

景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式 指数证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 28 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
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	47
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	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	50
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	50
10.8 其他重大事件	56
§ 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	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 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	景顺长城中证 500 增强策略 ETF
场内简称	中证 500 增强 ETF 景顺
基金主代码	159610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 13 日
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	145,568,207.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 1 月 10 日

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	36,824,360.30
本期利润	49,008,715.81
加权平均基金份额本期利润	0.3010
本期加权平均净值利润率	24.30%
本期基金份额净值增长率	26.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	58,270,222.02
期末可供分配基金份额利润	0.4003
期末基金资产净值	204,842,119.25
期末基金份额净值	1.4072
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	40.72%

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

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

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

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

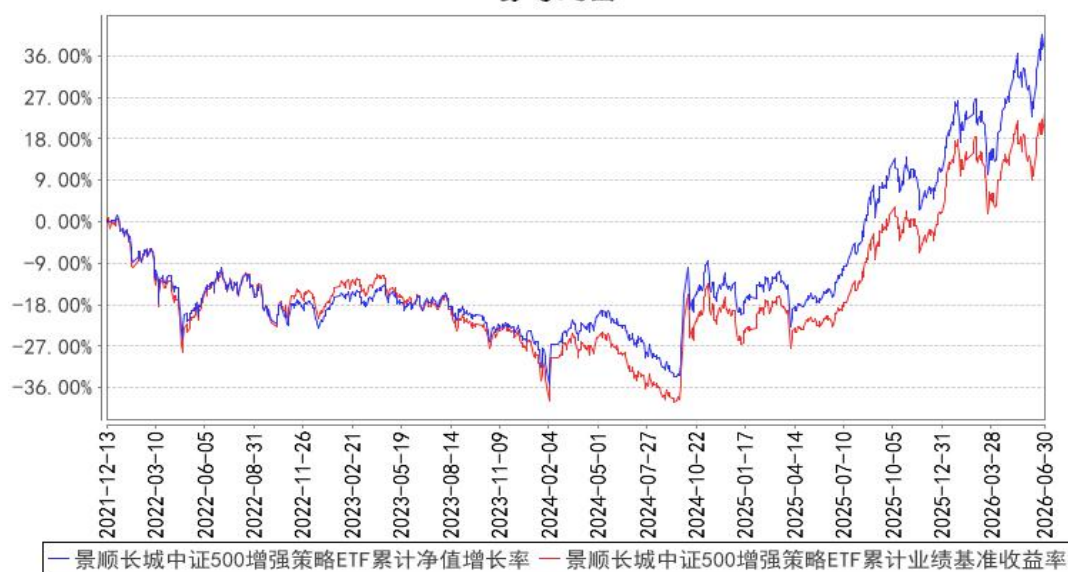
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	23.94%	1.53%	18.56%	1.65%	5.38%	-0.12%
过去六个月	26.73%	1.56%	20.97%	1.66%	5.76%	-0.10%
过去一年	60.69%	1.38%	52.68%	1.42%	8.01%	-0.04%
过去三年	69.93%	1.40%	50.55%	1.49%	19.38%	-0.09%
自基金合同生效起至今	40.72%	1.32%	23.60%	1.40%	17.12%	-0.08%

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

景顺长城中证500增强策略ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的投资组合比例为：基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2021 年 12 月 13 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2026 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 233 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
金璜	本基金的基金助理	2024 年 5 月 22 日	—	10 年	工 学 硕 士 ， CFA 。 曾 任 美 国 AltfestPersonalWealthManagement（艾福斯特个人财富管理）投资部量化研究员，Morgan Stanley（美国摩根士丹利）风险管理部信用风险分析员。2018 年 7 月加入本公司，历任风险管理部经理、ETF 与创新投资部研究员、ETF 与创新投资部基金经理助理，自 2023 年 9 月起担任 ETF 与创新投资部基金经理。具有 10 年证券、基金行业从业经验。
张 晓 南	本基金的基金经理	2024 年 5 月 30 日	—	16 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，现任 ETF 与创新投资部总监、基金经理。具有 16 年证券、基金行业从业经验。
郭琳	本基金的基金经理	2024 年 7 月 20 日	—	12 年	理学硕士。曾任大成国际资产管理有限公司投资研究部高级研究员。2016 年 8 月加入本公司，历任研究部研究员、专户投资部投资经理、研究部基金经理助理，自 2022 年 7 月起担任股票投资部基金经理，现任研究部基金经理。具有 12 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”为公司决定且公告的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”及“离任日期”指根据公司决定且公告的聘任、解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况
无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 10 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

