25 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司基金转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 25 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增鼎信汇金（北京）投资管理有限公司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	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 25 日
14	景顺长城基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 30 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿保险股份有限公司申购及定期定额投资申购费率优	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 3 月 31 日

	惠活动的公告		
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东方财富证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 3 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富证券股份有限公司为销售机构并开通基金转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 3 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 7 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 8 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加万联证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 10 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券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	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 10 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 15 日
23	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 2020 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 17 日
24	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 2020 年第 1 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 17 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 20 日
26	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 年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 20 日
27	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 2020 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于直销网上交易系统农业银行渠道暂停支付的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 4 月 29 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于直销	中国证监会指定报刊及	2020 年 4 月 30 日

	网上交易系统农业银行渠道恢复支付的公告	网站	
31	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 15 日
32	景顺长城基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员（首席信息官）变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 28 日
33	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 2020 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 30 日
34	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 2020 年第 2 号更新招募说明书摘要	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 5 月 30 日
35	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售有限公司基金申购及转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2020 年 6 月 1 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20200101-20200630	310,632,019.11	-	196,082,688.00	114,549,331.11	52.82
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险： 1、大额申购风险 在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。 2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险： （1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险； （2）如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； （3）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影						

响基金的投资运作和收益水平；
（4）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
（5）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
（6）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。
本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止和化解上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前，请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予景顺长城中证 500 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

2020 年 8 月 24 日