

景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券
投资基金
2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49

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	49
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	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末上市基金前十名持有人	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 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
基金简称	景顺长城中证 500ETF
场内简称	景顺中证 500ETF
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	30,572,956.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014 年 1 月 21 日

2.2 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	杨崑阳
	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	李进	葛海蛟

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1,068,237.38
本期利润	1,875,766.21
加权平均基金份额本期利润	0.0604
本期加权平均净值利润率	3.18%
本期基金份额净值增长率	3.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	25,951,510.78
期末可供分配基金份额利润	0.8488
期末基金资产净值	56,524,466.78
期末基金份额净值	1.8488
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	84.88%

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

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

3、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。

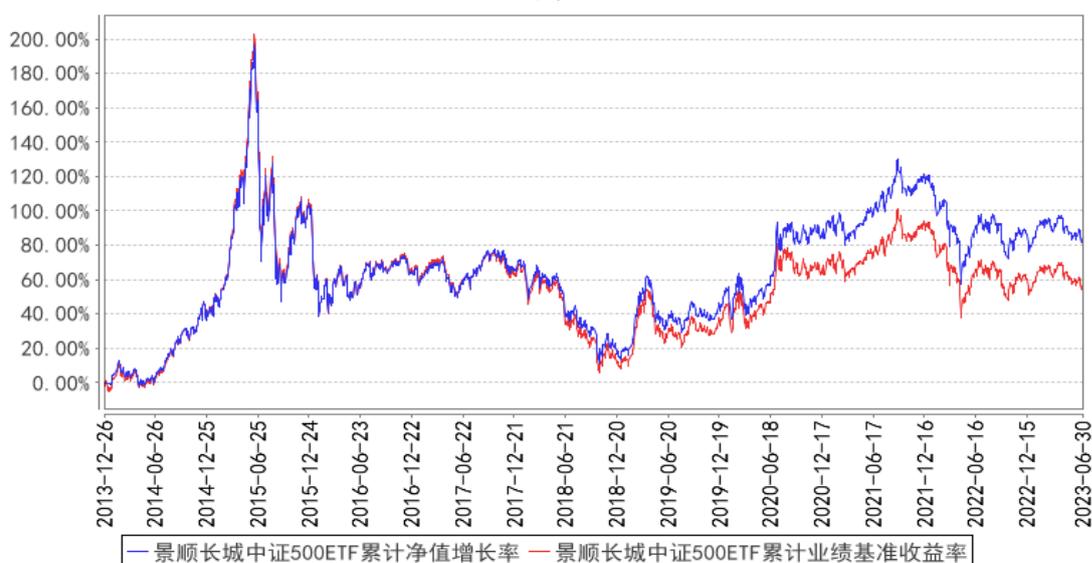
3.2 基金净值表现

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	-0.26%	0.92%	-0.81%	0.93%	0.55%	-0.01%
过去三个月	-4.47%	0.82%	-5.38%	0.83%	0.91%	-0.01%
过去六个月	3.11%	0.78%	2.29%	0.79%	0.82%	-0.01%
过去一年	-5.50%	0.94%	-7.06%	0.96%	1.56%	-0.02%
过去三年	12.27%	1.16%	2.29%	1.19%	9.98%	-0.03%
自基金合同生效起至今	84.88%	1.57%	57.51%	1.60%	27.37%	-0.03%

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：本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的建仓期为自 2013 年 12 月 26 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2023年6月30日，本公司旗下共管理175只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑天行	本基金的基金经理	2023年6月20日	-	9年	理学硕士，CFA。曾任美国摩根斯坦利（纽约）对冲基金投资组合分析员，美国Aristeia基金（纽约）数据分析师，美国城堡基金（纽约）大数据研究员。2019年5月加入本公司，历任养老及资产配置部研究员、ETF投资部研究员、专户投资部投资经理，自2022年8月起担任ETF与创新投资部基金经理。具有9年证券、基金行业从业经验。
张晓南	本基金的基金经理	2020年4月15日	2023年6月19日	13年	经济学硕士，CFA，FRM。曾任鹏华基金管理有限公司产品规划部高级产品设计师，兴银基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资部基金经理。2020年2月加入本公司，自2020年4月起担任ETF与创新投资部基金经理。具有13年证券、基金行业从业经验。
金璜	本基金的基金经理助理	2022年10月13日	-	7年	工学硕士，CFA。曾任美国AltfestPersonalWealthManagement（艾福斯特个人财富管理）投资部量化研究员，Morgan Stanley（美国摩根士丹利）风险

					管理部信用风险分析员。2018 年 7 月加入本公司，历任风险管理部经理、ETF 与创新投资部研究员，现任基金经理助理。具有 7 年证券、基金行业从业经验。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 17 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，A 股权益市场整体表现较为平稳但结构上有所分化，主要宽基指数涨跌幅及排

序为：科创 50(4.71%)>上证指数(3.65%)>沪深 300(-0.75%)>中小 100(-1.84%)>创业板指(-5.61%)。市值维度，总体表现出小盘占优特征，规模指数涨跌幅及排序为：中证 1000(5.10%)>中证 500(2.29%)>沪深 300(-0.75%)。风格维度，中信风格指数涨跌幅及排序为：稳定(10.12%)>成长(7.80%)>周期(1.29%)>金融(-0.72%)>消费(-2.52%)。行业维度，涨跌幅排前五行业为：通信(50.66%)、传媒(42.75%)、计算机(27.57%)、机械设备(13.44%)、家用电器(13.29%)，排后五行业为：商贸零售(-23.44%)、房地产(-14.29%)、美容护理(-13.61%)、建筑材料(-10.52%)、综合(-9.62%)。

本基金采用复制标的指数的方法进行组合管理，通过控制跟踪误差和跟踪偏离度，力争基金收益和指数收益基本一致。在报告期内，本基金结合申购赎回情况、标的指数成分调整情况定期或不定期调整投资组合，保持对标的指数的紧密跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2023 年上半年，本基金份额净值增长率为 3.11%，业绩比较基准收益率为 2.29%。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 0.2%以内，跟踪误差（年化）控制在 2%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

宏观数据层面，主要经济活动指标：5 月工业增加值同比增长 3.5%，前值 5.6%，经季度调整后环比增长 0.63%；5 月 PMI 48.8，6 月 PMI 49；5 月社会消费品零售总额同比增长 12.7%，前值 18.40%。通胀指标：5 月 PPI 同比 -4.6%，前值 -3.6%；5 月 CPI 当月同比 0.2%，前值 0.1%。货币金融指标：5 月 M2 同比增长 11.6%，前值 12.4%；5 月社会融资规模同比增长 9.5%，前值 10.0%。总体来看，增长斜率有所放缓，但保持良好的复苏态势，同时通胀在高基数下保持稳步回落态势。