2026 年上半年 A 股整体呈现先抑后扬、结构极致分化的走势，科技成长板块在二季度强势爆发带动下领涨全市场，而一季度表现占优的周期与红利板块在二季度明显回撤。市场主要指数涨跌幅及排序为：科创 50 (64.25%) > 创业板 50 (37.01%) > 中证 500 (20.97%) > 沪深 300 (7.55%)。市值维度分化较大，规模指数涨跌幅及排序为：中证 500 (20.97%) > 中证 1000 (15.99%) > 中证 2000 (9.10%) > 沪深 300 (7.55%)。风格维度成长大幅领涨，中信风格指数涨跌幅及排序为：成长 (36.71%) > 周期 (-4.31%) > 稳定 (-6.36%) > 金融 (-12.58%) > 消费 (-13.46%)。行业维度，中信证券一级行业指数涨跌幅前五为：电子 (85.49%) > 通信 (74.54%) > 建材 (43.70%) > 基础化工 (18.56%) > 机械 (16.17%)，后五为：消费者服务 (-31.88%) < 综合金融 (-29.58%) < 综合 (-25.09%) < 农林牧渔 (-24.76%) < 商贸零售 (-22.18%)。

2026 年上半年中国经济呈现“前稳后弱、外强内弱”的分化格局，但整体运行稳健。上半年

GDP 同比增长 4.7%，落在全年经济增速目标区间的中沿；二季度增速 4.3%，较一季度的 5.0%温和回落。价格端，二季度 GDP 平减指数同比上涨 1.4%，价格修复仍在延续；不过 7 月中东冲突再度升温令油价走势不确定性上升，对后续价格判断形成扰动。

从最近的 6 月数据来看，内外需在分化中已显露出边际改善的暖意。内需方面，社零在基数走低与“以旧换新”品类修复的支撑下由负转正，同比增长 1.0%；更全面的居民消费支出数据显示，二季度居民消费增速由 3.6%回升至 3.8%，说明前期社零下滑更多受“以旧换新”退坡拖累，更广泛的服务消费韧性犹在。投资端仍在低位，6 月当月同比下滑约一成，但其中制造业投资跌幅收窄、由-4.2%回升至-3.2%，基建与房地产投资则分别下滑 10.2%和 24.4%。房地产呈现一线企稳、全局分化的特征：一线城市二手房价 6 月环比上涨 0.3%，已实现连续 4 个月 0.3%以上的涨幅，表现甚至好于“924”之后，但企稳仍局限于一线城市，尚未向更广泛城市及一手房扩散。

外需是上半年较为突出的主线。6 月出口（美元计价）同比增速由 19.4%进一步攀升至 27%，连续大幅超出市场预期，背后是 AI 产业高景气、关税扰动消退与中国供应链优势的共同驱动，机电、劳动密集型与原材料出口在 6 月迎来广谱改善。强劲的出口也带动生产端修复，工业增加值同比由 4.5%回升至 5.3%。需要留意的是，二季度产能利用率由 73.6%回落至 73.0%，逼近历史低点 72.9%，价格企稳回升的内生动能仍偏弱，后续复苏的基础也尚需进一步夯实。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 26.73%，业绩比较基准收益率为 20.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前来看，二季度经济下行主要源于财政支出力度边际放缓。7 月中旬的经济形势座谈会明确要求“加大逆周期调节力度，用好用足存量政策，预研储备增量政策”，并强调“做好下半年经济工作直接关系全年发展目标实现”。预计财政工具下半年将加速落地，基建投资有望在“六张网”建设带动下回升，传统经济部门或有所修复，内外需分化也有望收敛。消费则仍受居民就业与预期偏弱制约，预计维持低速弱修复；房地产延续“销售回暖、投资仍待企稳”的分化格局。整体而言，经济或将呈现“稳中承压、结构分化”的运行态势，在稳增长政策持续发力下，下半年基本面的支撑将更为扎实，A 股科技成长与出口链的结构性机遇有望延续。

宽基指数成分覆盖均衡，天然横跨多行业、风格分布多元，既包含上半年领涨的科技成长，也涵盖处于估值低位的传统蓝筹，在结构极致分化的行情中具备较好的风险分散与修复弹性。当前宽基指数估值仍处历史合理偏低区间，在盈利周期回升与稳增长政策加码的共同作用下，有望迎来估值与盈利的“双击”；其中中小盘方向更偏新质生产力、修复弹性更足，大盘方向稳定性突出，增强策略则可在跟踪基础上力争获取超额收益。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。基金估值委员会的成员包括投资部、研究部/固定收益部信评人员、基金事务部、法律监察稽核部、风险管理部等相关人员。本基金托管人根据基金合同及法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、

准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6. 4. 7. 1	2, 889, 211. 26	3, 236, 114. 68
结算备付金		1, 515, 051. 70	1, 366, 096. 73
存出保证金		69, 043. 14	103, 095. 71
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	201, 032, 894. 55	227, 914, 015. 65
其中：股票投资		201, 024, 894. 41	227, 914, 015. 65
基金投资		-	-
债券投资		8, 000. 14	-
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		93, 369. 56	1, 155, 680. 92
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		205, 599, 570. 21	233, 775, 003. 69
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		118,280.92	967,567.34
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		75,456.92	99,888.13
应付托管费		15,091.38	19,977.62
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	548,621.74	1,085,701.52
负债合计		757,450.96	2,173,134.61
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	145,568,207.00	208,568,207.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	59,273,912.25	23,033,662.08
净资产合计		204,842,119.25	231,601,869.08
负债和净资产总计		205,599,570.21	233,775,003.69