权益市场的长期趋势反映上市公司总体盈利能力的逐步提升，背后的驱动力是经济长期增长动能以及科技升级、产业升级带来的生产力提升。目前主要宽基指数估值水平处在历史低位，在经济复苏大背景下，权益市场配置价值凸显。

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、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（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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,179,287.28	945,485.85
结算备付金		3,214.70	18,768.68
存出保证金		581.20	1,157.46
交易性金融资产	6.4.7.2	55,503,969.20	59,452,984.36
其中：股票投资		55,503,969.20	59,452,984.36
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	109,985.08
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		56,687,052.38	60,528,381.43
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.10	101,109.62
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		23,308.95	27,729.98
应付托管费		4,661.79	5,546.01
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	134,614.76	194,143.85
负债合计		162,585.60	328,529.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	30,572,956.00	33,572,956.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	25,951,510.78	26,626,895.97
净资产合计		56,524,466.78	60,199,851.97
负债和净资产总计		56,687,052.38	60,528,381.43

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.8488 元，基金份额总额 30,572,956.00 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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,208,591.48	-7,666,452.33
1. 利息收入		1,736.79	2,339.98
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,736.79	2,339.98
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-737,148.90	-231,983.15
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,394,891.26	-907,233.40

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	8,874.79	10,439.36
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	648,867.57	664,810.89
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,944,003.59	-7,436,744.16
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	-	-65.00
减：二、营业总支出		332,825.27	338,986.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	146,192.87	151,557.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	29,238.61	30,311.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	157,393.79	157,117.11
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		1,875,766.21	-8,005,438.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		1,875,766.21	-8,005,438.85
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		1,875,766.21	-8,005,438.85

6.3 净资产（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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	33,572,956.00	-	26,626,895.97	60,199,851.97
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	33,572,956.00	-	26,626,895.97	60,199,851.97
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-	-675,385.19	-3,675,385.19
(一)、综合收益总额	-	-	1,875,766.21	1,875,766.21
(二)、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)	-3,000,000.00	-	-2,551,151.40	-5,551,151.40
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-3,000,000.00	-	-2,551,151.40	-5,551,151.40
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	30,572,956.00	-	25,951,510.78	56,524,466.78
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	33,572,956.00	-	40,514,252.00	74,087,208.00
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	33,572,956.00	-	40,514,252.00	74,087,208.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-	-11,271,444.08	-14,271,444.08

(一)、综合收益总额	-	-	-8,005,438.85	-8,005,438.85
(二)、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)	-3,000,000.00	-	-3,266,005.23	-6,266,005.23
其中：1. 基金申购款	2,000,000.00	-	1,644,073.38	3,644,073.38
2. 基金赎回款	-5,000,000.00	-	-4,910,078.61	-9,910,078.61
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	30,572,956.00	-	29,242,807.92	59,815,763.92

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(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[2013]1501 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基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式指数基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 512,538,347.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 887 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基金合同》于 2013 年 12 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 512,572,956.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 34,609.00 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2014]第 17 号文审核同意,本基金

512,572,956.00 份基金份额于 2014 年 1 月 21 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金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%。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数。

本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“景顺长城中证 500ETF 联接基金”）。景顺长城中证 500ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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 2023 年 8 月 28 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（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》、本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 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产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和会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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(如适用)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(如适用)产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,179,287.28
等于：本金	1,179,194.68
加：应计利息	92.60
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1 个月(含)-3 个月	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

合计	1,179,287.28
----	--------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	58,713,045.74	-	55,503,969.20	-3,209,076.54
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	58,713,045.74	-	55,503,969.20	-3,209,076.54

注：于 2023 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值 0.00 元。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末的衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	12,834.31
其中：交易所市场	12,834.31
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
应付指数使用费	35,000.00
合计	134,614.76

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,572,956.00	33,572,956.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-3,000,000.00	-3,000,000.00
本期末	30,572,956.00	30,572,956.00

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,717,499.80	-30,090,603.83	26,626,895.97
本期利润	-1,068,237.38	2,944,003.59	1,875,766.21
本期基金份额交易产生的变动数	-5,055,718.65	2,504,567.25	-2,551,151.40
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-5,055,718.65	2,504,567.25	-2,551,151.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,593,543.77	-24,642,032.99	25,951,510.78

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	1,608.33
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	123.55
其他	4.91
合计	1,736.79

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,066,229.13
股票投资收益——赎回差价收入	-328,662.13
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,394,891.26

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	8,077,477.06
减：卖出股票成本总额	9,119,732.17
减：交易费用	23,974.02
买卖股票差价收入	-1,066,229.13

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	5,551,151.40
减：现金支付赎回款总额	209,665.40
减：赎回股票成本总额	5,670,148.13
减：交易费用	-
赎回差价收入	-328,662.13

6.4.7.14.4 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	6.56
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	8,868.23
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	8,874.79

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	39,876.39
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	31,000.00
减：应计利息总额	6.57
减：交易费用	1.59
买卖债券差价收入	8,868.23

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	648,867.57
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	648,867.57

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,944,003.59
股票投资	2,944,003.59
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,944,003.59

注：本基金本报告期公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益 0.00 元。

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	595.00
指数使用费	70,000.00
存托服务费	18.34
合计	157,393.79

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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 （“景顺长城中证 500ETF 联接基金”）	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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	8,367,222.37	53.17	12,762,292.61	53.07

6.4.10.1.2 权证交易

无。

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 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	7,793.86	53.17	6,690.19	52.13
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	11,889.57	53.08	10,942.66	53.04

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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。

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	146,192.87	151,557.89
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 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
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	29,238.61	30,311.52

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
景顺长城中证 500ETF 联接基金	26,763,000.00	87.5400	31,029,900.00	92.4300

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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-活期	1,179,287.28	1,608.33	1,183,476.30	2,144.49

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 13,100 股长城证券（证券代码：002939）的 A 股普通股，成本总额为人民币 142,521.81 元，估值总额为人民币 106,503.00 元，占基金资产净值的比例为 0.19%（2022 年 12 月 31 日：本基金持有长城证券（证券代码：002939）11,300 股 A 股普通股，成本总额为人民币 130,782.88 元，估值总额为人民币 93,564.00 元，占基金资产净值的比例为 0.16%。）。

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（2023 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

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
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.40	5,700	33,238.28	39,729.00	-
000540	中天金融	2023年5月19日	退市	0.11	-	-	41,300	104,332.59	4,543.00	

注：本基金截至 2023 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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的

证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金未持有除国债、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（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合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 2023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	1,179,287.28	-	-	-	-	-	1,179,287.28
结算备付金	3,214.70	-	-	-	-	-	3,214.70
存出保证金	581.20	-	-	-	-	-	581.20
交易性金融资产	4,543.00	-	-	-	-	55,499,426.20	55,503,969.20
资产总计	1,187,626.18	-	-	-	-	55,499,426.20	56,687,052.38
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	23,308.95	23,308.95
应付托管费	-	-	-	-	-	4,661.79	4,661.79
应付证券清算款	-	-	-	-	-	0.10	0.10
其他负债	-	-	-	-	-	134,614.76	134,614.76
负债总计	-	-	-	-	-	162,585.60	162,585.60
利率敏感度缺口	1,187,626.18	-	-	-	-	-	-
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

2022 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	945,485.85	-	-	-	-	-	945,485.85
结算备付金	18,768.68	-	-	-	-	-	18,768.68
存出保证金	1,157.46	-	-	-	-	-	1,157.46
交易性金融资产	-	-	-	-	-59,452,984.36	-59,452,984.36	59,452,984.36
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	109,985.08
资产总计	965,411.99	-	-	-	-59,562,969.44	-59,562,969.44	60,528,381.43
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	27,729.98
应付托管费	-	-	-	-	-	-	5,546.01
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	101,109.62
其他负债	-	-	-	-	-	-	194,143.85
负债总计	-	-	-	-	-	-	328,529.46
利率敏感度缺口	965,411.99	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	55,503,969.20	98.19	59,452,984.36	98.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	55,503,969.20	98.19	59,452,984.36	98.76

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	2,499,894.45	1,950,660.93
	沪深 300 指数下降 5%	-2,499,894.45	-1,950,660.93

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	55,459,697.20	59,237,101.36
第二层次	39,729.00	215,883.00
第三层次	4,543.00	-
合计	55,503,969.20	59,452,984.36

6.4.14.2.2 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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	55,503,969.20	97.91
	其中：股票	55,503,969.20	97.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,182,501.98	2.09
8	其他各项资产	581.20	0.00
9	合计	56,687,052.38	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	386,496.00	0.68
B	采矿业	2,033,286.82	3.60
C	制造业	34,778,926.77	61.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,908,086.60	3.38
E	建筑业	614,653.50	1.09
F	批发和零售业	1,744,852.20	3.09
G	交通运输、仓储和邮政业	829,546.27	1.47
H	住宿和餐饮业	102,330.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,656,554.95	8.24
J	金融业	4,742,469.28	8.39
K	房地产业	748,182.50	1.32
L	租赁和商务服务业	679,533.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	621,132.08	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	306,447.63	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	276,170.00	0.49
R	文化、体育和娱乐业	779,541.00	1.38
S	综合	291,217.60	0.52
	合计	55,499,426.20	98.19

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,543.00	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,543.00	0.01

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	5,300	781,485.00	1.38
2	688256	寒武纪	1,872	351,936.00	0.62
3	000988	华工科技	8,259	313,924.59	0.56
4	002340	格林美	42,000	290,220.00	0.51
5	002384	东山精密	11,200	290,080.00	0.51
6	002422	科伦药业	9,600	284,928.00	0.50
7	300418	昆仑万维	6,900	277,932.00	0.49
8	600372	中航电子	18,300	277,794.00	0.49
9	300012	华测检测	13,700	267,150.00	0.47
10	300724	捷佳伟创	2,300	258,405.00	0.46
11	600157	永泰能源	181,500	257,730.00	0.46
12	600079	人福医药	9,300	250,542.00	0.44
13	688777	中控技术	3,988	250,366.64	0.44
14	600489	中金黄金	23,700	244,821.00	0.43
15	300003	乐普医疗	10,800	244,188.00	0.43
16	002738	中矿资源	4,740	241,455.60	0.43
17	600487	亨通光电	16,100	236,026.00	0.42
18	002028	思源电气	5,020	234,534.40	0.41
19	600536	中国软件	4,942	231,680.96	0.41
20	002463	沪电股份	10,900	228,246.00	0.40
21	601058	赛轮轮胎	20,000	227,800.00	0.40
22	601555	东吴证券	32,690	226,868.60	0.40
23	300037	新宙邦	4,320	224,164.80	0.40
24	600765	中航重机	8,405	222,816.55	0.39
25	000066	中国长城	15,800	218,514.00	0.39
26	600885	宏发股份	6,848	218,108.80	0.39
27	000807	云铝股份	17,000	216,410.00	0.38
28	688099	晶晨股份	2,450	206,584.00	0.37
29	600482	中国动力	8,800	206,272.00	0.36

30	000423	东阿阿胶	3,800	203,110.00	0.36
31	000009	中国宝安	16,780	202,534.60	0.36
32	300146	汤臣倍健	8,300	199,034.00	0.35
33	600352	浙江龙盛	21,200	198,220.00	0.35
34	002156	通富微电	8,700	196,620.00	0.35
35	603444	吉比特	400	196,444.00	0.35
36	300058	蓝色光标	20,300	196,301.00	0.35
37	002966	苏州银行	29,960	196,238.00	0.35
38	002185	华天科技	20,900	192,280.00	0.34
39	601108	财通证券	26,500	191,860.00	0.34
40	600415	小商品城	22,400	191,072.00	0.34
41	002625	光启技术	12,300	187,698.00	0.33
42	002624	完美世界	11,100	187,479.00	0.33
43	600027	华电国际	27,800	185,982.00	0.33
44	300144	宋城演艺	14,900	184,760.00	0.33
45	600109	国金证券	21,300	184,671.00	0.33
46	000783	长江证券	31,600	183,280.00	0.32
47	600988	赤峰黄金	13,600	183,056.00	0.32
48	600161	天坛生物	6,700	181,905.00	0.32
49	601233	桐昆股份	13,700	181,525.00	0.32
50	601077	渝农商行	50,500	181,295.00	0.32
51	600298	安琪酵母	5,000	181,050.00	0.32
52	002008	大族激光	6,900	180,780.00	0.32
53	600418	江淮汽车	14,262	179,558.58	0.32
54	300568	星源材质	10,400	178,776.00	0.32
55	002385	大北农	27,000	178,200.00	0.32
56	300285	国瓷材料	6,500	178,100.00	0.32
57	600096	云天化	10,400	177,528.00	0.31
58	002223	鱼跃医疗	4,926	177,286.74	0.31
59	002409	雅克科技	2,400	174,912.00	0.31
60	000630	铜陵有色	60,200	173,978.00	0.31
61	603882	金域医学	2,300	173,650.00	0.31
62	002407	多氟多	8,700	172,782.00	0.31
63	600862	中航高科	6,800	172,108.00	0.30
64	300390	天华新能	4,790	171,482.00	0.30
65	603688	石英股份	1,500	170,760.00	0.30
66	688072	拓荆科技	400	170,388.00	0.30
67	601162	天风证券	56,600	168,668.00	0.30
68	300024	机器人	10,100	168,367.00	0.30
69	300395	菲利华	3,400	167,280.00	0.30
70	002497	雅化集团	9,400	167,132.00	0.30
71	300474	景嘉微	1,850	166,481.50	0.29
72	000933	神火股份	12,800	166,400.00	0.29