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.4072 元，基金份额总额 145,568,207.00 份。

6.2 利润表

会计主体：景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		49,759,270.19	23,326,625.00
1. 利息收入		9,140.85	12,087.58
其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,140.85	12,087.58
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		37,227,212.01	-833,426.15
其中：股票投资收益	6.4.7.14	35,930,496.22	-5,112,100.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	0.14	113,353.81
资产支持证券投	6.4.7.16	-	-

资收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,296,715.65	4,165,320.37
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	12,184,355.51	23,977,720.33
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	338,561.82	170,243.24
减：二、营业总支出		750,554.38	1,653,986.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	503,351.03	1,237,310.32
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	100,670.17	247,462.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.33
8. 其他费用	6.4.7.23	146,533.18	169,214.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		49,008,715.81	21,672,638.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		49,008,715.81	21,672,638.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		49,008,715.81	21,672,638.03

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 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	208,568,207.00	-	23,033,662.08	231,601,869.08

资产				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	208,568,207.00	-	23,033,662.08	231,601,869.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-63,000,000.00	-	36,240,250.17	-26,759,749.83
(一)、综合收益总额	-	-	49,008,715.81	49,008,715.81
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-63,000,000.00	-	-12,768,465.64	-75,768,465.64
其中：1. 基金申购款	76,000,000.00	-	18,987,424.31	94,987,424.31
2. 基金赎回款	-139,000,000.00	-	-31,755,889.95	-170,755,889.95
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	145,568,207.00	-	59,273,912.25	204,842,119.25
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	818,568,207.00	-	-128,115,083.82	690,453,123.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	818,568,207.00	-	-128,115,083.82	690,453,123.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-337,000,000.00	-	68,267,101.36	-268,732,898.64
(一)、综合收益总额	-	-	21,672,638.03	21,672,638.03
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-337,000,000.00	-	46,594,463.33	-290,405,536.67
其中：1. 基金申购款	262,000,000.00	-	-41,661,617.22	220,338,382.78
2. 基金赎回款	-599,000,000.00	-	88,256,080.55	-510,743,919.45
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	481,568,207.00	-	-59,847,982.46	421,720,224.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

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

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

本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 2026 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体

会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税，金融

同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部 国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《财政部 国家税务总局 证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得

暂免征收个人所得税。

(4) 印花税

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

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《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[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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,889,211.26
等于：本金	2,889,023.37
加：应计利息	187.89
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1 个月（含）-3 个月	—
存款期限 3 个月（含）至 1 年	—
存款期限 1 年（含）以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	2,889,211.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		181,691,969.39	-	201,024,894.41	19,332,925.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,000.00	0.14	8,000.14	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,000.00	0.14	8,000.14	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		181,699,969.39	0.14	201,032,894.55	19,332,925.02

注：股票投资的公允价值包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末的其他资产余额为零。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	117,438.06
其中：交易所市场	117,438.06
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	146,287.82
应退替代款	246,877.86
可退替代款	38,018.00
合计	548,621.74

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	208,568,207.00	208,568,207.00
本期申购	76,000,000.00	76,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-139,000,000.00	-139,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	145,568,207.00	145,568,207.00

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,987,766.29	-13,954,104.21	23,033,662.08
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	36,987,766.29	-13,954,104.21	23,033,662.08
本期利润	36,824,360.30	12,184,355.51	49,008,715.81
本期基金份额交易产生的变动数	-15,541,904.57	2,773,438.93	-12,768,465.64
其中：基金申购款	22,514,513.24	-3,527,088.93	18,987,424.31
基金赎回款	-38,056,417.81	6,300,527.86	-31,755,889.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	58,270,222.02	1,003,690.23	59,273,912.25

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
活期存款利息收入	4,763.89
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	4,213.41
其他	163.55
合计	9,140.85

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	31,320,678.66
股票投资收益——赎回差价收入	4,609,817.56
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	35,930,496.22
----	---------------

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	592,652,642.55
减：卖出股票成本总额	560,738,600.29
减：交易费用	593,363.60
买卖股票差价收入	31,320,678.66

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	170,755,889.95
减：现金支付赎回款总额	87,547,456.95
减：赎回股票成本总额	78,598,615.44
减：交易费用	-
赎回差价收入	4,609,817.56

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	0.14

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,296,715.65
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	1,296,715.65

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	12,184,355.51
股票投资	12,184,355.51
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	12,184,355.51

注：公允价值变动损益—股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	338,561.82
合计	338,561.82