73	300604	长川科技	3,500	166,215.00	0.29
74	300073	当升科技	3,300	166,089.00	0.29
75	600705	中航产融	43,300	165,839.00	0.29
76	002240	盛新锂能	5,200	165,724.00	0.29
77	002439	启明星辰	5,500	163,680.00	0.29
78	601168	西部矿业	15,500	162,905.00	0.29
79	605358	立昂微	4,400	161,612.00	0.29
80	000932	华菱钢铁	33,800	161,226.00	0.29
81	600066	宇通客车	10,800	159,192.00	0.28
82	002600	领益智造	23,000	158,930.00	0.28
83	002850	科达利	1,200	158,700.00	0.28
84	300136	信维通信	7,900	158,632.00	0.28
85	603596	伯特利	2,000	158,520.00	0.28
86	000975	银泰黄金	13,540	158,418.00	0.28
87	600060	海信视像	6,400	158,400.00	0.28
88	688301	奕瑞科技	560	158,160.80	0.28
89	002138	顺络电子	6,600	157,806.00	0.28
90	688521	芯原股份	2,190	157,504.80	0.28
91	002797	第一创业	27,400	156,728.00	0.28
92	002465	海格通信	15,000	155,100.00	0.27
93	002568	百润股份	4,240	154,124.00	0.27
94	600563	法拉电子	1,119	153,638.70	0.27
95	300832	新产业	2,600	153,400.00	0.27
96	603939	益丰药房	4,140	153,180.00	0.27
97	601128	常熟银行	22,400	152,768.00	0.27
98	603816	顾家家居	4,000	152,600.00	0.27
99	000021	深科技	7,630	152,523.70	0.27
100	600839	四川长虹	30,100	152,005.00	0.27
101	600160	巨化股份	11,020	151,855.60	0.27
102	300253	卫宁健康	14,000	151,480.00	0.27
103	000591	太阳能	22,300	151,194.00	0.27
104	688567	孚能科技	6,966	150,395.94	0.27
105	600879	航天电子	17,692	150,205.08	0.27
106	600873	梅花生物	16,800	150,024.00	0.27
107	000683	远兴能源	20,700	148,833.00	0.26
108	300866	安克创新	1,700	148,750.00	0.26
109	603589	口子窖	3,000	148,050.00	0.26
110	601990	南京证券	18,000	147,240.00	0.26
111	688169	石头科技	459	147,192.12	0.26
112	300699	光威复材	4,760	146,846.00	0.26
113	002025	航天电器	2,300	146,740.00	0.26
114	600392	盛和资源	11,395	146,653.65	0.26
115	002368	太极股份	3,551	146,194.67	0.26

116	600497	驰宏锌锗	29,100	146,082.00	0.26
117	002078	太阳纸业	13,626	145,661.94	0.26
118	601696	中银证券	13,600	144,976.00	0.26
119	688390	固德威	863	144,000.18	0.25
120	300118	东方日升	5,600	143,528.00	0.25
121	000729	燕京啤酒	11,500	143,405.00	0.25
122	600177	雅戈尔	22,600	142,606.00	0.25
123	600516	方大炭素	23,000	142,600.00	0.25
124	000831	中国稀土	4,800	142,080.00	0.25
125	300017	网宿科技	19,900	141,489.00	0.25
126	600141	兴发集团	6,320	140,430.40	0.25
127	002294	信立泰	4,500	140,355.00	0.25
128	600642	申能股份	20,000	139,800.00	0.25
129	002673	西部证券	21,900	139,065.00	0.25
130	000728	国元证券	21,300	138,876.00	0.25
131	002430	杭氧股份	4,000	137,440.00	0.24
132	000629	钒钛股份	35,100	137,241.00	0.24
133	600699	均胜电子	7,780	137,239.20	0.24
134	600170	上海建工	50,800	136,652.00	0.24
135	002532	天山铝业	22,800	136,572.00	0.24
136	600325	华发股份	13,812	136,048.20	0.24
137	600118	中国卫星	4,800	135,408.00	0.24
138	002273	水晶光电	11,324	135,208.56	0.24
139	002195	二三四五	46,722	135,026.58	0.24
140	002268	电科网安	4,820	134,333.40	0.24
141	601966	玲珑轮胎	6,000	133,320.00	0.24
142	600166	福田汽车	39,200	133,280.00	0.24
143	600153	建发股份	12,200	133,102.00	0.24
144	002739	万达电影	10,600	132,924.00	0.24
145	300595	欧普康视	4,400	132,836.00	0.24
146	600143	金发科技	15,200	132,696.00	0.23
147	002372	伟星新材	6,460	132,688.40	0.23
148	600521	华海药业	7,200	132,552.00	0.23
149	000998	隆平高科	8,600	132,010.00	0.23
150	603000	人民网	4,500	131,400.00	0.23
151	689009	九号公司	3,565	131,370.25	0.23
152	600549	厦门钨业	6,900	131,307.00	0.23
153	000400	许继电气	5,694	131,246.70	0.23
154	600486	扬农化工	1,500	131,130.00	0.23
155	300487	蓝晓科技	2,100	131,082.00	0.23
156	600637	东方明珠	16,700	130,594.00	0.23
157	600399	抚顺特钢	12,800	130,560.00	0.23
158	688002	睿创微纳	2,901	129,964.80	0.23

159	000738	航发控制	5,300	129,320.00	0.23
160	002065	东华软件	18,300	129,198.00	0.23
161	688220	翱捷科技	1,709	128,841.51	0.23
162	688536	思瑞浦	589	128,402.00	0.23
163	600859	王府井	6,464	127,922.56	0.23
164	601577	长沙银行	16,400	127,264.00	0.23
165	600481	双良节能	9,100	127,218.00	0.23
166	002444	巨星科技	5,811	127,144.68	0.22
167	002131	利欧股份	55,173	126,897.90	0.22
168	601198	东兴证券	15,800	126,716.00	0.22
169	600499	科达制造	11,100	126,096.00	0.22
170	300383	光环新网	11,700	125,775.00	0.22
171	000997	新大陆	6,652	125,722.80	0.22
172	002353	杰瑞股份	5,000	125,650.00	0.22
173	600704	物产中大	25,400	125,476.00	0.22
174	300438	鹏辉能源	2,600	124,904.00	0.22
175	000960	锡业股份	8,000	124,400.00	0.22
176	600021	上海电力	11,500	123,855.00	0.22
177	000519	中兵红箭	6,827	123,500.43	0.22
178	300682	朗新科技	5,300	123,384.00	0.22
179	601997	贵阳银行	23,900	123,324.00	0.22
180	600271	航天信息	9,000	123,210.00	0.22
181	002373	千方科技	9,000	122,760.00	0.22
182	300001	特锐德	5,900	122,602.00	0.22
183	688009	中国通号	21,138	122,600.40	0.22
184	603077	和邦生物	50,443	122,576.49	0.22
185	000623	吉林敖东	7,600	121,904.00	0.22
186	000703	恒逸石化	17,900	121,362.00	0.21
187	300088	长信科技	19,971	120,425.13	0.21
188	300676	华大基因	2,000	119,980.00	0.21
189	600511	国药股份	3,086	119,891.10	0.21
190	002056	横店东磁	6,564	119,530.44	0.21
191	600380	健康元	9,392	119,372.32	0.21
192	688516	奥特维	632	119,068.80	0.21
193	603737	三棵树	1,820	119,064.40	0.21
194	600867	通化东宝	11,400	119,016.00	0.21
195	002507	涪陵榨菜	6,500	119,015.00	0.21
196	002152	广电运通	10,100	118,372.00	0.21
197	600498	烽火通信	5,800	118,146.00	0.21
198	603338	浙江鼎力	2,100	117,621.00	0.21
199	600998	九州通	11,324	117,543.12	0.21
200	002281	光迅科技	3,169	117,538.21	0.21
201	600546	山煤国际	8,100	117,207.00	0.21

202	600529	山东药玻	4,300	117,046.00	0.21
203	000513	丽珠集团	3,003	116,846.73	0.21
204	002203	海亮股份	9,700	116,497.00	0.21
205	601016	节能风电	31,720	116,412.40	0.21
206	600348	华阳股份	14,700	116,277.00	0.21
207	000636	风华高科	7,543	115,709.62	0.20
208	603517	绝味食品	3,100	115,165.00	0.20
209	002299	圣农发展	6,000	114,900.00	0.20
210	600739	辽宁成大	8,700	114,405.00	0.20
211	002192	融捷股份	1,700	113,611.00	0.20
212	603927	中科软	2,940	113,366.40	0.20
213	601636	旗滨集团	13,100	112,922.00	0.20
214	002432	九安医疗	3,200	112,672.00	0.20
215	002595	豪迈科技	3,200	112,416.00	0.20
216	002506	协鑫集成	38,200	111,926.00	0.20
217	603712	七一二	3,700	111,777.00	0.20
218	002531	天顺风能	7,300	111,179.00	0.20
219	603885	吉祥航空	7,200	111,096.00	0.20
220	688772	珠海冠宇	5,501	110,845.15	0.20
221	002080	中材科技	5,400	110,808.00	0.20
222	600863	内蒙华电	26,600	110,390.00	0.20
223	600580	卧龙电驱	7,477	109,238.97	0.19
224	600655	豫园股份	15,900	109,074.00	0.19
225	600970	中材国际	8,550	109,012.50	0.19
226	002092	中泰化学	16,900	109,005.00	0.19
227	300182	捷成股份	17,200	108,532.00	0.19
228	000878	云南铜业	9,800	108,290.00	0.19
229	300296	利亚德	16,500	107,745.00	0.19
230	300212	易华录	3,240	107,665.20	0.19
231	600820	隧道股份	17,900	107,579.00	0.19
232	600909	华安证券	23,020	107,503.40	0.19
233	688385	复旦微电	2,132	106,813.20	0.19
234	600528	中铁工业	10,800	106,704.00	0.19
235	002939	长城证券	13,100	106,503.00	0.19
236	002926	华西证券	12,800	106,368.00	0.19
237	002683	广东宏大	3,600	105,984.00	0.19
238	600535	天士力	7,300	105,923.00	0.19
239	600329	达仁堂	2,355	105,715.95	0.19
240	688188	柏楚电子	560	105,593.60	0.19
241	000750	国海证券	31,090	104,151.50	0.18
242	000547	航天发展	10,400	104,000.00	0.18
243	000039	中集集团	15,040	103,625.60	0.18
244	600008	首创环保	35,970	103,593.60	0.18

245	603233	大参林	3,688	103,300.88	0.18
246	000893	亚钾国际	4,500	103,230.00	0.18
247	600416	湘电股份	5,400	103,086.00	0.18
248	300244	迪安诊断	4,000	102,520.00	0.18
249	600258	首旅酒店	5,400	102,330.00	0.18
250	002557	洽洽食品	2,459	102,171.45	0.18
251	603893	瑞芯微	1,400	101,990.00	0.18
252	000970	中科三环	7,945	101,854.90	0.18
253	603160	汇顶科技	2,200	101,750.00	0.18
254	300748	金力永磁	3,400	101,728.00	0.18
255	603156	养元饮品	4,100	101,270.00	0.18
256	002429	兆驰股份	18,400	101,200.00	0.18
257	000060	中金岭南	21,300	101,175.00	0.18
258	688200	华峰测控	660	100,980.00	0.18
259	601991	大唐发电	30,300	100,293.00	0.18
260	000830	鲁西化工	9,407	99,337.92	0.18
261	600369	西南证券	27,100	98,915.00	0.17
262	603456	九洲药业	3,600	98,568.00	0.17
263	600390	五矿资本	18,300	98,454.00	0.17
264	603658	安图生物	1,900	98,287.00	0.17
265	002500	山西证券	17,560	97,984.80	0.17
266	600435	北方导航	8,520	97,894.80	0.17
267	600398	海澜之家	14,100	97,008.00	0.17
268	002936	郑州银行	42,026	96,659.80	0.17
269	002508	老板电器	3,800	96,102.00	0.17
270	300558	贝达药业	2,000	96,060.00	0.17
271	601880	辽港股份	61,499	95,938.44	0.17
272	002128	电投能源	7,231	95,593.82	0.17
273	600038	中直股份	2,400	95,568.00	0.17
274	300009	安科生物	9,532	95,320.00	0.17
275	300070	碧水源	17,700	94,872.00	0.17
276	601717	郑煤机	7,510	93,499.50	0.17
277	600985	淮北矿业	8,100	93,312.00	0.17
278	600848	上海临港	7,800	93,210.00	0.16
279	002153	石基信息	6,630	92,820.00	0.16
280	300026	红日药业	17,102	92,692.84	0.16
281	603858	步长制药	4,500	92,655.00	0.16
282	000050	深天马 A	10,000	91,800.00	0.16
283	002572	索菲亚	5,200	90,584.00	0.16
284	300529	健帆生物	3,900	90,402.00	0.16
285	601179	中国西电	16,700	90,347.00	0.16
286	603127	昭衍新药	2,200	89,980.00	0.16
287	002244	滨江集团	10,124	89,293.68	0.16