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

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	17,356.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	228.00
IOPV 数据费	9,916.99
注册登记费	59,507.37
存托服务费	17.36
合计	146,533.18

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、关联关系

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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
--------------------	--------------------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金 额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
长城证券	-	-	252,362,020.51	10.62

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
长城证券	49,209.59	10.62	49,209.59	21.71

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

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，被动股票型基金不得通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	503,351.03	1,237,310.32

其中：应支付销售机构的客户维护费	158,564.96	309,695.96
应支付基金管理人的净管理费	344,786.07	927,614.36

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

$$\text{日管理人报酬}=\text{前一日基金资产净值}\times0.50\%/\text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	100,670.17	247,462.08

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

$$\text{日托管费}=\text{前一日基金资产净值}\times0.10\%/\text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行－活期	2,889,211.26	4,763.89	3,947,661.48	7,971.96

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	88	4,686.88	5,169.12	—
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	75	1,378.50	1,258.50	—
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	219	5,954.61	6,856.89	—
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	155	4,708.90	6,043.45	—
001399	惠科股	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	986	9,978.32	27,341.78	—

	份									
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	136	3,625.76	6,930.56	-
301531	春光集团	2026年4月28日	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	244	3,245.20	12,580.64	-
301599	理奇智能	2026年4月22日	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	260	3,616.60	8,442.20	-
301669	高特电子	2026年6月2日	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	404	2,860.32	11,473.60	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	46	3,605.48	5,601.42	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	133	3,282.44	11,544.40	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	229	2,560.22	4,028.11	-
603293	埃泰克	2026年4月9日	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	38	1,272.62	1,289.34	-
603352	至信股份	2026年1月8日	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	86	1,881.68	2,194.72	-
603407	长裕集团	2026年4月29日	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-

603435	嘉德利	2026年5月15日	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	97	1,528.72	4,530.87	-
603459	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	138	2,442.60	11,636.16	-
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	90	3,688.20	27,737.10	-
688712	北芯生命	2026年1月28日	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	149	2,610.48	5,352.08	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	6个月	新股流通受限	22.68	47.61	71	1,610.28	3,380.31	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	62	5,715.16	28,715.30	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	73	3,252.88	34,212.91	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	51	4,175.88	80,800.83	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	665	4,262.65	16,046.45	-
688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	新股流通受限	9.47	70.14	684	6,477.48	47,975.76	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华	2026	1个月	新债	100.00	100.00	80	8,000.00	8,000.14	-

	峰 转 债	年 6 月 24 日	内（含）	未上 市						
--	-------------	---------------	------	---------	--	--	--	--	--	--

注：以上限售证券的实际流通日期以上市公司的公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用

风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流

通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	2,889,211.26	-	-	-	-	-	2,889,211.26
结算备付金	1,515,051.70	-	-	-	-	-	1,515,051.70

存出保证金	69,043.14	-	-	-	-	-	69,043.14
交易性金融资产	-	-	-	-	8,000.14	201,024,894.41	201,032,894.55
应收清算款	-	-	-	-	-	93,369.56	93,369.56
资产总计	4,473,306.10	-	-	-	8,000.14	201,118,263.97	205,599,570.21
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	75,456.92	75,456.92
应付托管费	-	-	-	-	-	15,091.38	15,091.38
应付清算款	-	-	-	-	-	118,280.92	118,280.92
其他负债	-	-	-	-	-	548,621.74	548,621.74
负债总计	-	-	-	-	-	757,450.96	757,450.96
利率敏感度缺口	4,473,306.10	-	-	-	8,000.14	-	-
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	3,236,114.68	-	-	-	-	-	3,236,114.68
结算备付金	1,366,096.73	-	-	-	-	-	1,366,096.73
存出保证金	103,095.71	-	-	-	-	-	103,095.71
交易性金融资产	-	-	-	-	-	227,914,015.65	227,914,015.65
应收清算款	-	-	-	-	-	1,155,680.92	1,155,680.92
资产总计	4,705,307.12	-	-	-	-	229,069,696.57	233,775,003.69
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	99,888.13	99,888.13
应付托管费	-	-	-	-	-	19,977.62	19,977.62
应付清算款	-	-	-	-	-	967,567.34	967,567.34
其他负债	-	-	-	-	-	1,085,701.52	1,085,701.52
负债总计	-	-	-	-	-	2,173,134.61	2,173,134.61
利率敏感度缺口	4,705,307.12	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.00%（上年度末：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	201,024,894.41	98.14	227,914,015.65	98.41
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	201,024,894.41	98.14	227,914,015.65	98.41

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	10,233,210.64	14,262,289.56
	沪深 300 指数下降 5%	-10,233,210.64	-14,262,289.56

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	200,628,520.79	227,537,523.62
第二层次	8,000.14	-
第三层次	396,373.62	376,492.03
合计	201,032,894.55	227,914,015.65