288	300373	扬杰科技	2,200	89,254.00	0.16
289	688779	长远锂科	7,884	88,852.68	0.16
290	688116	天奈科技	1,941	88,800.75	0.16
291	002408	齐翔腾达	13,928	88,721.36	0.16
292	600673	东阳光	12,300	88,683.00	0.16
293	601456	国联证券	9,700	88,270.00	0.16
294	002266	浙富控股	21,345	88,154.85	0.16
295	601958	金钼股份	7,900	88,085.00	0.16
296	600895	张江高科	6,300	87,696.00	0.16
297	002019	亿帆医药	6,000	87,600.00	0.15
298	003035	南网能源	12,300	87,576.00	0.15
299	600566	济川药业	3,000	87,120.00	0.15
299	600667	太极实业	12,000	87,120.00	0.15
300	600827	百联股份	6,500	86,905.00	0.15
301	688538	和辉光电	34,057	86,504.78	0.15
302	000155	川能动力	6,000	86,400.00	0.15
303	002958	青农商行	31,700	86,224.00	0.15
304	600208	新湖中宝	34,700	86,056.00	0.15
305	601000	唐山港	24,211	85,464.83	0.15
306	601666	平煤股份	11,300	85,202.00	0.15
307	000739	普洛药业	4,800	85,152.00	0.15
308	603267	鸿远电子	1,300	84,890.00	0.15
309	600282	南钢股份	25,100	84,587.00	0.15
310	300357	我武生物	2,500	84,075.00	0.15
311	600171	上海贝岭	4,602	83,986.50	0.15
312	000887	中鼎股份	6,400	83,776.00	0.15
313	600755	厦门国贸	10,802	83,607.48	0.15
314	002155	湖南黄金	6,800	82,960.00	0.15
315	600959	江苏有线	24,500	82,810.00	0.15
316	600378	昊华科技	2,200	82,808.00	0.15
317	002670	国盛金控	9,401	82,540.78	0.15
318	600316	洪都航空	3,500	82,075.00	0.15
319	300677	英科医疗	3,700	81,400.00	0.14
320	300115	长盈精密	6,816	81,178.56	0.14
321	688281	华秦科技	400	81,000.00	0.14
322	300888	稳健医疗	1,940	80,839.80	0.14
323	601231	环旭电子	5,400	80,784.00	0.14
324	002487	大金重工	2,600	80,184.00	0.14
325	600517	国网英大	14,000	79,800.00	0.14
326	601866	中远海发	32,300	79,781.00	0.14
327	603218	日月股份	4,200	79,758.00	0.14
328	000778	新兴铸管	19,500	79,560.00	0.14
329	002030	达安基因	7,974	79,500.78	0.14

330	000598	兴蓉环境	14,600	79,278.00	0.14
331	600056	中国医药	6,077	78,879.46	0.14
332	600131	国网信通	3,900	78,741.00	0.14
333	600582	天地科技	13,500	78,705.00	0.14
334	600315	上海家化	2,700	78,327.00	0.14
335	688082	盛美上海	708	78,163.20	0.14
336	002221	东华能源	9,004	77,884.60	0.14
337	000987	越秀资本	12,230	77,660.50	0.14
338	600598	北大荒	5,800	77,314.00	0.14
339	002249	大洋电机	13,557	77,274.90	0.14
340	603026	胜华新材	1,300	77,025.00	0.14
341	300363	博腾股份	2,600	76,934.00	0.14
342	300251	光线传媒	9,500	76,855.00	0.14
343	601005	重庆钢铁	54,700	76,580.00	0.14
344	000027	深圳能源	11,620	76,575.80	0.14
345	002326	永太科技	5,000	76,450.00	0.14
346	600906	财达证券	10,600	76,320.00	0.14
347	000709	河钢股份	33,700	76,162.00	0.13
348	002518	科士达	1,900	76,019.00	0.13
349	002183	怡亚通	14,800	75,480.00	0.13
350	601106	中国一重	22,400	75,264.00	0.13
351	601992	金隅集团	34,000	74,120.00	0.13
352	002831	裕同科技	3,020	73,657.80	0.13
353	600718	东软集团	6,900	73,554.00	0.13
354	000883	湖北能源	16,100	73,416.00	0.13
355	601665	齐鲁银行	18,700	73,304.00	0.13
356	600373	中文传媒	5,500	73,260.00	0.13
357	300776	帝尔激光	1,120	72,688.00	0.13
358	002511	中顺洁柔	6,500	72,475.00	0.13
359	000825	太钢不锈	18,700	72,369.00	0.13
360	002690	美亚光电	2,810	72,357.50	0.13
361	601778	晶科科技	14,500	71,630.00	0.13
362	603568	伟明环保	4,078	71,405.78	0.13
363	601928	凤凰传媒	6,200	70,680.00	0.13
364	603228	景旺电子	2,752	70,588.80	0.12
365	600663	陆家嘴	7,100	70,077.00	0.12
366	600737	中粮糖业	8,700	70,035.00	0.12
367	600967	内蒙一机	6,901	69,700.10	0.12
368	002985	北摩高科	1,576	69,533.12	0.12
369	600297	广汇汽车	33,100	68,848.00	0.12
370	603883	老百姓	2,302	68,714.70	0.12
371	600801	华新水泥	5,551	68,554.85	0.12
372	600155	华创云信	11,000	68,420.00	0.12