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	201,024,894.41	97.77
	其中：股票	201,024,894.41	97.77
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	8,000.14	0.00
	其中：债券	8,000.14	0.00
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	4,404,262.96	2.14
8	其他各项资产	162,412.70	0.08
9	合计	205,599,570.21	100.00

注：本表权益投资股票项中，含可退替代款估值增值 1,148.00 元，而 7.2 中不含可退替代款估值增值，因此二者存在差异。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	3,279,875.00	1.60
C	制造业	135,353,027.10	66.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,845,924.00	0.90
E	建筑业	794,538.00	0.39
F	批发和零售业	4,756,320.00	2.32
G	交通运输、仓储和邮政业	1,661,868.00	0.81
H	住宿和餐饮业	1,018,234.00	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,261,731.71	3.55
J	金融业	10,677,877.00	5.21
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	655,270.00	0.32

M	科学研究和技术服务业	1,399,860.00	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	828,172.00	0.40
S	综合	—	—
	合计	169,532,696.81	82.76

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	1,508,860.00	0.74
C	制造业	21,801,939.85	10.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	685,573.00	0.33
E	建筑业	390,052.00	0.19
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	672,952.00	0.33
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,216,664.75	1.08
J	金融业	2,652,717.00	1.30
K	房地产业	603,564.00	0.29
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	958,727.00	0.47
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	31,491,049.60	15.37

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	001309	德明利	4,400	4,148,760.00	2.03
2	688498	源杰科技	2,125	4,007,750.00	1.96
3	301536	星辰科技	29,200	3,758,332.00	1.83
4	688347	华虹宏力	10,245	3,445,393.50	1.68
5	300475	香农芯创	10,900	3,270,000.00	1.60
6	688002	睿创微纳	21,075	3,260,091.75	1.59
7	002281	光迅科技	11,900	3,057,586.00	1.49
8	688235	百济神州	12,004	3,056,338.44	1.49
9	300223	北京君正	12,000	2,986,800.00	1.46
10	300857	协创数据	8,620	2,929,938.00	1.43
11	688266	泽璟制药	24,862	2,900,400.92	1.42
12	002008	大族激光	17,800	2,671,958.00	1.30
13	300142	沃森生物	184,900	2,401,851.00	1.17
14	603077	和邦生物	1,033,200	2,397,024.00	1.17
15	301526	国际复材	47,900	2,235,493.00	1.09
16	300604	长川科技	6,400	2,185,088.00	1.07
17	600816	建元信托	869,100	2,120,604.00	1.04
18	688349	三一重能	135,925	2,063,341.50	1.01
19	601108	财通证券	234,000	2,024,100.00	0.99
20	002185	华天科技	90,500	2,019,055.00	0.99
21	002436	兴森科技	39,000	1,987,050.00	0.97
22	002407	多氟多	38,900	1,953,947.00	0.95
23	600927	永安期货	147,100	1,831,395.00	0.89
24	600390	五矿资本	388,800	1,772,928.00	0.87
25	600497	驰宏锌锗	146,100	1,769,271.00	0.86
26	000800	一汽解放	286,900	1,707,055.00	0.83
27	002738	中矿资源	28,700	1,693,013.00	0.83
28	301611	珂玛科技	9,400	1,692,658.00	0.83
29	688777	中控技术	14,283	1,678,252.50	0.82
30	002120	韵达股份	261,300	1,661,868.00	0.81
31	000703	恒逸石化	121,900	1,654,183.00	0.81
32	600884	杉杉股份	120,700	1,635,485.00	0.80
33	002517	恺英网络	100,300	1,629,875.00	0.80
34	000519	中兵红箭	76,400	1,609,748.00	0.79
35	301358	湖南裕能	21,000	1,593,270.00	0.78
36	002414	高德红外	117,900	1,563,354.00	0.76