373	603225	新凤鸣	6,172	68,200.60	0.12
374	688208	道通科技	2,246	68,076.26	0.12
375	688778	厦钨新能	1,375	68,062.50	0.12
376	603529	爱玛科技	2,100	67,662.00	0.12
377	601098	中南传媒	5,800	67,280.00	0.12
378	002468	申通快递	6,200	67,084.00	0.12
379	000012	南玻 A	11,204	66,775.84	0.12
380	300482	万孚生物	2,500	66,575.00	0.12
381	001227	兰州银行	23,200	66,352.00	0.12
382	002745	木林森	7,200	66,240.00	0.12
383	600871	石化油服	33,200	65,736.00	0.12
384	603866	桃李面包	6,490	65,678.80	0.12
385	000156	华数传媒	7,500	65,250.00	0.12
386	300861	美畅股份	1,500	65,055.00	0.12
387	002032	苏泊尔	1,300	65,000.00	0.11
388	600500	中化国际	11,690	64,996.40	0.11
389	002791	坚朗五金	1,000	64,710.00	0.11
390	000401	冀东水泥	8,617	63,507.29	0.11
391	688276	百克生物	1,012	63,351.20	0.11
392	688052	纳芯微	400	63,348.00	0.11
393	002867	周大生	3,550	63,119.00	0.11
394	000581	威孚高科	4,000	63,000.00	0.11
395	601611	中国核建	7,400	62,530.00	0.11
396	002250	联化科技	5,974	62,488.04	0.11
397	600556	天下秀	8,800	62,392.00	0.11
398	601118	海南橡胶	13,900	62,272.00	0.11
399	600022	山东钢铁	43,710	62,068.20	0.11
400	688520	神州细胞	1,092	61,960.08	0.11
401	688690	纳微科技	1,586	61,616.10	0.11
402	000930	中粮科技	7,588	61,462.80	0.11
403	688029	南微医学	748	61,006.88	0.11
404	000785	居然之家	16,000	60,960.00	0.11
405	301029	怡合达	1,360	60,764.80	0.11
406	002010	传化智联	11,400	60,648.00	0.11
407	688006	杭可科技	1,973	60,117.31	0.11
408	002423	中粮资本	7,500	60,000.00	0.11
409	300850	新强联	1,600	59,808.00	0.11
410	601598	中国外运	12,800	59,648.00	0.11
411	601608	中信重工	14,100	59,361.00	0.11
412	002505	鹏都农牧	31,170	58,911.30	0.10
413	000559	万向钱潮	10,800	58,860.00	0.10
414	002081	金螳螂	13,000	58,630.00	0.10
415	600062	华润双鹤	3,362	58,566.04	0.10

416	600597	光明乳业	5,600	58,240.00	0.10
417	600782	新钢股份	15,600	57,876.00	0.10
418	600259	广晟有色	1,600	57,824.00	0.10
419	000089	深圳机场	8,300	57,685.00	0.10
420	000958	电投产融	13,100	56,723.00	0.10
421	603638	艾迪精密	2,740	56,224.80	0.10
422	600901	江苏金租	13,580	56,085.40	0.10
423	600707	彩虹股份	11,700	55,692.00	0.10
424	600339	中油工程	13,600	55,352.00	0.10
425	300618	寒锐钴业	1,700	55,097.00	0.10
426	600409	三友化工	10,094	55,012.30	0.10
427	603826	坤彩科技	1,100	55,000.00	0.10
428	000937	冀中能源	8,600	54,868.00	0.10
429	600095	湘财股份	7,000	54,600.00	0.10
430	688107	安路科技	981	54,337.59	0.10
431	000898	鞍钢股份	19,500	54,210.00	0.10
432	601187	厦门银行	10,700	53,714.00	0.10
433	603707	健友股份	3,964	53,514.00	0.09
434	601718	际华集团	17,900	53,163.00	0.09
435	002761	浙江建投	3,500	53,130.00	0.09
436	600507	方大特钢	11,432	52,930.16	0.09
437	000415	渤海租赁	25,200	52,920.00	0.09
438	000537	广宇发展	4,500	52,515.00	0.09
439	000967	盈峰环境	10,300	52,015.00	0.09
440	688234	天岳先进	702	51,905.88	0.09
441	600167	联美控股	7,440	51,856.80	0.09
442	001914	招商积余	3,400	51,170.00	0.09
443	601568	北元集团	9,690	51,066.30	0.09
444	600968	海油发展	16,600	50,962.00	0.09
445	000563	陕国投 A	16,630	50,721.50	0.09
446	600808	马钢股份	19,700	50,629.00	0.09
447	601156	东航物流	3,800	49,400.00	0.09
448	002925	盈趣科技	2,530	49,082.00	0.09
449	002705	新宝股份	2,700	48,681.00	0.09
450	300257	开山股份	3,173	48,134.41	0.09
451	600195	中牧股份	4,108	47,981.44	0.08
452	600126	杭钢股份	11,040	47,913.60	0.08
453	603379	三美股份	1,980	46,549.80	0.08
454	600764	中国海防	1,700	46,274.00	0.08
455	002608	江苏国信	6,100	46,177.00	0.08
456	300442	润泽科技	1,500	46,140.00	0.08
457	603650	彤程新材	1,400	45,920.00	0.08
458	000959	首钢股份	12,700	44,450.00	0.08

459	000402	金融街	9,700	43,844.00	0.08
460	002653	海思科	1,800	42,480.00	0.08
461	601828	美凯龙	8,800	42,152.00	0.07
462	002110	三钢闽光	9,950	41,989.00	0.07
463	688185	康希诺	512	41,728.00	0.07
464	002563	森马服饰	6,600	41,052.00	0.07
465	001203	大中矿业	3,600	39,996.00	0.07
466	601228	广州港	12,300	39,729.00	0.07
466	601298	青岛港	5,700	39,729.00	0.07
467	603786	科博达	600	39,420.00	0.07
468	600377	宁沪高速	4,000	39,320.00	0.07
469	688289	圣湘生物	2,330	39,237.20	0.07
470	603056	德邦股份	2,500	38,550.00	0.07
471	000031	大悦城	10,457	38,272.62	0.07
472	603317	天味食品	2,609	38,117.49	0.07
473	600928	西安银行	10,800	38,016.00	0.07
474	600623	华谊集团	6,100	38,003.00	0.07
475	688819	天能股份	1,030	37,945.20	0.07
476	600927	永安期货	2,300	37,398.00	0.07
477	600350	山东高速	5,500	35,035.00	0.06
478	002399	海普瑞	3,000	34,410.00	0.06
479	601139	深圳燃气	4,700	34,263.00	0.06
480	601136	首创证券	2,400	34,008.00	0.06
481	000869	张裕 A	1,100	33,726.00	0.06
482	601869	长飞光纤	900	33,309.00	0.06
483	601969	海南矿业	4,900	32,242.00	0.06
484	001872	招商港口	1,800	31,086.00	0.05
485	600995	南网储能	2,800	30,828.00	0.05
486	002945	华林证券	2,200	30,096.00	0.05
487	688105	诺唯赞	980	29,880.20	0.05
488	000553	安道麦 A	3,500	29,540.00	0.05
489	688248	南网科技	692	26,565.88	0.05
490	601158	重庆水务	4,700	26,132.00	0.05
491	600299	安迪苏	3,200	25,504.00	0.05
492	688295	中复神鹰	662	24,282.16	0.04
493	603355	莱克电气	880	22,360.80	0.04
494	300741	华宝股份	1,000	21,420.00	0.04
495	600032	浙江新能	1,700	21,352.00	0.04
496	600956	新天绿能	2,400	20,928.00	0.04
497	603868	飞科电器	300	18,927.00	0.03
498	002901	大博医疗	400	12,432.00	0.02