37	002812	恩捷股份	23,200	1,552,312.00	0.76
38	688475	萤石网络	55,434	1,516,119.90	0.74
39	605358	立昂微	19,400	1,505,440.00	0.73
40	300136	信维通信	12,400	1,478,700.00	0.72
41	002126	银轮股份	29,200	1,454,160.00	0.71
42	601577	长沙银行	164,600	1,433,666.00	0.70
43	002203	海亮股份	61,800	1,412,130.00	0.69
44	300012	华测检测	101,000	1,399,860.00	0.68
45	688331	荣昌生物	10,305	1,342,329.30	0.66
46	603345	安井食品	16,700	1,339,173.00	0.65
47	301377	鼎泰高科	2,400	1,322,160.00	0.65
48	300339	润和软件	33,700	1,297,787.00	0.63
49	601233	桐昆股份	58,700	1,270,855.00	0.62
50	600105	永鼎股份	18,700	1,261,876.00	0.62
51	601869	长飞光纤	2,300	1,255,570.00	0.61
52	300037	新宙邦	13,400	1,244,190.00	0.61
53	002841	视源股份	36,000	1,243,080.00	0.61
54	002056	横店东磁	39,800	1,213,104.00	0.59
55	600177	雅戈尔	161,100	1,213,083.00	0.59
56	600801	华新建材	77,400	1,207,440.00	0.59
57	300390	天华新能	12,900	1,206,279.00	0.59
58	688200	华峰测控	2,290	1,202,479.00	0.59
59	603899	晨光股份	57,900	1,194,477.00	0.58
60	600688	上海石化	398,900	1,168,777.00	0.57
61	002851	麦格米特	6,500	1,086,670.00	0.53
62	002821	凯莱英	6,700	1,085,400.00	0.53
63	001286	陕西能源	102,000	1,034,280.00	0.50
64	300620	光库科技	2,700	1,021,140.00	0.50
65	600754	锦江酒店	56,600	1,018,234.00	0.50
66	600546	山煤国际	91,800	1,003,374.00	0.49
67	603444	吉比特	2,700	967,734.00	0.47
68	300548	长芯博创	3,400	945,200.00	0.46
69	600601	方正科技	68,200	943,888.00	0.46
70	300395	菲利华	7,000	936,110.00	0.46
71	001389	广合科技	3,900	925,275.00	0.45
72	688708	佳驰科技	17,947	911,707.60	0.45
73	000709	河钢股份	468,600	909,084.00	0.44
74	002271	东方雨虹	74,600	885,502.00	0.43
75	688220	翱捷科技	7,074	879,439.68	0.43
76	300458	全志科技	22,200	876,012.00	0.43
77	603129	春风动力	3,400	869,720.00	0.42
78	300757	罗博特科	1,400	866,600.00	0.42
79	600901	江苏金租	149,600	860,200.00	0.42

80	300054	鼎龙股份	8,000	847,760.00	0.41
81	600977	中国电影	64,100	828,172.00	0.40
82	688385	复旦微电	11,552	823,542.08	0.40
83	000951	中国重汽	42,000	819,420.00	0.40
84	688728	格科微	38,739	815,068.56	0.40
85	601139	深圳燃气	143,400	811,644.00	0.40
86	600398	海澜之家	152,700	798,621.00	0.39
87	300972	万辰集团	4,600	797,686.00	0.39
88	600170	上海建工	357,900	794,538.00	0.39
89	002064	华峰化学	83,100	788,619.00	0.38
90	300346	南大光电	8,400	778,260.00	0.38
91	603225	新凤鸣	38,600	758,490.00	0.37
92	600298	安琪酵母	20,800	752,960.00	0.37
93	000960	锡业股份	17,500	747,075.00	0.36
94	688469	芯联集成	70,406	747,007.66	0.36
95	601608	中信重工	156,500	746,505.00	0.36
96	603256	宏和科技	2,800	742,924.00	0.36
97	688629	华丰科技	3,887	728,851.37	0.36
98	603308	应流股份	12,000	724,800.00	0.35
99	600711	盛屯矿业	65,300	716,341.00	0.35
100	300373	扬杰科技	4,500	707,535.00	0.35
101	003031	中瓷电子	3,900	703,170.00	0.34
102	603699	纽威股份	13,800	694,140.00	0.34
103	603939	益丰药房	38,300	688,634.00	0.34
104	603338	浙江鼎力	16,100	684,250.00	0.33
105	603298	杭叉集团	28,600	682,396.00	0.33
106	000629	钒钛股份	203,400	679,356.00	0.33
107	002318	久立特材	28,137	672,474.30	0.33
108	002444	巨星科技	21,600	671,760.00	0.33
109	002273	水晶光电	18,900	670,572.00	0.33
110	688169	石头科技	6,969	661,845.93	0.32
111	000415	渤海租赁	161,000	655,270.00	0.32
112	600885	宏发股份	18,900	651,861.00	0.32
113	000987	越秀资本	81,200	634,984.00	0.31
114	600988	赤峰黄金	24,000	631,680.00	0.31
115	300957	贝泰妮	19,900	627,049.00	0.31
116	600499	科达制造	45,100	622,380.00	0.30
117	688188	柏楚电子	5,828	621,847.60	0.30
118	002756	永兴材料	10,900	617,376.00	0.30
119	300677	英科医疗	15,500	607,135.00	0.30
120	002624	完美世界	48,300	599,886.00	0.29
121	301606	绿联科技	9,740	594,334.80	0.29
122	600808	马钢股份	237,600	594,000.00	0.29

123	000830	鲁西化工	48,700	584,400.00	0.29
124	000983	山西焦煤	97,300	564,340.00	0.28
125	002032	苏泊尔	13,900	550,440.00	0.27
126	688192	迪哲医药	13,290	530,669.70	0.26
127	600879	航天电子	23,800	506,702.00	0.25
128	688692	达梦数据	1,909	466,349.61	0.23
129	600562	国睿科技	21,700	460,474.00	0.22
130	600595	中孚实业	78,500	441,170.00	0.22
131	600566	济川药业	17,300	383,887.00	0.19
132	601699	潞安环能	25,500	364,140.00	0.18
133	601112	振石股份	229	4,028.11	0.00

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	688403	汇成股份	29,761	1,181,511.70	0.58
2	603186	华正新材	4,800	1,081,440.00	0.53
3	688456	有研粉材	7,378	1,029,968.80	0.50
4	003018	金富科技	13,100	998,613.00	0.49
5	600549	厦门钨业	11,300	962,760.00	0.47
6	603259	药明康德	7,700	958,727.00	0.47
7	688041	海光信息	2,567	950,560.10	0.46
8	300661	圣邦股份	6,500	932,620.00	0.46
9	688256	寒武纪	545	869,574.75	0.42
10	300201	海伦哲	39,100	823,837.00	0.40
11	300438	鹏辉能源	9,800	811,930.00	0.40
12	301018	申菱环境	6,900	797,709.00	0.39
13	601211	国泰海通	43,200	786,240.00	0.38
14	002422	科伦药业	20,400	785,808.00	0.38
15	002993	奥海科技	10,900	780,549.00	0.38
16	603078	江化微	15,700	775,894.00	0.38
17	688059	华锐精密	3,838	766,486.98	0.37
18	603876	鼎胜新材	28,700	746,487.00	0.36
19	600118	中国卫星	9,000	738,450.00	0.36
20	002931	锋龙股份	10,400	717,392.00	0.35
21	002602	世纪华通	49,600	699,360.00	0.34
22	600900	长江电力	25,900	685,573.00	0.33
23	002541	鸿路钢构	38,900	673,748.00	0.33
24	600012	皖通高速	42,700	672,952.00	0.33
25	002552	宝鼎科技	11,000	671,000.00	0.33
26	601727	上海电气	95,700	669,900.00	0.33
27	002001	新和成	23,200	659,344.00	0.32
28	000333	美的集团	8,700	657,111.00	0.32
29	603859	能科科技	13,500	647,730.00	0.32

30	601899	紫金矿业	25,100	631,014.00	0.31
31	600007	中国国贸	31,800	603,564.00	0.29
32	000688	国城矿业	17,000	581,910.00	0.28
33	600999	招商证券	21,000	443,100.00	0.22
34	603115	海星股份	3,600	440,892.00	0.22
35	300033	同花顺	1,800	433,800.00	0.21
36	002916	深南电路	900	412,110.00	0.20
37	301235	华康洁净	5,200	390,052.00	0.19
38	301150	中一科技	6,060	382,446.60	0.19
39	002353	杰瑞股份	2,400	366,000.00	0.18
40	688390	固德威	3,098	336,163.98	0.16
41	600036	招商银行	9,300	330,150.00	0.16
42	600919	江苏银行	30,600	329,868.00	0.16
43	002142	宁波银行	11,100	329,559.00	0.16
44	601058	赛轮轮胎	28,400	327,452.00	0.16
45	002478	常宝股份	51,600	318,888.00	0.16
46	688205	德科立	1,497	311,660.43	0.15
47	688677	海泰新光	2,975	300,861.75	0.15
48	002128	电投能源	12,800	295,936.00	0.14
49	688808	联讯仪器	51	80,800.83	0.04
50	688818	电科蓝天	684	47,975.76	0.02
51	688797	臻宝科技	73	34,212.91	0.02
52	688785	恒运昌	62	28,715.30	0.01
53	688635	长进光子	90	27,737.10	0.01
54	001399	惠科股份	986	27,341.78	0.01
55	688811	有研新材	665	16,046.45	0.01
56	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
57	301531	春光集团	244	12,580.64	0.01
58	603459	红板科技	138	11,636.16	0.01
59	301696	三瑞智能	133	11,544.40	0.01
60	301669	高特电子	404	11,473.60	0.01
61	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
62	301599	理奇智能	260	8,442.20	0.00
63	301513	尚水智能	136	6,930.56	0.00
64	001365	天海电子	219	6,856.89	0.00
65	001393	维通利	155	6,043.45	0.00
66	301683	慧谷新材	46	5,601.42	0.00
67	688712	北芯生命	149	5,352.08	0.00
68	001237	惠康科技	88	5,169.12	0.00
69	603435	嘉德利	97	4,530.87	0.00
70	688781	视涯科技	71	3,380.31	0.00
71	603352	至信股份	86	2,194.72	0.00
72	603293	埃泰克	38	1,289.34	0.00