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000540	中天金融	41,300	4,543.00	0.01

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	002463	沪电股份	235,564.00	0.39
2	000066	中国长城	219,416.00	0.36
3	600372	中航电子	198,803.00	0.33
4	000423	东阿阿胶	189,294.00	0.31
5	000933	神火股份	178,443.00	0.30
6	002240	盛新锂能	176,983.00	0.29
7	002008	大族激光	169,927.00	0.28
8	688072	拓荆科技	167,778.43	0.28
9	603882	金域医学	167,499.00	0.28
10	688169	石头科技	152,092.98	0.25
11	300395	菲利华	148,960.00	0.25
12	002600	领益智造	147,572.00	0.25
13	688536	思瑞浦	143,667.60	0.24
14	688220	翱捷科技	142,389.72	0.24
15	300487	蓝晓科技	132,181.00	0.22
16	300118	东方日升	131,295.00	0.22
17	601966	玲珑轮胎	130,602.00	0.22
18	002432	九安医疗	129,059.00	0.21
19	300595	欧普康视	127,586.00	0.21
20	300438	鹏辉能源	118,892.00	0.20

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	688122	西部超导	262,735.52	0.44
2	603345	安井食品	230,478.00	0.38
3	603605	珀莱雅	220,823.80	0.37
4	000999	华润三九	214,762.00	0.36
5	601607	上海医药	214,196.00	0.36
6	002603	以岭药业	197,967.60	0.33
7	603606	东方电缆	174,930.00	0.29
8	601699	潞安环能	173,023.00	0.29
9	601872	招商轮船	170,076.00	0.28
10	688063	派能科技	166,667.05	0.28
11	603613	国联股份	164,473.00	0.27
12	300168	万达信息	163,194.00	0.27

13	600026	中远海能	146,940.70	0.24
14	601333	广深铁路	116,947.00	0.19
15	002212	天融信	108,458.00	0.18
16	600201	生物股份	96,068.17	0.16
17	600728	佳都科技	93,829.00	0.16
18	002396	星网锐捷	86,739.00	0.14
19	688188	柏楚电子	81,726.00	0.14
20	688088	虹软科技	77,846.39	0.13

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	7,896,861.55
卖出股票收入（成交）总额	8,077,477.06

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	581.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	581.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000540	中天金融	4,543.00	0.01	退市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		中国银行股份有限公司 -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	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
363	84, 223. 02	2, 521, 800. 00	8. 25	1, 288, 156. 00	4. 21	26, 763, 000. 00	87. 54

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国银行股份有限公司-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	26, 763, 000. 00	87. 54
2	中信证券股份有限公司	1, 995, 800. 00	6. 53
3	中信建投证券股份有限公司	526, 000. 00	1. 72
4	杜培新	102, 700. 00	0. 34
5	王丽花	90, 000. 00	0. 29
6	沈健美	78, 000. 00	0. 26
7	高伟焯	46, 000. 00	0. 15
8	李艳	35, 600. 00	0. 12
9	孙飞	30, 000. 00	0. 10
10	沈国强	27, 000. 00	0. 09
11	王仁	26, 292. 00	0. 09

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本期末基金管理人的所有从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

- 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 (2013 年 12 月 26 日)	512, 572, 956. 00
----------------------------	-------------------

基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	33,572,956.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	3,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	30,572,956.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	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 (%)	
长城证券股份 有限公司	3	8,367,222.37	53.17	7,793.86	53.17	-
东方证券股份 有限公司	2	7,370,620.18	46.83	6,864.28	46.83	-
德邦证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	本期报 告新增1 个
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	2	-	-	-	-	-
华宝证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	本期报 告新增2 个
华泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份 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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
中信建投证	2	-	-	-	-	-

券股份有限 公司						
中信证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长城证券股份 有限公司	39,876.39	100.00	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份 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	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份 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	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 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 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 10 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中金财富证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 24 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 25 日
7	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 28 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及	2023 年 3 月 28 日

	基金 2022 年年度报告提示性公告	网站	
9	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开通“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”业务并修改基金合同、托管协议公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 30 日
10	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 30 日
11	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 30 日
12	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 30 日
13	关于景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金“深市股票实物申赎、沪市股票现金替代”模式下增加申购赎回代理券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 3 日
14	关于景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 3 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 8 日
16	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	2023 年 4 月 18 日
17	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 21 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 22 日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 6 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 13 日
22	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
23	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 2 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 26 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 27 日
25	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 10 日
26	关于景顺长城基金管理有限公司旗下	中国证监会指定报刊及	2023 年 6 月 10 日

	基金调整持有停牌股票估值价格的公告	网站	
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 17 日
28	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基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 20 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 22 日
30	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 3 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 22 日
31	景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 6 月 22 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 (%)
本基金的联接基金	1	20230101-20230630	31,029,900.00	54,800.00	4,321,700.00	26,763,000.00	87.54

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，充分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

为更好地满足广大投资者的理财要求，根据深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司关于跨市场股票 ETF “深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”业务方案，景顺长城基金管理有限公司与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 4 月 3 日起对景顺长城中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增场内“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”业务，并对本基金《基金合同》、《托管协议》作出相应修改。详情请参阅本基金管理人于 2023 年 3 月 30 日发布的《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开通“深市股票实物申赎，沪市股票现金替代”业务并修改基金合同、托管协议公告》。

§ 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

2023 年 8 月 30 日