73	001312	福恩股份	75	1, 258. 50	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	300073	当升科技	4, 026, 066. 00	1. 74
2	000933	神火股份	3, 980, 623. 00	1. 72
3	688235	百济神州	3, 910, 064. 73	1. 69
4	688498	源杰科技	3, 751, 978. 22	1. 62
5	688347	华虹宏力	3, 663, 576. 91	1. 58
6	600927	永安期货	3, 607, 958. 00	1. 56
7	300757	罗博特科	3, 507, 239. 00	1. 51
8	688266	泽璟制药	3, 472, 745. 18	1. 50
9	601168	西部矿业	3, 423, 364. 00	1. 48
10	601108	财通证券	3, 404, 492. 00	1. 47
11	601233	桐昆股份	3, 222, 246. 00	1. 39
12	600801	华新建材	3, 184, 551. 00	1. 38
13	600885	宏发股份	3, 082, 279. 00	1. 33
14	600487	亨通光电	3, 075, 491. 00	1. 33
15	688220	翱捷科技	3, 003, 981. 55	1. 30
16	002185	华天科技	2, 990, 066. 00	1. 29
17	603077	和邦生物	2, 898, 598. 00	1. 25
18	600816	建元信托	2, 896, 598. 00	1. 25
19	001309	德明利	2, 846, 794. 00	1. 23
20	002126	银轮股份	2, 708, 017. 00	1. 17

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	688525	佰维存储	6, 559, 597. 58	2. 83
2	000933	神火股份	6, 026, 395. 00	2. 60
3	601233	桐昆股份	5, 843, 276. 11	2. 52
4	688322	奥比中光	5, 842, 898. 90	2. 52
5	600549	厦门钨业	5, 691, 077. 00	2. 46
6	600487	亨通光电	5, 450, 113. 00	2. 35
7	301308	江波龙	5, 374, 015. 05	2. 32
8	600096	云天化	5, 260, 051. 00	2. 27
9	600378	昊华科技	5, 205, 834. 00	2. 25
10	600166	福田汽车	5, 185, 226. 00	2. 24
11	601991	大唐发电	4, 943, 833. 00	2. 13
12	600873	梅花生物	4, 799, 849. 00	2. 07
13	601997	贵阳银行	4, 755, 397. 00	2. 05

14	601717	中创智领	4,454,663.00	1.92
15	600909	华安证券	4,370,574.00	1.89
16	601019	山东出版	4,346,095.72	1.88
17	688235	百济神州	4,303,877.78	1.86
18	300073	当升科技	4,240,090.00	1.83
19	601865	福莱特	4,150,909.00	1.79
20	600801	华新建材	4,098,890.00	1.77

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	554,397,796.98
卖出股票收入（成交）总额	592,652,642.55

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	8,000.14	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,000.14	0.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118071	华峰转债	80	8,000.14	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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约定的备选股票库

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	69,043.14
2	应收清算款	93,369.56
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	162,412.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
3,590	40,548.25	20,299,511.00	13.95	125,268,696.00	86.05

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	266,700.00	0.183213

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

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	—
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 12 月 13 日) 基金份额总额	1,499,568,207.00
本报告期期初基金份额总额	208,568,207.00
本报告期基金总申购份额	76,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	139,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	145,568,207.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

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，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，不存在基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

			(%)		(%)	
招商证券股份有限公司	4	678,005,017.24	59.15	132,209.79	59.19	未变更
长江证券股份有限公司	2	175,950,409.53	15.35	34,316.89	15.36	未变更
华泰证券股份有限公司	2	154,388,698.18	13.47	30,106.73	13.48	未变更
国投证券股份有限公司	1	135,181,434.34	11.79	26,359.11	11.80	未变更
中信证券股份有限公司	5	2,301,381.38	0.20	287.41	0.13	未变更
申万宏源证券有限公司	1	507,578.27	0.04	98.98	0.04	未变更
北京证券有限责任公司	2	-	-	-	-	未变更
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
东方证券股份有限公司	3	-	-	-	-	未变更
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
高盛（中国）证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更

广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国联民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国盛证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	本期报告退租 1 个
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
太平洋证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
天风证券	1	-	-	-	-	未变

股份有限公司						更
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中航证券有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中邮证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
华泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国投证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
北京证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
第一创业 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
高盛（中 国）证券有 限责任公 司	-	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国都证券 股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际	-	-	-	-	-	-

金融股份有限公司						
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 20 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
3	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
4	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 1 月 27 日
5	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国联民生证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 11 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 25 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 2 月 26 日
8	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华鑫证券为一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 4 日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 25 日
10	关于景顺长城中证 500 增强策略交易	中国证监会指定报刊及	2026 年 3 月 26 日

	型开放式指数证券投资基金变更场内简称的公告	网站	
11	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
12	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
13	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
14	景顺长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2025 年度)	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
15	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 7 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 21 日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
18	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
20	2025 年度景顺长城基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 4 月 29 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 12 日
22	景顺长城基金管理有限公司关于部分基金投顾组合终止的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 13 日
23	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 21 日
24	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 22 日
25	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 23 日
26	景顺长城中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 5 月 23 日
27	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2026 年 5 月 27 日

	停机维护的通知	网站	
28	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 2 日
29	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 9 日
30	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 23 日
31	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026 年 6 月 26 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日